（上接D39版）

（四）报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期期末未持有债券。

（五）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细

本基金本报告期期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

（七）报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

（八）投资组合报告附注

1.本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

2.本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

3.本基金截止2011年10月18日，其他资产构成如下：

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	302,928.21
5	应收申购款	-
6	其他应收款	3,792.65
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	806,720.86

4.报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.报告期末基金投资的前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限的情况。

6.由于四舍五入的原因，分项之和与合计项可能存在尾差。

九、重大事件揭示

本基金自合同生效至上市交易期间未发生对基金份额持有人有较大影响的重大事件。

十、基金管理人承诺

本基金管理人就本基金上市交易之后履行管理人职责做出如下承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。

（二）真实、准确、完整和及时地披露定期报告等有关信息披露文件，披露所有对基金份额持有人有重大影响的信息，并接受中国证监会、深圳证券交易所的监督管理。

（三）在知悉可能对基金价格产生误导性影响或引起较大波动的任何公共传播媒介中出现的或者在市场上流传的消息后，将及时予以公开澄清。

十一、基金托管人承诺

基金托管人就基金上市交易后履行托管人职责做出承诺：

（一）严格遵守《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定，设立专门的基金托管部，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员负责基金财产托管事宜。

（二）根据《基金法》及其他相关法律法规、本基金基金合同及托管协议的规定，对基金的投资范围、基金资产的投资组合比例、基金资产净值和基金份额净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付等行为进行监督和核查。

（三）基金托管人发现基金管理人的行为违反《基金法》及其他相关法律法规、基金合同及托管协议的规定，将及时以通知基金管理人限期纠正，督促基金管理人改正。

（四）基金托管人发现基金管理人有重大违规行为，将立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正，并将纠正结果报告中国证监会。

十二、基金份额申购、赎回

（一）申购和赎回的场所

投资者应当在申购赎回代理券商办理基金申购、赎回业务的营业场所或按申购赎回代理券商提供的其他方式办理本基金的申购和赎回。基金管理人可依据实际情况增加或减少申购赎回代理券商，并予以公告。

（二）申购和赎回的开放日及时间

1、申购与赎回的开始时间

自2011年10月25日起，本基金开始办理申购、赎回。

2、开放日及开放时间

投资者可办理申购、赎回等业务的开放日为深圳证券交易所的交易日，具体业务办理时间为深圳证券交易所交易日的交易时间。但基金管理人根据法律法规、中国证监会的要求或基金合同的规定公告暂停申购、赎回时除外。

若出现新的证券交易市场、证券交易所交易时间变更或其他特殊情况或实际情况需要，基金管理人将视情况对前述开放日及具体业务办理时间进行相应的调整，但应在实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

（三）申购和赎回的原则

1、本基金采用份额申购和份额赎回的方式，即申购和赎回均以份额申请。

2、本基金的申购对价、赎回对价包括组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。

3、申购、赎回申请提交后不得撤销。

4、申购、赎回应遵守深交所《业务细则》的规定。

5、基金管理人可在不损害基金份额持有人实质利益、不违背交易所相关规则的情况下更改上述原则，但最迟应在新的原则实施前依照有关规定在指定媒体上予以公告。

（四）申购和赎回的程序

1、申购和赎回的申请的提出

投资者必须按申购赎回代理券商规定的手续，在开放日的具体业务办理时间提出申购或赎回的申请。

投资者在提交申购申请时须根据申购赎回清单备足申购对价要求的组合证券和现金，投资者在提交赎回申请时须持有足够的基金份额余额和赎回对价要求的现金。否则，投资者所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

2、申购和赎回申请的确认

投资者申购、赎回申请在受理当日进行确认。如投资者未能提供符合要求的申购对价，则申购申请失败。如投资者持有的符合要求的基金份额不足或未能根据要求准备足额的现金，或本基金投资组合内不具备足额的符合要求的赎回对价，则赎回申请失败。投资者可在申请当日通过其办理申购、赎回的销售网点查询有关申请的确认情况。

