交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）（更新）招募说明书摘要

（2016年第1号）

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
二〇一六年八月

基金招募说明书自基金合同生效日起,每6个月更新一次,并于每6个月结束之日后的45日内公告,更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）（以下简称"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成。交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金份额持有人大会于2016年6月30日审议通过《关于交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型及基金合同修改有关事项的议案》,基金份额持有人大会决议自表决通过之日起生效,报中国证监会备案。自2016年7月19日起,由《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》修订而成的《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金合同》生效。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金募集的注册以及变更注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。中国证监会不对基金的投资价值及市场前景等作出实质性判断或保证。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证投资本基金一定盈利,也不保证基金份额持有人的最低收益;因基金价格可升可跌,亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资人在投资本基金前,需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性,充分考虑自身的风险承受能力,理性判断市场,对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人根据所持有份额享受基金的收益,但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括:因受到经济因素、政治因素、投资心理和交易制度等各种因素的影响而引起的市场风险;基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险;由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险;交易对手违约风险;投资股指期货的特定风险;投资本基金特有的风险等等。投资本基金特有的风险主要包括指数化投资风险和基金运作的特有风险。其中指数化投资风险主要包括:标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险、基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险、标的指数变更的风险等;基金运作的特有风险主要包括:上市交易风险、基金份额的折/溢价交易风险等。

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。

投资有风险,投资人在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同等信息披露文件。基金的过往业绩并不代表未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的"买者自负"原则,在投资者作出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人,其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受,并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。

本招募说明书所载内容截止日为2016年8月13日,有关财务数据和净值表现截止日为2016年6月30日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称:交银施罗德基金管理有限公司
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
邮政编码:200120
法定代表人:于亚利
成立时间:2005年8月4日
注册资本:2亿元人民币
存续期间:持续经营
联系人:何万金
电话:（021）61055050
传真:（021）61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称"公司"）经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准设立。公司股权结构如下:

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司（以下使用全称或其简称"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%

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

于亚利女士,董事长,硕士学位。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长,交通银行财务会计部副总经理、总经理,交通银行预算财务部总经理,交通银行首席财务官。

陈朝灯先生,副董事长,博士学位。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理,景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。

阮红女士,董事,总经理,博士学位,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室副处长、处长,交通银行海外机构管理部副总经理、总经理,交通银行上海分行副行长,交通银行资产托管部总经理,交通银行投资管理部总经理。

徐瀚先生,董事,硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行香港分行电脑中心副总经理,交通银行信息技术部副总经理,交通银行太平洋信用卡中心副首席执行官、首席执行官。

孙培基先生,董事,学士学位。现任交通银行风险管理部副总经理。历任交通银行财会部副处长,交通银行董事会办公室副处长、处长,交通银行预算财务部高级经理,交通银行海南分行副行长,交通银行审计部副总经理。

孟方德先生,董事,硕士学位。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理,施罗德投资管理（新加坡）有限公司副董事长,施罗德投资管理国际有限公司执行董事,施罗德投资管理（卢森堡）有限公司总经理,施罗德投资管理（日本）有限公司总经理,施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监。

谢丹阳先生,独立董事,博士学位。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。历任蒙特利尔大学经济系助理教授,国际货币基金组织经济学家和高级经济学家,香港科技大学助理教授、副教授、教授、系主任,瑞安经管中心主任。

袁志刚先生,独立董事,博士学位。现任复旦大学经济学院教授。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任、经济学院院长。

周林先生,独立董事,博士学位。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。历任复旦大学管理科学系助教,美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授,美国杜克大学经济系副教授,香港城市大学经济与金融系教授,美国亚利桑那州立大学凯瑞商学院经济系冠名教授,上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生,监事长,硕士学位。现任交通银行战略投资部总经理。历任交通银行办公室副处长,交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理,交通银行投资银行部副总经理,交通银行江苏分行副行长。

裴关淑仪女士,监事,双硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理（香港）有限公司总经理。曾任职荷兰银行、渣打银行（香港）有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED,施罗德投资管理(香港)有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事、交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监。

张玲菡女士,监事、学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司营销管理部总经理。历任中国银行福州分行客户经理,新华人寿保险公司上海分公司区域经理,银河基金管理有限公司市场部渠道经理,交银施罗德基金管理有限公司渠道经理、渠道部副总经理、广州分公司副总经理。

3、基金管理人高级管理人员

阮红女士,总经理。简历同上。

许珊燕女士,副总经理,硕士学历,高级经济师,兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。历任湖南大学(原湖南财经学院)金融学院讲师,湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理,湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

夏华龙先生,副总经理,博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长;交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理;交通银行资产托管业务中心副总裁;云南省曲靖市市委常委、副市长（挂职）。

谢卫先生,副总经理,经济学博士,高级经济师。历任中央财经大学金融系教员;中国社会科学院财经所助理研究员;中国电力信托投资公司基金部副经理;中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理,富国基金管理有限公司副总经理。

苏奋先生,督察长,纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理,交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人,交通银行投资管理部投资并购高级经理,交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

4、本基金基金经理

蔡铮先生,基金经理。复旦大学电子工程硕士。7年证券从业经验。2007年7月起在瑞士银行香港分行工作。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,曾任投资研究部数量分析师,现任量化投资部助理总经理。2011年3月7日至2012年12月26日担任上证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基金经理助理,2011年9月22日至2012年12月26日担任深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理,2011年9月28日至2012年12月26日担任交银施罗德深证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助理,2012年11月7日至2012年12月26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、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基金经理至今,2015年4月22日起担任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,2015年8月13日至2016年7月18日担任基金转型前的交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理,2016年7月19日起担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）基金经理至今。

