

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

2014】半年度报告摘要

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，应阅读半年度报告全文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014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)
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
报告期末基金资产总额	48,824,581.82份
基金份额净值	不定期

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称		交银深证300价值ETF联接
基金代码		159913
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
报告期末基金资产总额		48,824,581.82份
基金份额净值		不定期

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	本基金通过把全部或绝大部分的基金资产投资于目标ETF，即持有的指数成份股和该成份股进行被动式指数的投资，真正实现了目标ETF的费率低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于股票的指数成份股、备选成份股、新股、回购、债券以及中国证监会允许的其他金融工具。本基金将主要通过投资于目标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他金融工具(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%。本基金的绩效比较基准为：深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。
业绩比较基准	深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与股票型基金相当。本基金的业绩评价指标，即持有的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，相当于股票基金的较高风险，较低的收益特征。

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	
本基金属股票型基金，风险与股票型基金相当。	本基金通过把全部或绝大部分的基金资产投资于目标ETF，即持有的指数成份股和该成份股进行被动式指数的投资，真正实现了目标ETF的费率低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于股票的指数成份股、备选成份股、新股、回购、债券以及中国证监会允许的其他金融工具。本基金将主要通过投资于目标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他金融工具(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%。本基金的绩效比较基准为：深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。
投资策略	本基金通过把全部或绝大部分的基金资产投资于目标ETF，即持有的指数成份股和该成份股进行被动式指数的投资，真正实现了目标ETF的费率低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于股票的指数成份股、备选成份股、新股、回购、债券以及中国证监会允许的其他金融工具。本基金将主要通过投资于目标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他金融工具(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%。本基金的绩效比较基准为：深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%。
业绩比较基准	深证300价值价格指数收益率×95%+银行活期存款利率×5%
风险收益特征	本基金属股票型基金，风险与股票型基金相当。本基金的业绩评价指标，即持有的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，相当于股票基金的较高风险，较低的收益特征。

2.2.2 投资管理人与基金经理

2.3 基金管理人和基金经理	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
名称	中国农业银行股份有限公司
法定代表人	孙扬
信息披露负责人	李芳华
联系电话	021-61050500
电子邮箱	xsp@jyqjj.com; disclosure@jyqjj.com
客户服务电话	400-700-5000; 021-61050000
传真	021-61050504

2.4 信息披露方式

2.5 主要财务指标和基金净值表现	
金额单位：人民币元	

3.1 主要会计数据和财务指标

报告期(2014年1月1日至2014年6月30日)

报告期损益 -1,591,627.61

本期利润 -2,338,790.79

加权平均基金份额本期利润 -0.0453

期末基金份额净值 4.5695

报告期期末可供分配基金份额利润 -0.121

基金份额净值增长率 42,915,835.91

基金份额净值增长率标准差 0.879

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不计费用的收益。

2.本期三季报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		业绩比较基准 收益率(%)	业绩比较基准 收益率(%)	①-③	②-④
	单期	年化				
过去一个月	0.46%	0.87%	-0.14%	0.90%	0.60%	-0.03%
过去三个月	2.21%	0.90%	0.81%	0.91%	1.40%	-0.01%
过去六个月	4.56%	1.13%	-3.24%	1.13%	0.68%	0.00%
过去一年	4.19%	1.21%	-3.66%	1.22%	0.55%	-0.01%
成立以来	-12.10%	1.29%	-17.66%	1.34%	5.56%	-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%+银行活期存款利率×5%，每日进行再平衡。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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的差额
(2011年1月26日至2014年6月30日)	-2.338,790.79

注：本基金成立期为自基金合同生效日起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 基金管理人及基金经理的经验

交银施罗德基金管理有限公司是经中国证监会证监基字[2005]1128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1月4日，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20%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。

截至目前，公司管理的基金资产总规模达2,000多亿元人民币。

4.1.2 基金经理

基金经理孙扬先生，复旦大学学士和硕士，历任交通银行总行资金部分析员、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，担任基金经理助理、基金经理。

基金经理李芳华女士，复旦大学学士和硕士，历任交通银行总行资金部分析员、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，担任基金经理助理、基金经理。

基金经理孙扬先生，复旦大学学士和硕士，历任交通银行总行资金部分析员、交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理，担任