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招募说明书

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

二零一一年八月

基金招募说明书自基金合同生效日起，每6个月更新一次，并于每6个月结束之日后的45日内公告，更新内容截至每6个月的最后1日。

【重要提示】

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（以下简称“本基金”）经2011年6月20日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2011】967号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资债券引发的信用风险，以及本基金投资策略所特有的风险等等。本基金为ETF联接基金，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，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金，属于证券投资基金中风险较高、预期收益较高的品种。

投资有风险，投资者在投资本基金前应认真阅读本基金的招募说明书和基金合同。基金的过往业绩并不代表其未来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

一、绪言

《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招募说明书》（以下简称“本招募说明书”）依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他相关法律法规的规定以及《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基金合同》（以下简称“基金合同”）编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏，并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料申请募集的。本基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息，或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书根据本基金的基金合同编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资者自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

二、释义

在本招募说明书中，除非文意另有所指，下列词语或简称具有如下含义：

1、基金或本基金：指交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金

2、基金管理人或本基金管理人：指交银施罗德基金管理有限公司

3、基金托管人或本基金托管人：指中国农业银行股份有限公司

4、基金合同或本基金合同：指《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基金合同》及对基金合同的任何有效修订和补充

5、托管协议：指基金管理人与基金托管人就本基金签订之《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托管协议》及对该托管协议的任何有效修订和补充

6、招募说明书或本招募说明书：指《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招募说明书》及其定期的更新

7、基金份额发售公告：指《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发售公告》

8、法律法规：指中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章、规范性文件及对该等法律法规不时作出的修订

9、《基金法》：指2003年10月28日经第十届全国人民代表大会常务委员会第五次会议通过，自2004年6月1日起实施的《中华人民共和国证券投资基金法》及颁布机关对其不时作出的修订

10、《证券法》：指2005年10月27日经第十届全国人民代表大会常务委员会第十八次会议通过，自2006年1月1日实施的《中华人民共和国证券法》及对其不时做出的修订

11、《销售办法》：指中国证监会2004年6月25日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金销售管理办法》及对其不时作出的修订

12、《信息披露办法》：指中国证监会2004年6月8日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金信息披露管理办法》及对其不时作出的修订

13、《运作办法》：指中国证监会2004年6月29日颁布、同年7月1日实施的《证券投资基金运作管理办法》及对其不时作出的修订

14、中国：指中华人民共和国，就本基金合同而言，不包括香港特别行政区、澳门特别行政区和台湾地区

15、中国证监会：指中国证券监督管理委员会

16、中国银监会：指中国银行业监督管理委员会

17、基金合同当事人：指受基金合同约束，根据基金合同享有权利并承担义务的法律主体，包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人

18、个人投资者：指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人

19、机构投资者：指符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国境内注册登记或经政府有关部门批准设立的机构

20、合格境外机构投资者：指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及其他相关法律法规规定的条件，经中国证监会批准可投资于中国证券市场，并取得国家外汇管理局额度批准的中国境外的机构投资者

21、基金投资者或投资者：指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者，以及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者

22、基金份额持有人：指依招募说明书和基金合同合法取得基金份额的基金投资者

23、基金销售业务：指基金的宣传推介、认购、申购、赎回、转换、转托管及定期定额投资等业务

24、销售机构：指直销机构和代销机构

25、直销机构：指交银施罗德基金管理有限公司

26、代销机构：指符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件，取得基金代销业务资格并与基金管理人签订了基金销售服务代理协议、代为办理基金销售业务的机构

27、基金销售网点：指直销机构的直销中心及代销机构的代销网点

28、注册登记业务：指基金登记、存管、过户、清算和结算业务，具体内容包括基金投资者基金账户的建立和管理、基金份额注册登记、基金销售业务的确认、清算和结算、代理发放红利、建立并保管基金份额持有人名册、办理非交易过户业务等

29、注册登记机构：指办理注册登记业务的机构。基金的注册登记机构为交银施罗德基金管理有限公司或接受交银施罗德基金管理有限公司委托代为办理注册登记业务的机构

30、基金账户：指注册登记机构为基金投资者开立的、记录其持有的、基金管理人所管理的基金份额余额及其变动情况的账户

31、基金交易账户：指销售机构为基金投资者开立的、记录基金投资者通过该销售机构办理交易业务而引起的基金份额的变动及结余情况的账户

32、基金合同生效日：指基金募集期结束后达到法律法规规定及基金合同约定的备案条件，基金管理人聘请法定机构验资并向中国证监会办理基金备案手续完毕，并收到其书面确认的日期

