

交银施罗德环球精选价值证券投资基金
2010 年年度报告
2010 年 12 月 31 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：二〇一一年三月二十八日

§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 2011 年 3 月 25 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。

本报告期自 2010 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 境外投资顾问和境外资产托管人	6
2.5 信息披露方式	6
2.6 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
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	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§6 审计报告	14
§7 年度财务报表	15
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	16
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
7.4 报表附注	18
§8 投资组合报告	37
8.1 期末基金资产组合情况	37
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	37
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	38
8.4 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	38
8.5 报告期内股票投资组合的重大变动	48
8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细	50
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	50

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细	50
8.10 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	50
8.11 投资组合报告附注	51
§9 基金份额持有人信息	51
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	51
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	52
§10 开放式基金份额变动	52
§11 重大事件揭示	52
11.1 基金份额持有人大会决议	52
11.2 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	52
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	52
11.4 基金投资策略的改变	52
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	53
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	53
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	53
11.8 其他重大事件	56
§12 影响投资者决策的其他重要信息	58
§13 备查文件目录	58
13.1 备查文件目录	58
13.2 存放地点	59
13.3 查阅方式	59

§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	交银环球精选股票(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	177,515,776.99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	本基金以股票及股票基金为主要投资对象，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。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	陈超	尹东
	联系电话	021-61055050	010-67595003
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	yindong.zh@ccb.cn
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	010-67595096
传真		021-61055034	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 201 号渣打银行大厦 10 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		钱文挥	郭树清

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.jyfund.com, www.jysld.com, www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2010 年	2009 年	2008 年 8 月 22 日 (基金合同生效日) 至 2008 年 12 月 31 日
本期已实现收益	18,871,347.06	127,586,319.39	-2,670,933.93
本期利润	2,446,246.55	188,340,131.86	-15,603,179.12
加权平均基金份额本期利润	0.0105	0.6444	-0.0356
本期加权平均净值利润率	0.71%	50.49%	-3.65%
本期基金份额净值增长率	1.46%	72.31%	-2.70%
3.1.2 期末数据和指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
期末可供分配利润	78,892,161.16	87,985,105.74	-8,318,231.25
期末可供分配基金份额利润	0.444	0.345	-0.027
期末基金资产净值	282,962,640.04	400,363,770.72	297,326,188.57
期末基金份额净值	1.594	1.571	0.973
3.1.3 累计期末指标	2010 年末	2009 年末	2008 年末
基金份额累计净值增长率	70.11%	67.65%	-2.70%

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。

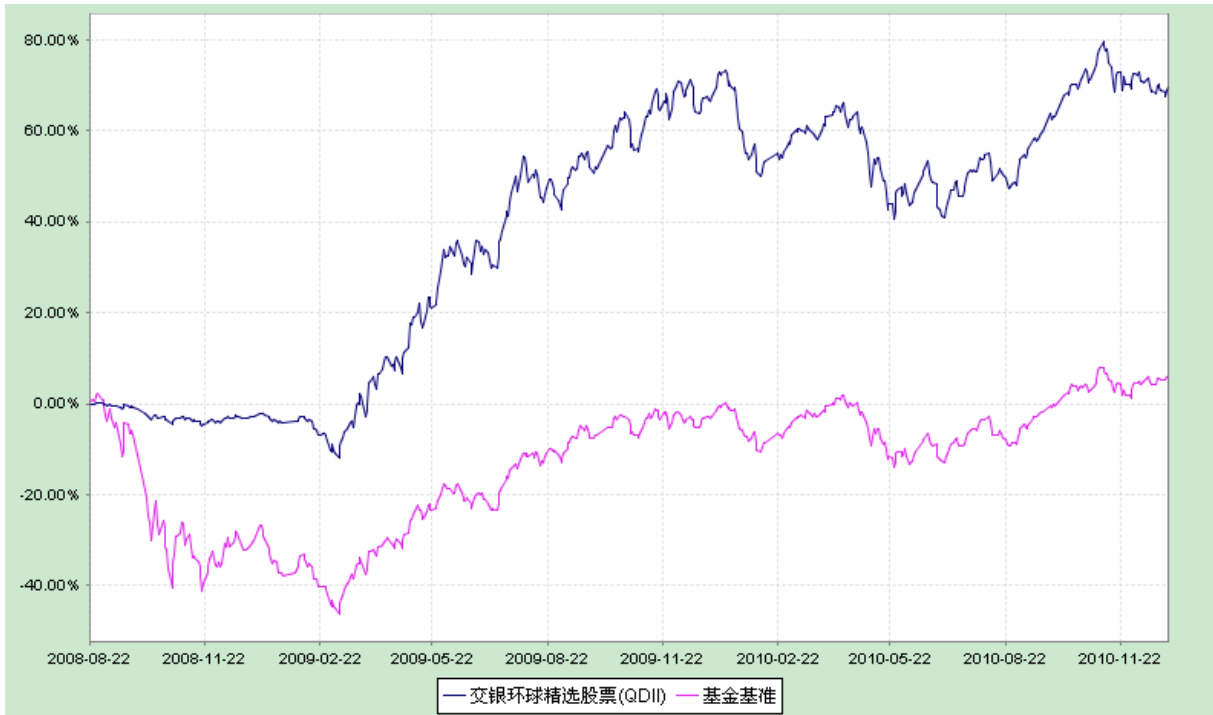
3.2 基金净值表现

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

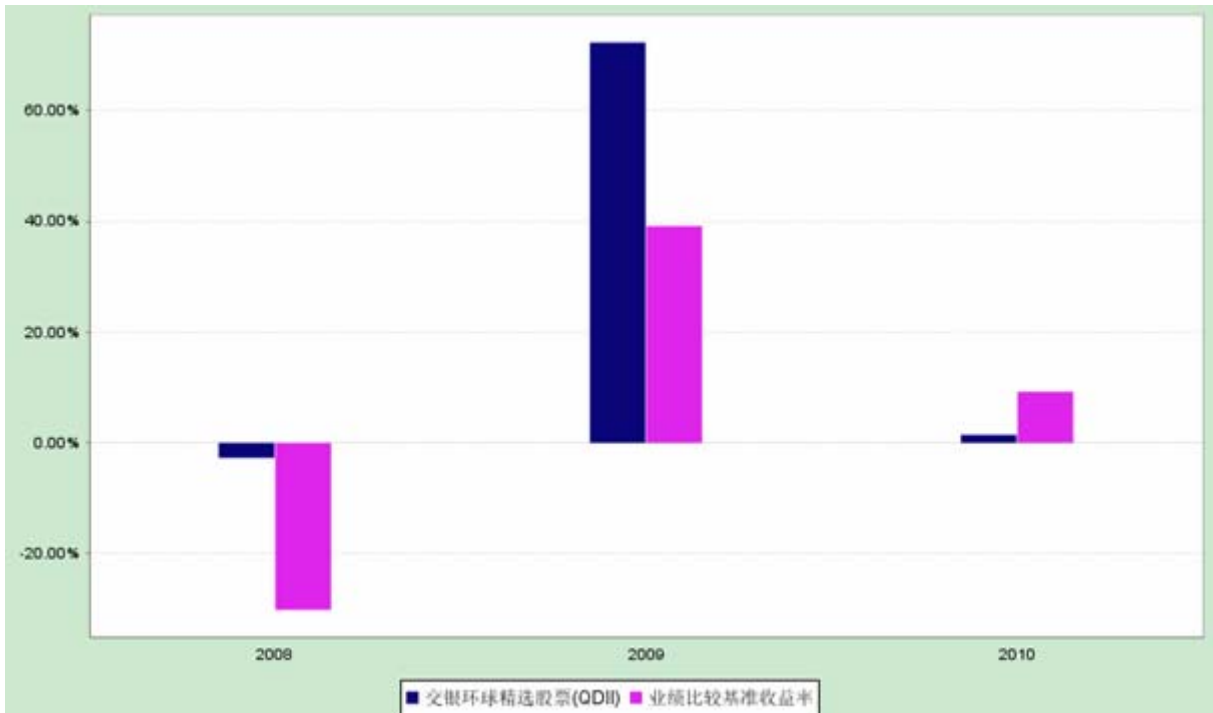
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	4.18%	0.91%	6.80%	0.84%	-2.62%	0.07%
过去六个月	18.96%	0.87%	20.82%	0.82%	-1.86%	0.05%
过去一年	1.46%	1.04%	9.25%	0.99%	-7.79%	0.05%
自基金合同生效起至今	70.11%	1.14%	6.22%	1.74%	63.89%	-0.60%

