交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之E金融A与E金融B基金份额上市交易公告书

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
注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司
上市地点:深圳证券交易所
上市时间:2015年7月8日
公告日期:2015年7月3日

一、重要声明与提示

《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之E金融A与E金融B基金份额上市交易公告书》(以下简称“本公告”)依据《中华人民共和国证券投资基金法》(以下简称“《基金法》”)、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第1号<上市交易公告书的内容与格式>》和《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》的规定编制,交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金(以下简称“本基金”)基金管理人交银施罗德基金管理有限公司(以下简称“本公司”)的董事会及董事保证本公告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。本基金托管人中国建设银行股份有限公司保证本公告中基金财务会计资料等内容的真实性、准确性和完整性,承诺其中不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、深圳证券交易所对本基金之E金融A与E金融B基金份额上市交易及有关事项的意见,均不表明对本基金的任何保证。凡本公告未涉及的有关内容,请投资者详细查阅刊登在2015年6月11日《中国证券报》、2015年6月12日《上海证券报》和2015年6月15日《证券时报》以及本公司网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)上的《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金招募说明书》。

二、基金概览

1、基金名称:交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金
2、基金类型:股票型
3、基金运作方式:契约型开放式
4、本基金的基金份额包括本基金之基础份额(即“交银互联网金融份额”,场内简称“E金融”,基金代码:164907)、稳健收益类份额(即“交银互联网金融A份额”,场内简称“E金融A”,基金代码:150317)与积极收益类份额(即“交银互联网金融B份额”,场内简称“E金融B”,基金代码:150318)。其中,交银互联网金融A份额、交银互联网金融B份额的基金份额配比始终保持1∶1的比例不变。
5、基金存续期限:不定期。
6、交银E金融A份额、交银E金融B份额与交银互联网金融份额的资产合并投资运作。
7、本基金通过场外、场内两种方式公开发售。投资者场外认购所得的份额,将被确认为场外交银互联网金融份额;投资者场内认购所得的全部份额将按1∶1的基金份额配比自动分离为交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额,场内认购份额的自动分离由基金管理人委托登记机构进行,无需基金份额持有人申请。
8、交银互联网金融份额设置单独的基金代码,只可以进行场内与场外的申购和赎回,不上市交易。交银互联网金融A份额(场内简称“E金融A”,交易代码:150317)与交银互联网金融B份额(场内简称“E金融B”,交易代码:150318)可在深圳证券交易所上市交易,但不可进行申购或赎回。
9、交银互联网金融份额的申购与赎回:投资者可通过场外或场内两种方式申购或赎回交银互联网金融份额(场内简称“E金融”,基金代码:164907)。场外申购和赎回业务的场所为基金管理人的直销机构和除基金管理人之外的其他场外销售机构。场内申购和赎回业务的场所为具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可、通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所会员单位,具体销售网点和会员单位的名单由基金管理人在招募说明书或其他公告中列明。交银互联网金融A份额与交银互联网金融B份额只上市交易,不接受申购和赎回。
10、场内份额配对转换:场内份额配对转换是指本基金场内的交银互联网金融份额与分级份额之间进行转换的行为,包括分拆与合并。分拆指基金份额持有人将其持有的每2份场内的交银互联网金融份额申请转换成1份交银互联网金融A份额与1份交银互联网金融B份额的行为。合并指基金份额持有人将其持有的每1份交银互联网金融A份额与1份交银互联网金融B份额申请转换成2份交银互联网金融份额的场内份额的行为。
11、基金份额折算:基金份额定期折算的频率为每年折算1次(基金合同约定的特殊情形除外)。基金份额不定期折算的条件是交银互联网金融份额的基金份额净值大于或等于1.500元,或交银互联网金融B份额的基金份额参考净值小于或等于0.250元。有关基金份额折算的约定,参见基金合同“第二十一部分 基金份额折算”。定期折算基准日或不定期折算基准日的具体日期,详见基金管理人届时发布的公告。
12、基金份额总额:截至2015年7月1日,本基金的份额总额为441,570,114.09份;其中,交银互联网金融份额为323,568,752.09份;交银互联网金融A份额为59,000,681.00份;交银互联网金融B份额为59,000,681.00份。
13、基金份额净值:截至2015年7月1日,交银互联网金融份额的基金份额净值为1.000元,交银互联网金融A份额的基金份额参考净值为1.001元,交银互联网金融B份额的基金份额参考净值为0.999元。
14、本次上市交易的基金份额简称及交易代码:E金融A,交易代码:150317;E金融B,交易代码:150318。
15、本次上市交易份额:E金融A:59,000,681.00份;E金融B:59,000,681.00份。
16、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所
17、上市交易日期:2015年7月8日
18、基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
19、基金托管人:中国建设银行股份有限公司
20、本次上市交易的基金份额注册登记机构:中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司