33、基金合同终止日：指基金合同规定的基金合同终止事由出现后，基金财产清算完毕，清算结果报中国证监会备案并予以公告的日期

34、目标ETF：指另一获中国证监会核准的交易型开放式指数证券投资基金（简称ETF），该ETF和本基金所跟踪的标的指数相同，并且该ETF的投资目标和本基金的投资目标类似，本基金主要投资于该ETF以求达到投资目标。发售时，本基金选择深证300价值交易型开放式指数证券投资基金为目标ETF

35、ETF联接基金或联接基金：指将绝大多数基金财产投资于跟踪同一标的指数的目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化，采用开放式运作方式的基金，本基金是联接其所投资的目标ETF的ETF联接基金

36、基金募集期：指自基金份额发售之日起至发售结束之日止的期间，最长不得超过3个月

37、存续期：指基金合同生效至终止之间的不定期期限

38、工作日：指上海证券交易所、深圳证券交易所的正常交易日

39、日：指公历日

40、月：指公历月

41、T日：指销售机构在规定时间受理基金投资者申购、赎回或其他基金业务申请的工作日

42、T+n日：指自T日起第n个工作日（不包含T日）

43、开放日：指为基金投资者办理基金份额申购、赎回或其他业务的工作日

44、交易时间：指开放日基金接受申购、赎回或其他交易的时间段

45、认购：指在基金募集期间，基金投资者申请购买基金份额的行为

46、申购：指在基金存续期内，基金投资者按基金合同和招募说明书的规定申请购买基金份额的行为

47、赎回：指在基金存续期内基金份额持有人按基金合同和招募说明书的规定的条件要求申请将基金份额兑换为现金的行为

48、标的指数：指深证300价值价格指数及其未来可能发生的变更

49、基金转换：基金份额持有人按照基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件，向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的某一开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为

50、定期定额投资计划：指基金投资者通过有关销售机构提出申请，约定每期申购日、扣款金额及扣款方式，由销售机构在基金投资者指定银行账户内自动完成扣款并于每期约定的申购日提交基金申购申请的一种投资方式

51、转托管：指基金份额持有人在本基金的不同销售机构之间实施变更所持基金份额销售机构的操作

52、巨额赎回：指本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一工作日基金总份额的10%的情形

53、元：指人民币元

54、基金利润：指基金利息收入、投资收益、公允价值变动收益和其他收入扣除相关费用后的余额

55、基金资产总值：指基金拥有的包括目标ETF份额在内的各类有价证券、银行存款本息、基金应收款项及其他资产的价值总和

56、基金资产净值：指基金资产总值减去基金负债后的净资产值

57、基金份额净值：指计算日基金资产净值除以计算日基金份额总数的数值

58、基金资产估值：指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

59、指定媒体：指中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊、基金管理人、基金托管人的互联网网站及其他媒体

60、《业务规则》：指《交银施罗德基金管理有限公司开放式基金业务规则》，是规范基金管理人所管理的开放式证券投资基金注册登记方面的业务规则，由基金管理人制订、解释与修订

61、不可抗力：指本基金合同当事人不能预见、不能避免且不能克服，且在本基金合同由基金管理人、基金托管人签署之日后发生的，使本基金合同当事人无法全部或部分履行本基金合同的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其他自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

三、基金管理人

（一）基金管理人概况

名称：交银施罗德基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区银城中路188号交通银行大楼二层（邮）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道201号渣打银行大厦10楼

邮政编码：200120

法定代表人：钱文挥

成立时间：2005年8月4日

注册资本：2亿元人民币

存续期间：持续经营

联系人：陈超

电话：021-61055050

传真：021-61055034

交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“公司”）经中国证监会证监基金字【2005】128号文批准设立。公司股权结构如下：

股东名称	股权比例
交通银行股份有限公司(以下简称“交通银行”)	65%
施罗德投资管理有限公司	30%
中国国际海运集装箱(集团)股份有限公司	5%

本基金管理人公司治理结构完善，经营运作规范，能够切实维护基金投资者的合法权益。公司董事会下设合规审核及风险管理委员会，提名与薪酬委员会两个专业委员会，有针对性地研究公司在经营管理和基金运作中的相关情况，制定相应的政策，并充分发挥独立董事的职能，切实加强对公司运作的监督。

