
交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）
（交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金）

2020 年第 4 季度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二一年一月二十一日

§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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 1 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。

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。

本基金管理人已于 2020 年 10 月 16 日起至 2020 年 10 月 27 日以通讯方式召开了交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会决议已于 2020 年 10 月 28 日生效，并自 2020 年 11 月 30 日起，《交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）基金合同》同时生效，交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 10 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，基金转型前的报告期间为 2020 年 10 月 1 日起至 11 月 29 日止，基金转型后的报告期为 2020 年 11 月 30 日起至 12 月 31 日。

§2 基金产品概况

2.1 交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 交银国证新能源指数（LOF） |
| 场内简称 | 交银新能 |
| 基金主代码 | 164905 |
| 交易代码 | 164905 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年11月30日 |
| 报告期末基金份额总额 | 303,042,438.24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，即按照国证新能源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。 |
| 业绩比较基准 | 国证新能源指数收益率×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。本基金为指数型基金，主要采用组合复制策略跟踪标的指数，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。 |
| 基金管理人 | 交银施罗德基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 |

注：1、上表中“报告期末”指2020年12月31日。

2、本基金于2020年11月30日由交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金转型为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF），新基金合同及托管协议即日起生效。

2.2 交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金

| | |
|------------|-----------------|
| 基金简称 | 交银国证新能源指数分级 |
| 场内简称 | 交银新能 |
| 基金主代码 | 164905 |
| 交易代码 | 164905 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2015年3月26日 |
| 报告期末基金份额总额 | 256,228,349.14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，即按照国证新能源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。 | | |
| 业绩比较基准 | 国证新能源指数收益率×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。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，其中交银新能源份额具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征；交银新能源A份额具有低预期风险、预期收益相对稳定的特征；交银新能源B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 | | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 交银新能 | 新能源 A | 新能源 B |
| 下属分级基金的场内简称 | 交银新能 | 新能源 A | 新能源 B |
| 下属分级基金的交易代码 | 164905 | 150217 | 150218 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 233,250,009.14 份 | 11,489,170.00 份 | 11,489,170.00 份 |
| 下属分级基金的风险收益特征 | 交银新能源份额具有与标的指数、以及标 | 交银新能源 A 份额具有低预期风险、预期 | 交银新能源 B 份额具有高预期风险、高预 |

| | | | |
|--|----------------------|-----------|--------|
| | 的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征 | 收益相对稳定的特征 | 期收益的特征 |
|--|----------------------|-----------|--------|

注：上表中“报告期末”指2020年11月29日。

§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 (2020年11月30日-2020年 12月31日) | 报告期 (2020年10月1日-2020年 11月29日) |
|----------------|--------------------------------------|-------------------------------------|
| 1.本期已实现收益 | 18,882,143.65 | 9,899,264.51 |
| 2.本期利润 | 32,491,669.24 | 38,570,095.37 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.1244 | 0.1449 |
| 4.期末基金资产净值 | 343,194,411.61 | 258,509,442.94 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.1325 | 1.0090 |

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、交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金从2020年11月30日起正式转型为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF）。

3.2 基金净值表现

3.2.1 交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF）

（报告期：2020年11月30日-2020年12月31日）

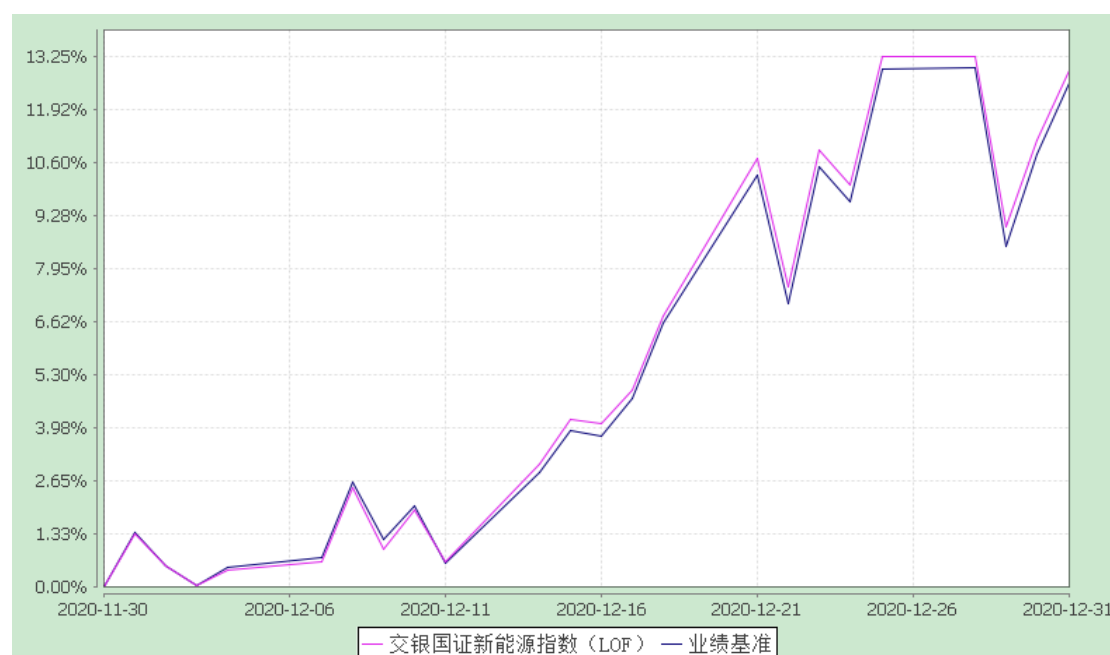
3.2.1.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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2020年11月30日-2020年12月31日 | 12.88% | 1.87% | 12.57% | 1.89% | 0.31% | -0.02% |

注：交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金从 2020 年 11 月 30 日起正式转型为交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF），本表列示的是本报告期基金转型后的基金净值表现，转型后基金的业绩比较基准为国证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.1.2 自基金转型以来基金份额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

交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2020 年 11 月 30 日-2020 年 12 月 31 日)



注：本基金由交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金转型而来。基金转型日为 2020 年 11 月 30 日。本基金基金合同生效日为 2020 年 11 月 30 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 2020 年 12 月 31 日，本基金尚处于建仓期。

3.2.2 交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金

（报告期：2020年10月1日-2020年11月29日）

3.2.2.1 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

| 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 |
|--------------------------------|--------|-----------|------------|---------------|-------|--------|
| 2020 年 10 月 1 至 2020 年 11 月 29 | 16.45% | 1.65% | 15.64% | 1.79% | 0.81% | -0.14% |

| | | | | | | |
|-----------------------|--------|-------|--------|-------|---------|--------|
| 日 | | | | | | |
| 2020年7月1日至2020年11月29日 | 34.39% | 1.73% | 33.56% | 1.79% | 0.83% | -0.06% |
| 2020年1月1日至2020年11月29日 | 52.29% | 1.89% | 51.30% | 1.92% | 0.99% | -0.03% |
| 2018年1月1日至2020年11月29日 | 23.56% | 1.64% | 25.69% | 1.65% | -2.13% | -0.01% |
| 2016年1月1日至2020年11月29日 | 4.11% | 1.63% | 6.73% | 1.64% | -2.62% | -0.01% |
| 自基金合同生效起至2020年11月29日 | 5.85% | 2.00% | 22.81% | 1.90% | -16.96% | 0.10% |

注：交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金从2020年11月30日起正式转型为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金（LOF），本表列示的是本报告期基金转型前的基金净值表现，转型前基金的业绩比较基准为国证新能源指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

3.2.2.2 自基金合同生效日以来基金份额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

交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2015年3月26日-2020年11月29日)



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 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|--|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 蔡铮 | 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(QDI I- | 2020-11-30 | - | 11年 | 蔡铮先生，中国国籍，复旦大学电子工程硕士。历任瑞士银行香港分行分析员。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、量化投资部副总经理。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，2015年4月22日至2017年3月24日担任交银施罗德环球精选价值证券投资基金基金经理，2015年4月22日至2017年3月24日担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金基 |

| | | | | | |
|--|---|--|--|--|---|
| | 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， 公司量 化投资 副总监 兼多元 资产管 理副总 监 | | | | 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基金 经理。2018 年 5 月 18 日至 2020 年 7 月 17 日担任交银 施罗德致远量化智投策略 定期开放混合型证券投资 基金的基金经理。2015 年 6 月 26 日至 2020 年 11 月 25 日担任交银施罗德中证互 联网金融指数分级证券投 资基金的基金经理。2015 年 3 月 26 日至 2020 年 11 月 29 日担任交银施罗德国证 新能源指数分级证券投资 基金的基金经理。 |
|--|---|--|--|--|---|

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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 报告期内基金投资策略和运作分析

2020 年第四季度，经过前两个季度的稳步修复，国内经济加速势头进一步显现。需求端，社会消费品零售总额、固定资产投资与出口增速持续提升；生产端，规模以上工业增加值及服务业生产指数也均呈现同比加速增长趋势。国内就业保持总体稳定，市场发展活力增强，中国预计将成为 2020 年全球唯一实现正增长的主要经济体。在国内经济稳步向好的背景下，投资者风险偏好显著提升，四季度 A 股市场震荡上行，作为跟踪基准指数的指数基金，四季度基金总体呈现上行态势。