3、申购和赎回的清算交收与登记

本基金申购赎回过程中涉及的股票和基金份额交收适用深圳证券交易所的结算规则。投资者T日申购、赎回成功后，注册登记机构在T日收市后为投资者办理组合证券的清算交收以及基金份额、现金替代的清算，在T+1日办理基金份额、现金替代的交收以及现金差额的清算，在T+2日办理现金差额的交收，并将结果发送给申购赎回代理券商、基金管理人和基金托管人。如果注册登记机构在清算交收时发现不能正常履约的情形，则依据《中国证券登记结算有限责任公司关于深圳证券交易所上市的交易型开放式指数基金登记结算业务实施细则》的有关规定进行处理。

注册登记机构可在法律法规允许的范围内，对清算交收和登记的办理时间、方式进行调整，并按照相关规定在指定媒体公告。

（五）申购和赎回的数额限定

投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

本基金最小申购赎回单位为100万份。基金管理人可以根据市场情况，调整上述规定的数量或比例限制。基金管理人必须在调整前依照有关规定在指定媒体上公告。

（六）申购、赎回的对价及费用

1、申购对价是指投资者申购基金份额时应交付的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。赎回对价是指投资者赎回基金份额时，基金管理人应交付给赎回人的组合证券、现金替代、现金差额及其他对价。申购对价和赎回对价根据申购赎回清单和投资者申购、赎回的基金份额数额确定。

2、申购赎回清单由基金管理人编制。T日的申购赎回清单在当日深圳证券交易所开市前公告。T日的基金份额净值在当天收市后计算，并在T+1日公告，计算公式为计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。如遇特殊情况，可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

3、投资者在申购或赎回基金份额时，申购赎回代理券商可按照不超过申购或赎回份额0.5%的标准收取佣金，其中包含证券交易所、注册登记机构等收取的相关费用。

（七）申购赎回清单的内容与格式

1、申购赎回清单的内容

T日申购赎回清单公告内容包括最小申购赎回单位所对应的组合证券内各成份证券数据、现金替代、T日现金替代的保证金率、T日允许现金替代的最高比例、T日预估现金差额、T-1日现金差额、基金份额净值及其它相关内容。

2、申购赎回清单组合证券相关内容

组合证券是指本基金标的指数所包含的全部或部分证券。申购赎回清单将公告最小申购赎回单位所对应的各成份证券名称、证券代码及数量。

3、最小申购赎回单位

最小申购赎回单位是基金申购赎回的最基本单位。

4、申购赎回清单现金替代相关内容

现金替代是指申购、赎回过程中，投资者按基金合同和招募说明书的规定，用于替代组合证券中部分证券的一定数量的现金。

①现金替代分为3种类型：禁止现金替代（标志为“禁止”）、可以现金替代（标志为“允许”）和必须现金替代（标志为“必须”）。

禁止现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

可以现金替代是指在申购基金份额时，允许使用现金作为全部或部分该成份证券的替代，但在赎回基金份额时，该成份证券不允许使用现金作为替代。

必须现金替代是指在申购、赎回基金份额时，该成份证券必须使用现金作为替代。

②可以现金替代

①适用情形：可以现金替代的证券一般是由于停牌等原因导致投资者无法在申购时买入的证券，或基金管理人认为可以采用现金替代的其他情形。

②替代金额：对于可以现金替代的证券，替代金额的计算公式为：

替代金额=替代证券数量×该证券经除权调整的T-1日收盘价×（1+现金替代保证金率）

收取现金替代保证金的原因是，对于使用现金替代的证券，基金管理人需在证券恢复交易后买入，而实际买入价格加上相关交易费用后与申购时的最新价格可能有所差异。为便于操作，基金管理人在申购赎回清单中预先确定现金替代保证金率，并据此收取替代金额。如果预先收取的金额高于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将退还多收取的差额；如果预先收取的金额低于基金购入该部分证券的实际成本，则基金管理人将向投资者收取欠缺的差额。

③替代金额的处理程序

T日，基金管理人在申购赎回清单中公布现金替代保证金率，并据此收取替代金额。

在T日后被替代的成份证券有正常交易的2个交易日（简称为T+2日）内，基金管理人将以收到的替代金额买入被替代的部分证券。

T+2日日终，若已购入全部被替代的证券，则以替代金额与被替代证券的实际购入成本（包括买入价格与交易费用）的差额，确定基金应退还投资者应补交的款项；若未能购入全部被替代的证券，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照T+2日收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

