深证300价值交易型开放式指数证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:二〇一五年十月二十七日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银深证300价值ETF
场内简称	深价值
基金主代码	159913
交易代码	159913
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月22日
报告期末基金份额总额	34,329,693份
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	本基金绝大部分资产采用完全复制法,跟踪深证300价值价格指数,以完全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,进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时,或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,或因某些特殊情况导致流动性不足时,或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	深证300价值价格指数
风险收益特征	本基金属于股票基金,风险与预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金,同时本基金为指数型基金,具有与标的指数,以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-3,074,107.28
2.本期利润	-17,861,520.22
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5251
4.期末基金资产净值	42,218,523.44
5.期末基金份额净值	1.230

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

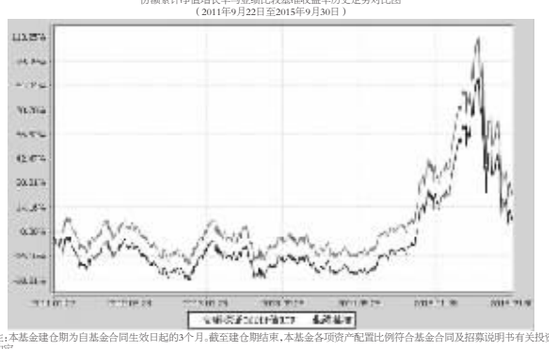
3.2 基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-32.42%	3.54%	-33.55%	3.59%	1.13%	-0.05%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2011年9月22日至2015年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的3个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
蔡铮	交银环球精选混合(QDII)、交银上证180公司治理ETF及其联接、交银深证300价值ETF及其联接、交银全球资源混合(QDII)、交银国证新能源指数分级、交银中证海外中国互联网指数(QDII-LOF)、交银中证互联网金融指数分级、交银中证环境治理指数分级的基金经理,公司量化投资部助理总经理	2012-12-27	-	6年	蔡铮先生,复旦大学电子工程硕士。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日至2015年6月30日担任交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金基金经理。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,对于交易所公开竞价交易,遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年第三季度,国内经济增速面临稳,内需疲软,经济基本面对资本市场的支持力度较为有限。工业增加值和PPI继续回落,经济增长和企业盈利下行压力较大,同时货币政策延续宽松。随着监管层扩大洒埋配资范围以及人民币贬值影响,市场出现大幅下跌。作为跟踪基准指数的指数基金,在第三季度基金总体呈现出下跌走势。

展望第四季度,宽松的货币政策环境有望持续,但经过此轮调整,市场风险偏好会急剧下降。总体而言,预计产业创新的发展思路不会改变,但面因素逐渐被市场所消化反应,因此对A股市场保持谨慎乐观的态度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.230元,本报告期份额净值增长率为-32.42%,同期业绩比较基准增长率为-33.55%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

截至本报告期末,本基金已经连续二十个工作日以上出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 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	41,380,200.95	97.57
	其中:股票	41,380,200.95	97.57
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	1,026,291.44	2.42
7	其他资产	4,428.66	0.01
8	合计	42,410,921.05	100.00

注:本表权益投资股票项中含可退替代款估值增值,而5.2.2合计项中不含可退替代款估值增值,因此二者存在上述差异。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2 指数投资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	580,748.35	1.38
C	制造业	25,538,105.53	60.49
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,037,294.35	4.83
E	建筑业	283,114.00	0.67
F	批发和零售业	258,481.48	0.61
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	163,593.50	0.39
J	金融业	4,981,898.32	11.80
K	房地产业	6,194,955.44	14.67
L	租赁和商务服务业	666,744.84	1.58
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	675,265.14	1.60
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	41,380,200.95	98.01

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小的股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资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	000002	万 科A	246,100	3,132,853.00	7.42
2	000651	格力电器	132,074	2,136,957.32	5.06
3	000001	平安银行	181,795	1,907,029.55	4.52
4	000725	京东方A	678,285	1,892,415.15	4.48
5	000333	美的集团	58,858	1,484,987.34	3.52
6	000858	五 粮 液	50,826	1,307,752.98	3.10
7	002415	海康威视	34,500	1,124,010.00	2.66
8	000776	广发证券	83,600	1,095,160.00	2.59
9	000024	招商地产	33,600	957,264.00	2.27
10	000783	长江证券	100,319	929,957.13	2.20

