

---

**交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金  
(LOF)**

**2020 年第 3 季度报告**

**2020 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：二〇二〇年十月二十八日

## §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2020年10月27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2020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 | 955,200,269.46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<br>(2020年7月1日-2020年9月30日) |
|----------------|-------------------------------|
| 1.本期已实现收益      | 141,480,203.67                |
| 2.本期利润         | 90,774,953.37                 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0914                        |
| 4.期末基金资产净值     | 1,733,240,372.19              |
| 5.期末基金份额净值     | 1.815                         |

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 | 4.91%  | 1.73%     | 4.64%      | 1.63%         | 0.27% | 0.10% |
| 过去六个月 | 41.69% | 1.77%     | 41.30%     | 1.67%         | 0.39% | 0.10% |

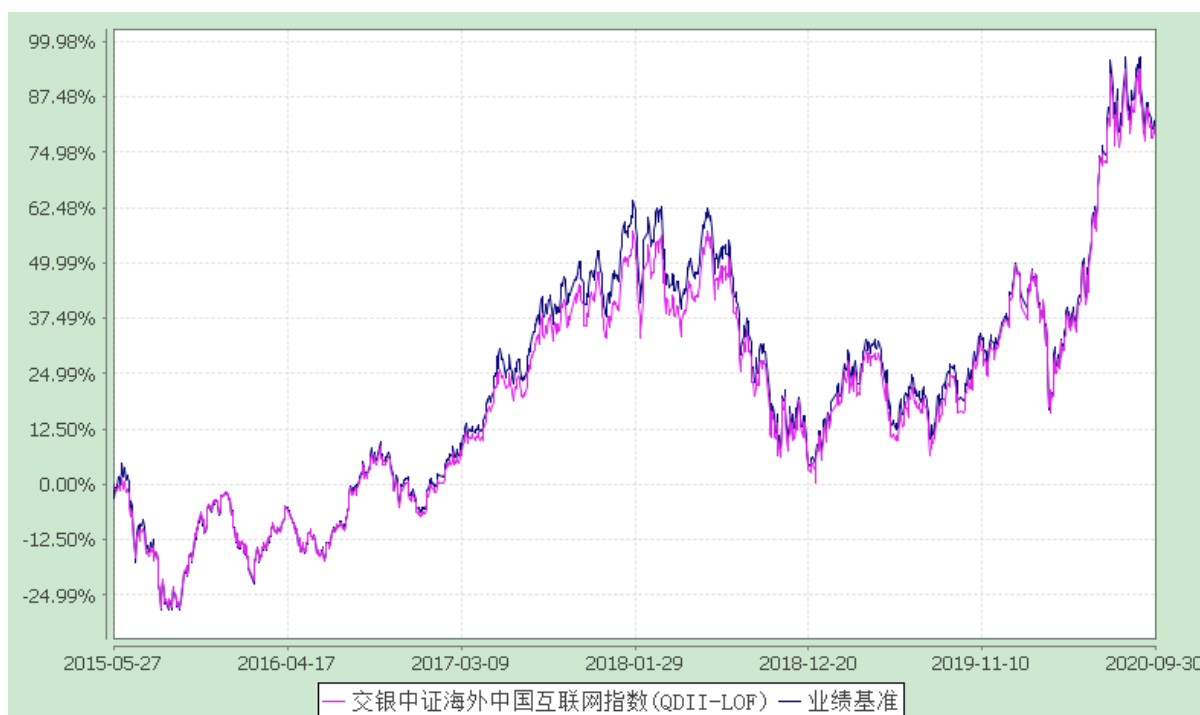
|            |         |       |         |       |        |       |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 过去一年       | 55.79%  | 1.82% | 52.60%  | 1.74% | 3.19%  | 0.08% |
| 过去三年       | 31.52%  | 1.74% | 27.77%  | 1.65% | 3.75%  | 0.09% |
| 过去五年       | 143.95% | 1.57% | 147.01% | 1.51% | -3.06% | 0.06% |
| 自基金合同生效起至今 | 81.50%  | 1.60% | 82.62%  | 1.57% | -1.12% | 0.03% |

注：本基金的业绩比较基准为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%，每日进行再平衡过程。其中中证海外中国互联网指数采用人民币价格，自2020年第三季度报告起追溯调整过往业绩比较基准收益率。

### 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2020年9月30日)



注：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 | 说明 |
|----|----|-------------|------|----|
|----|----|-------------|------|----|

|    |   | 任职日期       | 离任日期 | 年限  |  |
|----|---|------------|------|-----|--|
| 蔡铮 | 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(LO | 2015-05-27 | -    | 11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、量化投资部副总经理。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4月22日至2017年3月24日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理，2015年4月22日至2017年3月24日担任交银施罗德全球自然资源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。2018年5月18日至2020年7月17日担任交银施罗德致远量化智投策略定期开放混合型证券投资基金的基金经理。</p> |

|  |  |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|
|  | F)、交银创业板 50 指数的基金经理, 公司量化投资副总监兼多元资产管理副总监 |  |  |  |  |
|--|--|--|--|--|--|

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，基金整体运作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

2020 年三季度，全球范围内新冠疫情持续蔓延，每日新增确诊人数仍在高位徘徊。同时，像印度、巴西等发展中大国确诊人数开始快速上升，整体情况仍十分严峻。九月以来以西班牙、法国和英国为代表的欧洲区域疫情再度升级，部分国家可能会采取更为严格的封锁措施。叠加美国新一轮财政刺激迟迟无法推出，投资者担忧情绪升温，美股市场短期波动有所加大。作为跟踪中证海外中国互联网指数的指数基金，三季度基金总体呈现出震荡态势。

