

交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)

2019年半年度报告摘要

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
报告送达日期:二〇一九年八月十九日

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的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签章。

基金管理人:中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年8月26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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期中财务数据未经审计。

本报告期自2019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

基金简称	交银中证海外中国互联网指数(LOF)
场内简称	中国互联
基金代码	169006
交易代码	169006
基金运作方式	上市契约型开放式(LOF)

基金合同生效日 2015年6月27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

报告期末基金总资产 997,564,795.61元

基金合同的存续期间 不定期

基金份额上市的证券交易所 深圳证券交易所

上市日期 2015年7月10日

2.2 基金产品说明

投资目标 本基金在报告期期末未发现异常交易行为。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超过该证券当日总成交量%的情况有1次，是投资组合因投资策略需要而发生同日反向交易，未发现不公平交易和利益输送的情况。本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗口(如日内、3日、5日内)同向交易的交易价差未发现异常。

4.3 管理人对报告期内基金投资策略和运作分析

4.3.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年国内宏观环境基本稳定，央行货币政策维持稳健，财政政策加力提效，减税降费力度加大，积极扶持中小企业和新经济发展，多方面政策持续发力缓解经济下行压力。全球主要经济体相对平稳，美国经济不稳定性增加，欧洲经济延续弱势，但总体下行空间较为有限。上半年海外主要资本市场表现出现震荡趋弱，作为避险资产的黄金表现较好，但总体表现不如预期。我们认为宏观经济依然面临一定挑战，持续加码，新兴产业加速发展，开放创新将释放经济新增长的内在潜力。我们正处于由高速增长转向高质量发展的关键阶段，新兴产业将成为推动经济发展的核心动力。同时，科创板加速推进，为新兴产业提供了更为便捷的融资渠道，有助于扶持科技类新兴产业，优化A股产业结构。市场情绪上，中美贸易摩擦仍然是主要影响因素，但边际影响有所减弱。我们总体上对于下半年中国海外互联网板块的表现保持谨慎乐观的看法。

4.3.2 管理人对报告期内基金估值程序的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.3 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.4 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.5 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.6 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.7 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.8 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.9 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.10 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.11 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.12 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.13 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.14 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.15 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.16 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.17 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.18 管理人对报告期内基金资产估值政策的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理人批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部、交易部和固定收益部、基金经理组成。

公司严格按照新会准则，证监会相关规定的基金合同关于估值的约定进行估值，保证估值的公平、合理，保持估值政策和程序的一致性。

估值委员会的组成部分按照投资品种的不同性质，研究并参考市场价格普遍认同的做法，建议合理的估值模式。

对本基金估值时，估值委员会将通过讨论，对基金估值方法、估值参数、估值程序等进行测算和认可，从而评估估值委员会从基金经理、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

4.3.19