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



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：图示日期为 2008 年 8 月 22 日至 2010 年 12 月 31 日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	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	年度利润分配合计	备注
2010年	-	-	-	-	-
2009年	0.800	14,870,788.10	9,864,887.42	24,735,675.52	-
2008年	-	-	-	-	-
合计	0.800	14,870,788.10	9,864,887.42	24,735,675.52	-

§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

本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司。交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]128号文批准，于2005年8月4日成立的合资基金管理公司。公司总部设于上海，注册资本为2亿元人民币。截止到2010年12月31日，公司已经发行并管理的基金共有十三只，均为开放式基金：交银施罗德精选股票证券投资基金（基金合同生效日：2005年9月29日）、交银施罗德货币市场证券投资基金（基金合同生效日：2006年1月20日）、交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金（基金合同生效日：2006年6月14日）、交银施罗德成长股票证券投资基金（基金合同生效日：2006年10月23日）、交银施罗德蓝筹股票证券投资基金（基金合同生效日：2007年8月8日）、交银施罗德增利债券证券投资基金（基金合同生效日：2008年3月31日）、交银施罗德环球精选价值证券投资基金（基金合同生效日：2008年8月22日）、交银施罗德保本混合型证券投资基金（基金合同生效日：2009年1月21日）、交银施罗德先锋股票证券投资基金（基金合同生效日：2009年4月10日）、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金（基金合同生效日：2009年9月25日）、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金（基金合同生效日：2009年9月29日）、交银施罗德主题优选灵活配置混合型证券投资基金（基金合同生效日：2010年6月30日）和交银施罗德趋势优先股票证券投资基金（基金合同生效日：2010年12月22日）。

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		
郑伟辉	本基金的基金经理	2008-08-22	-	33年	郑伟辉先生，中国国籍。大专学历。曾任施罗德投资管理（香港）有限公司独立投资基金主管，负责管理香港机构客户、大型退休基金、

					慈善基金及私人客户基金。 2007 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。

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
Virginie Maisonneuve	施罗德集团资产配置委员会成员、多区域（全球及国际）股票投资主管	23 年	Virginie Maisonneuve 女士，法国高等商业管理学院工商管理硕士，CFA。历任苏格兰 Martin Currie 资产管理公司欧洲大陆股票基金基金经理，波士顿 Batterymarch 财务管理公司基金经理，纽约 Clay Finlay 公司投资总监、董事、管理委员会及投资策略委员会委员。2004 年加入施罗德投资管理有限公司。

4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、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、安全高效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

本公司有严格的投资控制制度和风险监控制度来保证旗下基金运作的公平，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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率以及不同时间窗内（同日内、5 日内、10 日内）同向交易的交易价格并未发现异常差异。

4.4.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本公司旗下无与本基金投资风格相似的其他投资组合。

4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。

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

2010 年第一季全球股票市场波动加大,但受到不断改善的经济数据和良好企业盈利的驱动,主要成熟股票市场最终整个季度录得正收益。让人鼓舞的是,很多公司收入开始增长,更多的国家公布积极的增长数据显示他们正从 2009 年的衰退中复苏。第二季度风险资产表现较差,而 5 月则是雷曼破产之后表现最差的月份,究其原因希腊债务危机开始扩散到其周边的欧洲国家,而随后的欧洲几个经济体财政瘦身计划也加剧了这种担忧。第三季度全球股票市场继续波动,虽然 7 月和 8 月开局不利,但在 9 月强劲反弹,投资者对经济放缓以及经济二次探底的担忧也得到缓解。全球股票市场 2010 年四季度受到了正面和负面双重情绪的影响,虽然 11 月金融市场再次受到欧债危机的影响出现调整,然而美国 QE2 以及好于预期的经济数据提升了美国经济前景,让投资者对股票市场重新恢复乐观情绪。美国方面,因公布令人鼓舞的经济数据,经济增长上调以及消费者信心提升,股票市场四季度表现良好。令人鼓舞的是,在 2010 年末奥巴马同意对布什政府的减税计划进行延期,这提振了 2011 年美国经济增长前景,同时也提升了投资者对美国企业盈利的预期。欧洲方面,德国的出口良好,继续支持制造业的强劲复苏,消费者信心指数进一步提升,而零售商将受益于这一趋势。欧央行保持利率在 1% 不变,这提升了进一步的借贷需求。在英国,《政府全面支出复审》(CSR)在缩减支出和公共部门裁员方面低于投资者预期,虽然其也受到欧债危机的影响,但是企业盈利状况依然良好。在日本,受到不期而遇的日本央行货币放松政策的推动,另外为了提升日本国际竞争力和成长性,12 月政府对企业税收减掉了 5% 的税率,这些都鼓舞了市场情绪。亚洲股票市场四季度录得正收益,特别是台湾和韩国两个出口型经济体,预期其将受益于 2011 年亚洲强劲出口的拉动。相对而言,中国市场表现较差,原因在于央行加息以试图应对通胀压力。新兴市场秘鲁和墨西哥表现非常出色,前者主要受益于银价和铜价上涨,而后者则受益于美国 QE2 举措利于美国和墨西哥的贸易往来。俄罗斯表现最为抢眼,受益于当前油价上涨以及预期 2011 年油价的进一步上升。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2010 年 12 月 31 日,本基金份额净值为 1.594 元,本报告期份额净值增长率为 1.46%,同期业绩比较基准增长率为 9.25%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在未来 6 个月,我们预期发达国家货币政策继续保持宽松以应对财政政策方面的继

续巩固和较低的通胀率，这可能让美国和欧元区央行延迟到 2012 年 3 月才开始升息。环大西洋地区，我们预期英国可能也要到 2011 年 11 月才会进一步升息。新兴市场方面，我们相信会进一步紧缩政策以应对通胀压力和资产泡沫，而中国在 2011 年可能将继续升息并允许人民币温和升值。基于宏观背景和估值方面的判断，我们处在一个股票市场继续有超额收益并可能有更好前景的经济阶段，股票看上去依然很有吸引力，因此我们原则上会继续维持我们在股票方面的高仓位。对于不同地区的市场，我们预期如下：美国企业利润强劲复苏，公司间的收购兼并活动继续支持股票市场；新兴市场虽然基本面更强，比如外贸顺差等保持了最好的增长前景，然而增长的溢价已经反映在股票的估值上，而投资者的情绪对这一地区的情绪也有所降温。因为目前全球投资者风险偏好在上升，我们更偏好周期股，受益于大宗商品价格上涨，我们期望基础材料和能源股可能获得超额收益。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2010 年度，本基金管理人根据《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》等有关法规诚实守信、勤勉尽责，依法履行基金管理人职责，落实风险控制，强化监察稽核职能，确保基金管理业务运作的安全、规范，保护基金投资人的合法权益。

本报告期内，本基金管理人为了确保公司业务的规范运作，主要做了以下工作：

（一）开展全面风险评估和内部控制持续提升

公司将 2010 年定位为风险防范和内控年，全年公司以全面健全内控为目标，通过风险识别、风险定位、内控整改、全面贯彻等四阶段的工作，推进公司内部控制体系的健全。在风险识别阶段，公司动员全体员工力量，全面识别和评估公司风险点和相应内部控制情况。在风险定位阶段，公司深化分析风险点，形成了公司风险指引和风险报告，就重大风险点制定了整改工作计划，并在内控整改阶段进行了集中内部控制整改。通过内控项目的实施，公司形成了风险评估和内部控制完善的长效机制，在公司内部贯彻统一、强健的内控文化并持续提升。

同时，公司启动持续风险评估，针对实际情况组织跨部门流程梳理，细化风险点控制，通过系统升级、强化操作流程、对制度和运作流程进行完善，公司关键业务流程和内部控制环境得以持续提升。

（二）加强监督检查力度

2010 年，公司督察长和监察稽核部加强了内部控制检查的力度，开展了一系列内部审计，检查公司从投资、销售到后台业务各方面运作的合规性和内部控制的有效性。本年度监察稽核部还完善了定期内控核查程序，主要目的是通过对基金投资、销售、运营等部门的内部控制关键点进行定期抽查，确认业务部门在相关业务执行过程中是否按公司制度落实内部控制要求，有关风险是否得到有效控制，并对发现的异常情况进行调查和处理，确保监察稽核部门对公司内部控制的有效监督。

