

A50

## 信息披露

Disclosure

(上接A49版)

传真:(021)68728703  
联系人:陈敏  
客户服务电话:(021)63340678  
网址:www.apqz.com  
(30)长城证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区深南大道6008号特区报业大厦14、16、17层  
法定代表人:周耀华  
电话:(0755)18361289  
传真:(0755)183616199  
联系人:匡婷  
客户服务电话:(0755)33680000,400-6666-888  
网址:www.cc168.com.cn  
(31)国泰证券股份有限公司  
住所:成都市锦城大道上街95号  
办公地址:成都市东城根上街95号  
法定代表人:冉云  
电话:(028)66960126  
传真:(028)66960126  
联系人:金皓  
客户服务电话:400-6600-109  
网址:www.gjqz.com.cn  
(32)方正证券股份有限公司  
住所:湖南长沙芙蓉中路一段华侨国际大厦22-24层  
办公地址:湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦22-24层  
法定代表人:雷杰  
电话:(0731)95832343  
传真:(0731)95832342  
联系人:彭博  
客户服务电话:95571  
网址:www.founders.com  
(33)渤海证券股份有限公司  
住所:天津经济技术开发区第二大街42号写字楼101室  
办公地址:天津市南开区宾水道8号  
法定代表人:高庆平  
电话:(022)28451861  
传真:(022)28451892  
联系人:王兆权  
客户服务电话:400-651-5998  
网址:www.hhzq.com  
(34)信达证券股份有限公司  
住所:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心  
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心  
法定代表人:高红江  
电话:(010)63010000  
传真:(010)6300978  
联系人:唐静  
客户服务电话:400-800-8899  
网址:www.cindasc.com  
(35)华泰证券有限责任公司  
住所:福州市五四路157号新天地大厦7、8层  
办公地址:福州市五四路新天地大厦7至10层  
法定代表人:林金坤  
电话:(0591)87383623  
传真:(0591)87383610  
客户服务电话:(0591)96326  
网址:www.hfzq.com.cn  
(36)中国中投证券有限责任公司  
住所:深圳市福田区益田路与福中路交界处荣超商务中心A栋第18层-21层及04层01.02.03.05.11.12.13.15.16.18.19.20.21.22.23单元  
办公地址:深圳市福田区益田路6003号荣超商务中心A栋第04、18层至21层  
法定代表人:龙增培  
电话:(0755)182023442  
传真:(0755)182026539  
联系人:刘毅  
客户服务电话:400-600-8008  
网址:www.china-inva.cn  
(37)华泰证券股份有限公司  
住所:北京市西城区金融大街8号  
办公地址:北京市西城区金融大街8号  
法定代表人:周明伟  
电话:(010)65686062  
传真:(010)65686065  
联系人:程丽、耿欣  
客户服务电话:(010)59568118  
网址:www.hsec.com.cn  
(38)中原证券股份有限公司  
住所:郑州市东风新区商务外环路10号  
办公地址:郑州市东风新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层  
法定代表人:史国军  
电话:(0371)6558670  
传真:(0371)65586665  
联系人:程丽、耿欣  
客户服务电话:(0371)967218,400-813-9666  
网址:www.ccnew.com  
(39)天相投资顾问有限公司  
住所:北京市朝阳区金融街9号富凯大厦B座701  
办公地址:北京市西城区新街口外大街28号G座5层  
法定代表人:艾文柏  
电话:(010)6604529  
传真:(010)6604518  
联系人:尹玲  
客户服务电话:(010)66045678  
网址:http://www.txsec.com, www.jjm.com.cn  
(40)联讯证券股份有限公司  
住所:惠州市江北三路65号广播电视台新闻中心西面一层大堂和三、四层  
办公地址:惠州市江北三路65号广播电视台新闻中心西面一层大堂和三、四层  
法定代表人:徐刚  
电话:(021)33606736  
传真:(021)33606760  
联系人:陈思  
客户服务电话:95564  
网址:www.lxqz.com.cn  
(41)杭州数米基金销售有限公司  
住所:杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼  
法定代表人:陈柏青  
电话:(0571)22829790,(021)60897869  
传真:(0571)26696533  
联系人:周健  
客户服务电话:400-766-123  
网址:www.fund123.com  
(42)深圳众禄基金销售有限公司  
住所:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元  
办公地址:深圳市罗湖区深南东路5047号发展银行大厦25楼J、J单元  
法定代表人:陈峰  
电话:(0755)13227963  
传真:(0755)182080798  
联系人:汤素娟  
客户服务电话:4006-788-887  
网址:www.zlfund.cn, www.jmmw.com  
(43)上海长量基金销售投资顾问有限公司  
住所:上海市浦东新区高科西路2号2幢220室  
办公地址:上海市浦东新区浦东大道556号裕景国际B座16层  
法定代表人:黄伟  
电话:(021)20691635  
传真:(021)20691861  
联系人:单丙伟  
客户服务电话:400-089-1289  
网址:www.erichfund.com  
(44)上海好买基金销售有限公司  
住所:上海市黄浦区中环路685弄37号4号楼449室  
办公地址:上海市浦东新区浦东南路1118号鄂尔多斯国际大厦903-906室  
法定代表人:杨文斌  
传真:(021)68596916  
联系人:薛萍  
客户服务电话:400-700-9665  
网址:www.ehowbuy.com  
(45)诺亚正行(上海)基金销售投资顾问有限公司  
住所:上海市徐汇区飞虹路360号9号楼224室  
办公地址:上海杨浦区秦皇岛路32号C栋 2楼  
法定代表人:王静波  
电话:(021)38600736  
传真:(021)38509777  
联系人:方成  
客户服务电话:400-821-5399  
网址:www.noah-fund.com  
(46)和讯信息科技有限公司  
住所:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
办公地址:北京市朝阳区朝外大街22号泛利大厦10层  
法定代表人:王莉  
电话:(021)200835789  
传真:(021)20836879  
联系人:周铁  
客户服务电话:4009200022

