

交银施罗德环球精选价值证券投资基金
2016 年年度报告
2016 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：二〇一七年三月二十九日

§ 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根据本基金合同规定，于 2017 年 3 月 28 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。

本报告期自 2016 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	7
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	9
§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	11
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
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
4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.8 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.10 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
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	43
8.3 期末按行业分类的权益投资组合	44
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	44
8.5 报告期内权益投资组合的重大变动	53

8.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	55
8.7 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	55
8.8 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	55
8.9 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	55
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	55
8.11 投资组合报告附注	55
§9 基金份额持有人信息	56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	57
9.3 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	57
§10 开放式基金份额变动	57
§11 重大事件揭示	57
11.1 基金份额持有人大会决议	57
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	58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	58
11.4 基金投资策略的改变	58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
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	58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	58
11.8 其他重大事件	74
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§ 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	61,370,048.29 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	tianqingl.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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.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 (特殊普通合伙)	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	2016 年	2015 年	2014 年
本期已实现收益	-2,028,238.47	4,491,773.60	27,600,369.17
本期利润	6,396,541.93	262,832.59	9,435,959.18
加权平均基金份额本期利润	0.1077	0.0040	0.1005
本期加权平均净值利润率	7.07%	0.24%	6.23%
本期基金份额净值增长率	7.08%	0.15%	6.38%
3.1.2 期末数据和指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
期末可供分配利润	33,588,086.91	34,515,326.21	50,169,033.43
期末可供分配基金份额利润	0.547	0.598	0.650
期末基金资产净值	100,793,987.15	92,231,125.53	128,269,800.31
期末基金份额净值	1.642	1.598	1.662
3.1.3 累计期末指标	2016 年末	2015 年末	2014 年末
基金份额累计净值增长率	104.89%	91.35%	91.06%

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	2.88%	0.49%	-1.12%	0.51%	4.00%	-0.02%
过去六个月	9.69%	0.52%	5.81%	0.53%	3.88%	-0.01%
过去一年	7.08%	0.81%	4.22%	0.83%	2.86%	-0.02%
过去三年	14.08%	0.94%	1.43%	0.77%	12.65%	0.17%
过去五年	58.27%	0.86%	35.94%	0.74%	22.33%	0.12%
自基金合同生效 起至今	104.89%	0.99%	26.69%	1.17%	78.20%	-0.18%

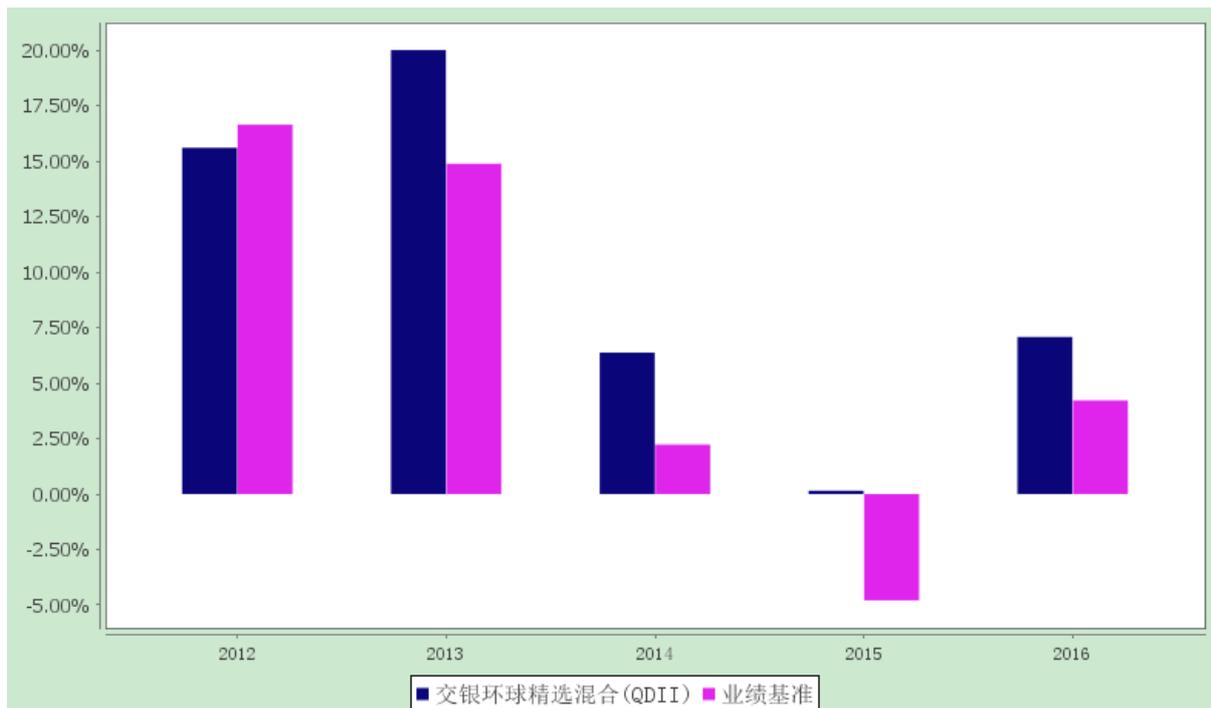
注：本基金的业绩比较基准为 70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数，每日进行再平衡过程。