（三）固化独立风险和绩效评估

2010 年，公司进一步固化投资组合风险与业绩评估工作，加强了投资组合风险与业

绩评估的独立性，风险管理部结合风险与业绩对投资组合进行分析，对各投资类别、不同市场投资组合开展独立风险与业绩评估工作，更及时地揭示组合合规、运作及风险状况，增强投资组合风险与绩效报告对基金经理的提示和约束作用，体现投资部主动管理及风险管理部独立监控的投资风险管理体系，维护基金持有人利益。

4.8 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，由金融工程部进行测算和认证，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其适用性的情况后，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。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

遵照法律法规及基金合同的约定，本报告期内本基金利润分配信息列示如下：

金额单位：人民币元

本报告期内应分配金额	本报告期内已分配金额	尚未分配利润金额	本报告期内分红次数
7,889,216.12	-	7,889,216.12	-

本基金于 2011 年 1 月 12 日进行本报告期利润的第一次分红，向基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。本次分红的权益登记日为 2011 年 1 月 12 日，除息日为 2011 年 1 月 11 日，红利再投确认日为 2011 年 1 月 13 日，现金红利划出日为 2011 年 1 月 20 日。本基金此次分配金额为 7,920,918.51 元。此次分红之后，2010 年度本基金分红次数和分配比例达到了法律法规及基金合同的要求。

§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、利润分配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 审计报告

普华永道中天审字(2011)第 20365 号

交银施罗德环球精选价值证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的交银施罗德环球精选价值证券投资基金(以下简称“交银施罗德环球精选基金”)的财务报表，包括 2010 年 12 月 31 日的资产负债表、2010 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表是交银施罗德环球精选基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 设计、实施和维护与财务报表编制相关的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误而导致的重大错报；

(2) 选择和运用恰当的会计政策；

(3) 作出合理的会计估计。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守职业道德规范，计划和实施审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，我们考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

三、审计意见

我们认为，上述财务报表已经按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，在所有重大方面公允反映了交银施罗德环球精选基金 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
 会计师事务所有限公司

注册会计师 薛 竞

中国·上海市

注册会计师 金 毅

2011 年 3 月 24 日

§7 年度财务报表

7.1 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：2010 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2010 年 12 月 31 日	上年度末 2009 年 12 月 31 日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	20,309,366.56	30,006,617.09
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	260,975,180.56	374,106,568.79
其中：股票投资		260,975,180.56	374,106,568.79
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收证券清算款		4,265,105.87	-
应收利息	7.4.7.5	2,124.90	1,399.22
应收股利		130,419.97	135,262.31
应收申购款		62,886.37	802,130.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	32,316.42	-
资产总计		285,777,400.65	405,051,977.53
负债和所有者权益	附注号	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		32,316.42	189,220.98
应付赎回款		1,814,257.06	3,197,860.50
应付管理人报酬		442,356.97	614,165.53
应付托管费		86,013.82	119,421.07
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	439,816.34	567,538.73
负债合计		2,814,760.61	4,688,206.81
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	177,515,776.99	254,877,988.54
未分配利润	7.4.7.10	105,446,863.05	145,485,782.18
所有者权益合计		282,962,640.04	400,363,770.72
负债和所有者权益总计		285,777,400.65	405,051,977.53

注: 报告截止日 2010 年 12 月 31 日, 基金份额净值 1.594 元, 基金份额总额 177,515,776.99 份。

7.2 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: 2010 年 1 月 1 日至 2010 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

项 目	附注号	本期 2010年1月1日至 2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至 2009年12月31日
一、收入		14,618,247.02	203,652,681.63

1.利息收入		52,447.89	931,335.65
其中：存款利息收入	7.4.7.11	52,447.89	162,181.45
债券利息收入		-	752,854.20
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	16,300.00
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,655,668.02	141,808,868.34
其中：股票投资收益	7.4.7.12	27,154,542.29	134,718,609.52
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	485,770.70
资产支持证券投资		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	424,093.74	1,788,051.19
股利收益	7.4.7.15	4,077,031.99	4,816,436.93
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-16,425,100.51	60,753,812.47
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-856,044.48	-726,290.68
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	191,276.10	884,955.85
减：二、费用		12,172,000.47	15,312,549.77
1. 管理人报酬		6,250,367.73	6,673,925.74
2. 托管费		1,215,349.23	1,297,707.79
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.18	4,119,102.36	6,744,263.63
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.19	587,181.15	596,652.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,446,246.55	188,340,131.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,446,246.55	188,340,131.86

7.3 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：2010年1月1日至2010年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31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）	254,877,988.54	145,485,782.18	400,363,770.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,446,246.55	2,446,246.55

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)	-77,362,211.55	-42,485,165.68	-119,847,377.23
其中：1.基金申购款	65,512,910.67	33,091,989.99	98,604,900.66
2.基金赎回款	-142,875,122.22	-75,577,155.67	-218,452,277.89
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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	177,515,776.99	105,446,863.05	282,962,640.04
项目	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31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)	305,644,419.82	-8,318,231.25	297,326,188.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	188,340,131.86	188,340,131.86
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)	-50,766,431.28	-9,800,442.91	-60,566,874.19
其中：1.基金申购款	511,875,571.05	160,463,949.19	672,339,520.24
2.基金赎回款	-562,642,002.33	-170,264,392.10	-732,906,394.43
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)	-	-24,735,675.52	-24,735,675.52
五、期末所有者权益(基金净值)	254,877,988.54	145,485,782.18	400,363,770.72

报告附注为财务报表的组成部分

本报告页码(序号)从7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理公司负责人: 战龙, 主管会计工作负责人: 许珊燕, 会计机构负责人: 张丽

7.4 报表附注

7.4.1 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 (JP Morgan & Chase Bank)，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。

本财务报表由本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司于 2011 年 3 月 24 日批准报出。

7.4.2 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”)、中国证监会公告[2010]5 号《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>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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》和中国证监会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2010 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 2010 年 12 月 31 日的财务状况以及 2010 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资(包括股票存托凭证)、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资(包括股票存托凭证)、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值; 估值日无交易, 但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的, 按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具, 如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化, 参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素, 调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场, 采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时, 尽可能最大程度使用市场参数, 减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时, 金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时, 申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列, 并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除适用的境外代扣代缴所得税后, 确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益; 处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益, 其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

无。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、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) 基金取得源自境内的债券差价收入暂免征收营业税和企业所得税。

(3) 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，在境内暂免征收营业税和企业所得税。

(4) 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，在境内暂未征收个人所得税和企业所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
活期存款	20,309,366.56	30,006,617.09
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	20,309,366.56	30,006,617.09

注：于2010年12月31日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款632,486.93元(折合人民币4,188,771.18元)和港币活期存款5,474,749.66元(折合人民币4,664,180.83元)。于2009年12月31日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款687,656.98元(折合人民币4,695,459.39元)和港币活期存款24,016,298.79元(折合人民币21,147,904.27元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2010年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票(包括股票存托凭证)		229,578,713.79	260,975,180.56	31,396,466.77
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	债券合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		229,578,713.79	260,975,180.56	31,396,466.77
项目		上年度末 2009年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票(包括股票存托凭证)		326,285,001.51	374,106,568.79	47,821,567.28
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	债券合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		326,285,001.51	374,106,568.79	47,821,567.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2010年12月31日	2009年12月31日
应收活期存款利息	2,121.72	1,371.43
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	3.18	27.79
其他	-	-

合计	2,124.90	1,399.22
----	----------	----------

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应收在途资金	32,316.42	-
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	32,316.42	-

注：本基金于本期末应收在途资金为换汇交易过程中产生的应收外汇金额。

7.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末及上年度末无应付交易费用。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,360.02	9,946.94
预提费用	404,403.51	557,591.79
应付在途资金	32,052.81	-
合计	439,816.34	567,538.73

注：本基金于本期末持有的应付在途资金为换汇交易过程中产生的应支付换汇金额。

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	254,877,988.54	254,877,988.54
本期申购	65,512,910.67	65,512,910.67
本期赎回（以“-”号填列）	-142,875,122.22	-142,875,122.22
本期末	177,515,776.99	177,515,776.99

