交银施罗德先进制造股票证券投资基金

2012 第四季度 报告

2012年12月31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：二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银先进制造股票	
基金主代码	519704	
交易代码	519704（前端）	519705（后端）
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2011年6月22日	
报告期末基金份额总额	489,983,870.81份	
投资目标	本基金通过重点投资于与装备制造相关的优质企业，把握中国产业结构升级的投资机会，在控制风险并保持基金资产良好的流动性的前提下，力争实现基金资产的长期稳定增值。	
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，目下而上挖掘与装备制造相关的上市公司投资机会，以谋求良好收益。	
业绩比较基准	75%×中银万国装备制造指数收益率+25%×中信标普全债指数收益率	
风险收益特征	本基金是一只股票型基金，属于基金中的高风险品种，本基金的风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。	
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（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-4,620,166.56
2.本期利润	18,027,285.76
3.加权平均基金份额本期利润	0.0361
4.期末基金资产净值	422,354,744.25
5.期末基金份额净值	0.862

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

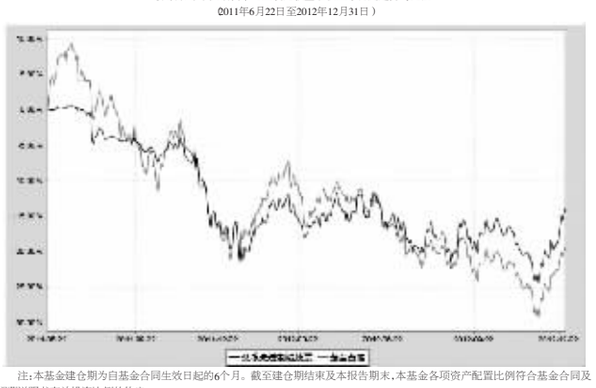
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	4.48%	1.03%	2.92%	1.06%	1.56%	-0.03%

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

交银施罗德先进制造股票证券投资基金

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6月22日至2012年12月31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		
张科兵	本基金的基金经理，交银施罗德稳健配置混合型证券投资基金基金经理、公司研究部总经理	2012-3-13	-	9年	张科兵先生，上海交通大学学士学历。历任安达信（上海）企业咨询有限公司审计部高级审计师，普华永道国际会计师事务所审计部项目经理，第一证券有限责任公司投资部投资经理，申万巴黎基金管理有限公司（现申万菱信基金管理有限公司）投资管理部高级研究员。2007年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任高级研究员、研究部副总经理。

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。

本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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率并未发现异常差异。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2012年四季度上证综指经历了10月和11月的持续下跌后于12月大幅报复性反弹。我们认为，驱动大盘10月和11月下跌的主要因素是，9月份工业增加值数据并不乐观，同时汇丰PMI显示经济复苏的迹象仍不明显，加之十八大维稳因素结束加剧了投资者对市场的恐慌。而驱动12月大盘报复性反弹的主要因素是，发电量开始持续向好，同时PMI回到荣枯线上方，经济呈现弱复苏态势，而港股在美国QE3的影响下大幅上扬也一定程度上扭转了投资者此前的担忧。从行业来看，银行、地产、非银行金融表现出色，而食品饮料、TMT等行业表现欠佳，市场风格偏向大盘蓝筹股。

考虑到宏观经济和政策的不确定性逐渐减弱，结合先进制造投资领域的特点，本基金于四季度提升了仓位，保持了一定的主动性，起到了一定效果，但由于基金合同投资范围的限制，本基金尽管净值跑赢了业绩比较基准，但未能跑赢上证综指。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2012年12月31日，本基金份额净值为0.862元，本报告期份额净值增长率为4.48%，同期业绩比较基准增长率为2.92%。

§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	359,520,996.16	83.40
	其中：股票	359,520,996.16	83.40
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	71,514,423.53	16.59
6	其他各项资产	59,786.19	0.01
7	合计	431,095,205.88	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	采掘业	21,434,427.00	5.07
C	制造业	205,886,800.92	48.75
C0	食品、饮料	20,745,021.80	4.91
C1	纺织、服装、皮毛	-	-
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	12,437,128.80	2.94
C5	电子	79,237,588.07	18.76
C6	金属、非金属	-	-
C7	机械、设备、仪表	93,467,062.25	22.13
C8	医药、生物制品	-	-
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	8,015,659.32	1.90
E	建筑业	13,874,267.62	3.28
F	交通运输、仓储业	-	-
G	信息技术业	70,724,667.30	16.75
H	批发和零售贸易	-	-
I	金融、保险业	-	-
J	房地产业	-	-
K	社会服务业	37,975,174.00	8.99
L	传播与文化产业	1,610,000.00	0.38
M	综合类	-	-
	合计	359,520,996.16	85.12

