
浦银安盛基金管理有限公司

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）

招募说明书摘要（更新）

2017 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：招商证券股份有限公司

内容截止日：2017 年 10 月 27 日

重要提示

本基金的募集申请已于 2017 年 1 月 13 日经中国证监会证监许可 (2017) 113 号文准予注册。

基金合同生效日期: 2017 年 4 月 27 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。

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金, 其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金, 为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。

投资者在投资本基金之前, 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。

基金资产投资于相关股票市场交易互联互通机制试点允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票(以下简称“港股通标的股票”)的,会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险,包括港股市场股价波动较大的风险(港股市场实行 T+0 回转交易,且对个股不设涨跌幅限制,港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动)、汇率风险(汇率波动可能对基金的投资收益造成损失)、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险(在内地开市香港休市的情形下,港股通不能正常交易,港股不能及时卖出,可能带来一定的流动性风险)等。

本基金名称仅表明基金可以通过港股通机制投资港股,基金资产对港股标的投资比例会根据市场情况、投资策略等发生较大的调整,存在不对港股进行投资的可能。

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止日为 2017 年 10 月 27 日,有关财务数据和净值表现截止日为 2017 年 9 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.....	10
四、 基金的名称.....	25
五、 基金的类型.....	25
六、 基金的投资目标.....	25
七、 基金的投资范围.....	25
八、 基金的投资策略.....	25
九、 基金的业绩比较基准.....	28
十、 风险收益特征.....	28
十一、 基金的投资组合.....	29
十二、 基金业绩.....	33
十三、 基金费用概况.....	34
十四、 对招募说明书更新部分的说明.....	36

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：谢伟

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

股权结构：上海浦东发展银行股份有限公司（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；上海国盛集团资产管理有限公司（以下简称“国盛资产”）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

联系人：徐薇

(二) 主要人员情况

1、董事会成员

谢伟先生，董事长，硕士研究生，高级经济师。曾任中国建设银行郑州分行金水支行副行长，河南省分行公司业务部总经理，许昌市分行党委书记、行长；上海浦东发展银行公司及投资银行总部发展管理部总经理，公司及投资银行总部副总经理兼投行业务部、发展管理部、大客户部总经理，上海浦东发展银行福州分行党委书记、行长，上海浦东发展银行资金总部总经理，资产管理部总经理。现任上海浦东发展银行党委委员、副行长、董事会秘书，兼任金融市场业务总监、金融市场部总经理。自 2017 年 3 月起兼任本公司董事，自 2017 年 4 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。现另兼任 Foch Saint Cloud Versailles Sci 及 Fuji Oak Hills 公司董事。自 2015 年 2 月起兼任安盛罗森堡投资管理公司亚太区董事。自 2009 年 3 月起兼任本公司副董事长。2016 年 12 月起兼任安盛投资管理(上海)有限公司董事长。

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任资产管理部总经理。2016 年 3 月起至今担任上海产权集团有限公司总裁。自 2014 年 9 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。

刘显峰先生,董事,硕士研究生,高级经济师。曾任中国工商银行北京市分行办公室副主任、副主任(主持工作)、主任兼党办主任,北京分行王府井支行党委书记、行长;上海浦东发展银行北京分行干部,北京分行党委委员、纪委书记、副行长,上海浦东发展银行信用卡中心党委副书记(主持工作)、副总经理(主持工作),信用卡中心党委书记、总经理。现任上海浦东发展银行零售业务总监,零售业务管理部总经理,信用卡中心党委书记、总经理。自 2017 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。2016 年 12 月起兼任安盛投资管理 (上海) 有限公司总经理 (法定代表人)。

郁蓓华女士, 董事, 总经理, 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 月至 2017 年 2 月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。2017 年 2 月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

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。

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、同济大学经济与管理学院院长, 现任同济大学经济与管理学院教师、BOSCH 讲席教授。自 2014 年 4 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。

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，2017 年 4 月 27 日起兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 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，现任本公司市场部副总监。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 月至 2017 年 2 月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。2017 年 2 月起兼任上海浦银安盛资产管理有限公司执行董事。

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

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，2017 年 4 月 27 日起兼任浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理。自 2012 年 3 月起兼任本公司职工监事。陈士俊先生具有 15 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

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。

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。

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。

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、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金及浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF) 基金经理并兼任本公司职工监事。

钟明女士, 本公司固定收益投资部副总监。

杨岳斌先生, 本公司研究部副总监。

督察长、风险管理部负责人、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

1、基本情况

名称: 招商证券股份有限公司

住所: 广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

办公地址: 广东省深圳市福田区益田路江苏大厦A座38-45层

法定代表人: 霍达

成立时间: 1993年8月1日

组织形式: 股份有限公司

注册资本: 人民币669942.23万元

存续期间: 持续经营

基金托管业务批准文号: 证监许可【2014】78号

联系人: 秦湘

联系电话: 0755-26951111

招商证券是百年招商局旗下金融企业, 经过二十多年创业发展, 已成为拥有证券市场业务全牌照的一流券商, 并经中国证券监督管理委员会评定为A类AA级券商。招商证券具有稳定的持续盈利能力、科学合理的风险管理架

构、专业的服务能力。公司拥有多层次客户服务渠道,在北京、上海、广州、深圳等城市拥有 222 家批准设立的证券营业部和 11 家证券经纪业务管理分公司,同时在香港设有分支机构,全资拥有招商证券国际有限公司、招商期货有限公司、招商致远资本投资有限公司、招商证券投资有限公司、招商证券资产管理有限公司,参股博时基金管理公司、招商基金管理公司、广东金融高新区股权交易中心有限公司及证通股份有限公司,构建起国内国际业务一体化的综合证券服务平台。招商证券致力于“全面提升核心竞争力,打造中国最佳投资银行”。公司将以卓越的金融服务实现客户价值增长,推动证券行业进步,立志打造产品丰富、服务一流、能力突出、品牌卓越的国际化金融机构,成为客户信赖、社会尊重、股东满意、员工自豪的优秀金融企业。

2、主要人员情况

招商证券托管部员工多人拥有证券投资基金业务运作经验、会计师事务所审计经验,以及大型IT公司的软件设计与开发经验,人员专业背景覆盖了金融、会计、经济、计算机等各领域,其中本科以上学历占比 100%,高级管理人员均拥有硕士研究生或以上学历。

3、基金托管业务经营情况

招商证券是国内首批获得证券投资基金托管业务的证券公司,可为各类公开募集资金设立的证券投资基金提供托管服务。托管部拥有独立的安全监控设施,稳定、高效的托管业务系统,完善的业务管理制度。招商证券托管部本着“诚实信用、谨慎勤勉”的原则,为基金份额持有人利益履行基金托管职责。除此之外,招商证券于2012年10月获得了证监会准许开展私募基金综合托管服务试点的正式批复,成为业内首家可从事私募托管业务的券商,经验丰富,服务优质,业绩突出。截至2017年三季度,招商证券共托管26只公募基金。

三、相关服务机构

(一) 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

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、平安银行借记卡、邮政储蓄银行借记卡、上海农商银行借记卡、上海银行借记卡、华夏银行借记卡、招商银行借记卡、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)

交易网站: 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

(二) 代销机构

1、场外代销机构

(1) 上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址: 上海市中山东一路 12 号

办公地址: 上海市中山东一路 12 号

法定代表人: 高国富

客户服务热线: 95528

公司网址: www.spdb.com.cn

(2) 招商银行股份有限公司

注册地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

办公地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号

法定代表人: 李建红

客户服务热线: 95555

网址: www.cmbchina.com

(3) 兴业银行股份有限公司

注册地址: 福建省福州市湖东路 154 号

办公地址: 福建省福州市湖东路 154 号

法定代表人: 高建平

服务热线: 95561

网址: www.cib.com.cn

(4) 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: 陈四清

客户服务热线: 95566

公司网址: www.boc.cn

(5) 中国民生银行股份有限公司

注册地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号

办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 2 号民生银行大厦

法定代表人: 洪崎

客服电话: 95568

公司网址: www.cmbc.com.cn

(6) 上海银行股份有限公司

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: 金煜

咨询电话: 95594

网址: www.bosc.cn

(7) 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 号浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