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



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。

3.2.3 过去五年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



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
2016年	0.600	1,060,257.52	2,388,623.66	3,448,881.18	-
2015年	0.660	1,620,714.07	3,392,077.59	5,012,791.66	-
2014年	0.390	1,567,517.23	2,440,095.69	4,007,612.92	-
合计	1.650	4,248,488.82	8,220,796.94	12,469,285.76	-

§ 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。

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 69 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 (LOF) 的基金经理，公司量化投资部副总经理	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、量化投资部助理总经理。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。2015 年 8 月 13 日至 2016 年 7 月 18 日担任交银施罗德中证环境治理指数分级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)、交银沪港深价值精选混合的基金经理	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、2017年3月25日本基金管理人发布公告，经公司领导办公会审议通过，蔡铮先生不再担任本基金基金经理，本基金由陈俊华女士和周中先生共同管理。除此之外基金经理（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合规守信情况的说明

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 公平交易制度和控制方法

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所管理的所有资产组合投资运作的公平。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。制度中包含的主要控制方法如下：

(1) 公司建立资源共享的投资研究信息平台，所有研究成果对所有投资组合公平开放，确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2) 公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易制度，建立了合理且可操作的公平交易分配机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3) 公司建立了清晰的投资授权制度，明确各层级投资决策主体的职责和权限划分，组合投资经理充分发挥专业判断能力,不受他人干预,在授权范围内独立行使投资决策权，维护公平的投资管理环境，维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合交易决策的客观性和独立性，防范不公平及异常交易的发生。

(4) 公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。在全公司适用股票、债券备选库的基础上，根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，按需要建立不同投资组合的投资对象风格库和交易对手备选库，组合经理在此基础上根据投资授权构建投资组合。

(5) 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投资组合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。

4.4.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等，本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

4.4.3 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 2 次，是投资组合因投资策略或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

2016年，欧美和香港市场表现完全不同。欧美股市受经济复苏预期影响，全年录得正收益。港股市场经历震荡走势，最终全年收平：港股年初受到国内市场影响，单月跌幅超过10%，后续受到一定反弹，但四季度持续回落，基本抹杀全年涨幅。香港市场的交易量也较上年略有减少，体现出在经济震荡期，离岸金融市场受到海外和国内双重不确定性因素的影响。

本基金在2016年录得正收益。回顾一年的操作，我们的收获主要源自于：1) 坚定欧美、香港市场分散化投资；2) 在选个股层面，坚持先行业后公司，从中观到微观的选股策略。精选个股，持股相对更加集中，且细分行业的龙头公司比例增多。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.642元，本报告期份额净值增长率为7.08%，同期业绩比较基准增长率为4.22%。

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2017年，我们认为海外市场的不确定性增大，总体呈谨慎乐观的态度。谨慎在于，美国新一届总统、执政团队上任，前期投资者的预期普遍较高，未来兑现的程度和步伐值得关注。此外，2016年底，美国明确了来年3次加息预期，在2017年这二者都将牵动全体投资者的信心。乐观在于：我们仍看好香港市场全年的表现。首先，中国经济逐步企稳，进一步恶化风险减小；其次，伴随沪港通、深港通的开通，国内投资者进入香港的通道被显著放宽，相较于国内的估值水平，香港市场的估值优势显著；最后，海外资金是否会回流，这个值得关注。综上，我们仍将坚持中观到微观层面的精选个股策略。我们相对关注轨交、医药、化工、通讯等行业，仍会坚持在行业内精选个股，持续勤勉尽责地努力为投资者赚取业绩回报。

4.7 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2016年度，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，本基金管理人诚实守信、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) 持续完善公司内部控制制度和业务流程，推动制度流程的及时更新。

公司持续以提升制度和业务流程的指导性和执行力为强化内部控制的重要抓手，以内部管理制度的全面修订和公司主要业务流程的梳理为工作重点。梳理工作使公司制度的有效性、制度流程之间的匹配度得到明显提升。同时在梳理过程中，公司着重关注于公司的核心增值流程，通过对流程的研究、梳理、再造等过程实现管理上风险和回报的平衡。

（二）全面开展内部监督检查，强化公司内部控制。

公司审计部门坚持以法律法规和公司各项制度为依据，按照监管机构的要求对基金运作和公司经营所涉及的各个环节实施了严格的稽核监察。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和不定期检查，促进公司内部控制制度规范、执行有效，风险管理水平不断提升。

（三）强化培训教育，持续提高全员风险合规意识。

公司积极推动各项新法规落实和风险合规教育工作。通过及时、有序和针对性的法律法规、制度规章、风险案例的研讨、培训和交流，提升了员工的风险合规意识，提高了员工内部控制、风险管理的技能和水平，公司内部控制和风险管理基础得到夯实和优化。

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，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

根据相关法律法规和基金合同的规定，本基金对上一年度及本年度应分配的可供分配利润进行了收益分配，具体情况参见 7.4.8.2 资产负债表日后事项及 7.4.11 利润分

配情况。

4.10 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关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为 3,448,881.18 元。

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(2017)第 20178 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“交银施罗德环球基金”)的财务报表，包括 2016 年 12 月 31 日的资产负债表、2016 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是交银施罗德环球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)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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财务报表，并使其实现公允反映；

(2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

二、注册会计师的责任

我们的责任是在执行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中国注册会计师职业道德守则，计划和执行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，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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，上述交银施罗德环球精选基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了交银施罗德环球精选基金 2016 年 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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（特殊普通合伙）
师