5、投资决策委员会成员

委员:阮红（总经理）
王少成（权益投资总监、基金经理）
齐皓（跨境投资总监、投资经理）
于海颖（固定收益（公募）投资总监）
张鸿羽（研究部总经理）

上述人员之间不存在近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为2016年8月13日,期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称:中信银行股份有限公司（简称"中信银行"）
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:李庆萍
成立时间:1987年4月7日
组织形式:股份有限公司
注册资本:467.873亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立文号:中华人民共和国国务院办公厅国办函[1987]14号
基金托管业务批准文号:中国证监会证监基字[2004]125号
联系人:中信银行资产托管部
联系电话: 010-89936330
传真:010-85230024
客服电话:95558
网址:bank.ecitic.com

经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期和长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑与贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项;提供保管箱服务;结汇、售汇业务;代理开放式基金业务;办理黄金业务;黄金进出口;开展证券投资基金、企业年金基金、保险资金、合格境外机构投资者托管业务;经国务院银行业监督管理机构批准的其他业务;保险兼业代理业务（有效期至2017年09月08日）。（依法须经批准的项目,经相关部门批准后依批准的内容开展经营活动。）

中信银行（601998.SH、0998.HK）成立于1987年,原名中信实业银行,是中国改革开放中最早成立的新兴商业银行之一,是中国最早参与国内外金融市场融资的商业银行,并以屡创中国现代金融史上多个第一而蜚声海内外。伴随中国经济的快速发展,中信实业银行在中国金融市场改革的大潮中逐渐成长壮大,于2005年8月,正式更名"中信银行"。2006年12月,以中国中信集团和中信国际金融控股有限公司为股东,正式成立中信银行股份有限公司。同年,成功引进战略投资者,与欧洲领先的西班牙对外银行（BBVA）建立了优势互补的战略合作关系。2007年4月27日,中信银行在上海交易所和香港联合交易所成功同步上市。2009年,中信银行成功收购中信国际金融控股有限公司（简称:中信国金）70.32%股权。经过近三十年的发展,中信银行已成为国内资本实力最雄厚的商业银行之一,是一家快速增长并具有强大综合竞争力的全国性商业银行。

2009年,中信银行通过了美国SAS70内部控制审订并获得无保留意见的SAS70审订报告,表明了独立公正第三方对中信银行托管服务运作流程的风险管理和内部控制的健全有效性全面认可。

2、主要人员情况

孙德顺先生,中信银行行长。1958年出生,东北财经大学经济学硕士。1981年4月至1984年5月,就职于中国人民银行。1984年5月至2005年11月,任职中国工商银行海淀区办事处、海淀区支行、北京分行、总行数据中心（北京）等单位。1995年12月至2005年11月,任中国工商银行北京分行行长助理、副行长。1999年1月至2004年4月,兼任中国工商银行总行数据中心（北京）总经理。2005年12月至2009年12月,任交通银行北京分行行长。2010年1月至2011年10月,任交通银行北京管理部副总裁,兼任北京分行行长。2011年10月至2014年5月,任中信银行副行长。2014年5月至2016年6月,任中信银行常务副行长。杨毓先生,中信银行副行长,分管托管业务。1962年12月生,2011年4月起担任中国建设银行江苏省分行行长,党委书记;2006年7月至2011年3月担任中国建设银行河北省分行行长,党委书记;1982年8月至2006年7月在中国建设银行河南省分行工作,历任计划财务处科员,副处长,信阳地区中心支行副行长,党组成员,计划处处长,中介处处长,郑州市铁路专业支行行长,党组书记,郑州分行行长,党委书记,金水支行行长,党委书记,河南省分行副行长,党委副书记。

刘泽云先生,现任中信银行股份有限公司资产托管部总经理,经济学博士。1996年8月进入本行工作,历任总行行长秘书室科长、总行投资银行部处经理、总行资产保全部主管、总行国际业务部总经理助理、副总经理、副总经理（主持工作）。

3、基金托管业务经营情况

2004年8月18日,中信银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会批准,取得基金托管人资格。中信银行本着"诚实信用、勤勉尽责"的原则,切实履行托管人职责。

截至2016年半年末,中信银行已托管81只开放式证券投资基金,以及证券公司资产管理产品、信托产品、企业年金、股权基金、QDII等其他托管资产,托管总规模达到5.35万亿元人民币。

（二）基金托管人的内部控制制度

1、内部控制目标。强化内部管理,确保有关法律法规及规章在基金托管业务中得到全面严格的贯彻执行;建立完善的规章制度和操作规程,保证基金托管业务持续、稳健发展;加强稽核监察,建立高效的风险监控体系,及时有效地发现、分析、控制和避免风险,确保基金财产安全,维护基金份额持有人利益。

2、内部控制组织结构。中信银行总行建立了风险管理委员会,负责全行的风险控制和风险防范工作;托管部内设内控合规岗,专门负责托管部内部风险控制,对基金托管业务的各个工作环节和业务流程进行独立、客观、公正的稽核监察。

3、内部控制制度。中信银行严格按照《基金法》以及其他法律法规及规章的规定,以控制和防范基金托管业务风险为主线,制定了《中信银行基金托管业务管理办法》、《中信银行基金托管业务内部控制管理办法》和《中信银行托管业务内控检查实施细则》等一整套规章制度,涵盖证券投资基金托管业务的各个环节,保证证券投资基金托管业务合法、合规、持续、稳健发展。

