证券代码:002480 证券简称:新筑股份 公告编号:2013-074

成都市新筑路桥机械股份有限公司第五届董事会第四次会议决议公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露内容的真实、准确和完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、董事会会议召开情况

成都市新筑路桥机械股份有限公司于2013年11月26日以通讯表决方式召开了第五届董事会第四次会议。本次会议已于2013年11月20日以电子邮件形式发出通知。本次会议由公司董事长黄志明先生召集并主持,应到董事9名,实到董事8名,公司董事会秘书出席了本次会议,董事罗珉先生因出差无法参加本次会议。本次会议的召集、召开符合《公司法》、《公司章程》、《董事会议事规则》等有关规定。

二、董事会会议审议情况

1、审议通过《关于出售资产暨关联交易的议案》

表决结果:同意票4票,反对票0票,弃权票0票。关联董事黄志明、冯克敏、汪省明、彭波回避表决。

具体内容详见2013年11月27日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和巨潮资讯网(www.cninfo.com.cn)披露的《关于出售资产暨关联交易的公告》(公告编号:2013-075)

特此公告

成都市新筑路桥机械股份有限公司董事会

二〇一三年十一月二十六日

证券代码:002480 证券简称:新筑股份 公告编号:2013-075

成都市新筑路桥机械股份有限公司关于出售房产暨关联交易的公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确、完整,不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

一、关联交易概述

成都市新筑路桥机械股份有限公司(以下简称“公司”或“本公司”)第五届董事会第四次会议审议通过了《关于出售房产暨关联交易的议案》,同意公司将所拥有的位于成都市武侯区洗面桥街30号高速大厦20层的办公用房(以下简称“标的资产”)转让给控股股东新筑投资集团有限公司(以下简称“新筑投资”)下属子公司四川新筑路业发展有限公司(以下简称“新筑路业”),以提高公司的资产效率,同时,将彻底解决与新筑路业因上述标的资产租赁产生的关联交易。

新筑路业是本公司控股股东控制的下属企业,根据深交所《股票上市规则》的规定,公司本次向新筑路业转让办公用房的行为构成公司的关联交易。

本次关联交易已经公司第五届董事会第四次会议审议通过,关联董事均回避表决,公司独立董事均事前认可了本次关联交易,并对本次关联交易发表了独立意见。根据深交所《股票上市规则》、《公司章程》、《关联交易管理制度》的相关规定,本次关联交易无需提交公司股东大会审议。

本次关联交易不构成《上市公司重大资产重组管理办法》规定的重大资产重组。

二、关联方基本情况

1、关联方基本信息

关联方名称	四川新筑路业发展有限公司
住所	成都市成华区东三环路二段龙潭工业园
法定代表人	吕晶
注册资本	捌仟万元人民币
实收资本	捌仟万元人民币
公司类型	其他有限责任公司
主营业务	公路工程、市政公用工程;公路工程的技术服务与咨询。
税务登记证号码	川税字510108782280886号
主要股东	新筑投资(出资4400万元,占出资额的55%),吕晶(出资3600万元,占出资额的45%)
实际控制人	黄志明

2、新筑路业历史沿革及经营状况

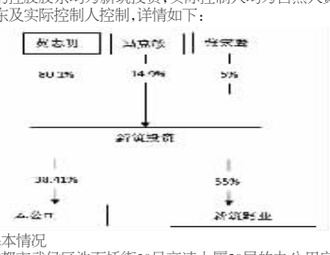
新筑路业是由新筑投资、自然人吕晶先生共同投资设立的有限责任公司。于2005年12月19日成立,取得四川省工商行政管理局核发的注册号为“510000000032072”号《企业法人营业执照》。近年,新筑路业经营情况正常,近一年一期的主要财务数据如下:

单位:万元

项目	2013年1-10月	2012年度
总资产	61,445.57	58,745.01
净资产	10,108.55	18,224.13
营业收入	10,472.91	16,518.06
净利润	-379.60	653.18

3、关联关系的说明

本公司与新筑路业的控股股东均为新筑投资,实际控制人均为自然人黄志明,本公司与新筑路业受同一控股股东及实际控制人控制,详情如下:



三、关联交易标的基本情况

1、标的资产位于成都市武侯区洗面桥街30号高速大厦20层的办公用房,建筑面积为1,087.96 平方米,公司于2001年购置。标的资产不存在抵押、质押或其他第三人权利,亦不存在重大争议、诉讼、仲裁、查封、冻结等事项。

