

深证300价值交易型开放式指数证券投资基金

[2012] 第四季度报告

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:二〇一三年一月二十一日

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2013年1月18日复核了本报告中的财务数据，净值表现和资产组合报告等，保证本基金的信息真实、准确、完整。

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。

本报告期财务数据未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至12月31日止。

§ 1 基金产品概况

5.1 报告期末基金资产组合情况

举收复星线，市场顿时活跃起来。指数基金因其产品属性决定持仓权重较高，加之本基金的标的指数深市大盘价值型，恰与12月份市场热点相吻合，因此也成了12月表现较好的股票型基金之一。

4.5 报告期内基金份额表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.956元，本报告期份额净值增长率为10.14%，同期业绩比较基准增长率为10.52%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.04%，跟踪误差为0.05%。

5.2 投资组合报告

5.1.1 报告期末基金资产组合情况

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。

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.944元，本报告期份额净值增长率为2.06%，同期业绩比较基准增长率为2.07%。本报告期内本基金的日均跟踪偏离度为0.06%，跟踪误差为0.07%。

5.1.2 报告期末基金份额持有人户数统计

5.2.1 基金产品概况

5.2.2 报告期内基金资产组合情况

5.2.3 报告期内基金管理人运用基金资产买卖国债、金融债的说明

5.2.4 报告期内基金管理人通过港股通交易的股票情况

5.2.5 其他资产

5.2.6 报告期末持有的各类债券投资情况

5.2.7 报告期末持有的企业债情况

5.2.8 报告期末持有的可转换债券情况

5.2.9 报告期末持有的附权证债券情况

5.2.10 报告期末持有的资产支持证券情况

5.2.11 报告期末持有的买入返售金融资产情况

5.2.12 报告期末持有的长期股权投资情况

5.2.13 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.14 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

5.2.15 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

5.2.16 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

5.2.17 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

5.2.18 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.19 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.20 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.21 报告期末持有的其他负债情况

5.2.22 报告期末持有的其他资产情况

5.2.23 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.24 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.25 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.26 报告期末持有的其他负债情况

5.2.27 报告期末持有的其他资产情况

5.2.28 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.29 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.30 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.31 报告期末持有的其他负债情况

5.2.32 报告期末持有的其他资产情况

5.2.33 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.34 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.35 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.36 报告期末持有的其他负债情况

5.2.37 报告期末持有的其他资产情况

5.2.38 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.39 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.40 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.41 报告期末持有的其他负债情况

5.2.42 报告期末持有的其他资产情况

5.2.43 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.44 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.45 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.46 报告期末持有的其他负债情况

5.2.47 报告期末持有的其他资产情况

5.2.48 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.49 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.50 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.51 报告期末持有的其他负债情况

5.2.52 报告期末持有的其他资产情况

5.2.53 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.54 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.55 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.56 报告期末持有的其他负债情况

5.2.57 报告期末持有的其他资产情况

5.2.58 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.59 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.60 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.61 报告期末持有的其他负债情况

5.2.62 报告期末持有的其他资产情况

5.2.63 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.64 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.65 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.66 报告期末持有的其他负债情况

5.2.67 报告期末持有的其他资产情况

5.2.68 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.69 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.70 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.71 报告期末持有的其他负债情况

5.2.72 报告期末持有的其他资产情况

5.2.73 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.74 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.75 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.76 报告期末持有的其他负债情况

5.2.77 报告期末持有的其他资产情况

5.2.78 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.79 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.80 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.81 报告期末持有的其他负债情况

5.2.82 报告期末持有的其他资产情况

5.2.83 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.84 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.85 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.86 报告期末持有的其他负债情况

5.2.87 报告期末持有的其他资产情况

5.2.88 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.89 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.90 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.91 报告期末持有的其他负债情况

5.2.92 报告期末持有的其他资产情况

5.2.93 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.94 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.95 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.96 报告期末持有的其他负债情况

5.2.97 报告期末持有的其他资产情况

5.2.98 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.99 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.100 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.101 报告期末持有的其他负债情况

5.2.102 报告期末持有的其他资产情况

5.2.103 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.104 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.105 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.106 报告期末持有的其他负债情况

5.2.107 报告期末持有的其他资产情况

5.2.108 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.109 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.110 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.111 报告期末持有的其他负债情况

5.2.112 报告期末持有的其他资产情况

5.2.113 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.114 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.115 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.116 报告期末持有的其他负债情况

5.2.117 报告期末持有的其他资产情况

5.2.118 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.119 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.120 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.121 报告期末持有的其他负债情况

5.2.122 报告期末持有的其他资产情况

5.2.123 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.124 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.125 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.126 报告期末持有的其他负债情况

5.2.127 报告期末持有的其他资产情况

5.2.128 报告期末持有的其他金融工具情况

5.2.129 报告期末持有的其他类资产情况

5.2.130 报告期末持有的其他金融负债情况

5.2.131 报告期末持有的其他负债情况

5.2.132 报告期末持有的其他资产情况