

# 浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金招募说明书摘

## 要(更新)2016年第1号

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

内容截止日：2016年8月3日

### 重要提示

本基金的募集申请已于2015年6月30日经中国证监会证监许可（2015）1446号文准予注册。

基金合同生效日期：2016年2月3日

基金管理人保证本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注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益做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、勤勉尽责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。投资人在投资本基金前，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，对投资本基金的意愿、时机、数量等投资行为作出独立决策。投资人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，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为混合型基金，预期收益和预期风险水平高于货币市场基金、债券型基金，但低于股票型基金，属于证券投资基金中中高预期收益和预期风险水平的投资品种。投资人在投资本基金之前，请仔细阅读本基金的招募说明书和基金合同，全面认识本基金的风险收益特征和产品特性，并充分考虑自身的风险承受能力，理性判断市场，谨慎做出投资决策。投资有风险，投资人认购（或申购）基金时应认真阅读本招募说明书。基金的过往业绩并不预示其未来表现。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。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会注册。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《基金法》、《运作办法》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅基金合同。

本次更新的招募说明书已经本基金托管人复核。本招募说明书所载内容截至日为2016年8月3日，有关财务数据和净值表现截至日2016年6月30日（财务数据未经审计）。

目 录

一、基金管理人	4
二、基金托管人	9
三、相关服务机构	12
四、基金的名称	24
五、基金的类型	24
六、基金的投资目标	24
七、基金的投资范围	25
八、基金的投资策略	25
九、业绩比较基准	30
十、风险收益特征	31
十一、基金的投资组合报告	31
十二、基金业绩	35
十三、基金费用概览	37
十四、对招募说明书更新部分的说明	39

## 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：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：中国上海市淮海中路 381 号中环广场 38 楼

成立时间：2007 年 8 月 5 日

法定代表人：姜明生

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

注册资本：28,000 万元人民币

股权结构：上海浦东发展银行股份有限公司持有 51% 的股权；法国安盛投资管理有限公司持有 39% 的股权；上海国盛集团资产有限公司持有 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：徐薇

### (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 2013 年 3 月兼上海浦东发展银行上海分行党委书记、行长，现兼任中国银联董事。2016 年 6 月起兼任上海浦东发展银行董事。自 2009 年 11 月起兼任本公司董事长。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

Bruno Guilloton 先生，副董事长，法国国籍，毕业于国立巴黎工艺美术学院。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。2009年起任安盛投资管理公司亚洲股东代表。现任安盛投资管理公司亚太区 CEO。自 2015 年 2 月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。现另兼任 Foch Saint Cloud Versailles Sci 及 Fuji Oak Hills 公司董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。

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 年起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，2008 年至 2012 年 11 月兼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，现任上海浦东发展银行总行金融机构部总经理。自 2011 年 3 月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。1999 年加盟安盛罗森堡投资管理公司，先后担任亚太区 CIO 和 CEO,安盛罗森堡日本公司 CIO。2010 年任命为安盛-Kyobo 投资管理公司 CEO。2012 年起担任安盛投资管理公司亚洲业务发展主管。自 2012 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司监事。

郁蓓华女士，董事，复旦大学工商管理硕士。自 1994 年 7 月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自 2012 年 7 月起担任本公司总经理。自 2013 年 3 月起兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。

汪素南先生，董事。浙江大学计算机专业博士，高级工程师、国际注册内审师。1996 年 10 月加盟浦发银行宁波分行，历任发展研究部、电脑部、分行营业部总经理。2003 年 10 月调任至浦发银行总行，历任审计部执行审计官、首席审计官助理、中小企业业务经营中心总经理。2014 年 1 月至今担任浦发银行总行零售业务总监。2014 年 3 月起兼任浦发银行总行小企业金融服务中心总经理。自 2014 年 4 月起兼任本公司董事。

金杰先生，董事。上海财经大学工商管理硕士。曾先后就职于上海三菱电气股份有限公司、上海神光科技有限公司、上海（医药）集团有限公司等公司。2011 年 5 月进入上海国盛集团资产有限公司，现任上海国盛集团资产有限公司资产管理部总经理。自 2014 年 9 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。

韩启蒙先生，独立董事。法国岗城大学法学博士。1995 年 4 月加盟基德律师事务所担任律师。2001 年起在基德律师事务所担任本地合伙人。2004 年起担任基德律师事务所上海首席代表。2006 年 1 月至 2011 年 9 月，担任基德律师事务所全球合伙人。2011 年 11 月起至今，任上海启恒律师事务所合伙人。自 2013 年 2 月起兼任本公司独立董事。

董叶顺先生，独立董事。中欧国际工商学院 EMBA，上海机械学院机械工程学士。现任火山石投资管理有限公司创始合伙人。董叶顺先生拥有 7 年投资行业经历，曾任 IDG 资本投资顾问（北京）有限公司合伙人及和谐成长基金投委会成员，上海联和投资有限公司副总经理，上海联创创业投资有限公司、宏力半导体制造有限公司、MSN（中国）有限公司、南通联亚药业有限公司等公司董事长。董叶顺先生有着汽车、电子产业近 20 多年的管理经

验，曾任上海申雅密封件系统、中联汽车电子、联合汽车电子系统、延峰伟世通汽车内饰系统等有限公司总经理、党委书记职务。自 2014 年 4 月起兼任本公司独立董事。

霍佳震先生，独立董事。同济大学管理学博士。1987 年进入同济大学工作，历任同济大学经济与管理学院讲师、副教授、教授，同济大学研究生院培养处处长、副院长。现任同济大学经济与管理学院教授、院长，同济大学中德学院教席教授。自 2014 年 4 月起兼任本公司独立董事。

