交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF) 2016年年度报告摘要

(交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金)

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
报告送出日期:二〇一七年三月二十九日

§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,并由董事长签发。

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2017年3月28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及其更新。

本基金管理人于2016年4月1日起至2016年6月30日止通讯方式召开了基金份额持有人大会,就本基金转型相关事宜进行表决。本次基金份额持有人大会决议于2016年6月30日生效,本基金管理人根据基金份额持有人大会的授权,以2016年7月18日为本基金分级份额终止运作转换基准日,并于2016年7月19日正式实施基金转型,自2016年7月19日起,《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金合同》失效且《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》同时生效,交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金正式变更为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至12月31日止。本报告按基金转型前后的两个报告期进行编制,其中,基金转型前的原交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(指数级)及交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)基金合同于2016年1月18日起至2016年7月18日止,基金转型后的交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)报告期间为2016年7月19日起至2016年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金本情况

2.1.1交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

基金简称	交银中证环境治理指数(LOF)
场内简称	环境治理
基金主代码	164908
交易代码	164908
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	143,982,354.68份
基金合同存续期	不定期

注:1.原交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)简称"原基金",是由交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)(原交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF),新基金合同及托管协议即日起生效,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。

2.1.2交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

基金简称	交银中证环境治理指数分级		
场内简称	环境治理		
基金主代码	164908		
交易代码	164908		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年8月13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	136,744,307.51份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	环境治理	环境A	环境B
下属分级基金的场内简称	环境治理	环境A	环境B
下属分级基金的交易代码	164908	150319	150320
报告期末下属分级基金的份额总额	136,114,195.51份	315,056.00份	315,056.00份

注:上表"报告期末"指2016年7月18日。

2.2 基金产品说明

2.2.1交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

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,或因其他特殊情况导致成份股流动性不足时,或其他影响因素导致基金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。
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%
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、预期较高收益的证券投资基金品种。

2.2.2交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

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,或因其他特殊情况导致成份股流动性不足时,或其他影响因素导致基金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。
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%
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、预期较高收益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,其中交银环境治理分额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征;交银环境治理A分额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征;交银环境治理B分额具有高预期风险、高预期收益的特征。
下属分级基金的风险收益特征	交银环境治理分额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征 / 交银环境治理A分额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征 / 交银环境治理B分额具有高预期风险、高预期收益的特征

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		交银施罗德基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	孙艳	方舞
	联系电话	(021)61055050	4008800000
	电子邮箱	xxpl@jysld.com, disclosure@jysld.com	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95558
传真		(021)61055054	010-85230024

2.4 信息披露方式

项目	www.fund001.com,www.bocomschroder.com
基金年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

3.1.1主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1.1期间数据和指标	报告期(2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日)
本期已实现收益	3,244,924.95
本期利润	3,368,999.07
加权平均基金份额本期利润	0.0228
本期基金份额净值增长率	3.06%
3.1.1.2 期末数据和指标	2016年末
期末可供分配基金份额利润	-0.022
期末基金资产净值	140,841,808.67
期末基金份额净值	0.978

注:1.上述基金业绩指标不包括持有人认购或申购基金份额的各项费用,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.交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金从2016年7月19日起正式转型为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF),截至本报告期末(2016年12月31日),交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)转型时间未满一年。

3.1.2基金净值表现(转型后)

3.1.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
2016年5月1日至2016年7月18日	6.27%	1.48%	5.75%	1.40%	0.52%	0.08%
2016年2月1日至2016年7月18日	17.16%	1.95%	14.40%	1.82%	2.76%	0.13%
自基金合同生效起至2016年12月31日	-5.10%	2.22%	-19.42%	2.56%	14.32%	-0.34%

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%,每日进行再平衡处理。

3.1.2.2 基金净值表现(转型前)

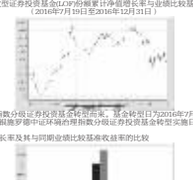
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2016年5月1日至2016年7月18日	6.27%	1.48%	5.75%	1.40%	0.52%	0.08%
2016年2月1日至2016年7月18日	17.16%	1.95%	14.40%	1.82%	2.76%	0.13%
自基金合同生效起至2016年12月31日	-5.10%	2.22%	-19.42%	2.56%	14.32%	-0.34%

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%,每日进行再平衡处理。

3.2.2.1 基金份额净值增长率及与同期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的比较

(2016年7月19日至2016年12月31日)



注:本基金基金合同生效日为2016年8月13日,基金合同生效日至基金转型日前一日,本基金运作时间未满一年。本基金建仓期为日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。

