

（上接A49版）

传真：(021) 68728703
 联系人：陈敏
 客户服务电话：(021) 63340678
 网址：www.aqzq.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：黄耀华
 电话：(0755) 183616289
 传真：(0755) 183616199
 联系人：匡寿
 客户服务电话：(0755) 33680000，400—6666—888
 网址：www.cc168.com.cn
 （31）国金证券股份有限公司
 住所：成都市东城根上街96号
 办公地址：成都市东城根上街96号
 法定代表人：冉云
 电话：(028) 86690126
 传真：(028) 86690126
 联系人：金洁
 客户服务电话：400—6600—109
 网址：www.gjzq.com.cn
 （32）方正证券股份有限公司
 住所：湖南长沙芙蓉中路二段华侨国际大厦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) 85832343
 传真：(0731) 85832342
 联系人：彭博
 客户服务电话：96571
 网址：www.foundascs.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：天津市南开区滨水西道8号
 法定代表人：杜广良
 电话：(022) 28451861
 传真：(022) 28451892
 联系人：王兆乾
 客户服务电话：400—651—5988
 网址：www.bhzcj.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：高冠红
 电话：(010) 63801000
 传真：(010) 63800878
 联系人：唐静
 客户服务电话：400—800—8899
 网址：www.cindasc.com
 （35）华福证券有限责任公司
 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：黄金琳
 电话：(0591) 877383623
 传真：(0591) 877383610
 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中路交界处荣超商务中心A栋第18层—21层及第04层01、02、03、06、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：龙耀军
 电话：(0755) 180223442
 传真：(0755) 180226359
 联系人：刘毅
 客户服务电话：(0755) 6000—8008
 网址：www.china-invsn.com
 （37）华融证券股份有限公司
 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：宋德清
 电话：(010) 58568235
 传真：(010) 58568062
 联系人：黄恒
 客户服务电话：(010) 58568118
 网址：www.hrsec.com.cn
 （38）中原证券股份有限公司
 住所：郑州市郑东新区商务外环路10号
 办公地址：郑州市郑东新区商务外环路10号中原广发金融大厦17层
 法定代表人：吕建明
 电话：(0371) 65585670
 传真：(0371) 65585665
 联系人：程旭、耿俊
 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：北京市西城区金融街19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C座2层
 法定代表人：林义相
 电话：(010) 66045529
 传真：(010) 66045518
 联系人：尹玲
 客户服务电话：(010) 66045678
 网址：http://www.txsec.com, www.tjia.com.cn
 （40）联讯证券股份有限公司
 住所：惠州市江北东江二路55号广播电视新闻中心西面一层大堂和三、四层
 办公地址：惠州市江北东江二路55号广播电视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：96564
 网址：www.lxwzq.com.cn
 （41）杭州数米基金销售有限公司
 住所：杭州市余杭区仓前街道海曙路2号
 办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道3588号恒生大厦12楼
 法定代表人：吴革
 电话：(0571) 28829790，(021) 60897869
 传真：(0571) 28858533
 联系人：周盛思
 客户服务电话：4000—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：薛峰
 电话：(0755) 133227953
 传真：(0755) 182080798
 联系人：汤素娥
 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：上海市浦东新区高翔路526号2幢220室
 办公地址：上海市浦东新区浦东南路565号裕景国际B座16层
 法定代表人：张跃伟
 电话：(021) 20691835
 传真：(021) 20691861
 联系人：单丙峰
 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：上海市虹口区四川中路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
 电话：(021) 68909616
 联系人：薛年
 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：上海市虹口区四川路360弄9号2724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：汪静波
 电话：(021) 38600735
 传真：(021) 38609777
 联系人：方成
 客户服务电话：400—821—5399
 网址：www.noah-fund.com
 （46）联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) 20835789
 传真：(021) 20835879
 联系人：周秩
 客户服务电话：4009200022

