交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金 2018年半年度报告摘要

2018年6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：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一八年八月二十五日

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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月24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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至6月30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28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	
报告期末基金份额总额	41,111,125.24份	
基金合同存续期	不定期	

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159913
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月22日
基金份额上市的证券交易所	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，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具，其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。
业绩比较基准	深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%
风险收益特征	本基金属ETF联接基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，紧密跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，相当于股票基金中风险较高，预期收益较高的品种。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金绝大部分资产采用完全复制法，跟踪深证300价值价格指数，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。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。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	深证300价值价格指数
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。同时本基金为指数型基金，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。

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	王晚婷	贺倩
	联系电话	(021)61055050	010-66060069
	电子邮箱	xxpl@ysld.com, disclosure@ysld.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-700-5000,021-61055000	95599
传真		(021)61055054	010-68121816

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.fund001.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年1月1日至2018年6月30日)
本期已实现收益	2,688,223.40
本期利润	-10,285,082.15
加权平均基金份额本期利润	-0.2393
本期基金份额净值增长率	-11.44%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.546
期末基金资产净值	64,624,814.37
期末基金份额净值	1.572

注：1、本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

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
过去一个月	-6.32%	1.47%	-6.66%	1.51%	0.34%	-0.04%
过去三个月	-8.07%	1.28%	-8.68%	1.31%	0.61%	-0.03%
过去六个月	-11.44%	1.34%	-11.66%	1.37%	0.22%	-0.03%
过去一年	-0.19%	1.14%	-0.60%	1.17%	0.41%	-0.03%
过去三年	-10.22%	1.54%	-9.92%	1.61%	-0.30%	-0.07%
自基金合同生效起至今	57.20%	1.47%	50.03%	1.52%	7.17%	-0.05%

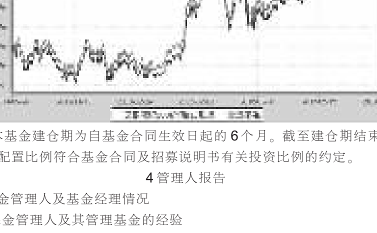
注：本基金的业绩比较基准为深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%，每日进行再平衡过程。

3.2.2 自基金合同生效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

交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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

(2011年9月28日至2018年6月30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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基金字[2005]128号文批准，由交通银行股份有限公司、施罗德投资管理有限公司、中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司共同发起设立。公司成立于2005年8月4日，注册地在中国上海，注册资本金为2亿元人民币。其中，交通银行股份有限公司持有65%的股份，施罗德投资管理有限公司持有30%的股份，中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司持有5%的股份。公司并下设交银施罗德资产管理(香港)有限公司和交银施罗德资产管理有限公司。

截至报告期末，公司管理了包括货币型、债券型、保本混合型、普通混合型和股票型在内的81只基金，其中股票型涵盖普通指数型、交易型开放式(ETF)、QDII等不同类型基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)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)、交银致远智投混合的基金经理，公司量化投资副总监兼多元资产管理副总监	2012-12-27	-	9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。

注：1、本表所列基金经理(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)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

本报告期内，本基金管理人严格遵循《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，基金投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的约定，未发生损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

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特定客户资产管理专户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“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。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年国内经济整体延续稳定状态，投资增速缓中趋稳，政策层面持续推行经济结构优化和去杠杆，消费增速小幅回落，对经济的贡献有所减弱。新旧动能转换，工业产能持续出清，产能利用率回升，行业集中度上升，经济整体效率提升，从长期看有利于经济增长进入高质量发展的新时代。在此经济背景下，一季度A股市场宽幅震荡，二季度因中美贸易摩擦的不确定性增加、美元加息、汇率波动等各因素频发，二季度A股市场波动加大，阶段性下行。作为跟踪基准指数的指数基金，上半年基金总体呈现出震荡向下的走势。

4.4.2 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。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为通胀仍将维持温和，货币中性稳健，财政政策持续发力。中美贸易摩擦的影响在短期内或仍将延续，但市场经历了剧烈调整后，许多行业指数已接近合理估值区间，目前股价也包含了投资者较为悲观的预期，总体而言，从中长期来看我们对A股市场仍维持谨慎中性的看法。