公司监事会由两位监事组成，主要负责检查公司的财务以及对公司董事、高级管理人员的行为进行监督。

公司总体经营管理由总经理负责，下设风险控制委员会和投资决策委员会两个专业委员会，其中投资决策委员会包括公募基金（含QDII）投资决策委员会、QDII投资决策委员会和专户投资决策委员会。公司设督察长，监督检查基金和公司运作的合法合规及公司内部风险控制情况。投资研究部下设权益部、固定收益部、专户投资部、研究部及金融工程部。中央交易室隶属总经理直接管理。市场部下设产品开发部、营销策划部、电子商务部、客服中心、机构理财部、专户理财部、销售支持部、上海销售中心、北京分公司、广州分公司、营运部下设财务部、基金运营部与信息技术部。公司并设综合管理部，负责人力资源及行政事务。此外，监察稽核下设合规审计部与风险管理部，由督察长协同总经理直接管理。本基金采用投资决策委员会领导下的基金经理负责制。投资决策委员会定期就投资管理业务的重大问题进行讨论。投资管理流程中，基金经理、研究员、交易员在明确权责的基础上密切合作，在各自职责内按照业务程序独立工作并合理地相互制衡。

截止到2011年二季度末，公司已经发行并管理了15只基金，包括1只货币市场基金、2只债券型基金、2只混合型基金、9只股票型基金，其中1只为QDII基金、1只为交易型开放式基金（ETF）、1只为ETF联接基金。截止到2011年6月30日，公司有员工178人，其中54.5%的员工具有硕士以上学历。

公司已经建立健全投资管理制度、风险控制制度、内部监察制度、财务管理制度、人事管理制度、信息披露制度和员工行为准则等公司管理制度。

（二）主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。现任交通银行股份有限公司执行董事，副行长。历任建设银行资产负债管理委员会办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理委员会办公室主任兼体制改革办公室主任兼上海分行副行长、资产负债管理部总经理、资产负债管理部总经理兼重组改制办公室主任、交通银行股份有限公司副行长兼上海分行行长。

雷切达先生，副董事长，学士学历，加拿大证券学院和香港证券学院荣誉院士。历任巴克莱基金管理有限公司基金经理、施罗德投资管理（香港）有限公司执行董事、交银施罗德基金管理有限公司总经理。曾任中国证监会开放式基金海外专家评审委员会委员。

战龙先生，董事，总经理，CFA、CPA，硕士学历。历任安达信（新加坡）有限公司审计师，澳洲信孚基金管理有限公司投资风险管理副总监，信安资产管理亚洲有限公司投资风险管理总监，荷兰国际投资管理亚太有限公司中国区总经理，招商基金管理有限公司常务副总经理，富达国际中国董事总经理。

阮红女士，董事，博士学历。历任交通银行办公室综合处副处长兼宣传处副处长、办公室综合处处长、交通银行海外机构管理部副总经理、总经理、交通银行上海分行副行长、交通银行资产托管部总经理，现任交通银行投资管理部总经理。

吴伟先生，董事，博士学历。历任交通银行总行财会部财务处主管、副处长，总行预算财务部副总经理、总经理，现任交通银行沈阳分行行长。

葛礼达先生，董事，大专学历。历任施罗德集团信息技术工作集团信息技术部董事、施罗德集团首席营运官，现任施罗德集团亚太地区总裁。

孙祁祥女士，独立董事，博士学历，国务院政府特殊津贴专家，博士生导师。现任北京大学经济学院副院长、风险管理及保险学系主任。

王松奇先生，独立董事，博士学历。历任中国人民大学讲师、中国社会科学院财贸所金融研究中心研究员，现任中国社会科学院金融研究中心副主任、研究员，北京创业投资协会常务副理事长、秘书长。

陈家乐先生，独立董事，博士学历。历任香港科技大学金融学系副教授、教授，现任香港科技大学金融学系系主任。

2、基金管理人监事会成员

康定选先生，监事长，EMBA，高级经济师。历任河南巩县农业银行信贷股信贷员、副股长，巩县支行副行长；郑州市农业银行行政区办事处副主任；交通银行郑州分行信贷部副主任、计划信贷处处长、副行长；交通银行南京分行副行长、行长；交通银行上海分行行长。