中国注册会计

薛竞 朱宏宇

上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

2017 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：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：		-	-
银行存款	7.4.7.1	12,816,813.45	5,202,004.01
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	85,673,428.11	87,160,169.42
其中：股票投资		85,673,428.11	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,101,594.65	672,420.39
应收利息	7.4.7.5	767.18	153.61
应收股利		106,583.52	58,880.05
应收申购款		1,405,575.37	10,795.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	1,011,779.49
资产总计		101,104,762.28	94,116,202.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31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	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	512,228.40
应付赎回款		61,953.67	95,995.74
应付管理人报酬		149,555.87	140,089.97
应付托管费		29,080.28	27,239.71
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	70,185.31	1,109,523.11
负债合计		310,775.13	1,885,076.93
所有者权益：		-	-
实收基金	7.4.7.9	61,370,048.29	57,715,799.32
未分配利润	7.4.7.10	39,423,938.86	34,515,326.21
所有者权益合计		100,793,987.15	92,231,125.53
负债和所有者权益总计		101,104,762.28	94,116,202.46

注：报告截止日 2016 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.642 元，基金份额总额 61,370,048.29 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：2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016 年 1 月 1 日 至 2016 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 12 月 31 日
一、收入		8,617,705.27	3,115,891.52
1.利息收入		10,264.60	24,911.80
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,264.60	24,911.80
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）		-236,795.89	6,704,242.02
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-1,908,714.43	4,862,614.69
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.15	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	15,417.31	37,185.37
股利收益	7.4.7.17	1,656,501.23	1,804,441.96
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	8,424,780.40	-4,228,941.01
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		411,862.31	579,269.78
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	7,593.85	36,408.93
减：二、费用		2,221,163.34	2,853,058.93
1. 管理人报酬		1,626,680.43	1,977,768.08
2. 托管费		316,299.02	384,566.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	206,124.03	369,516.29
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	72,059.86	121,208.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,396,541.93	262,832.59
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,396,541.93	262,832.59

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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）	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）	-	6,396,541.93	6,396,541.93
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）	3,654,248.97	1,960,951.90	5,615,200.87
其中：1.基金申购款	11,693,623.14	6,370,387.21	18,064,010.35
2.基金赎回款	-8,039,374.17	-4,409,435.31	-12,448,809.48
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）	61,370,048.29	39,423,938.86	100,793,987.15
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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）	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）	-	262,832.59	262,832.59
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）	-19,462,316.89	-11,826,398.82	-31,288,715.71
其中：1.基金申购款	22,400,523.59	17,113,080.84	39,513,604.43

2.基金赎回款	-41,862,840.48	-28,939,479.66	-70,802,320.14
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）	57,715,799.32	34,515,326.21	92,231,125.53

报表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：单江

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（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。

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 2017 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 7.4.4 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。

7.4.3 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 12 月 31 日的财务状况以及 2016 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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金以交易目的持有的股票投资(包括股票存托凭证)、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(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，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。对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，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；对于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。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的公允价值变动作为公允价值变动损益计入当期损益；在资产持有期间所取得的利息或现金股利以及处置时产生的处置损益计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具(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 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 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

股票投资和基金投资在持有期间应取得的现金股利及基金分红收益扣除股票和基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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，处置价格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则按直线法计算。

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则按直线法计算。

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) 本基金的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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 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。

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[2004]78号《财政部、国家税务总局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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》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)于2016年5月1日前，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。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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(于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)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。

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	12,816,813.45	5,202,004.01
定期存款	-	-
其他存款	-	-
合计	12,816,813.45	5,202,004.01

注：于 2016 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 147,415.93 元(折合人民币 1,022,624.30 元)和港币活期存款 9,082,435.32 元(折合人民币 8,125,736.00 元)。于 2015 年 12 月 31 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 219,398.13 元(折合人民币 1,424,683.69 元)和港币活期存款 3,694,262.19 元(折合人民币 3,095,068.64 元)。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2016 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		69,760,889.09	85,673,428.11	15,912,539.02
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		69,760,889.09	85,673,428.11	15,912,539.02
项目		上年度末 2015 年 12 月 31 日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		79,672,410.80	87,160,169.42	7,487,758.62
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		79,672,410.80	87,160,169.42	7,487,758.62

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工具。

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	766.73	153.43
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	0.45	0.18
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	767.18	153.61

7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
应收在途资金	-	1,011,779.49
合计	-	1,011,779.49

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	185.31	9.89
预提审计费	40,000.00	50,000.00
预提信息披露费	30,000.00	60,000.00
应付在途资金	-	999,513.22
合计	70,185.31	1,109,523.11

7.4.7.9 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12月31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	11,693,623.14	11,693,623.14
本期赎回（以“-”号填列）	-8,039,374.17	-8,039,374.17
本期末	61,370,048.29	61,370,048.29

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。

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	37,025,613.04	-2,510,286.83	34,515,326.21
本期利润	-2,028,238.47	8,424,780.40	6,396,541.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,039,593.52	-78,641.62	1,960,951.90
其中：基金申购款	6,325,114.57	45,272.64	6,370,387.21
基金赎回款	-4,285,521.05	-123,914.26	-4,409,435.31
本期已分配利润	-3,448,881.18	-	-3,448,881.18
本期末	33,588,086.91	5,835,851.95	39,423,938.86

