

# 浦银安盛基金管理有限公司

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

招募说明书摘要（更新）

2011 年第 2 号

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

内容截止日：2011 年 12 月 10 日

---

---

## 重要提示

本基金经 2010 年 7 月 14 日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】961 号文核准募集。

基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。

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，但不保证投资本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益；因基金价格可升可跌，亦不保证基金份额持有人能全数取回其原本投资。

本基金投资于证券市场，基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动。投资者在投资本基金前，需全面认识本基金产品的风险收益特征和产品特性，充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，对认(申)购基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者根据所持有份额享受基金的收益，但同时也需承担相应的投资风险。投资本基金可能遇到的风险包括：因政治、经济、社会等因素对证券价格波动产生影响而引发的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资策略所特有的风险等等。

投资有风险，投资人在认(申)购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成新基金业绩表现的保证。

本招募说明书所载内容截止日为 2011 年 12 月 10 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2011 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

---

---

## 目 录

目 录 .....	1
一、基金管理人.....	2
二、基金托管人.....	6
三、相关服务机构 .....	7
四、基金的名称.....	14
五、基金的类型.....	14
六、基金的投资目标 .....	14
七、基金的投资范围 .....	14
八、投资策略 .....	15
九、业绩比较基准 .....	18
十、风险收益特征 .....	18
十一、基金的投资组合报告.....	19
十二、基金业绩.....	22
十三、基金费用概览 .....	26
十四、对招募说明书更新部分的说明 .....	29

## 一、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：浦银安盛基金管理有限公司

住所：上海市浦东新区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：上海市卢湾区淮海中路 381 号中环广场 38 楼

邮政编码：200020

法定代表人：姜明生

成立时间：2007 年 8 月 5 日

批准设立机关及批准设立文号：中国证监会证监基金字[2007]207 号

组织形式：有限责任公司

注册资本：2 亿元

存续期间：持续经营

股权结构：上海浦东发展银行（以下简称“浦发银行”）持有 51%的股权；法国安盛投资管理有限公司（以下简称“安盛投资”）持有 39%的股权；上海盛融投资有限公司（以下简称“上海盛融”）持有 10%的股权。

电话：(021) 23212888

传真：(021) 23212800

客服电话：400-8828-999；(021) 33079999

网址：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

联系人：徐莹

### （二）主要人员情况

#### 1、董事会成员

姜明生先生，董事长，本科学历。历任中国工商银行总行信托投资公司业务一部副总经理；招商银行总行信托投资部副总经理；招商银行北京分行行长助理；招商银行广州分行副行长（主持工作）；招商银行总行公司银行部总经理；招商银行上海分行党委书记、副行长（主持工作）；招商银行上海分行党委书记、行长。2007 年 4 月加入上海浦东发展银行，任总行党委委员。2007 年 9 月起任上海浦东发展银行总行副行长，2007 年 10 月至今兼上海浦东发展银行上海分行党委书记、行长。自 2009 年 11 月起兼任本公司董事长。

Bruno Guilloton 先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺技术学

院。于 1999 年加盟安盛投资管理（巴黎）公司，担任股票部门主管。2000 年至 2002 年，担任安盛投资管理（东京）公司首席执行官。2002 年，任职安盛罗森堡公司和安盛投资管理公司的亚洲区域董事。2005 年起，担任安盛投资管理公司内部审计全球主管。现任安盛投资管理公司亚洲股东代表。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。

刘以研先生，董事，工商管理硕士，高级经济师。1985 年 8 月参加工作，2006 年 1 月调入上海浦东发展银行，负责筹建长春分行，开业后任长春分行行长。2008 年 3 月任上海浦东发展银行总行个人银行总部总经理。2011 年 6 月起担任上海浦东发展银行总行人力资源部总监。自 2008 年 6 月起兼任本公司董事。

刘长江先生，董事。1998 年至 2003 年担任中国工商银行总行基金托管部副处长、处长，2003 年至 2005 年担任上海浦东发展银行总行基金托管部总经理，2005 年至 2008 年担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部资产托管部总经理、期货结算部总经理，2008 年至今担任上海浦东发展银行总行公司及投资银行总部副总经理，兼资产托管部总经理。自 2011 年 3 月起兼任本公司董事。