三、基金的募集与上市交易

(一)本基金上市前基金募集情况
1、基金募集申请的核准机构和核准文号:中国证监监督管理委员会2015年5月20日证监许可[2015]941号
2、基金运作方式:契约型开放式
3、基金存续期限:不定期
4、发售日期:自2015年6月16日至2015年6月19日
5、发售价格:1.00元人民币
6、发售方式:场内、场外认购
7、发售机构:
(1)场内销售机构
具有基金销售业务资格、经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的、通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的深圳证券交易所场内会员单位。
(2)场外销售机构
①直销机构
交银施罗德基金管理有限公司及其网上直销交易平台。
②除基金管理人之外的其他场外销售机构
中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、光大证券股份有限公司、中信建设证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、中万宏源证券股份有限公司、国都证券有限责任公司、中信证券(浙江)有限责任公司、中信证券(山东)有限责任公司、齐鲁证券有限公司、江海证券有限公司、中国国际金融有限公司、国金证券股份有限公司、信达证券股份有限公司、西南证券股份有限公司、中国中投证券有限责任公司、华融证券股份有限公司、安信证券股份有限公司、中万宏源西部证券有限公司、天相投资顾问有限公司、杭州数米基金销售有限公司、深圳众禄基金销售有限公司、诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司、和讯信息科技有限公司、上海天天基金销售有限公司、北京钱景财富投资管理有限公司、北京展恒基金销售有限公司、一路财富(北京)信息科技有限公司。
8、验资机构名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
9、募集资金总额及入账情况:本次募集的有效认购户数为5,920户,净认购金额为人民币441,524,789.06元,折合基金份额441,524,789.06份;在募集期间有效认购申请确认金额产生的银行利息共计人民币45,325.03元,折合基金份额45,325.03份。上述有效净认购资金及利息已于2015年6月25日全额划入本基金在基金托管人中国建设银行股份有限公司开立的交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金托管专户。
本基金通过场外、场内两种方式公开发售,按照份额分配原则,基础份额1.00元计算,本基金募集期间含本息共募集441,570,114.09份基金份额,本基金场内认购的基金份额(本息)确认为118,001,362.00份,场外认购的基金份额(本息)确认为323,568,752.09份。
10、本基金募集备案情况
本基金已于2015年6月25日验资完毕,向中国证监会提交了验资报告,办理基金备案手续,并于2015年6月26日获书面确认,本基金《基金合同》自该日起正式生效。
11、基金合同生效日:2015年6月26日
12、基金合同生效日的基金份额总额:441,570,114.09份
(二)本基金上市交易的主要内容
1、基金上市交易的核准机构和核准文号:深圳证券交易所深证上[2015]331号
2、上市交易日期:2015年7月8日
3、上市交易的证券交易所:深圳证券交易所。投资者在深圳证券交易所各会员单位证券营业部均可参与基金交易。
4、基础份额简称及基金代码:交银互联网金融份额,场内简称:E金融,基金代码:164907。
5、上市交易份额简称及交易代码:E金融A,交易代码:150317;E金融B,交易代码:150318。
6、本次上市交易份额:E金融A:59,000,681.00份;E金融B:59,000,681.00份
7、基金净值的披露:基金管理人每个估值日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算,基金托管人复核。本基金上市交易后,自2015年7月8日起,基金管理人于每个工作日交易结束后将经过基金托管人复核的E金融A及E金融B的基金份额参考净值以及自基金开放日常申购、赎回后将经过基金托管人复核的交银互联网金融份额的基金份额净值传送给深圳证券交易所,深圳证券交易所于下个工作日通过行情系统揭示。
8、未上市交易份额的流通规定:对于托管在场内的交银互联网金融份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其分拆为E金融A份额和E金融B份额即可上市流通;对于托管在场外的份额,基金份额持有人在符合相关办理条件的前提下,将其跨系统转托管至深圳证券交易所场内后分拆为E金融A份额和E金融B份额即可上市流通。
(三)本基金的转托管
本基金开通转托管业务日期:2015年7月8日,具体业务按照中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规定。

