

## 上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

## 2017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：二〇一八年三月二十八日

## 重要提示

1.1 提示投资人  
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。本年度报告已通过基金合同约定的渠道向投资人披露。

基金管理人的董事、监事、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、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已通过基金合同约定的渠道向投资人披露。

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”，根据本基金合同规定，于2018年3月20日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利率配息情况、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。

基金过往业绩并不代表其未来表现。投资人投资于基金前应仔细阅读基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要由年度报告正文、投资报告欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

## § 2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

基金名称	交银上证180公司治理ETF
场内简称	治理ETF
基金代码	610101
交易代码	610101
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2009年1月26日
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司
报告期末基金总资产	402,524,362份
基金合同的延续期	不定期
基金上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2009年12月16日

注：本表所列的基金代码610101为本基金二级市场交易代码，本基金一级市场申购代码为610101。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，力求跑赢业绩基准，超越业绩基准。
本基金采用完全复制法，即原则上以100%的理论比例，以完全复制法为原则，以定期调整和不定期抽样两种方法相结合的方式，进行被动式指数投资。股票在投资组合中按市值比例配置，根据成份股的发行量或权重的变动而进行相应调整，但在特殊情况下(如流动性不足等)，根据法律法规足额配置的股票，基金经理人可以调整其持仓比例以适应当时的特征。	
业绩比较基准	上证公司治理指数
风险收益特征	本基金是股票型基金，风险与收益均高于货币市场基金，具有较高的预期收益和预期风险。
风险收益代码	截至2017年12月31日，本基金份额净值1.189元，本报告期份额净值增长率为22.96%，同期业绩比较基准增长率为20.51%。

4.5 管理人对报告期内基金业绩表现的简要展望

展望2018年，我们认为宏观经济将进入2016年下半年的态势，宏观经济小幅回落，基本面面对资金市场的支撑力总体较为有限，在杠杆大的环境下流动性总体趋紧。美联储加息，我们预计美元流动性将进入逐步趋紧的阶段。2017年上半年主要经济数据仍呈现较好增长，通胀持续改善。国内市场，金融去杠杆告一段落，环保限产下经济阶段性承压，供给和需求端均出现改善，人民币汇率升值并保持升值，国内经济的复苏趋势较为明显。

在海外市场，上年A股市场风格上呈现出进退分化的格局，价值风格震荡上涨，但因特殊原因(如流动性不足等)，导致无法获得足额配置的股票，基金经理人可以调整其持仓比例以适应当时的特征。

4.6 报告期内基金业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值1.189元，本报告期份额净值增长率为22.96%，同期业绩比较基准增长率为20.51%。

4.7 会议记录

4.8 报告期内基金管理人内部管理及激励情况的说明

本基金管理人制定了健全、有效的估值政策和程序，经公司管理层批准后实行，并成立了估值委员会，估值委员会成员由研究部、基金运营部、风险管理部等部门和固定收益人员及基金经理组成。

本公司严格按照新准则规定，证监会相关规定的相关规定，估值委员会的成员根据各自不同的职责，研究并参加市场普遍认同的、建议合理的估值模型，形成估值报告，认可后将报告提交给委员会从基金经理、风向、风险等方面一致同意后，报公司投资总监、总经理审批。

估值委员会定期评估政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后，及时召开会议进行研究，适时修订估值办法，以保证其持续适用。估值委员会成员均具备相应的专业资格和工作经验。基金经理作为估值委员会成员，对基金经理会的交易、信息披露、估值情况保持应有的职业敏感，估值委员会提供估值参考意见，并参与估值政策和程序之间不存在任何利益冲突。

4.9 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.10 报告期内基金的费用情况

本基金本报告期内无费用。

4.11 基金管理人及基金托管人

交银施罗德基金管理有限公司，中国农业银行股份有限公司。

信息披露负责人：王婷婷，性别：女，联系电话：021-61060600，电子邮箱：wangting.yt@jzxxchina.com

客户服务电话：400-990-5000，021-61060000

传真：(021)61060604，010-61218186

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告的管理人互联网网址：www.fund001.com, www.bocomchina.com

基金份额年度报告发布地：基金管理人的办公场所

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1期间数据和指标

2017年 2016年 2015年

本期末 可供基金份额 16,297,008.01 14,350,463.38 402,333,204.07

本期年初可供基金份额 103,861,681.04 -29,389,639.28 172,016,621.40

加权平均基金份额本期利润 0.0226 -0.0416 0.1635

本期末基金净值增长率为 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.2期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

期初可供基金份额 0.179 0.068 0.069

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 11.89% -2.46% -22.96%

3.1.3本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.4期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.5本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.6本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.7本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.8本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.9本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.10本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.11本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.12本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.13本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.14本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,136,621.18 673,406,961.24

本期可供基金份额净值增长率 22.96% -6.48% -32.7%

3.1.15本期末数据和指标

2017年末 2016年末 2015年末

本期可供基金份额 1.189 0.067 0.067

本期可供基金份额净值 478,421,616.66 503,