4、内部控制措施。建立了各项规章制度、操作流程、岗位职责、行为规范等,从制度上、人员上保证基金托管业务稳健发展;建立了安全保管基金财产的物质条件,对业务运行场所实行封闭管理,在要害部门和岗位设立了安全保密区,安装了录像、录音监控系统,保证基金信息的安全;建立严密的内部控制防线和业务授权管理等制度,确保所托管的基金财产独立运行;营造良好的内部控制环境,开展多种形式的持续培训,加强职业道德教育。

（三）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人根据《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同、托管协议和有关法律法规及规章的规定,对基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额净值计算、应收资金到账、基金费用开支及收入确定、基金收益分配、相关信息披露、基金宣传推介材料中登载的基金业绩表现数据等进行监督和核查。

如基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》、基金合同和有关法律法规及规章的行为,将及时以书面形式通知基金管理人限期纠正。在限期内,基金托管人有权随时对通知事项进行复查,督促基金管理人改正。基金托管人发现基金管理人有重大违规行为或违规事项未能在限期内纠正的,基金托管人将以书面形式报告中国证监会。

三、相关服务机构

（一）基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为基金管理人以及基金管理人的网上直销交易平台。

名称:交银施罗德基金管理有限公司
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
法定代表人:于亚利
成立时间:2005年8月4日
电话:（021）61055724
传真:（021）61055054
联系人:傅鲸
客户服务电话:400-700-5000（免长途话费）,（021）61055000
网址:www.fund001.com,www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过基金管理人网上直销交易平台办理开户、本基金的场外申购、赎回等业务,具体交易细则请参阅基金管理人网站。

网上直销交易平台网址:www.fund001.com,www.bocomschroder.com。

2、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（具体名单见深圳证券交易所网站）。

3、除基金管理人之外的其他场外销售机构

（1）交通银行股份有限公司
住所:上海市浦东新区银城中路188号
办公地址:上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人:牛锡明
电话:（021）58781234
传真:（021）58408483
联系人:曹榕
客户服务电话:95559
网址:www.bankcomm.com

（2）招商银行股份有限公司
住所:深圳市福田区深南大道7088号
办公地址:深圳市福田区深南大道7088号
法定代表人:李建红
电话:（0755）83198888
传真:（0755）83195109
联系人:邓炯鹏
客户服务电话:95555
网址:www.cmbchina.com

（3）上海银行股份有限公司
住所:上海市银城中路168号
办公地址:上海市银城中路168号
法定代表人:范一飞
电话:（021）68475888
传真:（021）68476111
联系人:张萍
客户服务电话:（021）962888
网址:www.bankofshanghai.com

（4）中信银行股份有限公司
住所:北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址:北京市东城区朝阳门北大街9号
法定代表人:常振明
电话:（010）89936330
传真:（010）85230024
联系人:丰靖
客户服务电话:95558
网址:bank.ecitic.com

（5）东莞农村商业银行股份有限公司
住所:东莞市东城区鸿福东路2号
办公地址:东莞市东城区鸿福东路2号
法定代表人:何沛良
电话:（0769）22866254
传真:（0769）22866282
联系人:林培珊
客户服务电话:（0769）961122
网址:www.drcbank.com

（6）江苏江南农村商业银行股份有限公司
住所:江苏省常州市和平中路413号
办公地址:江苏省常州市和平中路413号
法定代表人:陆向阳
电话:0519-80585939
传真:0519-89995170
联系人:蒋姣
客户服务电话:96005
网址:http://www.jnbank.com.cn

（7）光大证券股份有限公司
住所:上海市静安区新闸路1508号
办公地址:上海市静安区新闸路1508号
法定代表人:薛峰
电话:（021）22169999
传真:（021）22169134
联系人:刘晨
客户服务电话: 10108998
网址:www.ebscn.com

（8）中信建投证券股份有限公司
住所:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝阳门内大街188号
法定代表人:王常青
电话:（010）85130588
传真:（010）65182261
联系人:魏明
客户服务电话:4008-888-108
网址:www.csc108.com

（9）中国银河证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座
法定代表人:陈有安
电话:（010）66568292
联系人:邓颜
客户服务电话:400-888-8888
网址:www.chinastock.com.cn

（10）招商证券股份有限公司
住所:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38－45层
办公地址:深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层
法定代表人:宫少林
电话:（0755）82943666
传真:（0755）82943636
联系人:黄健
客户服务电话:400-8888-111,95565
网址:www.newone.com.cn

（11）兴业证券股份有限公司
住所:福州市湖东路268号
办公地址:上海市浦东民生路1199弄五道口广场1号楼21层
法定代表人:兰荣
电话:（021）38565785
传真:（021）38565955
联系人:谢高得
客户服务电话:400-8888-123
网址:www.xyzq.com.cn

（12）中信证券股份有限公司
住所:深圳市深南大道7088号招商银行大厦A层
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦
法定代表人:王东明
电话:（010）60838888
传真:（010）60833739
联系人:陈忠
客户服务电话:95558
网址:www.cs.ecitic.com

（13）申万宏源证券有限公司
住所:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
办公地址:上海市徐汇区长乐路989号世纪商贸广场45层
法定代表人:李梅
电话:（021）33389888
联系人:李清怡
客户服务电话:95523或4008895523
网址:www.sywg.com

（14）国都证券股份有限公司
住所:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
办公地址:北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦9层10层
法定代表人:常喆
客户服务电话:400-818-8118
网址:www.guodu.com

