

交银施罗德中证环境治理指数型证券投资
基金(LOF)
2021年第3季度报告

2021年9月30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

报告送出日期：2021年10月26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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 10 月 25 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 2021 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	交银中证环境治理指数 (LOF)
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	605,899,618.36 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。

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、预期收益较高的证券投资基金品种。	
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	
下属分级基金的基金简称	交银中证环境治理指数(LOF)A	交银中证环境治理指数(LOF)C
下属分级基金的场内简称	环境治理	-
下属分级基金的交易代码	164908	013413
报告期末下属分级基金的份额总额	546,760,388.33份	59,139,230.03份

§ 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(2021年7月1日-2021年9月30日)	报告期(2021年8月30日-2021年9月30日)
	交银中证环境治理指数(LOF)A	交银中证环境治理指数(LOF)C
1. 本期已实现收益	-1,479,245.04	-14,279.06
2. 本期利润	30,823,866.82	-329,993.47
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0641	-0.0147
4. 期末基金资产净值	308,835,201.36	33,401,745.33
5. 期末基金份额净值	0.5648	0.5648

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 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

交银中证环境治理指数(LOF)A

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	13.87%	1.47%	14.00%	1.48%	-0.13%	-0.01%
过去六个月	6.97%	1.21%	6.79%	1.22%	0.18%	-0.01%
过去一年	6.57%	1.26%	7.10%	1.29%	-0.53%	-0.03%
过去三年	3.63%	1.53%	4.27%	1.57%	-0.64%	-0.04%
过去五年	-43.35%	1.43%	-40.77%	1.45%	-2.58%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-40.48%	1.42%	-37.70%	1.44%	-2.78%	-0.02%

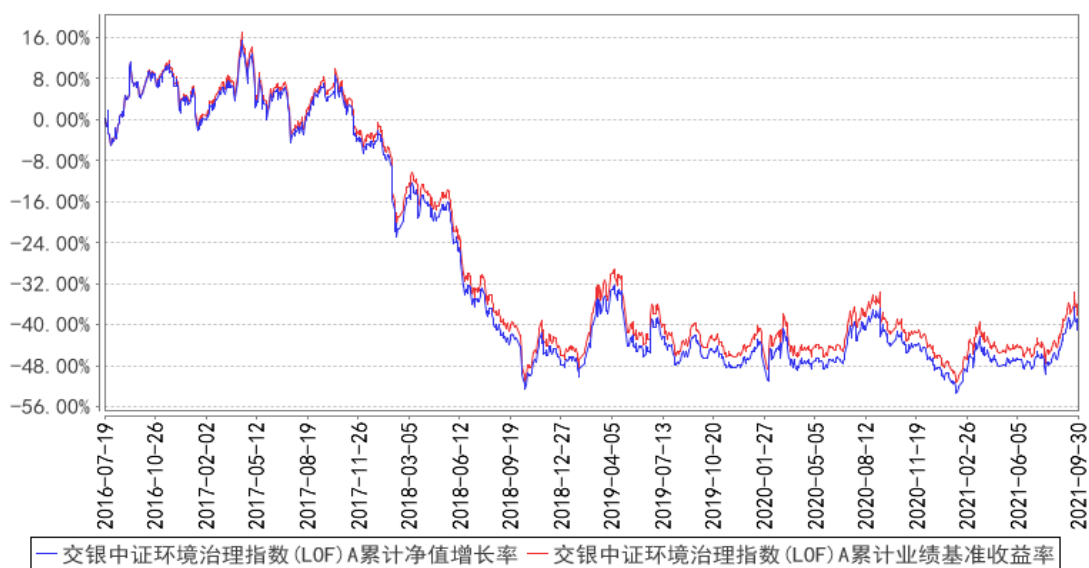
交银中证环境治理指数 (LOF) C

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
自基金合同生效起至今	7.75%	1.92%	7.89%	1.95%	-0.14%	-0.03%

