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 2019 年第 3 季度报告 2019 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:二〇一九年十月二十二日

§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 2019 年 10 月 21 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2019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

2.1 全立至平月儿			
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	41,706,801.66 份		
机次日标	紧密跟踪标的指数,追求路	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小	
投资目标	化。		
	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		
+几次 左mb	于基金资产净值的90%,其余资产可投资于标的指数		
投资策略 	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。		
业绩比较基准	深证 300 价值价格指数收益率×95%+银行活期存款		

	税后收益率×5%
	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,
风险收益特征	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			
	本基金属于股票基金,风险与预期收益高于混合基金、			
风险收益特征	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。			

§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(2019年7月1日-2019年9月30日)
1.本期已实现收益	1,654,941.71
2.本期利润	712,489.96
3.加权平均基金份额本期利润	0.0161
4.期末基金资产净值	72,528,756.82
5.期末基金份额净值	1.739

- 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

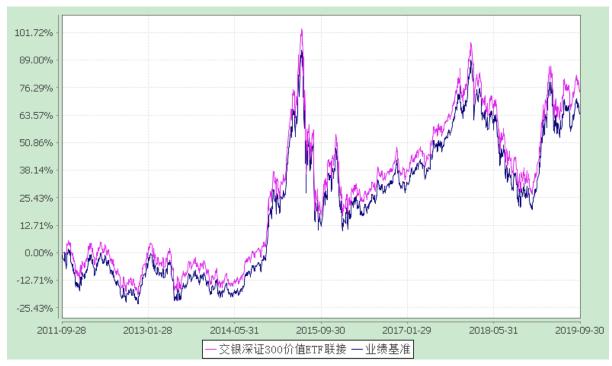
3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.75%	1.02%	-0.02%	1.04%	0.77%	-0.02%

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

交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接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28日至2019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

抽点	职务	任本基金的基	基金经理期限	证券从业 年限	说明
姓名	い分	任职日期	离任日期		<u></u> 近
蔡铮	交上 180 岩 E 及联交深 3价 E 及银证 0 岩 理 F 其 接银证 0 值 F 其	2012-12-27	-	10年	蔡铮先生,中国国籍, 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、量化投资部 理总经理、量化投资部 副总经理。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

		度报告
联接、		金基金经理,2015年
交银		4月22日至2017年
国证		3月24日担任交银施
新能		罗德环球精选价值证券
源指		投资基金基金经理,
数分		2015年4月22日至
级、		2017年3月24日担任
交银		交银施罗德全球自然资
中证		源证券投资基金基金经
海外		理, 2015年8月13日
中国		至 2016 年 7 月 18 日担
互联		任交银施罗德中证环境
网指		治理指数分级证券投资
数		基金基金经理。
(QD		
II-		
LOF)		
、交		
银中		
证互		
联网		
金融		
指数		
分级、		
交银		
中证		
环境		
治理		
指数		
(LO		
F) ,		
交银		
致远		
智投		
混合		
的基		
金经		
理,		
公司		
量化		
投资		
副总		
监兼		
多元		

资产			
管理			
副总			
监			

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管理人对报告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,基金整体运作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

2019年三季度国内宏观环境基本稳定,经济走势稳中偏弱,政策面支持力度加大。受需求端拖累和外部不确定性影响,国内制造业投资面临一定压力,但消费和基建的温和回暖为国内经济带来支撑。在此经济背景下,三季度A股市场延续震荡态势,估值水平基本稳定,市场风险偏好有所上升,科技类品种受到较强关注。作为跟踪基准指数的指数基金,三季度基金总体呈现震荡走势。

展望 2019 年四季度,我们认为宏观经济仍然面临一定压力,但随着政策和改革的推进,新兴产业作为经济增长新动力也将提速发展。四季度是国内宏观政策的重要时间窗口,预计针对内外部环境将会有更多稳增长政策出台。国内市场经历年初的火爆现已回归冷静,维持区间震荡,估值水平基本稳定,从中长期来看我们对 A 股市场仍维持谨慎乐观的看法。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本基金(各类)份额净值及业绩表现请见"3.1 主要财务指标"及"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"部分披露。

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

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	689,712.60	0.95
	其中: 股票	689,712.60	0.95
2	基金投资	66,807,465.00	91.83
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中: 买断式回购的买		
	入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金	4 206 070 77	5.90
/	合计	4,286,079.77	5.89
8	其他各项资产	967,588.71	1.33
9	合计	72,750,846.08	100.00

5.2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	66,807,46 5.00	92.11

5.3报告期末按行业分类的股票投资组合

5.3.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位: 人民币元

			三・ノマレマハトラビ
代码	行业类别	公允价值	占基金资产 净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,466.00	0.00
В	采矿业	4,574.00	0.01
C	制造业	501,436.60	0.69
D	电力、热力、燃气及水生产和 供应业	11,255.00	0.02
Е	建筑业	4,623.00	0.01
F	批发和零售业	12,558.00	0.02
G	交通运输、仓储和邮政业	4,645.00	0.01

Н	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	71,535.00	0.10
K	房地产业	74,472.00	0.10
L	租赁和商务服务业	2,148.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
О	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	689,712.60	0.95

5.3.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.4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	000651	格力电器	1,400	80,220.00	0.11
2	000333	美的集团	1,430	73,073.00	0.10
3	000858	五粮液	500	64,900.00	0.09
4	000001	平安银行	2,400	37,416.00	0.05
5	000002	万科 A	1,400	36,260.00	0.05
6	000725	京东方 A	7,500	28,125.00	0.04
7	002304	洋河股份	200	20,800.00	0.03
8	000568	泸州老窖	200	17,044.00	0.02
9	000338	潍柴动力	1,300	14,586.00	0.02
10	001979	招商蛇口	700	13,293.00	0.02

5.5 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。

- **5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细** 本基金本报告期末未持有债券。
- **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。
- **5.8 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贵金属投资明细** 本基金本报告期末未持有贵金属。
- **5.9 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。
- 5.10 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。

5.11 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。

5.12投资组合报告附注

- 5.12.1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。
- 5.12.2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。

5.12.3其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额		
1	存出保证金	7,994.33		
2	应收证券清算款	828,398.79		
3	应收股利	-		
4	应收利息	989.42		
5	应收申购款	130,206.17		

度报告

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	967,588.71

5.12.4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。

5.12.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 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	46,271,708.21
本报告期期间基金总申购份额	6,390,871.09
减:本报告期期间基金总赎回份额	10,955,777.64
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	41,706,801.66

- 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。

87 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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	13,122,703.41
本报告期买入/申购总份额	-
本报告期卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	13,122,703.41

报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例	21.46
(%)	31.46

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。

7.2 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情 况		
投资者 类别	序号	持有基金份额 比例达到或者 超过20%的时间 区间	期初份额	申购份额	赎回份 额	持有份额	份额占 比
机构	1	2019/7/1- 2019/9/30	13, 12 2, 703 . 41	ı	-	13, 122, 703 . 41	31. 46%
产品特有风险							

本基金本报告期内出现单一投资者持有基金份额比例超过基金总份额20%的情况。如 该类投资者集中赎回,可能会对本基金带来流动性冲击,从而影响基金的投资运作和 收益水平。基金管理人将加强流动性管理,防范相关风险,保护持有人利益。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接 基金募集的文件:
 - 2、《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合同》
- 3、《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招募说明 书》:
 - 4、《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托管协议》
 - 5、关于申请募集交银施罗德深证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深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金在 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)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@jysld.com。