

2013年1月21日 星期一

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:二〇一三年一月二十一日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2013年1月18日核对了本报告中的财务指标、净值表现和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。投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告期自2012年10月1日至至12月31日止。

本基金报告期自2012年10月1日至至12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称:交银环球精选股票(QDII)

基金主代码:519696

交易代码:519696(前端) 519699(后端)

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2008年8月12日

报告期末基金份额总额:121,596,495.13份

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:本基金主要通过分析全球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，从而下而上地选择证券，按相对价值、具备竞争优势的上市公司的股票进行投资，并有效控制下行风险。

业绩比较基准:70%×标普全球大盘指数+30%×恒生综合指数(S&P Global LargeCap Index)*+30%×恒生综合指数

风险收益特征:本基金以股票及股票基金为投资对象，属于较高风险和预期收益的投资品种，其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券基金类型。此外，本基金在全世界范围内进行投资，除了需要面对国内市场的风险外，还面临汇率、政治、国别风险、新兴市场风险以及海外市场所特有的各种特别投资风险。

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

境外投资顾问英文名称:Schroder Investment Management Limited

境外投资顾问中文名称:施罗德投资管理有限公司

境外外汇风险管理人英文名称:JP Morgan Chase Bank, National Association

境外外汇风险管理人中文名称:摩根大通银行

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元 报告期(2012年10月1日-2012年12月31日)

1.本期已实现收益 1,160,642.65

2.本期利润 -6,322,380.00

3.期末基金资产净值 165,994,362.14

4.期末基金份额净值 1.0363

5.期末可供分配基金份额利润 0.0000

注:1.上述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基金份额净值。

2.本期已实现收益指基金利息收入、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 本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 净值增长 率① 业绩比较基 准收益率② 业绩比较基 准收益率③ ①-③ ②-④

过去三个月 3.97% 4.36% 0.53% -0.39% -0.02%

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

较 截至报告期期末基金累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率变动情况

份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率走势图

2008年8月22日至2012年12月31日

注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产

均符合基金合同及招募说明书的有关规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理或基金经理小组简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 说明

邓伟辉 基金经理,交银施罗德基金管理有限公司基金经理 2008-8-22 - 35年

说明:邓伟辉先生,中国国籍,大学本科,曾任任施罗德投资管理有限公司投资总监,负责香港及内地客户,大型退休基金,养老金及私人客户服务。2007年加入施罗德基金管理有限公司。

夏晋 本基金的基金经理 2012-4-9 - 6年

说明:夏晋先生,中国国籍,大学本科,历任施罗德分析师,2009年加入施罗德基金管理有限公司,历任基金经理,Traffic Bound Capital LLC高级研究员,2009年加入施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师,QQQ高级分析师。

饶旭 本基金的基金经理 2012-4-9 - 5年

说明:饶旭先生,中国国籍,大学本科,2008年加入施罗德基金管理有限公司,历任行业分析师,QQQ高级分析师。

4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

姓名 在境外投资顾问所任职务 证券从业年限 说明

Virginie Maisonneuve 基金投资主管 25年 Virginie Maisonneuve女士,法国高等商业管理学院工商管理硕士,CFRA,历任苏格兰Martini Currie资产管理公司欧洲大中华区股票基金经理,波士顿Batterymarch资产管理公司基金经理,纽约Clay Finlay公司投资总监,董事,管理委员会及投资策略委员会委员。2004年加入施罗德基金管理有限公司。

4.3 报告期内本基金运作遵守信守情况说明

在报告期内,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、勤勉尽责的原则运用基金资产,基金管理符合有关法律法规和基金合同的规定,确保持有人民要求最大利益。

4.4 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.5 报告期内本基金运作遵守信守情况说明

在报告期内,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、勤勉尽责的原则运用基金资产,基金管理符合有关法律法规和基金合同的规定,确保持有人民要求最大利益。

4.6 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.7 报告期内本基金运作遵守信守情况说明

在报告期内,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、勤勉尽责的原则运用基金资产,基金管理符合有关法律法规和基金合同的规定,确保持有人民要求最大利益。

4.8 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.9 报告期内本基金运作遵守信守情况说明

在报告期内,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、勤勉尽责的原则运用基金资产,基金管理符合有关法律法规和基金合同的规定,确保持有人民要求最大利益。

4.10 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.11 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.12 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.13 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.14 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.15 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例分配”的原则按事先独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司对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,对子季度和每季度分别对所管理的各投资组合的整体收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行分析,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。

本公司定期对公平交易执行情况进行定期评估,对不同投资组合的综合收益差率、分投资类别别的收益差率以及同一时间同向交易的交易盈亏情况进行评估。

4.16 公平交易制度的执行情况

本公司制定严格的投研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其它客户资产管理专户严格按照制度进行公平交易。

本公司设立投资决策的投票权信息平台,在公司交易执行环节实行集中交易制度,建立公开的交易分配制度,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,由基金经理根据不同的交易对手,遵循“价格优先、比例