

---

**交银施罗德全球自然资源证券投资基金**  
**2018 年年度报告摘要**  
**2018 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：二〇一九年三月二十七日

## § 1 重要提示

### 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 2019 年 3 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	交银全球资源混合(QDII)
基金主代码	519709
交易代码	519709
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 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	36,915,122.15 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在全球范围内精选自然资源相关行业的上市公司，通过积极主动的资产配置和组合管理，在有效控制组合下行风险的前提下力争实现资本的长期保值增值。
投资策略	通过对全球宏观经济、大宗商品价格和自然资源相关行业上市公司基本面的分析，根据宏观经济运行特点对不同自然资源类别相关资产价格或其所对应的大宗商品（如能源、贵金属、基本金属、农产品等）价格所产生的不同影响，利用基金管理人在大宗商品、自然资源及其相关产业等领域的专业研究，自上而下的选择明显受益于宏观经济运行特征的自然资源类别进行投资，同时在该资源类别内自下而上精选证券，挖掘定价合理、具备持续竞争优势、明显受益于相关资源价格上涨的上市公司股票进行投资，在有效控制下行风险的前提下，优化组合收益，构建具有长期投资价值的投资组合，实现资产的保值增值。
业绩比较基准	MSCI 全球原材料总收益指数收益率×65%+MSCI 全球能源总收益指数收益率×35%
风险收益特征	本基金为主要投资全球范围内自然资源相关行业上市公司的主动混合型基金，基金所投之标的与全球经济景气度、大宗商品市场表现及各相关产业联动性相对较高，

	波动性较大，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。
--	--

### 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	王晚婷	田青
	联系电话	(021) 61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	tianqing1.zh@ccb.com
客户服务电话		400-700-5000, 021-61055000	010-67595096
传真		(021) 61055054	010-66275853

### 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

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§ 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	2018 年	2017 年	2016 年
本期已实现收益	2,886,517.38	5,970,171.53	-6,907,119.21
本期利润	-11,326,386.48	10,700,569.59	1,926,796.63
加权平均基金份额本期利润	-0.3197	0.3136	0.0723
本期基金份额净值增长率	-13.57%	27.95%	7.44%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末	2017 年末	2016 年末
期末可供分配基金份额利润	-0.106	-0.198	-0.391
期末基金资产净值	50,106,057.32	49,394,717.90	39,335,885.59
期末基金份额净值	1.357	1.570	1.227

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	-13.35%	1.73%	-16.99%	1.18%	3.64%	0.55%
过去六个月	-21.29%	1.63%	-17.62%	0.99%	-3.67%	0.64%
过去一年	-13.57%	1.57%	-18.48%	0.96%	4.91%	0.61%
过去三	18.83%	1.17%	16.23%	0.93%	2.60%	0.24%

年						
过去五年	9.63%	1.44%	-15.48%	0.99%	25.11%	0.45%
自基金合同生效起至今	38.24%	1.32%	1.11%	0.98%	37.13%	0.34%