四、持有人户数、持有人结构及前十名持有人情况

(一)基金份额持有人户数
截至2015年7月1日,交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金的持有人总户数为5,920户,平均每户持有的基金份额为74,589.55份;场外交银互联网金融份额5,134户,平均每户持有的基金份额为63,024.69份;场内交银E金融A份额786户,平均每户持有的基金份额为75,064.48份;场内交银E金融B份额786户,平均每户持有的基金份额为75,064.48份。
(二)基金份额持有人结构
1、截至2015年7月1日,场内基金份额持有人结构如下:
E金融A:机构投资者持有的基金份额4,075,081.00份,占比6.91%;个人投资者持有的基金份额54,925,600.00份,占比93.09%。
E金融B:机构投资者持有的基金份额4,075,082.00份,占比6.91%;个人投资者持有的基金份额54,925,599.00份,占比93.09%。
2、截至2015年7月1日,基金管理人的从业人员持有本基金的情况如下:

项目	份额级别	持有基金份额总数(份)	占基金总份额的比例(%)
基金管理公司所有从业人员持有本基金	交银互联网金融份额	0	0
	E金融A	–	–
	E金融B	–	–
	合计	0	0

截至2015年7月1日,本基金管理人的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人、基金经理未认购本基金。
(三)截至2015年7月1日,E金融A基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额数	占E金融A基金份额的比例(%)
1	李怡名	12,500,243.00	21.19%
2	东方汇智–光大银行–东方汇智资产管理有限公司	2,500,048.00	4.24%
3	富安达基金–海通证券–富安达–东海恒信6期资产管理计划	1,500,029.00	2.54%
4	张宏	1,000,019.00	1.69%
5	吴斌	600,035.00	1.02%
6	林利	550,032.00	0.93%
7	庞元辉	500,029.00	0.85%
8	管飞	500,029.00	0.85%
9	刘秀珍	500,029.00	0.85%
10	江勇	500,010.00	0.85%
合计		20,650,503.00	35.00%

截至2015年7月1日,E金融B基金份额前十名持有人情况

序号	基金份额持有人名称	持有基金份额数	占E金融B基金份额的比例(%)
1	李怡名	12,500,243.00	21.19%
2	东方汇智–光大银行–东方汇智资产管理有限公司	2,500,049.00	4.24%
3	富安达基金–海通证券–富安达–东海恒信6期资产管理计划	1,500,029.00	2.54%
4	张宏	1,000,019.00	1.69%
5	吴斌	600,034.00	1.02%
6	林利	550,032.00	0.93%
7	庞元辉	500,029.00	0.85%
8	管飞	500,029.00	0.85%
9	刘秀珍	500,029.00	0.85%
10	杨荣凤	500,010.00	0.85%
合计		20,650,503.00	35.00%

注:以上信息依据中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司提供的持有人信息编制。由于四舍五入的原因,占场内总份额比例分项之和与合计可能有尾差。

五、基金主要当事人简介

(一)基金管理人
1、公司概况
名称:交银施罗德基金管理有限公司
法定代表人:阮红(代任)
设立日期:2005年8月4日
注册资本:2亿元人民币
住所:上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层(裙)
办公地址:上海市浦东新区世纪大道8号国金中心二期21–22楼
设立批准文号:中国证监会证监基金字[2005]128号
工商登记注册的法人营业执照文号:310000400579595号
经营范围:基金募集、基金销售、资产管理和中国证监会许可的其它业务。
存续期间:持续经营
电话:(021)61055050
传真:(021)61055034
2、股东及其出资比例