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
活期存款利息收入	10,248.58	24,858.15
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	16.02	53.65
合计	10,264.60	24,911.80

7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	61,473,436.35	116,540,320.17
减：卖出股票成本总额	63,382,150.78	111,677,705.48
买卖股票差价收入	-1,908,714.43	4,862,614.69

7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金投资收益。

7.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

7.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 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12月	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月
----	--------------------------	-------------------------------

	31日	31日
卖出权证成交总额	15,417.31	37,185.37
减：卖出权证成本总额	-	-
买卖权证差价收入	15,417.31	37,185.37

注：买卖权证差价收入包含权证行权差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他衍生工具投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,656,501.23	1,804,441.96
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,656,501.23	1,804,441.96

7.4.7.18 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12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
1.交易性金融资产	8,424,780.40	-4,222,439.10
——股票投资	8,424,780.40	-4,222,439.10
——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	-	-6,501.91
——权证投资	-	-6,501.91
3.其他	-	-
合计	8,424,780.40	-4,228,941.01

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金赎回费收入	7,593.85	36,408.93
合计	7,593.85	36,408.93

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。

7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	206,124.03	369,516.29
银行间市场交易费用	-	-
合计	206,124.03	369,516.29

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	40,000.00	50,000.00
信息披露费	30,000.00	60,000.00
其他	1,164.86	9,270.07
银行汇划费	895.00	1,938.45
合计	72,059.86	121,208.52

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

根据相关法律法规和基金合同要求，本基金本报告期内已实施的利润分配情况请参见附注 7.4.11 利润分配情况，本报告期应分配尚未实施分配的利润为 3,358,808.69 元，本基金管理人于 2017 年 1 月 12 日宣告分红，向截至 2017 年 1 月 16 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限公司登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.700 元。

财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自 2016 年 5 月 1 日起执行。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 1 月 6 日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)，2017 年 7 月 1 日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在 2017 年 7 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

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
施罗德投资管理有限公司(Schroder Investment Management Limited)	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
交银施罗德资产管理有限公司	基金管理人的子公司
上海直源投资管理有限公司	受基金管理人控制的公司
交烨投资管理(上海)有限公司	受基金管理人控制的公司

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。

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 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,626,680.43	1,977,768.08
其中：支付销售机构的客户维护费	204,361.20	238,727.06

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至 2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	316,299.02	384,566.04

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。

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。

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	
	2016年1月1日至 2016年12月31日		2015年1月1日至 2015年12月31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	40.67%		41.50%	

- 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。
 3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

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未持有本基金。

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	
	2016年1月1日至2016年12月31日		2015年1月1日至2015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	3,668,487.03	10,250.69	682,282.72	24,858.09
摩根大通银行	9,148,326.42	-2.11	4,519,721.29	0.06

注：本基金的银行存款分别由基金境内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。

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。

7.4.10.7 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。

7.4.11 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	本期利润分 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	-

注：本基金的基金管理人于资产负债表日后，报告批准报出日前宣告的利润分配情况，请参见附注 7.4.8.2 资产负债表日后事项。

7.4.12 期末（2016 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

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 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。

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。

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。

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 12 月 31 日，本基金未持有信用类债券(2015 年 12 月 31 日：无)。

7.4.13.3 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证券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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个半月以内且不计息，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 2016 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	12,816,813.45	-	-	-	12,816,813.45
交易性金融资产	-	-	-	85,673,428.11	85,673,428.11
应收证券清算款	-	-	-	1,101,594.65	1,101,594.65
应收利息	-	-	-	767.18	767.18
应收股利	-	-	-	106,583.52	106,583.52

应收申购款	9.88	-	-	1,405,565.49	1,405,575.37
资产总计	12,816,823.33	-	-	88,287,938.95	101,104,762.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	61,953.67	61,953.67
应付管理人报酬	-	-	-	149,555.87	149,555.87
应付托管费	-	-	-	29,080.28	29,080.28
其他负债	-	-	-	70,185.31	70,185.31
负债总计	-	-	-	310,775.13	310,775.13
利率敏感度缺口	12,816,823.33	-	-	87,977,163.82	100,793,987.15
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年12月31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)。

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 2016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	1,022,624.30	8,125,736.00	-	9,148,360.30
交易性金融资产	45,921,677.18	17,068,166.28	22,683,584.65	85,673,428.11
应收证券清算款	-	1,101,594.65	-	1,101,594.65
应收股利	67,939.24	-	38,644.28	106,583.52
资产合计	47,012,240.72	26,295,496.93	22,722,228.93	96,029,966.58
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表 外汇风险敞口净额	47,012,240.72	26,295,496.93	22,722,228.93	96,029,966.58
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

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 2016年12月31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 480	增加约 460
2.所有外币相对人民币贬值 5%	减少约 480	减少约 460	

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 2016年12月31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	85,673,428.11	85.00	87,160,169.42	94.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	85,673,428.11	85.00	87,160,169.42	94.50

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 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	增加约 456	增加约 556
	2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	减少约 456	减少约 556

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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2016 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 85,673,428.11 元，无属于第二层次和第三层次的余额 (2015 年 12 月 31 日：第一层次 87,160,169.42 元，无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间不将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2016 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产 (2015 年 12 月 31 日：同)。