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	002415	海康威视	787,466	24,498,067.26	5.80
2	600967	北方创业	1,249,597	22,880,121.07	5.42
3	600406	国电南瑞	1,374,979	22,040,913.37	5.22
4	002353	杰瑞股份	449,925	21,434,427.00	5.07
5	002236	大华股份	399,889	18,534,855.15	4.39
6	300070	碧水源	393,438	15,776,863.80	3.74
7	600893	航空动力	1,223,073	15,447,411.99	3.66
8	002025	航天电器	1,252,574	14,204,189.16	3.36
9	002081	金螳螂	315,181	13,874,267.62	3.28
10	600570	恒生电子	1,101,993	13,080,656.91	3.10

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	29,249.47
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	16,368.75
5	应收申购款	14,167.97
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	59,786.19

5.8.4 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。

5.8.5 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的情况。

5.8.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

1、交银施罗德基金管理有限公司期末持有本基金份额20,004,400.00份，占本基金期末总份额的4.08%，报告期内未发生申购、赎回。

2、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

本报告期期初基金份额总额	512,333,540.77
本报告期基金总申购份额	2,370,644.04
减：本报告期基金总赎回份额	24,720,314.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	489,983,870.81

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 影响投资者决策的其他重要信息

依据中国证监会《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》（证监会公告〔2008〕38号）的有关规定和《中国证券业协会基金估值小组关于停牌股票估值的参考方法》的指导意见，经与基金托管人协商一致，本基金对其所持有的恒生电子（证券代码：600570）自2012年12月26日起采取指数收益法进行估值，并已于2013年1月4日起恢复按市场价格进行估值。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会核准交银施罗德先进制造股票证券投资基金募集的文件；

2、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金基金合同》；

3、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金招募说明书》；

4、《交银施罗德先进制造股票证券投资基金托管协议》；

5、关于募集交银施罗德先进制造股票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先进制造股票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.jyfund.com、www.jysld.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@jysld.com。

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

2012年12月31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：二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	交银深证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	98,329,693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，或因其他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，从而获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	

注：本基金场内简称为“深价值”。

§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（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-2,816,612.79
2.本期利润	8,576,931.61
3.加权平均基金份额本期利润	0.0835
4.期末基金资产净值	94,022,925.84
5.期末基金份额净值	0.956

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

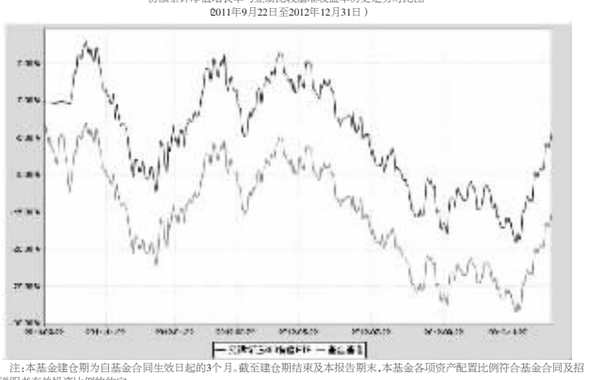
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	10.14%	1.31%	10.52%	1.31%	-0.38%	0.00%

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2012年12月31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		
屈乐伟	本基金及其联接基金、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银沪深300分层等权指数基金基金经理	2011-9-22	-	16年	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；华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理助理。2006年加入交银施罗德基金管理有限公司。
蔡铮	本基金及其联接基金、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银沪深300分层等权指数基金基金经理	2012-12-27	-	4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。

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。

本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。本投资组合与公司旗下管理的不同投资组合的整体收益率、分投资类别（股票、债券）的收益率并未发现异常差异。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内未发现异常交易行为。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成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

在大量限售股解禁及潜在扩容双重压力重压下，大盘似乎无视多项宏观经济指标的好转，在2012年四季度前期又出现了大幅下跌，上证指数在2000点整数大关几经争夺，最终还是向下突破，并创1949点新低，市场情绪降至冰点。12月份，在QFII等长线资金介入的背景下，大盘终于出现大幅连续上涨，并一举收复年线，市场倾时活跃起来。指数基金因其产品属性决定持有仓位较重，加之本基金的标的指数属深市大盘价值型，恰与12月市场热点相吻合，因此也成了12月表现较好的股票型基金之一。