特例情况：若自T日起（不含T日），深圳证券交易所正常交易日已达到20日而该证券正常交易日低于2日，则以替代金额与所购入的部分被替代证券实际购入成本加上按照最近一次收盘价计算的未购入的部分被替代证券价值的差额，确定基金应退还投资者或投资者应补交的款项。

若现金替代日（T日）后至T+2日（若在特例情况下，则为T日起第20个交易日）期间发生除息、送股（转增）、配股等权益变动，则进行相应调整。

T+2日后第1个工作日（若在特例情况下，则为T日起第21个交易日），基金管理人将应退款和补款的明细及汇总数据发送给注册登记机构，注册登记机构办理现金替代多退少补资金的清算；T+2日后第2个工作日（若在特例情况下，则为T日起第22个交易日），注册登记机构办理现金替代多退少补资金的交收。

④替代限制：为更有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，基金管理人可规定投资者使用可以现金替代的比例合计不得超过申购基金份额资产净值的一定比例。现金替代比例的计算公式为：

替代比例=假设当天可以现金替代的股票只数为n。

⑤必须现金替代

①适用情形：必须现金替代的证券一般是由于标的指数调整，即将被剔除的成份证券，或基金管理人出于保护持有人利益等原因认为有必要实行必须现金替代的成份证券。

②替代金额：对于必须现金替代的证券，基金管理人将在申购赎回清单中公告替代的一定数量的现金，即“固定替代金额”。固定替代金额的计算方法为申购赎回清单中该证券的数量乘以其经除权调整的T-1日收盘价。

5、预估现金差额相关内容

预估现金差额是指由基金管理人计算并在T日申购赎回清单中公布的当日现金差额的预估值，预估现金差额由申购赎回代理券商预先冻结。

预估现金差额的计算公式为：

T日预估现金差额=T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日经除权调整的前收盘价乘积之和）

其中，T日经除权调整的前收盘价由深圳证券交易所提供。另外，若T日为基金分红除息日，则计算公式中的“T-1日最小申购赎回单位的基金资产净值”需扣减相应的收益分配数额。预估现金差额的数值可能为正、为负或为零。

6、申购赎回清单现金差额相关内容

T日现金差额在T+1日的申购赎回清单中公告，其计算公式为：

T日现金差额=T日最小申购赎回单位对应的基金份额×T日基金份额净值-（申购赎回清单中必须用现金替代的固定替代金额+申购赎回清单中可以用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和+申购赎回清单中禁止用现金替代成份证券的数量与T日收盘价相乘之和）

T日投资者申购赎回基金份额时，需按T+1日公告的T日现金差额进行资金的清算交收。现金差额的数值可能为正、为负或为零。在投资者申购时，如现金差额为正数，则投资者应根据其申购的基金份额支付相应的现金，如现金差额为负数，则投资者将根据其申购的基金份额获得相应的现金，如现金差额为负数，则投资者应根据其赎回的基金份额支付相应的现金。