2、截至2013年9月30日,标的资产账面原值为750.75万元,累计折旧429.43万元,账面净值为321.32万元。公司聘请了具有执行证券、期货相关业务资格的评估机构中水致远资产评估有限公司对标的资产进行了评估,于2013年11月18日出具了中水致远评报字[2013]第3031号《资产评估报告》(评估基准日:2013年9月30日),评估方法为市场法,评估值为1,249.63万元。

四、关联交易的定价政策及定价依据

考虑到标的资产购置时间较早,近年来升值幅度较大,市场价格远高于账面价值,交易双方以上述《资产评估报告》的评估价格1,249.63万元(评估方法为市场法)作为资产转让的交易价格。

五、交易目的和对上市公司的影响

1、交易目的

(1)消除与新筑路业之间因标的资产租赁产生的关联交易

公司于2010年11月26日与新筑路业签订了标的资产部分租房协议(租用面积250平方米),租期3年(2010年11月30日至2013年11月30日),租约将于2013年11月30日到期,通过本次转让资产,公司将彻底消除与新筑路业之间因标的资产租赁产生的关联交易。

(2)变现使用效率较低的资产,提高资产效率

标的资产建筑面积为1,087.96平方米,新筑路业租用面积占标的资产面积约23%,剩余部分未能合理、充分利用,公司目前也无自用剩余部分的相应计划。通过本次转让资产,将公司使用效率较低的资产及时变现,提高了公司资产效率。

2、对上市公司的影响

经过初步测算,扣除交易环节的税费及企业所得税后,本次交易增加公司2013年的净利润约688万元,但不影响公司2013年度业绩预计。

六、本年年初至披露日与该关联人累计发生的各类关联交易总金额

除本次关联交易外,公司年初至披露日与新筑路业发生房屋租赁费用14.40万元、电费2.40万元,合计16.80万元。

七、独立董事意见

公司事前已向独立董事提交了相关资料,独立董事进行了事前审查,同意将该关联交易事项提交第五届董事会第四次会议审议。

独立董事针对本次关联交易发表的独立意见如下:本次关联交易定价公允合理,不存在损害公司及其他股东,特别是中小股东的利益。公司董事会在审议该议案的过程中,关联董事回避了表决,表决程序合法、表决结果有效,符合《公司法》和《公司章程》等规范性文件的规定。

八、其他

公司尚未与新筑路业就上述交易签署协议,公司将及时披露该交易的后续进展情况,请投资者关注。

九、备查文件

1、第五届董事会第四次会议决议;

2、独立董事关于关联交易的事前认可意见;

3、独立董事关于关联交易的独立意见;

4、资产评估报告。

成都市新筑路桥机械股份有限公司董事会

二〇一三年十一月二十六日

证券代码:600283 证券简称:钱江水利 公告编号:临2013-039

钱江水利开发股份有限公司2013年度第一期短期融资券发行结果公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

公司于2012年4月25日召开2011年度股东大会,审议通过了公司申请发行不超过人民币4亿元(含4亿元)短期融资券的议案。2012年9月17日,经中国银行间市场交易商协会核准,同意接受公司短期融资券注册,注册金额为人民币4亿元,注册额度自通知书发出之日起2 年内有效。

2013年11月25日,公司完成了钱江水利开发股份有限公司2013年度第一期短期融资券的发行工作,本次发行规模为人民币2亿元,目前该募集资金已全部到账。

现将发行结果公告如下:

短期融资券名称	钱江水利开发股份有限公司2013年度第一期短期融资券	短期融资券简称	13钱江水利CP001
短期融资券代码	041360083	短期融资券期限	365天
计息方式	附息固定	发行日	2013年11月22日
实际发行总额	人民币2亿元	计划发行总额	人民币2亿元
票面价格	人民币100元/百元面值	票面利率	7.00%
主承销商	兴业银行股份有限公司		

本期短期融资券募集资金主要用于偿还银行贷款和补充公司流动资金。

本期短期融资券的发行情况详见中国货币网(http://www.chinamoney.com.cn)和上海清算所网站(http://www.shclearing.com)的公告。