## 2、监事会成员

檀静女士，监事长，澳大利亚悉尼大学人力资源管理和劳资关系硕士研究生，加拿大不列颠哥伦比亚大学国际工商管理硕士。2010 年 4 月至 2014 年 6 月就职于上海盛融投资有限公司，曾先后担任人力资源部副总经理，监事。2011 年 1 月起至今就职于上海国盛集团资产管理有限公司任行政人事部总经理、本部党支部书记。自 2015 年 3 月起兼任本公司监事长。

Simon Lopez 先生，澳大利亚/英国国籍。澳大利亚莫纳什大学法学学士、文学学士。2003 年 8 月加盟安盛投资管理公司（英国伦敦），历任固定收益产品专家、固定收益产品经理、基金会计师和组合控制、首席运营官。现任安盛投资管理有限公司亚太区首席运营官。自 2013 年 2 月起兼任本公司监事。

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 日起兼任浦银安盛沪深 300 增强型指数证券投资基金基金经理，2012 年 5 月 14 日起兼任浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金基金经理。自 2012 年 3 月起兼任本公司职工监事。

朱敏奕女士，本科学历。2000 年至 2007 年就职于上海东新投资管理有限公司资产管理部任客户主管。2007 年 4 月加盟浦银安盛基金管理有限公司担任市场策划经理，现任本公司市场策划部经理。自 2013 年 3 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

郁蓓华女士，复旦大学工商管理硕士。自 1994 年 7 月起，在招商银行上海分行工作，历任银行职员、招商银行宝山支行副行长、招商银行上海分行会计部总经理、计财部总经理，招商银行上海分行行长助理、副行长，招商银行信用卡中心副总经理。自 2012 年 7 月 23 日起担任本公司总经理。自 2013 年 3 月起，兼任本公司董事。2013 年 12 月起兼任本公司旗下子公司——上海浦银安盛资产管理有限公司总经理。

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。

李宏宇先生，西南财经大学经济学博士。1997 年起曾先后就职于中国银行、道勤集团和上海东新国际投资管理有限公司分别从事联行结算、产品开发以及基金研究和投资工作。2007 年 3 月起加盟本公司，历任公司产品开发部总监、市场营销部总监、首席市场营销官。自 2012 年 5 月 2 日起，担任本公司副总经理兼首席市场营销官。

## 4、本基金基金经理

吴勇，上海交通大学工商管理硕士，上海交通大学材料工程系学士，CPA，CFA，中国注册造价师。1993 年 8 月至 2002 年 12 月在上海电力建设有限责任公司任预算主管，2003 年 1 月至 2007 年 8 月在国家开发银行上海市分行任评审经理，2007 年 9 月起加盟浦银安盛基金管理有限公司任职研究员，2009 年 8 月起担任浦银安盛精致生活混合型证券投资基金基金经理助理。2010 年 2 月至 4 月，担任浦银安盛红利精选混合基金（原浦银红利股票基

金)基金经理助理。2010年4月至2016年1月,担任浦银安盛红利精选混合基金(原浦银红利股票基金)基金经理。2011年5月起,兼任浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金基金经理之职。2012年11月起,担任本公司权益投资部总监。2013年3月起,兼任浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金基金经理。2013年12月起兼任浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年2月起担任浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。2016年4月起兼任公司投资总监。

#### 5、投资决策委员会成员

郁蓓华女士,本公司总经理,董事,并任投资决策委员会主席。

李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。

陈士俊先生,本公司金融工程部总监,公司旗下浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金及浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金基金经理并兼任本公司职工监事。

吴勇先生,本公司投资总监兼权益投资部总监,公司旗下浦银安盛精致生活灵活配置混合型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛消费升级灵活配置混合型证券投资基金及浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

薛铮先生,本公司固定收益投资部总监,公司旗下浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季添利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金、浦银安盛幸福聚利定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛盛鑫定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛盛元纯债债券型证券投资基金基金经理。

黄列先生,本公司研究部总监。

蒋建伟先生,本公司权益投资部副总监兼旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金及浦银安盛增长动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

顾佳女士,本公司合规风控部总经理。

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)基金托管人的基本情况

名称:广发证券股份有限公司(简称:广发证券)

注册地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)

办公地址:广州市天河区天河北路183-187号大都会广场5楼、7楼、8楼、18楼、19楼、38楼、39楼、40楼、41楼、42楼、43楼和44楼

法定代表人:孙树明

成立时间:1994年1月21日

基金托管资格批文及文号:证监许可【2014】510号

注册资本:人民币7,621,087,664元

存续期间:长期

联系人:崔瑞娟

联系电话:020-87555888

广发证券成立于1991年,是国内首批综合类证券公司。公司先后于2010年和2015年分别在深圳证券交易所及香港联合交易所主板上市(股票代码:000776.SZ,1776.HK)。截至2015年12月31日,公司共有分公司20家、证券营业部264家,营业网点分布于全国31个省、直辖市、自治区。广发证券旗下拥有五家全资子公司,分别是广发期货有限公司、

广发控股（香港）有限公司、广发信德投资管理有限公司、广发乾和投资有限公司和广发证券资产管理（广东）有限公司，控股广发基金管理有限公司，参股易方达基金管理有限公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司等公司，间接全资持有广发金融交易（英国）有限公司（伦敦金属交易所 LME 第一类交易会员）和广发证券（加拿大）有限公司，形成了以证券业务为核心、业务跨越境内外的金融控股集团架构。

截至 2015 年 12 月 31 日，广发证券注册资本 76.21 亿元，总资产 4,190.97 亿元，归属于上市公司股东的所有者权益 775.19 亿元；2015 年营业收入为 334.47 亿元，归属于上市公司股东的净利润为 132.01 亿元。资本实力及盈利能力在国内证券行业持续领先，总市值居国内上市证券公司前列。

广发证券设资产托管部。现有员工具有多年基金、证券和银行从业经历，具备基金从业资格，员工的学历均在本科以上，专业分布合理，是一支诚实勤勉、积极进取的资产托管从业人员团队。