办公地址: 浙江省宁波市鄞州区宁东路 345 号

法定代表人: 陆华裕

客服电话: 95574

公司网址: www.nbcb.com.cn

(8) 上海农村商业银行股份有限公司

注册地址: 上海市中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 15-20 楼,22-27 楼

办公地址: 上海市中国(上海)自由贸易试验区银城中路 8 号 15-20 楼,22-27 楼

法定代表人: 冀光恒

客服电话: 021-962999

公司网址: www.srcb.com

(9) 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: 广东省深圳市福田区中心三路 8 号中信证券大厦

法定代表人: 张佑君

客户服务热线: 95548

网址: www.cs.ecitic.com

(10) 海通证券股份有限公司

注册地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

办公地址: 上海市广东路 689 号海通证券大厦

法定代表人: 周杰

客服电话: 95553 或 4008888001

公司网址: www.htsec.com.cn

(11) 国泰君安证券股份有限公司

注册地址: 中国 (上海) 自由贸易试验区商城路 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: 杨德红

客户服务热线: 95521 或 400-8888-666

公司网址: www.gtja.com

(12) 中国银河证券股份有限公司

注册地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层

办公地址: 北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 2-6 层

法定代表人: 陈共炎

客服电话: 4008-888-888 (95551)

公司网站: www.chinastock.com.cn

(13) 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 至 45 层

办公地址: 深圳市福田区益田路江苏大厦 A 座 38 至 45 层

法定代表人: 霍达

客户服务热线: 95565

公司网址: www.newone.com.cn

(14) 广发证券股份有限公司

注册地址: 广东省广州市天河北路 183-187 号大都会广场 43 楼广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街 2 号 618 室

办公地址: 广东省广州市天河区天河北路 183-187 号大都会广场 40 楼 5 楼, 7 楼, 8 楼, 18 楼, 19 楼, 38-44 楼.

法定代表人: 孙树明

客户服务热线: 95575

公司网站: www.gf.com.cn

(15) 兴业证券股份有限公司

注册地址: 福建省福州市湖东路 268 号

办公地址: 福建省福州市湖东路 268 号

法定代表人: 兰荣

客户服务热线: 95562

公司网站: www.xyzq.com.cn

(16) 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

(17) 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

办公地址: 广东省深圳市福田区金田路 4018 号安联大厦 35 层

法定代表人: 王连志

客服电话: 4008-001-001

公司网站: www.essence.com.cn

(18) 上海证券有限责任公司

注册地址: 上海市四川中路 213 号久事商务大厦 7 楼

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: 李俊杰

客户服务热线: 021-962518

网址: www.962518.com

(19) 中泰证券股份有限公司

注册地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号

法定代表人: 李玮

客户服务热线: 95538

网址: www.zts.com.cn

(20) 光大证券股份有限公司

注册地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人: 薛峰

客服电话: 95525

公司网址: www.ebscn.com

(21) 中信证券 (山东) 有限责任公司

注册地址: 山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

办公地址: 山东省青岛市崂山区深圳路 222 号 1 号楼 2001

法定代表人: 姜晓林

客服电话: 95548

公司网址: www.citicssd.com

(22) 万联证券股份有限公司

注册地址: 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

办公地址: 广东省广州市天河区珠江东路 11 号高德置地广场 18、19 层

法定代表人: 张建军

客户服务电话: 400-8888-133

网址: www.wlzq.cn

(23) 东北证券股份有限公司

注册地址: 吉林省长春市自由大路 1138 号

办公地址: 吉林省长春市生态大街 6666 号

法定代表人: 李福春

服务热线: 95360

网址: www.nesc.cn

(24) 中国国际金融股份有限公司

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

办公地址: 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

(25) 申万宏源证券有限公司

注册地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

办公地址: 上海市徐汇区长乐路 989 号 45 层

法定代表人: 李梅

电话: 021-33389888

公司网址: www.swhysc.com

(26) 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

网址: www.hysec.com

(27) 爱建证券有限责任公司

注册地址: 上海市世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址: 上海市世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 祝健