3.2.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:图示日期为2016年7月19日至2016年12月31日。基金合同生效当年的净值增长率按照当年实际存续期计算。

3.2.3 过去三年基金的利润分配情况

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2016年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

3.2交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

3.2.1基金经理(或基金经理小组)及基金投资决策委员会成员情况

	姓名	职务	任本基金的基金经理(期)期限		证券从业年限	说明
			任职日期	离任日期		
蔡铮		交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银环球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数(LOF)的基金经理,公司量化投资部副总监	2015-08-13	-	7年	蔡铮先生,中国国籍,复旦大学电子工程硕士,历任交银施罗德基金管理有限公司,从事证券投资分析员、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、量化投资部助理总经理、2014年12月27日至2015年6月30日担任交银施罗德沪深300行业分层股权激励基金基金经理。2015年8月13日至2016年7月18日担任交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金经理。

注:1.表内所列基金经理(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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定;
3.基金经理(或基金经理小组)负责人(如适用)是指(如有)被认定为基金经理人的相关公告;
4.管理人对投资决策委员会成员的变动,以公告为准。

3.2.2基金经理(或基金经理小组)变动情况

姓名	变动日期	说明
蔡铮	2016-07-19	因本基金转型,本基金基金经理变更为蔡铮、王海涛

3.3 公平交易制度和执行情况

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所管理的所有资产组合投资运作的公平,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门户产品等遵循制度进行公平交易。制度中包含的主要控制方法如下:

(1)公司建立投资共享投权投研决策信息平台,所有研究成果对所有投资组合公平开放,确保各投资组合在获得研究支持和实施投资决策方面享有公平的机会。

(2)公司根据投资管理部制定及执行即使相同策略,实行集中交易制度,建立了合理且可操作的公平交易分配机制,确保投资组合享有公平的交易执行机会。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。

(3)公司建立了调研的投资授权制度,明确各级投资决策主体的调研权限、调研内容、调研报告的编写、调研报告的审查和分发等专业环节的管理,力求在授权范围内独立行使投资决策权,维护所管理投资组合的合法利益,保证各投资组合公司决策的客观性和独立性,防范不公平现象发生的发生。

(4)公司建立统一的投资对象备选库和交易对手备选库,制定明确的备选库建立、维护程序,在全公司适用原则、投资备选库的基础上,根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等,按需要建立不同投资组合的投资对象风险库和交易对手备选库,组合经理在此基础上根据投资授权和建投资组合。

(5)公司中央交易室和风控管理部通过日常交易行为监控,风险管理部及时对各投资组合公司进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的投资风格、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)和期间风险调整后的净值在资产规模、投资风格、业绩表现、风险控制等方面进行横向、纵向比较,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易制度的执行效益。

3.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合。

3.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内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超过该证券当日总成交量5%的情况有2次,超投资组合日均投资策略或合规投资指令的反向交易情况,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下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未发现异常。

4.1 基金管理人对报告期内基本情况的说明

2016年国内经济增速仍呈现调结构的态势,内需疲软,固商一定的不确定性,经济基本面对资本市场的支持力度较为有限,A股市场在上半年表现出大幅下行直叠跌幅度的格局,1月份市场开局即有较明显的熔断效应的影响下,在人民币贬值风险的担忧中大幅快速下跌,此后2、3月份股票大市正不断企稳,银行信贷投入加大,经济数据有所好转等利好因素,市场总体表现出震荡格局。4-6月份随着美元加息预期的反复,国内股票市场以及国内期货品种和相关市场产生较大波动的情况,最终市场的风险偏好有所恢复。第二季度上证综指涨幅近10%,经济转长和企业盈利下行方向较大,同时货币政策延续宽松,随着货币供应量扩大消费配资范围以及人民币贬值影响,市场出现大幅下跌,进入到10月、11月,市场整体表现较为强,在下半12月初房地产结构性调控政策,部分金融政策及时对冲以及了一定短期流动性风险的,并对货币市场产生一定扰动,A股市场呈出现一定程度的调整,作为调控中证环境治理指数的指数基金,在2016年度总体表现出较为强大的表现。

4.2 宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年,国内经济已有所企稳,处于的良性循复苏期间,预计将继续维持温和增长的态势,我们对经济了调整后的A股市场总体维持乐观的看法。

4.6 管理人对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、风险管理部等人员和相应收益人员及基金经理组成。

公司严格按照新会计准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定进行估值,保证基金估值的公平、合理,保持估值政策和程序的一贯性。估值委员会的研究重点包括投资品种的不同性质、研究并参考市场惯例以同的做法、建议合理的估值模型、进行测算和认定、认可后交各估值委员会成员及基金会计、风险、合规等方面的审核,一致同意后,报公司投资总监、总经理审批。

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适用性的情况后,及时召开临时会议进行研究,及时修订估值方法,以保证其持续适用,确保基金资产估值的公允价值。基金管理人在估值委员会成员选定后,将从基金持有人利益出发,以基金管理人的名义与其他基金管理人进行协商,在不影响基金份额持有人实质性利益的前提下,对估值政策进行调整,并及时公告。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)2016年7月19日至2016年12月31日期间未进行利润分配。

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)基金合同于2017年3月24日批准报出。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未触发预警说明。

§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》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)LOF)原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,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)(原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金)的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为,在有关投资方面,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容投资真实、准确和完整发表意见

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,基金管理人所编制和复核的交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)(原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金)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,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)(原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金)2016年12月31日的资产负债表、2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2017)第20163号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

6.2 交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金

普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)对交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金2016年7月18日(基金合同失效前日)的资产负债表、2016年1月13日至2016年7月18日(基金合同失效前日)期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注出具了标准无保留意见的审计报告【普华永道中天审字(2017)第20161号】。投资者可通过本基金年度报告正文查看该审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)

7.1.1资产负债表(转型后)

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:2016年12月31日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
资产:		
银行存款	7.1.4.7.1	8,376,677.46
结算备付金		-
存出保证金		45,098.94
交易性金融资产	7.1.4.7.2	132,966,070.15
其中:股票投资		132,966,070.15
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.1.4.7.4	-
应收证券清算款		694,637.04
应收利息	7.1.4.7.5	1,741.35
应收股利		-
应收申购款		28,172.61
递延所得税资产		-
其他资产	7.1.4.7.6	-
资产总计		142,112,397.55

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		738,121.67
应付赎回款		78,826.29
应付管理人报酬		120,813.25
应付托管费		24,162.65
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.1.4.7.7	68,367.73
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.1.4.7.8	240,297.29
负债合计		1,270,588.88
所有者权益:		-
实收基金	7.1.4.7.9	143,982,354.68
未分配利润	7.1.4.7.10	-3,140,546.01
所有者权益合计		140,841,808.67
负债和所有者权益总计		142,112,397.55

注:1.报告截止日2016年12月31日,基金份额净值0.9780元,基金份额总额143,982,354.68份。
2.本财务报表的实际编制期间为2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日。
3.本期末中所产负债表和利润表中划阴注号为年度报告正文中对应的附注号,投资者欲了解相应附注的内容,应阅读登载于基金管理人网站的年度报告正文。

7.1.2 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:2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日
一.收入		4,445,800.31
1.利息收入		32,868.31
其中:存款利息收入	7.1.4.7.11	32,868.31
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		4,211,845.60
其中:股票投资收益	7.1.4.7.12	4,206,052.71
基金投资收益		-
债券投资收益	7.1.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.1.4.7.14	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.1.4.7.15	-
股利收益	7.1.4.7.16	5,792.89
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.1.4.7.17	124,074.12
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.1.4.7.18	77,012.28
减:二.费用		1,076,801.24
1.管理人报酬		672,812.60
2.托管费		134,762.45
3.销售服务费		-
4.交易费用	7.1.4.7.19	166,850.15
5.利息支出		-
其中:卖出回购金融资产支出		-
6.其他费用	7.1.4.7.20	101,376.04
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		3,368,999.07
减:所得税费用		-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		3,368,999.07

7.1.3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:2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2016年7月19日(转型生效日)至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	136,744,307.51	-6,943,252.05	129,801,055.46
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,368,999.07	3,368,999.07
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	7,238,047.17	433,706.97	7,671,754.14
其中:1.基金申购款	73,183,886.82	1,417,067.62	74,600,954.44
2.基金赎回款	-65,945,839.65	-983,360.65	-66,929,200.30
四.本期内基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五.期末所有者权益(基金净值)	143,982,354.68	-3,140,546.01	140,841,808.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告共编制了第1页至第24页财务报表及下列财务报表:

基金管理人负责人:阮红 主管会计工作负责人:夏华龙 会计机构负责人:单江

7.14 报表附注

7.14.1 基金基本情况

《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"是由交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金(以下简称"原基金")通过基金份额计变更而来,原基金经中国证券监督管理委员会以《关于核准交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金募集的批复》(证监许可[2015]940号)文予核准,由交银施罗德基金管理有限公司向原《中国证券报》、《上海证券报》、《证券日报》、《证券时报》、《证券市场周刊》公开募集,并经原交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金(LOF)基金合同生效后,在