

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:二〇一二年三月三十日

1.1 重要提示
基金管理人及基金托管人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,并由董事会审议通过。
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2012年3月28日复核了本报告中的财务指标、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的本金不受损失或保证收益。
基金的投资业绩并不代表其未来表现,投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。
本年度报告摘要自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告日期为2011年9月28日起至12月31日止。

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|-------------------|
| 基金名称 | 交银施罗德300价值ETF联接基金 |
| 基金代码 | 519706 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 75,900,350.23份 |
| 基金合同生效日期 | 不定期 |

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 | 本基金通过组合证券资产投资于目标ETF,标的指数成份股和备选成份股进行组合投资,正常情况下一切资产的投资比例不低于基金资产净值的90%。基金资产投资于目标ETF和标的指数成份股、备选成份股、国债、债券、回购、权证及中国证监会允许基金投资的其它金融工具,其目的是为了力争本基金在跟踪标的指数的过程中,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。 |
| 业绩比较基准 | 中证300价值价格指数收益率+95%+银行同期存款税后收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于ETF联接基金,风险与预期收益高于混合基金,低于股票型基金,属于证券投资基金中风险较高的品种,具有与标的指数、以及标的指数所代表的证券市场相似的风险收益特征,属于证券投资基金中风险较高、预期收益较高的品种。 |

2.3 基金管理人

| | | |
|--------|---------------------------|------------------|
| 名称 | 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 |
| 法定代表人 | 陈维 | 李勇 |
| 注册地址 | 021-6105080 | 010-6201510 |
| 客服电话 | xsp@sd.com.cn | hsfeng@china.com |
| 客户服务热线 | 400-700-5000,021-61050000 | 95599 |
| | 021-6105884 | 010-6201816 |

3.1 主要会计数据和财务指标

| | |
|---------------|---------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 2011年9月28日(基金合同生效日)至2011年12月31日 |
| 本期已实现收益 | 1,003,076.65 |
| 本期利润 | -6,425,192.61 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0888 |
| 本基金份额净值增长率 | -9.20% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2011年末 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.092 |
| 期末基金资产净值 | 68,935,225.47 |
| 期末基金份额净值 | 0.908 |

3.2 自基金合同生效以来基金业绩比较基准及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率基准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率基准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去三年自基金合同生效至今 | -9.20% | 1.01% | -12.53% | 1.43% | 3.33% | -0.42% |
| 过去三年自基金合同生效至今 | -9.20% | 0.98% | -14.50% | 1.49% | 5.30% | -0.42% |

3.3 过去三年基金的利润分配情况

| 年度 | 每10份基金份额应派现金金额 | 再投资方式发放总额 | 年度利润分配合计 | 备注 |
|-------|----------------|-----------|----------|----|
| 2011年 | - | - | - | - |
| 合计 | - | - | - | - |

4.1 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.2 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.3 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.4 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.5 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.6 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.7 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.8 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.9 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.10 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.11 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

4.12 基金管理人及基金托管人

| | |
|-------|---------------|
| 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 |

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

2011 年度 报告摘要

2011年12月31日

ETF因其独特的指数化投资、分散化投资、低成本、高透明度等优势,成为近年来最受投资者欢迎的基金品种之一。截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.908元,本报告期净值增长率为-9.20%,同期业绩比较基准增长率为-14.50%。本报告期本基金日均跟踪偏离度为0.44%,跟踪误差为0.84%。

截至2011年12月31日,本基金份额净值为0.908元,本报告期净值增长率为-9.20%,同期业绩比较基准增长率为-14.50%。本报告期本基金日均跟踪偏离度为0.44%,跟踪误差为0.84%。