特此公告。

钱江水利开发股份有限公司董事会

2013年11月27日

民生加银基金管理有限公司关于民生加银现金增利货币市场基金网上直销快速赎回业务升级的公告

为进一步满足投资者的理财需求,民生加银基金管理有限公司(以下简称“本公司”)自2013年11月27日起对民生加银现金增利货币市场基金网上直销快速赎回服务(以下简称“快速赎回”)进行全面升级,具体公告如下:

一、业务规则变动内容

1、快速赎回适用于符合相关法律法规规定、使用以下银行借记卡(或支付账户)开通基金直销网上交易方式的个人投资者:

民生银行、建设银行、农业银行、招商银行、易宝第三方支付(含工商银行、农业银行、中国银行、建设银行、交通银行、光大银行、招商银行、兴业银行、中信银行、浦发银行、平安银行、温州银行);

本公司后续如新增上线支持快速赎回服务的银行卡(或支付账户),届时可在本公司网站“快速赎回”页面查询,不再另行公告。

2、延长快速赎回业务受理时间:

自公告之日起每个自然日0:00-24:00(即7*24小时)均可办理民生加银现金增利货币市场基金的快速赎回业务。本公司可根据业务发展需要,调整上述业务受理时间。如有变更,请以最新公告为准。

3、提高快速赎回份额上限:

单个投资者单笔快速赎回份额上限调整为500000份;

单日单个投资者快速赎回累计上限调整为500000份。

4、提高可赎回比例:

单个投资者可快速赎回份额与可用份额的占比调整为100%。

5、提高每日可赎回次数:

单个投资者单日可赎回次数调整为5次。

6、快速赎回的份额在快速赎回申请所属自然日起(含当日)的基金收益归本公司所有。

举例说明:

快速赎回申请时间	快速赎回的份额对应收益归属
2013年11月20日24:00前	截至2013年11月19日(含19日)的收益归投资者,2013年11月20日之后(含20日)的收益归本公司

二、业务操作流程

投资者访问本公司网站www.msjyfund.com.cn,登录民生加银基金管理有限公司网上直销交易系统后,点击“基金交易—快速赎回”菜单,根据页面提示选择要进行快速赎回的支付账户和货币基金,输入赎回份额,预览并提交申请,直至提示交易成功即可。

三、投资者可通过以下途径了解或咨询详情:

民生加银基金管理有限公司网站:www.msjyfund.com.cn

民生加银基金管理有限公司客服热线:400-8888-388转0 (免长话费)

民生加银基金管理有限公司客服信箱:services@msjyfund.com.cn

四、其他提示

有关民生加银现金增利货币市场基金“网上直销快速赎回服务”相关宣传材料与本公告内容不一致的,以本公告为准。

投资者在办理业务前,应认真阅读《民生加银基金管理有限公司网上直销快速赎回用户服务协议》等相关文件。

本公司可对所有投资者的快速赎回总额设定限额,如当日快速赎回总额接近、等于或超过本公司设定的限额,本公司可临时暂停快速赎回业务,并视情况及时恢复该业务。

民生加银基金管理有限公司网上直销快速赎回服务的解释权归本公司所有,本公司可根据业务发展情况,对业务规则做出必要的调整并提前予以公告。

本公司承诺以诚实信用、勤勉尽责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。投资者购买货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构。投资有风险,请谨慎选择。

特此公告。

民生加银基金管理有限公司

二〇一三年十一月二十七日

易方达基金管理有限公司关于增加上海银行为易方达天天理财货币市场基金销售机构及在上海银行开通定期定额申购业务的公告

根据易方达基金管理有限公司(以下简称"本公司")与上海银行股份有限公司(以下简称"上海银行")签署的基金销售协议,本公司自2013年11月27日起增加上海银行为易方达天天理财货币市场基金(以下简称"本基金")的销售机构。同时为满足广大投资者的理财需求,经本公司与上海银行协商一致,自2013年11月27日起,本基金A类基金份额在上海银行开通定期定额申购业务。

一、关于定期定额申购业务

定期定额申购业务是指投资者可通过基金管理人指定的销售机构提交申请,约定每期扣款时间、扣款金额,由指定的销售机构于每期约定扣款日在投资者指定资金账户内自动完成扣款,并提交基金申购申请的一种长期投资方式,该业务相关规定如下:

