

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：二〇一四年八月二十五日

## § 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。

本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2014年8月22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摘要。

本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，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务数据未经审计。

本报告期自2014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	交银施罗德全球自然资源证券投资基金
基金主代码	519799
交易代码	519799
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010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
报告期末基金总资产	7,756,745.11元
基金合同终止日期	不定期

## 2.2 基金产品说明

投资目标	在全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，在有效控制风险的前提下力争实现资本的长期保值增值。
投资策略	本基金将主要通过以下途径实现投资目标：1、资产配置：根据宏观经济形势、行业景气度、公司基本面等综合因素，通过定期评估和调整，动态地调整大类资产配置比例；2、个股选择：本基金将重点考察公司的盈利能力、成长性、估值水平、行业地位、公司治理结构、公司质地等多方面因素，精选出具有持续增长能力的优质企业进行投资；3、风险管理：通过严格的风险控制机制，对投资组合进行有效的风险管理，降低投资组合的波动率，从而实现资本的长期保值增值。
业绩比较基准	MSCI全球原材料指数收益指数*65%+MSCI全球能源指数收益指数*35%
风险收益特征	本基金主要投资于境外市场，因此本基金的预期风险和预期收益均高于国内股票型基金，属于高风险、高收益的基金品种。

## 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	孙艳	田青
联系电话	021-61055050	010-67595096
电子邮箱	xsp@jxfund.com.disclosure@jxfund.com	tianqing@ccb.com
客户服务电话	400-700-5000; 021-61055000	010-67595096
传真	021-61055054	010-66275883

## 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	Schneider Investment Management Limited	JPMorgan Chase Bank, National Association

## 2.5 信息披露方式

基金管理人年度报告的管理人互联网网址	www.fund001.com, www.bocomcrdr.com
基金管理人办公地点	基金管理人办公场所

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

金额单位：人民币元

3.1 利润表和利润分配		报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)	
本期已实现收益	-	372,560.21	
本期利润	-	-372,588.72	
加权平均基金份额本期利润	-	-0.002	
末期基金份额净值增长率	-	-2.49%	
3.1.2 利润表和利润分配	报告期(2014年6月30日)		
利润总额	0.207		
期末基金资产净值	9,363,259.24		
期末基金资产净值增长率	1.307		

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不计费用的净值；

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	2.55%	0.47%	3.11%	0.39%	-0.56%	0.08%
过去3个月	4.50%	0.73%	6.42%	0.43%	-1.92%	0.30%
过去6个月	-2.49%	0.73%	7.69%	0.53%	-10.18%	0.20%
过去一年	12.70%	0.70%	24.14%	0.60%	-11.85%	0.10%
自基金合同生效起至今	22.90%	0.82%	28.82%	0.85%	-5.86%	-0.03%

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%，每日重新平衡。

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：净值增长率=（当前基金份额净值-1）\*100%；同期业绩比较基准收益率历史走势对比图（2012年5月22日至2014年6月30日）

交银施罗德全球自然资源证券投资基金

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

(2012年5月22日至2014年6月30日)

注：1、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规定。

§ 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[2006]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2006年7月4日，注册资本在1亿元人民币。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34只基金，其中股债混合型涵盖指数型、交易型开放式（ETF）、QDII等不同类型基金。

## 4.1.2 基金经理（或基金经理助理）任职期间及离任日期

基金管理人和基金托管人根据法律法规的有关规定，对报告期内公司高级管理人员和基金经理（或基金经理助理）进行了核查，未发现有违法违纪行为。

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	职务	任本基金的基金经理	证券从业年限	说明
徐旭	基金经理助理	基金经理	7年	徐旭先生，中国国籍，北京大学硕士，美国普林斯顿大学MBA，2001年7月至2004年6月就职于摩根士丹利华鑫证券有限责任公司，2004年6月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、QDII高级分析师，2014年4月起至2014年6月30日任本基金基金经理。
吴晓军	基金经理助理	基金经理	8年	吴晓军先生，中国国籍，上海交通大学硕士，2006年1月加入交银施罗德基金管理有限公司，历任行业分析师、QDII高级分析师，2014年1月起至2014年6月30日任本基金基金经理。

注：1.本公司根据《基金合同》约定，对报告期内公司高级管理人员和基金经理（或基金经理助理）进行了核查，未发现有违法违纪行为。

2.本表所列基金经理人员的任期，从该基金经理开始担任本基金基金经理之日起计算。

3.本基金的基金经理（或基金经理助理）的离任日期，从该基金经理不再担任本基金基金经理之日起计算。

4.3 管理人对报告期内基金运作合规性的专项说明

## 4.4.1 平均交易量的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所有的投资组合在获得投资信息、投资建议和实施交易时，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；对于非集中竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则；对于集中竞价交易，对于非集中竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则；对于柜台交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则。

本公司建立公平的交易研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施交易时，建立公平的交易分配制度。

本公司严格执行公平交易制度，风险管理部负责对各投资组合公平交易情况进行分析，通过分析评估和信息披露来加强公平交易制度和结果的监督。

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 常常交易行为的专项说明

本公司制定了严格的投资控制制度和平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平，旗下所有的投资组合在获得投资信息、投资建议和实施交易时，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；对于非集中竞价交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则；对于柜台交易，遵循“价格优先、时间优先”的原则。

本公司建立公平的交易研究信息平台，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施交易时，建立公平的交易分配制度。

本公司严格执行公平交易制度，风险管理部负责对各投资组合公平交易情况进行分析，通过分析评估和信息披露来加强公平交易制度和结果的监督。

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。

4.5 管理人对报告期内基金的投资组合和业绩表现的说明

报告期内，本公司严格按照法律法规的有关规定，对报告期内公司高级管理人员和基金经理（或基金经理助理）进行了核查，未发现有违法违纪行为。

4.6 报表附注

## 4.6.1 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”）经中国证监会证监基金字[2006]128号文批准，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》、《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》的有关规定，向中国证监会备案，基金名称定为“交银施罗德全球自然资源证券投资基金”，基金合同生效日为2010年5月22日正式生效，基金合同生效日的基金资产总额为628,520,196.14万元人民币，其中认申购资金总额折合人民币260,126.36万元人民币，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JP Morgan & Chase Bank, N.A.，境外投资顾问为施罗德投资管理有限公司(Schroders 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》的有关规定，本基金的经营范围为：股票、债券、货币市场工具以及中国证监会允许的其他证券品种。

本基金上半年采取精选个股的策略操作，重点配置方向在北美和香港能源行业公司，在全球方面配置较少，因为上半年香港市场表现不佳，使本基金整体组合的表现受到一定影响。

4.6.2 报告期内基金的业绩表现

截至2014年6月30日，本基金份额净值为1.207元，本报告份额净值增长率为-2.49