

**交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金  
(LOF)  
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：中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业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。

## §2 基金产品概况

基金简称	交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)
场内简称	中国互联
基金主代码	164906
交易代码	164906
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)
基金合同生效日	2015 年 5 月 27 日
报告期末基金份额总额	498,293,275.45 份
投资目标	本基金紧密跟踪标的指数，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 0.5%，年跟踪误差不超过 5%。
投资策略	本基金为指数型基金，原则上采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照中证海外中国互联网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。
业绩比较基准	中证海外中国互联网指数收益率×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，属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。同时本基金为指数型基金，具有与标的指数相似的风险收益特征。
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
境外资产托管人英文名称	JPMorgan Chase Bank, National Association HONG KONG BRANCH
境外资产托管人中文名称	摩根大通银行香港分行

### §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1日-2016年9月30日)
1.本期已实现收益	6,664,200.03
2.本期利润	98,040,357.19
3.加权平均基金份额本期利润	0.1832
4.期末基金资产净值	521,182,772.44
5.期末基金份额净值	1.046

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 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③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	21.06%	1.01%	20.93%	1.34%	0.13%	-0.33%

### 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

交银施罗德中证海外中国互联网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  
(2015年5月27日至2016年9月30日)



注：本基金基金合同生效日为2015年5月27日，截至报告期期末，本基金已完成建仓但报告期期末距建仓结束未满一年。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)	2015-05-27	-	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

	<p>           )、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、         </p>				<p>           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>
--	--	--	--	--	---

	交银 中证 环境 治理 指数 (LO F) 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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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业绩表现说明

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。与此相比，海外市场三季度内表现强劲，受到英国脱欧影响，二季度末全球市场出现大幅调整，而在三季度全球主要市场均出现一定的上涨，充裕的流动性将市场的波动幅度进一步压缩。作为跟踪中证海外中国互联网指数的指数基金，在本季度获得了可观的涨幅。

展望四季度，在海外整体经济没有稳步向上的环境下，美联储加息进度持续低于预期，加上整体流动性最宽松阶段似乎已过，我们总体持较为谨慎的看法。

截至 2016 年 9 月 30 日，本基金份额净值为 1.046 元，本报告期份额净值增长率为 21.06%，同期业绩比较基准增长率为 20.93%。

#### 4.5 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 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（人民币元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	470,115,566.12	82.08
	其中：普通股	123,397,492.86	21.54
	存托凭证	346,718,073.26	60.53
	优先股	-	-

	房地产信托	-	-
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	84,993,729.50	14.84
8	其他资产	17,652,064.23	3.08
9	合计	572,761,359.85	100.00

注：本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家（地区）	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例（%）
美国	380,052,526.39	72.92
香港	90,063,039.73	17.28
合计	470,115,566.12	90.20

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。

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

### 5.3.1 报告期末指数投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
信息技术	345,621,242.31	66.31
非必需消费品	117,047,161.12	22.46
工业	7,447,162.69	1.43



合计	470,115,566.12	90.20
----	----------------	-------

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

### 5.3.2 报告期末积极投资按行业分类的股票及存托凭证投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

### 5.4 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及存托凭证投资明细

#### 5.4.1 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及存托凭证投资明细

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（人民币元）	占基金资产净值比例（%）
1	ALIBABA GROUP HOLDING-SP ADR	阿里巴巴集团控股有限公司	BABA US	美国证券交易所	美国	74,319	52,502,245.97	10.07
2	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	700 HK	香港证券交易所	香港	277,600	50,911,997.76	9.77
3	NetEase INC-ADR	网易公司	NTES US	美国证券交易所	美国	21,774	35,009,994.01	6.72
4	BAIDU INC - SPON ADR	百度	BIDU US	美国证	美国	28,445	34,584,200.32	6.64

				券交易所				
5	JD.COM INC-ADR	京东	JD US	美国证券交易所	美国	184,751	32,188,021.64	6.18
6	SINA CORP	新浪公司	SINA US	美国证券交易所	美国	47,617	23,476,227.34	4.50
7	VIPSHOP HOLDINGS LTD - ADS	唯品会控股有限公司	VIPS US	美国证券交易所	美国	222,813	21,827,502.56	4.19
8	CTRP.COM INTERNATIO	携程	CTRP US	美国证券交易所	美国	55,906	17,385,935.57	3.34
9	TAL EDUCATION GROUP-ADR	学而思教育集团	XRS US	美国证券交易所	美国	35,215	16,658,644.22	3.20
10	WEIBO CORP-SPON ADR	新浪微博	WB US	美国证券交	美国	46,448	15,551,946.58	2.98

				易 所				
--	--	--	--	--------	--	--	--	--

#### 5.4.2 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及存托凭证投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票及存托凭证。

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.7 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。

#### 5.8 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金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 5.9 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基金投资明细

本基金本报告期末未持有基金。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除京东（证券代码：JD US）外，未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。报告期内本基金投资的前十名证券之一京东（证券代码：JD US）的孙公司北京京东世纪信息技术有限公司在 2015 年 7 月 28 日至 2016 年 4 月 8 日期间，发生 89 次存在利用虚假的或者使人误解的价格手段，诱骗消费者或者其他经营者与其进行交易的价格违法行为。鉴于上述行为违反了《中华人民共和国价格法》，2016 年 5 月 25 日北京发改委以京发改价格处罚[2016]19 号《行政处罚决定书》对北京京东世纪信息技术有限公司作出警告和罚款 500,000 元的行政处罚。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

5.10.2 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。

### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（人民币元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,491.12
5	应收申购款	17,646,573.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	17,652,064.23

### 5.10.4 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。

### 5.10.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

#### 5.10.5.1 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的情况。

#### 5.10.5.2 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。

### 5.10.6 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	560,013,232.01
报告期期间基金总申购份额	72,167,824.48

减：报告期期间基金总赎回份额	133,887,781.04
报告期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	498,293,275.45

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。

## §7 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；本基金管理人本报告期末持有本基金份额0.00份，占本基金期末总份额的0.00%。

## §8 备查文件目录

### 8.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)募集注册的文件；
- 2、《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 3、《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- 4、《交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、关于申请募集注册交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)的法律意见书；
- 8、报告期内交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)在指定报刊上各项公告的原稿。

### 8.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

### 8.3 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](http://www.fund001.com), [www.bocomschroder.com](http://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。