裴关淑（又女士，监事，CFA、CIPM、FRM，工商管理、资讯管理双硕士。曾任职荷兰银行、渣打银行（香港）有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED，施罗德投资管理（香港）有限公司资讯科技部主管、中国事务联席董事。现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监、总经理助理。

3、公司高管人员

钱文挥先生，董事长，硕士学历。简历同上。

战龙先生，董事，总经理，硕士学历。简历同上。

苏奋先生，督察长，纽约城市大学工商管理硕士。历任交通银行广州分行市场营销部总经理助理、副总经理，交通银行纽约分行信贷管理部经理、公司金融部经理、信用风险管理办公室负责人，交通银行投资管理部投资并购高级经理，交银施罗德基金管理有限公司综合管理部总监。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师。历任湖南大学（原湖南财经学院）金融学院讲师、湘财证券有限责任公司国债部副经理、基金管理总部总经理、湘财荷银基金管理有限公司副总经理。

谢卫先生，副总经理，经济学博士，高级经济师。历任中央财经大学金融系教员；中国社会科学院财经所助理研究员；中国电力信托投资公司基金部副经理；中国人保信托投资公司证券部副总经理、总经理、北京证券营业部总经理、证券总部副总经理兼北方部总经理，富国基金管理有限公司副总经理。

4、本基金基金经理

邱乐伟先生，基金经理。数理系硕士。15年证券投资从业经验。历任广发证券北京业务总部研发部经理、投资部经理；华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理助理。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。于2009年9月25日起担任上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金基金经理至今，并于2009年9月29日起兼任交银施罗德上证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经理至今。

蔡铮先生，基金经理助理。复旦大学电子工程硕士。3年证券从业经验。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，现任上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金和交银施罗德上证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经理助理。

5、投资决策委员会成员

委员：顾廷锋（投资总监）

战龙（总经理）

史伟（权益部副总经理、基金经理）

张迎军（固定收益部副总经理、基金经理）

张科兵（研究部总经理、基金经理）

上述人员之间无近亲属关系。

（三）基金管理人的职责

1、依法募集基金，办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜；

2、办理基金备案手续；

3、对所管理的不同基金财产分别管理、分别记账，进行证券投资；

4、按照基金合同的约定确定基金收益分配方案，及时向基金份额持有人分配收益；

5、进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

6、编制季度、半年度和年度基金报告；

7、计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回价格；

8、办理与基金财产管理业务活动有关的信息披露事项；

9、召集基金份额持有人大会；

10、保存基金财产管理业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料；

11、以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；

12、有关法律法规和中国证监会规定的其他职责。

（四）基金管理人的承诺

1、基金管理人承诺不从事违反《证券法》的行为，并承诺建立健全内部控制制度，采取有效措施，防止违反《证券法》行为的发生；

2、基金管理人承诺不从事违反《基金法》的行为，并承诺建立健全内部风险控制制度，采取有效措施，防止下列行为的发生：

①将基金管理人固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；

②不公平地对待管理的不同基金财产；

③利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；

④向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；

⑤依照法律法规有关规定，由中国证监会规定禁止的其他行为。

（下转D11版）

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发售公告

重要提示

1、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（以下简称“本基金”）的募集已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可【2011】967号文批准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金是深证300价值交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“目标ETF”）的联接基金，将绝大部分基金财产投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数表现，采用开放式运作方式。

3、本基金的管理人为交银施罗德基金管理有限公司（以下简称“本公司”），托管人为中国农业银行股份有限公司（以下简称“中国农业银行”），注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中登”）。

4、投资者可以通过场外、场内两种方式认购本基金。场外销售渠道为基金管理人的直销机构和场外代销机构的代销网点；场内销售渠道为通过上海证券交易所开放式基金业务系统（上证基金通）办理相关业务的有资格的上海证券交易所会员单位。场内销售渠道为上海证券交易所会员单位。场内认购需遵守上海证券交易所相关规则。具体销售机构名单详见本公告“一、本次募集基本情况”项下“8、销售机构”章节。除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得提前发售基金份额。