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固定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。估值委员会的研究部成员按投资品种的不同性质，研究并参考市场普遍认同的做法，建议合理的估值模型，进行测算和认证，认可后交各估值委员会成员从基金会计、风险、合规等方面审批，一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会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。估值委员会成员均具备相应的专业资格及工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对本基金持仓证券的交易情况、信息披露情况保持应有的职业敏感，向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论。本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突，截止报告期末未有与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期内无需预警说明。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—交银施罗德基金管理有限公司2018年1月1日至2018年6月30日基金的投资运作，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，没有从事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本基金的投资运作、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；在报告期内，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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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披露的本基金半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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,125,000.39	3,788,044.68
结算备付金		-	-
存出保证金		14,678.56	1,084.29
交易性金融资产	6.4.7.2	61,040,178.65	62,060,787.70
其中：股票投资		1,214,201.15	1,858,655.20
基金投资		59,825,977.50	60,202,132.50
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	808.47	1,128.71
应收股利		-	-
应收申购款		70,451.01	49,868.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		65,251,117.08	65,900,913.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		318,621.10	-
应付赎回款		219,036.21	100,665.13
应付管理人报酬		1,986.71	2,272.31
应付托管费		397.34	454.44
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	1,136.88	2,890.89
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	85,124.47	80,651.69
负债合计		626,302.71	186,934.46
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	41,111,125.24	37,030,624.51
未分配利润	6.4.7.10	23,513,689.13	28,683,354.64
所有者权益合计		64,624,814.37	65,713,979.15
负债和所有者权益总计		65,251,117.08	65,900,913.61

注：1、报告截止日2018年6月30日，基金份额净值1.572元，基金份额总额41,111,125.24份。

2、本摘要中资产负债表和利润表所列附注号为半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半年度报告正文。

6.2 利润表

会计主体：交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
一、收入		-10,106,869.82	7,728,044.99
1.利息收入		17,725.63	12,419.87
其中：存款利息收入	6.4.7.11	17,725.35	12,419.87
债券利息收入		0.28	-
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)		2,803,974.08	191,943.53
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-180,972.38	192,839.26
基金投资收益	6.4.7.13	2,975,589.95	-
债券投资收益	6.4.7.14	23.93	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	9,332.58	-895.73
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.18	-12,973,305.55	7,516,514.53
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.19	44,736.02	7,167.06
减：二、费用		178,212.33	111,504.66
1. 管理人报酬		14,373.67	9,066.40
2. 托管费		2,874.74	1,813.25
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.20	67,551.36	7,082.45
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.21	93,412.56	93,542.56
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-10,285,082.15	7,616,540.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-10,285,082.15	7,616,540.33

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2018年1月1日至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30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)	37,030,624.51	28,683,354.64	65,713,979.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-10,285,082.15	-10,285,082.15
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)	4,080,500.73	5,115,416.64	9,195,917.37
其中：1.基金申购款	25,145,914.12	21,660,560.73	46,806,474.85
2.基金赎回款	-21,065,413.39	-16,545,144.09	-37,610,557.48
四、本期向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)	41,111,125.24	23,513,689.13	64,624,814.37

项目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30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)	32,205,391.07	11,746,608.09	43,951,999.16
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,616,540.33	7,616,540.33
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)	5,022,667.31	2,051,025.29	7,073,692.60
其中：1.基金申购款	9,681,202.90	4,153,879.02	13,835,081.92
2.基金赎回款	-4,658,535.59	-2,102,853.73	-6,761,389.32
四、本期向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)	37,228,058.38	21,414,173.71	58,642,232.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2011]第967号《关于核准深证300价值交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准，由交银施罗德基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币374,246,582.11元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第377号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》于2011年9月28日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为374,322,437.11份基金份额，其中认购资金利息折合75,855.00份基金份额。本基金的基金管理人为交银施罗德基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

本基金为深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是大部分资产采用完全复制法实现对深证300价值价格指数紧密跟踪的指数基金，本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争使本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金以目标ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象(含中小板股票和创业板股票及其他经中国证监会核准的上市股票)，把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现，正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。此外，为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于新股、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.3%，年跟踪误差不超过4%。本基金的业绩比较基准为：深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本基金本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
交银施罗德基金管理有限公司(“交银施罗德基金公司”)	基金管理人、基金销售机构
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	基金托管人、基金销售机构
深证300价值交易型开放式指数证券投资基金(“目标ETF”)	本基金的基金管理人管理的其他基金
交通银行股份有限公司(“交通银行”)	基金管理人的股东、基金销售机构
交银施罗德资产管理有限公司(“交银施罗德资管”)	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,373.67	9,066.40
其中：支付销售机构的客户维护费	50,754.25	31,756.62

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)的0.5%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=(前一日基金资产净值－基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值)×0.5%÷当年天数。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,874.74	1,813.25