5.3.2 报告期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	4,208.84
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	219.82
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,428.66

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000858	五 粮 液	1,307,752.98	3.10	重大事项

5.11.5.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	23,329,693
本报告期期间基金总申购份额	398,000,000
减:本报告期期间基金总赎回份额	387,000,000
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	34,329,693

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投等。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、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;
2、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金合同》;
3、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》;
4、《深证300价值交易型开放式指数证券投资基金托管协议》;
5、关于申请募集深证300价值交易型开放式指数证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内深证300价值交易型开放式指数证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

8.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所。

8.3 查阅方式
投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com、www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jyshd.com。

交银施罗德成长30混合型证券投资基金

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

基金管理人:交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:二〇一五年十月二十七日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银成长30混合	
基金主代码	519727	
交易代码	519727(前端)	519728(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2013年6月5日	
报告期末基金份额总额	78,998,262.12份	
投资目标	本基金属于成长型混合型基金,主要通过投资于不超过30只精选的成长型上市公司股票,在适度控制风险并保持基金资产良好流动性的前提下,为基金份额持有人谋求长期、稳定的资本增值。	
投资策略	本基金充分发挥基金管理人的研究优势,将严谨、规范化的选股方法与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行和行业景气变化以及上市公司成长潜力的基础上,精选业务聚焦型、在所属行业内数一数二的成长型上市公司股票,并通过持有不超过30只股票的集中持股策略,为基金资产谋求长期稳健增值。	
业绩比较基准	75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只混合型基金,以成长型股票为主要投资对象,其风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。属于承担较高风险、预期收益较高的证券投资基金品种。	
基金管理人	交银施罗德基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	3,916,791.23
2.本期利润	-40,584,422.32
3.加权平均基金份额本期利润	-0.5149
4.期末基金资产净值	105,385,428.66
5.期末基金份额净值	1.334

注:1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后的实际收益水平要低于所列数字;
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

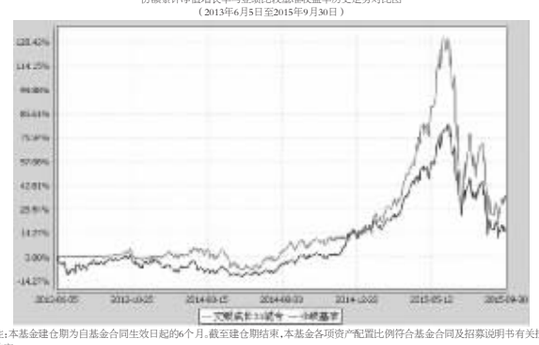
3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-25.31%	3.90%	-23.50%	2.72%	-1.81%	1.18%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

交银施罗德成长30混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年6月5日至2015年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的6个月。截至建仓期结束,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书有关投资比例的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王少成	交银成长混合、交银成长30混合的基金经理,公司权益投资总监	2013-07-02	-	11年	王少成先生,复旦大学硕士学历。历任上海融昌资产管理公司研究员,中原证券投资经理,信诚基金管理有限公司研究总监助理,东吴基金管理有限公司投资经理、基金经理、投资部副总经理。其中2010年9月至2012年10月担任东吴新创业股票型证券投资基金基金经理,2011年2月至2012年11月担任东吴中证新兴产业指数证券投资基金基金经理,2011年5月至2012年11月担任东吴价值成长双动力股票型证券投资基金基金经理。2012年加入交银施罗德基金管理有限公司,历任公司权益部副总经理。2013年3月21日至2015年8月14日担任交银施罗德先进制造混合型证券投资基金(原交银施罗德先进制造股票证券投资基金)基金经理,2013年5月29日至2015年8月14日担任交银施罗德先锋股票证券投资基金(原交银施罗德先锋股票证券投资基金)基金经理。