7、申购赎回清单的格式

申购赎回清单的格式举例如下：

基本信息

最新公告日期：2011-10-14

基金名称：深价值

基金管理公司名称：交银施罗德基金管理有限公司

基金代码：159913

拟合指数代码：399348

T-1日信息内容

现金差额：-2,296.23元

最小申购赎回单位资产净值：998,852.66元

基金份额净值：0.999元

T日信息内容

预估现金差额：-2,296.23元

可以现金替代比例上限：30.00%

是否需要公布IOPV：是

最小申购赎回单位：1,000,000份

最小申购赎回单位现金红利：0.00元

申购赎回组合证券只数：100只

是否开放申购：允许

是否开放赎回：允许

是否开放保证金申购：禁止

组合信息内容

证券代码	证券简称	股份数量	现金替代标志	现金替代保证金率	固定替代金额
000001	深发展A	3300	允许	15%	
000002	万　科A		必须		78,859
000006	深振业A	800	允许	15%	
000012	南　玻A	1400	允许	15%	
000021	长城开发	700	允许	15%	
000022	深赤湾A	100	允许	15%	
000024	招商地产	900	允许	15%	
000027	深圳能源	1000	允许	15%	
000036	华联控股	1000	允许	15%	
000039	中集集团		必须		1,750
000042	深长城	100	允许	15%	
000059	辽通化工	800	允许	15%	
000069	华侨城A	3100	允许	15%	
000088	盐田港	600	允许	15%	
000089	深圳机场	900	允许	15%	
000090	深天健	400	允许	15%	
000099	中信海直	400	允许	15%	
000100	TCL集团	6400	允许	15%	
000157	中联重科	5000	允许	15%	
000159	国际实业	400	允许	15%	
000338	潍柴动力	900	允许	15%	
000401	冀东水泥	800	允许	15%	
000402	金融街	3000	允许	15%	
000417	合肥百货	400	允许	15%	
000419	通程控股	300	允许	15%	
000422	湖北宜化	600	允许	15%	
000425	徐工机械	900	允许	15%	
000488	晨鸣纸业	1100	允许	15%	
000501	鄂武商A	300	允许	15%	
000527	美的电器	2300	允许	15%	
000528	柳　工	800	允许	15%	
000539	粤电力A		必须		4,167
000541	佛山照明	700	允许	15%	
000543	皖能电力	400	允许	15%	
000550	江铃汽车	200	允许	15%	
000562	宏源证券	700	允许	15%	
000568	泸州老窖	900	允许	15%	
000572	海马汽车	600	允许	15%	
000581	威孚高科	500	允许	15%	
000584	友利控股	400	允许	15%	
000589	黔轮胎A	400	允许	15%	
000597	东北制药	200	允许	15%	
000600	建投能源	300	允许	15%	
000601	韶能股份	1000	允许	15%	
000608	阳光股份	600	允许	15%	
000616	亿城股份	1300	允许	15%	
000619	海螺型材	300	允许	15%	
000623	吉林敖东	700	允许	15%	
000625	长安汽车	2000	允许	15%	
000651	格力电器	2500	允许	15%	
000659	珠海中富	1100	允许	15%	
000667	名流置业	2200	允许	15%	
000679	大连友谊	300	允许	15%	
000680	山推股份	800	允许	15%	
000690	宝新能源	1600	允许	15%	
000698	沈阳化工	600	允许	15%	
000707	双环科技	500	允许	15%	
000708	大冶特钢	200	允许	15%	
000709	河北钢铁	4900	允许	15%	
000717	韶钢松山	1400	允许	15%	
000726	鲁　泰A	600	允许	15%	
000728	国元证券	1000	允许	15%	
000729	燕京啤酒	700	允许	15%	
000731	四川美丰	500	允许	15%	
000748	长城信息	400	允许	15%	
000759	中百集团	800	允许	15%	
000761	本钢板材	200	允许	15%	
000778	新兴铸管	1300	允许	15%	
000780	平庄能源	500	允许	15%	
000783	长江证券	2000	允许	15%	
000786	北新建材	400	允许	15%	
000800	一汽轿车	1000	允许	15%	
000825	太钢不锈	2700	允许	15%	
000828	东莞控股	400	允许	15%	
000830	鲁西化工	800	允许	15%	
000850	华茂股份	700	允许	15%	
000877	天山股份	300	允许	15%	
000881	大连国际	300	允许	15%	
000898	鞍钢股份	1700	允许	15%	
000900	现代投资	300	允许	15%	
000903	云内动力	600	允许	15%	
000910	大亚科技	400	允许	15%	
000911	南宁糖业	200	允许	15%	
000926	福星股份	700	允许	15%	
000933	神火股份	200	允许	15%	
000937	冀中能源	900	允许	15%	
000951	中国重汽	200	允许	15%	
000959	首钢股份		必须		6,480
000963	华东医药	300	允许	15%	
000989	九 芝 堂	200	允许	15%	
002001	新 和 成	400	允许	15%	
002028	思源电气	300	允许	15%	
002048	宁波华翔	500	允许	15%	
002078	太阳纸业	400	允许	15%	
002142	宁波银行	1400	允许	15%	
002191	劲嘉股份	300	允许	15%	
002202	金风科技	1600	允许	15%	
002242	九阳股份	300	允许	15%	
002244	滨江集团	500	允许	15%	
002254	泰和新材	300	允许	15%	