James Young 先生，董事，本科学位，新西兰国籍。2006 年 1 月起担任 AXA Rosenberg 亚太地区首席运营官，自 2009 年 12 月 15 日起兼任本公司董事。

章曦先生，董事，经济学博士，高级经济师。历任上海张江集成电路产业区开发有限公司总经理，上海张江高科技园区开发股份有限公司审计法务室主任、董事会秘书、副总经理、财务总监。2006 年 3 月起至今担任上海建筑材料（集团）总公司副总裁，2009 年 12 月起至今担任上海国盛（集团）有限公司财务总监。2010 年 1 月起兼任本公司董事。

王家祥女士，独立董事。1980 年至 1985 年担任上海侨办华建公司投资项目部项目经理，1985 年至 1989 年担任上海外办国际交流服务有限公司综合部副经理，1989 年至 1991 年担任上海国际信托投资有限公司建设部副经理，1991 年至 2000 年担任正信银行有限公司（原正大财务有限公司）总裁助理，2000 年至 2002 年担任上海实业药业有限公司总经理助理，2002 年至 2006 年担任上海实业集团有限公司顾问。自 2011 年 3 月起，担任本公司独立董事。

吴伟聪（Michael WU）先生，独立董事，英国国籍，香港大学法学学士。历任香港证券及期货事务监察局（仲裁监管部）董事、执行董事、副主席、首席运营官，中国证监会顾问，中国证监会策略和发展委员会委员，汇富金融控股有限公司中国区主席。Michael WU 先生现阶段同时兼任了汇富金融控股有限公司、

深圳投资有限公司、贸易通电子贸易有限公司、第一电讯集团有限公司及首华金融控股有限公司的独立董事，上海证券交易所指数咨询委员会主席，中证指数有限公司指数咨询委员会主席。自 2008 年 10 月起兼任本公司独立董事。

尹应能 (Richard Yin) 先生，独立董事，澳大利亚国籍，英格兰及威尔士特许会计师协会和澳大利亚特许会计师协会的资深会员，有十年以上在各类监管机构任职的经历。现任 First Vanguard Group Ltd 集团主席。自 2007 年 8 月起兼任本公司独立董事。

## 2、监事会成员

黄跃民先生，监事长，华东师范大学世界现代史专业硕士研究生。现任上海盛融投资有限公司总裁。自 2007 年 8 月起兼任本公司监事长。

廖正旭先生，监事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。现任安盛罗森堡投资管理有限公司亚太地区高级研究主任。自 2011 年 3 月起兼任本公司监事。

戴刚先生，职工监事，伦敦 MIDDLESEX 大学商学院工商管理硕士 (MBA)，上海国家会计学院会计专业硕士 (MPAcc)，美国特许金融分析师 (CFA)。现任本公司风险管理部总监。自 2007 年 8 月起兼任本公司职工监事。

## 3、公司总经理及其他高级管理人员

钱华先生，北京大学政治经济学专业硕士研究生学历，经济学硕士学位。曾先后在江苏省委党校、中国人民银行总行和中国华阳金融租赁有限公司从事研究、管理等岗位工作；1994 年 1 月至 1998 年 3 月间，在国泰证券有限公司担任基金部副总经理；1998 年 3 月至 2003 年 1 月间，任职国泰基金管理有限公司投资总监；2003 年 1 月至 2006 年 10 月期间，在国联安基金管理有限公司担任副总经理之职；2006 年 11 月至 2008 年 5 月间，在安信证券股份有限公司公司任职管理委员会委员、拟任副总裁；2008 年 6 月至 2010 年 9 月期间，担任万家基金管理有限公司主管投资管理的副总经理；自 2010 年 12 月 23 日起，担任本公司总经理之职。

陈麓 (Hiram Chen) 先生，密苏里大学学士学位，芝加哥大学工商管理硕士学位。历任 AXA Rosenberg 旧金山的全球交流主管、AXA IM 中国业务发展董事。现任本公司副总经理兼首席运营官。2007 年 8 月起，担任本公司副总经理兼首席运营官至今。

周文桐先生 (Alex Zhou)，美国国籍。北京大学生物学学士，美国西北大学

分子生物学博士，芝加哥大学工商管理硕士。1999 年至 2009 年任职美国奥本海默基金公司，先后担任研究员和基金经理之职。2009 年 10 月被法国安盛投资管理有限公司（亚太区）聘用，并委派至公司担任副总经理兼首席投资官之职。2011 年 3 月起兼任浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理。

