
交银施罗德全球精选价值证券投资基金
2019 年半年度报告
2019 年 6 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一九年八月二十九日

§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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
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 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介	10
4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布	35
7.3 期末按行业分类的权益投资组合	36
7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细	37
7.5 报告期内权益投资组合的重大变动	44
7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细	46
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	47

7.11 投资组合报告附注	47
§8 基金份额持有人信息	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	48
§9 开放式基金份额变动	48
§10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	49
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	49
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	49
10.9 其他重大事件	64
11 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德全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	60,003,232.74 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

		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
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区银城中路188号交通银行大楼二层（裙）	北京市西城区金融大街25号
办公地址		上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21-22楼	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		200120	100033
法定代表人		阮红	田国立

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

2.6 其他相关资料

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

	公司	
--	----	--

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	1,973,244.28
本期利润	15,870,812.21
加权平均基金份额本期利润	0.2583
本期加权平均净值利润率	13.80%
本期基金份额净值增长率	14.96%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	44,610,086.35
期末可供分配基金份额利润	0.743
期末基金资产净值	118,978,152.90
期末基金份额净值	1.983
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	167.93%

注：1、 本基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后的实际收益水平要低于所列数字；

2、 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	5.14%	0.60%	6.35%	0.65%	-1.21%	-0.05%

过去三个月	5.03%	0.59%	1.66%	0.62%	3.37%	-0.03%
过去六个月	14.96%	0.63%	13.54%	0.65%	1.42%	-0.02%
过去一年	8.78%	0.77%	2.43%	0.77%	6.35%	0.00%
过去三年	43.43%	0.65%	33.47%	0.62%	9.96%	0.03%
自基金合同生效起至今	167.93%	0.92%	59.81%	1.07%	108.12%	-0.15%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德环球精选价值证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2008 年 8 月 22 日至 2019 年 6 月 30 日)



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128 号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱（集团）股份有限公司共同发起设立。公司成立于 2005 年 8 月 4 日，注册地在中国上海，注册资本为 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、普通混合型和股票型在内的 80 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、交银核心资产混合的基金经理，公司跨境投资副总监	2015-11-21	-	14 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	-	10 年	周中先生，中国国籍，复旦大学金融学硕士。历任野村证券亚太区股票研究部研究助理，中银国际证券研究部研究员、高级经理，瑞银证券研究部行业分析师、董事。2015 年加入交银施罗德基金管理有限公司。

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

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

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

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名	在境外投资顾问所任职务	证券从业年限	说明
Simon Webber	施罗德集团多区域（全球及国际）股票投资主管、全球和国际股票基金经理、全球气候变化股票基金经理	20 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

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，基金整体运作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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.4.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内未发现异常交易行为。本报告期内，本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日总成

交易 5%的情况有 1 次，是投资组合因投资策略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

2019 年上半年，全球股市都经历了流动性增加带动市场大涨，到贸易摩擦、预计经济增速放缓，带来风险偏好迅速回落的过程。投资者预期的剧烈变化带动一季度资金流入股市，新兴市场跑赢发达国家市场。二季度，资金流出股市，发达国家市场跑赢新兴市场。此外，发生的贸易摩擦分歧、美国科技股公司业绩波动，其他国家降息等因素，进一步加剧了股市的短期波动。目前，投资者预期回落到一个比较谨慎的阶段。美联储降息预期再次提升，欧美部分长期债券收益率都创了几年较低水平。回顾上半年，市场的波动超出了我们的预期，让我们较以往面临了更多的短期业绩挑战和回撤管理挑战。

回顾上半年操作，我们以防御性为主。欧美市场，我们不断优化、增加仓位到消费、医疗领域，增加对于细分龙头的配置，而减少了工业、资源类股票的配置。港股市场，我们对于地产板块仍是超配，主要考虑其较低的估值和业绩锁定程度高。此外，我们择机增加了部分科技龙头。

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 年下半年，我们关注美联储降息进程，这会对海外股市的流动性产生较大影响。香港方面，我们相对更为乐观，对于大多数中国企业，伴随时间加长，贸易摩擦带来的影响，边际在减弱，而“减税降费”的实质性收益将逐步体现。我们会密切关注港股的中报情况。具体操作方面，我们仍坚持优选龙头，我们认为，在经济压力仍在的大背景下，行业龙头和财务稳健的公司有机会获取更多市场份额，提升自身竞争优势，从而有机会为投资者带来更多收益。我们将继续勤勉尽责地积极调研，努力为投资人赚取回报。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

估值委员会会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况后，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。

4.8 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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

报告截止日：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	15,743,226.23	18,195,744.60
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	102,840,332.38	91,423,894.33
其中：股票投资		102,840,332.38	91,423,894.33
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,311,923.82	-
应收利息	6.4.7.5	743.79	1,455.39
应收股利		322,792.53	139,325.51
应收申购款		146,655.47	181,562.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		120,365,674.22	109,941,981.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,102,088.34	1,130,445.18
应付管理人报酬		173,248.51	169,760.24
应付托管费		33,687.23	33,008.93
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	-	-
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	78,497.24	73,438.87
负债合计		1,387,521.32	1,406,653.22
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	60,003,232.74	62,907,239.77
未分配利润	6.4.7.10	58,974,920.16	45,628,089.00
所有者权益合计		118,978,152.90	108,535,328.77
负债和所有者权益总计		120,365,674.22	109,941,981.99

