交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银沪深300分层等权指数
基金主代码	519714
交易代码	519714(前端) 519715(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月7日
报告期末基金份额总额	9,343,854.14份
投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照成份股在沪深300行业分层等权重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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300行业分层等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金,具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场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	中国建设银行股份有限公司

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	4,971,208.84
2.本期利润	2,703,145.57
3.加权平均基金份额本期利润	0.2993
4.期末基金资产净值	9,343,854.14
5.期末基金份额净值	1.000

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、根据本基金转型方案实施安排,以2015年6月30日为转型基准日,基金管理人已对转型基准日登记在册的原交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金份额持有人计算其持有的基金资产及未结转收益,按照1.00 元的面值折算为交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金份额。

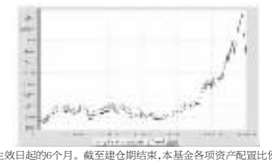
3.2 基金净值表现

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	11.79%	2.63%	16.99%	2.62%	-5.20%	0.01%

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

交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金
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
(2012年11月7日至2015年6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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡铮	本基金、交银环球精选股票基金(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银深证300价值ETF及其联接基金、交银全球资源股票基金(QDII)、交银证券新能源指数分级基金、交银中证海外中国互联网指数基金(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级基金的基金经理、公司量化投资部助理总经理	2012-12-27	-	6年	蔡铮先生,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。

注:1、2015年6月26日本基金管理人发布公告,因本基金实施转型,蔡铮先生自2015年7月1日起不再担任本基金基金经理,详情请见相关公告。
2、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管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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》、基金合同及其他有关法律法规的规定,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运作分析

二季度,经济仍在底部,上行动力不足,但政策加码稳增长延续:国内融资定向支持力度增强,PSL和地方可置换债务规模均有所扩大,地产销量持续好转。货币政策继续宽松,银行间资金利率维持低位,发改委允许企业借新还旧,城投债可能继续松绑。1年期金融债收益率大幅下行约100bp,10年金融债收益率窄幅震荡,整体收益率曲线呈陡峭化。

中债总全价(总值)指数在4月上涨1.30%,5月上涨0.10%,6月下跌0.05%。报告期内,本基金已完成绝大部分仓位配置,本报告期内运作较为稳健。

债券市场面临多重考验:稳增长政策持续发力,资金面宽松已被充分预期,关联储加息渐行渐近,地方债置换进度亦有可能超出投资者预期。我们对三季度债券市场持谨慎乐观,警惕预期先于现实而进行调整。权益类市场的波动加大,债券市场作为避险场所有望成为部分投资者的替代选项,打破刚性兑付的预期进一步上升,我们保持对低等级信用债的警惕。本基金以与封闭期适度匹配的债券配置进行杠杆操作,力争获取相对稳定的收益。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.042元,本报告期份额净值增长率为4.30%,同期业绩比较基准增长率为1.06%。

4.6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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	8,802,979.26	87.34
	其中:股票	8,802,979.26	87.34
2	固定收益投资	4,359.30	0.04
	其中:债券	4,359.30	0.04
	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	1,143,495.24	11.35
7	其他资产	128,191.56	1.27
8	合计	10,079,025.36	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	65,196.50	0.70
C	制造业	43,215.00	0.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	75,652.20	0.81
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	184,063.70	1.97

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	51,868.28	0.56
B	采矿业	921,230.67	9.86
C	制造业	3,915,292.72	41.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	833,444.33	8.92
E	建筑业	252,605.05	2.70
F	批发和零售业	297,019.05	3.18
G	交通运输、仓储和邮政业	218,623.92	2.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	697,171.92	7.46
J	金融业	716,018.51	7.66
K	房地产业	222,031.02	2.38
L	租赁和商务服务业	134,108.51	1.44
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	71,993.66	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	44,551.06	0.48
R	文化、体育和娱乐业	207,590.71	2.22
S	综合	35,366.15	0.38
	合计	8,618,915.56	92.24