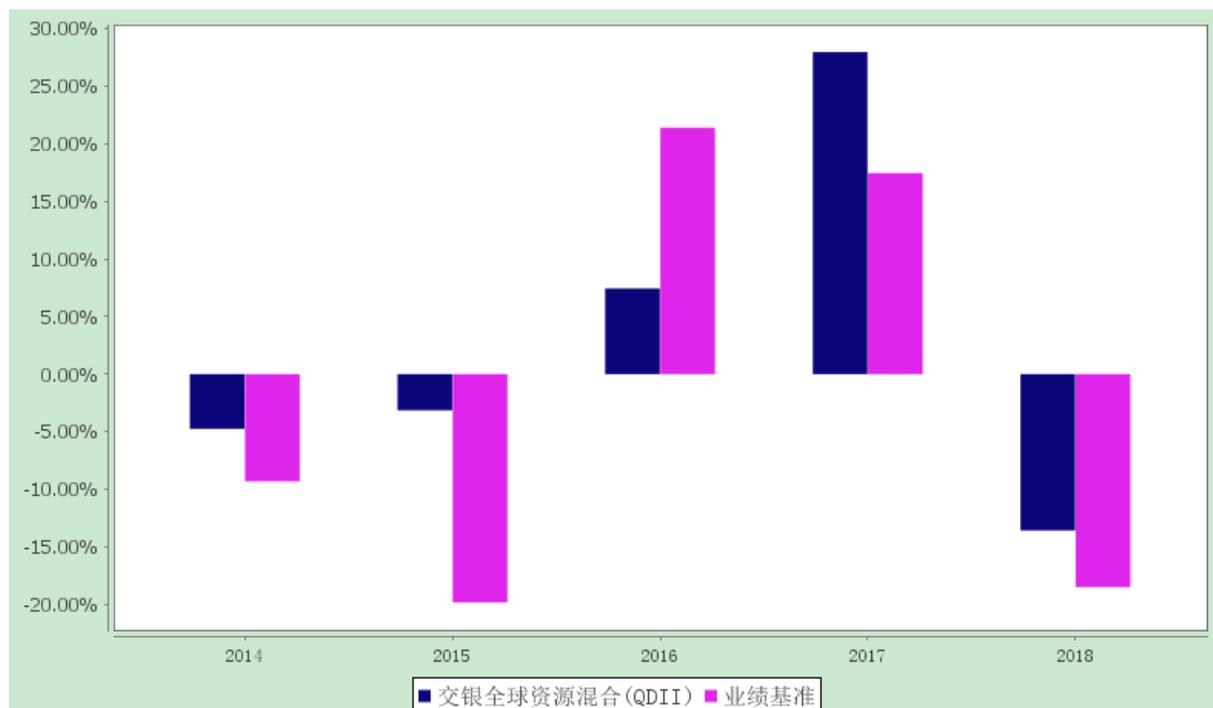
注：本基金的业绩比较基准为 MSCI 全球原材料总收益指数收益率×65%+MSCI 全球能源总收益指数收益率×35%，每日进行再平衡过程。

### 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
2018 年	-	-	-	-	-
2017 年	-	-	-	-	-
2016 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

## § 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。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 77 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		
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，公司跨境投资副总监	2015-11-21	-	13 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)、交银创新成长混合的基金经理	2015-12-12	-	9 年	周中先生，中国国籍，复旦大学金融学硕士。历任野村证券亚太区股票研究部研究助理，中银国际证券研究部研究员、高级经理，瑞银证券研究部行业分析师、董事。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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

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

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

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所 任职务	证券从业年限	说明
Simon Webber	施罗德集团多区域 （全球及国际）股	19 年	Simon Webber 先生，英国曼彻斯特大学

	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		物理学学士，CFA。1999 年加入施罗德投资管理有限公司，历任全球技术团队分析员。
--	--------------------------------	--	--

### 4.3 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内，本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定，并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定，为基金持有人谋求最大利益。

### 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

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

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

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

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

#### 4.4.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，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出现异常。

### 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

2018 年全年全球经济出现明显分化，海外股票市场的市场波动显著加大。港股市场受到美国加息，中美贸易战和中国经济降温的利空影响，出现了比较大的波动。美股市场在 2018 年四季度出现了大幅回调，投资者开始预期美国经济增长将在 2019 年放缓，从而开始抛售股票。十二月美联储继续加息使得整个市场继续承压，港股市场也受到相应的压力。

我们总体保持相对较低仓位，在行业配置方面，我们降低了前期超额收益较高的石油石化板块的配置，同时继续降低对消费品板块的配置。

#### 4.5.2 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要会计数据和财务指标”及“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”部分披露。