注：报告截止日 2019 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.983 元，基金份额总额 60,003,232.74 份。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2019 年 1 月 1 日 至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入		17,275,608.00	2,309,992.18
1.利息收入		32,715.67	17,678.80
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,715.67	17,678.80
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）		3,349,243.14	9,917,543.59
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,107,735.88	8,869,845.60
基金投资收益	6.4.7.13	-	-
债券投资收益	6.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,241,507.26	1,047,697.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	13,897,567.93	-7,837,477.99
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-33,170.92	196,422.49
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	29,252.18	15,825.29
减：二、费用		1,404,795.79	1,486,965.13
1. 管理人报酬		1,026,198.16	1,045,993.66
2. 托管费		199,538.52	203,387.62
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	102,195.86	156,046.01
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	6.4.7.21	76,863.25	81,537.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		15,870,812.21	823,027.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		15,870,812.21	823,027.05

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：交银施罗德环球精选价值证券投资基金

本报告期：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	62,907,239.77	45,628,089.00	108,535,328.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,870,812.21	15,870,812.21
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)	-2,904,007.03	-2,523,981.05	-5,427,988.08
其中: 1.基金申购款	7,131,787.85	6,185,287.14	13,317,074.99
2.基金赎回款	-10,035,794.88	-8,709,268.19	-18,745,063.07
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)	60,003,232.74	58,974,920.16	118,978,152.90
项目	上年度可比期间		
	2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	64,619,702.83	56,519,968.29	121,139,671.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	823,027.05	823,027.05
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,419,984.24	-826,180.15	-2,246,164.39
其中: 1.基金申购款	8,923,091.33	7,492,967.34	16,416,058.67
2.基金赎回款	-10,343,075.57	-8,319,147.49	-18,662,223.06
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)	-	-4,514,582.50	-4,514,582.50

以“-”号填列)			
五、期末所有者权益 (基金净值)	63,199,718.59	52,002,232.69	115,201,951.28

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：谢卫，主管会计工作负责人：夏华龙，会计机构负责人：单江

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德环球精选价值证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2008]第 635 号《关于核准交银施罗德环球精选价值证券投资基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 508,068,907.66 元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第 130 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》于 2008 年 8 月 22 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 508,425,627.85 份基金份额，其中认购资金利息折合 356,720.19 份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司，境外资产托管人为摩根大通银行（JPMorgan & Chase Bank, N.A.），境外投资顾问为施罗德投资管理有限公司（Schroder Investment Management Limited）。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证

监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2019 上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2019 年 6 月 30 日的财务状况以及 2019 上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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 日前取得的基金、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基金份额净值、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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
活期存款	15,743,226.23
定期存款	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	15,743,226.23

注：于 2019 年 6 月 30 日，活期存款中包括的外币余额为美元活期存款 1,666,723.50(折合人民币 11,458,224.05 元)，港币活期存款 218,229.90(折合人民币 192,078.94 元)和加元活期存款 0.01（折合人民币 0.05 元）。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		78,043,338.61	102,840,332.38	24,796,993.77
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		78,043,338.61	102,840,332.38	24,796,993.77

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日
应收活期存款利息	743.69
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	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	0.10
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	743.79

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

本基金本报告期末无应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,635.98
预提审计费	19,835.79
预提信息披露费	56,025.47
合计	78,497.24

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	62,907,239.77	62,907,239.77
本期申购	7,131,787.85	7,131,787.85
本期赎回（以“-”号填列）	-10,035,794.88	-10,035,794.88
本期末	60,003,232.74	60,003,232.74

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	44,741,984.15	886,104.85	45,628,089.00
本期利润	1,973,244.28	13,897,567.93	15,870,812.21
本期基金份额交易产生的变动数	-2,105,142.08	-418,838.97	-2,523,981.05
其中：基金申购款	5,166,816.61	1,018,470.53	6,185,287.14
基金赎回款	-7,271,958.69	-1,437,309.50	-8,709,268.19

本期已分配利润	-	-	-
本期末	44,610,086.35	14,364,833.81	58,974,920.16

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,710.33
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	5.34
合计	32,715.67

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	39,334,793.23
减：卖出股票成本总额	37,227,057.35
买卖股票差价收入	2,107,735.88

6.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.14 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2019年1月1日至2019年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,241,507.26
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,241,507.26

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
1.交易性金融资产	13,897,567.93
——股票投资	13,897,567.93
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	13,897,567.93

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
基金赎回费收入	29,252.18
合计	29,252.18

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25% 归入基金资产。

6.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月30日
----	----------------------------

交易所市场交易费用	102,195.86
银行间市场交易费用	-
合计	102,195.86

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2019年1月1日至2019年6月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	56,025.47
银行汇划费用	675.00
其他	326.99
合计	76,863.25

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

无。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,026,198.16	1,045,993.66
其中：支付销售机构的客户维护费	156,103.00	158,471.58

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.8%÷当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至 2019年6月30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	199,538.52	203,387.62

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

日托管费=前一日基金资产净值×0.35%÷当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

无。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2019年1月1日至2019年6月 30日	2018年1月1日至2018年6月 30日
报告期初持有的基金份额	27,024,464.49	26,054,355.51
报告期间申购/买入总份额	-	970,108.98
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	27,024,464.49	27,024,464.49
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	45.04%	42.76%