网址:<http://lcaike.hexun.com/>

(47)上海天天基金销售有限公司  
住所:上海市徐汇区龙田路190号2号楼2层  
办公地址:上海市徐汇区龙田路195号3C座10楼  
法定代表人:其实  
电话:(021)54509908  
传真:(021)64385308  
联系人:潘友生  
客户服务电话:400-1818-188  
网址:www.123467.com.cn  
(48)北京钱经理投资管理有限公司  
住所:北京市海淀区丹棱街6幢1号层1008-1012  
办公地址:北京市海淀区丹棱街6幢1号层1008-1012  
法定代表人:赵荣春  
电话:(010)57418829  
传真:(010)57569671  
联系人:魏静  
客户服务电话:400-678-5095  
网址:www.nini.net  
(49)深圳市新兰德证券投资咨询有限公司  
住所:深圳市福田区华强北路赛格科技园4栋10层1006#  
办公地址:北京市西城区金融大街35号国际企业大厦C座9层  
法定代表人:陈操  
电话:(010)58325395  
传真:(010)58325382  
联系人:刘宝文  
客户服务电话:400-850-7771  
网址:<http://tjjc.com/>  
基金管理人可根据有关法律法规的要求,选择其它符合要求的机构代理销售本基金,并及时公告。  
(二)基金登记机构  
名称:中国证券登记结算有限责任公司  
住所:北京市西城区太平桥大街17号  
办公地址:北京市西城区太平桥大街17号  
法定代表人:周明伟  
电话:(010)59378839  
传真:(010)59378907  
联系人:朱立华  
客户服务电话:400-851-5998  
(三)出具法律意见书的律师事务所  
名称:上海市恒力律师事务所  
住所:上海市恒力中路6号时代金融中心19楼  
办公地址:上海市恒力中路6号时代金融中心19楼  
负责人:俞卫锋  
电话:(021)31358666  
传真:(021)31359600  
联系人:黎明  
经办律师:孙红、黎明  
(四)审计计师事务所  
名称:普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)  
住所:上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼  
办公地址:上海市浦东新区陆家嘴环路202号普华永道中心11楼  
首席合伙人:杨绍信  
电话:(021)23238888  
传真:(021)23238800  
联系人:沈杰杰  
经办注册会计师:汪棣、沈杰杰  
四、基金的名称  
本基金名称:交银施罗德沪深300行业分层等权重指数证券投资基金  
五、基金的类型  
本基金类型:契约型开放式  
六、基金的投资目标  
紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。  
七、基金的投资方向  
本基金投资于具有良好流动性的金融工具,以沪深300行业分层等权重指数成份股及备选成份股(含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)为主要投资对象。为更大地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非指数成份股及其备选成份股、新股、首次公开发行、增发、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会批准的允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)),如法律法规或监管部门以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。投资有风险,投资人应做出投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。  
八、基金的投资策略  
本基金将指数型基金、绝大部分资金采用完全复制的指数方法跟踪标的指数,即按照成份股在沪深300行业分层等权重指数中的成分股及其权重构建股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整或成份股发生增配、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或因某些特殊情况下导致跟踪不足时,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进行适当调整和变更,从而更有效地跟踪标的指数。  
九、业绩比较基准  
本基金业绩比较基准为沪深300行业分层等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。  
沪深300行业分层等权重指数由中证指数有限公司编制和计算,沪深300行业分层等权重指数与沪深300指数有相同的成分股。不同的是,沪深300指数采用自由流通市值加权,而沪深300行业分层等权重指数采用了行业分层权重加权,具体做法是:它将进行权重,然后将行业内的个股再权,沪深300行业分层等权重指数展现了与沪深300指数不同的风险收益特征,以满足投资人日益多元化的投资选择。  
十、基金的风险收益特征  
本基金业绩比较基准为沪深300行业分层等权重指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。  
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、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。  
十一、基金的组合投资  
本基金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,并对其中的真实性、准确性、完整性和合法性承担个别及连带责任。  
本基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定,于2014年10月23日核对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。  
本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务数据未经审计师审定。