#### 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 2019 年，我们维持相对谨慎的态度。海外风险可能在 2019 年加大，贸易战对全球经济的负面影响将在未来几个季度显现。我们将继续坚持自下而上精选个股的投资策略，寻找能够穿越经济周期的优质个股，力求为投资者创造持续回报。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值，保证基金估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性、适用性的情况后，及时召开临时会议进行研究，及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内曾连续二十个工作日以上出现基金资产净值低于 5000 万元的情形，截至本报告期末，本基金基金资产净值已高于 5000 万元。

## § 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合规守信、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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）对交银施罗德全球自然资源证券投资基金 2018 年 12 月 31 日的资产负债表，2018 年度的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2019)第 21528 号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德全球自然资源证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	8,401,304.81	9,392,056.09

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	37,161,167.11	41,852,409.42
其中：股票投资		37,161,167.11	41,852,409.42
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		4,811,457.04	-
应收利息	7.4.7.5	885.56	1,585.33
应收股利		17,640.00	12,500.00
应收申购款		23,965.50	55,148.03
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		50,416,420.02	51,313,698.87
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2018 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2017 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	1,195,513.82
应付赎回款		164,904.07	587,201.44
应付管理人报酬		79,444.03	75,005.42
应付托管费		15,447.44	14,584.40
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	50,567.16	46,675.89
负债合计		310,362.70	1,918,980.97
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	36,915,122.15	31,462,505.96
未分配利润	7.4.7.10	13,190,935.17	17,932,211.94
所有者权益合计		50,106,057.32	49,394,717.90
负债和所有者权益总计		50,416,420.02	51,313,698.87

注：1、报告截止日 2018 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.357 元，基金份额总额 36,915,122.15 份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为年度报告正文中对应的附注号，投资者欲了解相应附注的内容，应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

## 7.2 利润表

会计主体：交银施罗德全球自然资源证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日 至 2017 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		<b>-9,706,382.43</b>	<b>12,123,064.22</b>
1.利息收入		42,528.10	40,387.25
其中：存款利息收入	7.4.7.11	42,528.10	40,387.25
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）		4,201,064.14	7,714,342.78
其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,189,670.18	6,570,499.69
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	-	-
股利收益	7.4.7.17	1,011,393.96	1,143,843.09
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-14,212,903.86	4,730,398.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		185,963.93	-440,606.73
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	76,965.26	78,542.86
<b>减：二、费用</b>		<b>1,620,004.05</b>	<b>1,422,494.63</b>
1. 管理人报酬		1,008,360.62	865,660.48
2. 托管费		196,070.06	168,322.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	354,091.99	338,723.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.21	61,481.38	49,788.13
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-11,326,386.48</b>	<b>10,700,569.59</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-11,326,386.48</b>	<b>10,700,569.59</b>

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德全球自然资源证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 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）	31,462,505.96	17,932,211.94	49,394,717.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-11,326,386.48	-11,326,386.48

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）	5,452,616.19	6,585,109.71	12,037,725.90
其中：1.基金申购款	42,073,457.76	29,071,332.46	71,144,790.22
2.基金赎回款	-36,620,841.57	-22,486,222.75	-59,107,064.32
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）	36,915,122.15	13,190,935.17	50,106,057.32
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 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）	32,063,310.06	7,272,575.53	39,335,885.59
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,700,569.59	10,700,569.59
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）	-600,804.10	-40,933.18	-641,737.28
其中：1.基金申购款	57,357,585.54	24,883,182.21	82,240,767.75
2.基金赎回款	-57,958,389.64	-24,924,115.39	-82,882,505.03
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）	31,462,505.96	17,932,211.94	49,394,717.90

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：谢卫，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

交银施罗德全球自然资源证券投资基金(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[2011]第 1628 号《关于核准交银施罗德全球自然资源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《交银施罗德全球自然资源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 628,260,071.31 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(2012)第 139 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 628,520,198.14 份基金份额，其中认购资金利息折合 260,126.83 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《交银施罗德全球自然资源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)，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、存托凭证、权证、股票基金(含 ETF)等权益类证券占基金资产净值的 60%-100%，其中权益类资产中不低于 80%配置于自然资源相关行业股票；债券、货币市场工具、现金及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的 0%-40%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：MSCI 全球原材料总收益指数收益率×65%+MSCI 全球能源总收益指数收益率×35%。

