

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
(交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金)

2016 年第 3 季度报告

2016 年 9 月 30 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一六年十月二十五日

§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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2016 年 10 月 24 日复核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。

本基金管理人于 2016 年 6 月 7 日起至 2016 年 6 月 29 日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，就本基金转型相关事宜进行表决。本次基金份额持有人大会决议于 2016 年 6 月 30 日生效，本基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，以 2016 年 7 月 18 日为本基金分级份额终止运作转换基准日，2016 年 7 月 19 日正式实施基金转型。自 2016 年 7 月 19 日起，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2016 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制。其中，基金转型前的原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金报告期间为 2016 年 7 月 1 日起至 2016 年 7 月 18 日止，基金转型后的交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）报告期间为 2016 年 7 月 19 日起至 2016 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

基金简称	交银中证环境治理指数(LOF)
场内简称	环境治理
基金主代码	164908
交易代码	164908
基金运作方式	契约型开放式

基金合同生效日	2016年7月19日
报告期末基金份额总额	165,568,069.60份
投资目标	本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证环境治理指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证环境治理指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司

注：1、上表中“报告期末”指2016年9月30日。

2、本基金于2016年7月19日由交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF），新基金合同及托管协议即日起生效。

2.2 交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

基金简称	交银中证环境治理指数分级
场内简称	环境治理
基金主代码	164908
交易代码	164908
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年8月13日
报告期末基金份额总额	136,744,308.51份
投资目标	本基金采用指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。本基金力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。
投资策略	本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证环境治理指数中的成份股组成及其权重构建股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。在正常市场情况下，力争控制本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证环境治理指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，其预期风险与预期收益高于

	<p>混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计，不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额，其中交银环境治理份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银环境治理 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银环境治理 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征。</p>		
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	环境治理	环境 A	环境 B
下属分级基金的场内简称	环境治理	环境 A	环境 B
下属分级基金的交易代码	164908	150319	150320
报告期末下属分级基金的份额总额	136,114,196.51 份	315,056.00 份	315,056.00 份
下属分级基金的风险收益特征	交银环境治理份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征	交银环境 A 份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征	交银环境 B 份额具有高预期风险、高预期收益的特征

注：上表中“报告期末”指2016年7月18日。

§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

主要财务指标	报告期 (2016年7月19日- 2016年9月30日)	报告期 (2016年7月1日-2016年 7月18日)
1.本期已实现收益	-374,643.35	115,667.75
2.本期利润	5,215,841.33	3,930,816.32
3.加权平均基金份额本期利润	0.0362	0.0285
4.期末基金资产净值	165,033,826.30	129,801,055.46
5.期末基金份额净值	0.997	0.949

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、交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金从2016年7月19日起正式转型为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

(报告期：2016年7月19日-2016年9月30日)

3.2.1.1 本报告期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	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
2016年 7月19日- 2016年 9月30日	5.06%	1.31%	5.19%	1.31%	-0.13%	0.00%

