



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 (更新) 招募说明书摘要

(2012年第1号)

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,更新内容截至至每6个月的最月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,本基金基金合同于2011年9月28日正式生效。

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

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

有人能全部取回其原本投资。

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,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。投资者根据所持份额享受

基金的收益,但同时也要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

会等因素引起证券市场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风险,基金管

理人在基金管理过程中产生的基金管理风险,本基金投资债券资产引发的信用风险,以及本基

金投资策略所特有的风险等。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的品种,预期收益较高的品种。

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,基金的各项

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对本基金业绩表现的保

证。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写,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。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人

和本基金合同的当事人,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》、《运作办法》、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。

本招募说明书所载内容截止日为2012年3月28日,有关财务数据和净值表现截止日为2012

年3月31日。本招募说明书所载的财务数据未经审计。

一、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号交通银行大楼二楼(裙)

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:楼文网

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:陈皓

电话:(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	股份比例
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%
中国国际金融有限公司(集团)股份有限公司	5%

(二)主要成员情况

1、基金管理人董事会成员

文澜先生,董事,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

资产负债管理部办公室主任兼上海分行副行长,资产负债管理部总经理兼改制办公

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。

南庆先生,副董事长,硕士学历,加拿大籍,现任交通银行和香港证券学院荣誉院士,历任巴克莱基

金有限公司基金经理,施罗德投资管理有限公司执行董事,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。

陈卫先生,董事,总经理,CFA,CIPM,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经理副总监,信贷资产管理亚洲有限公司投资风险经理总监,荷兰

国际投资管理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,交通银行总行资产管理部副经理,总经理,交通银行上海分行副行长,交通银行资产

管理部,现任交通银行投资管理部副经理。

吴伟先生,董事,博士学历,历任交通银行总行财会部财务主任、副处长、预算财务部副副总

经理,现任交通银行沈阳分行行长。

葛卫达先生,董事,大学学历,历任施罗德集团信息工作小组信息技术部技术部副经理

首席运营官,现任施罗德集团亚太地区总裁。

谢川明先生,独立董事,博士学历,历任蒙特利尔大学经济学助理教授,国际货币基金经济

学家和高级经济学家,香港科技大学助理教授、副教授、教授,系主任,现任香港科技大学教授、福安

经管学院院长。

袁庆先生,独立董事,博士学历,历任复旦大学管理学院副教授、教授,经济系系主任,现任

复旦大学经济学院院长。

周林先生,独立董事,博士学历,历任复旦大学管理学系副教授、美国纽约大学经济系副教

授、副教授,美国乔治大学经济系副教授,香港城市大学经济与金融系教授,美国亚利桑那州大

学凯瑞商学院经济系冠名教授,上海交通大学上海高级金融学院常务副院长、教授,现任上海交

通大学安泰与管理学院院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

范晓先生,监事长,FAMA,高级经济师,历任河南省农业银行信贷员信贷员、副行长,现县

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。

姜淑英女士,监事,CFA,CIPM,FRM,工商管理,资讯管理双硕士,曾任西南银行、渣打银

行(香港)有限公司、MIDAS-KAPITI INTERNATIONAL LIMITED,施罗德投资管理有限公司

资讯科技部主管,中国事务联席董事,交银施罗德基金管理有限公司监察稽核及风险管理总监,现

任交银施罗德基金管理有限公司总经理助理。

陈超女士,监事,硕士学历,历任交通银行股份有限公司资产托管部内控综合员,交银施罗德

基金管理有限公司董事办秘书,合规审计部总经理,现任交银施罗德基金管理有限公司监察稽核

部总经理兼董事会秘书。

3、公司高管人员

文澜先生,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理

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。

许嘉楠女士,副总经理,硕士学历,高级经济师。历任湖南大学(现湖南财经学院)金融学院讲

师,湘财证券有限责任公司市场部副经理,基金管理部总经理,湘财银银基金管理有限公司副总

经理。

谢先生,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师;中国社会科

学院财经所助理研究员;中国电信投资公司基金部副经理;中国人保证券投资中心证券部副

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

屈伟伟先生,基金经理,数理系硕士,16年证券投资从业经验,历任广发证券北京业务总经

理助理、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,风险控制研

究小组成员以及上述SOEITY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日起担任上述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,2009年9

月29日起兼任施罗德上证300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,

2011年9月22日起兼任深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理至今,并于

2011年9月28日起兼任本基金基金经理至今。

蔡伟先生,基金经理助理,复旦大学工学工程硕士,4年证券从业经验,历任瑞丰银行香港分行

主任,2009年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任研究员和数量化分析师,2011年3月7

日起担任上述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,2011年9月22

日起兼任深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理至今,2011年9月28日起兼任本基

金经理助理至今。

5、投资决策委员会成员

委员:项廷锋(投资总监)

战龙(总经理)

史伟(权益部副经理,基金经理)

张亚斌(权益部副经理,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。

二、基金托管人

(一)基金托管人基本情况

1、基本情况

名称:中国农业银行股份有限公司(以下使用其全称或简称“中国农业银行”)

