

# 信息披露

## (上接A21版)

适用于本基金业绩比较基准的指数时,则基金管理人将视情况与基金托管人协商并签订相关程序后调整本基金的业绩比较基准,及时公告并在更新的招募说明书中列示。

### 十、基金的风险收益特征

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。

### 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。

本基金托管人中国工商银行根据本《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	711,982,857.66	83.03
2	固定收益投资	2,317,520.00	0.27
3	其中:股票	2,317,520.00	0.27
4	其中:债券	-	-
5	其中: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:买入返售金融资产-买入返售金融资产	-	-
10	银行存款和结算备付金合计	125,939,331.82	14.61
7	其他资产	17,255,131.53	2.01
8	合计	857,495,220.51	100.00

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	372,540,098.68	44.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	22,480,925.82	2.69
E	建筑业	67,575,887.18	8.10
F	交通运输、仓储和邮政业	37,908,012.87	4.54
G	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	金融业	21,844,116.76	2.62
J	房地产业	-	-
K	租赁和商务服务业	34,998,423.88	4.19
L	批发和零售业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	卫生、医药和公共卫生管理业	40,465,508.80	4.84
O	水利、环境和公共设施管理业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	86,306,650.83	10.33
R	文化、体育和娱乐业	27,863,383.00	3.34
S	综合	-	-
合计		711,982,857.66	85.25

### 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	300347	泰格医药	2,006,737	68,409,664.33	8.19
2	002475	弘业股份	1,290,177	42,253,276.75	5.16
3	002681	金耀华	1,999,878	38,737,636.86	4.64
4	600026	山东黄金	1,080,046	29,336,149.39	3.51
5	002462	鑫富药业	1,220,009	28,476,213.57	3.41
6	603005	晶方科技	593,163	28,329,464.98	3.39
7	300291	华谊嘉瑞	700,085	27,363,383.00	3.34
8	002353	杰瑞股份	689,973	26,895,147.54	3.22
9	000661	大连高新	249,909	25,560,692.52	3.06
10	600773	恒信股份	1,000,024	22,870,548.88	2.74

### 4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
4	其中:政策性金融债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	其他	2,317,520.00	0.28
9	合计	2,317,520.00	0.28

### 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

序号	债券代码	债券名称	数量(元)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	110028	招商银行	19,640	2,317,520.00	0.28

### 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十名权证投资明细

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

(1)报告期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。

(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

## 信息披露

### (3)其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	494,034.31
2	应收证券清算款	16,542,021.74
3	应收利息	-
4	应收股利	34,153.02
5	应收申购款	183,291.96
6	其他应收款	-
7	预收账款	-
8	其他	-
9	合计	17,255,513.03

### (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)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情况。

### (6)投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于组合五A的原因,分项之和与合计项之间可能存在误差。

### 十二、基金的业绩

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应仔细阅读本基金的招募说明书。

### 1.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②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
过去三个月	15.52%	0.76%	10.26%	0.67%	5.26%	0.09%
2014年度上半年	-1.63%	1.13%	-4.54%	0.78%	2.71%	0.35%
2013年度	3.99%	1.28%	-4.57%	1.08%	10.66%	0.19%
2012年度	0.86%	1.17%	7.98%	0.96%	-6.26%	0.21%
2011年度	-5.22%	1.22%	-18.35%	0.98%	-6.67%	0.01%

### 2.自基金合同生效以来基金业绩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

交银施罗德德兴先锋股票证券投资基金业绩净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图(2014年1月22日至2014年9月30日)



注:本基金建仓期为自基金合同生效日起的六个月。截至建仓期结束,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、基金的费用与税收

#### (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》生效后与基金相关的信息披露费用;

4.《基金合同》生效后与基金相关的会计师事务所、律师事务所和审计费;

5.基金份额持有人大会费用;

6.基金的证券交易费用;

7.基金的银行汇划费用;

8.按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。

本基金终止清算时发生费用,按实际支出从基金财产总值中扣除。

#### (二)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

本基金的管理费按前一日基金资产净值的1.5%年费率计提。管理费的计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

#### (三)基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2个工作日内从基金财产中一次性支付。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述一、基金费用中第3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。

#### 2.与基金销售有关的费用

(1)申购费用

本基金申购费用为申购资金的支付费用。投资者可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用。该费用在申购时由基金管理人收取,场外申购时由基金管理人收取,场内申购时由基金管理人收取。

本基金的申购费用在基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率	赎回费率
100万以下	1.5%	1.5%
100万(含)-500万	1.0%	1.0%
500万(含)以上(含500万)	0.6%	每笔交易1000元

### 1、与基金运作有关的费用

(一)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

#### (二)基金托管人的托管费

在本基金托管费,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述一、基金费用中第3-8项费用,由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额,列入或摊入当期基金费用。

#### 2、与基金销售有关的费用

(1)申购费用

本基金申购费用为申购资金的支付费用。投资者可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用。该费用在申购时由基金管理人收取,场外申购时由基金管理人收取,场内申购时由基金管理人收取。

本基金的申购费用在基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率	赎回费率
100万以下	1.5%	1.5%
100万(含)-500万	1.0%	1.0%
500万(含)以上(含500万)	0.6%	每笔交易1000元

### 1、与基金运作有关的费用

(一)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

#### (二)基金托管人的托管费

在本基金托管费,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述一、基金费用中第3-8项费用,由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额,列入或摊入当期基金费用。

#### 2、与基金销售有关的费用

(1)申购费用

本基金申购费用为申购资金的支付费用。投资者可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用。该费用在申购时由基金管理人收取,场外申购时由基金管理人收取,场内申购时由基金管理人收取。

本基金的申购费用在基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率	赎回费率
100万以下	1.5%	1.5%
100万(含)-500万	1.0%	1.0%
500万(含)以上(含500万)	0.6%	每笔交易1000元

### 1、与基金运作有关的费用

(一)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

#### (二)基金托管人的托管费

在本基金托管费,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年托管费率÷当年天数,本基金年托管费率为0.25%

H为每日应计提的基金托管费

E为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

(3)上述一、基金费用中第3-8项费用,由基金托管人根据有关法规及相应协议的规定,按费用实际支出金额,列入或摊入当期基金费用。

#### 2、与基金销售有关的费用

(1)申购费用

本基金申购费用为申购资金的支付费用。投资者可以选择前端收费模式,即在申购时支付申购费用;也可以选择后端收费模式,即在赎回时才支付相应的申购费用。该费用在申购时由基金管理人收取,场外申购时由基金管理人收取,场内申购时由基金管理人收取。

本基金的申购费用在基金申购人承担,不列入基金财产,主要用于本基金的市场推广、销售、注册登记等各项费用。

投资者可以多次申购本基金,申购费率按每笔申购申请单独计算。

本基金的申购费率如下:

申购金额(含申购费)	申购费率	赎回费率
100万以下	1.5%	1.5%
100万(含)-500万	1.0%	1.0%
500万(含)以上(含500万)	0.6%	每笔交易1000元

### 1、与基金运作有关的费用

(一)基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下:

H=E×年管理费率÷当年天数,本基金年管理费率为1.5%

H为每日应计提的基金管理费

E为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月月初2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、公休假等,支付日期顺延。

#### (二)基金托管人的托管费

在本基金托管费,基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下: