交银施罗德先进制造股票证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先进制造股票
基金主代码	519704
交易代码	519704(前端) 519705(后端)
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年6月22日
报告期末基金份额总额	669,540,186.58份
投资目标	本基金通过重点投资于与装备制造相关的优质企业,把握中国产业结构升级的投资机会,在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下,力争实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,自下而上挖掘与装备制造相关的上市公司投资机会,以谋求良好收益。
业绩比较基准	75%×申银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率
风险收益特征	本基金是一只股票型基金,属于基金中的高风险品种,本基金的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	34,400,446.02
2.本期利润	120,766,581.81
3.加权平均基金份额本期利润	0.1836
4.期末基金资产净值	912,751,259.11
5.期末基金份额净值	1.363

注:1、上述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 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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	15.90%	0.93%	17.29%	0.75%	-1.39%	0.18%

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

交银施罗德先进制造股票证券投资基金
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6月22日至2014年9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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王少成	本基金、交银先锋股票、交银成长30股票的基金经理,公司权益部副总经理	2013-03-21	-	10年	王少成先生,复旦大学硕士学历,历任上海融昌资产管理公司研究员,中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理,基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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口(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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第三季度,国内经济增速整体企稳,流动性宽松,各项改革出现加速迹象。在这种经济环境下,资本市场中无论是周期蓝筹股还是中小市值股均一定程度上受益,总体反应积极。本基金为跟踪基准指数的指数基金,在本季度内获得较为可喜的上涨。

展望未来,在微刺激的经济政策背景下,预计货币政策仍将保持相对稳定,经济增速较为平稳,股市在温和的外部环境下预计整体风险不大。在整体政策着力于改革与结构调整的大趋势下,市场或将进入良性可持续的发展阶段。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.363元,本报告期份额净值增长率为15.90%,同期业绩比较基准增长率17.29%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	657,437,301.66	71.18
	其中:股票	657,437,301.66	71.18
2	固定收益投资	20,008,000.00	2.17
	其中:债券	20,008,000.00	2.17
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	59,376,409.06	6.43
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	177,625,133.01	19.23
7	其他资产	9,232,939.01	1.00
8	合计	923,679,782.74	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	527,084,773.72	57.75
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,824,767.62	3.92
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,399,367.94	2.13
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,361,235.63	4.09
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
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	37,767,156.75	4.14
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	657,437,301.66	72.03

5.3 报告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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600389	江山股份	2,241,446	72,040,074.44	7.89
2	600967	北方创业	4,326,735	68,968,155.90	7.56
3	600038	哈飞股份	1,230,628	43,202,904.28	4.73
4	601311	骆驼股份	2,660,559	40,573,524.75	4.45
5	600763	通策医疗	782,739	37,767,156.75	4.14
6	300335	迪森股份	2,366,233	35,824,767.62	3.92
7	002223	鱼跃医疗	1,206,236	34,980,844.00	3.83
8	600893	航空动力	1,047,624	31,135,385.28	3.41
9	601179	中国西电	6,252,107	29,634,987.18	3.25
10	600089	特变电工	2,815,138	28,066,925.86	3.07

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,008,000.00	2.19
	其中:政策性金融债	20,008,000.00	2.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,008,000.00	2.19

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	130331	13进出31	200,000	20,008,000.00	2.19

5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 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。
5.11.1 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。
5.11.2 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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	73,765.35
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	929,041.51
5	应收申购款	8,230,132.15
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,232,939.01

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600038	哈飞股份	2,484,213.08	0.27	非公开发行

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	763,741,346.11
本报告期基金总申购份额	375,964,420.21
减:本报告期基金总赎回份额	470,165,579.74
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	669,540,186.58

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	20,004,400.00
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	20,004,400.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	2.99

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。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》;
3、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德先进制造股票证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内交银施罗德先进制造股票证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。
8.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所。
8.3 查阅方式
投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金

【2014】第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银深证300价值ETF
基金主代码	159913
交易代码	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
报告期末基金份额总额	64,329,693份
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。
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

注:本基金场内简称为"深价值"。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	1,349,003.00
2.本期利润	7,185,686.01
3.加权平均基金份额本期利润	0.1323
4.期末基金资产净值	65,695,775.18
5.期末基金份额净值	1.021