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未持有本基金。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2019年1月1日至2019年6月 30日		2018年1月1日至2018年6月 30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	4,092,975.03	16,370.37	5,154,491.03	17,266.07
摩根大通银行	11,650,251.20	16,339.96	7,494,005.11	406.52

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2019 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。

6.4.13.2 信用风险

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

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种的信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有信用类债券(2018 年 12 月 31 日：无)。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于 2019 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个半月以内且不计息，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。

注：流动性受限资产、7 个工作日可变现资产的计算口径见《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》第四十条。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月

1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理, 通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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%。本基金所持部分证券在证券交易所上市, 其余亦可在银行间同业市场交易。此外, 本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求, 其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算, 确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

同时, 本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度; 按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理, 以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外, 本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度: 根据质押品的资质确定质押率水平; 持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额; 并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时, 可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施, 本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2019年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,743,226.23	-	-	-	15,743,226.23
交易性金融资产	-	-	-	102,840,332.38	102,840,332.38
应收证券清算款	-	-	-	1,311,923.82	1,311,923.82
应收利息	-	-	-	743.79	743.79
应收股利	-	-	-	322,792.53	322,792.53
应收申购款	1,359.17	-	-	145,296.30	146,655.47
资产总计	15,744,585.40	-	-	104,621,088.82	120,365,674.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,102,088.34	1,102,088.34
应付管理人报酬	-	-	-	173,248.51	173,248.51
应付托管费	-	-	-	33,687.23	33,687.23
其他负债	-	-	-	78,497.24	78,497.24
负债总计	-	-	-	1,387,521.32	1,387,521.32
利率敏感度缺口	15,744,585.40	-	-	103,233,567.50	118,978,152.90
上年度末 2018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	18,195,744.60	-	-	-	18,195,744.60
交易性金融资产	-	-	-	91,423,894.33	91,423,894.33
应收利息	-	-	-	1,455.39	1,455.39
应收股利	-	-	-	139,325.51	139,325.51
应收申购款	99.85	-	-	181,462.31	181,562.16
资产总计	18,195,844.45	-	-	91,746,137.54	109,941,981.99

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,130,445.18	1,130,445.18
应付管理人报酬	-	-	-	169,760.24	169,760.24
应付托管费	-	-	-	33,008.93	33,008.93
其他负债	-	-	-	73,438.87	73,438.87
负债总计				1,406,653.22	1,406,653.22
利率敏感度缺口	18,195,844.45			90,339,484.32	108,535,328.77

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2019 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2018 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(2018 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2019年6月30日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
银行存款	11,458,224.05	192,078.94	0.05	11,650,303.04
交易性金融资产	56,611,196.43	19,040,635.71	27,188,500.24	102,840,332.38
应收证券清算款	-	1,311,923.82	-	1,311,923.82
应收利息	-	0.71	-	0.71
应收股利	50,173.35	107,751.91	76,379.27	234,304.53

资产合计	68,119,593.83	20,652,391.09	27,264,879.56	116,036,864.48
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	68,119,593.83	20,652,391.09	27,264,879.56	116,036,864.48
项目	上年度末 2018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	4,483,041.56	7,092,250.04	0.05	11,575,291.65
交易性金融资产	54,331,346.83	15,007,885.62	22,084,661.88	91,423,894.33
应收股利	78,004.11	113.08	61,208.32	139,325.51
资产合计	58,892,392.50	22,100,248.74	22,145,870.25	103,138,511.49
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	58,892,392.50	22,100,248.74	22,145,870.25	103,138,511.49

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019年6月30日	上年度末 2018年12月31日
	1.所有外币相对人民币升值5%	增加约 580	增加约 516
	2.所有外币相对人民币贬值5%	减少约 580	减少约 516

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019 年 6 月 30 日		上年度末 2018 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	102,840,332.38	86.44	91,423,894.33	84.23
交易性金融资产—基金 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券 投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金 属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投 资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	102,840,332.38	86.44	91,423,894.33	84.23
----	----------------	-------	---------------	-------

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准(附注 6.4.1)上升 5%	增加约 529	增加约 503
	2.业绩比较基准(附注 6.4.1)下降 5%	减少约 529	减少约 503

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	102,840,332.38	85.44
	其中：普通股	101,296,418.58	84.16
	存托凭证	1,543,913.80	1.28
	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	15,743,226.23	13.08
8	其他各项资产	1,782,115.61	1.48
9	合计	120,365,674.22	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.2 期末在各个国家（地区）证券市场的权益投资分布

金额单位：人民币元

国家（地区）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
美国	56,611,196.43	47.58
香港	19,040,635.71	16.00
法国	5,490,954.06	4.62
日本	5,261,957.08	4.42
瑞士	5,059,318.06	4.25
德国	2,948,672.24	2.48
荷兰	1,973,339.57	1.66
英国	1,916,013.70	1.61
加拿大	1,915,341.95	1.61
奥地利	1,561,627.68	1.31
澳大利亚	1,061,275.90	0.89
合计	102,840,332.38	86.44

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定；

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

7.3 期末按行业分类的权益投资组合

金额单位：人民币元

行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
------	------	--------------