（八）拒绝或暂停申购的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可拒绝或暂停接受投资者的申购申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法接受申购；

2、因特殊原因（如深圳证券交易所决定临时停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、申购赎回代理券商、深圳证券交易所、注册登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、深圳证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当（上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等）；

4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；

5、法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并按照有关规定在指定媒体上及时公告。在暂停申购的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购业务的办理，并按照有关规定在指定媒体上予以公告。

（九）暂停赎回的情形及处理方式

发生下列情况时，基金管理人可暂停接受投资者的赎回申请：

1、因不可抗力导致基金无法正常运作或无法接受赎回；

2、因特殊原因（如深圳证券交易所决定临时停市），导致基金管理人无法计算当日基金资产净值；

3、申购赎回代理券商、深圳证券交易所、注册登记机构等因异常情况无法办理申购、赎回，或者指数编制单位、深圳证券交易所等因异常情况使申购赎回清单无法编制或编制不当（上述异常情况指基金管理人无法预见并不可控制的情形，包括但不限于系统故障、网络故障、通讯故障、电力故障、数据错误等）；

4、发生本基金合同规定的暂停基金资产估值的情形；

5、法律法规、深圳证券交易所规定或中国证监会认定的其他情形。

发生上述情形之一时，基金管理人应在当日报中国证监会备案，并按照有关规定在指定媒体上及时公告。在暂停赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复赎回业务的办理，并按照有关规定在指定媒体上予以公告。

（十）基金的非交易过户等其他业务

注册登记机构可依据其业务规则，受理基金份额的非交易过户、冻结与解冻等业务，并收取一定的手续费用。

（十一）集合申购与其他服务

在条件允许时，基金管理人可开放集合申购，即允许多个投资者集合其持有的组合证券，共同构成最小申购赎回单位或其整数倍，进行申购。在不损害基金份额持有人利益的前提下，基金管理人有权制定集合申购业务的相关规则。

在条件允许时，基金管理人也可采取其他合理的申购、赎回方式，并于新的申购、赎回方式开始执行前的至少3个工作日予以公告。

基金管理人指定的代理机构可依据本基金合同开展其他服务，双方需签订书面委托代理协议，并报中国证监会备案。

十三、基金上市推荐人意见

本基金无上市推荐人。

十四、备查文件目录

以下备查文件存放在基金管理人的办公场所，在办公时间可供免费查阅。

（一）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；

（二）《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；

（三）《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；

（四）《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

（五）关于募集深证300价值交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书；

（六）基金管理人业务资格批件、营业执照；

（七）基金托管人业务资格批件、营业执照；

（八）中国证监会要求的其他文件。

交银施罗德基金管理有限公司

2011年10月20日

附件：基金合同摘要

一、基金管理人、基金托管人和基金份额持有人的权利、义务

（一）基金管理人

1、基金管理人的权利

①自本基金合同生效之日起，依照有关法律法规和本基金合同的规定独立运用基金财产；

②依照本基金合同获得基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他收入；

③根据法律法规和基金合同之规定销售基金份额；

④根据法律法规和基金合同的规定制定基金收益分配方案；

⑤依照有关规定为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利；

⑥在符合有关法律法规、交易所及注册登记结构相关业务规则和本基金合同的前提下，决定基金的除调高托管费和管理费之外的费率结构和收费方式；

⑦根据本基金合同及有关规定监督基金托管人，对于基金托管人违反了本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会和中国银监会，并采取必要措施保护基金及相关基金当事人的利益；

⑧在基金合同约定的范围内，拒绝或暂停受理申购、赎回申请；

⑨自行担任基金注册登记机构或选择、更换注册登记机构，并对注册登记机构的代理行为进行必要的监督和检查；

⑩选择、更换代销机构，并依据销售代理协议和有关法律法规，对其行为进行必要的监督和检查；

⑪在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；

⑫依法召集基金份额持有人大会；

⑬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；

⑭选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；

⑮根据国家有关规定，在法律法规允许的前提下，以基金的名义依法为基金融资、融券；

⑯法律法规、基金合同以及依据基金合同制定的其它法律文件规定的其他权利。

2、基金管理人的义务

①依法募集基金，办理或者委托经由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、赎回和注册登记事宜；

②办理基金备案手续；

③自基金合同生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产；

④配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金财产；

⑤建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立，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；

