

深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金(更新)招募说明书摘要(2016 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

二〇一六年九月

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】

深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金（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 22 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：市场风险、标的指数回报与股票市场平均回报偏离的风险、标的指数波动的风险以及基金投资组合回报与标的指数回报偏离的风险，基金份额二级市场交易价格折溢价的风险，基金的退市风险，投资者申购、赎回失败的风险以及基金份额赎回对价的变现风险等等。

本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、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。

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。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 2016 年 9 月 22 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2016 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（裙）

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 8 号国金中心二期 21-22 楼

邮政编码：200120

法定代表人：于亚利

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：何万金

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]128 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

于亚利女士，董事长，硕士学位。现任交通银行执行董事、副行长。历任交通银

行郑州分行财务会计处处长、郑州分行副行长，交通银行财务会计部副总经理、总经理，交通银行预算财务部总经理，交通银行首席财务官。

陈朝灯先生，副董事长，博士学位。现任施罗德证券投资信托股份有限公司投资总监兼专户管理部主管。历任复华证券投资信托股份有限公司专户投资经理，景顺证券投资信托股份有限公司部门主管、投资总监。

阮红女士，董事，总经理，博士学位，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事长。历任交通银行办公室副处长、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，交通银行投资管理部总经理。

徐瀚先生，董事，硕士学位。现任交通银行个人金融业务部总经理。历任交通银行香港分行电脑中心副总经理，交通银行信息技术部副总经理，交通银行太平洋信用卡中心副首席执行官、首席执行官。

孙培基先生，董事，学士学位。现任交通银行风险管理部副总经理。历任交通银行财会部副处长，交通银行董事会办公室副处长、处长，交通银行预算财务部高级经理，交通银行海南分行副行长，交通银行审计部副总经理。

孟方德先生，董事，硕士学位。现任施罗德投资管理有限公司亚太区总裁。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。

谢丹阳先生，独立董事，博士学位。现任武汉大学经济与管理学院院长、香港科技大学经济系教授。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、瑞安经管中心主任。

袁志刚先生，独立董事，博士学位。现任复旦大学经济学院教授。历任复旦大学经济学院副教授、教授、经济系系主任、经济学院院长。

周林先生，独立董事，博士学位。现任上海交通大学安泰经济与管理学院院长、教授。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。

2、基金管理人监事会成员

王忆军先生，监事长，硕士学位。现任交通银行战略投资部总经理。历任交通银

行办公室副处长，交通银行公司业务部副处长、高级经理、总经理助理、副总经理，交通银行投资银行部副总经理，交通银行江苏分行副行长。

裴关淑仪女士，监事，双硕士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司助理总经理、交银施罗德资产管理（香港）有限公司总经理。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。

张玲菡女士，监事、学士学位。现任交银施罗德基金管理有限公司市场总监。历任中国银行福州分行客户经理，新华人寿保险公司上海分公司区域经理，银河基金管理有限公司市场部渠道经理，交银施罗德基金管理有限公司渠道经理、渠道部副总经理、广州分公司副总经理、营销管理部总经理。

3、基金管理人高级管理人员

阮红女士，总经理。简历同上。

许珊燕女士，副总经理，硕士学历，高级经济师，兼任交银施罗德资产管理有限公司董事。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。

夏华龙先生，副总经理，博士学历。历任中国地质大学经济管理系教师、经济学院教研室副主任、主任、经济学院副院长；交通银行资产托管部副处长、处长、高级经理、副总经理；交通银行资产托管业务中心副总裁；云南省曲靖市市委常委、副市长（挂职）。

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。

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。

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。7年证券从业经验。2007年7月起在瑞士银行香港分行工作。2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，曾任投资研究部数量分析师，现任量化投资部副总经理。2011年3月7日至2012年