5.3报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300017	网宿科技	2,654	123,198.68	1.32
2	002292	奥飞动漫	2,400	90,840.00	0.97
3	600886	国投电力	5,891	83,298.74	0.89
4	002353	杰瑞股份	1,853	82,180.55	0.88
5	600900	长江电力	5,343	76,672.05	0.82
6	600027	华电国际	6,043	67,198.16	0.72
7	601898	中煤能源	5,592	63,860.64	0.68
8	600583	海油工程	3,831	63,824.46	0.68
9	600863	内蒙华电	7,746	63,362.28	0.68
10	600688	上海石化	5,821	62,459.33	0.67

5.3.2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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002416	爱施德	3,660	75,652.20	0.81
2	600395	盘江股份	4,150	65,196.50	0.70
3	002429	兆驰股份	3,350	43,215.00	0.46

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	4,359.30	0.05
8	其他	-	-
9	合计	4,359.30	0.05

5.5 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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110031	航信转债	30	4,359.30	0.05

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十名资产支持证券投资明细
本基金本报告期未未持有资产支持证券。
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五名贵金属投资明细
本基金本报告期未未持有贵金属。
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权证投资明细
本基金本报告期未未持有权证。
5.9报告期末基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期未未持有股指期货。
5.10报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期未未持有国债期货。
5.11投资组合报告附注
5.11.1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。
5.11.2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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	9,146.06
2	应收证券清算款	118,844.18
3	应收股利	-
4	应收利息	201.32
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	128,191.56

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期未未持有处于转股期的可转换债券。
5.11.5报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明
5.11.5.1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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002292	奥飞动漫	90,840.00	0.97	重大事项
2	600886	国投电力	83,298.74	0.89	重大事项
3	002353	杰瑞股份	82,180.55	0.88	重大事项
4	600900	长江电力	76,672.05	0.82	重大事项

5.11.5.2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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002416	爱施德	75,652.20	0.81	重大事项
2	600395	盘江股份	65,196.50	0.70	重大事项

5.11.6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	6,784,829.67
本报告期期间基金总申购份额	12,384,224.29
减:本报告期期间基金总赎回份额	14,398,332.37
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	4,573,132.55
报告期期末基金份额总额	9,343,854.14

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情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2 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。

§8影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人已于2015年5月1日起至2015年5月25日以通讯方式召开了交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金的基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会决议已于2015年5月26日生效,并自2015年7月1日起,《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合同》失效且《交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金基金合同》同时生效,交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金正式变更为交银施罗德消费新驱动股票型证券投资基金。有关详情请查阅本基金管理人2015年5月27日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

§9备查文件目录

9.1备查文件目录
1、中国证监会核准交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金募集的文件;
2、《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合同》;
3、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3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,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。

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

【2015】第二季度报告

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
报告送出日期:二〇一五年七月十八日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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2015年4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银国证新能源指数分级		
场内简称	交银新能		
基金主代码	164905		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年3月26日		
报告期末基金份额总额	1,743,061,846.77份		
投资目标	本基金采用指数化投资,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0.35%,年跟踪误差不超过4%。		
投资策略	本基金为指数型基金,绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数,即按照国证新能源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。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因某些特殊情况导致成份股流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。		
业绩比较基准	国证新能源指数收益率×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,属于承担较高预期风险、预期收益较高的证券投资基金品种。本基金采取了基金份额分级的结构设计,不同的基金份额具有不同的风险收益特征。本基金共有三类份额,其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征;交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。		
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司		
基金托管人	中国建设银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	交银新能	新能源A	新能源B
下属分级基金的场内简称	交银新能	新能源A	新能源B
下属分级基金的交易代码	164905	150217	150218
报告期末下属分级基金的份额总额	791,067,773.77份	475,997,036.00份	475,997,037.00份
下属分级基金的风险收益特征	交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征	交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征	交银新能源B份额具有高预期风险、高预期收益的特征

§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(2015年4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	387,947,013.60
2.本期利润	516,897,426.22
3.加权平均基金份额本期利润	0.1819
4.期末基金资产净值	1,874,573,194.21
5.期末基金份额净值	1.075

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。

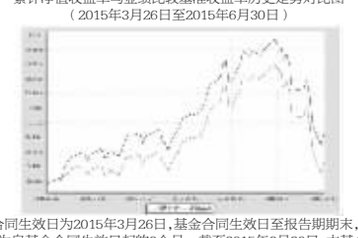
3.2 基金净值表现

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	7.29%	3.00%	16.80%	2.87%	-9.51%	0.13%