⑥除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人运作基金财产；

⑦依法接受基金托管人的监督；

⑧计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购赎回清单；

⑨采取适当合理的措施使计算基金份额认购价格以及申购、赎回对价的方法符合基金合同等法律文件的规定；

⑩按规定受理基金份额的申购和赎回申请，及时、足额支付申购的应付基金份额和现金及赎回之对价；

⑪进行基金会计核算并编制基金财务会计报告；

⑫编制季度、半年度和年度基金报告；

⑬严格按照《基金法》、基金合同及其他有关规定，履行信息披露及报告义务；

⑭保守基金商业秘密，不得泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

⑮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；

⑯依据《基金法》、基金合同及其他有关规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法召集基金份额持有人大会；

⑰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；

⑱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；

⑲组织并参加基金财产清算小组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

⑳因违反基金合同导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

㉑基金托管人违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；

㉒按规定向基金托管人提供基金份额持有人名册资料；

㉓建立并保存基金份额持有人名册；

㉔面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；

㉕执行生效的基金份额持有人大会的决定；

㉖不从事任何有损基金及其他基金合同当事人合法权益的活动；

㉗按照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利，不谋求对上市公司的控股和直接管理；

㉘法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（二）基金托管人

1、基金托管人的权利

①依照基金合同的约定获得基金托管费；

②监督基金管理人对本基金的投资运作；

③自本基金合同生效之日起，依照法律法规和基金合同、托管协议的规定保管基金财产；

④在基金管理人更换时，提名新任基金管理人；

⑤根据本基金合同及有关规定监督基金管理人，对于基金管理人违反本基金合同或有关法律法规规定的行为，对基金财产、其他基金合同当事人的利益造成重大损失的情形，应及时呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金及相关基金合同当事人的利益；

⑥依法提议召开或召集基金份额持有人大会；

⑦按规定取得基金份额持有人名册；

⑧法律法规规定的其他权利。

2、基金托管人的义务

①以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产；

②设立专门的基金托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金财产托管事宜；

③建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金财产的安全，保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立；对所托管的不同基金财产分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；

④除依据《基金法》、基金合同及其他有关规定外，不得为自己及任何第三人谋取利益，不得委托第三人托管基金财产；

⑤保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

⑥按规定开设基金财产的资金账户和证券账户；

⑦保守基金商业秘密。除《基金法》、基金合同及其他有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不得向他人泄露；

⑧对基金财务会计报告、季度、半年度和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人有未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；

⑨保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料不少于15年；

⑩按照基金合同的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；

⑪协理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；

⑫复核、审查基金管理人计算的基金资产净值和基金份额申购、赎回对价；

⑬按照规定监督基金管理人的投资运作；

⑭按规定制作相关账册并与基金管理人核对；

⑮依据基金管理人的指令或有关规定向基金份额持有人支付基金收益和交付赎回对价；

⑯按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金管理人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；

⑰因违反基金合同导致基金财产损失，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；

⑱按规定监督基金管理人按照法律法规规定和基金合同履行其义务，基金管理人因违反基金合同造成基金财产损失时，应为基金向基金管理人追偿；

⑲根据本基金合同和托管协议规定建立并保存基金份额持有人名册；

⑳参加基金财产清算组，参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配；

㉑面临解散、依法被撤销、破产或者由接管人接管其资产时，及时报告中国证监会和中国银监会，并通知基金管理人；

㉒执行生效的基金份额持有人大会的决定；

㉓法律法规、基金合同规定的以及中国证监会要求的其他义务。

（三）基金份额持有人

投资者自依招募说明书、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当事人，直至其不再持有本基金的基金份额，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的完全承认和接受。基金份额持有人作为基金合同当事人并不以在基金合同上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：