注:基金经理(或基金经理小组)期后变动(如有)敬请关注基金管理人发布的相关公告。

4.2 管理人对投资期内本基金运作遵规守信情况的说明

在报告期内,本基金管理人严格遵循了《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同和其他相关法律法规的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的规定,为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本公司制定了严格的投资控制制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有资产组合,包括证券投资基金和特定客户资产管理专户均严格遵循制度进行公平交易。

公司建立资源共享的投资研究信息平台,确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司在交易执行环节实行集中交易制度,建立公平的交易分配制度,对于交易所公开竞价交易,遵循"时间优先、价格优先、比例分配"的原则,全部通过交易系统进行比例分配;对于非集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循"价格优先、比例分配"的原则按事前独立确定的投资方案对交易结果进行分配。

公司中央交易室和风险管理部进行日常投资交易行为监控,风险管理部负责对各账户公平交易进行事后分析,于每季度和每年度分别对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异以及不同时间窗口同向交易的交易价差进行分析,通过分析评估和信息披露来加强对公平交易过程和结果的监督。

报告期内本公司严格执行公平交易制度,公平对待旗下各投资组合,未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内,本公司管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量没有超过该证券当日总成交量5%的情形,本基金与本公司管理的其他投资组合在不同时间窗下(如日内、3日内、5日内)同向交易的交易价差未出现异常。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2015年三季度A股市场再次经历了快速回调。在美元升值周期背景下,全球资金出现系统性的从新兴市场到发达国家市场再配置过程。在中国汇率改革的刺激下,8月国内资本外流的压力陡然增加,在中国政府的强力干预下,9月份外流量有所下降,但依然处于历史同期较高水平。对于发达经济体来说,宽松货币政策对促增长的边际效果持续下降,多年宽松货币政策在各个市场层面聚动的资产价格泡沫如何持续成为一个显性的问题;对于新兴市场国家来说,各层面的脆弱性在如何应对当下显著增加的波动性方面成为一个现实的挑战。

本基金三季度保持在低仓位运行,操作上进行了结构性的微调,增持了部分国企改革和贸气程度较高的新兴行业个股。

展望四季度,A股或将经历显著的筑底过程。在摆脱汇率约束后,由于国内宏观经济内生增长动力不足,持续的财政和货币政策放松可能是一个必然的选择。实际的效果需要持续观察,目前的经济状况,存在持续倒逼改革的可能性。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2015年9月30日,本基金份额净值为1.334元,本报告期份额净值增长率为-25.31%,同期业绩比较基准增长率为-23.50%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内无需预警说明。

§5投资组合报告

5.1 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	72,668,835.65	68.64
	其中:股票	72,668,835.65	68.64
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
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	33,130,229.23	31.29
7	其他资产	67,942.82	0.06
8	合计	105,867,007.70	100.00

5.2 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	-	-
C	制造业	47,075,949.83	44.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,271,696.38	3.10
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,566,393.08	3.38
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	2,241,864.00	2.13
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	14,512,525.00	13.77
R	文化、体育和娱乐业	2,000,407.36	1.90
S	综合	-	-
	合计	72,668,835.65	68.96

5.3 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	600763	通策医疗	196,780	14,512,525.00	13.77
2	600967	北方创业	924,712	13,140,157.52	12.47
3	600389	江山股份	511,215	10,157,842.05	9.64
4	300005	探路者	251,652	4,353,579.60	4.13
5	603555	贵人鸟	164,900	4,076,328.00	3.87
6	000061	农 产 品	248,876	3,566,393.08	3.38
7	002568	百润股份	76,476	3,074,335.20	2.92
8	002180	艾派克	71,800	2,584,800.00	2.45
9	300028	金亚科技	137,540	2,450,962.80	2.33
10	600687	刚泰控股	170,234	2,276,028.58	2.16

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细
本基金本报告期末未持有债券。

5.6 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。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明
本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查,在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。

5.11.2本基金投资的前十名股票中,没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	48,394.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	6,700.96
5	应收申购款	12,847.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	67,942.82

