

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF) 2018年半年度报告摘要

2018年6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:二〇一八年八月二十五日

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。
本半年度报告已经3次以上独立会计师事务所审阅,并由普华永道会计师事务所、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2018年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合等内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失或收益一定增长。
基金的投资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及其更新。
本半年度报告摘要自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应请读半年度报告正文。
本报告期指2018年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介
2.1 基金基本情况
基金名称:交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
基金代码:160908
基金简称:160908
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
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
报告期末基金份额总额:153,270,743.81
基金份额持有人户数:74,139

注: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),新基金合同及申购赎回日期自生效,本表列示的基金合同生效日及本报告列示的转型生效日均指2016年7月19日。

2.2 基金产品说明
基金类别:股票型证券投资基金
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
基金合同生效日:2016年7月19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
报告期末基金份额总额:153,270,743.81
基金份额持有人户数:74,139

2.3 基金管理人及基金托管人
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

2.4 信息披露方式
基金管理人网站:www.fund001.com
基金年度报告披露后,基金管理人网站披露

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要会计数据和财务指标
金额单位:人民币元

项目	报告期 2018年1月1日至2018年6月30日	本报告期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
3.1.1 期间数据和指标			
本期已实现收益	-12,409,114.73		
本期利润	-41,658,518.02		
加权平均基金份额本期利润	-0.2710		
本基金份额净值增长率	-29.41%		
3.1.2 期末资产负债情况			
期末基金份额净值	1.0000		
期末基金资产净值	98,798,368.00		
期末基金份额总额	153,270,743.81		

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列示数字。

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。

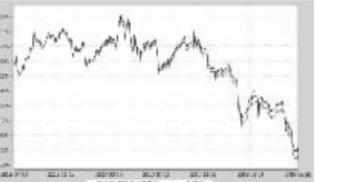
3.2 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	基金份额净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去一个月	-11.83%	1.95%	-11.33%
过去三个月	-20.77%	1.46%	-19.79%
过去六个月	-29.41%	1.51%	-27.84%
过去一年	-35.64%	1.30%	-33.82%
自基金合同生效以来	-32.48%	1.26%	-29.90%

注:本基金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%,每日进行净值平衡。

3.2.2 本基金转型为以基金份额净值增长率为基准的业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金(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2018年6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,本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%,每日进行净值平衡。

4 管理人报告
4.1 基金管理人及基金经理情况
4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验
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,由交银施罗德基金管理有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国银河投资管理有限公司共同发起设立,公司成立于2005年8月4日,注册地在上海,注册资本金为2亿元人民币,其中,交通银行股份有限公司持有65%的股份,施罗德投资管理有限公司持有30%的股份,中国银河投资管理有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末,公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通股票型和股票型在內的81只基金,其中股票型公募基金普通股票型、交易型开放式(ETF)、QDII等不同类型的基金。

4.1.2 基金基金经理(助理)及基金经理助理的简介

姓名	职务	在本基金基金经理(助理)任期	证券从业年限	说明
魏庆生	基金经理	2016-07-19	9年	魏庆生,中国国籍,复旦大学电子工程硕士,历任上海交银施罗德基金,2009年加入交银施罗德资产管理(香港)有限公司,担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金基金经理,2012年12月27日至2015年6月30日担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金基金经理,2015年4月22日至2017年3月24日担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金基金经理,2015年8月13日至2016年7月19日担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金基金经理。

注:1、本表所列基金基金经理(助理)任职日期和离职日期均以基金合同生效日或公司作出决定并公告(如适用)之日为准。

2、本表所列基金基金经理(助理)证券从业年限中的“证券从业”的含义遵从中国证券业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

3、基金经理(或基金基金经理)离职后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
本报告期内,本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制投资风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金整体运作合规合法,无不当内幕交易和关联交易,基金投资组合、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定,未发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易制度的执行情况
本公司制定了严格的内部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。

公司建立独立的投资研究决策体系,确保各投资组合在获得投资信息、投资决策和执行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,对于交易指令的分配,遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则,全部通过交易系统公开竞价交易,对于非集中竞价交易,以公司名义执行的场外交易,遵循“价格优先、比例分配”的原则事前独立确立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交易行为监控,风险管理部负责对各账户不同投资品种进行分离,于每年度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益差异、不同投资品种的收益差异以及不同期间内不同交易品种的交易价差进行分析,并对评估和收益差异进行公平交易过度和结果的监测。

