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

(2013年第2号)

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

二零一三年九月

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。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。基金投资人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2013年9月28日,有关财务数据和净值表现截止日为2013年6月30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】28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(以下使用全称或其简称"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%

(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。

雷贤达先生,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、预算财务部副总经理、总经理、交通银行沈阳分行行长、交通银行预算财务部总经理,现任交通银行投资银行部总经理。

Richard Mountford先生,董事,硕士学历。历任施罗德投资管理有限公司分析师、投资经理、施罗德投资管理(新加坡)有限公司副董事长、施罗德投资管理国际有限公司执行董事、施罗德投资管理(卢森堡)有限公司总经理、施罗德投资管理(日本)有限公司总经理、施罗德投资管理有限公司英国区总经理及销售总监、全球渠道销售业务总监,现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。

谢丹阳先生,独立董事,博士学历。历任蒙特利尔大学经济系助理教授,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、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生,独立董事,博士学历。历任复旦大学经济学院副教授、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。历任复旦大学管理科学系助教,美国耶鲁大学经济系助理教授、副教授,美国杜克大学经济系副教授,香港城市大学经济与金融系教授,美国亚利桑那州立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经济与管理学院院长、教授。

2、基金管理人监事会成员

杜静先生,监事长,硕士学位,高级经济师。历任中国农业银行潜江支行办公室副主任;交通银行武汉分行信贷处副处长、信贷处处长兼授信催理处主任、国外业务处处长;交通银行市场营销部业务代理处处长;交通银行宜昌分行党委书记、行长;交通银行福建省分行党委书记、行长;交通银行华中授信审批中心总经理。

裘关淑仪女士,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、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会秘书、合规审计部总经理、监察稽核部总经理,现任交银施罗德基金管理有限公司董事会监事会办公室总经理兼董事会秘书。

张科兵先生,监事,学士学历。历任安达信(上海)企业咨询有限公司审计部高级审计师,普华永道会计师事务所审计部项目经理,第一证券有限责任公司投资部投资经理,申万巴黎基金管理有限公司(现申万菱信基金管理有限公司)投资管理部高级研究员,交银施罗德基金管理有限公司高级研究员、研究部副总经理、研究部总经理,现任交银施罗德基金管理有限公司研究总监。

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

蔡铮先生,基金经理。复旦大学电子工程硕士。4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、基金经理助理。2012年12月27日起担任本基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、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、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金和交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理至今。

历任基金经理:

屈乐伟先生,2011年9月28日至2013年3月29日担任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员:项廷锋(投资总监、基金经理)

战龙(总经理)

管华雨(权益部总经理、基金经理)

胡军华(固定收益部总经理、基金经理)

张科兵(研究总监、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1月15日

注册资金:32,479,411.7万元人民币

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1月15日依法成立。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、机构网点和员工。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、服务领域最广、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努力赢得了良好的信誉,每年位居《财富》世界500强企业之列。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,立足县域和城市两大市场,实施差异化竞争策略,着力打造"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,与广大客户共创价值、共同成长。

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托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。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"金牌理财"TOP10颁奖盛典"中成绩突出,获"最佳托管银行"奖。2010年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的"最佳资产托管奖"。

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月更名为托管业务部,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、综合管理处、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,高级管理层均有20年以上金融从业经验和高级技术职称,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2013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153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、富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳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、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、裕阳证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、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、宝盈鸿利收益证券投资基金、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、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益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、富国天瑞强势地区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证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、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、信诚四季红混合型证券投资基金、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、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证100指数证券投资基金、泰达宏利首选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、鹏华动力增长混合型证券投资基金、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证券投资基金、中邮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、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、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)、大成行业轮动股票型证券投资基金、上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金、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、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交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基础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、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深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联接基金、泰达宏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证券投资基金、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取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)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮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、广发中小板300交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板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、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证300价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、富国中证500指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费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、长盛同瑞中证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、汇添富信用债债券型证券投资基金、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、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财14天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝7天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国7天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财21天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经50指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财21天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家14天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证500交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金。

(二)基金托管人的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、严格监察,确保业务的稳健运行,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、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,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权。

3、内部控制制度及措施

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进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;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)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规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、基金管理人的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、书面警示。对本基金投资比例接近超标、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。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

三、相关服务机构

(一)基金份额销售机构

1、直销机构

本基金直销机构为本公司以及本公司的网上直销交易平台。

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

法定代表人:钱文挥

成立时间:2005年8月4日

电话:(021)61055027

传真:(021)61055054

联系人:许野

客户服务电话:400-700-5000(免长途话费),(021)61055000

网址:www.fund001.com、www.bocomschroder.com

个人投资者可以通过本公司网上直销交易平台办理开户、本基金的申购、赎回、转换及定期定额投资等业务,具体交易细则请参阅本公司网站。网上直销交易平台网址:www.fund001.com、www.bocomschroder.com。

