

深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金 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、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

2 基金简介
2.1 基金基本情况

基金名称	交银中证 300 价值 ETF
场内简称	深证 300
基金代码	159913
交易简称	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	36,329,693.00
基金合同存续期	不定期
基金估值币种	人民币
基金业绩比较基准	深证 300 价值指数
上市交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月25日

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,跟踪标的指数的成份股,以完全复制的指数投资组合形式构建基金投资组合,进行被动式指数化投资,基金投资组合中的股票资产主要跟踪标的指数及其权重变动进行相应调整,当期成份股发生调整和成份股变更,本基金将根据成份股变更和成份股权重变动,及时调整投资组合,以跟踪标的指数的变动,本基金将根据成份股变更和成份股权重变动,及时调整投资组合,以跟踪标的指数的变动,本基金将根据成份股变更和成份股权重变动,及时调整投资组合,以跟踪标的指数的变动。
业绩比较基准	深证 300 价值指数
风险收益特征	本基金属于中高风险,风险与预期收益高于低风险基金,本基金将与证券市场基准收益率相挂钩,跟踪标的指数。

2.3 基金管理人及基金托管人

名称	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
法定代表人	陈显		
信息披露负责人	蔡圣文 (021) 61055050	010-66080069	
联系人	电子信箱: xzpl@yrd.com.cn	disclosure@yrd.com.cn	tgxpxl@china.com.cn
客户服务电话	400-700-5000 021-61055000	95599	
	(021) 61055054	010-66121816	

2.4 信息披露方式

基金年度报告和半年度基金管理人报告网址	www.fund001.com
基金半年度报告全文披露地点	基金管理人办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现
3.1 主要财务指标

3.1.1 期间业绩指标	报告期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
本期公允价值变动损益	-2,902.80
本期利润	-10,641,776.73
加权平均基金份额本期利润	-0.2841
报告期内基金份额净值增长率	-11.78%
3.1.2 基金份额净值	报告期末(2018 年 6 月 30 日)
期末可供分配基金份额利润	0.670
期末基金份额净值	64.029,073.19
期末基金份额净值	64.029,073.19

3.2 基金净值表现
3.2.1 基金合同生效以来基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	报告期净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②	①-④	②-④
过去三个月	-6.76%	1.57%	-7.01%	1.59%	0.25%
过去六个月	-8.24%	1.37%	-9.94%	1.28%	0.60%
过去九个月	-11.78%	1.47%	-12.29%	1.44%	0.52%
过去一年	0.06%	1.22%	-0.74%	1.23%	0.80%
过去三年	-8.24%	1.65%	-10.94%	1.69%	2.70%
自基金合同生效以来	67.00%	1.57%	44.37%	1.60%	22.63%

3.2.2 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.3 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.4 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.5 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.6 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.7 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.8 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.9 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.10 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.11 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.12 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.13 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.14 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.15 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.16 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.17 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.18 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.19 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

3.2.20 自基金合同生效以来基金净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率的比较

贵对各账户公允价值进行逐日分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整合收益率差异、分投资组合的收益差异以及不同时间窗口内交易的投资组合价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公允价值过程和结果的监督。

4.32 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未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口(如日内、3 日内、5 日内)反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,投资增速继续趋稳,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新时代。在此经济背景下,一季度 A 股市场涨幅高,二季度受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态势。

4.4.2 报告期内基金的投资策略和业绩表现
本基金(各)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 管理人对于宏观政策、证券市场及行业走势的简要预期
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或仍将延续,但市场经历长期调整后,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 股市场仍保持谨慎中性的看法。

4.6 管理人对于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员、基金运营部,风险管理部等部门和固定收益人员及基金估值人员,参与估值程序讨论。本基金管理人参与估值程序各方之间不存在任何重大利益冲突,截止本报告期末未与任何外部估值定价服务机构签约。

4.7 管理人对于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 报告期内管理人对于本基金持有人人数或基金资产净值预警情况的说明
本基金本报告期内无预警说明。

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 日本基金的投资运作,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,没有发现任何损害基金持有人利益的行为。