保健	17,215,722.58	14.47
金融	14,475,740.32	12.17
信息技术	14,372,914.89	12.08
必需消费品	11,686,916.60	9.82
非必需消费品	11,556,118.03	9.71
电信服务	11,052,882.97	9.29
工业	10,834,731.08	9.11
材料	3,900,143.91	3.28
能源	3,661,183.22	3.08
房地产	3,540,035.05	2.98
公共事业	543,943.73	0.46
合计	102,840,332.38	86.44

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

7.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券代码	所在证券市场	所属国家(地区)	数量 (股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	Danaher Corporation	丹纳赫	DHR US	美国证券交易所	美国	3,265	3,207,967.38	2.70
2	the Nestlé Group	雀巢集团	NESN SW	瑞士证券交易所	瑞士	4,221	3,007,057.34	2.53
3	Amazon .Com Inc	亚马逊公司	AMZN US	美国证券交易所	美国	212	2,759,845.29	2.32
4	Comcast Corporation	康卡斯特公司	CMCSA US	美国证券交易所	美国	9,086	2,640,957.80	2.22
5	Visa Inc	维萨公司	V US	美国证券交易所	美国	2,119	2,528,187.77	2.12

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

				所				
6	Microsoft Corp.	微软公司	MSFT US	美国证券交易所	美国	2,660	2,449,686.60	2.06
7	Texas Instruments Inc	德州仪器公司	TXN US	美国证券交易所	美国	3,003	2,369,188.54	1.99
8	Unitedhealth Group Inc	美国联合健康集团	UNH US	美国证券交易所	美国	1,382	2,318,298.85	1.95
9	T-Mobile US Inc	T-Mobile US 有限公司	TMUS US	美国证券交易所	美国	4,357	2,220,720.45	1.87
10	Union Pacific Corp	联合太平洋公司	UNP US	美国证券交易所	美国	1,875	2,179,838.47	1.83
11	Schneider Electric SA	施耐德电气有限公司	SU FP	法国证券交易所	法国	3,417	2,133,409.01	1.79
12	JPMorgan Chase & Co	摩根大通集团	JPM US	美国证券交易所	美国	2,697	2,072,891.17	1.74
13	Roche Holding AG	罗氏控股	ROG SW	瑞士证券交易所	瑞士	1,060	2,052,260.72	1.72
14	Adidas AG	阿迪达斯公司	ADS GR	德国证券交易所	德国	955	2,025,146.18	1.70
15	Alphabet Inc	Alphabet 公司	GOOGL US	美国证券交易所	美国	266	1,980,084.09	1.66
16	ASML HOLDING NV	阿斯麦公司	ASML NA	荷兰证券交易所	荷兰	1,372	1,973,339.57	1.66
17	Diageo plc	帝亚吉欧公司	DGE LN	伦敦证券交易所	英国	6,471	1,916,013.70	1.61
18	Nutrien Ltd	Nutrien 公司	NTR CN	加拿大证券交易所	加拿大	5,197	1,915,341.95	1.61
19	LVMH	LVMH	MC FP	法国证	法国	610	1,787,284.40	1.50

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

	Moet Hennes y Louis Vuitton	集团公司		券交易 所				
20	Johnson & Johnson	强生公司	JNJ US	美国证 券交易 所	美国	1,857	1,778,092.76	1.49
21	Procter & Gamble Co	宝洁公司	PG US	美国证 券交易 所	美国	2,341	1,764,671.21	1.48
22	China Merchan ts Bank Co.,Ltd.	招商银行 股份有限 公司	3968 HK	香港证 券交易 所	香港	50,000	1,714,126.87	1.44
23	The Walt Disney Co.	沃特迪士 尼公司	DIS US	美国证 券交易 所	美国	1,750	1,679,970.44	1.41
24	Intercon tinental Exchang e, Inc.	洲际交易 所	ICE US	美国证 券交易 所	美国	2,779	1,641,865.76	1.38
25	Adobe Systems Incorpor ated	奥多比	ADBE US	美国证 券交易 所	美国	792	1,604,299.24	1.35
26	Pfizer Inc	辉瑞制药 公司	PFE US	美国证 券交易 所	美国	5,288	1,574,829.88	1.32
27	TOTAL SA	道达尔公 司	FP FP	法国证 券交易 所	法国	4,071	1,570,260.65	1.32
28	Erste Group Bank AG	奥地利第 一储蓄银 行	EBS AV	奥地利 证券交 易所	奥地利	6,112	1,561,627.68	1.31
29	Bank of America Corporat ion	美国银行	BAC US	美国证 券交易 所	美国	7,769	1,548,876.78	1.30
30	HDFC Bank Ltd	HDFC 银 行有限公 司	HDB US	美国证 券交易 所	美国	1,727	1,543,913.80	1.30
31	TOYOT	丰田汽车	7203 JP	日本证 券交易 所	日本	3,600	1,536,860.41	1.29