## （二）主要人员情况

孙树明先生自 2012 年 5 月起获委任为公司的董事长兼执行董事。孙先生的主要工作经历包括：1984 年 8 月至 1990 年 8 月历任中国财政部条法司科员、副主任科员及主任科员，1990 年 8 月至 1994 年 9 月任中国财政部条法司副处长，1994 年 9 月至 1996 年 3 月任中国财政部条法司处长，1994 年 7 月至 1995 年 7 月任河北涿州市人民政府副市长（挂职），1996 年 3 月至 2000 年 6 月任中国经济开发信托投资公司总经理办公室主任、总经理助理，2000 年 6 月至 2003 年 3 月任中共中央金融工作委员会监事会工作部副部长，2003 年 9 月至 2006 年 1 月任中国银河证券有限公司监事会监事，2006 年 1 月至 2007 年 4 月任中国证监会会计部副主任，2007 年 4 月至 2011 年 3 月任中国证监会会计部主任，自 2015 年 3 月起兼任中证机构间报价系统股份有限公司副董事长。孙先生于 1984 年 7 月取得位于武汉的湖北财经学院（现名中南财经政法大学）经济学学士学位，并于 1997 年 8 月取得位于北京的财政部财政科学研究所经济学博士学位。

杨龙先生自 2014 年 5 月起获委任为本公司副总经理，其主要工作经历包括：1991 年 7 月至 1993 年 8 月任天津市政府研究室科员，1993 年 8 月至 1994 年 6 月任天津水利局办公室科员，1994 年 7 月至 1998 年 1 月任本公司深圳红宝路营业部总经理，1998 年 1 月至 2004 年 3 月任深圳业务总部总经理，2004 年 3 月至 2004 年 10 月任经纪业务总部常务副总经理兼深圳业务总部总经理，2004 年 10 月至 2005 年 3 月任人力资源部副总经理，2005 年 3 月至 2005 年 9 月任银证通营销中心总经理，2005 年 10 月至 2008 年 12 月任联通华建网络有限公司顾问，2009 年 1 月至 2014 年 9 月任本公司总经理助理（彼同时于 2009 年 10 月至 2012 年 11 月任深圳分公司总经理以及于 2011 年 9 月至 2011 年 12 月任深圳高新南一道证券营业部总经理）。杨先生自 2015 年 8 月任广东广发互联小额贷款股份有限公司董事长。杨先生于 1988 年 6 月获得位于天津的南开大学经济学学士学位，于 1991 年 7 月获得位于北京的中共中央党校经济学硕士学位，于 2013 年 5 月取得香港科技大学高层管理工商管理硕士学位及于 2003 年 12 月取得位于天津的南开大学管理学博士学位。刘洋先生现任广发证券资产托管部总经理。曾就职于大成基金管理有限公司、招商银行股份有限公司、浦银安盛基金管理有限公司、上海银行股份有限公司、美国道富银行。刘先生于 2000 年 7 月获得北京大学理学学士，并于 2003 年 7 月获得北京大学经济学硕士学位。

## （三）基金托管业务经营情况

广发证券于 2014 年 5 月取得中国证监会核准证券投资基金托管资格。广发证券严格履行基金托管人的各项职责，不断加强风险管理和内部控制，确保基金资产的完整性和独立性，切实维护基金份额持有人的合法权益，提供高质量的基金托管服务。截至 2015 年 12 月，

广发证券已托管宝盈睿丰创新灵活配置混合型证券投资基金、前海开源睿远稳健增利混合型证券投资基金、建信睿盈灵活配置混合型证券投资基金、东方睿鑫热点挖掘灵活配置混合型证券投资基金、国泰睿吉灵活配置混合型证券投资基金、大成睿景灵活配置混合型证券投资基金、长信利广灵活配置混合型证券投资基金、长信睿进灵活配置混合型证券投资基金、长信中证一带一路主题指数分级证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证 100 指数型发起式证券投资基金、天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金、天弘上证 50 指数型发起式证券投资基金、浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金、平安大华睿享文娱灵活配置混合型证券投资基金 15 只证券投资基金。

### 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

住所：中国（上海）自由贸易试验区浦东大道 981 号 3 幢 316 室

办公地址：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（目前支持上海浦东发展银行借记卡、中国建设银行借记卡、中国农业银行借记卡、兴业银行借记卡、中信银行借记卡、广发银行借记卡、上海农商银行借记卡、中国工商银行借记卡、交通银行借记卡、中国银行借记卡、光大银行借记卡、民生银行借记卡、平安银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、上海银行借记卡、华夏银行借记卡、招商银行借记卡）

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

微信服务号：浦银安盛微理财（AXASPDB-E）

客服电话：400-8828-999；（021）33079999

##### 2、场外代销机构

(1) 广发证券股份有限公司

地址：广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼

法定代表人：孙树明

客户服务热线：95575

公司网站：[www.gf.com.cn](http://www.gf.com.cn)