(d) 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。

(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	85,673,428.11	84.74

	其中：普通股	84,505,390.20	83.58
	存托凭证	1,168,037.91	1.16
	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	12,816,813.45	12.68
8	其他各项资产	2,614,520.72	2.59
9	合计	101,104,762.28	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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（%）
美国	45,084,966.76	44.73
香港	17,068,166.28	16.93
英国	5,309,773.53	5.27
日本	5,232,361.11	5.19
德国	4,588,392.55	4.55
挪威	1,534,366.33	1.52
瑞士	1,485,750.14	1.47
西班牙	1,129,026.95	1.12
法国	1,043,479.65	1.04
新加坡	836,710.42	0.83
泰国	812,085.41	0.81

巴西	789,066.81	0.78
瑞典	759,282.17	0.75
合计	85,673,428.11	85.00

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。

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 (%)
信息技术	14,309,447.87	14.20
金融	14,153,343.96	14.04
保健	11,969,762.54	11.88
工业	9,809,808.48	9.73
非必需消费品	9,731,947.16	9.66
必需消费品	7,788,094.35	7.73
材料	6,091,084.35	6.04
能源	5,999,816.74	5.95
电信服务	4,266,268.68	4.23
房地产	1,328,398.43	1.32
公共事业	225,455.55	0.22
合计	85,673,428.11	85.00

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	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国证 券交易 所	美国	396	2,176,901.36	2.16
2	Citigroup Inc	花旗集团	C US	美国证 券交易 所	美国	5,229	2,155,738.44	2.14
3	Unitedhealth Group	美国联合 健康集团	UNH US	美国证 券交易 所	美国	1,861	2,066,077.51	2.05

	Inc							
4	Comcast Corporation	康卡斯特公司	CMCSA US	美国证券交易所	美国	4,144	1,984,975.38	1.97
5	Union Pacific Corp	联合太平洋公司	UNP US	美国证券交易所	美国	2,555	1,837,627.95	1.82
6	Amazon .Com Inc	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	345	1,794,637.63	1.78
7	US Bancorp	美国合众银行	USB US	美国证券交易所	美国	5,020	1,788,895.52	1.77
8	JPMorgan Chase & Co	摩根大通集团	JPM US	美国证券交易所	美国	2,744	1,642,541.20	1.63
9	Apple Inc	苹果公司	AAPL US	美国证券交易所	美国	1,985	1,594,835.03	1.58
10	Statoil ASA	挪威国家石油公司	STL NO	挪威证券交易所	挪威	12,017	1,534,366.33	1.52
11	Visa Inc	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	2,799	1,514,888.05	1.50
12	Hewlett Packard Enterprise Co Ltd	惠普公司	HPE US	美国证券交易所	美国	9,401	1,509,069.01	1.50
13	Reckitt Benckiser Group Plc	利洁时集团	RB/ LN	伦敦证券交易所	英国	2,543	1,501,181.71	1.49
14	Nestle SA	雀巢集团	NESN VX	瑞士证券交易所	瑞士	2,979	1,485,750.14	1.47
15	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	香港证券交易所	香港	200,000	1,481,565.06	1.47
16	Walgreens Boots	沃尔格林博兹联合	WBA US	美国证券交易所	美国	2,486	1,427,227.81	1.42

	Alliance Inc	公司		所				
17	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	1,388,519.91	1.38
18	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	1,381,101.90	1.37
19	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	1,328,398.43	1.32
20	Dow Chemical Co Ltd	陶氏化学	DOW US	美国证券交易所	美国	3,312	1,314,649.18	1.30
21	Occidental Petroleum Corp	西方石油	OXY US	美国证券交易所	美国	2,646	1,307,448.16	1.30
22	ChinaSoft International Ltd.	中软国际有限公司	354 HK	香港证券交易所	香港	400,000	1,302,632.08	1.29
23	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢公司	SLB US	美国证券交易所	美国	2,196	1,278,865.09	1.27
24	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	1,232,897.24	1.22
25	China Hongqiao Group Limited	中国宏桥集团有限公司	1378 HK	香港证券交易所	香港	200,000	1,220,322.91	1.21

26	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	1,215,154.57	1.21
27	Prudential PLC	英国保诚集团	PRU LN	伦敦证券交易所	英国	8,704	1,214,394.43	1.20
28	Amgen Inc	安进公司	AMGN US	美国证券交易所	美国	1,197	1,214,067.75	1.20
29	Pfizer Inc	辉瑞制药公司	PFE US	美国证券交易所	美国	5,381	1,212,413.34	1.20
30	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 有限公司	TMUS US	美国证券交易所	美国	3,002	1,197,638.50	1.19
31	Estee Lauder Cos Inc	雅诗兰黛公司	EL US	美国证券交易所	美国	2,234	1,185,385.26	1.18
32	Eaton Corp PLC	伊顿	ETN US	美国证券交易所	美国	2,547	1,185,382.28	1.18
33	Ingersoll-Rand PLC	英格索兰	IR US	美国证券交易所	美国	2,208	1,149,379.88	1.14
34	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	1,129,026.95	1.12
35	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	1,087,738.60	1.08
36	LVMH Moët Hennessy Louis Vuitton	LVMH 集团公司	MC FP	法国证券交易所	法国	786	1,043,479.65	1.04
37	Shire PLC	Shire 公司	SHP LN	伦敦证券交易所	英国	2,507	1,006,679.22	1.00