12月26日担任上证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基金经理助理，2011年9月22日至2012年12月26日担任深证300价值交易型开放式指数证券投资基金基金经理助理，2011年9月28日至2012年12月26日担任交银施罗德深证300价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理助理，2012年11月7日至2012年12月26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，2012年12月27日起担任上证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、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基金经理至今，2015年3月26日起担任交银施罗德德国证新能源指数分级证券投资基金基金经理至今，2015年4月22日起担任交银施罗德全球精选价值证券投资基金基金经理至今，2015年4月22日起担任交银施罗德全球自然资源证券投资基金基金经理至今，2015年5月27日起担任交银施罗德中证海外中国互联网指数型证券投资基金(LOF)基金经理至今，2015年6月26日起担任交银施罗德中证互联网金融指数分级证券投资基金基金经理至今，2015年8月13日起至2016年7月18日担任基金转型前的交银施罗德中证环境治理指数分级证券投资基金基金经理，2016年7月19日起担任交银施罗德中证环境治理指数型证券投资基金(LOF)基金经理至今。

历任基金经理

屈乐伟先生，2011年9月22日至2013年3月29日任本基金基金经理。

5、投资决策委员会成员

委员：阮红（总经理）

王少成（权益投资总监、基金经理）

齐皓（跨境投资总监、投资经理）

于海颖（固定收益投资总监）

张鸿羽（研究部总经理）

上述人员之间无近亲属关系。上述各项人员信息更新截止日为2016年9月22日，期后变动（如有）敬请关注基金管理人发布的相关公告。

二、基金托管人

（一）基金托管人情况

1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（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：周慕冰

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

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“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。自 2010 年起中国农业银行连续通过托管业务国际内控标准 (ISAE3402) 认证, 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”。2013 年至 2015 年连续获得中国债券市场“优秀托管机构奖”, 2015 年被中国

银行业协会授予“养老金业务最佳发展奖”。

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，2014年更名为托管业务部/养老金管理中心，内设综合管理处、证券投资基金托管处、委托资产托管处、境外资产托管处、保险资产托管处、风险管理处、技术保障处、营运中心、市场营销处、内控监管处、账户管理处，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140余名，其中具有高级职称的专家30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

截止到2016年6月30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342只。

（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、申购赎回代理券商（简称“一级交易商”）

（1）光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闻路 1508 号

办公地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

电话：（021）22169999

传真：（021）22169134

联系人：刘晨

客户服务电话：10108998

网址：www.ebscn.com

（2）国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 层

法定代表人：万建华

电话：（021）38676161

传真：（021）38670161

联系人：芮敏棋

客户服务电话：95521，400-8888-666

网址：www.gtja.com

（3）中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：（010）85130588

传真：（010）65182261

联系人：魏明

客户服务电话：4008-888-108

网址：www.csc108.com

（4）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

（5）中国银河证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

办公地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：陈有安

电话：（010）66568292

联系人：邓颜

客户服务电话：400-888-8888

网址：www.chinastock.com.cn

（6）招商证券股份有限公司

住所：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

办公地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

电话：（0755）82943666

传真：（0755）82943636

联系人：黄健

客户服务电话：400-8888-111，95565

网址: www.newone.com.cn

(7) 兴业证券股份有限公司

住所: 福州市湖东路 268 号

办公地址: 上海市浦东民生路 1199 弄五道口广场 1 号楼 21 层

法定代表人: 兰荣

电话: (021) 38565785

传真: (021) 38565955

联系人: 谢高得

客户服务电话: 400-8888-123

网址: www.xyzq.com.cn

(8) 申万宏源证券有限公司

住所: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号世纪商贸广场 45 层

法定代表人: 李梅

电话: (021) 33389888

联系人: 李清怡

客户服务电话: 95523 或 4008895523

网址: www.sywg.com

(9) 国都证券股份有限公司

住所: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

办公地址: 北京市东城区东直门南大街 3 号国华投资大厦 9 层 10 层

法定代表人: 常喆

客户服务电话: 400-818-8118

网址: www.guodu.com

(10) 华泰证券股份有限公司

住所: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

办公地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人: 吴万善

电话: (025) 83290979

传真: (025) 51863323

联系人: 万鸣

客户服务电话: 95597

网址: www.htsc.com.cn

(11) 中银国际证券有限责任公司

住所：上海市银城中路 200 号 39 层

办公地址：中国上海浦东银城中路 200 号中银大厦 39-40 层

法定代表人：许刚

联系人：李丹

客户服务电话：400-620-8888

网址：www.bocichina.com

(12) 中信证券（山东）有限责任公司

住所：青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507—1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：（0532）85022326