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

	A MOTO R CORP	公司		券交易 所				
32	Thermo Fisher Scientifi c Inc	赛默飞世 尔科技公 司	TMO US	美国证 券交易 所	美国	759	1,532,392.08	1.29
33	Costco Wholesa le Corp.	好市多公 司	COST US	美国证 券交易 所	美国	831	1,509,684.53	1.27
34	Booking Holdings, Inc.	Booking 公司	BKNG US	美国证 券交易 所	美国	100	1,288,806.88	1.08
35	United Technol ogies	联合技术 公司	UTX US	美国证 券交易 所	美国	1,423	1,273,707.29	1.07
36	Ping An Insuranc e (Group) Compan y Of China,Lt d.	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	15,000	1,238,396.15	1.04
37	The Charles Schwab Corp.	嘉信理财 公司	SCHW US	美国证 券交易 所	美国	4,425	1,222,601.80	1.03
38	Estee Lauder Cos Inc	雅诗兰黛 公司	EL US	美国证 券交易 所	美国	954	1,200,920.31	1.01
39	Philip Morris Internati onal, Inc.	菲利普莫 里斯国际 公司	PM US	美国证 券交易 所	美国	2,195	1,185,015.07	1.00
40	BHP Billiton Ltd	必和必拓 有限公司	BHP AU	澳大利 亚证券 交易所	澳大利 亚	5,345	1,061,275.90	0.89
41	Las Vegas Sands Corp.	金沙集团	LVS US	美国证 券交易 所	美国	2,582	1,048,875.59	0.88
42	Medtron ic Plc	美敦力公 司	MDT US	美国证 券交易	美国	1,553	1,039,775.48	0.87

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

				所				
43	SMC Corporation	日本 SMC 公司	6273 JP	日本证券交易所	日本	400	1,025,645.98	0.86
44	Sunac China Holdings Limited	融创中国控股有限公司	1918 HK	香港证券交易所	香港	30,000	1,013,953.35	0.85
45	Cabot Oil & Gas Corp.	卡伯特油气公司	COG US	美国证券交易所	美国	6,408	1,011,458.66	0.85
46	Nintendo Co Ltd	任天堂	7974 JP	日本证券交易所	日本	400	1,008,283.79	0.85
47	The Home Depot, Inc.	家得宝公司	HD US	美国证券交易所	美国	704	1,006,530.88	0.85
48	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	中国工商银行股份有限公司	1398 HK	香港证券交易所	香港	200,000	1,003,391.34	0.84
49	Fortive Corp	Fortive 公司	FTV US	美国证券交易所	美国	1,746	978,503.00	0.82
50	Baxter International	百特国际有限公司	BAX US	美国证券交易所	美国	1,709	962,231.82	0.81
51	Weichai Power Co.,Ltd.	潍柴动力股份有限公司	2338 HK	香港证券交易所	香港	80,000	929,457.24	0.78
52	BASF SE	巴斯夫欧洲公司	BAS GR	德国证券交易所	德国	1,844	923,526.06	0.78
53	China Tower Corporation Limited	中国铁塔股份有限公司	788 HK	香港证券交易所	香港	500,000	902,172.04	0.76
54	Eli Lilly	礼来公司	LLY US	美国证	美国	1,164	886,558.29	0.75

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

	& Co			券交易所				
55	Kubota Corp	久保田公司	6326 JP	日本证券交易所	日本	7,400	846,930.30	0.71
56	Keyence Corp	西日本商工株式会社	6861 JP	日本证券交易所	日本	200	844,236.60	0.71
57	Longfor Group Holdings Limited	龙湖集团控股有限公司	960 HK	香港证券交易所	香港	30,000	777,628.29	0.65
58	S-Enjoy Service Group Co., Limited	新城悦服务集团有限公司	1755 HK	香港证券交易所	香港	100,000	738,460.82	0.62
59	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	30,000	728,778.97	0.61
60	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	舜宇光学科技(集团)有限公司	2382 HK	香港证券交易所	香港	10,000	710,295.45	0.60
61	YiChang HEC ChangJiang Pharmaceutical Co., Ltd.	宜昌东阳光长江药业股份有限公司	1558 HK	香港证券交易所	香港	20,000	687,411.08	0.58
62	China Jinmao Holdings Group Limited	中国金茂控股集团有限公司	817 HK	香港证券交易所	香港	150,000	627,119.59	0.53
63	SSY	石四药集	2005 HK	香港证	香港	100,000	621,398.50	0.52

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

	Group Limited	团有限公司		券交易所				
64	Tencent Holdings Limited	腾讯控股有限公司	700 HK	香港证券交易所	香港	2,000	620,694.36	0.52
65	China Resources Land Limited	华润置地有限公司	1109 HK	香港证券交易所	香港	20,000	605,555.47	0.51
66	Schlumberger Ltd	斯伦贝谢公司	SLB US	美国证券交易所	美国	2,196	599,948.47	0.50
67	BYD Electronic (International) Co., Ltd.	比亚迪电子(国际)有限公司	285 HK	香港证券交易所	香港	60,000	589,360.39	0.50
68	Citic Securities Company Limited	中信证券股份有限公司	6030 HK	香港证券交易所	香港	40,000	573,165.30	0.48
69	Yihai International Holding Ltd.	颐海国际控股有限公司	1579 HK	香港证券交易所	香港	16,000	571,052.90	0.48
70	CSPC Pharmaceutical Group Limited	石药集团有限公司	1093 HK	香港证券交易所	香港	50,000	554,505.74	0.47
71	Huadian Power International Corporation Limited	华电国际电力股份有限公司	1071 HK	香港证券交易所	香港	200,000	543,943.73	0.46
72	Semiconductor Manufacturer	中芯国际集成电路制造有限	981 HK	香港证券交易所	香港	70,000	536,022.22	0.45