(2) 上海浦东发展银行股份有限公司

住所：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

客户服务热线：95528

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

(3) 兴业银行股份有限公司

注册地址：福州市湖东路 154 号中山大厦

法定代表人：高建平

服务热线：95561

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

(4) 宁波银行股份有限公司

注册地址：宁波市鄞州区宁南南路 700 号

法定代表人：陆华裕

客服电话：95574

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

(5) 中信证券股份有限公司

注册地址：广东省深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场（二期）北座

办公地址：北京市朝阳区亮马桥 48 号中信证券大厦

法定代表人：王东明

客户服务热线：95548

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

(6) 中信证券（山东）有限责任公司

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 20 层

法定代表人：杨宝林

客服电话：95548

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

(7) 信达证券股份有限公司

地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：张志刚

客户服务热线：400-800-8899

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

(8) 上海证券有限责任公司

办公地址：上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

法定代表人：龚德雄

客户服务热线：4008-918-918 或 021-962518

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

(9) 海通证券股份有限公司

地址：上海市广东路 689 号 1001A 1001B 室

法定代表人：王开国

客服电话：95553 或 4008888001

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

(10) 中信建投证券股份有限公司

注册地址：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

客服电话：95587 或 4008-888-108

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(11) 中泰证券股份有限公司

办公地址：山东济南市经七路 86 号证券大厦 2001

法定代表人：李玮

客服电话：95538

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



(12) 爱建证券有限责任公司

注册地址：上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 层

法定代表人：钱华

客服电话：4001962502

公司网站：www.ajzq.com

(13) 中国国际金融有限公司

注册地址：北京市建国门外大街 1 号国贸写字楼 2 座 27 层及 28 层

法定代表人：丁学东

客服电话：410-910-1166

公司网站：www.cicc.com.cn

(14) 光大证券股份有限公司

地址：上海市静安区新闻路 1508 号

法定代表人：薛峰

客户服务热线：495525

网址：www.ebscn.com

(15) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

客户服务热线：4008888666

公司网址：www.gtja.com

(16) 申万宏源证券有限公司

地址：上海市长乐路 989 号 45 层

法定代表人：李梅

客服电话：95523、4008895523

网址：www.swhysc.com

(17) 中山证券有限责任公司

注册地址：深圳市南山区科技中一路西华强高新发展大楼 7 层、8 层

法定代表人：黄扬录

客服电话：4001022011

公司网站：www.zszq.com.cn

(18) 天相投资顾问有限公司

注册地址：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 505

法定代表人：林义相

客户服务热线：010-66045678

天相投顾网址：www.txsec.com

天相基金网网址：www.jjm.com.cn

(19) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：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大道 555 号裕景国际 B 座 16 层

法定代表人：张跃伟

客户服务电话：400-820-2899

网址：www.erichfund.com

(20) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区场中路 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  
客户服务电话：400-700-9665  
网址：[www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(21) 上海天天基金销售有限公司

办公地址：上海市徐汇区龙田路 195 号 3C 座 9 楼  
法定代表人：其实  
服务热线：400-1818-188  
网址：[www.1234567.com.cn](http://www.1234567.com.cn)

(22) 浙江同花顺基金销售有限公司

办公地址：杭州市西湖区翠柏路 7 号电子商务产业园 2 号楼 2 楼  
法定代表人：凌顺平  
服务热线：4008-773-772  
网址：[www.5ifund.com](http://www.5ifund.com)

(23) 和讯信息科技有限公司

办公地址：上海市浦东新区东方路 18 号保利大厦 18 楼  
法定代表人：王莉  
服务热线：400-920-0022  
网址：[licaike.hexun.com](http://licaike.hexun.com)

(24) 北京钱景财富投资管理有限公司

办公地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012  
法定代表人：赵荣春  
客服电话：400-893-688  
网址：[www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(25) 一路财富（北京）信息科技有限公司

注册地址：北京市西城区车公庄大街 9 号五栋大楼 C 座 702  
办公地址：北京市西城区阜成门外大街 2 号万通新世界广场 A 座 22 层  
法定代表人：吴雪秀  
客服电话：400-001-1566  
公司网站：[www.yilucaifu.com](http://www.yilucaifu.com)

(26) 众升财富（北京）基金销售有限公司

办公地址：北京市朝阳区望京浦项中心 A 座 04-08  
法定代表人：李招弟  
服务热线：400-059-8888  
网址：[www.wy-fund.com](http://www.wy-fund.com)

(27) 北京增财基金销售有限公司

办公地址：北京市西城区南礼士路 66 号建威大厦 1208 室  
法定代表人：罗细安  
服务热线：400-001-8811  
网址：[www.zcvc.com.cn](http://www.zcvc.com.cn)

(28) 北京展恒基金销售股份有限公司

办公地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦 2 层

法定代表人：闫振杰

服务热线：400-888-6661

网址：[www.myfp.cn](http://www.myfp.cn)

(29) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号 5 层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区东三环中路 20 号乐成中心 A 座 23 层

法定代表人：梁越

服务热线：400-786-88685

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

(30) 上海利得基金销售有限公司

注册地址：上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室

办公地址：上海浦东新区峨山路 91 弄 61 号 10 号楼 12 楼

法定代表人：沈继伟

客服电话：400-067-6266

公司网站：[m.leadfund.com.cn](http://m.leadfund.com.cn)，[admin.leadfund.com.cn](http://admin.leadfund.com.cn)

(31) 诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市虹口区飞虹路 360 弄 9 号 3724 室

办公地址：上海市杨浦区昆明路 508 号北美广场 B 座 12 楼

法定代表人：汪静波

客服电话：400-821-5399

公司网站：[www.noah-fund.com](http://www.noah-fund.com)

(32) 上海陆金所资产管理有限公司

注册地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼 09 单元

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路 1333 号 14 楼

法定代表人：郭坚

客服电话：4008219031

公司网站：[www.lufunds.com](http://www.lufunds.com)

(33) 上海凯石财富基金销售有限公司

注册地址：上海市黄浦区西藏南路 765 号 602-115 室

办公地址：上海市黄浦区延安东路 1 号凯石大厦 4 楼

法定代表人：陈继武

客服电话：4000 178 000

公司网站：[www.lingxianfund.com](http://www.lingxianfund.com)