（15）中信证券（山东）有限责任公司
住所:青岛市崂山区苗岭路29号澳柯玛大厦15层（1507－1510室）
办公地址:青岛市崂山区深圳路222号青岛国际金融广场1号楼第20层
法定代表人:杨宝林
电话:（0532）85022326
传真:（0532）85022605
联系人:吴忠超
客户服务电话:（0532）96577
网址:www.zxwt.com.cn

（16）安信证券股份有限公司
住所:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
办公地址:深圳市福田区金田路4018号安联大厦35层、28层A02单元
法定代表人:王连志
电话:（0755）82558305
传真:（0755）82558355
联系人:陈剑虹
客户服务电话:400-800-1001
网址:www.essence.com.cn

（17）申万宏源西部证券有限公司
住所:新疆乌鲁木齐市建设路2号
办公地址:北京市西城区太平桥大街19号宏源证券
法定代表人:冯戎
电话:（010）88085858
传真:（010）88085195
联系人:李巍
客户服务电话:4008-000-562
网址:www.hysec.com

（18）长江证券股份有限公司
住所:武汉市新华路特8号长江证券大厦
办公地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡运钊
电话:（027）65799999
传真:（027）85481900
联系人:李良
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com

（19）中泰证券股份有限公司
住所:山东省济南市市中区经七路86号
办公地址:山东省济南市市中区经七路86号
法定代表人:李玮
电话:（0531）68889155
传真:（0531）68889752
联系人:吴阳
客户服务电话:95538
网址:www.qlzq.com.cn

（20）江海证券有限公司
住所:黑龙江省哈尔滨市香坊区赣水路56号
法定代表人:孙名扬
电话:（0451）85863719
传真:（0451）82287211
联系人:刘爽
客户服务电话:400-666-2288
网址:www.jhzq.com.cn

（21）平安证券有限责任公司
住所:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼
办公地址:深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼(518048)
法定代表人:杨宇翔
电话:（0755）22627802
传真:（0755）82400862
联系人:郑舒丽
客户服务电话:95511-8
网址:www.pingan.com

（22）中国国际金融股份有限公司
住所:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
办公地址:北京建国门外大街1号国贸大厦2座27层及28层
法定代表人:丁学东
电话:（010）65051166
传真:（010）85679203
联系人:杨涵宇
网址:www.cicc.com.cn

（23）国金证券股份有限公司
住所:四川省成都市东城根上街95号
办公地址:成都市东城根上街95号
法定代表人:冉云
电话:（028）86690057,（028）86690058
传真:（028）86690126
联系人:刘婧漪 贾鹏
客户服务电话:95310
网址:www.gjzq.com.cn

（24）信达证券股份有限公司
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
电话:（010）63081000
传真:（010）63081344
联系人:唐静
客户服务电话:95321
网址:www.cindasc.com

（25）西南证券股份有限公司
住所:重庆市江北区桥北苑8号
办公地址:重庆市江北区桥北苑8号西南证券大厦
法定代表人:余维佳
电话:（023）63786141
传真:（023）63786212
联系人:张煜
客户服务电话:400-809-6096
网址:www.swsc.com.cn

（26）中国中投证券有限责任公司
住所: 深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层
法定代表人:龙增来
电话:（0755）82023442
传真:（0755）82026539
联系人:刘毅
客户服务电话:400-600-8008
网址:www.china-invs.cn

（27）华融证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街8号
办公地址:北京市西城区金融大街8号
法定代表人:宋德清
电话:（010）58568235
传真:（010）58568062
联系人:黄恒
客户服务电话:（010）58568118
网址:www.hrsec.com.cn

（28）天相投资顾问有限公司
住所:北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号C座5层
法定代表人:林义相
电话:（010）66045529
传真:（010）66045518
联系人:尹伶
客户服务电话:（010）66045678
网址:http://www.txsec.com,www.jjm.com.cn

（29）中信期货有限公司
住所:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
办公地址:深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座13层1301-1305室、14层
法定代表人:张皓
电话:（0755）23953913
传真:（0755）83217421
联系人: 洪诚
客户服务电话:400-990-8826
网址:www.citicsf.com

（30）杭州数米基金销售有限公司
住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号
办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
法定代表人:陈柏青
电话:（0571）28829790,（021）60897869
传真:（0571）26698533
联系人:周嬿旻
客户服务电话:4000-766-123
网址:www.fund123.cn

（31）深圳众禄基金销售有限公司
住所:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
办公地址:深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦8楼
法定代表人:薛峰
电话:（0755）33227953
传真:（0755）33227951
联系人:汤素娅
客户服务电话:4006-788-887
网址:www.zlfund.cn,www.jjmmw.com

（32）上海长量基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层
法定代表人:张跃伟
电话:（021）20691832
传真:（021）20691861
联系人:单丙烨
客户服务电话:400-820-2899
网址:www.erichfund.com

（33）诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司
住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼
法定代表人:汪静波
电话:（021）38600735
传真:（021）38509777
联系人:方成
客户服务电话:400-821-5399
网址:www.noah-fund.com

（34）和讯信息科技有限公司
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层
法定代表人:王莉
电话:（021）20835789
传真:（021）20835879
联系人:周轶
客户服务电话:4009200022
网址:http://licaike.hexun.com/

（35）上海天天基金销售有限公司
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼
法定代表人:其实
电话:（021）54509998
传真:（021）64385308
联系人:潘世友
客户服务电话:400-1818-188
网址:www.1234567.com.cn