喻庆先生，中国政法大学经济法专业硕士和法务会计专业研究生学历，中国人民大学应用金融学硕士研究生学历。历任申银万国证券有限公司国际业务总部高级经理；光大证券有限公司（上海）投资银行部副总经理；光大保德信基金管理有限公司副督察长、董事会秘书和监察稽核总监。2007 年 8 月起，担任本公司督察长至今。

#### 4、本基金基金经理

陈士俊先生，清华大学管理学博士。2001 年 7 月至 2003 年 6 月，任国泰君安证券有限公司研究所金融工程研究员。2003 年 7 月至 2007 年 9 月，任银河基金管理有限公司金融工程部研究员、研究部主管。2007 年 10 月至今，任浦银安盛基金管理有限公司金融工程部总监，2010 年 12 月 10 日起兼任本基金基金经理。具有 10 年证券从业经历。陈士俊先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。

#### 5、投资决策委员会成员

周文桐先生（Alex Zhou），投决会主席，本公司副总经理兼首席投资官，兼任浦银安盛货币市场证券投资基金基金经理。

陈麓（Hiram Chen）先生，本公司副总经理兼首席运营官。

李宏宇先生，本公司首席市场营销官。

黄列先生，本公司研究部总监。

陈士俊先生，本公司金融工程部总监兼浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金基金经理。

戴刚先生，本公司风险管理部总监，兼任本公司职工监事。

吴勇先生，本公司旗下浦银安盛红利股票基金及浦银安盛精致生活混合基金基金经理。

蒋建伟先生，本公司旗下浦银安盛价值成长股票基金基金经理。

总经理、督察长、其他基金经理及基金经理助理列席投资决策委员会会议。

6、上述人员之间均不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### （一）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司（简称：中国建设银行）

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：张建国（代行）

成立时间：2004 年 09 月 17 日

组织形式：股份有限公司

注册资本：贰仟叁佰叁拾陆亿捌仟玖佰零捌万肆仟元

存续期间：持续经营

基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12 号

联系人：尹 东

联系电话：(010) 6759 5003

### （二）主要人员情况

杨新丰，投资托管服务部副总经理（主持工作），曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管服务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

### （三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至 2011 年 6 月 30 日，中国建设银行已托管 195 只证券投资基金。建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。



---

---

2010 年初，中国建设银行被总部设于英国伦敦的《全球托管人》杂志评为 2009 年度“国内最佳托管银行”（Domestic Top Rated），并连续第三年被香港《财资》杂志评为“中国最佳次托管银行”。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金份额发售机构

##### 1、直销机构

###### （1）浦银安盛基金管理有限公司上海直销中心

地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

电话：（021）23212899

传真：（021）23212890

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

联系人：徐薇

网址：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

###### （2）电子直销

浦银安盛基金管理有限公司电子直销

交易网站：[www.py-axa.com](http://www.py-axa.com)

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

##### 2、场外代销机构

###### （1）中国建设银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 25 号

办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

法定代表人：郭树清

客户服务电话：95533

网址：[www.ccb.com](http://www.ccb.com)