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 2019 年 3 月 25 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》、《交银施罗德全球自然资源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。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2018 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 2018 年 12 月 31 日的财务状况以及 2018 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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[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》、财税[2016]140 号《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[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作, 主要税项列示如下:

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 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。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.8.1 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。

### 7.4.8.2 关联方报酬

#### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,008,360.62	865,660.48
其中：支付销售机构的客户维护费	313,987.14	293,280.79

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.80%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×1.80%÷当年天数。

#### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	196,070.06	168,322.85

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。

#### 7.4.8.2.3 销售服务费

无。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.8.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末2018年12月31日		上年度末2017年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
交银施罗德资产管理有限公司	5,114,450.13	13.85%	5,114,450.13	16.26%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

#### 7.4.8.5 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 2018年1月1日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017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	3,785,603.81	42,407.61	6,870,954.31	38,953.30
摩根大通银行	4,615,701.00	6.13	2,521,101.78	-

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。

#### 7.4.8.6 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的证券。

#### 7.4.8.7 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。

#### 7.4.9 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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。

#### 7.4.9.2 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。

#### 7.4.9.3 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。

#### 7.4.10 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 2018 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资产中属于第一层次的余额为 37,161,167.11 元，无属于第二或第三层次的余额 (2017 年 12 月 31 日：第一层次 41,852,409.42 元，无第二或第三层次)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

本基金本期及上年度可比期间持有的公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变化。

##### (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 2018 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 (2017 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	37,161,167.11	73.71
	其中：普通股	37,161,167.11	73.71
	存托凭证	-	-
	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	8,401,304.81	16.66
8	其他各项资产	4,853,948.10	9.63
9	合计	50,416,420.02	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 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 (%)
香港	37,161,167.11	74.17
合计	37,161,167.11	74.17

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（%）
材料	6,529,554.33	13.03
保健	6,348,104.76	12.67
非必需消费品	4,579,190.72	9.14
能源	4,249,601.19	8.48
必需消费品	3,515,913.86	7.02
信息技术	3,318,686.08	6.62
金融	3,212,095.42	6.41
公共事业	2,131,409.92	4.25
工业	2,042,403.22	4.08
房地产	1,234,207.61	2.46
合计	37,161,167.11	74.17

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前十名权益投资明细

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	China Shenhua Energy Company Limited	中国神华能源股份有限公司	1088 HK	香港证券交易所	香港	150,000	2,256,285.78	4.50
2	Sun Art Retail Group Limited	高鑫零售有限公司	6808 HK	香港证券交易所	香港	300,000	2,098,503.56	4.19
3	China Conch Venture Holdings Limited	中国海螺创业控股有限公司	586 HK	香港证券交易所	香港	100,000	2,042,403.22	4.08
4	Shandong	山东威高	1066 HK	香港证	香港	350,000	1,945,104.18	3.88

	g Weigao Group Medical Polymer Company Limited	集团医用高分子制品股份有限公司		券交易所				
5	AK Medical Holdings Limited	爱康医疗控股有限公司	1789 HK	香港证券交易所	香港	500,000	1,902,152.35	3.80
6	Hong Kong Exchanges And Clearing Limited	香港交易及结算有限公司	388 HK	香港证券交易所	香港	9,000	1,787,672.58	3.57
7	China Xinhua Education Group Limited	中国新华教育集团有限公司	2779 HK	香港证券交易所	香港	1,000,000	1,691,776.05	3.38
8	Anhui Conch Cement Company Limited	安徽海螺水泥股份有限公司	914 HK	香港证券交易所	香港	50,000	1,665,479.02	3.32
9	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	呷哺呷哺餐饮管理有限公司(中国)控股有限公司	520 HK	香港证券交易所	香港	150,000	1,625,156.89	3.24
10	MMG Limited	五矿资源有限公司	1208 HK	香港证券交易所	香港	550,000	1,624,718.61	3.24

注：1、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

2、投资者欲了解本报告期末基金投资的所有权益明细，应阅读登载于基金管理人

网站的年度报告正文。

## 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	China Education Group Holdings Limited	839 HK	3,925,083.44	7.95
2	China Xinhua Education Group Limited	2779 HK	3,887,179.43	7.87
3	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	3,375,974.96	6.83
4	China Conch Venture Holdings Limited	586 HK	3,094,632.05	6.27
5	Wisdom Education International Holdings Company Limited	6068 HK	2,960,659.21	5.99
6	China National Building Material Company Limited	3323 HK	2,841,799.15	5.75
7	Lee's Pharmaceutical Holdings Limited	950 HK	2,821,204.69	5.71
8	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	2,792,262.95	5.65
9	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	2,653,480.41	5.37
10	Sun Art Retail Group Limited	6808 HK	2,609,968.23	5.28
11	Shandong Weigao Group Medical Polymer Company Limited	1066 HK	2,299,193.13	4.65
12	MMG Limited	1208 HK	2,263,918.02	4.58
13	AK Medical Holdings Limited	1789 HK	2,251,741.15	4.56
14	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	2,071,188.21	4.19
15	ZTE Corporation	763 HK	1,991,750.60	4.03

16	Kingsoft Corporation Ltd.	3888 HK	1,990,362.49	4.03
17	China Tian Lun Gas Holdings Limited	1600 HK	1,986,491.71	4.02
18	Anhui Conch Cement Company Limited	914 HK	1,928,663.86	3.90
19	Xiabuxiabu Catering Management (China) Holdings Co., Ltd.	520 HK	1,927,067.98	3.90
20	A-Living Services Co., Ltd.	3319 HK	1,812,008.22	3.67
21	Huadian Power International Corporation Limited	1071 HK	1,541,781.79	3.12
22	Genscript Biotech Corporation	1548 HK	1,491,020.38	3.02
23	Xiaomi Corporation	1810 HK	1,485,109.85	3.01
24	AIA Group Limited	1299 HK	1,478,095.71	2.99
25	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	6869 HK	1,460,899.93	2.96
26	Hua Hong Semiconductor Limited	1347 HK	1,424,246.29	2.88
27	CRRC Corporation Limited	1766 HK	1,374,218.53	2.78
28	Yanzhou Coal Mining Company Limited	1171 HK	1,307,371.93	2.65
29	China Resources Beer (Holdings) Company Limited	291 HK	1,225,909.24	2.48
30	Tianli Education International Holdings Limited	1773 HK	1,163,573.50	2.36
31	Sunac China Holdings Limited	1918 HK	1,066,236.00	2.16
32	Semiconductor Manufacturing International Corporation	981 HK	1,066,204.45	2.16
33	Tong Ren Tang Technologies Co.,Ltd.	1666 HK	1,025,668.86	2.08

