

广发沪深300指数证券投资基金

2012年度 报告摘要

基金管理人:广发基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
1.1 重要提示
基金管理人承诺:基金管理人承诺不存在虚假记载、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法律责任。

Table with 2 columns: Section (e.g., 2.1 基金基本情况, 2.2 基金产品说明) and Content (Fund details, investment objectives, etc.).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.1 主要会计数据和财务指标) and Content (Financial performance metrics for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.2 基金净值表现) and Content (Net asset value performance metrics and benchmark comparisons).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.3 基金投资组合报告) and Content (Investment portfolio details, including asset allocation and top holdings).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.4 基金管理人报告) and Content (Management report, including strategy and performance analysis).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.5 基金持有人户数及持有基金份额分布情况) and Content (Holder statistics and distribution data).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.6 基金管理人承诺) and Content (Commitment statements regarding fund management and compliance).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.7 基金托管人报告) and Content (Custodian report on fund custody and compliance).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.8 会计师事务所声明) and Content (Auditor's statement regarding the fund's financial statements).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.9 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.10 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.11 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.12 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.13 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.14 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.15 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

Table with 2 columns: Section (e.g., 3.16 基金合同生效以来基金资产净值增长率与业绩比较基准收益率的比较) and Content (Comparison of fund performance vs benchmark since inception).

我们审计了后附的广发沪深300指数证券投资基金(以下简称“广发沪深300指数”)财务报表,包括2012年12月31日的资产负债表,2012年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表,以及财务报表附注。

我们的审计是按照中国注册会计师审计准则执行的,中国注册会计师审计准则与国际审计准则在所有重大方面是一致的。我们的审计是按照中国注册会计师审计准则执行的,中国注册会计师审计准则与国际审计准则在所有重大方面是一致的。

我们认为,后附的广发沪深300指数证券投资基金(以下简称“广发沪深300指数”)财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制,公允反映了2012年12月31日的财务状况以及2012年度的经营成果和基金净值变动情况。

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.1 资产负债表) and Content (Balance sheet data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.2 利润表) and Content (Income statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.3 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.4 现金流量表) and Content (Cash flow statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.5 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.6 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.7 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.8 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.9 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.10 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.11 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.12 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.13 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.14 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

Table with 2 columns: Section (e.g., 7.15 所有者权益(基金净值)变动表) and Content (Equity (Net Asset Value) change statement data for 2012 and 2011).

关联方名称 当期 上期
广发证券股份有限公司 966,551.01 29,266.26

关联方名称 当期 上期
广发证券股份有限公司 868,714.53 22,276.26

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

项目 2012年1月1日至2012年12月31日 2011年1月1日至2011年12月31日
当期发生应付托管费 18,013,424.00

8.6 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
本基金本报告期末持有债券
8.7 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
本基金本报告期末持有资产支持证券

Table with 2 columns: Section (e.g., 8.8 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) and Content (Details of warrant investments).

9.1 期末本基金持有的买入权证的投资明细
本基金本报告期末未持有权证

Table with 2 columns: Section (e.g., 9.2 期末本基金持有的买入权证的投资明细) and Content (Details of warrant investments).

11.1 基金估值程序
11.2 基金份额持有人大会
11.3 基金管理人、基金托管人、基金销售机构的重大人事变动

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.4 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.5 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.6 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.7 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.8 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.9 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.10 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.11 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.12 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.13 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.14 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.15 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).

Table with 2 columns: Section (e.g., 11.16 基金估值程序) and Content (Valuation procedures and other details).