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座

法定代表人:蒋超良

成立时间:2009年11月15日

注册资本:32,479,411.7亿元人民币

存续期间:持续经营

电话:(010)63201510

传真:(010)63201816

联系人:李芳菲

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分,总行设在北京,经国务院批准,

中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于2009年11月15日正式成立。中国农

业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点 and 员工,中国农业银行网

点遍布中国城乡,成为国内网点最多、业务辐射范围最广、服务网络最、服务对象最多、业务功能

齐全的大型国有商业银行之一。在海外,中国农业银行同样通过自己的不断努力赢得了良好的信誉,

每年位居《财富》世界500强企业之一。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业

银行,中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念,坚持审慎稳健经营、可持续发展,立足城

市和农村两大市场,实施差异化竞争战略,着力打造“伴你成长”服务品牌,依托覆盖全国的分支机

构,庞大的电子化网络和网络多元化的金融产品,致力为广大客户提供优质的金融服务,与广大客户共

同成长,共同发展。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行,经验丰富,服务优质,业绩突出,

2004年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”。2007年中国农业银行通过了美国SAS70

内部控制审计,并获得无保留意见的SAS70审计报告,表明了独立公正第三方对中国农业银行行

托管服务流程的合规性、内部控制的有效性、内部控制的有效性全面认可。中国农业银行着力加强能力建

设,品牌声誉进一步提升,在2010年首届“金理财”TOP100颁奖典礼中,获“最佳托管

银行”、2010年再次荣获《财资》杂志颁发的“最佳托管银行”。

中国农业银行证券投资基金托管部于1998年5月经中国证监会和中国人民银行批准成立,

2004年9月更名为证券投资基金托管部,内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保

险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理部、风险管理处,拥有先进的安全

防范设施和基金托管业务系统。

2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工146名,其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师

等专家10余名,服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强,高级管理人员均有20年以

上金融从业经验和高級技术职称,精通国内外证券市场的运作。

3、基金托管业务经营情况

截止2012年3月28日,中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共

120只,包括交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国天南平衡混

合型基金、华夏基金增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成

领先成长股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛主题增长股票型

证券投资基金、洛阳证券股票基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景顺主题增长股票型

证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈

和收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、

银河收益证券投资基金、长盛中债中证债市指数证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、

长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型

证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天瑞

强势动力精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资

基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票型

证券投资基金、泰达红利市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型

证券投资基金、大成沪深300指数证券投资基金、信诚四季红证券投资基金、富国天时货币

市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、诺安货币市场基金、长城安心回报混合

型基金、中欧中小盘(内地及香港)股票型证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、

交银施罗德成长股票型证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达红利中小企业股票型

证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合证券投资基金、宝

盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合

型基金、中欧核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利

灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海化

价值股票型证券投资基金、中巴智赢竞争优势股票型证券投资基金、鹏华优选成长股票型证券投资

基金、金元顺安成长动力灵活配置混合型证券投资基金、长信稳健双盈证券投资基金、中

融中证红利配置混合型证券投资基金、长信中证红利配置混合型证券投资基金、金元顺安成长

动力灵活配置混合型证券投资基金、富国天惠灵活配置混合型证券投资基金、交银施罗德

先锋策略证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益

稳健增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动

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

二零一二年三月

股票型证券投资基金、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、

上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深300指数增强型证券投资基

金、南方中证500指数证券投资基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心

优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证

券投资基金、博时创业板成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易达消费

行业股票型证券投资基金、富国红利分级债券型证券投资基金、大成保本分级债券型证券投资基

金、兴业沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资

基金、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券型证券投资

基金、大成深证成长40交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长40交易型开放式指数证

券投资基金基金联接基金、泰达红利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券型证

券投资基金、东吴中证新兴产业主题证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安

远回报债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型

证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中欧中小盘灵活配置混合型证券投资基金、

浙商银行产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中债300交

易型开放式指数证券投资基金、广发中债300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方

保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票型证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型

证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元比联保本混合型证券

投资基金、招商安保本混合型证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、深

证300价值交易型开放式指数证券投资基金、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信

中证成长股票型证券投资基金、大成中证内地主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股

票型证券投资基金、长盛同庆中证200指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券

投资基金、汇添富逆向操作股票型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富

兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐

产业股票型证券投资基金

(二)基金托管人内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范

运作,严格监查,确保业务的健康运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完

整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织机

为,风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理内部控制工作,对托管业务风险管理和

内部控制工作进行监督和评价,托管业务部门专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负

责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职责。

3、内部控制措施及措

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以

保证托管业务的规范操作和顺利运行,业务人员具备专业资格;业务管理实行严格的复核、审核、

控制制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,柜员实行严格保管、制约

机制和严格轮岗制度;业务信息系统设置相应的工作权限,限制业务人员违规发布信息;强化技

术手段,业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人基金管理人运作基金监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将基金《运作办法》、基金合同、托管协议约定的投资比例和禁

止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、

基金管理人投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示,对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面提示,对基金投资比例超规格、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进

行提示;

3、书面报告,对投资比例超规格、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易行为,书面提示有关

基金管理人并抄送中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金销售机构

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。

机构名称: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号交通银行大楼二楼(裙)

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

法定代表人:楼文网

成立时间:2005年8月4日

电话:(021)61055037

传真:(021)61050022

网址:www.jyfund.com, www.jsyid.com, www.bcomschneider.com

个人投资者可以通过本公司网上交易系统办理开户、本基金的申购、赎回、转换及定期定额