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	Tencent Holdings Limited	700 HK	3,844,302.42	7.78
2	China Education Group Holdings Limited	839 HK	3,202,000.61	6.48
3	Wisdom Education International Holdings Company Limited	6068 HK	3,072,409.25	6.22
4	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	2,795,301.87	5.66
5	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	2,660,489.93	5.39
6	Shenzhou International Group Holdings Ltd.	2313 HK	2,562,389.27	5.19
7	China Mengniu Dairy Company Limited	2319 HK	2,551,075.14	5.16
8	China National Building Material Company Limited	3323 HK	2,453,597.00	4.97
9	China Oriental Group Company Limited	581 HK	2,353,157.47	4.76
10	China Tian Lun Gas Holdings Limited	1600 HK	2,280,802.92	4.62
11	Yangtze Optical Fibre and Cable Joint Stock Limited Company	6869 HK	2,181,235.82	4.42
12	China Molybdenum Co.,Ltd.	3993 HK	2,150,364.14	4.35
13	Lee's Pharmaceutical Holdings Limited	950 HK	1,952,423.40	3.95
14	Xinyi Glass Holdings Ltd.	868 HK	1,853,956.74	3.75
15	ZTE Corporation	763 HK	1,831,459.12	3.71
16	Cosco Shipping Holdings Co.,Ltd.	1919 HK	1,759,103.88	3.56
17	Geely Automobile Holdings Limited	175 HK	1,622,011.68	3.28
18	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	1,609,186.72	3.26
19	Yanzhou Coal Mining Company Limited	1171 HK	1,540,830.12	3.12
20	Ping An Insurance (Group) Company Of China,Ltd.	2318 HK	1,479,606.18	3.00
21	Tingyi (Cayman Islands) Holding Corp.	322 HK	1,402,696.82	2.84
22	A-Living Services Co., Ltd.	3319 HK	1,295,028.27	2.62
23	Aluminum Corporation Of China Limited	2600 HK	1,280,786.76	2.59
24	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	1,261,624.29	2.55
25	Kingsoft Corporation Ltd.	3888 HK	1,255,810.35	2.54
26	Tianli Education International Holdings Limited	1773 HK	1,192,342.85	2.41
27	CRRC Corporation Limited	1766 HK	1,156,387.70	2.34
28	Semiconductor Manufacturing International Corporation	981 HK	1,111,745.17	2.25
29	China Taiping Insurance Holdings Company	966 HK	1,111,353.29	2.25

	Limited			
30	AAC Technologies Holdings Inc.	2018 HK	1,050,338.01	2.13
31	Genscript Biotech Corporation	1548 HK	1,032,994.60	2.09
32	Zhaojin Mining Industry Company Limited	1818 HK	1,008,782.88	2.04

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	80,669,760.55
卖出收入（成交）总额	74,337,769.18

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前十名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	4,811,457.04
3	应收股利	17,640.00
4	应收利息	885.56
5	应收申购款	23,965.50
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,853,948.10

### 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
4,334	8,517.56	5,213,282.36	14.12%	31,701,839.79	85.88%

## 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	30,612.77	0.08%

## 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放式基金	0
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(2012年5月22日)基金份额总额	628,520,198.14
本报告期期初基金份额总额	31,462,505.96
本报告期基金总申购份额	42,073,457.76
减：本报告期基金总赎回份额	36,620,841.57
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	36,915,122.15

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：

(1) 本基金管理人于 2018 年 6 月 30 日发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并于 2018 年 9 月 28 日发布公告，经公司第四届董事会第三十三次会议审议通过，同意余川女士担任公司督察长职务；

(2) 本基金管理人于 2018 年 10 月 20 日发布公告，经公司第五届董事会第一次会议审议通过，选举阮红女士担任公司董事长（法定代表人），并于 2019 年 2 月 28 日发布公告，经公司第五届董事会第五次会议审议通过，选举谢卫先生担任公司总经理，阮红女士不再担任公司总经理。期后变动敬请关注基金管理人发布的相关公告。

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），本期审计费用为 30,000.00 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

基金管理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。

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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited	-	83,823,991.12	54.08%	100,588.82	53.77%	-
China Merchants Securities(HK) Co.Ltd.	-	40,555,281.56	26.16%	40,555.42	21.68%	-
Shenyin Wanguo Securities(H.K.)Ltd	-	25,801,569.70	16.65%	38,702.36	20.69%	-
CICC Hong Kong Securities Limited	-	4,826,687.35	3.11%	7,240.03	3.87%	-
ABS Sundal Collier	-	-	-	-	-	-
Banco Di Investimentos CSFB Garantia SA	-	-	-	-	-	-
BOCI Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Bocom International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs (ASIA) Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-
Guosen Securities(HK) Brokerage Company, Limited	-	-	-	-	-	-
Macquarie	-	-	-	-	-	-