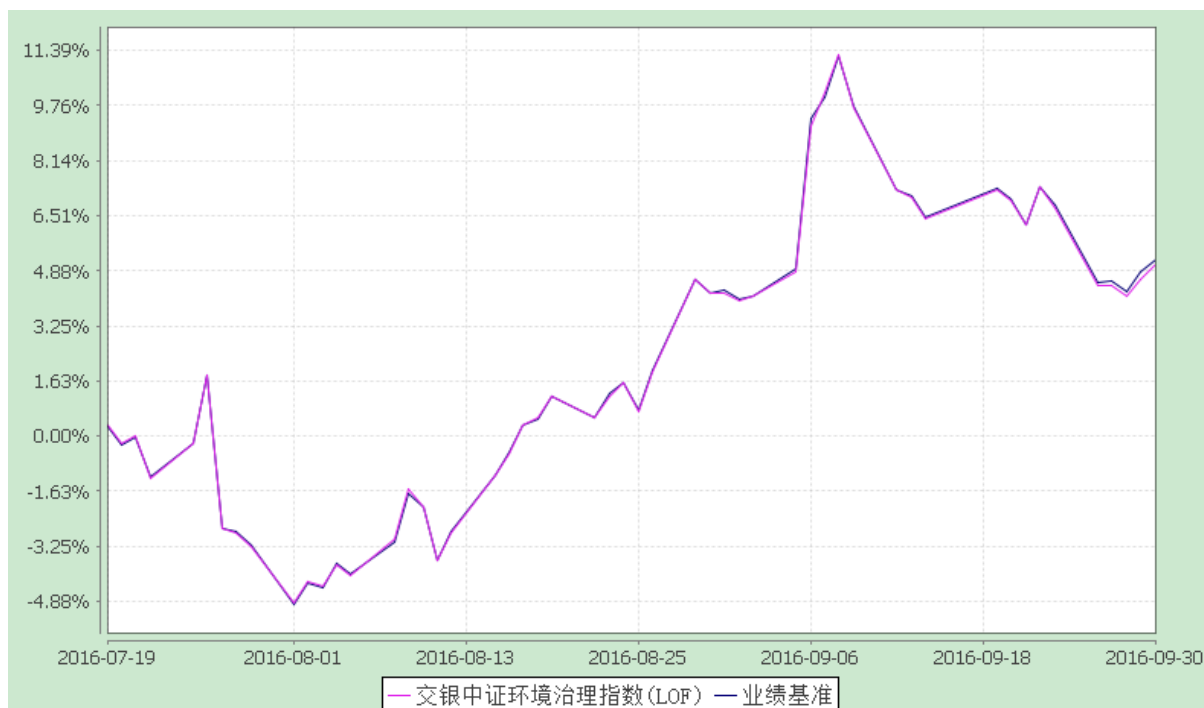
注：交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金从2016年7月19日起正式转型为交

银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)，本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为中证环境治理指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。。

3.2.1.2 自基金转型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

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
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

(2016年7月19日至2016年9月30日)



注：本基金由交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型而来。基金转型日为2016年7月19日，基金转型日至报告期期末，本基金转型时间未满一年。本基金的投资转型期为交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型实施日（即2016年7月19日）起的6个月。截至2016年9月30日，本基金尚处于投资转型期。

3.2.2 交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

(报告期：2016年7月1日-2016年7月18日)

3.2.2.1 本报告期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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率	①-③	②-④

			③	标准差 ④		
2016年 7月1日- 2016年 7月18日	3.04%	0.68%	3.08%	0.63%	-0.04%	0.05%

注：交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金从2016年7月19日起正式转型为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF)，本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为中证环境治理指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2.2 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

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金
 累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2015年8月13日至2016年7月18日）



注：本基金基金合同生效日为2015年8月13日，基金合同生效日至报告期期末，本基金运作时间未满一年。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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
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	2015-08-13	-	7年	<p>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日担任交银施罗德沪深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理。</p>

	网指数 (QDI I-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				
--	---	--	--	--	--

注：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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，基金投资管理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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。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没有超过该证券当日总成交量 5% 的情形，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出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2016 年三季度，国内宏观经济略有回升，通胀预期有所消退，货币政策仍然保持相对宽松的局面，但经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。A 股市场呈现出震荡格局，先扬后抑。随着无风险利率进一步下行，市场 7 月整体表现较强，行至 8 月中旬十年期国债收益率阶段性见底，市场随之出现一定程度的调整。作为跟踪中证环境治理指数的指数基金，在本季度总体呈现出震荡的走势。

展望四季度，国内经济已有所企稳，处于阶段性弱复苏期间，预计将继续维持温和增长的态势。四季度的 A 股市场有望阶段性好转，我们总体维持谨慎但不悲观的看法。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至 2016 年 9 月 30 日，交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)份额净值为 0.997 元，自 2016 年 7 月 19 日至 2016 年 9 月 30 日其份额净值增长率为 5.06%，同期业绩比较基准增长率为 5.19%。

截至 2016 年 7 月 18 日，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金份额净值为 0.949 元，自 2016 年 7 月 1 日至 2016 年 7 月 18 日其份额净值增长率为 3.04%，同期业绩比较基准增长率为 3.08%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5 投资组合报告

5.1 交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

(报告期：2016年7月19日-2016年9月30日)

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	156,022,901.59	93.31
	其中：股票	156,022,901.59	93.31
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	10,924,264.84	6.53
7	其他资产	257,704.82	0.15
8	合计	167,204,871.25	100.00

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.1.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	78,072,346.48	47.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,490,705.46	17.26
E	建筑业	8,299,925.52	5.03
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,706,450.00	2.25
N	水利、环境和公共设施管理业	37,453,474.13	22.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	156,022,901.59	94.54