				所				
38	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	BAS GR	德国证券交易所	德国	1,550	1,001,764.73	0.99
39	Lloyds Banking Group PLC	劳埃德银行集团	LLOY LN	伦敦证券交易所	英国	186,599	999,950.91	0.99
40	Danaher Corp	美国丹纳公司	DHR US	美国证券交易所	美国	1,813	978,976.63	0.97
41	Colgate-Palmolive Co Ltd	高露洁棕榄	CL US	美国证券交易所	美国	2,127	965,567.13	0.96
42	Keyence Corp	西日本商工株式会社	6861 JP	日本证券交易所	日本	200	954,135.79	0.95
43	Medtronic PLC	美敦力公司	MDT US	美国证券交易所	美国	1,802	890,408.76	0.88
44	SAP SE	SAP 公司	SAP GR	德国证券交易所	德国	1,444	875,133.14	0.87
45	Owens Corning	欧文斯科宁公司	OC US	美国证券交易所	美国	2,445	874,507.36	0.87
46	Cimarex Energy Corp	Cimarex 能源公司	XEC US	美国证券交易所	美国	919	866,376.50	0.86
47	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	香港	5,000	848,589.65	0.84
48	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	39,400	847,757.61	0.84
49	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	836,710.42	0.83
50	SMC Corporation	日本 SMC 公司	6273 JP	日本证券交易所	日本	500	829,961.32	0.82

51	Kubota Corp	久保田公司	6326 JP	日本证券交易所	日本	8,300	823,777.88	0.82
52	Mondelez International Inc	Mondelez 国际公司	MDLZ US	美国证券交易所	美国	2,673	821,993.50	0.82
53	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	812,085.41	0.81
54	KDDI Corp	KDDI 株式会社	9433 JP	日本证券交易所	日本	4,600	809,807.88	0.80
55	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	100,000	807,882.40	0.80
56	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	中国铁路通信信号股份有限公司	3969 HK	香港证券交易所	香港	160,000	800,188.28	0.79
57	Telefonica Brasil SA	巴西电信公司	VIVT4 BZ	巴西证券交易所	巴西	8,400	789,066.81	0.78
58	Assa Abloy AB	亚萨合莱集团	ASSAB SS	瑞典证券交易所	瑞典	5,878	759,282.17	0.75
59	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	745,289.38	0.74
60	HDFC Bank Ltd	HDFC 银行有限公司	HDB US	美国证券交易所	美国	1,758	740,007.53	0.73
61	Ball Corp	波尔公司	BLL US	美国证券交易所	美国	1,411	734,793.19	0.73
62	Bayerische Motoren	宝马汽车股份有限公司	BMW GR	德国证券交易所	德国	1,129	733,308.06	0.73

	Werke AG							
63	Bridgestone Corp	普利司通株式会社	5108 JP	日本证券交易所	日本	2,900	726,939.64	0.72
64	Facebook Inc	Facebook 公司	FB US	美国证券交易所	美国	909	725,474.58	0.72
65	The TJX Companies, Inc.	TJX 公司	TJX US	美国证券交易所	美国	1,302	678,572.21	0.67
66	Fortive Corp	Fortive 公司	FTV US	美国证券交易所	美国	1,796	668,168.23	0.66
67	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	100,000	662,946.68	0.66
68	China Mobile Limited	中国移动有限公司	941 HK	香港证券交易所	香港	9,000	661,873.09	0.66
69	BHP Billiton PLC	必和必拓公司	BLT LN	伦敦证券交易所	英国	5,246	587,567.26	0.58
70	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	70,000	587,436.97	0.58
71	Cognizant Technology Solutions	高知特科技公司	CTSH US	美国证券交易所	美国	1,485	577,189.96	0.57
72	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	567,217.54	0.56
73	CNOOC Limited	中国海洋石油有限公司	883 HK	香港证券交易所	香港	60,000	520,694.97	0.52

74	China Petroleum & Chemical Corporation	中国石油 化工股份 有限公司	386 HK	香港证 券交易 所	香港	100,000	492,065.69	0.49
75	China Merchants Bank Co Ltd	招商银行	3968 HK	香港证 券交易 所	香港	30,000	487,950.23	0.48
76	Aluminum Corporation Of China Limited	中国铝业 股份有限 公司	2600 HK	香港证 券交易 所	香港	170,000	486,697.70	0.48
77	Grupo Financiero Banorte	Banorte 金融集团	GBOOY US	美国证 券交易 所	美国	2,482	428,030.38	0.42
78	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	150,000	417,361.17	0.41
79	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	400,988.80	0.40
80	Shanghai Electric Group Co Ltd	上海电气 集团	2727 HK	香港证 券交易 所	香港	100,000	310,448.72	0.31
81	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	10,000	285,845.43	0.28
82	Hsbc	汇丰控股	5 HK	香港证	香港	5,000	278,464.45	0.28

	Holdings Plc	有限公司		券交易所				
83	Huaneng Renewables Corporation Limited	华能新能源股份有限公司	958 HK	香港证券交易所	香港	100,000	225,455.55	0.22
84	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	20,000	219,729.70	0.22
85	Kingdee international software group (Hong Kong) co., Ltd	金蝶国际软件公司	268 HK	香港证券交易所	香港	50,000	130,621.07	0.13
86	Xinjiang Goldwind Science & technology CO.,Ltd.	新疆金风科技股份有限公司	2208 HK	香港证券交易所	香港	10,000	117,201.10	0.12
87	Cogobuy Group	科通芯城集团	400 HK	香港证券交易所	香港	10,000	104,675.79	0.10
88	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	4,000	58,332.15	0.06
89	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	12,000	26,303.15	0.03