7.4.7.10 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	87,985,105.74	57,500,676.44	145,485,782.18
本期利润	18,871,347.06	-16,425,100.51	2,446,246.55
本期基金份额交易产生的变动数	-27,964,291.64	-14,520,874.04	-42,485,165.68
其中：基金申购款	23,515,030.29	9,576,959.70	33,091,989.99
基金赎回款	-51,479,321.93	-24,097,833.74	-75,577,155.67
本期已分配利润	-	-	-
本期末	78,892,161.16	26,554,701.89	105,446,863.05

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
活期存款利息收入	52,007.86	155,190.82
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	-	1,301.16
其他	440.03	5,689.47
合计	52,447.89	162,181.45

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出股票成交总额	882,196,565.27	1,343,196,223.07
减：卖出股票成本总额	855,042,022.98	1,208,477,613.55
买卖股票差价收入	27,154,542.29	134,718,609.52

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-	216,047,661.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-	211,887,331.40

减：应收利息总额	-	3,674,558.98
债券投资收益	-	485,770.70

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
卖出权证成交总额	424,093.74	1,788,051.19
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	424,093.74	1,788,051.19

注：买卖权证差价收入包含权证行权差价收入。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,077,031.99	4,816,436.93
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,077,031.99	4,816,436.93

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
1.交易性金融资产	-16,425,100.51	60,839,227.20
——股票投资	-16,425,100.51	62,084,790.50
——债券投资	-	-1,245,563.30
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
2.衍生工具	-	-85,414.73
——权证投资	-	-85,414.73
3.其他	-	-
合计	-16,425,100.51	60,753,812.47

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
----	-----------------------------	----------------------------------

基金赎回费收入	191,276.10	884,955.85
合计	191,276.10	884,955.85

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的 25% 归入基金资产。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
交易所市场交易费用	4,119,102.36	6,744,263.63
银行间市场交易费用	-	-
合计	4,119,102.36	6,744,263.63

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	352,515.72
税务顾问费	105,759.09	152,036.79
银行汇划费用	3,226.84	3,361.19
其他	118,195.22	28,738.91
合计	587,181.15	596,652.61

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2011 年 1 月 7 日宣告分红，向截至 2011 年 1 月 12 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.45 元。

7.4.9 关联方关系

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、基金代销机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金管理人的股东、基金代销机构

摩根大通银行	境外资产托管人
施罗德投资管理有限公司	基金管理人的股东、境外投资顾问
中国国际海运集装箱 (集团)股份有限公司	基金管理人的股东

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本报告期内及上年度可比期间本基金无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,250,367.73	6,673,925.74
其中：支付销售机构的客户维护费	807,722.27	750,212.19

注：支付基金管理人交银施罗德基金公司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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2010年1月1日至2010年12月 31日	上年度可比期间 2009年1月1日至2009年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,215,349.23	1,297,707.79

注：支付基金托管人中国建设银行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。

7.4.10.2.3 销售服务费

无。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日
期初持有的基金份额	21,334,716.22	20,006,200.00
期间申购/买入总份额	-	1,328,516.22
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	21,334,716.22	21,334,716.22
期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.02%	8.37%

7.4.10.4.2 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无投资本基金的情况。

7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2010年1月1日至2010年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31日	2009年1月1日至2009年12月31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	11,457,284.96	50,802.65	4,163,742.17	154,800.06
摩根大通银行	8,852,081.60	1,205.21	25,842,874.92	390.76
合计	20,309,366.56	52,007.86	30,006,617.09	155,190.82

注：本基金的银行存款分别由基金托管人中国建设银行和境外资产托管人摩根大通银行保管，按适用利率或约定利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内及上年度可比期间本基金未在承销期内参与关联方承销证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期内及上年度可比期间本基金无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本报告期内本基金无利润分配。

7.4.12 期末（2010年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
3905664Z LN	ROLLS-ROYCE GROUP-C SHARES	2010-10-27	-	C SHARES	-	0.0104	2,127,808	-	22,063.61	-

注：1. 上述期末估值单价原币 0.001 英镑，期末估值总额原币 2,127.81 英镑，已按 2010 年 12 月 31 日汇率折算为人民币；

2. 本公司已于 2010 年 11 月 26 日下达了将 ROLLS-ROYCE GROUP-C SHARES 转换成普通股的指令，于 2011 年 1 月 18 日，上述股票按每股 6.61 英镑价格转换成普通股。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

于本报告期末，本基金无从事市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金以股票为主要投资对象，属于较高预期风险和预期收益的证券投资基金品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金。本基金在日常经营活动中涉及的财务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有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。

7.4.13.2 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。

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了充分的评估。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，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，违约风险发生的可能性很小。

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 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2009 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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的证券不得超过该证券的 10%。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。

本基金所持有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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2010年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,309,366.56	-	-	-	20,309,366.56
交易性金融资产	-	-	-	260,975,180.56	260,975,180.56
应收证券清算款	-	-	-	4,265,105.87	4,265,105.87
应收利息	-	-	-	2,124.90	2,124.90
应收股利	-	-	-	130,419.97	130,419.97
应收申购款	-	-	-	62,886.37	62,886.37
其他资产	-	-	-	32,316.42	32,316.42
资产总计	20,309,366.56	-	-	265,468,034.09	285,777,400.65
负债					
应付证券清算款	-	-	-	32,316.42	32,316.42
应付赎回款	-	-	-	1,814,257.06	1,814,257.06
应付管理人报酬	-	-	-	442,356.97	442,356.97
应付托管费	-	-	-	86,013.82	86,013.82
其他负债	-	-	-	439,816.34	439,816.34
负债总计	-	-	-	2,814,760.61	2,814,760.61
利率敏感度缺口	20,309,366.56	-	-	262,653,273.48	282,962,640.04

上年末 2009年12月31日	1年以内	1至5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	30,006,617.09	-	-	-	30,006,617.09

交易性金融资产	-	-	-	374,106,568.79	374,106,568.79
应收利息	-	-	-	1,399.22	1,399.22
应收股利	-	-	-	135,262.31	135,262.31
应收申购款	62,622.87	-	-	739,507.25	802,130.12
资产总计	30,069,239.96	-	-	374,982,737.57	405,051,977.53
负债					
应付证券清算款	-	-	-	189,220.98	189,220.98
应付赎回款	-	-	-	3,197,860.50	3,197,860.50
应付管理人报酬	-	-	-	614,165.53	614,165.53
应付托管费	-	-	-	119,421.07	119,421.07
其他负债	-	-	-	567,538.73	567,538.73
负债总计	-	-	-	4,688,206.81	4,688,206.81
利率敏感度缺口	30,069,239.96	-	-	370,294,530.76	400,363,770.72

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2010 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资(2009 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2010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
银行存款	4,188,771.18	4,664,180.83	-	8,852,952.01
交易性金融资产	85,434,548.58	113,630,186.44	61,910,445.54	260,975,180.56
应收证券清算款	-	4,265,105.87	-	4,265,105.87
应收利息	14.70	2.33	-	17.03
应收股利	47,602.97	12,268.00	70,549.00	130,419.97
其他资产	-	-	32,316.42	32,316.42
资产合计	89,670,937.43	122,571,743.47	62,013,310.96	274,255,991.86
应付证券清算款	-	-	32,316.42	32,316.42

其他负债	32,052.81	-	-	32,052.81
负债合计	32,052.81	-	32,316.42	64,369.23
资产负债表外汇 风险敞口净额	89,638,884.62	122,571,743.47	61,980,994.54	274,191,622.63
项目	上年度末 2009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
银行存款	4,695,459.39	21,147,904.27	-	25,843,363.66
交易性金融资产	126,967,989.48	180,120,102.44	67,018,476.87	374,106,568.79
应收利息	-	78.97	-	78.97
应收股利	60,185.46	-	75,076.85	135,262.31
资产合计	131,723,634.33	201,268,085.68	67,093,553.72	400,085,273.73
应付证券清算款	-	189,220.98	-	189,220.98
负债合计	-	189,220.98	-	189,220.98
资产负债表外汇 风险敞口净额	131,723,634.33	201,078,864.70	67,093,553.72	399,896,052.75

7.4.13.4.2.2 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 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	所有外币相对人民币升值5%	增加约1,371	增加约2,000
	所有外币相对人民币贬值5%	减少约1,371	减少约2,000

7.4.13.4.3 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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2010年12月31日		上年度末 2009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	260,975,180.56	92.23	374,106,568.79	93.44
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
合计	260,975,180.56	92.23	374,106,568.79	93.44

