

信息披露 Disclosure

交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金额接基金

2013 年度报告摘要

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国农业银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一四年三月二十六日

\$1 重要提示

1.1 提示性
基金管理人的董事会、董事声明本基金的披露资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性承担责任个别及连带的法律责任。本公司报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金托管人复核。本公司报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金托管人复核。本公司报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由基金托管人复核。

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。

年度报告摘要自每年报告发布后，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告全文。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

\$2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	交银深证300价值ETF联接
基金主代码	519706
交易代码	519706(前端) 519707(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年9月26日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期截至基金份额总额	58,871,796,63
基金合同终止日期	不定期

2.1.1 基金基本情况

基金名称 深证300价值交易型开放式指数证券投资基金额接基金

基金代码 519913

基金运作方式 变更型开放式

基金合同生效日 2011年9月22日

基金上市交易所 深圳证券交易所

上市日期 2011年10月25日

基金管理人名称 交银施罗德基金管理有限公司

基金托管人名称 中国农业银行股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪精度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金通过定期或不定期的基金资产配置于沪深300价值指数（以下简称“ETF”）标的股票、现金等价物以及法律法规或监管机构允许的其他金融工具。本基金的资产配置比例下限为所持目标ETF的资产比例不低于基金净资产的90%，其余资金可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券、回购、权证、中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金力争在扣除必要的管理费和托管费后，实现跟踪标的指数的投目标。

业绩比较基准 沪深300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率后收益×5%

风险收益特征 本基金为ETF联接基金，基金净值为基金份额净值，紧密跟踪标的指数，具有较高的指数代表的股票市场风格的风险收益特征，相当于股票基金中风险较高，预期收入相对较高的水平。

2.2.1 基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪精度和跟踪误差最小化。

投资策略 本基金通过定期或不定期的基金资产配置于沪深300价值指数（以下简称“ETF”）标的股票、现金等价物以及法律法规或监管机构允许的其他金融工具。本基金的资产配置比例下限为所持目标ETF的资产比例不低于基金净资产的90%，其余资金可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券、回购、权证、中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金力争在扣除必要的管理费和托管费后，实现跟踪标的指数的投目标。

业绩比较基准 沪深300价值价格指数收益率×92.44%+同期同业绩效基准差为-0.06% 跟踪误差差为0.06%

风险收益特征 截至2013年12月31日，本基金份额净值为0.921，本期份额净值增长率为-2.44%，同期同业绩效基准净值增长率为-3.02%，报告期末净值增长率为-0.06% 跟踪误差差为0.06%。

4.7 本期报告期无未进行定期分派。

本报告期无报告期无未进行定期分派。

5.1 托管人报告

5.1.1 基金托管人遵照《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规的规定，忠实履行了基金托管人的职责，没有损害基金份额持有人的利益。

5.1.2 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《中华人民共和国证券投资基金法》和其他有关法律法规规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.3 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集证券投资基金运作管理办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.4 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.5 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集证券投资基金销售机构内部控制规范》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.6 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.7 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金销售服务办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.8 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金销售机构销售行为规范》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.9 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金销售支付结算业务规范》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.10 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金销售适用性管理办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.11 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.12 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.13 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.14 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.15 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.16 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.17 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.18 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.19 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.20 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.21 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.22 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.23 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.24 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.25 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.26 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.27 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.28 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.29 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.30 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.31 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.32 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.33 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.34 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.35 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.36 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.37 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.38 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.39 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.40 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.41 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.42 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.43 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.44 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.45 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.46 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.47 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.48 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.49 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.50 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.51 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.52 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.53 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.54 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.55 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.56 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.57 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.58 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.59 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.60 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.61 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.62 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.63 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.64 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.65 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.66 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.67 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.68 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.69 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.70 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.71 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价方法与评价结果公告办法》的规定，损害基金份额持有人利益的行为。

5.1.72 本报告期内，基金托管人没有发现基金管理人有违反《公开募集开放式证券投资基金评价