注：本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中目标ETF份额所对应资产净值后剩余部分(若为负数，则取0)的0.1%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=(前一日基金资产净值－基金财产中目标ETF份额所对应的资产净值)×0.1%÷当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

无。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年1月1日至2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
报告期初持有的基金份额	13,122,703.41	13,122,703.41
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	13,122,703.41	13,122,703.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	31.92%	35.25%

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。

3、基金管理人投资本基金适用的申购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末2018年6月30日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	上年度末2017年12月31日 持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
交银施罗德资产管理有限公司	4,257,629.52	10.36%	4,257,629.52	11.50%

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年6月30日 期末余额	当期利息收入	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日 期末余额	当期利息收入
中国农业银行	4,125,000.39	17,221.93	4,086,379.76	11,947.86

注：本基金的银行存款由基金托管人保管，按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末持有35,802,500.00份目标ETF基金份额，占其总份额的比例为93.41%。

6.4.9 期末(2018年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000540	中天金融	2017-08-21	重大事项	4.87	-	-	22,800	111,720.00	111,036.00	-
000793	华闻传媒	2018-02-01	重大事项	8.40	2018-07-16	7.55	11,200	95,575.00	94,080.00	-
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大事项	16.60	2018-07-31	16.50	4,700	79,434.11	78,020.00	-
000415	渤海金控	2018-01-17	重大事项	5.84	2018-07-17	5.20	9,600	56,064.00	56,064.00	-
000564	供销大集	2017-11-28	重大事项	4.78	2018-07-20	4.29	6,100	29,158.00	29,158.00	-
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大事项	6.00	-	-	1,200	6,936.00	7,200.00	-
002051	中工国际	2018-04-09	重大事项	15.27	-	-	300	4,848.00	4,581.00	-
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大事项	12.28	-	-	200	2,630.00	2,456.00	-
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	-	-	400	1,480.00	1,324.00	-

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,214,201.15	1.86
	其中：股票	1,214,201.15	1.86
2	基金投资	59,825,977.50	91.69
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	4,125,000.39	6.32
8	其他各项资产	85,938.04	0.13
9	合计	65,251,117.08	100.00

7.2 期末投资目标基金明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	交银施罗德基金管理有限公司	59,825,977.50	92.57

7.3 期末按行业分类的股票投资组合

7.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	41,940.00	0.06
B	采矿业	7,211.00	0.01
C	制造业	677,058.15	1.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,054.00	0.02
E	建筑业	9,631.00	0.01
F	批发和零售业	46,564.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,628.00	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,546.00	0.01
J	金融业	63,332.00	0.10
K	房地产业	200,093.00	0.31
L	租赁和商务服务业	56,064.00	0.09
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	94,080.00	0.15
S	综合	-	-
	合计	1,214,201.15	1.88

7.3.2 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。

7.4 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	000540	中天金融	22,800	111,036.00	0.17
2	000793	华闻传媒	11,200	94,080.00	0.15
3	000333	美的集团	1,600	83,552.00	0.13
4	000651	格力电器	1,700	80,155.00	0.12
5	300146	汤臣倍健	4,700	78,020.00	0.12
6	000415	渤海金控	9,600	56,064.00	0.09
7	000858	五粮液	600	45,600.00	0.07
8	002415	海康威视	1,200	44,556.00	0.07
9	000002	万科A	1,400	34,440.00	0.05
10	000725	京东方A	9,300	32,922.00	0.05

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于基金管理人网站的半年度报告正文。

7.5 报告期内股票投资组合的重大变动

7.5.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	2,578,372.70	3.92
2	000651	格力电器	2,400,578.00	3.65
3	000725	京东方A	1,499,013.00	2.28
4	000002	万科A	1,478,653.00	2.25
5	000858	五粮液	1,452,578.00	2.21
6	002415	海康威视	1,275,153.18	1.94
7	000001	平安银行	1,147,370.00	1.75
8	300498	温氏股份	927,960.00	1.41
9	002304	洋河股份	721,139.80	1.10
10	002027	分众传媒	572,086.00	0.87
11	000776	广发证券	524,330.00	0.80
12	000568	泸州老窖	472,738.00	0.72
13	001979	招商蛇口	445,788.40	0.68
14	002142	宁波银行	420,634.00	0.64
15	000538	云南白药	419,358.00	0.64
16	000338	潍柴动力	403,838.00	0.61
17	000423	东阿阿胶	354,934.00	0.54
18	002202	金风科技	346,141.10	0.53
19	000413	东旭光电	337,475.00	0.51
20	000100	TCL集团	327,354.00	0.50

