交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2016年年度报告摘要

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:二〇一七年三月二十九日

§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2017年3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2016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	61,370,048.29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	孙艳	田青
	联系电话	(021)61055050	010-67595096
	电子邮箱	xxpl@jyshd.com,disclosure@jyshd.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,www.bocomschroder.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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	-2,028,238.47	4,491,773.60	27,600,369.17
本期利润	6,396,541.93	262,832.59	9,435,959.18
加权平均基金份额本期利润	0.1077	0.0040	0.1005
本期基金份额净值增长率	7.08%	0.15%	6.38%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.547	0.598	0.650
期末基金资产净值	100,793,987.15	92,231,125.53	128,269,800.31
期末基金份额净值	1.642	1.598	1.662

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。

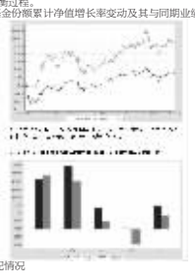
3.2 基金净值表现

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	2.88%	0.49%	-1.12%	0.51%	4.00%	-0.02%
过去六个月	9.69%	0.52%	5.81%	0.53%	3.88%	-0.01%
过去一年	7.08%	0.81%	4.22%	0.83%	2.86%	-0.02%
过去三年	14.08%	0.94%	1.43%	0.77%	12.65%	0.17%
过去五年	58.27%	0.86%	35.94%	0.74%	22.33%	0.12%
自基金合同生效起至今	104.89%	0.99%	26.69%	1.17%	78.20%	-0.18%

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



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
2016年	0.600	1,060,257.52	2,388,623.66	3,448,881.18	-
2015年	0.660	1,620,714.07	3,392,077.59	5,012,791.66	-
2014年	0.390	1,567,517.23	2,440,095.69	4,007,612.92	-
合计	1.650	4,248,488.82	8,220,796.94	12,469,285.76	-

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
蔡铮	交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银深证300价值ETF及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数(LOF)的基金经理,公司量化投资部副总经理	2015-4-22	-	7年	蔡铮先生,中国国籍,复旦大学电子工程硕士,历任瑞士银行香港分行分析员,2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任投资研究部数量分析师、基金经理助理、量化投资部助理总经理。2012年12月27日至2015年6月30日担任交银施罗德300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。2015年8月13日至2016年7月18日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经
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	2015-11-21	-	11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)的基金经理	2015-12-12	-	7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。

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、保本混合型、普通混合型和股票型在内的69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

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。

3.2017年3月29日本基金管理人发布公告,经公司领导办公会审议通过,蔡铮先生不再担任本基金基金经理,本基金由陈俊华女士和周中先生共同管理。除此之外基金经理(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	17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

本报告期内,本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金持有人利益的行为。

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,在全公司适用投票、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,投资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和建投资组合。

(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

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。通过投资交易监控、交易数据分析、专项稽核检查等,本基金管理人未发现任何违反公平交易制度的行为。

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前边交易量超过该证券当日总成交量5%的情况有20次,是投资组合因投资策略或在合规范围内因被动超标调整需要而发生同日反向交易,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

2016年,欧美和香港市场表现完全不同。欧美股市受经济复苏预期影响,全年录得正收益。港股市场经历震荡走势,最终全年收平:港股年初受到国内市场影响,单月跌幅超过10%,后续受到一定反弹,但四季度持续回落,基本抹杀全年涨幅。香港市场的交易量也较上年略有减少,体现出在经济震荡期,离岸金融市场受到海外和国内双重不确定性因素的影响。

本基金在2016年谨得正收益,回顾一年的操作,我们的收获主要源自于:1)坚定欧美、香港市场分散化投资;2)在选个股层面,坚持先行业后公司,从中观到微观的选股策略。精选个股,持股相对更加集中,且细分行业的龙头公司比例增多。

4.5.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.642元,本报告期份额净值增长率为7.08%,同期业绩比较基准增长率为4.22%。

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2017年,我们认为海外市场的不确定性增大,总体呈谨慎乐观的态度。谨慎在于,美国新一届总统、执政团队上任,前期投资者的预期普遍较高,未来兑现的程度和步伐值得关注。此外,2016年底,美国明确了未来3次加息预期,在2017年这二者都将牵动全体投资者的信心。乐观在于:我们仍看好香港市场全年的表现。首先,中国经济逐步企稳,进一步恶化风险减小;其次,伴随沪港通、深港通的开通,国内投资者进入香港的通道被显著放宽,相较于国内的估值水平,香港市场的估值优势显著;最后,海外资金是否会回流,这个值得关注。综上,我们将坚持中观到微观层面的精选个股策略。我们相对关注轨交、医药、化工、通讯等行业,仍会坚持在行业内精选个股,持续勤勉尽责地努力为投资者赚取业绩回报。