①分享基金财产收益；

②参与分配清算后的剩余基金财产；

③依法转让或者申请赎回其持有的基金份额；

④按照规定要求召开基金份额持有人大会；

⑤出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；

⑥查阅或者复制公开披露的基金信息资料；

⑦监督基金管理人的投资运作；

⑧对基金管理人、基金托管人、基金份额代销机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼；

⑨法律法规和基金合同规定的其他权利。

2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关法律法规的规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：

①遵守法律法规、基金合同及其他有关规定；

②缴纳基金认购款项和认购股票、应付申购对价和赎回对价及缴纳法律法规、基金合同和招募说明书规定的费用；

③在持有的基金份额范围内，承担基金亏损或者基金合同终止的有限责任；

④不从事任何有损基金及其他基金份额持有人合法权益的活动；

⑤执行生效的基金份额持有人大会决议；

⑥遵守基金管理人、基金托管人及销售机构和注册登记机构的相关交易及业务规则；

⑦返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人、代销机构以及其他基金份额持有人处获得的不当得利；

⑧法律法规和基金合同规定的其他义务。

（四）本基金合同当事人各方的权利义务以本基金合同为依据，不因基金账户名称而有所改变。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

（一）基金份额持有人大会的组成

1、基金份额持有人大会由基金份额持有人组成，基金份额持有人的合法授权代表有权代表基金份额持有人出席会议并表决。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

2、鉴于本基金和本基金的联接基金（即“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“联接基金”）的相关性，本基金联接基金的基金份额持有人可以凭所持有的联接基金份额出席或者委派代表出席本基金的份额持有人大会并参与表决。在计算参会份额和计票时，联接基金持有人持有的享有表决权的基金份额数和表决票数为，在本基金基金份额持有人大会的权益登记日，联接基金持有本基金份额的总数乘以该持有人所持有的联接基金份额占联接基金总份额的比例，计算结果按照四舍五入的方法，保留到整数位。

联接基金的基金管理人不应以联接基金的名义代表联接基金的全体基金份额持有人以本基金的基金份额持有人的身份行使表决权，但可接受联接基金的特定基金份额持有人的委托以联接基金的基金份额持有人代理人的身份出席本基金的基金份额持有人大会并参与表决。

联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会的，须先遵照联接基金基金合同的约定召开联接基金的基金份额持有人大会，联接基金的基金份额持有人大会决定提议召开或召集本基金份额持有人大会的，由联接基金的基金管理人代表联接基金的基金份额持有人提议召开或召集本基金份额持有人大会。

（二）召开事由

1、当出现或需要决定下列事由之一的，经基金管理人、基金托管人或持有基金份额10%以上（以上”含本数，下同）的基金份额持有人（以基金管理人收到提议当日的基金份额计算，下同）提议时，应当召开基金份额持有人大会：

①终止基金合同；

②转换基金运作方式；

③变更基金类别；

④变更基金投资目标、投资范围或投资策略（法律法规和中国证监会另有规定的除外）；

⑤变更基金份额持有人大会议事程序；

⑥更换基金管理人、基金托管人；

⑦提高基金管理人、基金托管人的报酬标准。但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

⑧本基金与其他基金的合并；

⑨（）终止基金上市，但因基金不再具备上市条件而被深圳证券交易所终止上市的除外；

⑩对基金合同当事人权利、义务产生重大影响，需召开基金份额持有人大会的变更基金合同等其他事项；

⑪法律法规、基金合同或中国证监会规定的其他情形。

2、出现以下情形之一的，可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：

①调低基金管理费、基金托管费等其他应由基金或基金份额持有人承担的费用；

②法律法规要求增加的基金费用的收取；

③在法律法规和本基金合同规定的范围内调整基金的申购费率、调低赎回费率、变更或增加收费方式；

④因相应的法律法规、深圳证券交易所或者注册登记机构的相关业务规则发生变动必须对基金合同进行修改；

⑤基金合同的修改不涉及本基金合同当事人权利义务关系发生重大变化；

⑥基金合同的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响；

⑦按照法律法规或本基金合同规定不需召开基金份额持有人大会的其他情形。

（三）召集人和召集方式

1、除法律法规或本基金合同另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集。基金管理人未按规定召集或者不能召集时，由基金托管人召集。