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 5,527,735.63 91.83

其中:股票 5,527,735.63 91.83

2 固定收益投资 - -

其中:债券 - -

资产支持证券 - -

贵金属投资 - -

4 金融衍生品投资 - -

5 其他金融资产 - -

其中:现金类资产 - -

6 衍生工具和备兑权证合计 478,873.96 7.96

7 其他资产 12,818.56 0.21

8 合计 6,019,426.15 100.00

2、报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金报告期末未持有积极投资的股票。

2.2指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 46,761.90 0.80

B 建筑业 753,337.85 12.87

C 制造业 2,367,934.21 40.46

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业 596,455.16 10.19

E 建筑业 188,760.97 3.23

F 批发和零售业 228,786.03 3.94

G 交通运输、仓储和邮政业 127,405.76 2.18

H 饮食、住宿和居民服务业 - -

I 信息传输、软件和信息技术服务业 344,299.37 5.88

J 金融业 418,732.35 7.16

K 租赁和商务服务业 138,536.19 2.37

L 租赁和商务服务业 82,647.63 1.41

M 科学研究、技术服务和地质勘查业 - -

N 水利、环境和公共设施管理业 92,331.56 1.58

O 居民服务、修理和其他服务业 - -

P 文化、体育和娱乐业 - -

Q 卫生和社会工作 - -

R 教育 - -

S 综合 - -

合计 5,527,735.63 94.46

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

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 600873 海能达物 15,339 85,131.45 1.45

2 002065 东华软件 3,630 75,903.30 1.30

3 600832 东方明珠 5,573 60,857.16 1.04

4 600497 航空港务 5,628 58,474.92 1.00

5 000883 湖北能源 11,687 53,877.07 0.92

6 600547 山东黄金 3,093 51,189.15 0.87

7 600637 百视通 1,514 48,432.86 0.83

8 600674 川投能源 2,680 47,596.80 0.81

9 600157 永泰能源 9,554 46,623.52 0.80

10 600706 中航资本 2,260 42,555.80 0.73

3.2 报告期末未持有积极投资的前五名股票投资明细

本报告期内未持有积极投资的股票。

4.报告期末未按券种分类的债券投资组合

本基金报告期末未持有债券。

5.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

本基金报告期末未持有债券。

6.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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

7.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贵金属投资明细

本基金报告期末未持有贵金属。

8.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

本基金报告期末未持有资产支持证券。

9.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

本基金报告期末未持有权证。

10.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股指期货投资明细

本基金报告期末未持有股指期货。

11.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国债期货投资明细

本基金报告期末未持有国债期货。

12.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。

13.其他资产构成

序号 名称 金额(元)

1 存出保证金 3,385.42

2 受托管理费 -

3 收取利息 -

4 支付利息 97.46

5 支付申购款 9,335.68

6 支付赎回款 -

7 支付费用 -

<div data-bbox="414