网址：http://llicaike.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195号3C座10楼
 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) 54509988
 传真：(021) 64385308
 联系人：潘世友
 客户服务电话：400—1818—188
 网址：www.1234567.com.cn
 （48）北京钱鼎财富投资管理有限公司
 住所：北京市海淀区丹棱街6061号9层1008—1012
 办公地址：北京市海淀区丹棱街6061号9层1008—1012
 法定代表人：赵荣泰
 电话：(010) 57418829
 传真：(010) 57560671
 联系人：魏宁
 客户服务电话：400—678—5096
 网址：www.niuji.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1006F
 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) 58325282
 联系人：刘宝文
 客户服务电话：400—950—7771
 网址：https://tjjj.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）基金注册登记机构
 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
 电话：(010) 59373839
 传真：(010) 59373907
 联系人：朱立元
 （三）出具法律意见书的律师事务所
 名称：上海市通力律师事务所
 住所：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
 负责人：俞卫锋
 电话：(021) 31358666
 传真：(021) 31358600
 联系人：黎明
 经办律师：吕红、黎明
 （四）审计基金财产的会计师事务所
 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号展展银行大厦6楼
 办公地址：上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
 首席合伙人：杨绍信
 电话：(021) 12323888
 传真：(021) 23238800
 联系人：沈兆杰
 经办注册会计师：汪敏、沈兆杰

四、基金的投资目标
 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的成份股及其备选成份股（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、新股（首次发行或增发）、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人可在履行适当程序后，将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，投资于权证的比例不得超过基金资产净值的3%，持有现金以及到期日在一年以内的政府债券的比例不低于基金资产净值的5%。

八、基金的投资策略
 本基金为指数型基金，绝大部分资产采用完全复制标的指数的方法跟踪标的指数，即按照成份股在沪深300行业分层等权重指数中的成份股组成及其权重构建投资组合投资标的，并跟踪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，或因某些特殊情况导致流动性不足时，或由于其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数的时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当调整和调整，从而使得投资组合紧密跟踪标的指数。

本基金投资于沪深300行业分层等权重指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，其余资产可投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股）、新股（首次发行或增发）、债券、货币市场工具、回购、权证、资产支持证券以及法律法规和中国证监会批准的允许本基金投资的其它金融工具，其目的是在保证基金资产流动性的前提下，有效利用基金资产，更好地实现跟踪标的指数的投资目标。

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×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指数具有相似的特征。不同的是，沪深300指数采用自由流通调整市值加权，而沪深300行业分层等权重指数采用了行业分层等权重加权，具体做法是：它先将行业等权，然后将行业内的个股再等权。沪深300行业分层等权重指数展现出了与沪深300指数不同的风险收益特征，以满足投资者日益多元化的投资选择。

由于本基金投资于现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，因此本基金业绩比较基准中同时加入了银行活期存款利率（税后），本基金认为，该业绩比较基准目前能够更真实地反映本基金的风险收益特征。如今后本基金所跟踪的目标指数被中证指数有限公司停止发布，或由其他指数替代，或由指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为目标指数；或者今后证券市场中有其他更具代表性的业绩比较基准推出时，本基金管理人将在征得基金托管人同意的情况下，履行适当程序后按实际情况变更标的的指数和业绩比较基准。