客户服务电话: 4001-962-502

网址: www.ajzq.com

(28) 中信期货有限公司

注册地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座 13 层
1301-1305 室、14 层

办公地址: 深圳市福田区中心三路 8 号卓越时代广场 (二期) 北座 13 层
1301-1305 室、14 层

法定代表人: 张皓

客服电话: 400-990-8826

公司网站: www.citicsf.com

(29) 方正证券股份有限公司

注册地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段 200 号华侨国际大厦 22-24 层

办公地址: 湖南省长沙市芙蓉中路二段 200 号华侨国际大厦 22-24 层

法定代表人: 高利

客户服务热线: 95571

公司网站: www.foundersc.com

(30) 平安证券股份有限公司

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: 刘世安

客服电话: 95511-8

公司网站: www.stock.pingan.com

(31) 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: 上海市浦东新区东方路 1267 号 11 层

法定代表人: 张跃伟

客户服务电话: 400-820-2899

网址: www.erichfund.com

(32) 上海好买基金销售有限公司

注册地址: 上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

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

(33) 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

(34) 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

(35) 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.zscffund.com

(36) 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

(37) 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

(38) 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: 400-893-6885

网址: www.qianjing.com

(39) 一路财富 (北京) 信息科技股份有限公司

注册地址: 北京市西城区阜成门外大街 2 号 1 幢 A2208 室

法定代表人: 吴雪秀

客服电话: 400-001-1566

网址: www.yilucaifu.com

(40) 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: 金佶

客服电话: 400-820-2819

公司网站: <https://tty.chinapnr.com>

(41) 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: 李兴春

客服电话: 400-921-7755

公司网站: www.leadfund.com.cn

(42) 大泰金石基金销售有限公司

注册地址: 南京市建邺区江东中路 222 号南京奥体中心现代五项馆 2105 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

(43) 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

(44) 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: 鲍东华

客服电话: 4008219031

公司网站: www.lufunds.com

(45) 北京虹点基金销售有限公司

注册地址: 北京市朝阳区工人体育场北路甲 2 号裙房 2 层 222 单元

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: 胡伟

客服电话: 4006180707

公司网站: www.hongdianfund.com

(46) 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 801

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

(47) 深圳富济财富管理有限公司

注册地址: 深圳市南山区粤海街道科苑南路高新南七道惠恒集团二期 418 室

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: 刘鹏宇

客服电话: 0755-83999907

公司网站: www.jinqianwo.cn

(48) 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 (入住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

(49) 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: 400-166-6788

公司网站: www.66zichan.com

(50) 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: 张彦

客服电话: 400-166-1188

公司网站: 8.jrj.com.cn

(51) 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

(52) 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

(53) 北京晟视天下投资管理有限公司

注册地址: 北京市怀柔区九渡河镇黄坎村 735 号 03 室

办公地址: 北京市朝阳区万通中心 D 座 21 层

法定代表人: 蒋煜

客服电话: 400-818-8866

公司网站: <https://fund.shengshiview.com/>

(54) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

办公地址: 北京市海淀区东北旺西路中关村软件园二期(西扩)N-1、N-2 地块新浪总部科研楼 5 层 518 室

法定代表人: 李昭琛

客服电话: 010-62675369

公司网站: www.xincai.com

(55) 北京汇成基金销售有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

办公地址: 北京市海淀区中关村大街 11 号 11 层 1108

法定代表人: 王伟刚

客服电话: 400-619-9059

公司网站: <http://www.hcjijin.com>

(56) 北京肯特瑞财富投资管理有限公司

注册地址: 北京市海淀区中关村东路 66 号 1 号楼 22 层 2603-06

办公地址: 北京市大兴区亦庄经济开发区科创十一街 18 号院 A 座 17 层

法定代表人: 陈超

客服电话: 95118

公司网站: fund.jd.com

2、场内代销机构

场内将通过深圳证券交易所内具有基金销售业务资格并经深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司认可的会员单位发售(具体名单详见基金份额发售公告或相关业务公告)。本基金认购期结束前获得基金销售业务资格的会员单位也可代理场内基金份额的发售。尚未取得基金销售业务资格,但属于深圳证券交易所会员的其他机构,可在本基金上市后,代理投资者通过深圳证券交易所交易系统参与本基金份额的上市交易。

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。

(三) 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: 赵亦清

电话: (010) 50938782

传真: (010) 50938991

(四) 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

(五) 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: 中国 (上海) 自由贸易试验区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 507 单元 01 室