###### （2）上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 500 号

办公地址：上海市中山东一路 12 号

法定代表人：吉晓辉

电话：（021）61618888

---

---

传真：(021) 63604199

联系人：徐伟、虞谷云

客户服务热线：95528

公司网站：www.spdb.com.cn

(3) 交通银行股份有限公司

办公地址：上海市浦东新区银城中路 188 号

法定代表人：胡怀邦

客服电话：95559

网址：www.95559.com.cn

(4) 中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦 C 座

法定代表人：孔丹

客服电话：95558

网址：bank.ecitic.com

(5) 招商银行股份有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦

法定代表人：秦晓

客服电话：95555

网址：www.cmbchina.com

(6) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

客服电话：400-8888-666

网址：www.gtja.com

(7) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市常熟路 171 号

---

---

法定代表人：丁国荣

客服电话：021-962505

网址：www.sw2000.com.cn

(8) 光大证券股份有限公司

住所：上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人：徐浩明

客服电话：4008888788、10108998

网址：www.ebscn.com

(9) 招商证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38—45 层

法定代表人：宫少林

客户服务热线：95565、4008888111

网址：www.newone.com.cn

(10) 海通证券股份有限公司

住所：上海市广东路 689 号

法定代表人：王开国

客户服务电话：021-95553 或 4008888001

网址：www.htsec.com

(11) 广发华福证券有限责任公司

注册地址：福州市五四路 157 号新天地大厦 7、8 层

法定代表人：黄金琳

客服热线：0591-96326

网址：www.gfzfzq.com.cn

(12) 广发证券股份有限公司

住所：广州市天河北路 183 号大都会广场 43 楼

法定代表人：王志伟

客户服务电话：95575

网址：www.gf.com.cn

(13) 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 号楼信达金融中心

法定代表人：张志刚

客服热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

（14）兴业证券股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 99 号标力大厦

法定代表人：兰荣

客户服务电话：4008888123

网址：www.xyzq.com.cn

（15）宏源证券股份有限公司

注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路 2 号

办公地址：北京市西城区太平桥大街 19 号

法定代表人：冯戎

客服电话：4008-000-562

网址：www.hysec.com

（16）上海证券有限责任公司

地址：上海市黄浦区西藏中路 336 号

法定代表人：郁忠民

客户服务电话：962518

网址：[www.962518.com](http://www.962518.com)

（17）中信建投证券有限责任公司

地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：张佑君

客户服务电话：400-8888-108

公司网址：www.csc108.com

（18）中国银河证券股份有限公司

地址：北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座

法定代表人：顾伟国

客户服务电话：4008-888-8888

---

---

网址: [www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(19) 华泰证券股份有限公司

地址: 江苏省南京市中山东路 90 号华泰证券大厦

法定代表人: 吴万善

客户服务电话: 95597

网址: [www.htsc.com.cn](http://www.htsc.com.cn)

(20) 天相投资顾问有限公司

地址: 北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

法定代表人: 林义相

客户咨询电话: 010-66045566

网址: [www.txsec.com](http://www.txsec.com)

(21) 中国工商银行股份有限公司

住所: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

法定代表人: 姜建清

联系人: 田耕

客户服务热线: 95588

公司网址: [www.icbc.com.cn](http://www.icbc.com.cn)

(22) 民族证券有限责任公司

注册地址: 北京市西城区金融街 5 号新盛大厦 A 座 6-9 层

法定代表人: 赵大建

联系人: 闫寒

客户服务热线: 40088-95618

网址: [www.e5618.com](http://www.e5618.com)

(23) 中信证券股份有限公司

注册地址: 广东省深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

法定代表人: 王东明

联系人: 张于爱

客户服务热线: 400-666-5589

---

---

网址：[www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

(24) 华泰联合证券有限责任公司

注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层

法定代表人：马昭明

联系人：庞晓芸

客户服务热线：95513

网址：[www.lhzq.com](http://www.lhzq.com)

(25) 安信证券股份有限公司

注册地址：深圳市福田区金田路 2222 号安联大厦 34 层、28 层 A02 单元

法定代表人：牛冠兴

联系人：陈剑红

客服电话：020-96210

网址：[www.axzq.com.cn](http://www.axzq.com.cn)

(26) 齐鲁证券股份有限公司

注册地址：山东省济南市经十路 128 号

法定代表人：李玮

联系人：王霖

客服电话：95538

网址：[www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

(27) 民生证券股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门内大街 28 号民生金融中心 A 座 16-18 层

法定代表人：岳献春

联系人：赵明

客服电话：4006198888

网址：[www.msza.com](http://www.msza.com)

(28) 华夏银行股份有限公司

注册地址：北京市东城区建国门那大街 22 号

法定代表人：吴建

联系人：黄斌

---

---

客服电话：95577

网址：<http://www.hxb.com.cn>

(29) 上海银行股份有限公司

地址：上海市浦东新区银城中路168号

法定代表人：陈辛

咨询电话：021-962888

联系人：张萍

网址：[www.bankofshanghai.com](http://www.bankofshanghai.com)