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

3、内部组织结构及职能
本基金管理人公司治理结构完善,经营运作规范,能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会、提名与薪酬委员会两个专业委员会,有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况,制定相应的政策,并充分发挥独立董事的职能,切实加强对公司运作的监督。
公司监事会由四位监事组成,主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。
公司总体经营管理由总经理负责、下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会,其中投资决策委员会包括公募基金(除QDII)投资决策委员会、QDII投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长,监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究条线下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部、量化投资部、跨境投资部、投资运营部。中央交易室隶属总经理直接管理。市场条线下设产品开发部、营销策划部、零售理财部、营销管理部、机构理财部、上海营销中心、北京分公司、广州分公司、西部营销中心。营运条线下设财务部、基金运营部与信息技术部。综合管理条线下设人力资源部和行政部。监察风控条线下设监察稽核部、风险管理部、法务部,由督察长协同总经理直接管理。此外,根据业务需要,增设了战略发展部、总裁办公室。本公司下设有交银施罗德资产管理有限公司和交银施罗德资产管理(香港)有限公司。
4、人员情况
截止到2015年6月30日,公司有员工226人,其中55%的员工具有硕士以上学历。
5、信息披露负责人:孙艳
电话:021–61055050
6、基金管理业务情况
截止到2015年6月30日,公司已经发行并管理了46只基金,包括2只货币市场基金、13只债券型基金、9只混合型基金、3只保本混合型基金、19只股票型基金(其中3只为QDII基金,2只为交易型开放式基金(ETF),2只为ETF联接基金)。
7、本基金基金经理简介
蔡铮先生,基金经理。复旦大学电子工程硕士。6年证券从业经验。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。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。2012年12月27日起担任上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金和交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理至今,2015年3月26日起担任交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金经理至今,2015年4月22日起担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金、交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理至今,2015年5月27日起担任交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)基金经理至今,2015年6月26日起担任交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理至今。
(二)基金托管人
1、基本情况
名称:中国建设银行股份有限公司(简称:中国建设银行)
住所:北京市西城区金融大街25号
办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人:王洪章
成立时间:2004年09月17日
组织形式:股份有限公司
注册资本:贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间:持续经营
基金托管资格批文及文号:中国证监会证监基字[1998]12号
信息披露联系人:田青
联系电话:(010) 67595096
中国建设银行拥有悠久的经营历史,其前身“中国人民建设银行”于1954年成立,1996年易名为“中国建设银行”。中国建设银行是中国四大商业银行之一。中国建设银行股份有限公司由原中国建设银行于2004年9月分立而成立,承继了原中国建设银行的商业银行业务及相关的资产和负债。中国建设银行(股票代码:939)于2005年10月27日在香港联合交易所主板上市,是中国四大商业银行中首家在海外公开上市的银行。2006年9月11日,中国建设银行又作为第一家H股公司晋身恒生指数。2007年9月25日中国建设银行A股在上海证券交易所上市并开始交易。A股发行后中国建设银行的已发行股份总数为:250,010,977,486股(包括240,417,319,880股H股及9,593,657,606股A股)。
2014年上半年,本集团实现利润总额1,695.16亿元,较上年同期增长9.23%;净利润1,309.70亿元,较上年同期增长9.17%。营业收入2,870.97亿元,较上年同期增长14.20%;其中,利息净收入增长12.59%,净利息收益率(NIM)2.80%;手续费及佣金净收入增长8.39%,在营业收入中的占比达20.96%。成本收入比24.17%,同比下降0.45个百分点。资本充足率与核心一级资本充足率分别为13.89%和11.21%,同业领先。
截至2014年6月末,本集团资产总额163,997.90亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户贷款和垫款总额91,906.01亿元,增长6.99%;负债总额152,527.78亿元,较上年末增长6.75%,其中,客户存款总额129,569.56亿元,增长6.00%。
截至2014年6月末,中国建设银行公司机构客户326.89万户,较上年末增加20.35万户,增长6.64%;个人客户近3亿户,较上年末增加921万户,增长3.17%;网上银行客户1.67亿户,较上年末增长9.23%,手机银行客户数1.31亿户,增长12.56%。
截至2014年6月末,中国建设银行境内营业机构总量14,707个,服务覆盖面进一步扩大;自助设备72,128台,较上年末增加3,115台。电子银行和自助渠道账务性交易量占比达86.55%,较上年末提高1.15个百分点。
2014年上半年,本集团各方面良好表现,得到市场与业界广泛认可,先后荣获国内外知名机构授予的40余个重要奖项。在英国《银行家》杂志2014年“世界银行1000强排名”中,以一级资本总额位列全球第2,较上年上升3位;在美国《福布斯》杂志2014年全球上市公司2000强排名中位列第2;在美国《财富》杂志世界500强排名第38位,较上年上升12位。
中国建设银行总行设投资托管业务部,下设综合处、基金市场处、证券保险资产市场处、理财信托股权市场处、OFII托管处、养老金托管处、清算处、核算处、监督稽核处等9个职能处室,在上海设有投资托管服务上海备份中心,共有员工240余人。自2007年起,托管部连续聘请外部会计师事务所对托管业务进行内部控制审计,并已经成为常规化的内控工作手段。
2. 主要人员情况
赵观甫,投资托管业务部总经理,曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作,并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务,长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
纪伟,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部,长期从事大多产的客户管理及服务工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张军红,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室,长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
张力铮,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部,并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务,长期从事信贷业务和集团客户业务等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
黄秀莲,投资托管业务部副总经理,曾就职于中国建设银行总行会计部,长期从事托管业务管理等工作,具有丰富的客户服务和业务管理经验。
3. 基金托管业务经营情况
作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行,中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念,不断加强风险管理和内部控制,严格履行托管人的各项职责,切实维护资产持有人的合法权益,为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展,中国建设银行托管资产规模不断扩大,托管业务品种不断增加,已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系,是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2014年9月末,中国建设银行已托管389只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平,赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”;获和讯网的中国“最佳资产托管银行”奖;境内权威经济媒体《每日经济观察》的“最佳基金托管银行”奖;中央国债登记结算有限责任公司的“优秀托管机构”奖。
(三)基金验资机构
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
首席合伙人:杨绍信
电话:(021)23238888
传真:(021)23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:汪棵、沈兆杰