5.1.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

5.1.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.1.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300072	三聚环保	131,420	5,729,912.00	3.47
2	300156	神雾环保	198,680	5,036,538.00	3.05
3	000925	众合科技	207,600	4,888,980.00	2.96
4	300203	聚光科技	142,600	4,690,114.00	2.84
5	300262	巴安水务	247,840	4,659,392.00	2.82
6	300090	盛运环保	436,942	4,627,215.78	2.80
7	600187	国中水务	754,571	4,617,974.52	2.80
8	300152	科融环境	503,400	4,495,362.00	2.72
9	002479	富春环保	325,600	4,463,976.00	2.70
10	002499	科林环保	184,540	4,438,187.00	2.69

5.1.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.1.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.1.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.1.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.1.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.1.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.1.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.1.11 投资组合报告附注

5.1.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.1.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.1.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	27,754.25
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,293.24
5	应收申购款	227,657.33
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	257,704.82

5.1.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.1.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.1.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002499	科林环保	4,438,187.00	2.69	重大事项

5.1.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
 本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.1.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
 由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

5.2 交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金 （报告期：2016年7月1日-2016年7月18日）

5.2.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	123,090,554.21	94.23
	其中：股票	123,090,554.21	94.23
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
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	银行存款和结算备付金合计	7,497,927.67	5.74
7	其他各项资产	35,603.74	0.03
8	合计	130,624,085.62	100.00

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-

B	采矿业	-	-
C	制造业	62,347,415.71	48.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,586,676.64	15.86
E	建筑业	6,386,950.00	4.92
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	3,271,268.00	2.52
N	水利、环境和公共设施管理业	30,498,243.86	23.50
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	123,090,554.21	94.83

5.2.2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

5.2.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.2.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300156	神雾环保	167,402	3,734,738.62	2.88
2	601388	怡球资源	165,000	3,679,500.00	2.83
3	000939	凯迪生态	380,948	3,542,816.40	2.73
4	300072	三聚环保	110,720	3,526,432.00	2.72
5	002340	格林美	405,800	3,502,054.00	2.70

6	300262	巴安水务	208,940	3,370,202.20	2.60
7	600526	菲达环保	238,700	3,341,800.00	2.57
8	002499	科林环保	156,740	3,280,568.20	2.53
9	603126	中材节能	271,700	3,271,268.00	2.52
10	000925	众合科技	175,000	3,267,250.00	2.52

5.2.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.2.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.2.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.2.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.2.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.2.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.2.11.2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.2.11.3 其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,469.24
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,134.50
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	35,603.74

5.2.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.2.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	136,744,307.51
基金合同生效日起至报告期期末期间基金总申购份额	53,323,631.01
减：基金合同生效日起至报告期期末期间基金总赎回份额	24,499,868.92
基金合同生效日起至报告期期末期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
报告期期末基金份额总额	165,568,069.60

注：1、上表中“报告期”指2016年7月19日至2016年9月30日；

2、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；

3、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。

单位：份

项目	环境治理	环境A	环境B
本报告期期初基金份额总额	137,528,747.28	315,056.00	315,056.00
本报告期期间基金总申购份额	5,152.32	-	-
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,419,703.09	-	-
本报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	136,114,196.51	315,056.00	315,056.00

注：上表中“报告期”指2016年7月1日至2016年7月18日。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	76,052,590.58
本报告期期间买入/申购总份额	-
本报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	76,052,590.58
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	45.93

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于2016年6月7日起至2016年6月29日以通讯方式召开了基金份额持有人大会，就本基金转型相关事宜进行表决。本次基金份额持有人大会决议于2016年6月30日生效，本基金管理人根据基金份额持有人大会的授权，以2016年7月18日为本基金分级份额终止运作转换基准日，2016年7月19日正式实施基金转型。自2016年7月19日起，《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）。详情请查阅本基金管理人于2016年5月30日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于以通讯方式召开交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会的公告》以及2016年7月1日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》；
- 3、《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》；
- 6、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金托管协议》；
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 9、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 10、关于申请募集注册交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金的法律意见书；
- 11、关于《申请交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金变更注册为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）》的法律意见；
- 12、报告期内交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式

投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件，或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com, www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话：400-700-5000（免长途话费），021-61055000，电子邮件：services@jysld.com。