

## 上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

2019年半年度报告摘要

基金管理人:中国农业银行股份有限公司  
基金托管人:中国农业银行股份有限公司  
报告送出日期:二〇一九年八月二十九日

## 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2019年8月28日复核了报告中的财务指标、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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,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2019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	上证180公司治理ETF
场内简称	治理ETF
基金代码	510100
交易代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年09月15日
基金管理人	中国农业银行股份有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金总资产	339,524,362元
基金合同的存续期	不定期
基金的上市地	上海证券交易所
上市日期	2009年12月15日

注:本表所列的基金代码510100为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为10011。

## 2.2 基本产品说明

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	本基金采用完全复制法,跟踪上证180公司治理指数,以完全复制的指数化投资方法,在综合考虑交易成本、交易制度、市场环境等条件下,通过在交易所上市的交易型开放式基金,以完全复制的方法构建基金资产组合,以期在扣除基金管理费、托管费后的投资收益与标的指数的表现相一致。
业绩比较基准	上证180公司治理指数
风险收益特征	本基金属股票型基金,风险收益特征与标的指数所表示的市场平均风险和收益相类同。

注:本表所列的基金代码510100为本基金二级市场交易代码,本基金一级

市场申购赎回代码为10011。

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	中国农业银行股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	王春婷 联系电话 (021)61050050 电子邮箱 xsp@cnabchina.com	负责
客户服务电话	400-700-0000 102-61050000	95599
传真	(021)61050054	010-49123116

2.4 信息披露方式

基金管理人通过互联网方式: www.fund001.com

基金管理人通过公告栏:基金管理人的公告栏

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 相关数据和指标	报告期(2019年1月1日至2019年6月30日)
本期实现收益	8,133,887.17
本期利润	79,770,766.68
加权平均基金份额本期利润	0.2281
本期基金份额净值增长率为	22.62%
3.1.2 期末数据和指标	报告期(2019年6月30日)
期末总资产/基金份额净值	0.224
期末基金资产净值	390,269,960.21
期末基金份额净值	0.176

注: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,计价费用后

的实际收益水平要低于上述列示;

2.本期已实现收益指基金本期收入、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

3.2.2 基金份额净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2009年9月25日至2019年6月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3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概况

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[2006]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2006年9月4日,注册地在上海,注册资本为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、普通混合型和股票型在内的80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)及其基金经理助理的简介

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

在报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和相关法律法规的规定,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,为基金持有人谋取最大利益。

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,旗下所有的资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均遵循制度进行公平交易。

公司投资资源的共享研究平台,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机制。对于涉及公开竞价交易,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公平分配;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公平交易。

4.3.2 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,旗下所有的资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均遵循制度进行公平交易。

基金管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.4 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

在报告期内,基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和相关法律法规的规定,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,为基金持有人谋取最大利益。

4.5 管理人对报告期内基金投资组合报告的说明

4.5.1 本报告期末基金资产组合

4.5.2 本报告期末按行业分类的股票投资组合

4.5.3 本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股票投资组合

4.5.4 本报告期末按债券品种分类的债券投资组合

4.5.5 本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组合

4.5.6 本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及金融衍生品投资组合

4.5.7 本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其他投资品种投资组合

4.5.8 本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资产支持证券投资组合

4.5.9 本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由承销业务产生的财务顾问收入

4.5.10 本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融资所得收入

4.5.11 本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其他收入

4.6 管理人对报告期内基金绩效评估的说明

4.6.1 本报告期末基金的业绩评估

4.6.2 本报告期末基金的业绩评估

4.6.3 本报告期末基金的业绩评估

4.6.4 本报告期末基金的业绩评估

4.6.5 本报告期末基金的业绩评估

4.6.6 本报告期末基金的业绩评估

4.6.7 本报告期末基金的业绩评估

4.6.8 本报告期末基金的业绩评估

4.6.9 本报告期末基金的业绩评估

4.6.10 本报告期末基金的业绩评估

4.6.11 本报告期末基金的业绩评估

4.6.12 本报告期末基金的业绩评估

4.6.13 本报告期末基金的业绩评估

4.6.14 本报告期末基金的业绩评估

4.6.15 本报告期末基金的业绩评估

4.6.16 本报告期末基金的业绩评估

4.6.17 本报告期末基金的业绩评估

4.6.18 本报告期末基金的业绩评估

4.6.19 本报告期末基金的业绩评估

4.6.20 本报告期末基金的业绩评估

4.6.21 本报告期末基金的业绩评估

4.6.22 本报告期末基金的业绩评估

4.6.23 本报告期末基金的业绩评估

4.6.24 本报告期末基金的业绩评估

4.6.25 本报告期末基金的业绩评估

4.6.26 本报告期末基金的业绩评估

4.6.27 本报告期末基金的业绩评估

4.6.28 本报告期末基金的业绩评估

4.6.29 本报告期末基金的业绩评估

4.6.30 本报告期末基金的业绩评估

4.6.31 本报告期末基金的业绩评估

4.6.32 本报告期末基金的业绩评估

4.6.33 本报告期末基金的业绩评估

4.6.34 本报告期末基金的业绩评估

4.6.35 本报告期末基金的业绩评估

4.6.36 本报告期末基金的业绩评估

4.6.37 本报告期末基金的业绩评估

4.6.38 本报告期末基金的业绩评估

4.6.39 本报告期末基金的业绩评估

4.6.40 本报告期末基金的业绩评估