注：“本期累计买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000333	美的集团	1,809,163.93	2.75
2	000651	格力电器	1,747,585.00	2.66
3	000725	京东方A	984,342.00	1.50
4	000002	万科A	963,362.00	1.47
5	000858	五粮液	935,952.00	1.42
6	002415	海康威视	922,814.00	1.40
7	000001	平安银行	765,126.58	1.16
8	300498	温氏股份	592,873.00	0.90
9	002304	洋河股份	477,075.00	0.73
10	002027	分众传媒	445,388.00	0.68
11	000776	广发证券	363,499.00	0.55
12	001979	招商蛇口	322,878.00	0.49
13	002142	宁波银行	320,003.00	0.49
14	000568	泸州老窖	298,802.00	0.45
15	000538	云南白药	289,390.00	0.44
16	000338	潍柴动力	288,411.00	0.44
17	002202	金风科技	246,414.00	0.37
18	000783	长江证券	228,292.00	0.35
19	000413	东旭光电	225,197.00	0.34
20	000423	东阿阿胶	224,797.00	0.34

注：“本期累计卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.5.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本(成交)总额	27,571,753.05
卖出股票的收入(成交)总额	19,159,347.51

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列，不考虑相关交易费用。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	14,678.56
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	808.47
5	应收申购款	70,451.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	85,938.04

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十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	000540	中天金融	111,036.00	0.17	重大事项
2	000793	华闻传媒	94,080.00	0.15	重大事项
3	300146	汤臣倍健	78,020.00	0.12	重大事项
4	000415	渤海金控	56,064.00	0.09	重大事项

7.13.6 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。

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构 机构投资者 持有份额	占总份额比例	个人投资者 持有份额	占总份额比例
4,894	8,400.31	17,380,395.18	42.28%	23,730,730.06	57.72%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	19,928.86	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年9月28日)基金份额总额	374,322,437.11
本报告期期初基金份额总额	37,030,624.51
本报告期基金总申购份额	25,145,914.12
减：本报告期基金总赎回份额	21,065,413.39
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	41,111,125.24

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。

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人的重大人事变动：2018年6月30日本基金管理人发布公告，经公司第四届董事会第三十二次会议审议通过，同意苏奋先生辞去公司督察长职务，并决定由公司总经理阮红女士代为履行公司督察长职务。期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

2、基金托管人的基金托管部门的重大人事变动：本基金托管人的专门基金托管部门本报告期内未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期内投资策略未发生改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

请见《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金》当期定期报告披露。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效日起聘请普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金管理人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

2、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

基金托管人及其高级管理人员本报告期内未受监管部门稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	占当期股票成交总额的比例	应支付该券商的佣金 佣金	占当期佣金总量的比例	备注
中国银河证券股份有限公司	1	46,731,100.56	100.00%	43,520.95	100.00%	-
海通证券股份有限公司	1	-	-	-	-	-

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	占当期债券成交总额的比例	回购交易 成交金额	占当期回购成交总额的比例	权证交易 成交金额	占当期权证成交总额的比例	基金交易 成交金额	占当期基金成交总额的比例
中国银河证券股份有限公司	924.21	100.00%	-	-	-	-	-	-
海通证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、报告期内，本基金交易单元未发生变化；

2、租用证券公司交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价(财务状况、经营状况)、券商研究机构评价(报告质量、及时性和数量)、券商每日信息评价(及时性和有效性)和券商协作表现评价等四个方面；

3、租用证券公司交易单元的程序：首先根据租用证券公司交易单元的选择标准进行综合评价，然后根据评价选择基金交易单元。研究部提交方案，并上报公司批准。

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况 序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	报告期末持有基金情况 持有份额	份额占比
机构	1	2018/1/1-2018/6/30	13,122,703.41	-	-	13,122,703.41	31.92%
产品特有风险							
本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如该类投资者集中赎回，可能会对本基金带来流动性冲击，从而影响基金的投资运作和收益水平。基金管理人将加强流动性管理，防范相关风险，保护持有人利益。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、本基金管理人依据国家税收法律、法规、规章及税收规范性文件的规定，对管理的基金产品运营过程中产生的应税收入，计提及缴纳增值税及附加税费，该部分税费由基金资产承担。详情请见有关公告。

2、根据《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》的有关规定及相关监管要求，经与基金托管人协商一致并报监管机构备案，基金管理人对本基金基金合同等法律文件作相应修改。请投资者关注基金合同中“对持续持有期少于7日的基金份额持有人收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产”的条款已于2018年3月31日起正式实施。欲知详情请查阅本基金管理人于2018年3月22日发布的有关公告及法律文件。