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投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

根据相关法律法规和基金合同的规定,本基金对上一年度及本年度应分配的可供分配利润进行了收益分配,具体情况参见年度报告正文7.4.8.2资产负债表日后事项及7.4.11利润分配情况。

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,本基金实施利润分配的金额为3,448,881.18元。

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)对交银施罗德环球精选价值证券投资基金2016年12月31日的资产负债表、2016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(2017)第20178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:交银施罗德环球精选价值证券投资基金
报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

姓名	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	12,816,813.45	5,202,004.01
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	85,673,428.11	87,160,169.42
其中:股票投资		85,673,428.11	87,160,169.42
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		1,101,594.65	672,420.39
应收利息	7.4.7.5	767.18	153.61
应收股利		106,583.52	58,880.05
应收申购款		1,405,575.37	10,795.49
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	1,011,779.49
资产总计		101,104,762.28	94,116,202.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债:			
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		-	512,228.40
应付赎回款		61,953.67	95,995.74
应付管理人报酬		149,555.87	140,089.97
应付托管费		29,080.28	27,239.71
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	70,185.31	1,109,523.11
负债合计		310,775.13	1,885,076.93
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	61,370,048.29	57,715,799.32
未分配利润	7.4.7.10	39,423,938.86	34,515,326.21
所有者权益合计		100,793,987.15	92,231,125.53
负债和所有者权益总计		101,104,762.28	94,116,202.46

注:1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.642元,基金份额总额61,370,048.29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:交银施罗德环球精选价值证券投资基金
本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一、收入		8,617,705.27	3,115,891.52
1.利息收入		10,264.60	24,911.80
其中:存款利息收入	7.4.7.11	10,264.60	24,911.80
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)		-236,795.89	6,704,242.02
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-1,908,714.43	4,862,614.69
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	15,417.31	37,185.37
股利收益	7.4.7.17	1,656,501.23	1,804,441.96
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	8,424,780.40	-4,228,941.01
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		411,862.31	579,269.78
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.19	7,593.85	36,408.93
减:二、费用		2,221,163.34	2,853,058.93
1. 管理人报酬		1,626,680.43	1,977,768.08
2. 托管费		316,299.02	384,566.04
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	206,124.03	369,516.29
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	72,059.86	121,208.52
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		6,396,541.93	262,832.59
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		6,396,541.93	262,832.59

7.3 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:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016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)	57,715,799.32	34,515,326.21	92,231,125.53
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,396,541.93	6,396,541.93
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)	3,654,248.97	1,960,951.90	5,615,200.87
其中:1.基金申购款	11,693,623.14	6,370,387.21	18,064,010.35
2.基金赎回款	-8,039,374.17	-4,409,435.31	-12,448,809.48
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)	-	-3,448,881.18	-3,448,881.18
五、期末所有者权益(基金净值)	61,370,048.29	39,423,938.86	100,793,987.15
项目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015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)	77,178,116.21	51,091,684.10	128,269,800.31
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	262,832.59	262,832.59
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)	-19,462,316.89	-11,826,398.82	-31,288,715.71
其中:1.基金申购款	22,400,523.59	17,113,080.84	39,513,604.43
2.基金赎回款	-41,862,840.48	-28,939,479.66	-70,802,320.14
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)	-	-5,012,791.66	-5,012,791.66
五、期末所有者权益(基金净值)	57,715,799.32	34,515,326.21	92,231,125.53

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:阮红,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]595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508,425,627.35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证行办法》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90%-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。本基金的投资组合为:股票资产占基金资产的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。

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2017年3月24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》、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金合同》、《交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金招募说明书》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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016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2016年12月31日的财务状况以及2016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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》,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》及其他相关境内外税务法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)目前基金取得的源自境外的股息收入,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,在境内不予征收营业税于2016年5月1日前)或增值税(自2016年5月1日起)且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。

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
上海直都投资管理有限公司	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

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,626,680.43	1,977,768.08
其中:支付销售机构的客户维护费	204,361.20	238,727.06

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	316,299.02	384,566.04

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

份额单位:份

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
报告期初持有的基金份额	23,951,843.25	22,986,750.67
报告期间申购/买入总份额	1,007,791.44	965,092.58
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	24,959,634.69	23,951,843.25
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	40.67%	41.50%

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。

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

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。

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	3,668,487.03	10,250.69	682,282.72	24,858.09
摩根大通银行	9,148,326.42	-2.11	4,519,721.29	0.06

注:本基金的银行存款分别由基金端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(2016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 期末持有的暂时性停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时性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2016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工具中属于第一层次的余额为85,673,428.11元,无属于第二层次和第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次87,160,169.42元,无属于第二层次和第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况