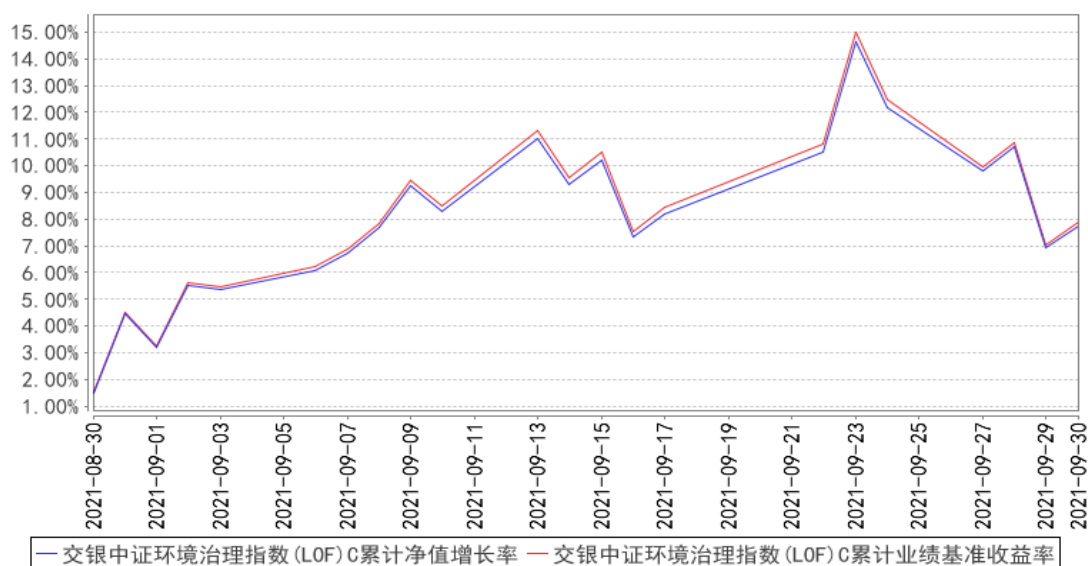
注：交银中证环境治理指数 (LOF) C 上述“自基金合同生效起至今”实际为“自基金份额类别首次确认起至今”，下同。

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

交银中证环境治理指数 (LOF) A 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



交银中证环境治理指数 (LOF) C 累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、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。基金转型日为 2016 年 7 月 19 日。本基金的投资转型期为交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金转型实施日（即 2016 年 7 月 19 日）起的 6 个月。截至投资转型期结束，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。

2、本基金自 2021 年 8 月 27 日起，开始销售 C 类份额，投资者提交的申购申请于 2021 年 8 月 30 日被确认并将有效份额登记在册。

3.3 其他指标

无。

§ 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		
邵文婷	交银上证 180 公司治理 ETF 及其联接、交银深证 300 价值 ETF 及其联接、交银中证海外中国互联网指数	2021 年 4 月 30 日	-	5 年	邵文婷女士，中国国籍，英国诺丁汉大学金融与投资硕士、西南财经大学数学与经济学双学士。2016 年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员，投资经理。

	(QDII-LOF)、 交银中证环境 治理指数 (LOF)、交银创 业板 50 指数、 交银国证新能 源指数(LOF)的 基金经理				
--	--	--	--	--	--

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。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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，基金整体运作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私募资产管理计划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“价格优先、时间优先”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，遵循公平交易分配原则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

2021 年第三季度，国内经济受疫情、汛情冲击明显，短期压力有所加大。宏观基本面方面，三季度制造业景气度延续回落，九月制造业 PMI 指数降至荣枯线以下，而非制造业商务活动指数重回扩张区间。国内需求端呈现放缓趋势，新订单指数继续回落，同时疫情长期化一定程度抑制了消费恢复。生产端在疫情汛情扰动及限电限产等因素影响下，短期冲击较大，九月生产指数降幅明显。流动性方面，七月央行宣布全面降准，且十年期国债收益率持续下行，国内流动性相对宽松。受益于碳达峰、碳中和相关政策持续推进，环境治理板块景气度提升，三季度涨幅较为突出。作为跟踪基准指数的指数基金，三季度基金总体呈现上行态势。

展望 2021 年四季度，随着疫情的影响逐步消退，国内经济将回归常态化。需求下行压力加大背景下，货币政策预计将进一步灵活精准、合理适度，流动性大概率保持结构性宽松，对 A 股形成一定支撑。政策方面，“碳中和”作为全球发展趋势有望成为长期战略方向，未来随着“减污”和“降碳”并举，相关政策高度及力度上升是大概率事件。总体而言，从中长期来看我们对环境治理板块的表现维持谨慎乐观的看法。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金（各类）份额净值及业绩表现请见“3.1 主要财务指标”及“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”部分披露。