办公地址: 上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人: 李丹

电话: (021) 23238888

联系人: 张振波

经办注册会计师: 薛竞、张振波

(六) 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

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金（LOF）

五、基金的类型

股票型证券投资基金

六、基金的投资目标

本基金采用被动式投资策略，紧密跟踪中证锐联沪港深基本面 100 指数。在正常市场情况下，力争将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绝对值控制在 0.40% 以内，年跟踪误差控制在 5% 以内。

七、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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、质押及买断式回购、银行存款、衍生工具（股指期货、权证等）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。

基金的投资组合比例为：本基金的股票资产投资比例不低于基金资产的 90%，其中投资于中证锐联沪港深基本面 100 指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%，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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

如法律法规或监管机构变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

八、基金的投资策略

（一）资产配置策略

本基金以紧密跟踪标的指数，获取指数长期增长的稳定收益为宗旨，在降低跟踪误差和控制流动性风险的条件下，构建指数化的投资组合。

本基金股票资产占基金资产的比例不低于 90%，其中，标的指数成份股及其

备选成份股的投资比例不低于非现金基金资产的 80%。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,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。

(二) 股票投资策略

1、股票组合构建

本基金原则上采用完全复制法,即按照中证锐联沪港深基本面 100 指数中的成份股组成及其权重构建投资组合,并根据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,以及因基金的申购和赎回对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时,基金管理人会对投资组合进行适当调整,降低跟踪误差。

如出现股票停牌、股票流动性较差或其他影响指数复制的因素,使基金管理人无法依指数权重购买成份股时,基金管理人可以根据市场情况,结合经验判断,对投资组合进行适当调整,以获得更接近标的指数的收益率。

2、股票组合调整

(1) 定期调整

本基金股票组合根据所跟踪的中证锐联沪港深基本面 100 指数对其成份股的调整而进行相应的定期跟踪调整。

(2) 不定期调整

1) 与指数相关的调整

根据指数编制规则,当中证锐联沪港深基本面 100 指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重重调整时,本基金将进行相应调整。

2) 申购赎回调整

根据本基金的申购和赎回情况,对股票投资组合进行调整,从而有效跟踪标的指数。

3) 其它调整

根据法律、法规和基金合同的规定,成份股在标的指数中的权重因其他特殊原因发生相应变化的,本基金可以对投资组合管理进行适当变通和调整,力求降低跟踪误差。

本基金通过严格的投资流程和量化风险管理手段,力争将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绝对值控制在 0.50% 以内,年跟踪误差控制在 6% 以内。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围,基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(三) 债券投资策略

基于基金流动性管理和有效利用基金资产的需要,本基金将投资于流动性较好的国债、央行票据等债券,保证基金资产流动性,提高基金资产的投资收益。本基金将根据宏观经济形势、货币政策、证券市场变化等分析判断未来利率变化,结合债券定价技术,进行个券选择。

(四) 股指期货投资策略

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,选择流动性好、交易活跃的期货合约,并根据对股票市场和期货市场运行趋势的研判,以及对股指期货合约的估值定价,与股票现货资产进行匹配,实现多头或空头的套期保值操作,以对冲风险资产组合的系统性风险和流动性风险。利用股指期货的杠杆作用,降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差,达到有效跟踪标的指数的目的。

本基金投资股指期货的,基金管理人应在季度报告、半年度报告、年度报告等定期报告和招募说明书(更新)等文件中披露股指期货交易情况,包括投资政策、持仓情况、损益情况、风险指标等,并充分揭示股指期货交易对基金总体风险的影响以及是否符合既定的投资政策和投资目标。

(五) 权证投资策略

权证为本基金辅助性投资工具,投资原则为有利于加强基金风险控制,有利于提高基金资产的投资效率,控制基金投资组合风险水平,更好地实现本基金的投资目标。

若未来法律法规或监管部门有新规定的,本基金将按最新规定执行。

(六) 资产支持证券投资策略

本基金通过分析资产支持证券对应资产池的资产特征,来估计资产违约风险和提前偿付风险,根据资产证券化的收益结构安排,模拟资产支持证券的本金偿还和利息收益的现金流支付,并利用合理的收益率曲线对资产支持证券进行估