（36）北京钱景财富投资管理有限公司
住所:北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012
办公地址:北京市海淀区丹棱街6幢1号9层1008-1012
法定代表人:赵荣春
电话:（010）57418829
传真:（010）57569671
联系人: 魏争
客户服务电话: 400-678-5095
网址:www.niuji.net

（37）深圳市新兰德证券投资咨询有限公司
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层
法定代表人:陈操
电话:（010）58325395
传真:（010）58325282
联系人:刘宝文
客户服务电话:400-850-7771
网址:http://8.jrj.com.cn/

（38）北京展恒基金销售股份有限公司
住所:北京市顺义区后沙峪镇安富街6号
办公地址:北京市朝阳区安苑路15-1号邮电新闻大厦2层
法定代表人:闫振杰
电话:（010）59601366-7024
传真:（010）62020355
联系人: 马林
客户服务电话:400-888-6661
网址:www.myfund.com

（39）一路财富（北京）信息科技有限公司
住所:北京市西城区车公庄大街9号五栋大楼C座702
办公地址:北京市西城区阜成门大街2号万通新世界广场A座22层2208
法定代表人: 吴雪秀
电话:010-88312877
传真:010-88312099
联系人: 苏昊
客户服务电话:400-001-1566
网址:http://www.yilucaifu.com/

（40）上海联泰资产管理有限公司
住所:中国（上海）自由贸易试验区富特北路277号3层310室
办公地址:上海市长宁区福泉北路518号8座3楼
法定代表人:燕斌
电话:021-52822063
传真:021-52975270
联系人:凌秋艳
客户服务电话:4000-466-788
网址:www.66zichan.com

（41）宜信普泽投资顾问（北京）有限公司
住所:北京市朝阳区建国路88号9号楼15层1809
办公地址:北京市朝阳区建国路88号SOHO现代城C座1809
法定代表人:沈伟桦
电话:010-52855713
传真:010-85894285
联系人:程刚
客户服务电话:400-6099-200
网址:www.yixinfund.com

（42）北京增财基金销售有限公司
住所:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
办公地址:北京市西城区南礼士路66号建威大厦1208
法定代表人:罗细安
电话:（010）67000988
传真:（010）67000988-6000
联系人:李皓
客户服务电话:400-001-8811
网址:www.zengcaiwang.com

（43）泰诚财富基金销售（大连）有限公司
住所:辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
办公地址: 辽宁省大连市沙河口区星海中龙园3号
法定代表人:林卓
电话:（0411）88891212
传真:（0411）84396536
联系人:薛长平
客户服务电话:4006411999
网址:www.taichengcaifu.com

（44）上海基煜基金销售有限公司
住所:上海市崇明县长兴镇路潘园公路1800号2号楼6153室（上海泰和经济发展区）
办公地址:上海市杨浦区昆明路518号A1002室
法定代表人:王翔
电话:（021）65370077
传真:（021）55085991
联系人:俞申莉
客户服务电话:（021）65370077
网址:http://www.fofund.com.cn/

（45）珠海盈米财富管理有限公司
住所:珠海市横琴新区宝华路6号105室-3491
办公地址:广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔12楼B1201-1203
法定代表人:肖雯
电话:（020）89629099
传真:（020）89629011
联系人:黄敏嫦
客户服务电话:（020）89629066
网址:www.yingmi.cn

（46）深圳富济财富管理有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室
办公地址:深圳市南山区高新南七道12号惠恒集团二期418室
法定代表人:齐小贺
电话:（0755）83999907-802
传真:（0755）83999926
联系人: 马力佳
客户服务电话:（0755）83999907
网址:www.jinqianwo.com

（47）上海陆金所资产管理有限公司
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼09单元
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1333号14楼
法定代表人:郭坚
电话:（021）20665952
传真:（021）22066653
联系人:宁博宇
客户服务电话:4008219031
网址:www.lufunds.com

（48）上海汇付金融服务有限公司
住所:上海市中山南路100号金外滩国际广场19楼
办公地址:上海市虹梅路1801号凯科国际大厦7楼
法定代表人:冯修敏
电话:（021）33323999
传真:（021）33323837
联系人:陈云卉
客户服务电话:4008213999
网址:https://tty.chinapnr.com

（49）北京乐融多源投资咨询有限公司
住所:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
办公地址:北京市朝阳区西大望路1号1号楼16层1603室
法定代表人:董浩
电话:（010）56580666
传真:（010）56580660
联系人:张婷婷
客户服务电话:400-068-1176
网址:www.jimufund.com

（50）上海凯石财富基金销售有限公司
住所:上海市黄浦区西藏南路765号602-115室
办公地址:上海市黄浦区延安东路1号凯石大厦4楼
法定代表人:陈继武
电话:021-63333319
传真:021-63332523
联系人:李晓明
客服电话:4000 178 000
网址:www.lingxianfund.com

（51）上海利得基金销售有限公司
住所: 上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
办公地址:上海浦东新区峨山路91弄61号陆家嘴软件园10号楼12楼
法定代表人:沈继伟
电话:021-50583533
传真:021-50583633
联系人: 徐鹏
客服电话:400-005-6355
网址:a.leadfund.com.cn

（52）大泰金石投资管理有限公司
住所:南京市建邺区江东中路359号国睿大厦一号楼B区4楼A506室
办公地址:上海市长宁区虹桥路1386号文广大厦15楼
法定代表人:袁顾明
电话:（025）68206846
传真:（021）22268089
联系人:何庭宇
客户服务电话:400-928-2266/021-22267995
网址:www.dtfunds.com

