

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国民生银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年十月二十七日

基金管理人的董事会及监事会对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、准确性完整性承担个别及连带责任。

基金托管人对本基金定期报告的编制、报告内容的真实性和完整性进行复核，但不保证本报告中的数据真实、准确和完整。

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，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。

本报告期自2015年7月1日起至2015年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 交银中证互联网金融指数分级证券投资基

金场内简称 金融

基金代码 164907

交易代码 164907

基金运作方式 灵活型开放式

基金合同生效日 2015年6月26日

报告期末基金份额总额 282,300,416.77份

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。

本基金力争在扣除基金管理费后的净值增长率在任何连续的30个交易日内不超过基准收益率加0.5%，年跟踪误差不超过2%。

本基金的业绩基准为“中证互联网金融指数”的净值增长率。

投资目标 本基金主要采用完全复制的指数法跟踪标的指数，即按照中证互联网金融指数的成份股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化定期调整，同时定期对投资组合进行调整以符合指数的成分股构成比例。除法律法规或基金合同另有约定外，本基金不进行现金管理。

投资策略 本基金主要通过投资于标的指数成份股、备选成份股以及可能影响标的指数成份股价格波动的有价证券，以达到跟踪标的指数的效果，从而使得基金净值增长率与标的指数收益率相拟合。

业绩比较基准 中证互联网金融指数收益率×90%+银行存款利率(税后)×10%。

本基金是一只股票型基金，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险类别。

本基金实现了基金分类的结构设计，不同的基金类别具有不同的风险收益特征。

本基金具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融A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

基金管理人：中国建设银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 金融A 金融B

下属分级基金的基金代码 164907 164907

报告期末下属分级基金的份额总额 267,341,902.77份 7,983,767.00份

交银互联网金融A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银互联网金融B份额具有高预期风险、高预期收益的特征。

下属分级基金的风险收益特征

风险收益特征

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

报告期：(2015年7月1日-2015年9月30日)

1.本期已实现收益 -10,773,011.47

2.本期利润 -85,294,085.61

3.期初至报告期利润 -2,027

4.期末基金净值 203,372,881.73

5.报告期净值增长率 -0.71%

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未计费用的水平。

2. 本期已实现收益指本期利润减去收入、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，本期利润为期末资产负债表中公允价值变动收益。

3.2. 基金净值表现

3.2.1 报告期内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(%) 净值增长率标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) 业绩比较基准收益率标准差(%)

准差② 标准差③ ①-③ ②-④

过去三个月 -28.20% 3.67% -32.47% 3.77% 4.27% -0.10%

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金管理

2015年第3季度报告

3.22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

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基

金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年6月26日至2015年9月30日)



注：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

交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基

金累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年6月26日至2015年9月30日)

4.6 报告期内本基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金报告期内无预警情形。

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 106,818,533.04 81.69

其中：股票 106,818,533.04 81.69

2 固定收益投资 - -

其中：债券 - -

资产支持证券 - -

3 货币市场工具 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他金融类投资 - -

6 银行存款和结算备付金合计 37,229,690.02 18.20

7 其他资产 158,057.37 0.00

8 合计 204,206,289.03 100.00

5.2 报告期内按行业分类的股票投资组合

序号 代码 行业类别 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 农、林、牧、渔业 - -

2 矿采、冶炼、非金属 - -

3 制造业 34,704,914.31 17.06

4 电力、热力、燃气及水生产和供应业 - -

5 建筑业 - -

6 铁路、船舶、航空航天和其他运输设备制造业 8,785,503.00 4.32

7 交通运输、仓储和邮政业 939,120.00 0.40

8 住宿和餐饮业 - -

9 信息传输、软件和信息技术服务业 57,218,798.61 28.13

10 金融业 30,183,646.21 19.22

11 制造业 22,031,294.61 10.03

12 租赁和商务服务业 3,956,393.00 1.94

13 科学、技术服务业 - -

14 国防军工 - -

15 公用事业 - -

16 文化、体育和娱乐业 161,900 0.07

17 交通运输、仓储和邮政业 - -

18 仪器仪表制造业 - -

19 其他 - -

20 合计 106,818,533.04 81.69

5.3 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股票投资明细

5.3.1 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的发行主体名称、证券简称、数量(股)、公允价值(元)、占基金资产净值比例(%)

序号 代码 名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000166 兴业银行 567,600 8,117,200.00 3.99

2 000198 中信银行 1,367,846 7,970,560.02 3.92

3 000218 中国平安 260,700 7,495,002.00 3.68

4 000271 天箭科技 132,676 7,118,006.44 3.50

5 000001 平安银行 666,800 6,994,720.00 3.44

6 000224 苏宁云商 573,000 6,944,760.00 3.41

7 300104 乐视网 161,900 6,618,472.00 3.26

8 000609 顺丰控股 512,800 6,466,152.00 3.17

9 000745 中信银行 300,329 5,733,280.61 2.82

10 000177 雅戈尔 459,700 5,699,146.00 2.76

5.3.2 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股票投资明细

5.3.3 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的发行主体名称、证券简称、数量(股)、公允价值(元)、占基金资产净值比例(%)

序号 代码 名称 数量(股) 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000399 中国联通 2,000,000 6,190,480.30 3.00

2 000848 中国银行 1,350,000 6,046,000.00 3.00

3 000198 中信银行 1,367,846 5,986,330.77 3.00

4 000271 天箭科技 132,676 5,748,000.00 3.00

5 000001 平安银行 666,800 5,699,146.00 3.00

6 000609 顺丰控股 512,800 5,699,146.00 3.00

7 300104 乐视网 161,900 5,699,146.00 3.00

8 000606 申能股份 500,000 4,785,000.00 2.66

9 000988 中国联通 2,000,000 4,785,000.00 2.66

10 000001 平安银行 1,367,846 4,785,000.00 2.66

5.4 报告期内本基金持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金报告期内未持有处于转股期的可转换债券。

5.5 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持证券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持证券。

5.6 报告期内本基金持有的处于摊销期的国债期货交易情况说明

本基金报告期内未持有处于摊销期的国债期货。

5.7 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持券。

5.8 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持券。

5.9 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持券。

5.10 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持券。

5.11 报告期内本基金持有的处于待兑期的资产支持券

本基金报告期内未持有待兑期的资产支持券。