

交银施罗德环球精选价值证券投资基金 2010年年度报告摘要

2010年12月31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:二〇一一年三月二十八日

§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责任。
 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2011年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配方案、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或不实之处。
 本基金的过往业绩并不预示其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要自年度报告正文,投资者想了解详细内容,应阅读年度报告正文。
 本报告日期为2010年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

基金名称	交银施罗德精选价值(QDII)
基金主代码	510606
交易代码	510606
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	177,515,776.99份
基金合同期限	不定期
2.2 基金产品说明	
通过全球资产配置和灵活资产配置,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	自上而下资产配置,通过对全球宏观经济和各个经济体经济体的分析,在不同区域间进行资产配置,自下而上精选证券,挖掘全球市场中具备持续竞争优势的上市公司股票进行投资。
业绩比较基准	95%*标普全球大盘指数(S&P Global LargeCap Index)+30%*恒生指数
风险收益特征	本基金以股票及股票基金为主要投资对象,属于中高风险收益和波动率较高的证券投资基金,其预期风险和收益水平高于混合型基金和债券型基金,本基金在全球范围内进行资产配置,主要投资于全球范围内的股票市场和股票基金,本基金在资产配置、行业选择等方面与全球市场保持同步。

2.3 基金管理人及基金托管人

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
法定代表人	王忠文	尹弘
注册地址	上海市浦东新区银城中路200号	北京市西城区金融大街25号
办公地址	上海市浦东新区银城中路200号	北京市西城区金融大街25号
客服电话	400-700-5000	95533
网址	www.fund.com.cn	www.ccb.com.cn

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标和基金净值表现

项目	2010年	2009年	2008年
本期基金份额净值增长率	18.81%	37.06%	127.56%
本期基金份额净值增长率标准差	2.46%	2.65%	1.88%
期末基金份额净值	1.0000	0.6444	-0.0386
期末基金份额净值增长率	1.46%	72.31%	-2.70%
本期基金份额净值增长率标准差	0.44%	0.34%	-0.027
期末基金份额净值	282,962,604.01	400,363,770.72	297,326,188.57
期末基金份额净值增长率标准差	1.594	1.571	0.973

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

年份	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2008年	127.56%	127.56%
2009年	37.06%	37.06%
2010年	18.81%	18.81%

3.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

年份	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2008年	127.56%	127.56%
2009年	37.06%	37.06%
2010年	18.81%	18.81%

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金投资组合

4.1.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.1.2 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.2 基金投资组合报告

4.2.1 基金投资组合报告
 截至2010年12月31日,本基金资产组合如下:

项目	公允价值	占基金资产净值比例(%)
股票	145,485,782.18	81.99
债券	24,877,495.74	14.02
货币市场工具	7,309,818.19	4.12
其他资产	1,788,051.19	1.01

4.3 基金管理人及基金投资组合

4.3.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.4 基金管理人及基金投资组合

4.4.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.5 基金管理人及基金投资组合
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

值模型,由金融工程部门跟踪和验证,并可及时在各估值委员会及基金会计、风控、合规等部门审批,一致通过后,报公司投资决策委员会审批。
 估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后,及时召开估值委员会会议,及时修订估值方法,以保证估值准确。估值委员会成员包括首席估值师、风控部负责人、基金会计、基金运营部负责人、基金托管人等。
 4.3 基金管理人及基金投资组合
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.4 基金管理人及基金投资组合

4.4.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.5 基金管理人及基金投资组合

4.5.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.6 基金管理人及基金投资组合

4.6.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.7 基金管理人及基金投资组合

4.7.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.8 基金管理人及基金投资组合

4.8.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.9 基金管理人及基金投资组合

4.9.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.10 基金管理人及基金投资组合

4.10.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.11 基金管理人及基金投资组合

4.11.1 基金管理人及基金投资组合情况
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

4.12 基金管理人及基金投资组合
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

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。
 7.4.1 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
 7.4.1.1 通过关联方交易单元进行的交易
 7.4.1.2 通过关联方交易单元进行的交易
 7.4.1.3 关联方交易
 7.4.1.4 关联方交易

7.4.2 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	6,250,367.71	6,673,925.74
其中:支付赎回款项的客户申购	807,722.27	750,212.19

7.4.3 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.4 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.5 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.6 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.7 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.8 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.9 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.10 基金投资组合
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。

7.4.11 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.12 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.13 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.14 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.15 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.16 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.17 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.18 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.19 基金投资组合

项目	本期	上期
当期发生的基金资产净值	1,215,392.21	1,297,707.79

7.4.20 基金投资组合
 本基金的基金管理人交银施罗德基金管理有限公司,交银施罗德基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准,于2005年8月14日成立,为中外合资基金管理公司。公司注册地为上海,注册资本为2亿元人民币。截止2010年12月31日,公司受托管理公募基金和专户理财产品,共管理公募基金和专户理财产品共11只,资产管理规模人民币1,200.14亿元。