金额单位:人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|---------------|------------|--------------|
| A | 农林牧渔 | - | - |
| B | 采矿业 | 20,284.16 | 0.03 |
| C | 制造业 | 326,114.12 | 0.47 |
| CD | 食品饮料 | 28,392.13 | 0.04 |
| C1 | 纺织服装 | 5,307.04 | 0.01 |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 医药、生物 | 7,356.44 | 0.01 |
| C4 | 化学、石化、塑胶、塑料 | 26,965.70 | 0.04 |
| C5 | 电子、计算机 | 11,345.44 | 0.02 |
| C6 | 金属、非金属 | 59,598.98 | 0.09 |
| C7 | 机械、设备、仪器 | 170,067.41 | 0.25 |
| C8 | 医药、生物制品 | 17,179.98 | 0.02 |
| C9 | 其他 | - | - |
| D | 电力、煤气及水和热力生产业 | 11,219.38 | 0.02 |
| E | 建筑业 | 1,733.05 | 0.00 |
| F | 交通运输、仓储业 | 9,341.89 | 0.01 |
| G | 信息技术业 | 2,482.92 | 0.00 |
| H | 批发和零售业 | 17,010.11 | 0.02 |
| I | 金融、保险业 | 61,676.00 | 0.09 |
| J | 房地产业 | 91,237.17 | 0.13 |
| K | 社会服务业 | 14,736.96 | 0.02 |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 1,649.07 | 0.00 |
| | 合计 | 557,484.84 | 0.81 |

8.4 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-------|-----------|--------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 6,987 | 52,192.89 | 0.08 |
| 2 | 000051 | 格力电器 | 1,628 | 33,113.16 | 0.05 |
| 3 | 000051 | 格力电器 | 3,668 | 28,839.72 | 0.04 |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 3,320 | 25,530.60 | 0.04 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 562 | 20,962.60 | 0.03 |
| 6 | 000318 | 鲁商动力 | 401 | 18,931.50 | 0.03 |
| 7 | 000237 | 美尚服饰 | 1,482 | 18,139.68 | 0.03 |
| 8 | 000069 | 华侨城A | 2,064 | 14,736.96 | 0.02 |
| 9 | 000425 | 地产集团 | 899 | 12,783.78 | 0.02 |
| 10 | 000402 | 金融街 | 1,932 | 11,688.60 | 0.02 |

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读披露于基金管理人网站的年度报告正文。

8.5 报告期内股票投资组合的重大变动

8.5.1 买入/卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 本期累计卖出金额 | 金额单位:人民币元 |
|----|--------|------|--------------|----------|-----------|
| 1 | 000002 | 万科A | 3,976,227.00 | 5,777 | |
| 2 | 000051 | 格力电器 | 2,990,548.00 | 4,34 | |
| 3 | 000001 | 浦发银行 | 2,686,056.90 | 3,85 | |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 2,284,074.00 | 3,83 | |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 1,708,802.48 | 2,48 | |
| 6 | 000318 | 鲁商动力 | 1,689,348.36 | 2,45 | |
| 7 | 000023 | 美尚服饰 | 1,681,768.73 | 2,44 | |
| 8 | 000623 | 鲁商能源 | 1,036,807.00 | 1,50 | |
| 9 | 000069 | 华侨城A | 1,036,699.00 | 1,50 | |
| 10 | 000937 | 中兴能源 | 928,223.76 | 1,35 | |
| 11 | 000012 | 南航A | 922,347.00 | 1,34 | |
| 12 | 000709 | 河北钢铁 | 910,504.00 | 1,32 | |
| 13 | 000024 | 招商轮船 | 888,288.00 | 1,29 | |
| 14 | 000783 | 长江证券 | 883,676.00 | 1,28 | |
| 15 | 000002 | 金融街 | 883,195.11 | 1,28 | |
| 16 | 000425 | 地产集团 | 828,021.00 | 1,20 | |
| 17 | 000081 | 威孚高科 | 783,726.00 | 1,14 | |
| 18 | 002202 | 金丰科技 | 769,292.70 | 1,12 | |
| 19 | 000403 | 神火股份 | 757,582.00 | 1,10 | |
| 20 | 000040 | 华鲁恒升 | 708,598.00 | 1,03 | |