### 3、场内代销机构

名单详见基金份额发售公告。

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，并及时履行信息披露义务。

#### (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：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

办公地址：北京西城区金融大街 27 号投资广场 23 层

法定代表人：金颖

联系人：朱立元

电话：(010) 58598839

传真：(010) 58598907

#### (三) 出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：上海通力律师事务所

办公地址：上海市银城中路 68 号时代金融中心 19 楼

负责人：韩炯

电话：(021) 31358666

传真：(021) 31358600

联系人：安冬

经办律师：安冬、吕红

(四) 审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

公司全称：普华永道中天会计师事务所有限公司

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1233 号汇亚大厦 1604-1608 室

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

法定代表人：杨绍信

电话：(021) 23238888

传真：(021) 23238800

联系人：单峰

经办注册会计师：汪棣、单峰

#### 四、基金的名称

浦银安盛沪深 300 指数增强型证券投资基金

#### 五、基金的类型

契约型开放式

#### 六、基金的投资目标

本基金为股票指数增强型基金，在力求对沪深 300 指数进行有效跟踪的基础上，主要通过数量化模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：力争使基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。

#### 七、基金的投资范围

本基金资产投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为 5%—10%，其中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%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 八、投资策略

本基金以沪深 300 指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，优化股票组合配置结构，一方面严格控制投资组合的跟踪误差，避免大幅偏离目标指数，另一方面在跟踪目标指数的同时，力争获得超越业绩比较基准的收益。

### （一）资产配置策略

在各类投资资产配置上，本基金为保持对目标指数的紧密跟踪，股票资产占基金资产的比例不低于 90%，投资于沪深 300 指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的 80%。本基金还将根据宏观经济趋势、资产估值水平、市场投资者情绪以及宏观经济、市场政策等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态调整股票和债券等资产的配置比例，在控制与目标指数的跟踪误差的前提下，适度获取超越目标指数的收益。

### （二）股票投资策略

#### 1、指数化投资

本基金投资策略是复制目标指数并增强收益表现，即根据目标指数的成份股在指数中的权重比例，在严格控制跟踪误差的基础上构建基金实际投资组合。在控制跟踪误差的过程中，首先要保持对目标指数的深入研究和跟踪调整。

#### （1）定期调整

本基金将按照沪深 300 指数对成份股及其权重的定期调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

#### （2）不定期调整

根据指数编制规则，当沪深 300 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数有限公司发布的临时调整决定，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

### （3）特殊情形下的调整

本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对目标指数中的成份股票加以替换，这些情形包括：①法律法规的限制；②目标指数成份股流动性严重不足；③本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；④成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为、或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等。本基金进行替换遵循以下原则：①用于替换的股票与被替换的股票属于同一行业，经营业务相似度高；②用于替换的股票与被替换的股票的市场价格收益表现具有很强的相关性，能较好地代表被替换股票的收益表现；③用于替换的股票优先从目标指数的其他成份股中挑选，如不能挑选出较合适的替换股票，再考虑从非目标指数成份股的股票中挑选。

## 2、增强型策略

本基金的增强型策略主要包括：A、成份股多因子量化 $\alpha$  增强策略；B、非成份股优选增强策略。本基金的增强型策略的核心是成份股多因子量化 $\alpha$  增强策略。

### （1）成份股多因子量化 $\alpha$ 增强策略

本基金的成份股量化增强策略通过公司自主研发的多因子量化 $\alpha$  模型来实现。该模型包括：价值、盈利动量、质量和技术等四个因子，每个因子分别由多项指标组合而成。其中，价值因子是衡量股票的估值水平，指标包括市盈率、市净率、预测动态市盈率等；盈利动量因子是反映上市公司业绩增长的情况，指标包括盈利增长率、盈利预测修正等；质量因子是反映上市公司资产盈利水平和财务状况，指标包括盈利性、运营效率、债务杠杆和流动性等；技术因子是反映股票市场交易的情况，指标包括价格动量/反转、规模、换手率等。以上四个因子既相互独立，又综合反映了股票市场的诸多驱动因素，并且在不同的市场阶段具有显著不同的收益表现，因此本基金通过该多因子模型能够较好地分析股票市场的运行特征，寻找良好的投资机会。

该模型所使用的数据来自本公司的金融数据库和外部咨询机构的数据库，数据包括上市公司公开披露的各类报表信息，股票市场交易价格信息，以及分析师盈利预测数据等等。模型对上述基础数据进行数据整理，定期计算股票的各因子指标数值，检测各因子指标的市场收益表现，筛选出具有稳定且显著超额收益的