(34) 上海汇付金融服务有限公司

办公地址：上海市中山南路 100 号金外滩国际广场 19 楼

法定代表人：冯修敏

客服电话：400-820-2819

公司网站：<https://tty.chinapnr.com>

(35) 大泰金石投资管理有限公司

注册地址：南京市建邺区江东中路 359 号国睿大厦一号楼 B 区 4 楼 A506 室

办公地址：上海市长宁区虹桥路 1386 号文广大厦 15 楼

法定代表人：袁顾明

客服电话：021-22267995

公司网站：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

(36) 北京乐融多源投资咨询有限公司

注册地址：北京市朝阳区西大望路 1 号 1 号楼 1603

办公地址：北京市朝阳区工人体育馆北路甲 2 号盈科中心 B 座裙楼二层

法定代表人：董浩

客服电话：400-068-1176

公司网站：www.jimufund.com

(37) 杭州数米基金销售有限公司

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：陈柏青

客户服务电话：4000-766-123

网址：www.fund123.cn

(38) 珠海盈米财富管理有限公司

注册地址：珠海市横琴新区宝华路 6 号 105 室-3491

办公地址：广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 12 楼 B1201-1203

法定代表人：肖雯

客服电话：020-89629066

公司网站：www.yingmi.cn

(39) 深圳众禄金融控股股份有限公司

注册地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

办公地址：深圳市罗湖区梨园路物资控股置地大厦 8 楼

法定代表人：薛峰

客服电话：4006-788-887

公司网站：www.zlfund.cn www.jjmmw.com

(40) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

法定代表人：齐小贺

客服电话：0755-83999907

公司网站：www.jinqianwo.cn

(41) 奕丰金融服务（深圳）有限公司

注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路 1 号 A 栋 201 室（入驻深圳市前海商务秘书有限公司）

办公地址：深圳市南山区海德三路海岸大厦东座 1115 室，1116 室及 1307 室

法定代表人：TAN YIK KUAN

客服电话：400-684-0500

公司网站：www.ifastps.com.cn

(42) 上海联泰资产管理有限公司

注册地址：中国（上海）自由贸易试验区富特北路 277 号 3 层 310 室

办公地址：上海市长宁区福泉北路 518 号 8 座 3 层

法定代表人：燕斌

客服电话：4000-466-788

公司网站：www.66zichan.com

(43) 深圳市新兰德证券投资咨询有限公司

注册地址：深圳市福田区华强北路赛格科技园 4 栋 10 层 1006#  
办公地址：北京市西城区宣武门外大街 28 号富卓大厦 A 座 7 层  
法定代表人：杨懿  
客服电话：400-166-1188  
公司网站：8.jrj.com.cn

(44) 名称：北京创金启富投资管理有限公司  
注册地址：北京市西城区民丰胡同 31 号中水大厦 215A  
办公地址：北京市西城区白纸坊东街 2 号经济日报社 A 综合楼 712 室  
法定代表人：梁蓉  
客服电话：400-6262-818  
公司网站：www.5irich.com

(45) 名称：中证金牛（北京）投资咨询有限公司  
注册地址：北京市丰台区东管头 1 号 2 号楼 2-45 室  
办公地址：北京市西城区宣武门外大街甲 1 号环球财讯中心 A 座 5 层  
法定代表人：钱昊旻  
客服电话：4008909998  
公司网站：www.jnlc.com

(46) 交通银行股份有限公司  
地址：上海市银城中路 188 号  
法定代表人：牛锡明  
客服电话：95559  
公司网站：www.bankcomm.com

(47) 中国银行股份有限公司  
注册地址：北京市复兴门内大街 1 号  
办公地址：北京市复兴门内大街 1 号  
法定代表人：田国立  
客服电话：95566  
公司网站：www.boc.cn

(48) 中国农业银行股份有限公司  
地址：北京市东城区建国门内大街 69 号  
法定代表人：周慕冰  
客服电话：95599  
公司网站：www.abchina.com

(49) 申万宏源西部证券有限公司  
注册地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
办公地址：新疆乌鲁木齐市高新区（新市区）北京南路 358 号大成国际大厦 20 楼 2005 室  
法定代表人：韩志谦  
客服电话：400-800-0562  
公司网站：www.hysec.com

(50) 中信银行股份有限公司  
地址：北京市东城区朝阳门北大街 9 号  
法定代表人：常振明  
客服电话：95558  
公司网站：bank.ecitic.com

(51) 平安证券有限责任公司

注册地址：广东省深圳市福田区金田路 4036 号荣超大厦 16-20 层

办公地址：广东省深圳市福田区金田路 4306 号荣超大厦 18 楼

法定代表人：谢永林

客服电话：95511-8

公司网站：www.stock.pingan.com

(52) 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：金煜

客服电话：95594

公司网站：www.bankofshanghai.com

### 3、场内代销机构

投资者可通过“上证基金通”办理本基金 A 类份额（基金代码：519172）和 C 类份额（基金代码：519173）的上海证券交易所场内申购与赎回，可办理“上证基金通”业务的证券公司的具体名单可在上海证券交易所网站查询。如果上海证券交易所增加或减少具有“上证基金通”业务资格的证券公司，请以上海证券交易所的具体规定为准。

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

联系人：崔巍

电话：（010）50938856

传真：（010）50938907

#### (三)出具法律意见书的律师事务所和经办律师

名称：国浩律师（上海）事务所

办公地址：上海市静安区北京西路 968 号嘉地中心 23-25 层

负责人：黄宁宁

电话：021-52341668

传真：021-52341670

联系人：孙芳尘

经办律师：宣伟华、孙芳尘

#### (四)审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

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

联系人：张振波

经办注册会计师：薛竞、张振波

#### (五)其他服务机构及委托办理业务的有关情况

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施系统以及有关业务应用系统构成。信息技术系

系统基础设施系统包括机房工程系统、网络集成系统，这些系统在公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建成，之后日常的维护管理由公司负责，但与第三方服务公司签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。公司业务应用系统主要包括开放式基金登记过户子系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值核算系统、网上交易系统、呼叫中心系统、外服系统、营销数据中心系统等。这些系统也主要是在公司筹建之初采购专业系统提供商的产品建设而成，建成之后在业务运作过程中根据公司业务的需要进行了相关的系统功能升级，升级由系统提供商负责完成，升级后的系统也均是系统提供商对外提供的通用系统。业务应用系统日常的维护管理由公司负责，但与系统提供商签订有技术服务合同，由其提供定期的巡检及特殊情况下的技术支持。除上述情况外，公司未委托服务机构代为办理重要的、特定的信息技术系统开发、维护事项。另外，本公司可以根据自身发展战略的需要，委托资质良好的基金服务机构代为办理基金份额登记、估值核算等业务。