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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 2010年12月31日	上年度末 2009年12月31日
	业绩比较基准上升5%	增加约1,408	增加约1,648
业绩比较基准下降5%	减少约1,408	减少约1,648	

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b) 以公允价值计量的金融工具

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

于 2010 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层级的余额为 260,953,116.95 元，第二层级的余额为 22,063.61 元，无属于第三层级的余额(2009 年 12 月 31 日：第一层级的余额为 374,106,568.79 元，无属于第二层级和第三层级的余额)。本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 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	260,975,180.56	91.32
	其中：普通股	231,331,990.79	80.95
	存托凭证	29,643,189.77	10.37
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	20,309,366.56	7.11
8	其他各项资产	4,492,853.53	1.57
9	合计	285,777,400.65	100.00

8.2 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 (%)

香港	113,630,186.44	40.16
美国	82,776,461.71	29.25
伦敦	21,016,870.62	7.43
韩国	6,783,498.64	2.40
德国	5,209,841.35	1.84
日本	4,938,587.15	1.75
荷兰	4,819,654.91	1.70
澳大利亚	4,022,328.55	1.42
挪威	3,691,884.41	1.30
瑞士	3,189,840.22	1.13
新加坡	2,658,086.87	0.94
比利时	2,334,736.64	0.83
芬兰	2,055,510.34	0.73
加拿大	2,000,007.84	0.71
巴西	1,847,684.87	0.65
合计	260,975,180.56	92.23

8.3 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	56,466,695.92	19.96
非必需消费品	48,377,495.74	17.10
能源	40,726,128.36	14.39
信息技术	36,412,037.35	12.87
必需消费品	23,869,553.29	8.44
材料	20,436,168.59	7.22
工业	19,012,644.77	6.72
保健	8,411,980.95	2.97
电信服务	7,262,475.59	2.57
合计	260,975,180.56	92.23

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

8.4 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	MING FUNG JEWELLERY GROUP LIMITED	明丰珠宝集团有限	860 HK	香港证券	香港	15,500,000	10,564,107.19	3.73

		公司		交易所				
2	CNOOC LIMITED	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	香港	506,000	7,949,183.96	2.81
3	SINO PROSPER STATE GOLD RESOURCES HOLDINGS LIMITED	中盈国金资源控股有限公司	766 HK	香港证券交易所	香港	18,000,000	7,284,122.29	2.57
4	PETROCHINA COMPANY LIMITED	中国石油天然气有限公司	857 HK	香港证券交易所	香港	800,000	6,924,601.87	2.45
5	CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	中国人寿保险股份有限公司	2628 HK	香港证券交易所	香港	238,000	6,437,715.80	2.28
6	PING AN INSURANCE(GROUP) COMPANY OF CHINA LIMITED	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	86,000	6,366,919.25	2.25
7	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LIMITED	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港证券交易所	香港	1,290,000	6,363,255.89	2.25
8	Baidu INC	百度集团	BIDU US	纳斯达克证券交易所	美国	9,000	5,753,603.08	2.03
9	BANK OF CHINA LIMITED	中国银行股份有限公司	3988 HK	香港证券交易所	香港	1,540,000	5,379,175.22	1.90
10	NATURAL BEAUTY BIO-TECHNOLOGY LIMITED	自然美生物科技有限公司	157 HK	香港证券交易所	香港	2,600,000	4,651,614.94	1.64
11	CTrip.COM INTERNATIONAL-ADR	携程网集团	CTRP US	纳斯达克证券交易所	美国	15,000	4,018,323.22	1.42

12	I.T LTD	I.T LIMITED	999 HK	香港 证券 交易 所	香港	800,000	4,014,360.73	1.42
13	AIRMEDIA GROUP INC	航美传媒 集团公司	AMCN US	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	86,000	3,924,214.66	1.39
14	HL TECHNOLOGY GROUP LTD	泓淋科技 集团有限 公司	1087 HK	香港 证券 交易 所	香港	2,000,000	3,680,398.63	1.30
15	MICROSOFT CORPORATION	-	MSFT US	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	18,277	3,378,312.58	1.19
16	TENCENT HOLDINGS LIMITED	腾讯控 股有限 公司	700 HK	香港 证券 交易 所	香港	23,000	3,309,547.35	1.17
17	ITAU UNIBANCO HOLDING SA-ADR	-	ITUB US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	20,134	3,201,528.02	1.13
18	RIO TINTO PLC	-	RIO LN	伦 敦 证 券 交 易 所	英国	6,880	3,200,661.49	1.13
19	NOVARTIS AG	-	NOVN VX	瑞 士 证 券 交 易 所	瑞士	8,172	3,189,840.22	1.13
20	SUNCOR ENERGY INC	-	SU US	纽 约 证 券 交 易 所	美国	12,301	3,119,326.73	1.10
21	PICC PROPERTY AND CASUALTY COMPANY LIMITED	中国 人民 财 产 保 险 股 份 有 限 公 司	2328 HK	香港 证 券 交 易 所	香港	324,000	3,108,096.65	1.10
22	UNILEVER NV-CVA	-	UNA NA	阿 姆 斯 特	荷 兰	14,907	3,085,829.54	1.09

				丹证 券交 易所				
23	CHINA UNICOM (HONG KONG) LIMITED	中国联合网络通信(香港)股份有限公司	762 HK	香港 证 券 交 易 所	香 港	320,000	3,031,557.99	1.07
24	BG GROUP PLC	-	BG/ LN	伦 敦 证 券 交 易 所	英 国	22,402	3,010,477.80	1.06
25	XSTRATA PLC	-	XTA LN	伦 敦 证 券 交 易 所	英 国	19,146	2,988,838.50	1.06
26	LONGRUN TEA GROUP COMPANY LIMITED	龙润茶集团有限公司	2898 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	6,000,000	2,964,765.57	1.05
27	VODAFONE GROUP PLC	-	VOD LN	伦 敦 证 券 交 易 所	英 国	165,825	2,850,874.94	1.01
28	GEA GROUP AG	-	G1A GR	德 国 证 券 交 易 所	德 国	14,532	2,792,593.15	0.99
29	WAL-MART STORES INC	-	WMT US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	7,789	2,781,936.46	0.98
30	YASHILI INTERNATIONAL HOLDINGS LTD	雅士利国际控股有限公司	1230 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	1,100,000	2,773,930.08	0.98
31	JPMORGAN CHASE & CO	-	JPM US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	9,673	2,717,483.62	0.96
32	DNB NOR ASA	-	DNBNOR NO	奥 斯 陆 证 券 交 易 所	挪 威	29,113	2,716,028.93	0.96

33	BRIDGESTONE CORPORATION	-	5108 JP	东京证券交易所	日本	21,200	2,715,949.81	0.96
34	ZHONGPIN INC	河南众品 食品股份 有限公司	HOGS US	纳斯达克 证券交易 所	美国	20,000	2,702,061.60	0.95
35	BAKER HUGHES INCORPORATED	-	BHI US	纽约证 券交易 所	美国	7,135	2,701,451.98	0.95
36	JARDINE STRATEGIC HOLDINGS LIMITED	-	JS SP	新加坡 证券交 易所	新加坡	14,500	2,658,086.87	0.94
37	SAMSUNG ELECTRONICS CO LTD	-	005930 KS	韩国证 券交易 所	韩国	472	2,634,542.23	0.93
38	GOOGLE INC-CL A	-	GOOG US	纳斯 达克证 券交易 所	美国	669	2,631,635.34	0.93
39	FEDEX CORPORATION	-	FDX US	纽约证 券交易 所	美国	4,215	2,596,344.43	0.92
40	TYCO ELECTRONICS LTD	-	TEL US	纽约证 券交易 所	美国	11,028	2,585,443.80	0.91
41	CITIGROUP INC	-	C US	纽约证 券交易 所	美国	80,340	2,516,680.31	0.89
42	VANCEINFO TECHNOLOGIES INC	文思信息 技术有限 公司	VIT US	纽约证 券交易 所	美国	11,000	2,516,228.64	0.89
43	PETROLEO BRASILEIRO S.A.	-	PBR US	纽约证 券交易 所	美国	9,789	2,453,152.45	0.87

