# 交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2019年半年度报告摘要

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

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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

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。

## 2 基金简介

2.1基金基本情况

| | |
|---|---|
| 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 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 王晓婷 | 田青 |
| | 联系电话 | (021)61055050 | 010-67596096 |
| | 电子邮箱 | xxp@jyshd.com, disclosure@jyshd.com | tianqing.1.zh@ccb.com |
| 客户服务电话 | | 400-700-5000,021-61055000 | 010-67596096 |
| 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, USA. |
| 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 |

## 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 |

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标准差④ | 业绩比较基准收益率③ | 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% |

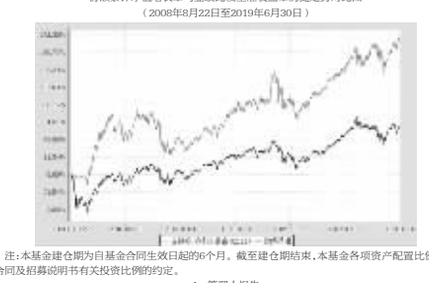
注:本基金的业绩比较基准为70%×标准普尔全球大中盘指数(S&P Global LargeMidCap Index)+30%×恒生指数,每日进行再平衡过程。

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,注册资本金为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)、交银环球资源混合(QDII)、交银环球价值精选混合、交银核心资产混合的基金经理、公司跨境投资部总监 | 2015-11-21 | - | 14年 | 陈俊华女士,中国籍,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、研究方部研究助理、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。兼职,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量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。投资者预期的刚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,让我们我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可的做法,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 | 1,466.39 |
| 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 | 109,941,991.99 |
| 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:1,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。

2,本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

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 | 2,107,736.88 | 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 | | 1,404,708.79 | 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 | 102,196.86 | 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 | 76,815.25 | 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 | -2,523,981.06 | -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(净值减少以"-"号填列) | - | -4,514,582.50 | -4,514,582.50 |
| 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]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 Limitec)。

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上半年度财务报表将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需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关联方关系

6.4.7.1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。

6.4.7.2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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1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。

6.4.8.2关联方报酬

6.4.8.2.1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。

6.4.8.2.2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。

6.4.8.2.3销售服务费

无。

6.4.8.3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。

6.4.8.4各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

| 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 |
|---|---|---|
| 基金合同生效日(2008年8月22日)持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 27,024,464.49 | 26,054,356.51 |
| 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。

6.4.8.4.2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

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。

6.4.8.5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 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 | |
|---|---|---|---|---|
| | 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。

6.4.8.6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证券。

6.4.8.7 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。

6.4.9期末(2019年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1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。

6.4.9.2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。

6.4.9.3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(%) |
|---|---|---|
| 英国 | 56,611,196.43 | 47.58 |
| 香港 | 19,040,635.71 | 16.00 |
| 法国 | 5,490,964.06 | 4.62 |
| 日本 | 5,261,967.08 | 4.42 |
| 瑞士 | 5,069,318.06 | 4.26 |
| 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 | 11,566,118.03 | 9.71 |
| 电信服务 | 11,062,882.97 | 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 | Danaher Corporation | 丹纳赫 | DHR US | 美国证券交易所 | 美国 | 3,