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,未发现任何异常交易行为。

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多的单边交易没有超过该证券当日总成交量5%的情况,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗(如:日内3日内、5日内)同日反向交易价差未出现异常。

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2018年上半年国内经济整体延续稳定状态,投资增速稳中趋稳,政策层面持续推行经济结构优化和去杠杆,消费增速小幅回落,对经济的贡献有所减弱。新旧动能转换,工业生产保持平稳,产能利用率回升,行业集中度上升,经济整体企稳回升,从长期看有利于经济长远发展,高质量发展阶段时代,在经济新常态下,一系列A股市场政策,二季度国内贸易数据的不确定性增加,美元指数、汇率波动等因素影响,二季度A股市场波动加大,阶段性下行,作为跟踪基准指数的指数基金,上半年基金整体呈现出震荡向下的走势。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
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 管理人对于宏观经济、证券市场及行业走势的宏观展望
展望未来半年,我们认为通胀仍将维持温和,货币中性的稳健,财政政策持续发力,中美贸易摩擦的影响在短期内仍将延续,但市场经历了剧烈调整后,许多行业指数已接近合理估值区间,目前股市也包含了投资者较为悲观的预期,总体而言,从中长期看我们认为A股市场的维持谨慎中性的看法。

4.6 管理人对于报告期内基金估值程序等事项的说明
本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序,经公司管理层批准并实行,并成立了估值委员会,估值委员会由研究员、基金运营部、风险管理部等部门人员组成,负责基金估值相关事宜。

公司严格按照会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的方法进行估值,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一致性。估值委员会的研究人员按投资品种的不同性质,研究并参考市场普遍认可的做账,建议合理的估值模型,进行测算和认定,以合同约定估值委员会的有关法律法规、合同等文件为依据,一致同意后,报公司投资总监、总经理审批。

方面,估值委员会定期对估值政策和程序进行评价,在发生了影响估值政策和程序的有效性及其适用性的情况下,及时召开估值委员会进行研究和及时修订估值方法,以保证其准确性。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金管理人作为估值委员会成员,对本基金持仓证券的公允价值,信息披露情况保持应有的职业谨慎,对估值委员会提供估值参考信息,参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值程序各方之间不存在任何重大利益冲突,截止报告期末未有与任何外部估值服务机构签署协议。

4.7 管理人对于报告期内基金利润分配情况的说明
本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对于本基金持仓人数或基金份额净值预警信息的说明
本基金报告期内无预警说明。

5 托管人报告
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明
作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《证券投资基金法》及其他相关法律法规、基金合同和托管协议的约定,对交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)本报告期基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算并提供了投资数据,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明
本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司在交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)的投资运作中,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各方面的资产处理严格依照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息内容的真实性、准确性和完整性的意见
本托管人认为,交银施罗德基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人编制和披露的交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有关损害基金份额持有人利益的行为。

6 半年度财务会计报告(未经审计)
6.1 资产负债表
会计主体:交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
报告截止日:2018年6月30日
单位:人民币元

资产	附注	期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
流动资产:			
货币资金		98,798,368.00	135,996,393.47
结算备付金		-	-
银行存款	6.4.7.1	5,888,929.19	7,436,749.02
其他货币资金		87,410.27	-
交易性金融资产	6.4.7.2	92,683,145.11	128,449,748.37
其中:股票投资		92,683,145.11	128,114,087.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
其他金融资产		-	-
应收利息		-	335,660.40
应收股利		-	-
其他应收款		-	-
其他流动资产		6.4.7.3	-
非流动资产:			
可供出售金融资产		-	-
持有至到期投资		-	-
长期股权投资		-	-
投资性房地产		-	-
固定资产		-	-
无形资产		-	-
递延所得税资产		-	-
其他非流动资产		-	-
资产总计		98,798,368.00	135,996,393.47
负债和所有者权益	附注	2018年6月30日	2017年12月31日
负债:			
短期借款		-	-
应付账款		-	-
应付利息		-	-
应付股利		-	-
其他应付款		-	-
其他流动负债		-	-
非流动负债		-	-
所有者权益:			
实收资本		121,639.06	215,442.26
资本公积		91,624.87	144,896.94
留存收益		13,539,699.27	22,587,254.27
未分配利润	6.4.7.10	-54,270,743.18	-13,755,035.85
所有者权益合计		98,298,042.24	135,309,774.55
负债和所有者权益总计		98,798,368.00	135,996,393.47