2、场内代销机构

具有基金代销资格的上海证券交易所场内会员单位(具体名单见基金份额发售公告)。

3、场外代销机构

(1)中国工商银行股份有限公司

住所:北京市复兴门内大街55号

办公地址:北京市复兴门内大街55号

法定代表人:姜建清

客户服务电话:95588

网址:www.icbc.com.cn

(2)中国农业银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街69号

办公地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:蒋超良

传真:(010)85109219

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

(3)中国建设银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

法定代表人:王洪章

电话:(010)66275654

传真:(010)66275654

客户服务电话:95533

网址:www.ccb.com

(4)交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市浦东新区银城中路188号

法定代表人:牛锡明

电话:(021)58781234

传真:(021)58408483

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:www.bankcomm.com

(5)招商银行股份有限公司

住所:深圳市福田区深南大道7088号

办公地址:深圳市福田区深南大道7088号

法定代表人:傅育宁

电话:(0755)83198888

传真:(0755)83195109

联系人:邓阿鹏

客户服务电话:95555

网址:www.cmbchina.com

(6)上海银行股份有限公司

住所:上海市银城中路168号

办公地址:上海市银城中路168号

法定代表人:范一飞

电话:(021)68475888

传真:(021)68476111

联系人:张萍

客户服务电话:(021)962888

网址:www.bankofshanghai.com

(7)中信银行股份有限公司

住所:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:田国立

电话:(010)65557083

传真:(010)65550827

联系人:丰靖

客户服务电话:95558

网址:bank.ecitic.com

(8)中国民生银行股份有限公司

住所:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区复兴门内大街2号

法定代表人:董文标

电话:(010)57092615

传真:(010)57092611

联系人:董云巍

客户服务电话:95568

网址:www.cmbc.com.cn

(9)宁波银行股份有限公司

住所:宁波市江东区中山东路294号

法定代表人:陆华裕

电话:(021)63586210

传真:(021)63586215

联系人:胡技勋

客户服务电话:96528(上海地区962528)

网址:www.nbcb.com.cn

(10)北京银行股份有限公司

住所:北京市西城区金融大街甲17号首层

办公地址:北京市西城区金融大街丙17号

法定代表人:闫冰竹

电话:(010)66223584

传真:(010)66226045

联系人:谢小华

客户服务电话:95526

网址:www.bankofbeijing.com.cn

(11)华夏银行股份有限公司

住所:北京市东城区建国门内大街22号

办公地址:北京市东城区建国门内大街22号

法定代表人:吴健

客户服务电话:95577

网址:www.hxb.com.cn

(12)海通证券股份有限公司

住所:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

电话:(021)23219000

传真:(021)23219100

联系人:李笑鸣

客户服务电话:95553或拨打各城市营业网点咨询电话

网址:www.htsec.com

(13)申银万国证券股份有限公司

住所:上海市常熟路171号

办公地址:上海市常熟路171号

法定代表人:丁国荣

电话:(021)54033888

联系人:李清怡

客户服务电话:95523或4008895523

网址:www.sywg.com

(14)红塔证券股份有限公司

住所:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

办公地址:云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼

法定代表人:况雨林

客户服务电话:0871-3577888

网址:www.hongtastock.com

(15)杭州数米基金销售有限公司

住所:杭州市余杭区仓前街道海曙路东2号

办公地址:浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼

法定代表人:陈柏青

电话:(0571)28829790、(021)60897869

传真:(0571)26698533

联系人:周嫣旻

客户服务电话:4000-766-123

网址:www.fund123.cn

(16)深圳众禄基金销售有限公司

住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1_J单元

办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼1_J单元

法定代表人:薛峰

电话:(0755)33227953

传真:(0755)82080798

联系人:汤素娅

客户服务电话:4006-788-887

网址:www.zlfund.cn、www.jjmmw.com

(17)上海长量基金销售投资顾问有限公司

住所:上海市浦东新区高翔路526号2幢220室

办公地址:上海市浦东新区浦东大道555号裕景国际B座16层

法定代表人:张跃伟

电话:(021)58788678

传真:(021)58787698

联系人:敖玲

客户服务电话:400-089-1289

网址:www.erichfund.com

(18)上海好买基金销售有限公司

住所:上海市虹口区场中路685弄37号4号楼449室

办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室

法定代表人:杨文斌

传真:(021)68596916

联系人:薛年

客户服务电话:400-700-9665

网址:www.ehowbuy.com

(19)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司

住所:上海市虹口区飞虹路360弄9号3724室

办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋2楼

法定代表人:汪静波

联系电话:(021)38600735

传真:(021)38509777

联系人:方成

客户服务电话:400-821-5399

网址:www.noah-fund.com

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

(二)基金注册登记机构

名称:中国证券登记结算有限责任公司

住所:北京市西城区太平桥大街17号

办公地址:北京市西城区太平桥大街17号

法定代表人:金颖

电话:010-59378839

传真:010-59378907

联系人:朱立元

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称:上海市通力律师事务所

住所:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

办公地址:上海市银城中路68号时代金融中心19楼

负责人:韩炯

电话:(021)31358666

传真:(021)31358600

联系人:黎明

经办律师:吕红、黎明

(四)审计基金财产的会计师事务所

名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人:杨绍信

电话:(021)23238888

传真:(021)23238800

联系人:魏佳亮

经办注册会计师:汪棣、屈斯洁

四、基金的名称

本基金名称: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

五、基金的类型

本基金类型:契约型开放式ETF联接基金

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金以目标ETF、标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象(含中小板股票和创业板股票及其他经中国证监会核准的上市股票),把全部或接近全部的基金资产用于跟踪标的指数的表现,正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,基金持有的现金及到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的5%。此外,为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于新股、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(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其它品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资,正常情况下投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%,其余资产可投资于标的指数成份股、备选成份股、新股、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,其目的是为了使本基金在应付申购赎回的前提下,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资目标ETF的方式以申购和赎回为主,但在目标ETF二级市场流动性较好的情况下,也可以通过二级市场交易买卖目标ETF,以降低成本、提高效率。