#### 四、 基金的名称

浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金

#### 五、 基金的类型

混合型证券投资基金

#### 六、 基金的投资目标

本基金通过对股票、固定收益证券、现金等资产的积极灵活配置，在严格控制风险并保证充分流动性的前提下，谋求基金资产的长期稳定增值。

#### 七、 基金的投资范围

本基金的投资范围为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（含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（含中小企业私募债）、货币市场工具（含中期票据）、权证、资产支持证券、股指期货以及法律法规或中国证监会允许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）。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，其投资比例遵循届时有效的法律法规和相关规定。

本基金的股票投资比例为基金资产的 0%-95%；现金、债券资产、资产支持证券及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产比例为 5%—100%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持现金或到期日在一年期以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

#### 八、 基金的投资策略

##### （一）资产配置策略

资产配置策略采用浦银安盛资产配置模型，通过宏观经济、估值水平、流动性和市场政策等四个因素的分析框架，动态把握不同资产类别的投资价值、投资时机以及其风险收益特征的相对变化，进行股票、固定收益证券和现金等大类资产的合理配置，在严格控制投资风险的基础上追求基金资产的长期持续稳定增长。

##### （二）股票投资策略

本基金坚持“自上而下”与“自下而上”相结合的投资理念，通过灵活资产配置，注重风险与收益的平衡，结合行业发展趋势精选个股构建投资组合。

##### 1、行业精选策略

本基金主要考察行业在产业链上的位置、行业定价能力、行业发展趋势、行业景气程度、

行业成熟程度、行业内竞争格局等因素，来构造本基金选股策略。

(1) 基于行业定位和定价能力的分析和判断

本基金将通过毛利率的变化情况深入分析各个相关行业的定位与定价能力，重点关注那些可顺利将上游成本转化、产品提价能力强，保持较高毛利率的行业。

(2) 基于全球视野下的行业发展潜力和行业景气程度的分析和判断

本基金着眼于全球视野，借鉴全球范围内各国家在经济结构调整中相关行业发展的国际经验，再结合对国内宏观经济、行业政策、产业发展规律、居民收入支出变化等经济因素的分析，从而判别国内各行业产业链传导的内在机制，并从中找出最具发展潜力以及处于高景气中的行业。

(3) 基于行业生命周期的分析和判断

由于各行业的外延在不断发展变化，发展成熟度不尽相同，本基金将重点投资处于快速成长期、稳定成长期的相关行业。

(4) 基于行业竞争结构的分析

本基金重点通过波特的竞争理论考察各行业的竞争结构：**a.成本控制能力；b.现有竞争状况；c.产品定价能力；d.新进入者的威胁；e.替代品的威胁等。**本基金重点投资那些行业内竞争规范、行业中上市公司具有一定市场份额集中度的行业。

## 2、个股选择策略

本基金将采取精选个股的策略，并辅之以公司特有的数量化公司财务研究模型基本面财务对拟投资的上市公司加以甄别。具体策略上，主要从定量分析、定性分析和估值水平三个层面对上市公司进行考察。

(1) 定量分析

主要通过运用特有的数量化公司财务研究模型基本面财务，结合上市公司的财务数据，从上市公司的盈利能力、增长趋势、运营能力、偿债能力和现金流指标等5个方面对相关上市公司进行量化筛选，挖掘财务健康度很高，数据可以信赖的上市公司，这些公司作为进一步选择的目标。主要指标包括有：盈利能力指标、增长趋势指标、运营能力指标、偿债能力指标、现金流指标。

(2) 定性分析

①公司所处的行业特征和在行业中的地位

主要包括公司所处行业的周期特征、行业景气度和行业集中度等内容，同时关注公司在所处行业或是子行业中的地位。

②公司的核心竞争力

主要体现在公司是否在经营许可、规模、资源、技术、品牌、创新能力和成本控制等方面具有竞争对手在中长期时间内难以模仿的显著优势，并重点关注公司的中长期持续增长能力或阶段性高速增长的能力，内容包括上市公司的主营产品或服务是否具有良好的市场前景，在产品或服务提供方面是否具有成本优势，是否拥有出色的销售机制、体系及团队，是否具备较强的技术创新能力并保持足够的研发投入以推动企业的持续发展等。

③公司的管理能力和治理结构

关注公司是否具有诚信、优秀的公司管理层和良好的公司治理结构。诚信、优秀的公司管理层能率领公司不断制定和调整发展战略，把握住正确的发展方向，以保证企业资源的最佳配置和自身优势的充分发挥；同时良好的治理结构能促使公司管理层诚信尽职、融洽稳定、重视股东利益并使得管理水平能充分适应企业规模的不断扩大。

④公司的历史表现

我们关注有良好历史盈利记录和管理能力的公司，同时也关注和历史表现相比，各方面情况正在得到改善的上市公司。



### （3）估值分析

对通过定量分析和定性分析筛选出的上市公司进行投资前的估值分析，主要分析方法包括对市场同类企业的估值水平进行横向比较和对拟投资上市公司的历史业绩和发展趋势进行纵向比较两种方法。涉及的主要指标包括有：市净率指标（PB）、市盈率指标（PE）、市盈率/盈利增长比率指标（PEG）、市值/标准化的净现金流指标（MV/NormalizedNCF）、经济价值/息税折旧摊销前利润指标（EV/EBITDA）。