（53）浙江同花顺基金销售有限公司
住所:浙江省杭州市文二西路1号元茂大厦903
办公地址:浙江省杭州市西湖区翠柏路7号电子商务产业园2号楼 2楼
法定代表人:凌顺平
电话:（0571）88911818
传真:（0571）86800423
联系人:吴强
客户服务电话:400-877-3772
网址:www.5ifund.com

（54）上海好买基金销售有限公司
住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室
法定代表人:杨文斌
传真:（021）68596916
联系人:薛年
客户服务电话:400-700-9665
网址:www.ehowbuy.com

（55）北京汇成基金销售有限公司
住所:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
办公地址:北京市海淀区中关村大街11号11层1108
法定代表人:王伟刚
电话:（010）56282140
传真:（010）62680827
联系人:丁向坤
客户服务电话:400-619-9059
网址:www.fundzone.cn、www.51jijinhui.com

（56）北京恒天明泽基金销售有限公司
住所:北京市经济技术开发区宏达北路10号五层5122室
办公地址:北京市朝阳区东三环北路甲19号SOHO嘉盛中心30层3001室
法定代表人:李悦
电话:（010）56642600
传真:（010）56642623
联系人:张晔
客户服务电话:4007868868
网址:www.chtfund.com

（57）北京广源达信投资管理有限公司
住所:北京市西城区新街口外大街28号C座六层605室
办公地址:北京市朝阳区望京东园四区13号楼浦项中心B座19层
法定代表人:齐剑辉
电话:（010）57298634
传真:（010）82055860
联系人:王英俊
客户服务电话:400-623-6060
网址:www.niuniufund.com

（58）奕丰金融服务（深圳）有限公司
住所:深圳市前海深港合作区前湾一路1号A栋201室（入住深圳市前海商务秘书有限公司）
办公地址:深圳市南山区海德三路海岸大厦东座1115室,1116室及1307室
法定代表人:TAN YIK KUAN
电话:（0755）89460500
传真:（0755）21674453
联系人:叶健
客户服务电话:400-684-0500
网址:www.ifastps.com.cn

基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构销售本基金,并及时公告。

（二）登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司
住所:北京市西城区太平桥大街17号
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号
法定代表人:周明
电话:（010）50938617
传真:（010）50938907
联系人:周莉

（三）出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所
住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人:俞卫锋
电话:（021）31358666
传真:（021）31358600
联系人:丁媛
经办律师:黎明、丁媛

（四）审计基金财产的会计师事务所

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
执行事务合伙人:李丹
联系电话:（021）23238888
传真:（021）23238800
联系人:沈兆杰
经办注册会计师:薛竞、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称:交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式

六、基金的投资目标

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%。

七、基金的投资方向

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,以中证环境治理指数的成份股及其备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股)、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为:本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,本基金投资于中证环境治理指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%, 投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后,持有现金或到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

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,即按照中证环境治理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。在正常市场情况下,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%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围, 基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%,本基金投资于中证环境治理指数的成份股及其备选成份股的比例不低于非现金基金资产的90%,其余资产可投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、债券、中期票据、货币市场工具、债券回购、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会批准的允许基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会相关规定）,其目的是在保证基金资产流动性的前提下,有效利用基金资产,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略,在严格控制风险的情况下,通过信用研究和流动性管理,选择风险调整后的收益高的品种进行投资,以期获得长期稳定收益。

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。在建仓期或者出现大量净申购或净赎回的情况时,本基金将使用股指期货来进行流动性风险管理。本基金力争利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

基金管理人针对股指期货交易制订严格的授权管理制度和投资决策流程,确保研究分析、投资决策、交易执行及风险控制各环节的独立运作,并明确相关岗位职责。此外,基金管理人建立股指期货交易决策部门或小组,并授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项。

九、基金的业绩比较基准

中证环境治理指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%

本基金的标的指数为中证环境治理指数。中证环境治理指数是由中证指数有限公司编制,代表性和可投资性受到市场认可。

由于本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%,因此本基金业绩比较基准中同时加入了5%的银行活期存款利率(税后)。本基金管理人认为,该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。

如果今后本基金所跟踪的标的指数的指数编制单位变更或停止中证环境治理指数的编制、发布或授权,或中证环境治理指数由其他指数替代、或由于指数编制方法的重大变更等事项导致中证环境治理指数不宜继续作为标的指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出,基金管理人认为有必要作相应调整时,本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原则,在履行适当程序后变更本基金的标的指数、业绩比较基准和基金名称等。其中,若变更标的指数涉及本基金投资范围或投资策略的实质性变更, 则基金管理人应就变更标的指数召开基金份额持有人大会,报中国证监会备案且在指定媒介公告。若变更标的指数对基金投资范围和投资策略无实质性影响（包括但不限于指数编制单位变更、指数更名等事项）,基金管理人应与基金托管人协商一致后,报中国证监会备案并及时公告。标的指数发生变更的,本基金业绩比较基准也相应变更。

除上述情形外,如果今后法律法规发生变化,或者市场推出更具权威、且更能够表征本基金风险收益特征的业绩比较基准,则本基金管理人可与本基金托管人协商一致后,调整或变更本基金的业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

十、基金的风险收益特征

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。

十一、基金投资组合报告

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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月20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。

本报告期为2016年4月1日至2016年6月30日。本基金投资组合报告列示的系转型前基金——交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金的财务资料,本报告财务资料未经审计。