(1)除另有公告外,定期定额申购费率与日常申购费率相同。

(2)定期定额申购每期扣款金额:本基金A类基金份额的每期扣款金额不低于人民币100元,不设金额级差,上海银行可在此基础上规定自己的最低扣款金额。上海银行将按照与投资者申请时所约定的每期约定扣款日、扣款金额扣款,并在与基金日常申购业务相同的受理时间内提交申请。若遇非基金开放日时,扣款是否顺延以上海银行的具体规定为准。具体扣款方式以上海银行的相关业务规则为准。

(3)基金的注册登记人按照基金申购申请日(T日)的基金份额净值为基准计算申购份额,申购份额通常将在 T+1工作日确认成功后直接计入投资者的基金账户,投资者可自T+2工作日起查询申购成交情况。

(4)当发生限制申购或暂停申购的情形时,除另有公告外,定期定额申购与日常申购按相同的原则确认。

(5)定期定额申购业务的其它具体办理程序请遵循上海银行的有关规定。

二、投资者可通过以下途径咨询有关详情

1. 上海银行

注册地址:上海市浦东新区银城中路168号

办公地址:上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人:范一飞

联系人:汤征程

联系电话:021-68475888

开放式基金咨询电话:95594

开放式基金业务传真:021-68476111

网址:www.bankofshanghai.com

上海银行在以下主要地区各营业网点为投资者办理开户和本基金的申购、赎回、定期定额申购和转换等业务:

上海、宁波、南京、杭州、天津、成都、深圳、北京、苏州、无锡等。

2.易方达基金管理有限公司

客户服务电话:400-881-8088

网址:www.efunds.com.cn

风险提示: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,也不保证最低收益。投资者投资于本基金前应认真阅读本基金的基金合同和招募说明书。敬请投资者注意投资风险。

特此公告。

易方达基金管理有限公司

2013年11月27日

证券代码:600458 证券简称:时代新材 编号:临2013-062

株洲时代新材料科技股份有限公司重大资产重组进展暨延期复牌公告

本公司董事会及全体董事保证本公告内容不存在任何虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏,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。

株洲时代新材料科技股份有限公司(以下简称"公司")2013 年8月29日披露了《重大资产重组的停牌公告》,公司股票于2013 年8月29日起连续停牌。经申请,公司于2013年9月10日、2013年10月30日两次发布《重大资产重组延期复牌公告》,公司申请停牌时间至2013年11月29日。

自停牌之日起,公司与中介机构积极推进相关尽职调查、审计评估、盈利预测等各项工作,不断研究完善方案,持续与有关主管部门沟通,并及时履行信息披露义务,披露工作进展情况。本次重大资产重组的方案初步拟定为:公司拟以自有资金和银行贷款的形式筹集资金,现金收购德国采埃孚股份公司(ZF Friedrichshafen AG)橡胶金属业务相关的股权和资产,助推公司突破发展瓶颈,实现核心主业持续发展。

由于本次收购标的规模较大,股权结构复杂,目前公司对收购标的的尽职调查、与标的主要客户的预沟通、与卖方采埃孚股份公司就员工剥离与转移、过渡期服务等方面的谈判以及向国家主管部门的报批(备)工作仍在进行当中,因此公司股票无法在原计划时间复牌。

公司将积极推进本次重大事项的各项工作,为避免公司股价异常波动,切实维护投资者利益,经申请,公司股票将延期复牌,预计复牌时间不晚于2013年12月30日,并力争早日复牌。停牌期间,公司将及时履行信息披露义务,每五个交易日发布一次进展情况公告。

该事项仍存在不确定性,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

株洲时代新材料科技股份有限公司

董事会

2013 年11月27日

(上接B30版)

注册地址	深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦40-42层		
法定代表人	卢长才		
网址	www.csco.com.cn		

68)宏源证券股份有限公司

注册地址	新疆乌鲁木齐市文艺路233号		
法定代表人	冯戎	联系人	李巍
客服电话	400-800-0562	网址	www.hysec.com

69)国海证券股份有限公司

注册地址	广西桂林市辅星路13号		
法定代表人	张雅锋	联系人	牛孟宇
客服电话	95563	网址	www.ghzq.com.cn

70)方正证券股份有限公司

注册地址	北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦11层		
法定代表人	雷杰		
客服电话	95571	网址	http://www.foundersc.com