本基金认为，通过定量指标和定性指标可筛选出那些财务健康、获利能力强、竞争优势明显、成长性高、公司治理完善的上市公司，再将筛选出的上市公司纳入估值指标进行考察，结合深入的基本面分析和实地调查研究，选择出最具有估值吸引力的股票，结合行业配置计划精选个股构建组合。

### （三）债券投资策略

在资本市场国际化的背景下，通过研判债券市场风险收益特征的国际化趋势和国内宏观经济景气周期引发的债券市场收益率的变化趋势，采取自上而下的策略构造组合。

#### 1、期限结构策略

##### （1）久期调整策略

本基金将根据对利率水平的预期，确定资产组合的久期配置。

##### （2）收益率曲线策略

在久期确定的基础上，根据对收益率曲线形状变化情景的分析，分别采用子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略，在长期、中期和短期债券间进行合理配置，以从长、中、短期债券的相对价格变化中获利。

##### （3）骑乘策略

通过分析收益率曲线各期限段的利差情况，买入收益率曲线最陡峭处所对应的期限债券，随着基金持有债券时间的延长，债券的剩余期限将缩短，到期收益率将下降，基金从而可获得资本利得收入。

#### 2、类属配置策略

在保证流动性的基础上，本基金将通过国债、央行票据、金融债、企业(公司)债、可转换债、资产支持证券、回购等资产的合理组合实现稳定的投资收益。

##### （1）相对价值策略

相对价值策略包括研究国债与金融债之间的信用利差、交易所与银行间的市场利差，寻找价值相对低估的投资品种。

##### （2）信用利差策略

通过对内外部评级、利差曲线研究和经济周期的判断主动采用相对利差投资策略。

#### 3、个券选择策略

##### （1）流动性策略

通过对流动性做针对性地分析，考察个券的流动性。

##### （2）信用分析策略

本基金对企业债、公司债、金融债、短期融资券等高信用债券进行信用分析。此分析主要通过三个角度完成：**a.**独立第三方的外部评级结果；**b.**第三方担保情况；**c.**基于基本面财务模型的内部评价。基本面财务模型在信用评价的主要作用在于通过对部分关键的财务指标分析判断发行债券企业未来出现偿债风险的可能性，从而确定该企业发行债券的信用等级与利率水平。主要关键的指标包括：**NETDEBT/EBITDA**、**EBIT/I**、资产负债率、流动资产/流动负债、经营活动现金流/总负债。其中资产负债率、流动资产/流动负债主要分析企业静态的债务水平与结构，其他的指标主要分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力。

#### 4、可转债投资策略

本基金投资于可转债，主要目标是降低基金净值的下行风险，基金投资的可转债可以转股，以保留分享股票升值的收益潜力。

可转债内含选择权定价是决定可转债投资价值的关键因素。本基金将采取积极管理策略，重视对可转债对应股票的分析与研究，选择那些公司行业景气趋势回升、成长性好、估值水平偏低或合理的转债进行投资，以获取收益。

#### 5、中小企业私募债投资策略

在严格控制风险的前提下，通过严谨的研究，综合考虑中小企业私募债券的安全性、收益性和流动性等特征，并与其他投资品种进行对比后，选择具有相对优势的类属和个券进行投资。同时，通过期限和品种的分散投资降低基金投资中小企业私募债券的信用风险、利率风险和流动性风险。

本基金可能投资的中小企业私募债，其信用风险一般情况下高于其他公募债券，其流动性一般情况下弱于其他公募债券。

#### 6、中期票据投资策略

投资策略通过浦银安盛信用分析系统，遴选收益风险平衡或被市场错误定价的中期票据，兼顾流动性，以持有到期为主，波段操作结合的方式进行中期票居的投资。

7、根据基金申购、赎回等情况，对投资组合进行流动性管理，确保基金资产的变现能力。

#### （四）权证投资策略

本基金的权证投资以权证的市场价值分析为基础，配以权证定价模型寻求其合理估值水平，以主动式的科学投资管理为手段，充分考虑权证资产的收益性、流动性及风险性特征，通过资产配置、品种与类属选择，追求基金资产稳定的当期收益。

#### （五）资产支持证券投资策略

本基金投资资产支持证券将综合运用久期管理、收益率曲线、个券选择和把握市场交易机会等积极策略，在严格控制风险的情况下，通过信用研究和流动性管理，选择风险调整后收益较高的品种进行投资，以期获得长期稳定收益。

#### （六）股指期货投资策略

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理的原则，以套期保值为主要目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

基金管理人将建立股指期货交易决策部门或小组，授权特定的管理人员负责股指期货的投资审批事项，同时针对股指期货交易制定投资决策流程和风险控制等制度并报董事会批准。

## 九、业绩比较基准

### 1、业绩比较基准

本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率\*55%+中证全债指数收益率\*45%。

### 2、选择比较基准的理由

沪深 300 指数是中证指数公司发布的反映 A 股市场总体走势的综合性指数，它是由上海和深圳证券市场中选取 300 只 A 股作为样本编制而成的成份股指数，所选择的成分股具有规模大、流动性好的特征。该指数具有广泛的市场代表性和良好的可投资性，是反映我国证券市场上股票整体走势的重要代表性指数；中证全债指数是中证指数公司编制的综合反映银行间债券市场和沪深交易所债券市场的跨市场债券指数，指数编制方法先进，指数信息透明度高，反映债券全市场整体价格和投资回报情况，具有很高的代表性，适合作为本基

金债券投资部分的基准。

综合本基金资产配置与市场指数代表性等因素，本基金选用沪深 300 指数和中证全债指数加权作为本基金的投资业绩评价基准。

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股票指数时，基金管理人和基金托管人协商一致并履行相关程序后，可以变更本基金业绩比较基准，报中国证监会备案并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### 十、 风险收益特征