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	321,332,029.63	89.70
	其中：股票	321,332,029.63	89.70
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	24,022,215.16	6.71
8	其他资产	12,878,462.88	3.59
9	合计	358,232,707.67	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	94,177,326.56	27.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	34,113,828.59	9.97
E	建筑业	9,390,195.50	2.74
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	5,101,500.00	1.49
N	水利、环境和公共设施管理业	178,549,178.98	52.17
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	321,332,029.63	93.89

5.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

无。

5.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

5.3 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

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	002534	杭锅股份	431,300	10,398,643.00	3.04
2	300203	聚光科技	481,850	9,502,082.00	2.78
3	300055	万邦达	708,694	9,390,195.50	2.74
4	300332	天壕环境	1,100,100	9,185,835.00	2.68
5	002549	凯美特气	647,966	8,877,134.20	2.59
6	002266	浙富控股	1,153,800	8,722,728.00	2.55
7	601388	怡球资源	1,619,600	8,648,664.00	2.53
8	000546	金圆股份	793,900	8,343,889.00	2.44
9	601330	绿色动力	657,800	7,735,728.00	2.26
10	002034	旺能环境	337,645	7,397,801.95	2.16

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

无。

5.3.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的全国中小企业股份转让系统挂牌股票投资明细

无。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

无。

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

无。

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

无。

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

无。

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

无。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

无。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

无。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

5.10.3 本期国债期货投资评价

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除万邦达（证券代码：300055）外，未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

公司全资子公司吉林省固体废物处理有限责任公司于2021年8月4日收到吉林市生态环境局下发的《行政处罚决定书》（吉市环罚[2021]ZD1号、吉市环罚[2021]ZD2号、吉市环罚[2021]ZD6号），行政处罚主要内容：（1）2021年5月12日吉林市生态环境局对吉林固废进行了调查，发现吉林固废“扩建危险废物焚烧设施及新建污泥处理设施项目”需要配套建设的环境保护设施未经验收，建设项目即投入生产。依据《建设项目环境保护管理条例》第二十三条第一款的规定，吉林市生态环境局对吉林固废处以人民币40万元整的罚款。（2）2021年5月12日，对吉林固废“扩建危险废物焚烧设施及新建污泥处理设施项目”的负责人进行了调查，发现其负责的吉林固废“扩建危险废物焚烧设施及新建污泥处理设施项目”配套建设的环境保护设施未经验收，建设项目即投入生产。依据《建设项目环境保护管理条例》第二十三条第一款的规定，吉林市生态环境局对该项目负责人处以人民币7万元整的罚款。（3）2021年7月20日吉林市生态环境局对吉林固废进行了调查，发现吉林固废2021年6月21日污水站总排口Ni排放浓度、氟化物排放浓度超过国家规定标准。依据《中华人民共和国水污染防治法》第八十三条的规定，吉林市生态环境局对吉林固废处以人民币22万元整的罚款。

本基金遵循指数化投资理念，绝大部分资产采用完全复制法跟踪指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。本基金对该证券的投资遵守本基金管理人基金投资管理相关制度及被动式指数化投资策略。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	149,431.02
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,723.44
5	应收申购款	12,724,308.42
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,878,462.88

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

5.11.5 报告期末股票中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

无。

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

无。

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	交银中证环境治理指数 (LOF)A	交银中证环境治理指数 (LOF)C
报告期期初基金份额总额	516,593,490.95	-
报告期期间基金总申购份额	337,377,700.91	72,857,358.26
减：报告期期间基金总赎回份额	307,210,803.53	13,718,128.23
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	546,760,388.33	59,139,230.03

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

单位：份

项目	交银中证环境治理指数 (LOF)A	交银中证环境治理指数 (LOF)C
报告期期初管理人持有的本基金份额	76,052,590.58	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-

报告期期末管理人持有的本基金份额	76,052,590.58	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	12.55	-

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。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

无。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金基金合同的有关规定，经与基金托管人协商一致，本基金管理人已于 2021 年 8 月 27 日起对本基金增加 C 类基金份额，同时调整基金份额净值计算小数点后保留位数，并对本基金的基金合同、托管协议作相应修改，欲知详情请查阅本基金管理人发布的最新法律文件。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《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》；
- 3、《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）招募说明书》；
- 4、《交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）托管协议》；
- 5、《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》；
- 6、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 7、《交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金托管协议》；
- 8、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 9、基金托管人业务资格批件、营业执照；

- 10、关于申请募集注册交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金的法律意见书；
- 11、关于《申请交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金变更注册为交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）》的法律意见；
- 12、报告期内交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金（LOF）、交银施罗德中证环境治理指数分级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)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。