	turing Internati onal Corporat ion	公司						
73	China Mengni u Dairy Compan y Limited	中国蒙牛 乳业有限 公司	2319 HK	香港证 券交易 所	香港	20,000	532,501.54	0.45
74	China Vanke CO.,LT D.	万科企业 股份有限 公司	2202 HK	香港证 券交易 所	香港	20,000	515,778.35	0.43
75	Kunlun Energy Compan y Limited	昆仑能源 有限公司	135 HK	香港证 券交易 所	香港	80,000	479,515.44	0.40
76	Huatai Securitie s Co.,ltd.	华泰证券 股份有限 公司	6886 HK	香港证 券交易 所	香港	30,000	354,883.67	0.30
77	TravelS ky Technol ogy 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	20,000	276,372.70	0.23
78	Hua Hong Semicon ductor Limited	华虹半导 体有限公 司	1347 HK	香港证 券交易 所	香港	20,000	266,162.76	0.22
79	Weimob Inc.	微盟集团	2013 HK	香港证 券交易 所	香港	50,000	225,763.05	0.19
80	Guangz hou Automob ile 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	14,000	102,768.40	0.09

7.5 报告期内权益投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计买入金额	占期初基金 资产净值比例 （%）
1	Roche Holding AG	ROG SW	1,850,492.47	1.70
2	Erste Group Bank AG	EBS AV	1,562,551.55	1.44
3	China Resources Land Limited	1109 HK	1,294,850.56	1.19
4	Philip Morris International, Inc.	PM US	1,290,945.30	1.19
5	Cabot Oil & Gas Corp.	COG US	1,151,099.45	1.06
6	Sunny Optical Technology (Group) Company Limited	2382 HK	1,136,508.08	1.05
7	Industrial And Commercial Bank Of China Limited	1398 HK	986,897.67	0.91
8	Eli Lilly & Co	LLY US	971,161.27	0.89
9	Texas Instruments Inc	TXN US	937,650.91	0.86
10	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	891,962.42	0.82
11	CSPC Pharmaceutical Group Limited	1093 HK	843,275.94	0.78
12	Yanzhou Coal Mining Company Limited	1171 HK	835,829.18	0.77
13	Shanghai Jin Jiang International Hotels (Group) Company Limited	2006 HK	821,439.31	0.76
14	Chinasoft International Ltd.	354 HK	798,436.96	0.74
15	Weichai Power Co.,Ltd.	2338 HK	788,565.53	0.73
16	ASML HOLDING NV	ASML NA	772,933.81	0.71
17	China Petroleum & Chemical Corporation	386 HK	741,490.29	0.68
18	China Tower Corporation Limited	788 HK	702,150.47	0.65
19	Citic Securities Company Limited	6030 HK	695,510.50	0.64
20	Hong Kong Exchanges	388 HK	690,481.41	0.64

	And Clearing Limited			
--	----------------------	--	--	--

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

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的权益投资明细

金额单位：人民币元

序号	公司名称（英文）	证券代码	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	Novartis AG	NOVN SW	1,999,847.96	1.84
2	The Toronto-Dominion Bank	TD CN	1,928,267.95	1.78
3	Apple Inc	AAPL US	1,684,437.40	1.55
4	China Jinmao Holdings Group Limited	817 HK	1,644,791.63	1.52
5	Raytheon Company	RTN US	1,408,770.17	1.30
6	International Business Machines Corp.	IBM US	1,270,255.05	1.17
7	Occidental Petroleum Corp	OXY US	1,146,254.25	1.06
8	Thermo Fisher Scientific Inc	TMO US	1,072,956.66	0.99
9	Sinopec Kantons Holdings Limited	934 HK	1,032,366.97	0.95
10	Bank of America Corporation	BAC US	922,441.03	0.85
11	China Resources Land Limited	1109 HK	912,998.98	0.84
12	Tencent Holdings Limited	700 HK	859,268.17	0.79
13	UBS Group AG	UBSG SW	854,052.89	0.79
14	The PNC Financial Services Group, Inc.	PNC US	835,698.09	0.77
15	DowDuPont Inc	DWDP US	801,485.34	0.74
16	Yanzhou Coal Mining Company Limited	1171 HK	799,750.68	0.74
17	Zhuzhou CRRC Times Electric Co., Ltd.	3898 HK	784,849.68	0.72
18	Li Ning Company Limited	2331 HK	777,068.84	0.72
19	China Shenhua Energy Company Limited	1088 HK	770,374.46	0.71
20	Alphabet Inc	GOOGL US	744,898.08	0.69

注：1、“本期累计卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用；

2、此处所用证券代码的类别是当地市场代码。

7.5.3 权益投资的买入成本总额及卖出收入总额

单位：人民币元

买入成本（成交）总额	34,745,927.47
卖出收入（成交）总额	39,334,793.23

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

7.6 期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

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

7.11.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	1,311,923.82
3	应收股利	322,792.53
4	应收利息	743.79
5	应收申购款	146,655.47
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	1,782,115.61