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	119,806,648.31	93.65
	其中:股票	119,806,648.31	93.65
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	6,992,962.18	5.47
7	其他各项资产	1,125,864.44	0.88
8	合计	127,925,474.93	100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1、积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	61,588,970.84	48.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,019,895.48	15.74
E	建筑业	6,634,140.32	5.21
F	批发和零售业	-	-
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	3,001,848.00	2.36
N	水利、环境和公共设施管理业	28,561,793.67	22.45
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	119,806,648.31	94.18

2.3报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

3、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

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	300156	神雾环保	180,002	3,704,441.16	2.91
2	002340	格林美	409,600	3,592,192.00	2.82
3	601388	怡球资源	165,400	3,551,138.00	2.79
4	300055	万邦达	188,112	3,425,519.52	2.69
5	000939	凯迪生态	382,048	3,419,329.60	2.69
6	000925	众合科技	176,600	3,408,380.00	2.68
7	002341	新纶科技	156,300	3,365,139.00	2.65
8	000035	中国天楹	464,853	3,286,510.71	2.58
9	300137	先河环保	220,234	3,257,260.86	2.56
10	300262	巴安水务	209,440	3,208,620.80	2.52

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。

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、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。

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。

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。

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。

9、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。

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。

11、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中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

（3）其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	5,915.89
2	应收证券清算款	1,113,936.70
3	应收股利	-
4	应收利息	2,171.44
5	应收申购款	3,840.41
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,125,864.44

（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）报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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。

（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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为2016年6月30日,本章节列示的系转型前基金——交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金的基金业绩表现,所载业绩数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

下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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

1、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	3.02%	1.63%	3.22%	1.53%	-0.20%	0.10%
2016年上半年度	-19.21%	2.61%	-18.25%	2.40%	-0.96%	0.21%
自基金合同生效日起至今（2015年8月13日至2016年6月30日）	-7.90%	2.28%	-21.82%	2.63%	13.92%	-0.35%

注:交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金的业绩比较基准:中证环境治理指数收益率×95%＋银行活期存款利率（税后）×5%,下图同。

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

交银施罗德中证环境治理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8月13日至2016年6月30日）



注:本基金基金合同生效日为2015年8月13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。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

1、基金管理人的管理费;
2、基金托管人的托管费;
3、基金标的指数许可使用费;
4、基金上市初费及上市年费;
5、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;
6、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费;
7、基金份额持有人大会费用;
8、基金的证券、期货交易费用;
9、基金的银行汇划费用;
10、基金的开户费用、账户维护费用;
11、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.0%年费率计提。管理费的计算方法如下:

$H = E \times 1.0\% \div 当年天数$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

自基金转型实施日起,基金管理费每日计提,按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后,由基金托管人于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$H = E \times 0.2\% \div 当年天数$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

自基金转型实施日起,基金托管费每日计提,按月支付。由基金管理人与基金托管人核对一致后, 由基金托管人复核后于次月首日起第3个工作日从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

（3）标的指数许可使用费

本基金作为指数基金,需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数许可使用费。通常情况下,本基金标的指数许可使用费按前一日基金资产净值的0.02%的年费率计提,标的指数许可使用费的计算方法如下:

$H = E \times 0.02\% \div 当年天数$

H为每日应计提的标的指数许可使用费

E为前一日基金资产净值

自基金转型实施日起,基金标的指数许可使用费每日计提,按季支付,标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币5万元,计费期间不足一季度的,根据实际天数按比例计算。由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数许可使用费划付指令, 经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付,若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的,支付日期顺延。

如果标的指数供应商根据相应指数使用许可协议变更上述标的指数许可使用费费率和计费方式,本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数许可使用费。此项调整无需召开基金份额持有人大会,基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。

（4）上述"（一）基金费用的种类"中第4－11项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

2、与基金销售有关的费用

（1）申购费

本基金的申购费用由基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、登记等各项费用。

投资人可以多次申购本基金,申购费用按每笔申购申请单独计算。

本基金的场外申购费率如下:

	申购金额（含申购费）	场外申购费率
申购费率	50万元以下	1.2%
	50万元（含）至100万元	0.8%
	100万元（含）至200万元	0.6%
	200万元（含）至500万元	0.4%
	500万元以上（含500万）	每笔交易1000元

本基金的场内申购费率由场内销售机构参照上表场外申购费率设定。

因红利自动再投资而产生的基金份额,不收取相应的申购费用。

本基金对通过基金管理人直销柜台申购基金的养老金客户实施特定申购费率。

养老金客户指基本养老基金与依法成立的养老计划筹集的资金及其投资运营收益形成的补充养老基金等,具体包括:

1）全国社会保障基金;
2）可以投资基金的地方社会保障基金;
3）企业年金单一计划以及集合计划;
4）企业年金理事会委托的特定客户资产管理计划;
5）企业年金养老金产品。

如将来出现经养老基金监管部门认可的新的养老基金类型, 本公司可在招募说明书更新或发布临时公告将其纳入养老金客户范围,并按规定向中国证监会备案。

通过基金管理人直销柜台申购本基金基金份额的养老金客户特定申购费率如下表:

	申购金额（含申购费）	特定申购费率
申购费率	50万元以下	0.24%
	50万元（含）至100万元	0.16%
	100万元（含）至200万元	0.12%
	200万元（含）至500万元	0.08%
	500万元以上（含500万）	每笔交易1000元