传真：（0532）85022605

联系人：吴忠超

客户服务电话：（0532）96577

网址：www.zxwt.com.cn

(13) 国信证券股份有限公司

住所：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼

办公地址：深圳市罗湖区红岭中路 1012 号国信证券大厦 16-26 楼

法定代表人：何如

电话：（0755）82130833

传真：（0755）82133952

联系人：周杨

客户服务电话：95536

网址：www.guosen.com.cn

(14) 安信证券股份有限公司

住所：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

办公地址：深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

电话：（0755）82558305

传真：（0755）82558355

联系人：陈剑虹

客户服务电话：400-800-1001

网址: www.essence.com.cn

(15) 申万宏源西部证券有限公司

住所: 新疆乌鲁木齐市建设路2号

办公地址: 北京市西城区太平桥大街19号宏源证券

法定代表人: 冯戎

电话: (010) 88085858

传真: (010) 88085195

联系人: 李巍

客户服务电话: 4008-000-562

网址: www.hysec.com

(16) 中泰证券股份有限公司

住所: 山东省济南市市中区经七路86号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路86号

法定代表人: 李玮

电话: (0531) 68889155

传真: (0531) 68889752

联系人: 吴阳

客户服务电话: 95538

网址: www.qlzq.com.cn

(17) 平安证券有限责任公司

住所: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼

办公地址: 深圳市福田区金田路大中华国际交易广场裙楼8楼(518048)