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600763	通策医疗	14,512,525.00	13.77	重大事项
2	600967	北方创业	13,140,157.52	12.47	重大事项
3	300028	金亚科技	2,450,962.80	2.33	重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分
由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	81,071,277.97
本报告期期间基金总申购份额	22,595,792.99
减:本报告期期间基金总赎回份额	24,668,808.84
本报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	-
报告期期末基金份额总额	78,998,262.12

注:1、如果本报告期间发生转换入、红利再投业务,则总申购份额中包含该业务;
2、如果本报告期间发生转换出业务,则总赎回份额中包含该业务。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期内未发生基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金管理人本报告期内未进行本基金的申购、赎回、红利再投。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《关于实施<公开募集证券投资基金运作管理办法>有关问题的规定》以及《公开募集证券投资基金运作管理办法》第三十条的规定"基金合同和基金招募说明书应当按照下列规定载明基金的类别:(一)百分之八十以上的基金资产投资于股票的,为股票基金;……(五)投资于股票、债券、货币市场工具或其他基金份额,并且股票投资、债券投资、基金投资的比例不符合第(一)项、第(二)项、第(四)项规定的,为混合基金;……",由于交银施罗德成长30股票型证券投资基金的基金投资比例已不符合《公开募集证券投资基金运作管理办法》中关于股票型基金的要求,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,本基金管理人决定自2015年8月8日起,调整本基金类型为混合型基金,基金名称变更为"交银施罗德成长30混合型证券投资基金",同时相应修改基金合同和托管协议相关表述,详情请见本基金管理人于2015年8月5日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金变更基金类别及修改基金名称并相应修改基金合同和托管协议的公告》。

2、鉴于交银施罗德成长30混合型证券投资基金的业绩比较基准的指数停止计算编制,本基金管理人根据基金合同的相关约定,经与基金托管人协商一致,并报中国证监会备案,决定自2015年10月1日起将交银施罗德成长30混合型证券投资基金的业绩比较基准由原"75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率"变更为"75%×富时中国A600成长指数收益率+25%×中证综合债券指数收益率",并相应修改基金合同的有关内容,详情请见本基金管理人于2015年9月28日发布的《交银施罗德基金管理有限公司关于旗下部分基金业绩比较基准变更并修改基金合同相关内容的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准交银施罗德成长30股票型证券投资基金募集的文件;
2、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金合同》;
3、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金招募说明书》;
4、《交银施罗德成长30混合型证券投资基金托管协议》;
5、关于募集交银施罗德成长30股票型证券投资基金之法律意见书;
6、基金管理人业务资格批件、营业执照;
7、基金托管人业务资格批件、营业执照;
8、报告期内交银施罗德成长30混合型证券投资基金在指定报刊上各项公告的原稿。

9.2 存放地点
备查文件存放于基金管理人的办公场所。

9.3 查阅方式
投资者可在办公时间内至基金管理人的办公场所免费查阅备查文件,或者登录基金管理人的网站(www.fund001.com、www.bocomschroder.com)查阅。在支付工本费后,投资者可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。
投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人交银施罗德基金管理有限公司。本公司客户服务中心电话:400-700-5000(免长途话费),021-61055000,电子邮件:services@jyshd.com。

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

2015 第三季度 报告

2015年9月30日

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:二〇一五年十月二十七日

§1 重要提示

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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10月26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。

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。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

2.1基金基本情况

基金简称	交银深证300价值ETF联接	
基金主代码	519706	
交易代码	519706(前端)	519707(后端)
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年9月28日	
报告期末基金份额总额	34,794,182.93份	
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。	
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中申购赎回的前提下,更好地实现跟踪标的指数的投资目标。	
业绩比较基准	深证300价值价格指数收益率x95%+银行活期存款税后收益率x5%	
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。	
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	

2.1.1目标基金基本情况

基金名称	深证300价值交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159913
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2011年9月22日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011年10月25日
基金管理人名称	交银施罗德基金管理有限公司
基金托管人名称	中国农业银行股份有限公司

2.1.2目标基金产品说明

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	本基金绝