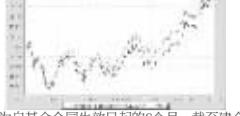


交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告



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	任本基金的基金管理期间	证券从业年限	说明
薛静	基金经理	2015-06-27	8年	薛静先生,中国国籍,复旦大学电子工程系毕业,历任瑞士信贷银行(中国)有限公司项目经理,交银施罗德基金管理有限公司研究员、基金经理助理,2012年12月至2015年6月任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2015年4月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2015年6月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年1月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年4月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年5月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年6月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年7月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年8月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年9月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年10月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年11月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2016年12月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2017年1月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2017年2月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理,2017年3月起任交银施罗德基金管理有限公司基金经理。

4.2 4.2报告期内本基金运作合规性声明

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,基金托管人和基金管理人对有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.3 4.3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,旗下各基金管理的资产组合,包括证券投资组合和特定客户资产管理专户均严格执行公平交易制度,全面通过交易系统实行比例配对,对于非对冲产品而言,以公司名义进行场外交易时,遵循“价格优先、比例分配”的原则按照行业独立的投资方案进行操作;对于对冲产品而言,遵循“价格优先、比例分配”的原则按照行业独立的投资方案进行操作。

本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,风险管理部门负责对各自账户的交易行为进行监控,风险管理部门负责对各自账户的交易行为进行监控,并根据公平交易制度的规定,定期对不同时间窗口内向交易所的交易的交易价差进行分析,通过分析收益率和信息偏差来识别不公平交易和利益输送。

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制度的行为。

4.4 报告期内本基金运作合规性声明

在报告期内,本基金管理人严格按照了《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,基金托管人和基金管理人对有关法律法规和基金合同的规定,为基金份额持有人谋求最大利益。

4.5 4.5报告期末本基金未持有通过港股通股票的投资

4.6 4.6报告期末在各个国家(地区)证券市场的股票及存托凭证投资分布

4.7 4.7报告期末未持有股票及存托凭证投资组合

4.8 4.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票及存托凭证

4.9 4.9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

4.10 4.10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

4.11 4.11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贵金属投资明细

4.12 4.12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保险及当日盈亏变动情况

4.13 4.13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指期货及当日盈亏变动情况

4.14 4.14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国债期货及当日盈亏变动情况

4.15 4.15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期权及当日盈亏变动情况

4.16 4.16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商品期货及当日盈亏变动情况

4.17 4.17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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.18 4.18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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.19 4.19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权证及当日盈亏变动情况

4.20 4.20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及当日盈亏变动情况

4.21 4.21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贵金属及当日盈亏变动情况

4.22 4.22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保险及当日盈亏变动情况

4.23 4.23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指期货及当日盈亏变动情况

4.24 4.24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国债期货及当日盈亏变动情况

4.25 4.25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期权及当日盈亏变动情况

4.26 4.26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商品期货及当日盈亏变动情况

4.27 4.27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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.28 4.28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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.29 4.29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权证及当日盈亏变动情况

4.30 4.30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及当日盈亏变动情况

4.31 4.31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贵金属及当日盈亏变动情况

4.32 4.32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保险及当日盈亏变动情况

4.33 4.33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指期货及当日盈亏变动情况

4.34 4.34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国债期货及当日盈亏变动情况

4.35 4.35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期权及当日盈亏变动情况

4.36 4.36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商品期货及当日盈亏变动情况

4.37 4.37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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.38 4.38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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.39 4.39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权证及当日盈亏变动情况

4.40 4.40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及当日盈亏变动情况

4.41 4.41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贵金属及当日盈亏变动情况

4.42 4.42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保险及当日盈亏变动情况

4.43 4.43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指期货及当日盈亏变动情况

4.44 4.44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国债期货及当日盈亏变动情况

4.45 4.45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期权及当日盈亏变动情况

4.46 4.46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商品期货及当日盈亏变动情况

4.47 4.47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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.48 4.48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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.49 4.49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权证及当日盈亏变动情况

4.50 4.50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及当日盈亏变动情况

4.51 4.51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贵金属及当日盈亏变动情况

4.52 4.52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保险及当日盈亏变动情况

4.53 4.53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指期货及当日盈亏变动情况

4.54 4.54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国债期货及当日盈亏变动情况

4.55 4.55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期权及当日盈亏变动情况

4.56 4.56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商品期货及当日盈亏变动情况

4.57 4.57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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.58 4.58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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.59 4.59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权证及当日盈亏变动情况

4.60 4.60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及当日盈亏变动情况

4.61 4.61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贵金属及当日盈亏变动情况

4.62 4.62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保险及当日盈亏变动情况

4.63 4.63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指期货及当日盈亏变动情况

4.64 4.64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国债期货及当日盈亏变动情况

4.65 4.65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期权及当日盈亏变动情况

4.66 4.66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商品期货及当日盈亏变动情况

4.67 4.67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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.68 4.68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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.69 4.69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权证及当日盈亏变动情况

4.70 4.70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及当日盈亏变动情况

4.71 4.71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贵金属及当日盈亏变动情况

4.72 4.72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保险及当日盈亏变动情况

4.73 4.73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指期货及当日盈亏变动情况

4.74 4.74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国债期货及当日盈亏变动情况

4.75 4.75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期权及当日盈亏变动情况

4.76 4.76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商品期货及当日盈亏变动情况

4.77 4.77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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.78 4.78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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.79 4.79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权证及当日盈亏变动情况

4.80 4.80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及当日盈亏变动情况

4.81 4.81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贵金属及当日盈亏变动情况

4.82 4.82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保险及当日盈亏变动情况

4.83 4.83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指期货及当日盈亏变动情况

4.84 4.84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国债期货及当日盈亏变动情况

4.85 4.85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期权及当日盈亏变动情况

4.86 4.86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商品期货及当日盈亏变动情况

4.87 4.87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外汇期货及当日盈亏变动情况

4.88 4.88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其他金融衍生工具及当日盈亏变动情况

4.89 4.89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权证及当日盈亏变动情况

4.90 4.90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及当日盈亏变动情况

4.91 4.91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贵金属及当日盈亏变动情况

4.92 4.92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保险及当日盈亏变动情况

4.93 4.93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指期货及当日盈亏变动情况

4.94 4.94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国债期货及当日盈亏变动情况

4.95 4.95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期权及当日盈亏变动情况

4.96 4.