六、基金合同摘要

基金合同的内容摘要见附件。

七、基金财务状况(未经审计)

(一)本基金募集期间相关费用明细
深圳证券交易所在交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金认购期间未收取任何费用。其他各基金销售机构根据本基金《招募说明书》设定的认购费率或佣金比率收取认购费。
本基金募集期间的信息披露费、会计师费、律师费以及其他费用,不从基金财产中列支。
(二)本基金发售后至本公告书公告前的重要财务事项
本基金发售后至上市交易公告书公告前无重要财务事项发生。
(三)本基金2015年7月1日资产负债表(未经审计)如下:

资产负债表(除特别注明外,单位为人民币元)

资产	本期末(2015年7月1日)
资产:	
银行存款	441,543,217.28
结算备付金	–
存出保证金	–
交易性金融资产	–
其中:股票投资	–
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	–
买入返售金融资产	–
应收证券清算款	–
应收利息	68,286.90
应收股利	–
应收申购款	–
递延所得税资产	–
其他资产	27,531.48
资产总计	441,639,035.66
负债及所有者权益	
负债:	
短期借款	–
交易性金融负债	–
衍生金融负债	–
卖出回购金融资产款	–
应付证券清算款	–
应付赎回款	–
应付管理人报酬	60,490.17
应付托管费	13,307.84
应付销售服务费	–
应付交易费用	–
应交税费	–
应付利息	–
应付利润	–
递延所得税负债	–
其他负债	9,781.22
负债合计	83,579.23
所有者权益:	
实收基金	441,570,114.09
未分配利润	−14,657.66
所有者权益合计	441,555,456.43
负债及所有者权益总计	441,639,035.66

注:报告截止日2015年7月1日,E金融份额的基金份额净值1.000元,E金融A份额的基金份额参考净值1.001元,E金融B份额的基金份额参考净值0.999元;E金融份额323,568,752.09份,E金融A份额59,000,681.00份,E金融B份额59,000,681.00份。

八、基金投资组合

截至2015年7月1日,本基金的投资组合如下:
(一)报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	–	–
	其中:股票	–	–
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	441,543,217.28	99.98
7	其他各项资产	95,818.38	0.02
8	合计	441,639,035.66	100.00