本基金为混合型基金，本基金属于中高风险、中高收益的基金品种，其预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

#### 十一、 基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至 2016 年 6 月 30 日（财务数据未经审计）。

##### （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 301,532,611.74 81.70

其中：股票 301,532,611.74 81.70

2 基金投资 --

3 固定收益投资 --

其中：债券 --

资产支持证券 --

4 贵金属投资 --

5 金融衍生品投资 --

6 买入返售金融资产

其中：买断式回购的买入返售金融资产

7 银行存款和结算备付金合计 34,191,911.11 9.26

8 其他资产 33,358,566.24 9.04

9 合计 369,083,089.09 100.00

##### （二） 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、渔业

B 采矿业

C 制造业 286,284,898.70 89.91

D 电力、热力、燃气及水生产和供应业

E 建筑业 210,957.28 0.07

F 批发和零售业 9,120,000.00 2.86

G 交通运输、仓储和邮政业

H 住宿和餐饮业

I 信息传输、软件和信息技术服务业 5,687,505.66 1.79

J 金融业

K 房地产业 209,124.00 0.07

L 租赁和商务服务业

M 科学研究和技术服务业 20,126.10 0.01

N 水利、环境和公共设施管理业  
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  
S 综合  
合计 301,532,611.74 94.69

(三) 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	000835	长城动漫	1,533,896	21,704,628.40	6.82
2	300213	佳讯飞鸿	737,325	20,822,058.00	6.54
3	002472	双环传动	840,409	20,438,746.88	6.42
4	002452	长高集团	1,230,000	16,039,200.00	5.04
5	002735	王子新材	352,450	16,029,426.00	5.03
6	300279	和晶科技	284,206	13,496,942.94	4.24
7	603611	诺力股份	499,921	13,477,870.16	4.23
8	300161	华中数控	434,897	13,329,593.05	4.19
9	002184	海得控制	499,976	13,154,368.56	4.13
10	300112	万讯自控	767,300	12,614,412.00	3.96

(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。

(八) 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。

(九) 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1、 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有股指期货。

2、 本基金投资股指期货的投资政策  
本基金本报告期末未持有股指期货。

(十) 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1、 本基金投资国债期货的投资政策  
本基金本报告期末未持有国债期货。

2、 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细  
本基金本报告期末未持有国债期货。

3、 本基金投资国债期货的投资评价  
本基金本报告期末未持有国债期货。

(十一) 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 488,251.24

2 应收证券清算款 31,236,171.02

3 应收股利 -

4 应收利息 4,409.74

5 应收申购款 1,629,734.24

6 其他应收款 -

7 待摊费用 -

8 其他 -

9 合计 33,358,566.24

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

序号 股票代码 股票名称 流通受限部分的公允价值(元) 占基金资产净值比例(%) 流通受限情况说明

1 000835 长城动漫 21,704,628.40 6.82 临时停牌

2 002452 长高集团 16,039,200.00 5.04 临时停牌

3 002735 王子新材 16,029,426.00 5.03 临时停牌

4 603611 诺力股份 13,477,870.16 4.23 临时停牌

## 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。

（一）浦银安盛睿智精选混合 A 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

2016年02月03日至2016年06月30日 10.90% 1.88% 4.39% 0.74% 6.51% 1.14%

浦银安盛睿智精选混合 C 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

2016年02月03日至2016年06月30日 10.20% 1.88% 4.39% 0.74% 5.81% 1.14%

（二）浦银安盛睿智精选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

浦银安盛睿智精选灵活配置混合型证券投资基金

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

浦银安盛睿智精选灵活配置混合 A：

（2016年2月3日至2016年6月30日）

浦银安盛睿智精选灵活配置混合 C：

(2016年2月3日至2016年6月30日)

### 十三、基金费用概览

#### (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、本基金从C类基金份额的基金财产中计提的销售服务费；
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券、期货交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、基金开户费和银行账户维护费；
- 10、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。

#### (二) 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

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：

$$H = E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

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前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、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、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：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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前3个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 3、C类基金份额的销售服务费

本基金A类基金份额不收取销售服务费，C类基金份额的销售服务费按前一日C类基金资产净值的0.80%年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H为C类基金份额每日应计提的销售服务费

E为C类基金份额前一日基金资产净值

C类基金份额销售服务费每日计提，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销售服务费划款指令，基金托管人复核后于次月前3个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人，经基金管理人代付给各个销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“(一)基金费用的种类中第4—10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。

### (三) 不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、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；
- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

### (四) 费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后，可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、C类基金份额销售服务费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或C类基金份额销售服务费率等费率，须召开基金份额持有人大会审议；调低基金管理费率、基金托管费率或C类基金份额销售服务费率等费率，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依照《信息披露办法》的有关规定在指定媒介上公告。

### (五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

1. 在“重要提示”部分，更新了部分内容；
2. 在“第三部分 基金管理人”部分，对基金管理人概况、人员更换或人员简历进行了更新；
3. 在“第四部分 基金托管人”部分，更新了基金托管人情况；
4. 在“第五部分 相关服务机构”部分，对基金份额发售机构、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师部分内容进行了更新；
5. 在“第六部分 基金的募集”，更新了部分内容；
6. 在“第七部分 基金合同的生效”，更新了部分内容；
7. 在“第八部分 基金份额的申购与赎回”，对“基金转换”和“定期定额投资计划”进行了更新；
8. 在“第九部分 基金的投资”部分，补充了本基金最近一期公开披露的投资组合报告的内容和截至2016年6月30日的投资业绩；
9. 在“第二十一部分 其他应披露事项”部分，更新了基金管理人截至2016年8月3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

二〇一六年九月十三日