

信息披露 Disclosure

交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2017年第三季度报告

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：二〇一七年十月二十五日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及高级管理人员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、完整性和及时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的规定，于二〇一七年十月

24日核对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。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称 交银施罗德上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金

基金主代码 510996

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2006年9月6日

报告期末基金份额总额 302,040,528,769份

投资目标 本基金通过投资于上证180公司治理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力争年度增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德上证180公司治理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同期业绩比较基准收益率历史走势图对比图

(2005年9月29日至2017年9月30日)

注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起的9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约定并及时向基金份额持有人说明。

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 基金基本情况

基金名称 上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

基金主代码 510996

基金运作方式 灵活配置型开放式

基金合同生效日 2006年9月6日

报告期末基金份额总额 302,040,528,769份

投资目标 本基金通过投资于上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金，力争年度增长率与同期业绩比较基准收益率的比较

交银施罗德上证180公司治理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同期业绩比较基准收益率历史走势图对比图

(2005年9月29日至2017年9月30日)

注：本基金建仓期为自基金合同生效之日起的9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约定并及时向基金份额持有人说明。

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

§ 2.2 目录基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

投资策略 本基金通过完全复制法，即完全按照标的指数的构成及其权重来构建股票组合，并根据标的指数成份股的实际调整而进行相应调整，以确保基金净值与标的指数的表现相一致。

投资范围 本基金投资于上证180公司的股票，其中包含约90%的A股股票和约10%的B股股票。

业绩比较基准 上证180公司治理指数×90%+银行存款利息税后的基准收益×5%

风险收益特征 本基金属于股票型基金，风险收益高于货币基金、债券基金与货币市

场基金，本基金的管理人承诺，本基金的风险收益预期高于标的指数所

代表的平均风险收益预期，但并不保证本基金的收益必然高于标的指数所

代表的平均风险。

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

§ 2.3 主要财务指标情况

主要财务指标 单位：人民币元

1.本期已实现收益 16,432,691.00

2.本期利润 20,006,700.02

3.加权平均基金份额本期利润 0.02476

4.期末基金资产净值 406,006,076.36

5.期末基金份额净值 1.260

注：本基金所列的基金代码为610011为目标基金的二级市场交易代码，目标基金的一级市场申购赎回代码为510996。

2.1.2 目录基金产品说明

投资目标 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

投资策略 本基金通过完全复制法，即完全按照标的指数的构成及其权重来构建股票组合，并根据标的指数成份股的实际调整而进行相应调整，以确保基金净值与标的指数的表现相一致。

投资范围 本基金投资于上证180公司的股票，其中包含约90%的A股股票和约10%的B股股票。

业绩比较基准 上证180公司治理指数×90%+银行存款利息税后的基准收益×5%

风险收益特征 本基金属于股票型基金，风险收益高于货币基金、债券基金与货币市

场基金，本基金的管理人承诺，本基金的风险收益预期高于标的指数所

代表的平均风险收益预期，但并不保证本基金的收益必然高于标的指数所

代表的平均风险。

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

主要财务指标 单位：人民币元

报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)

1.本期已实现收益 16,432,691.00

2.本期利润 20,006,700.02

3.加权平均基金份额本期利润 0.02476

4.期末基金资产净值 406,006,076.36

5.期末基金份额净值 1.260

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不计费用的水平；

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增值

4.3 公平交易专项说明

基金管理人对报告期内公平交易执行情况进行分析，未发现存在违反公平交易的情形。

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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理)简介

姓名 李晓峰

担任本基金基金经理的期间 2012-12-27 ~ 2017-12-27

性别 女

学历 大学本科

职称 经理

简要介绍 在加入本公司之前，李晓峰女士曾就职于国泰君安证券股份有限公司，从事金融工程研究工作，具有丰富的金融工程研究经验。2012年12月加入本公司，担任基金经理助理，负责量化投资部的日常工作。2013年1月起担任基金经理，负责公司旗下多只产品的量化投资管理工作，期间多次获得公司量化投资方面的奖项。2017年12月起担任基金经理，负责公司旗下多只产品的量化投资管理工作。