展望 2021 年一季度，国内经济大概率将持续恢复，海外供需缺口将继续驱动国内出口维持较高景气，需求增长有望带动企业整体利润水平提升。流动性方面，货币政策保持灵活适度，同时公募、保险与银行理财资金仍有望稳步流入，股票市场流动性或将保持合理充裕。政策层面，注册制的全面推进有助于加快资本市场优胜劣汰和良性循环，从而优化上市公司质量。总体而言，从中长期来看我们对 A 股市场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“3.2.1.1 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”、“3.2.2.1 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 交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）

（报告期：2020年11月30日-2020年12月31日）

5.1.1 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 | 322,629,660.58 | 91.34 |
| | 其中：股票 | 322,629,660.58 | 91.34 |
| 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 | 28,040,851.15 | 7.94 |
| 7 | 其他各项资产 | 2,550,513.53 | 0.72 |
| 8 | 合计 | 353,221,025.26 | 100.00 |

5.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.1.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|----------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 3,866,105.45 | 1.13 |
| C | 制造业 | 278,868,180.27 | 81.26 |

| | | | |
|---|------------------|----------------|-------|
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 18,826,993.30 | 5.49 |
| E | 建筑业 | 3,925,652.64 | 1.14 |
| 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 | 8,559,936.80 | 2.49 |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 4,107,150.00 | 1.20 |
| 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 | 4,314,652.35 | 1.26 |
| | 合计 | 322,468,670.81 | 93.96 |

5.1.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 160,989.77 | 0.05 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 160,989.77 | 0.05 |

5.1.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.1.3 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

5.1.3.1 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 | 300118 | 东方日升 | 226,900 | 6,541,527.00 | 1.91 |
| 2 | 300274 | 阳光电源 | 84,481 | 6,106,286.68 | 1.78 |
| 3 | 000591 | 太阳能 | 834,100 | 6,063,907.00 | 1.77 |
| 4 | 603799 | 华友钴业 | 75,688 | 6,002,058.40 | 1.75 |
| 5 | 300618 | 寒锐钴业 | 59,904 | 5,685,488.64 | 1.66 |
| 6 | 002709 | 天赐材料 | 53,817 | 5,586,204.60 | 1.63 |
| 7 | 002074 | 国轩高科 | 141,771 | 5,546,081.52 | 1.62 |
| 8 | 300750 | 宁德时代 | 15,700 | 5,512,427.00 | 1.61 |
| 9 | 300014 | 亿纬锂能 | 67,409 | 5,493,833.50 | 1.60 |
| 10 | 300073 | 当升科技 | 84,632 | 5,488,385.20 | 1.60 |

5.1.3.2 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

| 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 | 688617 | 惠泰医疗 | 736 | 54,802.56 | 0.02 |
| 2 | 300772 | 运达股份 | 2,336 | 38,660.80 | 0.01 |
| 3 | 300926 | 博俊科技 | 3,584 | 38,563.84 | 0.01 |
| 4 | 300927 | 江天化学 | 2,163 | 28,962.57 | 0.01 |

5.1.4 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。

5.1.5 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。

5.1.6 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。

5.1.7 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。

5.1.8 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。

5.1.9 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。

5.1.10 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。

5.1.11 投资组合报告附注

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体除东方日升（300118）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。

报告期内本基金投资的前十名证券之一东方日升（300118）于 2020 年 3 月 27 日披露了《东方日升关于控股子公司收到环保部门行政处罚决定书的公告》（公告编号：2020-028）。公司控股子公司东方日升（常州）新能源有限公司收到连云港市灌云生态环境局出具的《环境保护行政处罚决定书》（灌环罚字[2020]26 号），依据《中华人民共和国固体废物污染环境防治法》第六十八条第七项的规定，连云港市灌云生态环境局对日升常州处以人民币 10 万元的罚款。

5.1.11.1 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。

5.1.11.2 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。

5.1.11.3其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 24,279.76 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 2,527.49 |
| 5 | 应收申购款 | 2,523,706.28 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 2,550,513.53 |

5.1.11.4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。

5.1.11.5 报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明

5.1.11.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.1.11.5.2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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 | 占基金资产净值比例(%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-------------|--------------|----------|
| 1 | 688617 | 惠泰医疗 | 54,802.56 | 0.02 | 新股未上市 |
| 2 | 300926 | 博俊科技 | 38,563.84 | 0.01 | 新股未上市 |
| 3 | 300927 | 江天化学 | 28,962.57 | 0.01 | 新股未上市 |

5.1.11.6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。

5.2 交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金

(报告期: 2020年10月1日-2020年11月29日)

5.2.1 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 | 243,312,928.01 | 93.42 |
| | 其中: 股票 | 243,312,928.01 | 93.42 |
| 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 | 17,073,342.41 | 6.56 |
| 7 | 其他各项资产 | 71,637.35 | 0.03 |
| 8 | 合计 | 260,457,907.77 | 100.00 |