注:“买入/卖出金额”按买入/卖出成交金额(成交金额=成交数量×成交均价)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.2 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 3,976,227.00 | 5.77 |
| 2 | 000051 | 格力电器 | 2,990,548.00 | 4.34 |
| 3 | 000001 | 浦发银行 | 2,686,056.90 | 3.85 |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 2,284,074.00 | 3.83 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 1,708,802.48 | 2.48 |
| 6 | 000318 | 鲁商动力 | 1,689,348.36 | 2.45 |
| 7 | 000023 | 美尚服饰 | 1,681,768.73 | 2.44 |
| 8 | 000623 | 鲁商能源 | 1,036,807.00 | 1.50 |
| 9 | 000069 | 华侨城A | 1,036,699.00 | 1.50 |
| 10 | 000937 | 中兴能源 | 928,223.76 | 1.35 |
| 11 | 000012 | 南航A | 922,347.00 | 1.34 |
| 12 | 000709 | 河北钢铁 | 910,504.00 | 1.32 |
| 13 | 000024 | 招商轮船 | 888,288.00 | 1.29 |
| 14 | 000783 | 长江证券 | 883,676.00 | 1.28 |
| 15 | 000002 | 金融街 | 883,195.11 | 1.28 |
| 16 | 000425 | 地产集团 | 828,021.00 | 1.20 |
| 17 | 000081 | 威孚高科 | 783,726.00 | 1.14 |
| 18 | 002202 | 金丰科技 | 769,292.70 | 1.12 |
| 19 | 000403 | 神火股份 | 757,582.00 | 1.10 |
| 20 | 000040 | 华鲁恒升 | 708,598.00 | 1.03 |

注:“买入/卖出金额”按买入/卖出成交金额(成交金额=成交数量×成交均价)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.3 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 6,563,448.55 | 9.52 |
| 2 | 000051 | 格力电器 | 4,424,613.65 | 6.49 |
| 3 | 000001 | 浦发银行 | 4,201,207.78 | 6.10 |
| 4 | 000157 | 中联重科 | 3,765,825.12 | 5.36 |
| 5 | 000568 | 泸州老窖 | 2,992,958.47 | 4.30 |
| 6 | 000023 | 美尚服饰 | 2,750,388.78 | 3.99 |
| 7 | 000623 | 鲁商能源 | 2,610,671.71 | 3.79 |
| 8 | 000069 | 华侨城A | 1,752,081.86 | 2.54 |
| 9 | 000623 | 鲁商能源 | 1,545,499.66 | 2.24 |
| 10 | 000002 | 金融街 | 1,477,316.88 | 2.14 |
| 11 | 000709 | 河北钢铁 | 1,431,937.50 | 2.08 |
| 12 | 000012 | 南航A | 1,429,340.00 | 2.07 |
| 13 | 000037 | 鲁中制药 | 1,429,210.25 | 2.07 |
| 14 | 000024 | 招商轮船 | 1,407,802.42 | 2.04 |
| 15 | 000783 | 长江证券 | 1,383,423.93 | 2.01 |
| 16 | 000081 | 威孚高科 | 1,335,210.02 | 1.94 |
| 17 | 000425 | 地产集团 | 1,289,215.65 | 1.87 |
| 18 | 002202 | 金丰科技 | 1,234,118.68 | 1.79 |
| 19 | 000043 | 神火股份 | 1,162,422.08 | 1.69 |
| 20 | 000040 | 华鲁恒升 | 1,121,649.91 | 1.63 |

注:“买入/卖出金额”按买入/卖出成交金额(成交金额=成交数量×成交均价)填列,不考虑相关交易费用。

8.5.4 买入/卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------------|--------------|
| 1 | 000002 | 万科A | 6,563,448.55 | 9.52 |
| 2 | 000051 | 格力电器 | 4,424,613.65 | |