Bank Limited						
CCB International Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Barclays Capital Group	-	-	-	-	-	-
BRADESCO SEC	-	-	-	-	-	-
BSCH New York	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Australia Pty	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Ltd	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets New York	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets UK Equity	-	-	-	-	-	-
CORMARK SEC	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse First Boston (Seoul) Ltd	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	-	-	-	-	-	-
CSFB Singapore Secs PTE Limited	-	-	-	-	-	-
DB UK Bank Ltd London	-	-	-	-	-	-
DBS Vickers Securities (Singapore) Pte	-	-	-	-	-	-

Deutsche Securities Asia Ltd	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Australia Ltd Sydney	-	-	-	-	-	-
Evolution Group Plc	-	-	-	-	-	-
Exane Ltd London	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Company New York	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs Execution and Clearing DMA	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs International Ltd London	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs JB Were Pty Ltd Melbourne	-	-	-	-	-	-
Guoyuan Securities Brokerage (HongKong) Ltd.	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
HSBC Bank Plc London (equities)	-	-	-	-	-	-
HSBC Securities Inc	-	-	-	-	-	-
ICAP CORP LLC	-	-	-	-	-	-
Instinet Corporation	-	-	-	-	-	-
Instinet Corporation	-	-	-	-	-	-

New York(DMA)						
Instinet Europe Limited London	-	-	-	-	-	-
Investec Securities London	-	-	-	-	-	-
Investment Technology Group Ltd Dublin	-	-	-	-	-	-
ITG Australia Ltd Melbourne	-	-	-	-	-	-
ITG Europe Ltd	-	-	-	-	-	-
ITG Inc. New York	-	-	-	-	-	-
ITG Ltd - Hong Kong	-	-	-	-	-	-
J P Morgan Securities Ltd London	-	-	-	-	-	-
J. & E.Davy	-	-	-	-	-	-
Jefferies & Co Inc	-	-	-	-	-	-
Jefferies Intl Ltd London	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Secs (Asia Pacific) Korea	-	-	-	-	-	-
JP MORGAN Securities (Asia Pacific) Ltd.Hong Kong	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Inc N.Y.	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities Ltd	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Australia Pty Ltd	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-

EURO						
Liquidnet Inc New York	-	-	-	-	-	-
Macquarie Equities Ltd (Sydney)	-	-	-	-	-	-
Macquarie Equities New Zealand Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities(Sing apore)Pte Ltd	-	-	-	-	-	-
MACSECS HK	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Far East Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch London	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Pierce Fenner Smith NY	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Singapore DMA	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi Securities International	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd (HongKong)	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Co (Tokyo)	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. Intl Ltd ( Seoul )	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Co. New York	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley International Ltd	-	-	-	-	-	-

Morgan Stanley International Plc London	-	-	-	-	-	-
Nomura International Ltd London	-	-	-	-	-	-
Oriental Patron Securities Limited	-	-	-	-	-	-
Panmure Gordon Limited	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIES LIMITED	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets Corporation New York	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets Inc Toronto	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
State Street Global Markets LLC (DMA)	-	-	-	-	-	-
UBS Securities LLC Stamford	-	-	-	-	-	-
UBS Securities Singapore Ltd	-	-	-	-	-	-
WALL ST ACCESS	-	-	-	-	-	-
CLSA Ltd	-	-	-	-	-	-
NOMURA INTERNATIONAL PLC.	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley Hong Kong	-	-	-	-	-	-
ABN Amro Australia Limited	-	-	-	-	-	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。请投资者关注基金合同中“对持续持有期少于 7 日的基金份额持有人收取不低于 1.5%的赎回费并全额计入基金财产”的条款已于 2018 年 3 月 31 日起正式实施。欲知详情请查阅本基金管理人于 2018 年 3 月 22 日发布的有关公告及法律文件。

交银施罗德基金管理有限公司  
二〇一九年三月二十七日