展望 2020 年四季度，海外疫情的持续导致全球经济复苏或将出现边际放缓趋势，同时美国大选等风险因素可能对短期市场产生一定冲击。为缓解疫情冲击，发达经济体未来或将进一步加大财政刺激的力度，货币宽松的趋势大概率仍将延续。国内方面，国内经济继续保持修复性增长，其中消费和出口上行趋势相对明显。考虑到海外疫情和美国大选等不确定性因素，我们总体上对于中国海外互联网板块的表现保持谨慎乐观的看法。

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的 |
|----|----|----|---------|
|----|----|----|---------|

|   |                   |                  | 比例(%)  |
|---|-------------------|------------------|--------|
| 1 | 权益投资              | 1,648,928,181.27 | 92.53  |
|   | 其中：普通股            | 492,242,617.49   | 27.62  |
|   | 存托凭证              | 1,156,685,563.78 | 64.91  |
|   | 优先股               | -                | -      |
|   | 房地产信托凭证           | -                | -      |
| 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      | 95,826,064.62    | 5.38   |
| 8 | 其他各项资产            | 37,220,450.05    | 2.09   |
| 9 | 合计                | 1,781,974,695.94 | 100.00 |

注：本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 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

金额单位：人民币元

| 国家（地区） | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|--------|------------------|--------------|
| 美国     | 1,175,422,960.91 | 67.82        |
| 香港     | 473,505,220.36   | 27.32        |
| 合计     | 1,648,928,181.27 | 95.14        |

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

金额单位：人民币元

| 行业类别     | 公允价值             | 占基金资产净值比例（%） |
|----------|------------------|--------------|
| 通信服务     | 613,855,604.71   | 35.42        |
| 非日常生活消费品 | 807,061,465.98   | 46.56        |
| 工业       | 17,473,838.10    | 1.01         |
| 房地产      | 76,449,290.48    | 4.41         |
| 医疗保健     | 103,318,379.74   | 5.96         |
| 信息技术     | 30,769,602.26    | 1.78         |
| 合计       | 1,648,928,181.27 | 95.14        |

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 Ltd | 阿里巴巴     | BABA US | 美国证券交易所 | 美国       | 91,965  | 184,116,983.05 | 10.62        |
| 2  | Tencent Holdings Ltd      | 腾讯控股     | 700 HK  | 香港证券交易所 | 香港       | 319,200 | 143,467,228.00 | 8.28         |

|   |                       |                      |            |                 |    |         |                |      |
|---|-----------------------|----------------------|------------|-----------------|----|---------|----------------|------|
|   |                       |                      |            | 易所              |    |         |                |      |
| 3 | Meituan               | 美团                   | 3690<br>HK | 香港<br>证券<br>交易所 | 香港 | 624,500 | 132,688,390.35 | 7.66 |
| 4 | JD.com Inc            | 京东<br>集团             | JD US      | 美国<br>证券<br>交易所 | 美国 | 238,609 | 126,112,458.82 | 7.28 |
| 5 | Pinduoduo<br>Inc      | 拼多<br>多              | PDD<br>US  | 美国<br>证券<br>交易所 | 美国 | 174,599 | 88,167,067.59  | 5.09 |
| 6 | KE Holdings<br>Inc    | 贝壳                   | BEKE<br>US | 美国<br>证券<br>交易所 | 美国 | 183,130 | 76,449,290.48  | 4.41 |
| 7 | Trip.com<br>Group Ltd | 携程<br>集团<br>有限<br>公司 | TCOM<br>US | 美国<br>证券<br>交易所 | 美国 | 324,736 | 68,865,631.49  | 3.97 |
| 8 | Baidu Inc             | 百度                   | BIDU<br>US | 美国<br>证券<br>交易所 | 美国 | 78,284  | 67,487,897.32  | 3.89 |

|    |                                |         |        |         |    |           |               |      |
|----|--------------------------------|---------|--------|---------|----|-----------|---------------|------|
| 9  | Alibaba Health Information Tec | 阿里健康    | 241 HK | 香港证券交易所 | 香港 | 3,992,000 | 66,227,248.03 | 3.82 |
| 10 | TAL Education Group            | 好未来教育集团 | TAL US | 美国证券交易所 | 美国 | 127,673   | 66,114,186.83 | 3.81 |

#### 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）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）于2020年5月27日披露，根据北京市市场监督管理局开出的京市监价处罚〔2020〕5号决定书，京东因为存在“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，被警告以及作出50万元罚款的行政处罚。

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 名称      | 金额            |
|----|---------|---------------|
| 1  | 存出保证金   | -             |
| 2  | 应收证券清算款 | 30,842,708.60 |
| 3  | 应收股利    | -             |
| 4  | 应收利息    | 8,047.38      |
| 5  | 应收申购款   | 6,369,694.07  |
| 6  | 其他应收款   | -             |
| 7  | 待摊费用    | -             |
| 8  | 其他      | -             |
| 9  | 合计      | 37,220,450.05 |

### 5.10.4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期末投资的股票存在流通受限情况的说明

#### 5.10.5.1 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 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               | 1,121,146,096.48 |
| 报告期期间基金总申购份额              | 284,679,321.90   |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 450,625,148.92   |
| 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               | 955,200,269.46   |

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))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](mailto:services@jysld.com)。