6 半年度财务报表(未经审计)
6.1 资产负债表

资产	附注号	本期末 2018 年 6 月 30 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
货币资金		64.71	1,164,512.91
结算备付金		-	890,116.36
存出保证金		-	490.99
应收利息		-	10.81
应收申购款		64.72	63,653,393.78
其他应收款		-	64,647,470.67
总资产		64,72	63,653,393.78
负债		-	64,500,000.00
应付赎回款		-	106,000.00
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		-	-
其他应付		-	-
其他负债		64.76	-
净资产		64,818,540.84	65,537,892.74
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:		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	-
应付托管费		-	-
其他应付		-	-
其他负债		64.76	-
所有者权益:		64.78	198,763.90
实收资本		789,467.65	541,601.46
未分配利润		64.79	36,329,693.00
未分配利润		64.70	25,699,380.19
所有者权益合计		64,029,073.19	64,996,292.24
负债和所有者权益总计		64,818,540.84	65,537,892.74

注:本基金的业绩比较基准为深证 300 价值指数。

6.2 利润表

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
一、收入	-10,142,423.94	8,617,875.61
1.利息收入	3,967.13	2,161.07
其中:存款利息收入	64.71	3,864.07
债券利息收入	-	83.06
资产支持证券利息收入	-	-
其他利息收入	-	-
2.公允价值变动收益:损失以“-”号填列	-489,317.80	-32,183.60
其中:处置交易性金融资产取得的投资收益	64.72	-133,714.02
3.投资收益:损失以“-”号填列	64.73	24,941.55
其中:股票投资收益	64.74	24,941.55
4.公允价值变动收益:损失以“-”号填列	64.75	-
5.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.76	-
6.其他综合收益:损失以“-”号填列	64.77	-
7.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.78	-
8.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.79	-
9.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.80	-
10.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.81	-
11.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.82	-
12.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.83	-
13.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.84	-
14.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.85	-
15.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.86	-
16.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.87	-
17.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.88	-
18.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.89	-
19.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.90	-
20.其他业务收入:损失以“-”号填列	64.91	-
二、费用	490,352.79	143,833.15
1.管理人报酬	187,199.57	120,961.55
2.托管费	37,439.97	24,192.38
3.销售服务费	-	-
4.其他费用	64.79	16,779.26
5.其他费用	64.80	15,972.91
6.其他费用	64.81	-
7.其他费用	64.82	-
8.其他费用	64.83	-
9.其他费用	64.84	-
10.其他费用	64.85	-
11.其他费用	64.86	-
12.其他费用	64.87	-
13.其他费用	64.88	-
14.其他费用	64.89	-
15.其他费用	64.90	-
16.其他费用	64.91	-
17.其他费用	64.92	-
18.其他费用	64.93	-
19.其他费用	64.94	-
20.其他费用	64.95	-
三、利润总额:损失以“-”号填列	-10,142,423.94	8,617,875.61
四、净利润:损失以“-”号填列	-10,142,423.94	8,617,875.61

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

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
一、期初余额	198,763.90	198,763.90
二、本期增减变动金额:损失以“-”号填列	-10,142,423.94	8,617,875.61
1.发行	-	-
2.申购	-	-
3.赎回	-	-
4.转换	-	-
5.其他	-	-
6.其他	-	-
7.其他	-	-
8.其他	-	-
9.其他	-	-
10.其他	-	-
11.其他	-	-
12.其他	-	-
13.其他	-	-
14.其他	-	-
15.其他	-	-
16.其他	-	-
17.其他	-	-
18.其他	-	-
19.其他	-	-
20.其他	-	-
21.其他	-	-
22.其他	-	-
23.其他	-	-
24.其他	-	-
25.其他	-	-
26.其他	-	-
27.其他	-	-
28.其他	-	-
29.其他	-	-
30.其他	-	-
31.其他	-	-
32.其他	-	-
33.其他	-	-
34.其他	-	-
35.其他	-	-
36.其他	-	-
37.其他	-	-
38.其他	-	-
39.其他	-	-
40.其他	-	-
41.其他	-	-
42.其他	-	-
43.其他	-	-
44.其他	-	-
45.其他	-	-
46.其他	-	-
47.其他	-	-
48.其他	-	-
49.其他	-	-
50.其他	-	-
51.其他	-	-
52.其他	-	-
53.其他	-	-
54.其他	-	-
55.其他	-	-
56.其他	-	-
57.其他	-	-
58.其他	-	-
59.其他	-	-
60.其他	-	-
61.其他	-	-
62.其他	-	-
63.其他	-	-
64.其他	-	-
65.其他	-	-
66.其他	-	-
67.其他	-	-
68.其他	-	