值。同时还将充分考虑该投资品种的风险补偿收益和市场流动性,控制资产支持证券投资的风险,以获取较高的投资收益。

九、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准为:中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%

沪港深基本面 100 指数以沪深交易所和香港联合交易所互联互通机制规定范围内可交易的 A 股及港股为样本,并以财务指标衡量的基本面价值来分配样本股的权重,其中基本面价值由四个财务指标来衡量:营业收入、现金流、净资产和分红。基本面指数以基本面价值来分配样本股的权重,而不是像传统市值指数中以市值(股价)为权重计算指数,从而打破了样本股价与其权重之间的关联,在一定程度上避免了传统市值指数中“高配高估股票,低配低估股票”的现象。基本面指数问世以来,迅速受到了众多养老基金、共同基金等机构投资者的欢迎。沪港深基本面 100 指数作为基于沪深交易所和香港联合交易所互联互通实施以来的首条基本面指数,具有深远意义和影响,也顺应了内地和香港市场投资者的需求。

由于本基金投资标的指数为中证锐联沪港深基本面 100 指数,且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,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 5%,因此,本基金将业绩比较基准定为中证锐联沪港深基本面 100 指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

如果中证锐联沪港深基本面 100 指数被停止编制或发布,或由其他指数替代(单纯更名除外),或由于指数编制方法等重大变更导致该指数不宜继续作为本基金的目标指数,或证券市场有其他代表性更强、更适合投资的指数推出时,基金管理人可以依据审慎原则,在充分考虑基金份额持有人利益的前提下,更换本基金的标的指数、业绩比较基准和投资对象,并依据市场代表性、流动性、与原标的指数的相关性等诸多因素选择确定新的标的指数,基金管理人应与基金托管人协商一致,并在履行适当程序后,报中国证监会备案并及时公告。

十、风险收益特征

本基金属于采用被动指数化操作的股票型基金,其预期的风险和收益高于货

币市场基金、债券型基金、混合型基金,为证券投资基金中的较高风险、较高收益品种。本基金将投资港股通标的股票,需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

十一、基金的投资组合

本投资组合报告所载数据截至 2017 年 9 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	69,721,869.02	93.81
	其中: 股票	69,721,869.02	93.81
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	4,335,366.36	5.83
8	其他资产	262,700.60	0.35
9	合计	74,319,935.98	100.00

注: 其中港股通股票投资 (81,921,632.2 元) 占总资产比例 56.23%。

(二) 报告期末按行业分类的股票投资组合

2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,301,451.00	1.77
C	制造业	3,825,556.00	5.21
D	电力、热力、燃气	1,036,220.00	1.41

	及水生产和供应业		
E	建筑业	2,720,255.00	3.70
F	批发和零售业	175,540.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	498,307.00	0.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	682,640.00	0.93
J	金融业	13,881,246.40	18.90
K	房地产业	1,109,000.00	1.51
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	25,230,215.40	34.35

2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

本期末本基金未持有积极投资股票。

2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	603,700.43	0.82
C 消费者常用品	474,407.66	0.65
D 能源	4,563,234.98	6.21
E 金融	26,016,124.02	35.42

F 医疗保健	-	-
G 工业	1,137,074.49	1.55
H 信息技术	1,052,507.83	1.43
I 电信服务	3,405,811.13	4.64
J 公用事业	1,504,624.65	2.05
K 房地产	5,734,168.43	7.81
合计	44,491,653.62	60.58

注：以上分类采用全球行业分类标准 (GICS)。

(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

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	H00005	汇丰控股	110,800	7,206,595.21	9.81
2	H00939	建设银行	899,000	4,949,711.32	6.74
3	H01398	工商银行	661,000	3,257,426.51	4.44
4	H00941	中国移动	36,000	2,421,021.20	3.30
5	H03988	中国银行	701,000	2,293,104.89	3.12
6	601318	中国平安	35,185	1,905,619.60	2.59
7	601328	交通银行	289,600	1,830,272.00	2.49
8	601288	农业银行	449,200	1,715,944.00	2.34
9	H02888	渣打集团	25,450	1,663,955.03	2.27
10	H00386	中国石油 化工股份	334,000	1,660,150.67	2.26