				交易所				
44	THYSSENKRUPP AG	-	TKA GR	法兰克福 证券交易所	德国	8,781	2,417,248.20	0.85
45	KINGFISHER PLC	-	KGF LN	伦敦 证券交易所	英国	86,486	2,362,137.69	0.83
46	ROLLS-ROYCE GROUP PLC	-	RR/ LN	伦敦 证券交易所	英国	36,394	2,351,047.87	0.83
47	Anheuser-Busch InBev NV NPV	-	ABI BB	布鲁 塞尔 证券交易所	比利时	6,140	2,334,736.64	0.83
48	GOLDMAN SACHS GROUP INC	-	GS US	纽约 证券交易所	美国	2,073	2,308,644.61	0.82
49	TURKIYE GARANTI BANKASI A.S.	-	TKGBY US	OTC	美国	67,626	2,306,513.56	0.82
50	URBAN OUTFITTERS INC	-	URBN US	纳斯 达克 证券 交易所	美国	9,693	2,298,781.09	0.81
51	GENERAL MOTORS COMPANY	-	GM US	纽约 证券交易所	美国	9,158	2,235,584.31	0.79
52	SONY CORPORATION	-	6758 JP	东京 证券 交易所	日本	9,300	2,222,637.34	0.79
53	WELLPOINT INC	-	WLP US	纽约 证券交易所	美国	5,872	2,211,199.79	0.78
54	HYUNDAI MOTOR	-	005380	韩国	韩	2,151	2,195,011.71	0.78

	COMPANY		KS	证券 交易 所	国			
55	EOG RESOURCES INC	-	EOG US	纽约 证券 交易 所	美国	3,617	2,189,663.10	0.77
56	CNINSURE,INC	泛华保险 服务集团	CISG US	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	19,000	2,175,623.18	0.77
57	WALTER ENERGY INC	-	WLT US	纽约 证券 交易 所	美国	2,561	2,168,260.32	0.77
58	NEWCREST MINING LTD	-	NCM AU	澳大 利亚 证券 交易 所	澳大 利亚	7,863	2,158,320.81	0.76
59	XINGDA INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	兴达国际 控股有限 公司	1899 HK	香港 证券 交易 所	香港	300,000	2,146,899.20	0.76
60	PRUDENTIAL PLC	-	PRU LN	伦敦 证券 交易 所	英国	30,728	2,128,405.59	0.75
61	MAGIC HOLDINGS INTERNATIONAL LIMITED	美即控股 国际有限 公司	1633 HK	香港 证券 交易 所	香港	400,000	2,116,229.21	0.75
62	WORLD WIDE TOUCH TECHNOLOGY(HOLDINGS) LIMITED	世达科技 (控股)有 限公司	1282 HK	香港 证券 交易 所	香港	2,600,000	2,104,302.00	0.74
63	LLOYDS BANKING GROUP PLC	-	LLOY LN	伦敦 证券 交易 所	英国	308,602	2,102,363.13	0.74
64	DANAHER CORPORATION	-	DHR US	纽约 证券 交易 所	美国	6,644	2,075,537.49	0.73

				所				
65	ULTRA PETROLEUM CORP.	-	UPL US	纽约 证券 交易 所	美国	6,524	2,063,974.26	0.73
66	METSO OYJ	-	MEO1V FH	芬兰 证券 交易 所	芬兰	5,535	2,055,510.34	0.73
67	PEPSICO INC	-	PEP US	纽约 证券 交易 所	美国	4,728	2,045,621.17	0.72
68	CHECK POINT SOFTWARE TECHNOLOGIES LTD	-	CHKP US	纳斯 达克 证券 交易 所	美国	6,668	2,042,849.17	0.72
69	TEXHONG TEXTILE GROUP LTD	天虹纺织 集团有限 公司	2678 HK	香港 证券 交易 所	香港	400,000	2,027,627.02	0.72
70	CHINA OILFIELD SERVICES LIMITED	中海油田 服务股份 有限公司	2883 HK	香港 证券 交易 所	香港	140,000	2,008,543.48	0.71
71	FIRST QUANTUM MINERALS LTD	-	FM CN	多伦 多证 券交 易所	加拿大	2,779	2,000,007.84	0.71
72	SHINHAN FINANCIAL GROUP LTD	-	055550 KS	韩国 证券 交易 所	韩国	6,280	1,953,944.70	0.69
73	CELANESE CORPORATION	-	CE US	纽约 证券 交易 所	美国	7,073	1,928,499.84	0.68
74	AUSTRALIA AND NEW ZEALAND BANKING GROUP LIMITED	-	ANZ AU	澳大 利亚 证券 交易 所	澳大利 亚	11,761	1,864,007.74	0.66
75	ANHANGUERA	-	AEDU3	巴西	巴	11,588	1,847,684.87	0.65

	EDUCACIONAL PARTI		BZ	证券 交易 所	西			
76	NEWS CORPORATION	-	NWS US	纳 斯 达 克 证 券 交 易 所	美 国	16,865	1,833,979.94	0.65
77	ING GROEP N.V.	-	INGA NA	阿 姆 斯 特 丹 证 券 交 易 所	荷 兰	26,807	1,733,825.37	0.61
78	PHOENITRON HOLDINGS LIMITED	品创控 股有 限公 司	8066 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	500,000	1,490,902.22	0.53
79	CITIC DAMENG HOLDINGS LTD	中 信 大 锰 控 股 有 限 公 司	1091 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	600,000	1,415,931.14	0.50
80	O-NET COMMUNICATIONS(GROUP) LIMITED	昂 纳 光 通 信 (集 团) 有 限 公 司	877 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	300,000	1,395,484.48	0.49
81	TRINITY LIMITED	利 邦 控 股 有 限 公 司	891 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	200,000	1,395,484.48	0.49
82	PT TELEKOMUNIKASI INDONESIA	-	TLK US	纽 约 证 券 交 易 所	美 国	5,846	1,380,042.66	0.49
83	RUINIAN INTERNATIONAL LIMITED	瑞 年 国 际 有 限 公 司	2010 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	300,000	1,377,593.65	0.49
84	CHINA WIRELESS TECHNOLOGIES LIMITED	中 国 无 线 科 技 有 限 公 司	2369 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	300,000	1,239,578.71	0.44
85	BELLE INTERNATIONAL HOLDINGS LIMITED	百 丽 国 际 控 股 有 限 公 司	1880 HK	香 港 证 券 交 易 所	香 港	110,000	1,231,400.04	0.44

				所				
86	ALIBABA.COM LTD	阿里巴巴网络有限公司	1688 HK	香港证券交易所	香港	100,000	1,187,610.11	0.42
87	GOLDEN EAGLE RETAIL GROUP LIMITED	金鹰商贸集团有限公司	3308 HK	香港证券交易所	香港	70,000	1,142,627.46	0.40
88	LIFESTYLE INTERNATIONAL HLDGS LTD	利福国际集团有限公司	1212 HK	香港证券交易所	香港	70,000	1,141,434.74	0.40
89	KINGDEE INTERNATIONAL SOFTWARE GROUP COMPANY LIMITED	金蝶国际软件集团有限公司	268 HK	香港证券交易所	香港	300,000	1,114,342.92	0.39
90	CHINA MERCHANTS BANK CO.,LIMITED	招商银行股份有限公司	3968 HK	香港证券交易所	香港	65,000	1,086,484.35	0.38
91	ZTE CORPORATION	中兴通讯股份有限公司	763 HK	香港证券交易所	香港	40,000	1,053,002.94	0.37
92	HISOFT TECHNOLOGY INTERNATIONAL LIMITED	海辉软件(国际)集团公司	HSFT US	纳斯达克证券交易所	美国	5,000	1,000,027.70	0.35
93	STATOIL ASA	-	STL NO	挪威证券交易所	挪威	6,181	975,855.48	0.34
94	GCL-POLY ENERGY HOLDINGS LTD	保利协鑫能源控股有限公司	3800 HK	香港证券交易所	香港	400,000	974,624.08	0.34
95	COUNTRY STYLE COOKING RESTAURANT CHAIN CO LTD	乡村基餐饮管理有限公司	CCSC US	纽约证券交易所	美国	6,000	913,932.60	0.32
96	SANYI HEAVY EQUIPMENT INTERNATIONAL	三一重装国际控股	631 HK	香港证券交易所	香港	80,000	781,062.38	0.28