优势指标，构建多因子评分体系。本基金将密切跟踪模型各因子、指标的收益表现及变化，定期对各因子、指标进行回顾分析，并结合当前市场情况，形成对模型因子的收益预期的判断，适时调整各因子的配置权重以及各因子内部指标的构成和权重，更新调整上述多因子评分体系。

根据每个成份股的因子评分结果，以成份股在目标指数中的基准权重为基础，在一定的比例范围内进行超配或低配选择，获取增强型投资收益。

### （2）非成份股优选增强策略

本基金采用定性和定量相结合的方法，在非目标指数成份股中，选择优秀的成长型上市公司股票。非成份股优选的原则包括：①具有高于行业平均的资产收益率和净经营性现金流回报率；②具有高于行业平均的营业收入增长率和盈利增长率；③具有较高的行业技术壁垒，较高的研发投入等。在严格控制非成份股风险暴露度和组合跟踪误差的前提下，本基金通过适度投资于优选的成长型上市公司股票，获取一定的超额收益，增强整体投资组合的收益表现。

### 3、风险预估和控制

为有效地控制基金的跟踪误差，本基金采用公司自有的风险预算模型，根据基金投资组合相对业绩比较基准的资产配置暴露度、行业配置暴露度和个股投资比例暴露度，计算跟踪误差的预估值，对基金的跟踪误差进行估计和控制，预先防范基金收益表现偏离业绩比较基准过大的风险。

同时，本基金还将密切跟踪基金的实际跟踪误差，及时分析跟踪误差的来源，调整基金投资组合，将跟踪误差控制在跟踪目标以内。

4、本基金通过适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

### （三）债券投资策略

本基金债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金基于对国内外宏观经济形势、财政货币政策、以及流动性等因素及其对债券市场影响的深入分析，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定以目标久期管理为核心的债券资产配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金将采用期限结构配置、类属信用利差策略、流动性管理等手段进行

个券投资。

#### （四）权证投资策略

本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化期权定价模型，确定其合理内在价值，从而构建套利交易或避险交易组合以及在合同许可投资比例范围内的投资于价值出现较为显著的低估的权证品种。

### 九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）。

沪深 300 指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国 A 股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国 A 股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映 A 股市场总体发展趋势。

1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）是基于沪深 300 指数成份股的年红利收益率以及主动量化策略增强效应而作为业绩比较基准的一部分。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者沪深 300 指数停止编制或发布，或者由于证券市场重大变化或沪深 300 指数编制方法重大变更导致其不适合继续作为本基金的目标指数，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比较基准的股票指数时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会核准或备案，并在指定媒体上及时公告。

### 十、风险收益特征

本基金是一只股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

## 十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2011 年 09 月 30 日。

### (一) 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	190,081,768.63	92.32
	其中：股票	190,081,768.63	92.32
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	15,697,183.45	7.62
6	其他各项资产	121,782.17	0.06
7	合计	205,900,734.25	100.00

### (二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 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股票。

#### 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	588,976.00	0.29
B	采掘业	25,757,056.38	12.57

C	制造业	77,032,648.67	37.59
C0	食品、饮料	12,099,160.84	5.90
C1	纺织、服装、皮毛	620,351.25	0.30
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	-	-
C4	石油、化学、塑胶、塑料	4,303,198.06	2.10
C5	电子	2,721,393.68	1.33
C6	金属、非金属	17,948,547.73	8.76
C7	机械、设备、仪表	27,289,440.72	13.32
C8	医药、生物制品	11,402,244.39	5.56
C99	其他制造业	648,312.00	0.32
D	电力、煤气及水的生产和供应业	5,425,335.68	2.65
E	建筑业	8,136,258.55	3.97
F	交通运输、仓储业	10,883,336.19	5.31
G	信息技术业	8,020,693.36	3.91
H	批发和零售贸易	5,448,574.65	2.66
I	金融、保险业	36,944,077.31	18.03
J	房地产业	7,011,167.92	3.42
K	社会服务业	1,627,908.00	0.79
L	传播与文化产业	-	-
M	综合类	3,205,735.92	1.56
	合计	190,081,768.63	92.76