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,793	6,127.16	27,123,292.52	45.20%	32,879,940.22	54.80%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	70.03	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2008 年 8 月 22 日）基金份额总额	508,425,627.85
本报告期期初基金份额总额	62,907,239.77
本报告期基金总申购份额	7,131,787.85
减：本报告期基金总赎回份额	10,035,794.88
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	60,003,232.74

注：1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务，则总申购份额中包含该业务；

2、如果本报告期间发生转换出业务，则总赎回份额中包含该业务。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2019 年 2 月 28 日本基金管理人发布公告，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。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人中国建设银行股份有限公司于 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为资产托管业务部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本

基金提供审计服务。

10.7 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	
Shenyin Wanguo Securities(H.K.)Ltd	-	21,473,594.31	28.99%	32,210.43	55.18%	-
UOB Kay Hian(Hong Kong) Limited	-	16,092,054.94	21.72%	19,310.46	33.08%	-
Investment Technology Group Limited	-	8,158,124.67	11.01%	1,386.81	2.38%	-
Cowen and Company LLC	-	4,997,900.37	6.75%	525.19	0.90%	-
Goldman Sachs & Co. LLC New York	-	4,982,827.53	6.73%	505.30	0.87%	-
Haitong International Securities (USA) Inc	-	3,208,135.37	4.33%	230.81	0.40%	-
Citigroup Global	-	2,961,187.39	4.00%	155.55	0.27%	-

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

Markets Inc.						
UBS Securities LLC, Stamford	-	2,789,851.26	3.77%	914.34	1.57%	-
Two Sigma Securities LLC New York	-	2,789,307.02	3.77%	314.45	0.54%	-
ITG Inc.	-	2,614,304.94	3.53%	165.40	0.28%	-
BOCI Securities Limited	-	1,508,878.64	2.04%	2,263.32	3.88%	-
Virtu ITG Europe Limited	-	1,299,494.28	1.75%	220.87	0.38%	-
UBS Securities Canada Inc Toronto	-	741,792.27	1.00%	78.55	0.13%	-
UBS Securities Asia Limited Hong Kong	-	405,348.94	0.55%	81.07	0.14%	-
Goldman Sachs International Limited	-	40,420.05	0.05%	8.02	0.01%	-
Goldman Sachs Australia Pty Ltd	-	17,498.72	0.02%	5.27	0.01%	-
Nomura International PLC.	-	-	-	-	-	-
China Merchants Securities(H K)Co.Ltd.	-	-	-	-	-	-
Investment Technology Group Ltd Dublin(DMA)	-	-	-	-	-	-
Morgan	-	-	-	-	-	-

Stanley & Co.International PLC						
ITG Inc. New York (DMA)	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Pierce Fenner and Smith Inc. New York	-	-	-	-	-	-
Societe Generale London Branch	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley & Co. International Plc London	-	-	-	-	-	-
Instinet Europe Limited London	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Ltd Hong Kong	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Securities (Europe) Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities (Australia) Limited	-	-	-	-	-	-
Cowen & Company LLC New York (DMA)	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Limited London	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Inc.	-	-	-	-	-	-

NY (DTC418)						
Liquidnet Europe Limited London (International trades)	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse (Hong Kong) Ltd Hong Kong	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch International London	-	-	-	-	-	-
Panmure Gordon Limited	-	-	-	-	-	-
Investment Technology Group Ltd Dublin	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse Securities(Eu rope) Ltd	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Europe Limited London (International trades)	-	-	-	-	-	-
Credit Suisse(Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
KCG Americas LLC New York	-	-	-	-	-	-
UBS Limited London	-	-	-	-	-	-
Nordea Bank Danmark A/S Copenhagen	-	-	-	-	-	-
Goldman	-	-	-	-	-	-

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

Sachs & Co New York						
Morgan Stanley & Co. LLC New York	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities LLC New York	-	-	-	-	-	-
Scotia Capital (USA) Inc	-	-	-	-	-	-
PIPER JAFFRAY ASIA SECURITIE S LIMITED	-	-	-	-	-	-
RBC Capital Markets Corp	-	-	-	-	-	-
RBC Dain Rauscher Inc Minneapolis	-	-	-	-	-	-
Redburn Partners	-	-	-	-	-	-
Redburn Partners LLP (DMA) London	-	-	-	-	-	-
Royal Bank of Scotland Plc London	-	-	-	-	-	-
S J LEVINSON	-	-	-	-	-	-
Samsung Securities Asia Limited	-	-	-	-	-	-
SG Securities (London) Ltd	-	-	-	-	-	-
Southern Cross Equities Limited	-	-	-	-	-	-
UBS	-	-	-	-	-	-

Securities Ltd						
UBS Singapore DMA	-	-	-	-	-	-
WALL ST ACCESS	-	-	-	-	-	-
Wall Street Access Corporation	-	-	-	-	-	-
Yuanta Securities(H ONG KONG)Com pany Limited	-	-	-	-	-	-
Guosen Securities(H K) Brokerage Company, Limited	-	-	-	-	-	-
Instinet Pacific Limited	-	-	-	-	-	-
Jefferies and Company Inc New York	-	-	-	-	-	-
BTIG LLC	-	-	-	-	-	-
Imperial Capital LLC	-	-	-	-	-	-
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)	-	-	-	-	-	-