注:1、上述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。

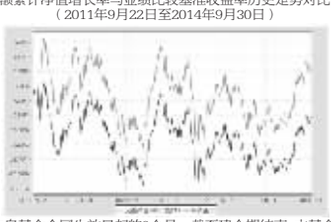
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	15.11%	0.94%	14.82%	0.95%	0.29%	-0.01%

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

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金
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22日至2014年9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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡铮	本基金及其联接基金、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银沪深300分层等权指数基金基金经理,公司量化投资部助理总经理	2012-12-27	-	5年	蔡铮先生,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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

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口(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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年第三季度,国内经济增速整体企稳,流动性宽松,各项改革出现加速迹象。在这种经济环境下,资本市场中无论是周期蓝筹股还是中小市值股均一定程度上受益,总体反应积极。本基金为跟踪基准指数的指数基金,在本季度内获得较为可喜的上涨。

展望未来,在微刺激的经济政策背景下,预计货币政策仍将保持相对稳定,经济增速较为平稳,股市在温和的外部环境下预计整体风险不大。在整体政策着力于改革与结构调整的大趋势下,市场或将进入良性可持续的发展阶段。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金份额净值为1.021元,本报告期份额净值增长率为15.11%,同期业绩比较基准增长率为14.82%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.04%,跟踪误差为0.05%。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	65,537,912.12	99.43
	其中:股票	65,537,912.12	99.43
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	357,064.23	0.54
7	其他资产	15,476.63	0.02
8	合计	65,910,452.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
5.2.2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,707,973.71	2.60
C	制造业	41,395,915.79	63.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,951,081.91	4.49
E	建筑业	603,161.79	0.92
F	批发和零售业	835,795.17	1.27
G	交通运输、仓储和邮政业	866,681.31	1.32
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	299,023.92	0.46
J	金融业	5,733,998.50	8.73
K	房地产业	9,394,279.39	14.30
L	租赁和商务服务业	524,524.53	0.80
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,225,476.10	1.87
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	65,537,912.12	99.76

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细
5.3.1 报告期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万 科A	576,594	5,293,132.92	8.06
2	000651	格力电器	153,200	4,248,236.00	6.47
3	000001	平安银行	336,679	3,413,925.06	5.20
4	000333	美的集团	123,125	2,448,956.25	3.73
5	000858	五 粮 液	119,736	2,211,523.92	3.37
6	000625	长安汽车	135,860	1,861,282.00	2.83
7	000783	长江证券	232,000	1,584,560.00	2.41
8	000725	京东方A	638,095	1,556,951.80	2.37
9	000338	潍柴动力	69,771	1,414,955.88	2.15
10	000100	TCL 集团	515,313	1,391,345.10	2.12

5.3.2 报告期末积极投资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明细
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
5.4 报告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。
5.5 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债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。
5.6 报告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。
5.7 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。
5.8 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投资明细
本基金本报告期末未持有权证。
5.9 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。
5.10 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。
5.11 投资组合报告附注
5.11.1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。
5.11.2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。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	285.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	67.53
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	15,123.20
8	其他	-
9	合计	15,476.63

5.11.4 报告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。
5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明
5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。
5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

本报告期期初基金份额总额	53,329,693
本报告期基金总申购份额	42,000,000
减:本报告期基金总赎回份额	31,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,329,693

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会核准深证300价值交易型开放式指数证券投资基金募集的文件;
2、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
4、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集深证300价值交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内深证300价值交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。
8.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所。
8.3 查阅方式
投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com,www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jysld.com。

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】第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

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	
报告期末基金份额总额	64,433,855.70份	
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。	
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	

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

2.1.2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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)
1.本期已实现收益	-297,357.35
2.本期利润	6,245,906.83
3.加权平均基金份额本期利润	0.1190
4.期末基金资产净值	64,730,963.66
5.期末基金份额净值	1.005

注:1、上述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。

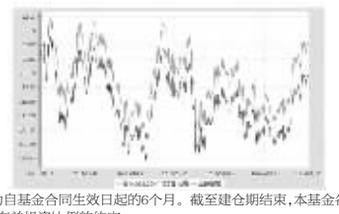
3.2 基金净值表现

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

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	14.33%	0.88%	14.05%	0.90%	0.28%	-0.02%

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2014年9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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离