注：此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

8.5 报告期内权益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	Guangzhou Automobile Group Co.,Ltd.	2238 HK	1,560,972.68	1.69
2	Union Pacific Corp	UNP US	1,391,702.11	1.51
3	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	1,303,170.25	1.41
4	Occidental Petroleum Corp	OXY US	1,236,804.52	1.34
5	CRCC High-Tech Equipment Corporation Limited	1786 HK	1,227,755.72	1.33
6	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	388 HK	1,206,569.52	1.31
7	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	1,196,762.25	1.30
8	Dow Chemical Co Ltd	DOW US	1,111,245.52	1.20
9	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	1,092,852.66	1.18
10	Colgate-Palmolive Co Ltd	CL US	1,056,721.83	1.15
11	T-Mobile US Inc	TMUS US	1,050,941.48	1.14
12	Hewlett Packard Enterprise Co Ltd	HPE US	1,049,118.28	1.14
13	Eaton Corp PLC	ETN US	1,039,979.95	1.13
14	Chinasoft International Ltd.	354 HK	976,557.68	1.06
15	LVMH Moet Hennessy Louis Vuitton	MC FP	974,143.06	1.06
16	Shire PLC	SHP LN	951,518.98	1.03
17	China State Construction International Holdings Limited	3311 HK	945,472.25	1.03
18	Ingersoll-Rand PLC	IR US	944,108.80	1.02
19	BASF SE	BAS GR	909,227.85	0.99

20	China Railway Signal & Communication Corporation Limited	3969 HK	881,907.90	0.96
----	--	---------	------------	------

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	3,159,636.82	3.43
2	Hong Kong Exchanges and Clearing Ltd	388 HK	2,093,818.70	2.27
3	Sinotruk Hong Kong Ltd	3808 HK	1,925,147.42	2.09
4	Agricultural Bank of China Ltd	1288 HK	1,605,074.37	1.74
5	Imperial Brands Plc	IMB LN	1,415,192.72	1.53
6	Diageo PLC	DGE LN	1,316,438.71	1.43
7	TCL Multimedia Technology Holdings Limited	1070 HK	1,296,328.76	1.41
8	ARM Holdings PLC	ARM LN	1,212,826.04	1.31
9	Vodafone Group PLC	VOD LN	1,131,909.49	1.23
10	Great Wall Motor Company Limited	2333 HK	1,089,415.90	1.18
11	Guangzhou Automobile Group Co.,Ltd.	2238 HK	1,083,165.99	1.17
12	Haitong Securities Co Ltd	6837 HK	1,019,606.42	1.11
13	Interpublic Group of Companies	IPG US	1,001,404.85	1.09
14	Intime Retail Group Co Ltd	1833 HK	913,745.43	0.99
15	Schneider Electric SE	SU FP	903,162.64	0.98
16	Shanghai Electric Group Co Ltd	2727 HK	901,632.11	0.98
17	BYD Company Limited	1211 HK	867,945.70	0.94
18	Safran SA	SAF FP	863,776.11	0.94
19	Sinosoft Technology Group Ltd	1297 HK	850,434.01	0.92
20	China Resources Land Limited	1109 HK	842,077.26	0.91

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	53,438,456.63
卖出收入（成交）总额	61,473,436.35

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。

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序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。

8.9 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。

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	1,101,594.65
3	应收股利	106,583.52
4	应收利息	767.18
5	应收申购款	1,405,575.37

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,614,520.72

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
4,937	12,430.64	25,305,622.04	41.23%	36,064,426.25	58.77%

9.2 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	0.11	0.00%

9.3 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、基金投资和研发部门负责人持有本开	0

开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 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	57,715,799.32
本报告期基金总申购份额	11,693,623.14
减：本报告期基金总赎回份额	8,039,374.17
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	61,370,048.29

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

本基金本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：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。经公司第四届董事会第十四次会议审议通过，印皓女士担任公司副总经理。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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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（特殊普通合伙），本期审计费为 40,000.00 元。自本基金合同生效以来，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

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

公司于 2016 年 1 月和 10 月接受来自上海证监局和中国证监会的现场检查，并于报告期内收到监管部门对公司相关负责人的警示。公司已认真落实整改要求，加强制度和风控措施，进一步提升了公司内部控制和风险管理能力，并向监管部门进行了报告。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。

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	
Barclays Capital Securities Limited London	-	182,483.41	0.16%	273.70	0.23%	-
UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited	-	33,716,864.20	29.34%	40,460.24	33.95%	-
CICC Hong	-	16,345,421.	14.22%	24,518.12	20.57%	-

