

# 上证180公司治理交易型开放式指数证券投资基金

## [2014] 第三季度报告

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:二〇一四年十月二十四日

§ 1 重要提示  
基金管理人的董事及董事会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，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人和中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、资产配置等内容，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未来表现。投资风险，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。

报告书中财务资料未经审计。

本报告期自2014年1月1日起至9月30日止。

### § 2 基金产品概况

基金简称 上证180公司治理ETF

基金代码 510010

交易代码 510010

基金份额净值 交易开放式

基金合同生效日 2009年9月25日

报告期末基金份额总额 2,675,324,362份

投资目标 采用行业轮动策略，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。

本基金采用完全复制法，跟踪上证180公司治理指数，以完全复制和指数成份股被动投资为主，同时辅以适当的现金头寸，以降低跟踪误差并提高流动性。

投资策略 在投资组合中分别配置股票指数成分股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊原因(如流动性等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人有权根据其他合理方法进行适当的替代。

业绩比较基准 上证180公司治理指数

风险收益特征 本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，属股票型基金，属于广泛投资股票型基金风险较高的品种。

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

注1:本表所列的基金主代码610010为本基金二级市场交易代码,本基金一级市场申购赎回代码为510010。

2.本基金年内简称为“治理ETF”。

### 3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 (2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 6,838,466.65

2.本期利润 229,364,751.80

3.期初平均基金份额净值 0.8087

4.期末基金份额净值 1,809,552.05/1.92

5.期末基金净值增长率 0.677

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率将低于相应的净值。

2.期初三季报收益指基金本利期息收入、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，本期利润为当期已实现收益加上本期未实现公允价值变动收益。

### 3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

阶段 净值增长①% 净值增长率②% 业绩比较基准收益差额③% 收益率差额④% ①-③ ②-④

过去三个月 13.21% 0.95% 11.56% 0.95% 1.65% 0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来以基金净资产累计净值增长率大小排序的前五名股票投资明细

序号 股票代码 股票名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000138 中国平安 126,377,413.50 6.98

2 600036 招商银行 105,121,134 109,221,072.26 6.04

3 600016 民生银行 17,262,971 107,720,939.04 5.95

4 601166 兴业银行 7,281,629 74,418,248.38 4.11

5 600000 浦发银行 7,126,962 69,487,879.50 3.84

6 600030 中信证券 5,011,960 66,759,307.20 3.69

7 600837 海通证券 5,155,230 53,201,973.60 2.94

8 601601 中国银行 1,999,172 38,803,928.52 2.14

9 601398 工商银行 10,905,633 38,496,884.49 2.13

10 600104 上海银行 2,104,962 38,057,803.36 2.10

5.3 报告期来自动权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

5.3.1 报告期来自动权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 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 000138 中国平安 126,377,413.50 6.98

2 600036 招商银行 105,121,134 109,221,072.26 6.04

3 600016 民生银行 17,262,971 107,720,939.04 5.95

4 601166 兴业银行 7,281,629 74,418,248.38 4.11

5 600000 浦发银行 7,126,962 69,487,879.50 3.84

6 600030 中信证券 5,011,960 66,759,307.20 3.69

7 600837 海通证券 5,155,230 53,201,973.60 2.94

8 601601 中国银行 1,999,172 38,803,928.52 2.14

9 601398 工商银行 10,905,633 38,496,884.49 2.13

10 600104 上海银行 2,104,962 38,057,803.36 2.10

5.3.2 报告期来自动权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

5.3.3 报告期来自动权投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号 债券代码 债券名称 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 100000 国家债券 18,896.15

2 100000 国债逆回购 6,378.43

3 100000 国债逆回购 926.79

4 100000 国债逆回购 15,124.24

5 100000 国债逆回购 41,325.61

5.4 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

董静 先生 夏复旦大学电子工程系硕士，历任华为电子工程师，2009年加入交银施罗德基金管理有限公司，历任投资研究员、基金经理助理、基金经理，现任基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规性情况的说明

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，基金管理符合有关法律法规和基金合同规定的标准，为基金持有人谋求最大利益。

4.3 公平交易专户说明

4.3.1 平均交易佣金的执行情况

本公司制定了严格的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，旗下所管理的所有有公平交易制度的账户均严格执行了公平交易制度。

本公司建立了专门的公平交易执行小组，根据各投资组合在投资交易中发生的大额交易和关联交易，遵循“时间优先、价格优先、比例分配”的原则，对不同组合间进行公平交易。

4.3.2 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.3 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.4 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.5 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.6 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.7 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.8 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.9 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.10 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.11 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.12 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.13 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.14 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.15 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.16 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.17 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.18 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.19 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.20 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.21 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.22 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.23 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。

4.3.24 相关制度的执行情况

本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，对于交易公开竞价部分，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。