法定代表人: 杨宇翔

电话: (0755) 22627802

传真: (0755) 82400862

联系人: 郑舒丽

客户服务电话: 95511-8

网址: www.pingan.com

(18) 华宝证券有限责任公司

住所: 中国上海市陆家嘴环路166号未来资产大厦27楼

办公地址: 中国上海市浦东新区世纪大道100号上海环球金融中心57楼

法定代表人: 陈林

电话: (021) 68777222

传真：（021）68777822

联系人：赵洁

客户服务电话：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

（19）国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街95号

办公地址：成都市东城根上街95号

法定代表人：冉云

电话：（028）86690126

传真：（028）86690126

联系人：金喆

客户服务电话：400-6600-109

网址：www.gjzq.com.cn

（20）方正证券股份有限公司

住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

办公地址：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层

法定代表人：雷杰

电话：（010）68546765

传真：（010）68546792

联系人：徐锦福

客户服务电话：95571

网址：www.foundersc.com

（21）渤海证券股份有限公司

住所：天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室

办公地址：天津市南开区滨水西道8号

法定代表人：王春峰

电话：（022）28451991

传真：（022）28451892

联系人：蔡霆

客户服务电话：400-651-5988

网址：www.bhzq.com

（22）信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

办公地址：北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人：高冠江

电话：（010）63081000

传真：（010）63080978

联系人：唐静

客户服务电话：95321

网址：www.cindasc.com

（23） 东方证券股份有限公司

住所：上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人：王益民

电话：（021）63325888

传真：（021）63326173

联系人：吴宇

客户服务电话：95503

网址：www.dfzq.com.cn

（24） 东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座12-15层

法定代表人：徐勇力

电话：（010）66555316

传真：（010）66555246

联系人：汤漫川

客户服务电话：400-8888-993

网址：www.dxzq.net

（25） 华福证券有限责任公司

住所：福州市五四路157号新天地大厦7、8层

办公地址：福州市五四路新天地大厦7至10层

法定代表人：黄金琳

电话：（0591）87383623

传真：（0591）87383610

客户服务电话：（0591）96326

网址：www.hfzq.com.cn

（26） 中国中投证券有限责任公司

住所：深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及第

04层 01. 02. 03. 05. 11. 12. 13. 15. 16. 18. 19. 20. 21. 22. 23 单元

办公地址：深圳市福田区益田路 6003 号荣超商务中心 A 栋第 04、18 层至 21 层

法定代表人：龙增来

电话：（0755）82023442

传真：（0755）82026539

联系人：刘毅

客户服务电话：400-600-8008

网址：www.china-invs.cn

（27）中原证券股份有限公司

住所：郑州市郑东新区商务外环路 10 号

办公地址：郑州市郑东新区商务外环路 10 号中原广发金融大厦 17 层

法定代表人：菅明军

电话：（0371）69099882

传真：（0371）65585899

联系人：程月艳、范春艳

客户服务电话：（0371）967218，400-813-9666

网址：www.ccnew.com

（28）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

（29）国海证券股份有限公司

住所：广西桂林市辅星路 13 号

办公地址：深圳市福田区竹子林四路光大银行大厦 3 楼

法定代表人：张雅锋

电话：（0771）5550386

客户服务电话：95563

网址：www.ghzq.com.cn

2、二级市场交易代理券商

包括具有经纪业务资格及深圳证券交易所会员资格的所有证券公司。

3、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）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：周明

电话：（010）50938617

传真：（010）50938907

联系人：周莉

（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：俞卫锋

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

执行事务合伙人：李丹

联系电话：（021）23238888

传真：（021）23238800

联系人：沈兆杰

经办注册会计师：薛竞、沈兆杰

四、基金的名称

本基金名称：深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金

五、基金的类型

本基金类型：交易型开放式

六、基金的投资目标

紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

七、基金的投资方向

本基金以标的指数成份股、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，正常情况下指数化投资比例，即投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 95%。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）。

如因标的指数成份股调整、基金份额申购赎回清单内现金替代、现金差额等因素导致基金投资比例不符合上述标准的，基金管理人将在 10 个交易日内进行调整。法律法规或监管机构日后允许本基金投资其他品种，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。

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、调整决策以及每日申购赎回清单的编制决策。

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、投资流程

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、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，基金经理以完全复制指数成份股权重的方法构建组合。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、现券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、基金的业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为标的指数。

本基金的标的指数为深证 300 价值价格指数。深证 300 价值价格指数是由深圳证券信息公司编制，并以深证 300 指数为基础开发的风格指数，它以深证 300 指数的成份股为样本空间，选取采用价值因子评分最高的 100 只股票为指数的成份股，并于每年 1 月和 7 月对指数成份股进行调整。该指数的基期为 2004 年 12 月 31 日，基点为 1000 点。

如果指数编制单位变更或停止深证 300 价值价格指数的编制及发布，或深证 300 价值价格指数由其他指数替代，或由于指数编制方法等重大变更导致深证 300 价值价格指数不宜继续作为标的指数，或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时，本基金管理人可以依据维护基金份额持有人合法权益的原

则，在履行适当的程序后，变更本基金的标的指数。

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。

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2016年7月20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2016年4月1日起至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 41,029,150.34 97.51

其中：股票 41,029,150.34 97.51

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 1,047,710.98 2.49

7 其他资产 698.23 0.00

8 合计 42,077,559.55 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

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。

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	236,154.40	0.58
B	采矿业	765,273.72	1.86
C	制造业	21,722,858.26	52.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,226,550.73	2.99
E	建筑业	706,961.80	1.72
F	批发和零售业	310,040.00	0.75
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	--	--
J	金融业	6,496,217.38	15.82
K	房地产业	8,229,514.97	20.04
L	租赁和商务服务业	507,782.48	1.24
M	科学研究和技术服务业	--	--
N	水利、环境和公共设施管理业	425,433.60	1.04
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	402,363.00	0.98
S	综合	--	--
	合计	41,029,150.34	99.91

2.3 报告期末按行业分类的沪港通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过沪港通投资的股票。

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

(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	231,500	5,655,545.00	13.77
2	000651	格力电器	106,374	2,044,508.28	4.98
3	000333	美的集团	74,187	1,759,715.64	4.28
4	000001	平安银行	169,494	1,474,597.80	3.59

5	000858	五 粮 液	37,026	1,204,455.78	2.93
6	000725	京东方 A	508,685	1,175,062.35	2.86
7	000776	广发证券	60,300	1,010,628.00	2.46
8	000166	申万宏源	103,900	873,799.00	2.13
9	002415	海康威视	39,700	851,962.00	2.07
10	002304	洋河股份	10,838	779,468.96	1.90

(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。

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、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。

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
投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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。