71)信达证券股份有限公司

注册地址	北京市西城区闹市口大街9号院1号楼		
法定代表人	高冠江	联系人	唐静
客服电话	400-800-8899	网址	www.cindasc.com

72)华龙证券有限责任公司

注册地址	甘肃省兰州市东岗西路638号		
法定代表人	李晓安	联系人	李昕田
客服电话	96668、4006898888	网址	www.hlzqgs.com

73)西部证券股份有限公司

注册地址	西安市东新街232号陕西信托大厦16-17层		
法定代表人	刘建武	联系人	刘莹
客服电话	95582	网址	www.westsecu.com.cn

74)红塔证券股份有限公司

注册地址	云南省昆明市北京路155号附1号红塔大厦9楼		
法定代表人	况雨林	联系人	高国泽
客服电话	400-871-8880	网址	www.hongtastock.com

75)浙商证券股份有限公司

注册地址	浙江省杭州市杭大路1号黄龙世纪广场A6/7		
法定代表人	吴承根		
客服电话	0571-967777	网址	www.stocke.com.cn

76)天风证券股份有限公司

注册地址	湖北省武汉市东湖新技术开发区关东园路2号高科大厦4楼		
法定代表人	余磊	联系人	刘鑫
客服电话	028-86711410;027-87618882	网址	www.tfzq.com

77)西藏同信证券有限责任公司

注册地址	西藏自治区拉萨市北京中路101号		
法定代表人	贾绍君	联系人	王钧
客服电话	400-881-1177	网址	www.xzsec.com

78)英大证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区深南中路华能大厦30、31层		
法定代表人	吴骏		
客服电话	4000-188-688	网址	www.ydsc.com.cn

79)华融证券股份有限公司

注册地址	北京市西城区金融大街8号		
法定代表人	宋德清	联系人	黄恒
客服电话	010-58568118	网址	www.hrsec.com.cn

80)国开证券有限责任公司

注册地址	北京市朝阳区安华外馆斜街甲1号泰利明苑写字楼A座二区4层		
法定代表人	黎维彬	联系人	朱瑜
客服电话	010-51789309	网址	www.gkzq.com.cn

81)日信证券有限责任公司

注册地址	呼和浩特市新城区锡林南路18号		
法定代表人	孔佑杰	联系人	文思婷
客服电话	400-660-9839	网址	http://www.rxzq.com.cn

82)大通证券股份有限公司

注册地址	辽宁省大连市沙河口区会展路129号大连国际金融中心A座-大连期货大厦38、39层		
法定代表人	张智河	联系人	谢立军
客服电话	4008-169-169	网址	www.daton.com.cn

83)国盛证券有限责任公司

注册地址	江西省南昌市北京西路88号(江信国际金融大厦)		
法定代表人	曾小普	联系人	陈明
客服电话	400-8222-111	网址	www.gsstock.com

84)国金证券股份有限公司

注册地址	成都市青羊区东城根上街95号		
法定代表人	冉云	联系人	刘一宏
客服电话	4006-600109	网址	www.gjzq.com.cn

85)华林证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区民田路178号华融大厦5、6楼		
法定代表人	薛荣年	联系人	王叶平
客服电话	全国统一客服热线400-188-3888; 全国统一电话委托号码:400-880-2888	网址	www.chinalions.com

86)中山证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区益田路6009号新世界商务中心29层		
法定代表人	吴永良	联系人	刘军
客服电话	400-1022-011	网址	http://www.zszq.com/

87)华鑫证券有限责任公司

注册地址	深圳市福田区金田路4018号安联大厦28层A01、B01(b)单元		
法定代表人	洪家新	联系人	陈敏
客服电话	021-32109999;029-68918888	网址	www.cfsc.com.cn

88)开源证券有限责任公司

注册地址	西安市高新区锦业路1号都市之门B座5层		
法定代表人	李刚	联系人	王姣
客服电话	400-860-8866	网址	www.kysec.cn

89)华安证券有限责任公司

注册地址	安徽省合肥市长江中路357号		
法定代表人	李工	联系人	甘霖
客服电话	96518(安徽);400-809-6518(全国)	网址	www.hazq.com

90)五矿证券有限公司

注册地址	深圳市福田区金田路4028号荣超经贸中心办公楼47层01单元		
法定代表人	张永衡	联系人	赖君伟
客服电话	400-184-0028	网址	www.wkzq.com.cn