十、基金的风险收益特征
 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。

十一、基金投资组合报告
 本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。

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。

本报告期为2014年7月1日至2014年9月30日。本报告财务资料未经审计师审计。

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
2	其中：股票	5,527,735.63	91.83
3	固定收益投资	—	—
4	其中：债券	—	—
5	资产支持证券	—	—
6	贵金属投资	—	—
7	金融衍生品投资	—	—
8	买入返售金融资产	—	—
9	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
10	银行存款和结算备付金合计	478,873.96	7.96
11	其他资产	12,818.56	0.21
12	合计	6,019,428.15	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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	46,761.90	0.80
B	采矿业	753,337.85	12.87
C	制造业	2,367,924.21	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	3.25
F	批发和零售业	228,765.03	3.91
G	交通运输、仓储和邮政业	127,495.76	2.18
H	住宿和餐饮业	—	—
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	房地产业	138,659.19	2.37
L	租赁和商务服务业	682,673.63	11.41
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	78,491.49	1.34
S	综合	63,255.16	1.08
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	梅花生物	15,339	85,131.45	1.45
2	002065	东方软件	3,630	75,903.30	1.30
3	600832	东方明珠	5,573	60,857.16	1.04
4	600497	施安特	5,628	58,474.92	1.00
5	000883	南光能源	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	东丰能源	9,554	46,623.52	0.80
10	600705	中航资本	2,260	42,555.80	0.73

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。
 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. 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
 本基金本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

本基金本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

本基金本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五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9. 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10. 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11. 投资组合报告附注

11.1 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。

11.2 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。

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	3,385.42
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	97.46
5	应收申购款	9,335.68
6	其他应收款	—
7	预付款项	—
8	其他	—
9	合计	12,818.56

11.4 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。

11.5 报告期末投资股指期货存在流通受限情况的说明

11.5.1 报告期末投资股指期货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	流通受限部分公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600873	梅花生物	85,131.45	1.45	重大事项
2	002065	东方软件	75,903.30	1.30	重大事项
3	600832	东方明珠	60,857.16	1.04	重大事项
4	600497	施安特	58,474.92	1.00	重大事项
5	600547	山东黄金	51,189.15	0.87	重大事项
6	600637	百视通	48,432.86	0.83	重大事项
7	600705	中航资本	42,555.80	0.73	重大事项

11.5.2 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。

11.6 投资组合报告附注的其他文本描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计数之间可能存在尾差。

十二、基金业绩

基金业绩截止日为2014年9月30日，所载财务数据未经审计师审计。
 基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

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③	业绩比较基准收益标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.80%	0.82%	17.93%	0.84%	-0.13%	0.02%
2014年度上半年	-7.79%	1.04%	-7.23%	1.04%	-0.56%	0.00%
2013年度	1.52%	1.25%	1.33%	1.26%	0.19%	-0.01%
2012年度(自基金合同生效日起至2012年12月31日)	9.60%	1.21%	4.67%	1.33%	4.93%	-0.12%

2. 本基金自成立以来的基金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

注：本基金建仓期为自基金合同生效日起的96个月，截至建仓结束，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。

十三、基金费用与税收

（一）基金费用的种类
 1. 基金管理人的管理费；
 2. 基金托管人的托管费；
 3. 基金合同的审计费；
 4. 基金财产审计支付的审计费用；
 5. 基金合同生效后的基金信息披露费用；
 6. 基金份额持有人大会费用；
 7. 基金合同生效与基金有关的会计师费、律师费和诉讼费；
 8. 基金的证券交易费用；
 9. 基金的开户费用、账户维护费用；
 10. 在中国证监会规定允许的前提下，本基金可以从基金财产中计提销售服务费，具体计提方法、计提标准在招募说明书或相关公告中载明；
 11. 依法可以计提的其他费用。

（二）上述基金费用由基金管理人按法律法规的范围和比例从基金财产中列支，法律法规另有规定时从其规定。

（三）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

1、与基金运作有关的费用

（1）基金管理人的管理费

在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的0.75%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（2）基金托管人的托管费

在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

（3）基金标的指数许可使用费

本基金作为指数基金，需根据与中证指数有限公司签署的指数使用许可协议的约定向中证指数有限公司支付标的指数的许可使用费。本基金标的指数许可使用费年费率为0.02%，标的指数许可使用费的收取下限为每季度5万元。标的指数许可使用费在通常情况下按前一日的基金资产净值0.02%的年费率计提，计算方法如下，若季度不足5万元则按5万元收取。

$H = E \times \text{标的指数许可使用费率} \div \text{当年天数}$

H为每日应计提的基金标的指数许可使用费

E为