5、基金募集期：本基金自2011年8月29日止通过销售机构公开发售（具体业务办理时间见各销售机构的相关业务公告或拨打客户服务电话咨询）。在募集期内，上海证券交易所将于交易日交易时间内持续挂牌定价发售本基金前端收费模式下的基金份额。本基金的募集期限不超过3个月，自基金份额开始发售之日起计算。本公司也可根据基金销售情况在募集期限内适当延长或缩短基金发售时间，并及时公告。

6、本基金募集对象为个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

7、本基金管理人在基金募集期间不设募集规模上限。

8、投资者通过场外认购本基金时，需首先开立中登基金账户。除法律法规另有规定外，一个投资者只能开设和使用一个基金账户。不得非法利用他人账户或资金进行认购，也不得违规融资或帮助他人违规进行认购。投资者应保证用于认购的资金来源合法，投资者应有权自行支配，不存在任何法律上、合约上或其他障碍。

①已持有上海人民币普通股票账户（或证券投资基金账户）的投资者，可以通过销售机构办理开户手续，将上海人民币普通股票账户（或证券投资基金账户）注册为开放式基金账户。

②没有上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户的投资者，可通过销售机构申请注册开放式基金账户。

③已经持有中登开放式基金账户的投资者到非原开户机构办理认购的，不需再次开立基金账户，可凭中登基金账号到非原开户机构办理账户登记，然后再认购本基金。

投资者通过场内认购本基金时，应使用上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户。

①已持有上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户的投资者不必再办理开户手续。

②尚无上海人民币普通股票账户或证券投资基金账户的投资者，需在认购前持本人身份证到中登公司的开户代理机构办理开户手续。

9、认购限额：通过代销机构认购本基金时，最低认购金额为单笔1,000元人民币，如果代销机构业务规则规定的最低单笔认购金额高于1,000元人民币，以代销机构的规定为准，选择场内认购的，每笔认购金额还必须是100元的整数倍，单笔认购最高不超过99,999,900元；通过直销机构认购本基金时，首次最低认购金额为单笔100,000元人民币，追加最低认购金额为单笔10,000元人民币，已在直销机构有认购或申购过本公司管理的其他基金记录的投资者不受首次最低认购金额的限制。通过本公司网上交易系统办理本基金认购业务的，不受直销机构最低认购金额的限制，最低认购金额为单笔1,000 元。投资者在募集期内可多次认购基金份额，认购费率按每笔认购申请单独计算，认购申请一经销售机构受理，则不可以撤销。

10、销售网点：①直销机构和（或代销机构的销售网点）对申请的受理并不表示对该申请的成功确认，而仅代表销售网点确实接受了认购申请。申请的成功确认应以基金合同生效后、注册登记机构的确认登记为准。投资者可以在基金合同生效后到原认购网点打印认购成交确认凭证。基金合同生效后，本公司将向首次开户并认购本基金的投资者寄送基金开户确认书，并在合同生效所在季度结束后15个工作日内向所有认购本基金的投资者寄送基金对账单。投资者在原认购网点打印的认购成交确认凭证与本公司寄送的基金开户确认书和对账单的记载不一致的，应以本公司的凭证为准。基金合同生效后三个月内未收到基金管理人发送的基金开户确认书和对账单的投资者应主动联系本公司，否则，视为投资者已经收到基金开户确认书和对账单。

11、本公告仅对本基金基金份额发售的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况，请详细阅读刊登在2011年8月24日《中国证券报》、2011年8月25日《上海证券报》和2011年8月26日《证券时报》上的《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招募说明书》。

12、本基金的基金合同、招募说明书及本公告将同时发布在本公司网站（www.jyfund.com、www.jysld.com、www.bocomschroder.com）。投资者亦可通过本公司网站下载基金申请表格和了解基金募集相关事宜。

13、代销机构的代销网点以及开户认购咨询事项的详细情况请向各代销机构咨询。

14、未开设销售网点的地方的投资者，可拨打本公司的客户服务电话400-700-5000（免长途话费）或（021）61055000咨询基金认购事宜。

15、由于各基金销售机构系统及业务安排等原因，工作日的具体业务办理时间可能有所不同，投资者应参照各基金销售机构的具体规定。

16、本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整。

17、风险提示

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个交易日基金的净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过基金总份额的百分之十时，投资者将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

基金分为股票基金、混合基金、债券基金、货币市场基金等不同类型，投资者投资不同类型的基金将获得不同的收益预期，也将承担不同程度的风险。一般来说，基金的收益预期越高，投资者承担的风险也越大。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，并根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和投资者的风险承受能力相适应。

