

## 深证300价值交易型开放式指数证券投资基金

## [2012] 第二季度报告

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:二〇一二年七月十八日

重要提示

基金管理人的董事会及监事会在报告期间不存在虚假记载、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约定,于2012年7月17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。

基金经理人承认并承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,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。

本基金报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年4月1日起至6月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称:交银施罗德深证300价值ETF

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:109,329,692份

报告期基金资产净值:109,329,692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:本基金主要通过股票投资来实现投资目标。股票投资组合由股票投资组合和现金投资组合两部分组成。股票投资组合根据指数成分股及其权重的变动而进行被动式调整,当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、送股时,基金管理人将根据指数编制规则对股票投资组合进行适当变通和调整,从而更灵活地跟踪标的指数。基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整,但不得导致基金的投资组合不符合标的指数的构成特征,并可能影响基金的收益和风险特性。

业绩比较基准:深证300价值指数

风险收益特征:本基金属于股票型基金,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

注:本基金场内简称称为“深证300”。

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2012年4月1日-2012年6月30日)

1.本期已实现收益 445,110.46

2.本期利润 493,923.51

3.加权平均基金份额本期利润 0.0056

4.期末基金份额净值 106,554,341.13

5.期末基金份额净值 0.975

注:1.上表基金业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。

3.2.1本期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 2.09% 1.72% 1.23% 0.37% -0.01%

## 3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率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2012年6月30日)

注:本基金合同生效日为2011年9月22日,基金合同生效日至报告期末,本基金运作时间未满一年。本基金合同期间为基金份额生效之日起的3个月。截至建仓期结束及本报告期末,本基金各项资产配置比例符合基金合同及招募说明书中有关投资比例的约定。

## § 4 管理人报告

## 4.1 基金经理(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

屈乐伟 基金基金经理、深证300价值ETF联接基金经理、银行理财产品及专户理财基金经理 2011-9-22 - 16年 银行理财产品及专户理财基金经理,屈乐伟先生,数理系硕士,历任广发证券北京业务总部研发部经理,投资部经理,华商基金管理有限公司基金经理助理,基金经理,华商基金管理有限公司基金经理助理,以及上证SOFEET基金经理助理,2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。

4.2 管理人报告期内本基金运作合规情况的说明

在报告期内,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的规定,并本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,基金投资管理符合有关法律法规和基金合同的有关规定,基金持有人取得了最大利益。

4.3 公平交易制度执行情况

本公司制定了公平交易制度和公平交易监控制度来保证旗下基金运作的公平,旗下所管理的所有组合,包括本基金在内的所有组合均严格执行公平交易制度。

本公司建立投资研究信息共享平台,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有公平的平台。公司在交易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;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;对于集中竞价交易,以公司名义进行的场外交易,遵循“价格优先、比例优先、公平分配”的原则;对于大宗交易,以公司名义进行的大宗交易,遵循“价格优先、比例优先、公平分配”的原则;对于柜台交易,遵循“价格优先、比例优先”的原则;对于场内大宗交易,遵循“价格优先、公平分配”的原则;对于柜台交易,遵循“价格优先”的原则。

4.4 报告期内本基金未发现不公平交易行为。

本基金2012年6月30日,本期份额净值为0.975元,本期份额净值增长率为-2.09%,同期业绩比较基准增长率为-1.72%。本期报告期份额净值偏差度为0.04%,跟踪误差为0.05%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场运行趋势的简要展望

上半年我国经济增速将明显回落,预计下半年经济形势依然严峻,货币政策将加强对外汇市场的干预和减持压力依然成为制约市场的最重要因素,预计下半年资金面不紧不松。在多空因素交织背景下

本基金报告期内严格执行公平交易制度,公平对待各投资组合,本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的收益差异将明显缩小。

4.6 报告期内本基金没有出现参与交易所公开竞价同日反向交易的情况。

本基金报告期内未发现不公平交易行为。报告期内本投资组合未出现参与交易所公开竞价同日反向交易,向交易所申报买卖的证券总量占该证券当年总成交量的比例未超过5%。

4.7 管理人报告期内本基金的估值政策和净值表现的说明

本基金报告期内未发现不公平交易行为。

4.8.5.1报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.2报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.3报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.4报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.5报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.6报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.7报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.8报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.9报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.10报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.11报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.12报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.13报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.14报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.15报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.16报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.17报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.18报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.19报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.20报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.21报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.22报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.23报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.24报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.25报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.26报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.27报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.28报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.29报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.30报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.31报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.32报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.33报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.34报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.35报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.36报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.37报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.38报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.39报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.40报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.41报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.42报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.43报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.44报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.45报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.46报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.47报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.48报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.49报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.50报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.51报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.52报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.53报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.54报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.55报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.56报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.57报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.58报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.59报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.60报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.61报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.62报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.63报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.64报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.65报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.66报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.67报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.68报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.69报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.70报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.71报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.72报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.73报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.74报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.75报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.76报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.77报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.78报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.79报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.80报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.81报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.82报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.83报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.84报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.85报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.86报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.87报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.88报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.89报告期本基金未发现有影响基金净值的重大事件。

4.8.5.90报告期本基金