	HOLDINGS COMPANY LIMITED	有限公司		交易所				
97	L'OCCITANE INTERNATIONAL SA	欧舒丹公司	973 HK	香港证券交易所	香港	10,000	183,167.99	0.06
98	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	20,000	109,048.85	0.04
99	SINOPHARM GROUP CO.,LTD.	国药控股股份有限公司	1099 HK	香港证券交易所	香港	2,000	46,175.37	0.02
100	TSC OFFSHORE GROUP LTD.	TSC 海洋集团有限公司	206 HK	香港证券交易所	香港	27,000	45,774.96	0.02
101	ROLLS-ROYCE GROUP-C SHRS	-	3905664Z LN	伦敦证券交易所	英国	2,127,808	22,063.61	0.01
102	CHINA SANJIANG FINE CHEMICALS COMPANY LIMITED	中国三江精细化工有限公司	2198 HK	香港证券交易所	香港	5,000	11,501.25	0.00

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 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	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LIMITED	1398 HK	53,207,909.67	13.29
2	CHINA CITIC BANK CORPORATION LIMITED	998 HK	20,249,972.93	5.06
3	CHINA MERCHANTS BANK CO.,LIMITED	3968 HK	16,718,575.45	4.18
4	BANK OF CHINA LIMITED	3988 HK	13,656,520.16	3.41
5	PETROCHINA COMPANY LIMITED	857 HK	13,649,665.58	3.41
6	CNOOC LIMITED	883 HK	12,055,450.75	3.01
7	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED	1088 HK	11,261,579.65	2.81

8	CHINA LIFE INSURANCE COMPANY LIMITED	2628 HK	11,210,051.68	2.80
9	FUSHAN INTERNATIONAL ENERGY GROUP LTD.	639 HK	10,269,361.60	2.57
10	TENCENT HOLDINGS LIMITED	700 HK	9,616,551.17	2.40
11	SINOPHARM GROUP CO.,LTD.	1099 HK	9,489,862.75	2.37
12	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	384 HK	9,220,522.57	2.30
13	MING FUNG JEWELLERY GROUP LIMITED	860 HK	9,058,286.81	2.26
14	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY LIMITED	966 HK	8,792,760.08	2.20
15	CHINA COAL ENERGY COMPANY LIMITED	1898 HK	7,953,257.95	1.99
16	KAISUN ENERGY GROUP LIMITED	8203 HK	7,482,578.77	1.87
17	POLY (HONG KONG) INVESTMENTS LIMITED	119 HK	7,298,593.88	1.82
18	ZHONGPIN INC	HOGS US	6,873,070.88	1.72
19	YANZHOU COAL MINING COMPANY LIMITED	1171 HK	6,848,441.20	1.71
20	ORANGE SKY GOLDEN HARVEST ENTERTAINMENT (HOLDINGS) LIMITED	1132 HK	6,818,736.60	1.70

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。

8.5.2 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	INDUSTRIAL AND COMMERCIAL BANK OF CHINA LTD	1398 HK	58,264,017.45	14.55
2	CHINA CITIC BANK CORPORATION LIMITED	998 HK	28,827,439.78	7.20
3	CHINA MERCHANTS BANK CO.,LIMITED	3968 HK	21,379,501.76	5.34
4	POLY (HONG KONG) INVESTMENTS LIMITED	119 HK	21,335,680.27	5.33
5	TENCENT HOLDINGS LIMITED	700 HK	16,934,093.26	4.23
6	CHINA SHENHUA ENERGY COMPANY LIMITED	1088 HK	16,782,791.32	4.19
7	BANK OF CHINA LIMITED	3988 HK	16,215,272.41	4.05
8	SINOPHARM MEDICINE HOLDING CO.,LTD	1099 HK	13,077,049.34	3.27
9	FUSHAN INTERNATIONAL ENERGY GROUP LTD.	639 HK	13,065,576.21	3.26
10	CHINA TAIPING INSURANCE HOLDINGS COMPANY LIMITED	966 HK	12,954,376.89	3.24

11	CHINA LIFE INSURANCE CO,LIMITED	2628 HK	12,541,334.44	3.13
12	PETROCHINA COMPANY LIMITED	857 HK	11,444,585.63	2.86
13	CNOOC LIMITED	883 HK	10,828,488.93	2.70
14	CHINA COAL ENERGY COMPANY LIMITED	1898 HK	10,373,190.98	2.59
15	KAISUN ENERGY GROUP LIMITED	8203 HK	9,510,043.69	2.38
16	CHINA MINSHENG BANKING CORP.,LTD.	1988 HK	9,493,090.76	2.37
17	SINO-TECH INTERNATIONAL HOLDINGS LTD.	724 HK	8,666,796.97	2.16
18	CHINA GAS HOLDINGS LIMITED	384 HK	8,626,894.70	2.15
19	CENTRON TELECOM INTERNATIONAL HOLDING LIMITED	1155 HK	8,584,065.70	2.14
20	CHINA PACIFIC INSURANCE (GROUP) CO.,LTD	2601 HK	8,355,497.11	2.09
21	BAIDU INC	BIDU US	8,278,838.21	2.07
22	PICC PROPERTY AND CASUALTY COMPANY LIMITED	2328 HK	8,082,844.17	2.02

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。

8.5.3 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	758,335,735.26
卖出收入（成交）总额	882,196,565.27

8.6 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。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	4,265,105.87
3	应收股利	130,419.97
4	应收利息	2,124.90
5	应收申购款	62,886.37
6	其他应收款	32,316.42
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,492,853.53

8.11.4 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。

8.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

8.11.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 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
7,385	24,037.34	24,600,089.80	13.86%	152,915,687.19	86.14%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	575,604.32	0.32%

§10 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	254,877,988.54
本报告期基金总申购份额	65,512,910.67
减：本报告期基金总赎回份额	142,875,122.22
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	177,515,776.99

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。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 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：2010年6月29日本基金管理人发布公告，经交银施罗德基金管理有限公司第二届董事会第十七次会议审议通过，同意彭纯先生因工作调动原因辞去公司董事长职务，任命钱文挥先生担任公司董事长。2010年9月29日本基金管理人发布公告，经交银施罗德基金管理有限公司第二届董事会第二十次会议审议通过，同意莫泰山先生辞去公司总经理职务，并决定由公司副董事长雷贤达先生代为履行公司总经理职务。2011年1月26日本基金管理人发布公告，经公司第二届董事会第二十一次会议审议通过，任命战龙先生担任本公司总经理。

2、本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2011年2月9日发布公告，经中国建设银行研究决定，聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理（主持工作），其任职资格已经中国证监会审核批准（证监许可（2011）115号）。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人2011年1月31日发布任免通知，解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所。报告年度支付给普华永道中天会计师事务所有限公司的审计费 60,000 元，自本基金基金合同生效以来，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
Goldman Sachs (ASIA) Securities Limited	-	272,018,577.21	16.59%	408,027.97	15.39%	-
CICC Hong Kong Securities Limited	-	179,850,443.31	10.97%	269,775.72	10.18%	-
UBS Securities Hong Kong Ltd	-	152,971,612.20	9.33%	172,445.12	6.50%	-
CLSA Ltd	-	120,951,077.01	7.38%	303,575.64	11.45%	-
CCB International Securities Limited	-	106,370,660.95	6.49%	173,405.79	6.54%	-
BOCI Securities Limited	-	87,138,361.89	5.31%	146,875.73	5.54%	-
China Merchants Securities(HK)Co.Ltd.	-	86,321,023.86	5.26%	140,422.62	5.30%	-
Morgan Stanley	-	55,217,207.01	3.37%	91,805.03	3.46%	-
Yuanta Securities(HONG KONG)Company Limited	-	54,010,611.26	3.29%	72,914.32	2.75%	-
ITG Inc. New York	-	53,642,613.60	3.27%	18,576.79	0.70%	-
UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited	-	49,345,216.22	3.01%	80,644.58	3.04%	-
Instinet Europe Limited London	-	48,814,623.83	2.98%	32,623.83	1.23%	-
Oriental Patron Securities Limited	-	43,932,286.67	2.68%	209,361.54	7.90%	-
Investment Tech Group Ltd Dublin	-	40,947,349.42	2.50%	49,386.42	1.86%	-
Bocom International Securities Limited	-	33,614,578.13	2.05%	58,036.69	2.19%	-
Merrill Lynch Far East Limited	-	28,336,112.27	1.73%	56,672.22	2.14%	-
JP MORGAN Securities	-	27,285,500.99	1.66%	27,285.51	1.03%	-