投资者应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资者进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式。但是定期定额投资并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资者获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值变化，不会改变基金的风险收益特征，不会降低基金投资风险或提高基金投资收益。以1元初始面值开展基金募集或因拆分、封转开、分红等行为导致基金份额净值调整至1元初始面值或1元附近，在市场波动等因素的影响下，基金投资仍有可能出现亏损或基金净值仍有可能低于初始面值。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行负担。

投资者应当通过基金管理人或具有基金代销业务资格的其他机构购买和赎回基金，基金代销机构名单详见本基金招募说明书以及相关公告。

一、本次募集基本情况

1、基金名称

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

2、基金类型

ETF联接基金

3、运作方式

契约型开放式

4、基金存续期限

不定期

5、基金份额发售面值

每份基金份额发售面值为1.00元人民币。

6、基金代码及基金简称

前端：519706；后端：519707；基金简称：交银价值

场内暂只开通前端收费基金认购，基金代码521706，基金简称：交银价认

本基金场外认购提供两种认购费用的支付模式：前端收费模式和后端收费模式，相应设置前端收费基金代码和后端收费基金代码，投资者可以选择任一收费模式，并以对应的基金代码认购本基金。

7、发售对象

个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者。

8、销售机构

①直销机构：

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上交易平台。募集期间个人投资者可以通过本公司网上交易平台办理本基金的开户和前端收费基金份额的认购业务，对后端收费基金份额的认购业务暂不办理。

②代销机构：

本基金的场内代销机构：本基金场内代销机构指由中国证监会核准的具有开放式基金代销资格，并经上海证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的上海证券交易所会员，名单详见上海证券交易所网站：

http://www.sse.com.cn/sseportal/webapp/listcompanyProOperationQualification?flag=3

目前场内交易只支持前端收费基金份额的认购。

本基金的场外代销机构：中国农业银行、中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、招商银行股份有限公司、上海银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司和华夏银行股份有限公司。

除法律法规另有规定外，任何与基金份额发售有关的当事人不得提前发售基金份额。

本公告中如无特别说明，销售机构即指上述直销机构和代销机构。

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售本基金，并及时公告。

9、募集时间安排与基金合同生效

根据有关法律法规的规定，基金的募集期为自基金份额发售之日起不超过3个月。本基金募集期自2011年8月29日起至2011年9月23日，期间面向个人投资者、机构投资者、合格境外机构投资者及法律法规或中国证监会允许购买证券投资基金的其他投资者同时发售。基金管理人根据认购的情况可适当延长发行时间，但最长不超过法定募集期限；同时也可根据认购和市场情况提前结束发行。本基金在募集期间达到基金合同的备案条件，基金管理人应当在基金募集结束后的10日内聘请法定验资机构验资，并在收到验资报告后10日内依法向中国证监会办理基金合同备案手续，自中国证监会书面确认之日起，基金合同生效。

募集期届满，未达到基金备案的条件，则基金募集失败。如基金募集失败，基金管理人应以其固有财产承担因募集行为而产生的债务和费用，在基金募集期限届满后30日内返还基金投资者已缴纳的认购款项，并加计同期银行存款利息。

10、认购期利息的处理方式

本基金合同生效前，基金投资者的认购款项只能存入专用账户，任何人不得动用。有效认购款项在基金募集期形成的利息在本基金合同生效后将折算成基金份额，归基金份额持有人所有。利息转份额的具体数额以注册登记机构的记录为准。

①场外认购

场外认购利息折算的基金份额精确到小数点后两位，小数点后两位截位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。

②场内认购

场内认购利息折算的基金份额精确到整数位，小数点后部分截位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。

11、基金认购方式与费率

本基金认购采取“金额认购，金额缴款”的方式。募集期内，投资者可以多次认购本基金，认购费率按每笔认购申请单独计算。

投资者认购本基金应支付认购费用。本基金提供两种认购费用的支付模式。投资者可以选择前端收费模式，即在认购时支付认购费用；也可以选择后端收费模式，即在赎回时才支付相应的认购费用，该费用随基金份额的持有时间递减。认购费率如下：

认购费率(前端)	认购金额(含认购费)	前端认购费率
	50万元以下	1.2%
	50万元(含)至100万元	1.0%
	100万元(含)至200万元	0.6%
	200万元(含)至500万元	0.3%
	500万元以上(含500万)	每笔交易1000元