（2）申购份额的计算

申购总金额=申请总金额

净申购金额=申购总金额/（1+申购费率）

（注:对于适用固定金额申购费用的申购,净申购金额＝申购总金额－固定申购费用金额）

申购费用=申购总金额-净申购金额

（注:对于适用固定金额申购费用的申购,申购费用＝固定申购费用金额）

申购份额=（申购总金额-申购费用）/ T日基金份额净值

例一:某投资者（非养老金客户）投资50,000元场外申购本基金（非网上交易）,假设申购当日基金份额净值为1.040元,申购费率为1.2%,则其可得到的申购份额为:

申购总金额＝50,000元
净申购金额=50,000/（1+1.2%）=49,407.11元
申购费用=50,000-49,407.11=592.89元
申购份额=（50,000-592.89）/1.040=47,506.84份

即:某投资者（非养老金客户）投资50,000元场外申购本基金（非网上交易）,假设申购当日基金份额净值为1.040元,则其可得到47,506.84份基金份额。

如果投资者是场内申购,则申购份额为47,506份,其余0.84份对应金额返回给投资者。退款金额具体计算如下:

实际净申购金额=47,506×1.040=49,406.24元
对应返还申购金额=50,000-49,406.24-592.89=0.87元

例二:某养老金客户投资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.040元,申购费率为0.24%,则其可得到的申购份额为:

申购总金额＝100,000元
净申购金额=100,000/（1+0.24%）=99,760.57元
申购费用=100,000-99,760.57=239.43元
申购份额=（100,000-239.43）/1.040=95,923.63份

即:该养老金客户投资100,000元通过基金管理人的直销柜台申购本基金,假设申购当日基金份额净值为1.040元,则其可得到95,923.63份基金份额。

（3）赎回费

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担, 在基金份额持有人赎回基金份额时收取,赎回费总额的25%应归基金财产,其余用于支付登记费和其他必要的手续费。

本基金的场外赎回费率如下:

	持有期限	赎回费率
赎回费率	1年以内（含）	0.5%
	1年-2年（含）	0.2%
	2年以上	0

上表中的"年"指的是365个自然日。场外赎回基金份额时,其持有期限的计算以中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则为准。

本基金的场内赎回费率为固定值0.5%,不按份额持有时间分段设置赎回费率。

（4）赎回金额的计算

本基金的场外赎回和场内赎回均采用份额赎回的方式。赎回金额为按实际确认的有效赎回份额乘以当日基金份额净值并扣除相应的费用,赎回金额单位为元,计算结果保留到小数点后两位,第三位四舍五入。 赎回金额的计算方法如下:

赎回费用=赎回份额×T日基金份额净值×赎回费率
赎回金额=赎回份额×T日基金份额净值-赎回费用

例一:某投资者在场外赎回持有的50,000份基金份额,持有期限为1.5年,对应的赎回费率为0.2%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用 ＝ 50,000×1.016×0.2%＝101.60元
赎回金额 ＝ 50,000×1.016-101.60＝50,698.40元

即:投资者在场外赎回50,000份基金份额,对应的赎回费率为0.2%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为50,698.40元。

例二:某投资者在场内赎回持有的50,000份基金份额,持有期限为1.5年,对应的赎回费率固定值为0.5%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为:

赎回费用 ＝ 50,000×1.016×0.5%＝254.00元
赎回金额 ＝ 50,000×1.016-254.00＝50546.00元

即:投资者在场内赎回50,000份基金份额,对应的赎回费率为0.5%,假设赎回当日基金份额净值是1.016元,则其可得到的赎回金额为50546.00元。

（5）网上直销的有关费用

本基金管理人已开通基金网上直销业务, 个人投资者可以直接通过本公司网站的网上直销交易平台办理开户和本基金的申购、赎回等业务。通过网上直销交易平台办理本基金申购业务的个人投资者将享受申购费率优惠,其他费率标准不变。具体优惠费率请参见公司网站列示的网上直销交易平台申购费率表或相关公告。

本公司基金网上直销业务已开通的银行卡及各银行卡交易金额限额请参阅本公司网站。

个人投资者通过本基金管理人网上直销交易平台申购本基金的单笔最低金额为10元（含）。

本基金管理人可根据业务情况调整上述交易费用和限额要求, 并依据相关法规的要求提前进行公告。

（6）基金管理人可以在基金合同约定的范围内调整费率或收费方式,并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

（7）基金管理人可以在不违背法律法规规定及基金合同约定的情况下根据市场情况制定基金促销计划,针对投资人定期和不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间,基金管理人可以按中国证监会要求履行必要手续后,对投资人适当调低基金销售费用。

（三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用:

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失;
2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》生效前的相关费用;
4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

（四）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,基金转型实施日前的信息披露费、律师费和会计师费以及相关费用按照《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金合同》的相关约定处理。

（五）基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率等相关费率。基金管理人必须依照有关规定于新的费率实施日前在指定媒介上刊登公告。

（六）基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

（一）更新了"三、基金管理人"中相关内容。
（二）更新了"四、基金托管人"中相关内容。
（三）更新了"五、相关服务机构"中相关内容。
（四）更新了"九、基金份额的申购与赎回"中相关内容。
（五）更新了"十、基金的投资"中"基金投资组合报告"相关内容,数据截止到2016年6月30日。
（六）更新了"十一、基金的业绩"中相关内容,数据截止到2016年6月30日。
（七）更新了"二十一、托管协议的内容摘要"中的相关内容。
（八）更新了"二十三、其他应披露事项"中的相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司
二〇一六年九月二十七日