(二)报告期末按行业分类的股票投资组合
1、报告期末指数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指数投资的股票。
2、报告期末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。
(三)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细
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
本基金本报告期末未持有指数投资的股票。
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。
(四)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。
(五)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
(六)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。
(七)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。
(八)报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
(九)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。
(十)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。
(十一)投资组合报告附注
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。
2. 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
3. 其他各项资产构成:

序号	名称	金额(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	68,286.90
5	应收申购款	–
6	其他应收款	27,531.48
7	待摊费用	–
8	其他	–
9	合计	95,818.38

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. 报告期末基金投资的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。
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,分项之和与合计项可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定,以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。
(二)真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件,披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息,并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。
(三)在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后,将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺:
(一)严格遵守《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定,设立专门的基金托管部,配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。
(二)根据《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定,对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值和基金份额净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。
(三)基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他相关法律法规、基金合同及托管协议的规定,将及时以通知基金管理人限期纠正,督促基金管理人改正。
(四)基金托管人发现基金管理人有重大违规行为,将立即报告中国证监会,同时通知基金管理人限期纠正,并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十三、备查文件目录

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所,在办公时间可供免费查阅。
(一)中国证监会核准交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金募集的文件;
(二)《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金合同》;
(三)《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金招募说明书》;
(四)《交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金托管协议》;
(五)关于募集交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金之法律意见书;
(六)基金管理人业务资格批件、营业执照;
(七)基金托管人业务资格批件、营业执照;
(八)中国证监会要求的其他文件。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一五年七月三日

附件:基金合同内容摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务
(一)基金管理人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的权利包括但不限于:
(1)依法募集资金;
(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;
(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;
(4)销售基金份额;
(5)按照规定召集基金份额持有人大会;
(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(7)在基金托管人更换时,提名新的基金托管人;
(8)选择、更换基金销售机构,对基金销售机构的相关行为进行监督和处理;
(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金登记机构办理基金登记业务并获得《基金合同》规定的费用;
(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;
(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理交银互联网金融份额申购与赎回申请;
(12)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;
(13)在法律法规允许的前提下,为基金的利益依法为基金进行融资融券和转融通;
(14)以基金管理人的名义,代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为;
(15)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商、期货经纪机构或其他为基金提供服务的外部机构;
(16)在符合有关法律、法规的前提下,制定和调整有关基金认购、申购、赎回、转换、上市交易、份额配对转换等的业务规则;
(17)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他权利。
(二)基金管理人的义务
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金管理人的义务包括但不限于:
(1)依法募集资金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;
(2)办理基金备案手续;
(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;
(4)配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策,以专业化的经营方式管理和运作基金财产;
(5)建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;
(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三运作基金财产;
(7)依法接受基金托管人的监督;
(8)采取适当合理的措施使计算交银互联网金融份额的认购、申购、赎回和注销价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告基金资产净值、交银互联网金融份额、交银互联网金融A份额和交银互联网金融B份额的基金份额(参考)净值,确定交银互联网金融基金份额申购、赎回的价格;
(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;
(10)编制季度、半年度和年度基金报告;
(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;
(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,在基金信息公开披露前应予保密,不向他人泄露;
(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;
(14)按规定受理交银互联网金融份额的申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;
(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会;
(16)按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料15年以上;
(17)确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出,并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式,随时查阅到与基金有关的公开资料,并在支付合理成本的条件下得到有关资料的复印件;
(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;
(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会并通知基金托管人;
(20)因违反《基金合同》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;
(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;
(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方处理有关基金事务的行为承担责任;
(23)以基金管理人名义,代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为;
(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用,将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在基金募集期结束后30日内退还基金认购人;
(25)执行生效的基金份额持有人大会的决议;
(26)建立并保存基金份额持有人名册;
(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。
(三)基金托管人的权利
根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定,基金托管人的权利包括但不限于:
(1)自《基金合同》生效之日起,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;
(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他费用;
(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,应呈报中国证监会,并采取必要措施保护基金投资者的利益;
(4)根据相关市场规则,为基金开设资金账户、证券账户等投资所需账户,为基金办理证券交易资金清算;
(5)提议召开或召集基金份额