	持有时间	后端认购费率
认购费率(后端)	1年以内(含)	1.6%
	1年—3年(含)	1.0%
	3年—5年(含)	0.4%
	5年以上	0

认购费用和认购份额的计算方法：

①场外认购

A、前端收费模式

认购总金额=申请总金额

净认购金额=申请总金额/（1+认购费率）

（注：对于适用固定金额认购费用的认购，净认购金额=认购总金额-固定认购费用金额）

认购费用=认购总金额-净认购金额

（注：对于适用固定金额认购费用的认购，认购费用=固定认购费用金额）

认购份额=净认购金额/基金份额初始面值+认购利息/基金份额初始面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

例一：某投资者投资本基金100,000元，假定认购期产生的利息为10.00元，如果其选择交纳前端认购费用，认购费率为1.2%，则可认购基金份额为：

认购总金额=100,000元

认购净金额=100,000/（1+1.2%）=98,814.23元

认购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元

认购份额=98,814.23/1.00+10.00/1.00=98,824.23份

若该投资者选择交纳前端认购费用，则投资100,000元本金可得到98,824.23份基金份额。

B、后端收费模式

认购总金额=申请总金额

认购份额=认购总金额/基金份额初始面值+认购利息/基金份额初始面值

认购份额的计算保留到小数点后2位，小数点2位以后的部分四舍五入，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担。

当投资者提出赎回时，后端认购费用的计算方法为：

后端认购费用=赎回份额×基金份额初始面值×后端认购费率

例二：某投资者投资本基金100,000元，假定认购期产生的利息为10.00元，如果其选择交纳后端认购费用，则可认购基金份额为：

认购份额=100,000/1.00+10.00/1.00=100,010.00份

即投资者投资100,000元认购本基金，如果选择交纳后端认购费用，可得到100,010.00份基金份额，但其在赎回时需根据其持有时间按对应的后端认购费率交纳后端认购费用。

②场内认购

目前场内交易只支持前端收费基金认购。本基金场内认购采用金额认购方式认购，计算公式如下：

认购总金额=申请总金额

净认购金额=申请总金额/（1+认购费率）

（注：对于适用固定金额认购费用的认购，净认购金额=认购总金额-固定认购费用金额）

认购费用=认购总金额-净认购金额

（注：对于适用固定金额认购费用的认购，认购费用=固定认购费用金额）

认购份额=净认购金额/基金份额初始面值+认购利息/基金份额初始面值

场内认购的有效份额保留到整数位，剩余部分对应认购资金返回投资者。场内认购利息折算的基金份额精确到整数位，小数点后部分截位，由此误差产生的收益或损失由基金财产承担，其中有效认购资金的利息及利息折算的基金份额以注册登记机构的记录为准。

对应返还认购金额=净认购金额+认购利息-取整数位后确认的认购份额×基金份额初始面值

例三：某投资者投资本基金100,000元，假定认购期产生的利息为10.00元，如果其选择场内认购，认购费率为1.2%，则可认购基金份额为：

认购总金额=100,000元

认购净金额 = 100,000/（1+1.2%）=98,814.23元

认购费用=100,000-98,814.23=1,185.77元

认购份额 = 98,814.23/1.00+10.00/1.00=98,824.23份

取整数后投资者实得认购份额98,824份，则：

对应返还认购金额=98,814.23+10.00-98,824×1.00=0.23元

即其余0.23份对应金额0.23元将返回给投资者。

二、募集方式及相关规定

1、本次基金的募集，在募集期内面向个人和机构客户同期发售。

2、本基金将通过场外、场内两种方式发售。

3、本公司直销网点接受首次认购金额在100,000元以上（含100,000元）的客户（不分机构和个人）的认购申请，追加最低认购金额为单笔10,000元，已在直销机构有认购或申购过本公司管理的其他基金记录的投资者不受首次认购最低金额的限制。通过本公司网上交易系统办理本基金认购业务的不受直销网点最低认购金额的限制，认购最低金额为单笔1,000 元。

4、在各代销网点（包括场内和场外）可接受投资者（不分机构和个人）单笔认购金额在1,000元人民币以上（含1,000元）的认购申请。选择场内认购的，每笔认购金额还必须是100元的整数倍，单笔认购最高不超过99,999,