## (三) 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

## 1 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	992,922	5,480,929.44	2.67
2	600036	招商银行	463,783	5,129,439.98	2.50
3	601318	中国平安	96,690	3,245,883.30	1.58
4	601166	兴业银行	233,885	2,897,835.15	1.41
5	601088	中国神华	108,122	2,739,811.48	1.34
6	601328	交通银行	602,458	2,699,011.84	1.32
7	600519	贵州茅台	12,249	2,334,536.91	1.14
8	600111	包钢稀土	39,189	2,155,395.00	1.05
9	000002	万科A	263,491	1,907,674.84	0.93
10	600585	海螺水泥	107,847	1,854,968.40	0.91

## 2 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股票。

## (四) 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。

## (五) 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

本基金本报告期末未持有债券。

## (六) 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## (七) 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

本基金本报告期末未持有权证。

### （八）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没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

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的范围。

#### 3 其他各项资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	17,088.58
4	应收利息	3,422.74
5	应收申购款	101,270.85
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	121,782.17

#### 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

##### 5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 5.2 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股票。

## 十二、基金业绩

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。

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	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	① - ③	② - ④
2010/12/10-2010/12/31	-0.40%	0.38%	0.22%	1.42%	-0.62%	%
2011/01/01-2011/6/30	-1.81%	1.08%	-2.03%	1.17%	0.22%	-0.
2011/01/01-2011/9/30	-16.16%	1.13%	-16.00%	1.20%	-0.16%	-0.
2010/12/10-2011/9/30	-16.50%	1.09%	-15.82%	1.22%	-0.68%	-0.

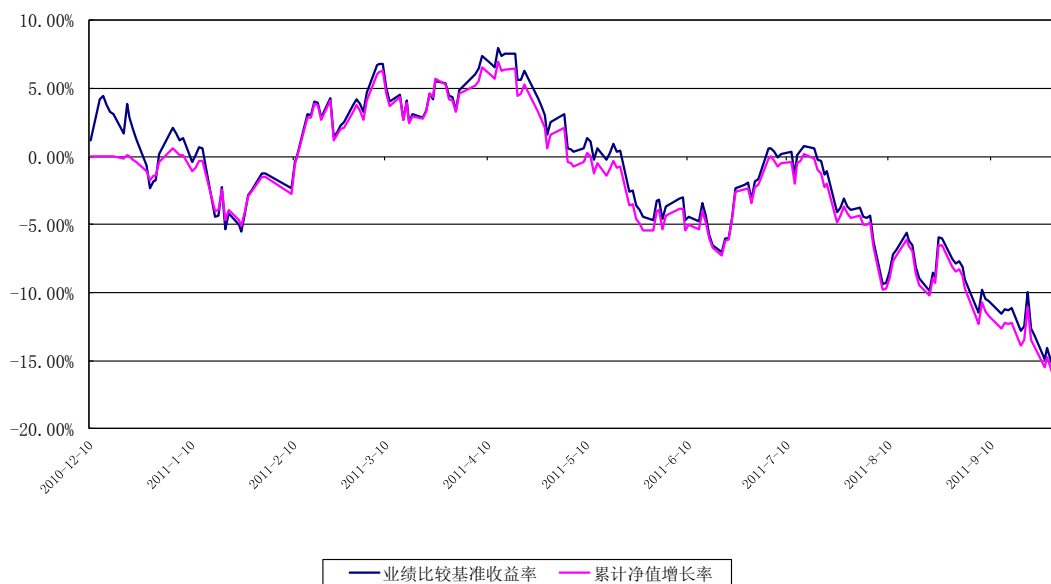
(二)自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 浦银安盛沪深 300 股票型证券投资基金

累计份额净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2010 年 12 月 10 日至 2011 年 9 月 30 日)

累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图  
(2009年12月3日至2011年9月30日)





### 十三、基金费用概览

#### (一) 与基金运作有关的费用

##### 1、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) 基金合同生效后的指数许可使用费；
- (4) 基金财产拨划支付的银行费用；
- (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) 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费；
- (8) 基金的证券交易费用；
- (9) 依法可以在基金财产中列支的其他费用。

2、上述基金费用由基金管理人在法律规定的范围内参照公允的市场价格确定，法律法规另有规定时从其规定。

##### 3、基金费用计提方法、计提标准和支付方式

###### (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 1%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) 基金合同生效后的指数许可使用费