(2)场内代销机构

具有基金代销业务资格的深圳证券交易所会员单位。

基金管理人可根据《基金法》、《运作办法》、《销售办法》和基金合同等的规定,选择其他符合要求的机构代理销售本基金,并及时履行公告义务。

(二)注册登记机构

名称	中国证券登记结算有限责任公司		
住所及办公地址	北京市西城区太平桥大街17号		
法定代表人	金颖	联系人	崔巍
电话	010-66210988、010-59378888	传真	010-66210938

(三)出具法律意见书的律师事务所

名称	北京市众一律师事务所		
住所及办公地址	北京市东城区东四十条甲22号南新仓国际大厦A座502室		
负责人	常建	联系人	云大慧
电话	010-64096089	传真	010-64096188
经办律师	云大慧、胡广志		

(四)会计师事务所及经办注册会计师

名称	安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)		
办公地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼(即东3办公楼)16层		
执行事务人	吴港平	联系人	王珊珊
电话	010-58153280;010-58152145	传真	010-85188298
经办注册会计师	李慧民、王珊珊		

五、基金的类型

股票型基金

六、基金的运作方式

上市契约型开放式

七、基金的投资目标

本基金运用指数化投资方法,通过严格的投资流程约束和数量化风险管理手段,追求跟踪误差最小化,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。

八、基金的投资范围

本基金投资于具有良好流动性的金融工具,包括沪深300指数的成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、现金和到期日在一年以内的政府债券等。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%,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%。在保证流动性的前提下,如果法律法规允许,在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种(如股票指数期货等金融产品),基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

九、基金的投资策略

本基金原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的组成及其基准权重构建股票投资组合,以拟合、跟踪沪深300指数的收益表现,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。

如未来法律法规或中国证监会允许,本基金还将投资于股票指数期货以及其他与标的指数或标的指数成份股相关的金融产品,以使基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数。基金拟投资于新的金融产品的,需将有关投资方案和基金托管人协商一致,并在报中国证监会备案后公告。

1.资产配置策略

本基金管理人主要按照沪深300指数的成份股组成及其权重构建股票投资组合,并根据指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。本基金投资于沪深300指数成份股及备选成份股的组合比例不低于基金资产净值的90%,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%,在保证流动性的前提下,如果法律法规允许,在履行适当程序后则本基金的股票组合投资比例可以提高到基金资产净值的100%。

2.股票投资组合构建

(1)组合构建原则

本基金原则上通过完全复制指数的方法,根据沪深300指数成份股组成及其基准权重构建股票投资组合。

(2)组合构建方法

本基金原则上采用完全复制法,按照成份股在沪深300指数中的基准权重构建股票投资组合。当预期成份股发生调整,成份股发生配股、增发、分红等行为,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪沪深300指数的效果可能带来影响,导致无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以根据市场情况,采取合理措施,在合理期限内进行适当的处理和调整,以力争使跟踪误差控制在限定的范围之内。

但因特殊情况(比如市场流动性不足、个别成份股被限制投资等)导致本基金无法获得足够数量的股票时,基金管理人将搭配使用其他合理方法(如买入非成份股等)进行适当的替代。

(3)组合调整

本基金所构建的股票投资组合原则上根据沪深300指数成份股组成及其权重的变动而进行相应调整。同时,本基金还将根据法律法规和基金合同中的投资比例限制、申购赎回变动情况、股票增发因素等变化,对股票投资组合进行实时调整,以保证基金净值增长率与沪深300指数收益率之间的高度正相关和跟踪误差最小化。

①定期调整

根据沪深300指数的调整规则和备选股票的预期,对股票投资组合及时进行调整。

②临时调整

A.当上市公司发生增发、配股等影响成份股在指数中权重的行为时,本基金将根据各成份股的权重变化及时调整股票投资组合;

B.根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪沪深300指数;

C. 根据法律、法规的规定,成份股在沪深300指数中的权重因其它原因发生相应变化的,本基金将做相应调整,以保持基金资产中该成份股的权重同指数一致。

(4)投资绩效评估

本基金日均跟踪偏离度的绝对值力争不超过0.35%,年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施将跟踪误差控制在限定的范围之内。

3.投资决策依据和决策流程

1)决策依据

(1)国家有关法律、法规、基金合同和标的指数编制、调整等相关规定,以及基金管理人事先制定的指数复制和跟踪策略,并以维护基金份额持有人利益为最高准则;

(2)国家宏观经济运行态势和证券市场走势。

2)决策程序

(1)投资管理部金融工程小组运用风险监测模型以及各种风险监控指标,结合公司内外研究报告,对市场预期风险和指数化投资组合风险进行风险测算与归因分析,依此提出研究分析报告;