(Asia Pacific) Ltd.Hong Kong						
Samsung Securities Asia Limited	-	26,277,620.12	1.60%	85,451.49	3.22%	-
Shenyin Wanguo Securities(H.K.)Ltd	-	21,222,454.61	1.29%	31,833.70	1.20%	-
PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIES LIMITED	-	20,943,299.28	1.28%	65,158.83	2.46%	-
Morgan Stanley International Ltd	-	13,903,884.19	0.85%	19,925.39	0.75%	-
UBS Securities Asia Ltd	-	9,280,499.77	0.57%	4,769.16	0.18%	-
LIQUIDNET EURO	-	8,226,302.88	0.50%	9,375.84	0.35%	-
S J LEVINSON	-	6,724,214.93	0.41%	8,069.02	0.30%	-
CS First Boston (Europe) Ltd	-	6,161,229.15	0.38%	7,566.95	0.29%	-
Merrill Lynch Pierce Fenner Smith NY	-	6,031,593.31	0.37%	8,700.85	0.33%	-
JPMorgan Securities(AsiaPacific)Ltd	-	5,594,664.56	0.34%	4,892.73	0.18%	-
Morgan Grenfell & Co	-	4,748,671.18	0.29%	6,762.80	0.26%	-
CSFB (Hong Kong) Ltd HK	-	4,709,138.80	0.29%	3,459.12	0.13%	-
Goldman Sachs International Limited	-	4,291,152.24	0.26%	6,072.12	0.23%	-
Merrill Lynch London	-	3,863,316.52	0.24%	5,098.09	0.19%	-
Jefferies & Co Inc	-	3,827,254.65	0.23%	3,444.45	0.13%	-
Instinet Pacific Limited	-	3,696,944.54	0.23%	1,814.53	0.07%	-
UBS Securities LLC Stamford	-	3,497,066.02	0.21%	5,725.91	0.22%	-
Nomura International Ltd London	-	3,491,360.57	0.21%	4,532.38	0.17%	-
Macquarie Equities Ltd (Sydney)	-	3,221,161.90	0.20%	4,831.74	0.18%	-
Panmure Gordon Limited	-	2,977,874.87	0.18%	4,466.77	0.17%	-
UBS Securities Ltd	-	2,920,969.88	0.18%	4,352.74	0.16%	-
Morgan Stanley & Co	-	2,613,736.34	0.16%	2,921.53	0.11%	-
Evolution Group Plc	-	2,579,025.49	0.16%	3,868.45	0.15%	-
Goldman Sachs & Company New York	-	2,532,780.41	0.15%	3,491.44	0.13%	-
ITG Ltd - Hong Kong	-	2,444,438.76	0.15%	1,222.23	0.05%	-
Macquarie Bank Ltd	-	2,237,362.57	0.14%	3,356.02	0.13%	-
Barclays Capital Inc.	-	2,220,136.58	0.14%	1,332.08	0.05%	-
Citigroup Global Markets	-	2,212,048.42	0.13%	3,318.07	0.13%	-

Australia Pty						
HSBC Securities	-	2,189,318.87	0.13%	3,283.96	0.12%	-
J P Morgan Securities Inc N.Y.	-	2,008,363.14	0.12%	0.00	0.00%	-
Deutsche Securities Asia Ltd	-	1,972,291.05	0.12%	3,894.96	0.15%	-
CORMARK SEC	-	1,796,633.53	0.11%	456.25	0.02%	-
Citigroup Global Markets Ltd	-	1,570,960.88	0.10%	4,712.85	0.18%	-
UBS Singapore DMA	-	1,506,373.68	0.09%	451.97	0.02%	-
ICAP CORP LLC	-	1,457,620.98	0.09%	1,749.11	0.07%	-
Jefferies International Limited	-	814,241.25	0.05%	1,221.20	0.05%	-
SG Securities (London) Ltd	-	508,367.85	0.03%	762.56	0.03%	-
JP Morgan Secs (Asia Pacific) Korea	-	340,804.57	0.02%	1,022.41	0.04%	-
Morgan Stanley N Co Intl Ltd (Seoul)	-	336,665.49	0.02%	1,009.99	0.04%	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	329,027.00	0.02%	3,290.27	0.12%	-
LIQUIDNET	-	318,904.42	0.02%	272.96	0.01%	-
ABN Amro Australia Limited	-	270,101.93	0.02%	675.31	0.03%	-
CSFB Singapore Secs PTE Limited	-	260,340.60	0.02%	78.10	0.00%	-
Liquidnet Australia Pty Ltd	-	234,612.53	0.01%	234.61	0.01%	-
Credit Suisse First Boston Seoul	-	213,718.92	0.01%	106.84	0.00%	-
Mizuho Securities Co (Tokyo)	-	192,575.38	0.01%	231.07	0.01%	-
Macquarie Securities(Singapore)Pte Ltd	-	185,033.52	0.01%	55.49	0.00%	-
Citigroup Global Markets UK Equity	-	100,252.76	0.01%	120.27	0.00%	-

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 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	交银施罗德环球精选价值证券投资基金季度报告（2009年第四季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-21
2	交银施罗德基金管理有限公司关于增加江苏银行、东兴证券、广发华福证券、北京银行为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-1-22
3	交银施罗德基金管理有限公司关于增加中国建银投资证券有限责任公司为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-5
4	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开办定期定额投资计划业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-16
5	关于交银施罗德环球精选价值证券投资基金在中国农业银行开办定期定额赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-16
6	交银施罗德基金管理有限公司关于开通中国民生银行借记卡网上直销定期定额投资业务和调整网上直销申购限额的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-26
7	交银施罗德环球精选价值证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-30
8	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2009年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-3-30
9	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（2010年第1号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-8
10	交银施罗德环球精选价值证券投资基金季度报告（2010年第一季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-20
11	交银施罗德基金管理有限公司关于直销账户开户银行名称变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-4-28
12	交银施罗德环球精选价值证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-5-18
13	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与信达证券股份有限公司、安信证券股份有限公司和中国建银投资证券有限责任公司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	2010-6-25
14	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在信达证券股份有限公司开办定期定额投资	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-25

	业务并参与相关优惠活动的公告		
15	交银施罗德环球精选价值证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-25
16	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网上银行基金费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-6-30
17	交银施罗德环球精选价值证券投资基金季度报告（2010年第二季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-7-21
18	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华融证券股份有限公司为旗下部分基金场外代销机构并参与相关费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-7-30
19	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海银行股份有限公司网上银行基金费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-7-31
20	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与海通证券股份有限公司定期定额投资业务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	2010-8-9
21	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券股份有限公司网上银行基金费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-18
22	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与江苏银行股份有限公司定期定额投资业务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	2010-8-20
23	交银施罗德基金管理有限公司关于向中国农业银行股份有限公司金穗借记卡持卡人调整基金网上直销前端申购费率优惠的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-20
24	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2010年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-26
25	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与齐鲁证券有限公司网上银行基金费率优惠和定期定额投资业务前端费率优惠活动延期的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-8-31
26	交银施罗德基金管理有限公司关于增加华夏银行股份有限公司为旗下部分基金场外代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-9-13
27	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与华泰证券股份有限公司定期定额投资业务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	2010-9-21
28	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（2010年第2号）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-9-30
29	交银施罗德环球精选价值证券投资基金季度报告（2010年第三季度）	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-10-26
30	交银施罗德环球精选价值证券投资基金因境外主要市场节假日暂停申购、赎回的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-21

31	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前端申购费率优惠活动调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-27
32	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定期定额投资业务投资起点金额调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
33	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海银行股份有限公司网上银行基金费率优惠活动调整的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31
34	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与深圳发展银行股份有限公司基金申购及定期定额投资业务前端费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2010-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

2010年1月29日，托管人中国建设银行股份有限公司发布第二届董事会第二十八次会议决议公告，决议聘任庞秀生先生担任中国建设银行股份有限公司副行长。

2010年5月13日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于高级管理人员辞任的公告，范一飞先生已提出辞呈，辞去中国建设银行股份有限公司副行长的职务。

2010年6月21日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于中央汇金投资有限责任公司承诺认购配股股票的公告。

2010年7月1日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2009年度A股分红派息实施公告，每10股派发现金股息人民币2.02元(含税)。

2010年9月15日，托管人中国建设银行股份有限公司发布公告，张福荣先生担任中国建设银行股份有限公司监事长，谢渡扬先生辞去中国建设银行股份有限公司监事、监事长职务。

2010年11月2日，托管人中国建设银行股份有限公司发布2010年度A股配股发行公告。

§13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

13.3 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.jyfund.com, www.jysld.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。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一一年三月二十八日