注:1、报告截止日2018年6月30日,基金份额净值0.641元,基金份额总额153,270,743.81份。

2、本摘要中资产负债表和利润表附注列于本报告正文中对应的附注9,投资者欲了解相应附注的内容,应查阅本基金管理人网站的半年度报告正文。

6.2 利润表
会计主体:交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日
单位:人民币元

项目	附注	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-40,631,629.75	1,648,428.95
1.利息收入		30,558.66	38,212.97
2.投资收益	6.4.7.11	30,282.54	38,212.97
3.公允价值变动收益		-	-
4.其他收入		-	-
二、费用		-	-
1.管理人报酬		-	-
2.托管费		-	-
3.销售服务费		-	-
4.交易费用		-	-
5.利息支出		-	-
6.其他费用		-	-
三、利润总额		-40,631,629.75	1,648,428.95
四、净利润		-40,631,629.75	1,648,428.95
五、其他综合收益		-	-
六、综合收益总额		-40,631,629.75	1,648,428.95

注:1、本报告期利润总额和净利润表附注列于本报告正文中对应的附注9,投资者欲了解相应附注的内容,应查阅本基金管理人网站的半年度报告正文。

6.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)
本报告期:2018年1月1日至2018年6月30日
单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、期初基金份额总额	149,064,808.40	135,309,774.55
二、本期基金份额变动	-41,658,518.02	-1,556,778.52
1.基金份额申购	4,205,934.78	4,348,949.3
2.基金份额赎回	-46,864,452.80	-1,561,728.27
3.基金转换	-	-
4.其他变动	-	-
三、期末基金份额总额	107,406,290.38	133,752,996.03
四、期初基金资产净值	153,270,743.18	135,309,774.55
五、本期基金资产净值变动	-54,270,743.18	-1,561,728.27
六、期末基金资产净值	98,999,000.00	133,748,046.28

注:1、本报告期基金份额总额和基金资产净值变动表附注列于本报告正文中对应的附注9,投资者欲了解相应附注的内容,应查阅本基金管理人网站的半年度报告正文。

6.4 关联方投资
6.4.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况
本基金报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中信银行股份有限公司(“中信银行”)	基金托管人、基金销售机构
交银施罗德资产管理有限公司(“交银资管”)	基金管理人的股东、基金销售机构

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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易
6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易
本基金报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬
6.4.8.2.1 基金管理费
单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的基金管理费	596,397.21	756,371.62
其中:支付销售机构的客户维护费	135,942.95	185,407.74

注:支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值1.0%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.0%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费
单位:人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	119,279.45	151,274.32

注:支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值0.2%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付,其计算公式为:
日托管费=前一日基金资产净值×0.2%÷当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易
本基金报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况
6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况
份额单位:份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
报告期末持有基金份额总额	76,052,590.58	76,052,590.58
报告期申购/买入总份额	-	-
报告期赎回/卖出总份额	-	-
报告期基金总申购/赎回总份额	-	-
报告期末持有基金份额总额	76,052,590.58	76,052,590.58
占基金总份额比例	49.62%	46.76%

注:1、如果本报告期间发生转换转入、红利再投资业务,则总申购份额中包含该业务。
2、如果本报告期间发生转换转出业务,则总赎回份额中包含该业务。
3、基金管理人投资本基金运用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况
本基金报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入
单位:人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年同期可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
期末余额	5,888,929.19	29,433.22
当期利息收入	8,555,964.47	37,187.46

注:本基金的银行存款由基金托管人保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况
本基金报告期内及上年度可比期间未与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联方交易事项
6.4.8.7.1 其他关联方交易事项
6.4.8.7.2 其他关联方交易事项

6.4.9 因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券的情况
6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有流通受限证券的情况
6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

6.4.10 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

6.4.11 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

6.4.12 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

6.4.13 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

6.4.14 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

6.4.15 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

6.4.16 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

6.4.17 投资组合报告附注

6.4.18 其他资产

6.4.19 其他

6.4.20 其他

6.4.21 其他

6.4.22 其他

6.4.23 其他

6.4.24 其他

6.4.25 其他

6.4.26 其他

6.4.27 其他

6.4.28 其他

6.4.29 其他

6.4.30 其他

6.4.31 其他

6.4.32 其他