本基金对于标的指数成份股和备选成份股部分的投资,主要采用完全复制法,按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况(如法律法规限制、流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

1、决策依据

有关法律法规、基金合同和标的指数的相关规定是基金管理人运用基金财产的决策依据。

2、决策和交易机制

本基金实行投资决策委员会领导下的基金经理负责制。

投资决策委员会的主要职责是决定有关指数重大调整的应对决策、其他重大组合调整决策以及重大的单项投资决策。

基金经理的主要职责是决定日常指数跟踪维护过程中的组合构建、调整决策,特别是对目标ETF份额的投资决策。

中央交易室负责交易执行和一线监控。通过严格的交易制度和实时的一线监控功能,保证基金经理的投资指令在合法、合规的前提下得到高效的执行。

3、投资程序

研究、决策、组合构建、交易、评估及组合维护的有机配合共同构成了本基金的投资管理程序。严格的投资管理程序可以保证投资理念的正确执行,避免重大风险的发生。

(1)研究支持:量化投资部依托公司整体研究平台、整合外部信息以及券商等外部研究力量的研究成果开展指数跟踪、成份股公司行为等相关信息的搜集与分析、目标ETF申购赎回清单分析、目标ETF二级市场的流动性和折溢价分析、成分股流动性分析、误差及其归因分析等工作,以作为基金投资决策的重要依据。

(2)投资决策:投资决策委员会定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,每日进行基金投资管理的日常决策。

(3)组合构建:根据标的指数情况,结合研究支持,基金经理构建以目标ETF为主的证券组合。在追求跟踪误差和偏离度最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低买入成本、控制投资风险。

(4)交易执行:中央交易室负责具体的交易执行,同时履行一线监控的职责。

(5)绩效评估:量化投资部定期和不定期对基金进行投资绩效评估,并提供相关报告。绩效评估能够确认组合是否实现了投资预期、组合误差的来源及投资策略成功与否,基金经理可以据此检讨投资策略,进而调整投资组合。

(6)组合监控与调整:基金经理将跟踪目标ETF申购赎回清单特征、二级市场交易特征及标的指数变动,结合成份股基本面情况、成份股公司行为、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况以及组合投资绩效评估的结果等,采取适当的跟踪技术对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

基金管理人在确保基金份额持有人利益的前提下有权根据环境变化和实际需要对上述投资管理程序做出调整,并在基金招募说明书更新中公告。

九、基金的业绩比较标准

本基金的业绩比较基准为:标的指数收益率×95%+银行活期存款税后收益率×5%。

本基金标的指数更换后,业绩比较基准随之变更,基金管理人可根据需要替换或删除基金名称中与原标的指数相关的商号或字样。

十、基金的风险收益特征

本基金属ETF联接基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金,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,相当于股票基金中风险较高,预期收益较高的品种。

十一、基金投资组合报告

本基金管理人的董事会及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责任。

本基金托管人中国农业银行根据本基金合同规定,于2013年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本投资组合报告期为2013年4月1日至2013年6月30日,所载财务数据未经审计师审计。

1、报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	531,550.92	0.97
	其中:股票	531,550.92	0.97
2	基金投资	50,652,717.50	92.72
3	固定收益投资	2,998,500.00	5.49
	其中:债券	2,998,500.00	5.49
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	296,499.12	0.54
7	其他各项资产	151,294.08	0.28
8	合计	54,630,561.62	100.00

2、期末投资目标基金明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	交银施罗德基金管理有限公司	50,652,717.50	93.26

3、报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	13,994.77	0.03
C	制造业	296,555.53	0.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	58,784.65	0.11
E	建筑业	1,190.16	0.00
F	批发和零售业	12,241.20	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	3,023.29	0.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,214.00	0.01
J	金融业	47,531.18	0.09
K	房地产业	86,150.38	0.16
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,865.76	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	531,550.92	0.98

4、报告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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	4,900	98,196.00	0.18
2	000002	万科A	3,886	38,277.10	0.07
3	002142	宁波银行	3,500	29,645.00	0.05
4	002570	贝因美	1,000	27,950.00	0.05
5	000651	格力电器	982	24,608.92	0.05
6	000598	兴蓉投资	5,100	24,531.00	0.05
7	000001	平安银行	1,794	17,886.18	0.03
8	000690	宝新能源	3,512	16,401.04	0.03
9	000600	建投能源	3,527	14,354.89	0.03
10	000338	潍柴动力	609	10,