3.2.2自基金合同生效以来基金累计份额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

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金
累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年3月26日至2015年6月30日)



注:本基金基金合同生效日为2015年3月26日,基金合同生效日至报告期期末,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至2015年6月30日,本基金尚处于建仓期。

§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	本基金、交银环球精选股票基金(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银深证300价值ETF及其联接基金、交银全球资源股票基金(QDII)、交银证券新能源指数分级基金、交银中证海外中国互联网指数基金(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级基金的基金经理、公司量化投资部助理总经理	2015-03-26	-	6年	蔡铮先生,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。

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管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

2015年二季度,国内经济增速弱企稳,内需疲软,经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。但通胀压力并不明显,货币政策持续进一步宽松,使资本市场在本季度前期仍然维持年初以来的上涨趋势。但随着季末资金面收紧以及场外配资去杠杆压力,市场出现较大幅度回调。作为跟踪国证新能源指数的指数基金,在本季度跟随大盘呈现出先涨后跌的走势。

展望未来一个季度,宽松的货币政策环境有望持续,但经过此轮调整,市场风险偏好会急剧下降。总体而言,预计产业创新的发展思路不会改变,新能源产业中长期的发展逻辑不会改变,改革进程有望进一步加快,因此对指数走势保持谨慎乐观的态度。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.075元,本报告期份额净值增长率为7.29%,同期业绩比较基准增长率为16.80%,本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.22%,跟踪误差为0.39%。

4.6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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,735,007,734.44	88.58
	其中:股票	1,735,007,734.44	88.58
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	80,062,198.05	4.09
7	其他各项资产	143,586,433.69	7.33
8	合计	1,958,656,366.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期未未持有积极投资的股票。

5.2.2指数投资按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	60,328,048.20	3.22
C	制造业	1,455,040,419.82	77.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	129,826,806.90	6.93
E	建筑业	24,969,254.94	1.33
F	批发和零售业	38,778,278.76	2.07
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,772,544.46	0.36
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	19,292,381.36	1.03
	合计	1,735,007,734.44	92.55

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002080	中材科技	2,504,859	58,187,874.57	3.10
2	000669	金鸿能源	1,114,900	46,524,777.00	2.48
3	600021	上海电力	2,021,027	42,643,669.70	2.27
4	300316	晶盛机电	1,581,000	40,947,900.00	2.18
5	002012	凯恩股份	3,424,369	40,407,554.20	2.16
6	002664	信质电机	1,121,512	40,385,647.12	2.15
7	601012	隆基股份	2,540,298	39,984,290.52	2.13
8	002091	江苏国泰	1,478,958	38,778,278.76	2.07
9	002309	中利科技	1,142,504	38,148,208.56	2.04
10	300207	欣旺达	1,462,178	35,413,951.16	1.89

5.3.2 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。

5.4 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。

5.5 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。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1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。

5.11.2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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	1,103,424.44
2	应收证券清算款	140,644,996.88
3	应收股利	-
4	应收利息	20,971.72
5	应收申购款	1,767,642.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	49,398.01
8	其他	-
9	合计	143,586,433.69

5.11.4 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。

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002080	中材科技	58,187,874.57	3.10	重大事项
2	000669	金鸿能源	46,524,777.00	2.48	重大事项
3	300316	晶盛机电	40,947,900.00	2.18	重大事项
4	002012	凯恩股份	40,407,554.20	2.16	重大事项
5	002309	中利科技	38,148,208.56	2.04	重大事项
6	002091	江苏国泰	38,778,278.76	2.07	重大事项

5.11.5.2 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。

5.11.6 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

项目	交银新能	新能源A	新能源B
本报告期期初基金份额总额	1,435,577,599.44	979,849,785.00	979,849,786.00
本报告期期基金总申购份额	811,546,871.45	-	-
减:本报告期基金总赎回份额	2,463,762,195.12	-	-
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	1,007,705,498.00	-503,852,749.00	-503,852,749.00
本报告期期末基金份额总额	791,067,773.77	475,997,036.00	475,997,037.00

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1