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

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	-	-	-	-	-	-

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年半年度报告

Asia Limited Hong Kong						
BNP Paribas Peregrine HK	-	-	-	-	-	-
Exane Ltd London	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Ltd Singapore	-	-	-	-	-	-
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(As ia)Ltd.	-	-	-	-	-	-
BNP Paribas	-	-	-	-	-	-

UK Ltd London						
BRADESCO SEC	-	-	-	-	-	-
BSCH New York	-	-	-	-	-	-
Calyon Securities (New York)	-	-	-	-	-	-
CITIC Securities Brokerage (HK) Limited	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets Australia Pty	-	-	-	-	-	-
Citigroup Global Markets UK Equity	-	-	-	-	-	-
CSFB Singapore Securities PTE Limited	-	-	-	-	-	-
Daiwa Securities (HK) Ltd Hong Kong	-	-	-	-	-	-
DBS Vickers Securities (Singapore) Pte	-	-	-	-	-	-
Deutsche Bank Alex Brown Inc	-	-	-	-	-	-
Deutsche Securities Asia Ltd	-	-	-	-	-	-
Evolution Group Plc	-	-	-	-	-	-
Goldman Sachs JB Were Pty Ltd Melbourne	-	-	-	-	-	-

Guoyuan Securities Brokerage(Hong Kong) Ltd	-	-	-	-	-	-
Haitong International Securities Company Limited	-	-	-	-	-	-
ICAP CORP LLC	-	-	-	-	-	-
Instinet Corporation	-	-	-	-	-	-
Instinet Corporation New York (DMA)	-	-	-	-	-	-
Investec Securities London	-	-	-	-	-	-
ITG Australia Ltd Melbourne	-	-	-	-	-	-
ITG EUROPE LTD	-	-	-	-	-	-
ITG Ltd - Hong Kong	-	-	-	-	-	-
ITG Triton	-	-	-	-	-	-
ITG Triton (US)	-	-	-	-	-	-
J P Morgan Securities Inc N.Y.	-	-	-	-	-	-
J P Morgan Securities Ltd	-	-	-	-	-	-
J P Morgan Securities Ltd London	-	-	-	-	-	-
J. & E.Davy	-	-	-	-	-	-
Jefferies & Co Inc	-	-	-	-	-	-
Jefferies	-	-	-	-	-	-

International Limited						
JP Morgan Chase Bank - London (TRS)	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities (Asia Pacific) Korea	-	-	-	-	-	-
JP Morgan Securities. (Asia Pacific) Ltd	-	-	-	-	-	-
Lehman Brothers International (Europe)	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET	-	-	-	-	-	-
Liquidnet (International Trades)	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Australia Pty Ltd	-	-	-	-	-	-
LIQUIDNET EURO	-	-	-	-	-	-
Liquidnet Inc New York (US\$ Trades)	-	-	-	-	-	-
Macquarie Equities New Zealand Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities(Singapore)Pte Ltd	-	-	-	-	-	-
Macquarie Securities HK	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Far East Limited	-	-	-	-	-	-
Merrill	-	-	-	-	-	-

Lynch Fund Managers							
Merrill Lynch London	-	-	-	-	-	-	-
Merrill Lynch Singapore DMA	-	-	-	-	-	-	-
Mitsubishi Securities International	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Asia Ltd (HongKong)	-	-	-	-	-	-	-
Mizuho Securities Co (Tokyo)	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Grenfell & Co	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley International Ltd	-	-	-	-	-	-	-
Morgan Stanley N Co Intl Ltd (Seoul)	-	-	-	-	-	-	-
Nomura International Ltd London	-	-	-	-	-	-	-

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。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

10.9 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调整投资者场外投资旗下部分基金单笔最低申购金额、最低赎回份额和最低保留余额限制的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-01-15
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	2019-01-16
3	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2018 年第 4 季度报告	中国证券报	2019-01-21
4	交银施罗德基金管理有限公司关于开展网上直销交易平台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	2019-01-28
5	交银施罗德基金管理有限公司关于暂停大泰金石基金销售有限公司办理相关销售业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-01-29
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	2019-02-15
7	交银施罗德基金管理有限公司关于总经理变更的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-02-28
8	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2018 年年度报告摘要	中国证券报	2019-03-27
9	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）费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-04-01
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（2019 年第	中国证券报	2019-04-08

	1 号)		
11	交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金参与奕丰基金销售有限公司基金前端申购（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	2019-04-12
12	交银施罗德基金管理有限公司关于取消纸质对账单寄送的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-04-12
13	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	2019-04-17
14	交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019 年第 1 季度报告	中国证券报	2019-04-20
15	交银施罗德基金管理有限公司关于增加北京唐鼎耀华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	2019-04-23
16	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	2019-05-16
17	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	2019-05-22
18	交银施罗德基金管理有限公司关于增加上海华夏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其基金前端申购费率（含定期定额投资）优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报	2019-05-23

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2019/1/1-2019/6/30	27,024,464.49	-	-	27,024,464.49	45.04%

产品特有风险

本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。

§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全球精选价值证券投资基金募集的文件；
- 2、《交银施罗德全球精选价值证券投资基金基金合同》；
- 3、《交银施罗德全球精选价值证券投资基金招募说明书》；
- 4、《交银施罗德全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全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全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)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。