基金管理人可与指数许可方签订书面协议，约定指数使用的费用及支付方式。本合同规定的指数许可使用费是指指数许可使用基点费，指数许可使用基点费的计费时间从本基金合同生效日开始计算。通常情况下，指数许可使用基点费的收取标准为本基金的资产净值的 0.016% 年费率，指数许可使用基点费的收取下限为每季人民币 5 万元（即不足 5 万元部分按照 5 万元收取）。基金合同生效当季，不足 3 个月的，按照 3 个月收费。指数许可使用基点费在基金财产中列支。

在通常情况下，指数许可使用基点费按前一日的基金资产净值的 0.016% 的年费率计提。指数许可使用基点费每日计算，逐日累计。

计算方法如下：

$$H = E \times 0.016\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的指数许可使用基点费

E 为前一日的基金资产净值

指数许可使用基点费的支付方式为每季支付一次。由基金管理人向基金托管人发送指数许可使用基点费划付指令，经基金托管人复核后于次季第一个月内从基金财产中一次性支付给中证指数有限公司。

(4) 除管理费、托管费和指数许可使用费之外的基金费用，由基金托管人根据其他有关法规及相应协议的规定，按费用支出金额支付，列入或摊入当期基

金费用。

(5) 不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。基金合同生效前所发生的信息披露费、律师费和会计师费以及其他费用不从基金财产中支付。

(6) 基金费用调整

基金管理人和基金托管人可根据基金发展情况调整基金管理费率和基金托管费率。降低基金管理费率和基金托管费率，无须召开基金份额持有人大会。基金管理人必须于新的费率实施日前按照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上刊登公告。

(一) 与基金销售有关的费用

1、申购费

本基金的申购费用由申购本基金的投资者承担，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。

本基金的申购费率适用以下前端收费费率标准：

申购金额 (M)	申购费率
M < 100 万元	1.2%
100 万元 ≤ M < 300 万元	0.8%
300 万元 ≤ M < 500 万元	0.3%
M ≥ 500 万元	按笔收取，每笔 1000 元

2、赎回费

本基金的赎回费用由赎回基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。不低于赎回费总额的 25% 应归基金财产（对本基金持续持有期小于 7 天的投资者收取的赎回费全额计入基金财产），其余用于支付注册登记费和其他必要的手续费。

本基金的赎回费率随持有期限的增加而递减，标准如下：

持有期限 (N)	赎回费率
----------	------

N<7 天	1.5%
7 天≤N<1 年	0.5%
1 年≤N<2 年	0.25%
N≥2 年	0

注：就赎回费而言，1 年指365 天，2 年指730 天。

3、本基金的申购费率、赎回费率最高不得超过法律法规规定的限额。本基金场内申购费率、赎回费率等同于场外申购费率、赎回费率。

4、基金管理人可以在《基金合同》约定的范围内调整费率或收费方式，并最迟应于新的费率或收费方式实施日前依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒体上公告。

5、对特定交易方式（如网上交易、电话交易等），基金管理人可以采用低于柜台交易方式的基金申购费率和赎回费率，并另行公告。

6、基金管理人可以在不违反法律法规规定及《基金合同》约定的情形下根据市场情况制定基金促销计划，针对投资人定期或不定期地开展基金促销活动。在基金促销活动期间，按相关监管部门要求履行必要手续后，基金管理人可以适当调低基金申购费率和基金赎回费率。

## （二）其他费用

本基金其他费用根据相关法律法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金的原招募说明书进行了更新，主要更新的内容如下：

- 1、更新了“重要提示”部分的内容截止日；
- 2、更新了“第三部分 基金管理人”中“主要人员情况”；

- 
- 
- 3、更新了“第四部分 基金托管人”的“基金托管人情况”和“基金托管人的内部控制制度”；
  - 4、更新了“第五部分 相关服务机构”中新增的代销机构的基本情况；
  - 5、“第八部分 基金份额的申购、赎回及其他注册登记业务”中关于“定期定额投资计划”中代销渠道的更新；
  - 6、“第九部分 基金的投资”中就“基金的投资组合报告”和“基金的业绩”的更新；
  - 7、更新了“第十九部分 基金托管协议的内容摘要”中基金托管人的相关内容；
  - 8、“第二十一部分 其他应披露事项”中更新了自 2011 年 6 月 11 日至 2011 年 12 月 10 日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和公司网站的与本基金相关的公告。

浦银安盛基金管理有限公司

二零一二年一月二十一日