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。

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。

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。

11、投资组合报告附注

(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。

(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。

(3) 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 503.19

- 2 应收证券清算款 -
- 3 应收股利 -
- 4 应收利息 195.04
- 5 应收申购款 -
- 6 其他应收款 -
- 7 待摊费用 -
- 8 其他 -
- 9 合计 698.23

(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) 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 000002 万 科 A 5,655,545.00 13.77 重大事项
- 2 000651 格力电器 2,044,508.28 4.98 重大事项

(6) 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。

(7) 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。

十二、基金的业绩

基金业绩截止日为 2016 年 6 月 30 日，所载财务数据未经审计师审计。

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资人在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

1、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 -0.15% 1.07% -0.91% 1.16% 0.76% -0.09%

2016 年度上半年 -13.43% 1.87% -14.62% 2.01% 1.19% -0.14%

2015 年度 15.34% 2.56% 15.63% 2.60% -0.29% -0.04%

2014 年度 45.96% 1.25% 44.92% 1.26% 1.04% -0.01%

2013 年度 -2.82% 1.50% -3.33% 1.50% 0.51% 0.00%

2012 年度 5.05% 1.40% 4.91% 1.40% 0.14% 0.00%

2011 年度（自基金合同生效日起至 2011 年 12 月 31 日） -9.00% 1.13% -19.19%

1.49% 10.19% -0.36%

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 2016 年 6 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。

十三、基金的费用与税收

（一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金合同生效后的信息披露费用；
- 4、标的指数使用许可费；
- 5、基金上市费及年费；
- 6、基金收益分配中发生的费用；
- 7、基金份额持有人大会费用；
- 8、基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- 9、基金的证券交易费用；
- 10、基金财产拨划支付的银行费用；
- 11、按照国家有关规定可以在基金财产中列支的其他费用。

（二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值 0.5% 的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划

付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(2) 基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为0.1%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

(3) 标的指数使用许可费

在通常情况下，基金标的指数使用许可费按前一日基金资产净值0.03%的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{标的指数使用许可费年费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金标的指数使用许可费

E为前一日基金资产净值

根据基金管理人与标的指数供应商签订的相应指数许可协议的规定，本基金标的指数使用许可费年费率为0.03%。基金合同生效之日所在季度的标的指数使用许可费，按实际计提金额收取，不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一季度起，标的指数使用许可费收取下限为每季度5万元，不足5万元时按照5万元收取。

自基金合同生效日起，基金标的指数使用许可费每日计提，逐日累计，按季支付，由基金管理人向基金托管人发送基金标的指数使用许可费划付指令，经基金托管人复核后从基金财产中一次性支付，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。如果标的指数供应商根据相应指数许可协议变更上述标的指数使用许可费费率和计费方式，本基金将采用调整后的方法或费率计算标的指数使用许可费，基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率和计费方式实施日前2日在指定媒体上刊登公告。

(4) 上述“(一) 基金费用的种类”中第3、5到11项费用由基金托管人根据其有法律法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基金费用。

2、与基金销售有关的费用

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。

(三) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金募集期间所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付，基金收取认购费的，可以从认购费中列支。

(四) 基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须依照有关规定最迟于新的费率实施日前在指定媒体上刊登公告。

(五) 基金税收

基金和基金份额持有人根据国家法律法规的规定，履行纳税义务。

十四、对招募说明书更新部分的说明

总体更新

本基金管理人依据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》、《信息披露办法》及其它有关法律法规的要求,对本基金的原招募说明书进行了更新,主要更新的内容如下:

- (一) 更新了“重要提示”中相关内容。
- (二) 更新了“三、基金管理人”中相关内容。
- (三) 更新了“四、基金托管人”中相关内容。
- (四) 更新了“五、相关服务机构”中相关内容。
- (五) 更新了“九、基金份额的申购与赎回”中相关内容。
- (六) 更新了“十、基金的投资”中“基金投资组合报告”相关内容，数据截止

到 2016 年 6 月 30 日。

（七）更新了“十一、基金的业绩”中相关内容，数据截止到 2016 年 6 月 30 日。

（八）更新了“二十一、托管协议的内容摘要”中的相关内容。

（九）更新了“二十三、其他应披露事项”中的相关内容。

交银施罗德基金管理有限公司

二〇一六年十一月五日