4.5 报告期内基金的业绩表现

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 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	93,853,905.39	98.82
	其中：股票	93,853,905.39	98.82
2	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	620,683.18	0.65
6	其他各项资产	500,144.54	0.53
7	合计	94,974,733.11	100.00

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	采掘业	5,298,808.55	5.64
C	制造业	50,267,146.90	53.46
C0	食品、饮料	4,791,002.60	5.10
C1	纺织、服装、皮毛	348,116.75	0.37
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	669,759.93	0.71
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,546,077.37	4.84
C5	电子	2,298,912.21	2.45
C6	金属、非金属	6,912,194.76	7.35
C7	机械、设备、仪表	26,683,832.58	28.38
C8	医药、生物制品	4,017,250.70	4.27
C99	其他制造业	-	-
D	电力、煤气及水的生产和供应业	2,119,391.95	2.25
E	建筑业	295,615.32	0.31
F	交通运输、仓储业	1,327,344.23	1.41
G	信息技术业	2,379,919.44	2.53
H	批发和零售贸易	4,600,039.73	4.89
I	金融、保险业	5,889,321.46	6.26
J	房地产业	17,921,506.41	19.06
K	社会服务业	3,464,444.10	3.68
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	290,367.30	0.31
	合计	93,853,905.39	99.82

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	979,526	9,912,803.12	10.54
2	000651	格力电器	255,823	6,523,486.50	6.94
3	000001	平安银行	297,601	4,767,568.02	5.07
4	000157	中联重科	480,565	4,426,003.65	4.71
5	002024	苏宁电器	479,524	3,188,834.60	3.39
6	000069	华侨城A	377,199	2,828,992.50	3.01
7	000568	泸州老窖	79,033	2,797,768.20	2.98
8	000338	潍柴动力	101,387	2,566,104.97	2.73
9	000024	招商地产	83,382	2,492,287.98	2.65
10	000983	西山煤电	175,000	2,434,250.00	2.59

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名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名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名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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。

5.8.2 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。

5.8.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	500,000.00
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	144.54
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	500,144.54

5.8.4 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。

5.8.5 报告期末投资的股票存在流通受限情况的说明

5.8.5.1 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	000002	万科A	9,912,803.12	10.54	重大事项停牌

5.8.5.2 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。

5.8.6 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

本报告期期初基金份额总额	112,329,693
本报告期基金总申购份额	2,000,000
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	98,329,693

§7 备查文件目录

7.1 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。

7.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人的办公场所。

7.3 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.jyfund.com、www.jysld.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@jysld.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

2012 第四季度 报告

2012年12月31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：二〇一三年一月二十一日

§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2013年1月18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2012年10月1日起至12月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金产品概况

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	92,520,196.20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%	
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 目标基金产品概况

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，或因其他原因导致流动性不足时，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。

§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（2012年10月1日-2012年12月31日）
1.本期已实现收益	-1,983,672.12
2.本期利润	7,345,097.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.0766
4.期末基金资产净值	87,325,066.65
5.期末基金份额净值	0.944

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

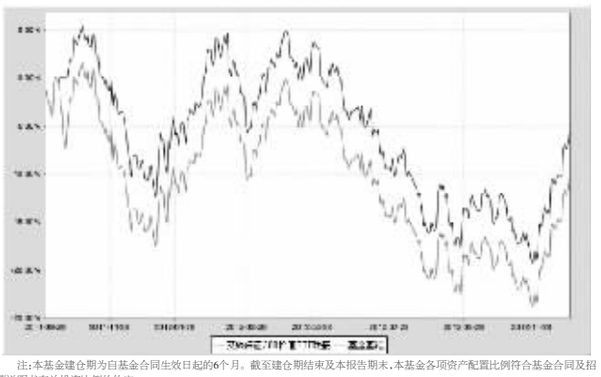
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.26%	1.23%	10.00%	1.24%	-0.74%	-0.01%

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2012年12月31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		
屈乐伟	本基金及深证300价值ETF、交银上证180公司治理ETF及其联接基金、交银沪深300分层等权指数基金基金经理	2011-9-28	-	16年	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；华夏基金管理有限公司基金管理部分析师、市场部高级经理、风险控制评估小组成员以及上证50ETF基金经理