5.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位: 人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | 2,724,610.75 | 1.05 |
| C | 制造业 | 216,820,074.40 | 83.87 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 12,680,842.03 | 4.91 |
| E | 建筑业 | 3,016,556.40 | 1.17 |
| 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 | 5,534,615.29 | 2.14 |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 2,501,212.50 | 0.97 |
| | 合计 | 243,277,911.37 | 94.11 |

5.2.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|-----------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 35,016.64 | 0.01 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| 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 | - | - |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | - | - |
| 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 | 35,016.64 | 0.01 |

5.2.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.2.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

5.2.3.1 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------|--------------|--------------|
| 1 | 300274 | 阳光电源 | 201,781 | 9,467,564.52 | 3.66 |
| 2 | 002594 | 比亚迪 | 38,649 | 6,728,790.90 | 2.60 |
| 3 | 002709 | 天赐材料 | 82,097 | 6,539,847.02 | 2.53 |
| 4 | 000625 | 长安汽车 | 228,688 | 5,472,503.84 | 2.12 |
| 5 | 300124 | 汇川技术 | 70,158 | 5,458,292.40 | 2.11 |
| 6 | 601012 | 隆基股份 | 75,972 | 5,280,054.00 | 2.04 |
| 7 | 603806 | 福斯特 | 73,171 | 5,246,360.70 | 2.03 |
| 8 | 600438 | 通威股份 | 163,804 | 5,122,151.08 | 1.98 |
| 9 | 300376 | 易事特 | 493,100 | 4,659,795.00 | 1.80 |
| 10 | 300037 | 新宙邦 | 55,004 | 4,564,781.96 | 1.77 |

5.2.3.2 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产 |
|----|------|------|-------|------|-------|
|----|------|------|-------|------|-------|

| | | | | | |
|---|--------|------|-------|-----------|--------------|
| | | | | | 产净值比 例(%) |
| 1 | 300772 | 运达股份 | 2,336 | 35,016.64 | 0.01 |

5.2.4 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。

5.2.5 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。

5.2.6 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。

5.2.7 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。

5.2.8 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。

5.2.9 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。

5.2.10 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。

5.2.11 投资组合报告附注

5.2.11.1 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。

5.2.11.2 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。

5.2.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | 19,029.32 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | 52,608.03 |

| | | |
|---|-------|-----------|
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 71,637.35 |

5.2.11.4 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。

5.2.11.5 报告期末投资的股票中存在流通受限情况的说明

5.2.11.5.1 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

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

5.2.11.6 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

6.1 交银施罗德德国证新能源指数证券投资基金（LOF）

单位：份

| | |
|-------------------------|----------------|
| 基金合同生效日的基金份额总额 | 256,228,349.14 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 85,938,948.62 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 39,124,859.52 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 303,042,438.24 |

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。

6.2 交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金

单位：份

| 项目 | 交银新能 | 新能源A | 新能源B |
|-----------------|----------------|---------------|---------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 168,514,726.73 | 13,093,848.00 | 13,093,848.00 |
| 本报告期期间总申购份额 | 258,777,927.03 | - | - |
| 减：本报告期期间基金总赎回份额 | 292,936,951.99 | - | - |
| 本报告期期间基金拆分变动份额 | 98,894,307.37 | -1,604,678.00 | -1,604,678.00 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 233,250,009.14 | 11,489,170.00 | 11,489,170.00 |

注：1、上表中“报告期”指2020年10月1日至2020年11月29日；

2、拆分变动份额为本基金三级份额之间的配对转换份额。

§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

本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人已于 2020 年 10 月 16 日起至 2020 年 10 月 27 日以通讯方式召开了交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金的基金份额持有人大会。本次基金份额持有人大会决议已于 2020 年 10 月 28 日生效，并自 2020 年 11 月 30 日起，《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》失效且《交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)基金合同》同时生效，交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金正式变更为交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)。有关详情请查阅本基金管理人 2020 年 10 月 28 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

2、根据有关法律法规规定和基金合同的约定，本基金可投资科创板股票。基金资产投资于科创板股票，会面临科创板机制下因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、集中度风险、系统性风险、政策风险等。有关详情请查阅本基金管理人于 2020 年 12 月 4 日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)可投资科创板股票的公告》。

§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国证新能源指数分级证券投资基金募集注册的文件；
- 2、中国证监会准予交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金变更注册的文件；
- 3、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金基金合同》；
- 4、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金招募说明书》；
- 5、《交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金托管协议》；
- 6、《交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)基金合同》；
- 7、《交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)招募说明书》；
- 8、《交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)托管协议》；
- 9、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 10、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 11、关于申请募集交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金之法律意见书；
- 12、关于申请交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金变更注册的法律意见书
- 13、报告期内交银施罗德国证新能源指数分级证券投资基金、交银施罗德国证新能源指数证券投资基金(LOF)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