Kong Securities Limited		35				
China Merchants Securities(HK)Co.Ltd.	-	11,711,060.36	10.19%	11,711.09	9.83%	-
Bocom International Securities Limited	-	11,496,507.96	10.00%	11,496.52	9.65%	-
Merrill Lynch International London	-	7,276,289.95	6.33%	4,623.18	3.88%	-
Instinet Europe Limited London	-	7,069,213.72	6.15%	1,902.03	1.60%	-
KCG Americas LLC New York	-	5,469,987.66	4.76%	6,201.20	5.20%	-
Investment Technology Group Ltd Dublin	-	5,451,975.89	4.74%	5,996.96	5.03%	-
UBS Securities LLC Stamford	-	2,254,472.76	1.96%	2,083.45	1.75%	-
Investment Technology Group Ltd Dublin (DMA)	-	2,137,510.10	1.86%	1,703.29	1.43%	-
Societe Generale London Branch	-	1,710,931.53	1.49%	1,073.75	0.90%	-
Morgan Stanley & Co. International Plc	-	1,415,192.72	1.23%	2,122.77	1.78%	-

London						
ITG Inc. New York (DMA)	-	1,275,382.0 8	1.11%	299.01	0.25%	-
ITG Inc. New York	-	1,245,799.6 1	1.08%	146.78	0.12%	-
Instinet Pacific Ltd Hong Kong	-	1,122,989.4 0	0.98%	336.63	0.28%	-
Merrill Lynch Pierce Fenner and Smith Inc. New York	-	790,139.74	0.69%	463.94	0.39%	-
JP Morgan Securities LLC New York	-	698,832.43	0.61%	147.14	0.12%	-
Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	-	648,097.01	0.56%	388.81	0.33%	-
Credit Suisse(Hon g Kong) Ltd	-	624,094.75	0.54%	936.15	0.79%	-
BOCI Securities Limited	-	529,519.25	0.46%	794.27	0.67%	-
Citigroup Global Markets Inc. NY (DTC418)	-	513,501.42	0.45%	336.28	0.28%	-
UBS Securities Asia Limited Hong Kong	-	498,468.65	0.43%	149.52	0.13%	-
Deutsche Bank AG London Branch	-	332,821.01	0.29%	499.27	0.42%	-
UBS	-	204,253.96	0.18%	224.68	0.19%	-

Limited London						
Jefferies International Limited London	-	190,082.01	0.17%	285.15	0.24%	-
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	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities(HONG KONG)Company Limited	-	-	-	-	-	-
Shenyin Wanguo Securities(H.K.)Ltd	-	-	-	-	-	-
Guosen Securities(HK) Brokerage Company, Limited	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Europe Limited London (International trades)	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Pierce Fenner and Smith Inc. New York	-	-	-	-	-	-
Jefferies and Company Inc New York	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
Imperial Capital LLC	-	-	-	-	-	-
Citigroup	-	-	-	-	-	-

Global Markets Limited London						
Deutsche Bank AG	-	-	-	-	-	-
Instinet LLC New York (DMA)	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International London	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Ltd	-	-	-	-	-	-
J.P. Morgan Securities plc London	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Securities Inc New York	-	-	-	-	-	-
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						
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						
HSBC Bank Plc London (equities)	-	-	-	-	-	-
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(A sia)Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas UK Ltd London	-	-	-	-	-	-
BRADESC O 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 Internationa l Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs JB Were Pty Ltd Melbourne	-	-	-	-	-	-
Guoyuan Securities Brokerage(Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Haitong Internationa l 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 Internationa l Limited	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Chase Bank - London (TRS)	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities (Asia Pacific) Korea	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities. (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
Lehman Brothers Internationa l (Europe)	-	-	-	-	-	-

LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-
T						
Liquidnet (International Trades)	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Australia Pty Ltd	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET EURO	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Inc New York (US\$ Trades)	-	-	-	-	-	-
Macquarie Equities New Zealand Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities(S ingapore)Pt e Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities HK	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Far East Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Fund Managers	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch London	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Singapore DMA	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi Securities Internationa l	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-
虚拟券商	-	-	-	-	-	-	-

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

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	成交金额	占当期回购成	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

		额的比例		交总额的 的比例		额的比例		额的比例
虚拟券商	-	-	-	-	15,41 7.31	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。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。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。

11.8 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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-03-01

	上电子交易平台基金前端申购费率优惠活动的公告		
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
19	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京恒天明泽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	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-01

	告		
20	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金在上海陆金所资产管理有限公司开通定期定额投资业务并参与其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	2016-07-01
21	交银施罗德环球精选价值证券投资基金2016年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-07-21
22	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京广源达信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其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	2016-07-22
23	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常熟农村商业银行股份有限公司网上交易平台、手机交易平台基金申购费率、定期定额投资费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-03
24	交银施罗德基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务(深圳)有限公司为旗下部分基金的场外销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-05
25	交银施罗德基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与基金前端申购(含定期定额投资)费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-19
26	交银施罗德环球精选价值证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-08-27
27	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	2016-09-02
28	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购(含定期定额投资业务)费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-09-20
29	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	2016-09-29
30	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2号)	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-09-30
31	交银施罗德环球精选价值证券投资基金2016年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-10-25

32	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京创金启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其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-02
33	交银施罗德基金管理有限公司关于增加日发资产管理（上海）有限公司为旗下部分基金的场外销售机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-09
34	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海云湾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其基金前端申购（含定期定额投资）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-11
35	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	2016-11-23
36	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-11-29
37	交银施罗德基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为旗下部分基金的场外销售机构并参与其基金前端（含定期定额投资）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	2016-12-14
38	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	2016-12-21
39	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参加交通银行股份有限公司手机银行基金前端申购（含定期定额投资业务）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-22
40	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农业银行股份有限公司基金交易费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2016-12-30

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

12.3 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。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一七年三月二十九日