(2)A股投资决策委员会依据投资管理部提供的研究报告,定期召开或遇重大事项时召开投资决策会议,决策相关事项。基金经理根据投资决策委员会的决议,进行基金投资管理的日常决策;

(3)根据标的指数,结合研究报告,基金经理原则上依据指数成份股的权重构建组合,在追求跟踪误差最小化的前提下,基金经理将采取适当的方法,以降低交易成本、控制投资风险;

(4)交易管理部根据基金经理下达的交易指令制定交易策略,完成具体证券品种的交易;

(5)投资管理部绩效与风险评估小组根据市场变化定期和不定期对投资组合进行投资绩效评估,并提供相关绩效评估报告。监察稽核部对投资计划的执行进行日常监督和实时风险控制;

(6)基金经理根据跟踪标的指数变动,结合成份股基本面情况、流动性状况、基金申购和赎回的现金流量情况,投资管理部和监察稽核部提供的绩效评估报告以及对各种风险的监控和评估结果,对投资组合进行监控和调整,密切跟踪标的指数。

十、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

由于本基金的投资标的为沪深300指数,且本基金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5%,因此,本基金将业绩比较基准定为95%×沪深300指数收益率+5%×商业银行活期存款利率(税后)。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩基准的指数时,本基金可以在基金管理人和基金托管人协商一致,履行适当程序后变更业绩比较基准并及时公告。

十一、风险收益特征

本基金为复制指数的股票型基金,具有较高风险、较高预期收益的特征,其风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

十二、投资组合报告

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。

基金托管人中国建设银行根据本基金合同规定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。

本投资组合报告所载数据截至2013年9月30日(财务数据未经审计)。

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	259,395,724.89	92.04
	其中:股票	259,395,724.89	92.04
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	22,370,568.87	7.94
6	其他资产	73,593.63	0.03
7	合计	281,839,887.39	100.00

2.报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1报告期末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	1,969,263.44	0.70
B	采矿业	18,084,140.11	6.45
C	制造业	93,309,508.58	33.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,848,162.39	2.80
E	建筑业	9,325,221.54	3.32
F	批发和零售业	8,376,182.51	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	5,966,303.99	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,676,503.09	2.38
J	金融业	87,072,861.50	31.04
K	房地产业	13,039,289.13	4.65
L	租赁和商务服务业	1,995,160.14	0.71
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	1,946,049.20	0.69
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	1,027,286.98	0.37
S	综合	2,759,792.29	0.98
	合计	259,395,724.89	92.47

2.2报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	600016	民生银行	1,161,211	11,101,177.16	3.96
2	600036	招商银行	848,261	9,263,010.12	3.30
3	601166	兴业银行	587,704	6,564,653.68	2.34
4	601318	中国平安	172,238	6,148,896.60	2.19
5	600000	浦发银行	575,313	5,804,908.17	2.07
6	601398	工商银行	1,351,527	5,216,894.22	1.86
7	600837	海通证券	415,956	5,203,609.56	1.85
8	000002	万 科A	497,692	4,543,927.96	1.62
9	600030	中信证券	354,143	4,352,417.47	1.55
10	601328	交通银行	806,870	3,469,541.00	1.24

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

注:本基金本报告期末未持有积极投资股票。

4.报告期末按债券品种分类的债券投资组合

注: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名的前五名债券投资明细

注: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名的前十名资产支持证券投资明细

注: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名的前五名权证投资明细

注:本基金本报告期末未持有权证。

8.报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有股指期货。

9.报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未持有国债期货。

10.投资组合报告附注

10.1本基金投资的前十名证券中包括中国平安(股票代码:601318)。

根据中国平安股票发行主体中国平安保险(集团)股份有限公司于2013年5月21日发布的公告,该上市公司的控股子公司平安证券有限责任公司在保荐万福生科(湖南)农业开发股份有限公司发行上市过程中受到中国证券监督管理委员会的行政处罚,罚款金额为5,110万元,同时其保荐机构资格被暂停3个月。

在上述公告公布后,本基金管理人对上述上市公司进行了进一步了解和分析,认为上述处罚不会对中国平安的投资价值构成实质性负面影响,因此本基金管理人对上述上市公司的投资判断未发生改变。

报告期内,本基金投资的前十名证券的其余九名证券的发