

信息披露 Disclosure

2014 年度 报告 摘要

上海180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

基金管理人：交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人：中国工商银行股份有限公司
报告送出日期：二〇一五年三月三十一日

1.1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金销售机构及基金服务机构不存在虚假记载、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(以下简称“中国农业银行”)根据本基金合同约定，于2015年3月30日复核了本年度报告中的财务指标、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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或本金不受损失。基金的投资有风险，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，应阅读年度报告正文。

本报告自2014年1月1日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况	
基金名称	交银上180公司治理ETF
场内简称	市治ETF
基金主代码	510100
交易代码	510100
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日期	2009年9月25日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,895,326,925
基金合同存续期限	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009年12月15日
注：本表所列的基金主代码为10010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510101。	
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	本基金采用完全复制策略，跟踪上180公司治理指数，以完全复制标的指数构成及其权重构成基金投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重按照上目标指数的指数构成及其权重进行相应调整。但在因特殊原因(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将使用其他合理方法进行替代。
业绩比较基准	上180公司治理指数
风险收益特征	本基金属股票基金，风险收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要跟踪标的指数，具有和标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。
2.3 基金管理人及基金托管人	
名称	基金管理人 基金托管人
姓名	施建辉 杨国雄
联系电话	021-61055050 010-66060069
电子邮箱	szq@jyld.com, dchong@jyld.com geyu@icbchina.com
客户服务电话	400-700-5000, 021-61055000 95599
传真	021-61055051 010-68121816
2.4 信息披露方式	
登载基金年度报告的网址	基金管理人网站
基金年度报告备置地点	www.fund001.com, www.icbccn.com

3.1 主要会计数据和财务指标	
单位：人民币元	
3.1.1 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444,281.43
本期公允价值变动损益	0.3434
本期计提资产减值准备	69.15%
本期公允价值变动损益	-7.74%
本期公允价值变动损益	14.17%
3.1.2 期末数据和指标	2014年末
期末可供分配基金份额利润	-0.026
期末基金资产净值	2,026,435,361.07
期末基金份额净值	1.069
3.1.3 期间数据和指标	2014年
本期已实现收益	428,435,114.77
本期公允价值变动损益	-274,396,850.38
本期计提资产减值准备	-280,444