4.2 管理人对报告期内本基金运作总体评价

报告期内，本基金管理人严格遵循《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，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金，履行受托义务，保护基金份额持有人的利益，较好地完成了本基金的各项工作。

4.3 报告期内本基金投资策略和运作特点的专项说明

本基金在报告期内严格按照基金合同的约定，通过定期评估和动态调整，积极关注股票

市场的变化，把握市场机会，努力实现基金资产的保值增值。

4.4 报告期内基金绩效评价结果

本基金在报告期内的绩效评价显示，本基金在报告期内的

投资运作中体现了较高的稳定性，实现了较好的投资回报。

4.5 报告期内基金面临的重大诉讼事项

本基金在报告期内无重大诉讼事项。

4.6 报告期内基金投资策略调整和投资额度变更的情况

本基金在报告期内无重大投资策略调整和投资额度变更情况。

4.7 报告期内履行社会责任情况

本基金在报告期内无履行社会责任情况。

4.8 管理人对宏观经济、证券市场走势的展望和基金投资策略调整的说明

本基金在报告期内无对宏观经济、证券市场走势的展望和基金投资策略调整情况。

4.9 报告期内基金的估值政策和方法与上年同期相比是否发生重大变化，是否存在对基金份额持有人利益造成影响的重大差额

本基金在报告期内无对基金份额持有人利益造成影响的重大差额。

4.10 管理人对会计政策、审计政策和会计差错的处理意见

本基金在报告期内无对会计政策、审计政策和会计差错的处理意见。

4.11 管理人对簿记利率的说明

本基金在报告期内无对簿记利率的说明。

4.12 管理人对会计师事务所的说明

本基金在报告期内无对会计师事务所的说明。

4.13 管理人对报告期内基金租用证券交易所交易席位的说明

本基金在报告期内无对租用证券交易所交易席位的说明。

4.14 管理人对报告期内基金投资决策委员会的说明

本基金在报告期内无对投资决策委员会的说明。

4.15 管理人对报告期内基金估值政策和方法的说明

本基金在报告期内无对估值政策和方法的说明。

4.16 管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内无对收益分配政策的说明。

4.17 管理人对中期报告编制安排的说明

本基金在报告期内无对中期报告编制安排的说明。

4.18 管理人对会计师事务所变更的说明

本基金在报告期内无对会计师事务所变更的说明。

4.19 管理人对审计报告的说明

本基金在报告期内无对审计报告的说明。

4.20 管理人对报告期内基金租用证券交易所交易席位的说明

本基金在报告期内无对租用证券交易所交易席位的说明。

4.21 管理人对报告期内基金投资决策委员会的说明

本基金在报告期内无对投资决策委员会的说明。

4.22 管理人对报告期内基金估值政策和方法的说明

本基金在报告期内无对估值政策和方法的说明。

4.23 管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内无对收益分配政策的说明。

4.24 管理人对中期报告编制安排的说明

本基金在报告期内无对中期报告编制安排的说明。

4.25 管理人对会计师事务所变更的说明

本基金在报告期内无对会计师事务所变更的说明。

4.26 管理人对报告期内基金租用证券交易所交易席位的说明

本基金在报告期内无对租用证券交易所交易席位的说明。

4.27 管理人对报告期内基金投资决策委员会的说明

本基金在报告期内无对投资决策委员会的说明。

4.28 管理人对报告期内基金估值政策和方法的说明

本基金在报告期内无对估值政策和方法的说明。

4.29 管理人对报告期内基金收益分配政策的说明

本基金在报告期内无对收益分配政策的说明。

4.30 管理人对中期报告编制安排的说明

本基金在报告期内无对中期报告编制安排的说明。