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

本期末本基金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序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。

(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序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

9.1 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。

9.2 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

10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

10.2 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。

10.3 本期国债期货投资评价

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

11.1 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内受到公开谴责、处罚的情况。

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的范围。

11.3 其他资产构成

序号	名称	金额 (元)
1	存出保证金	47,872.98
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	212,943.35
4	应收利息	1,884.27
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	262,700.60

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

11.6 报告期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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的股票。

11.7 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

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的股票。

11.8 投资组合报告附注的其他文字描述部分

-

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) 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
2017年04月27日至 2017年09月30日	4.74%	0.45%	6.46%	0.53%	-1.72%	-0.08%

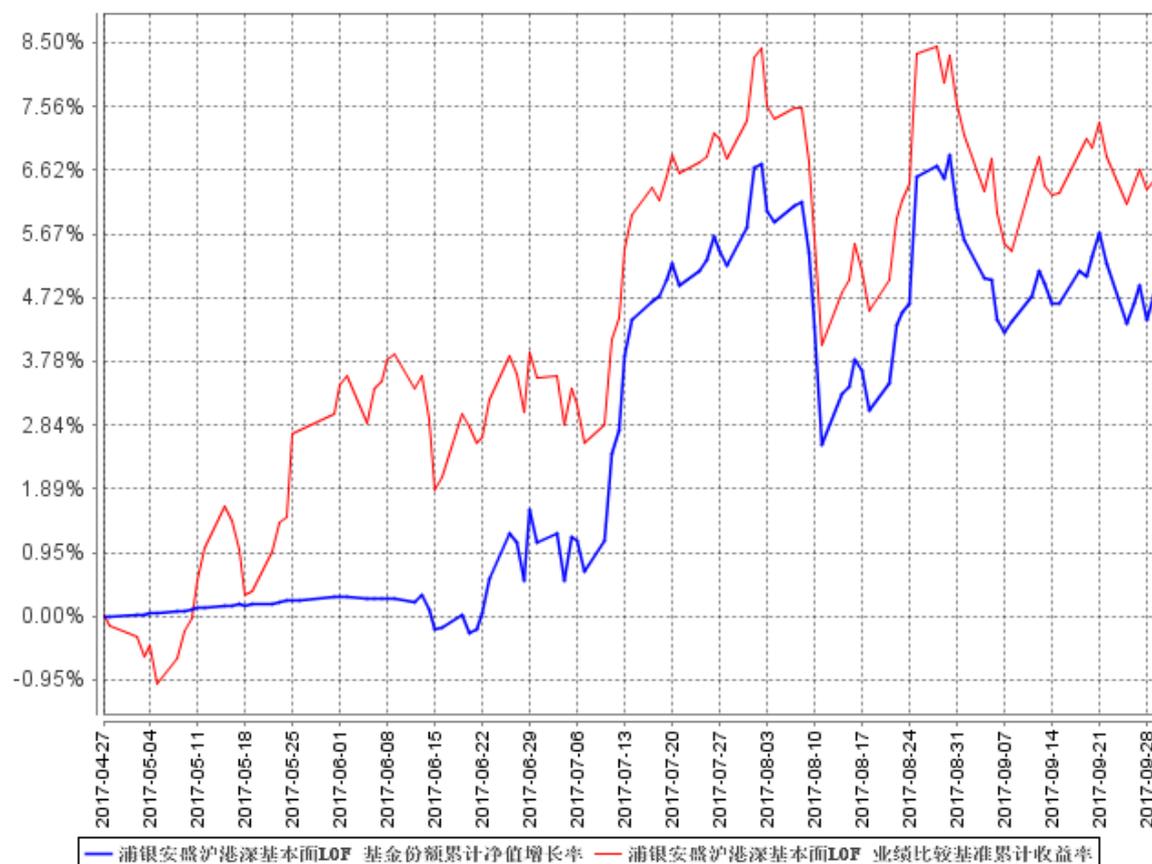
(二) 自基金合同生效以来基金累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛中证锐联沪港深基本面 100 指数证券投资基金 (LOF)

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

(2017年4月27日至2017年9月30日)

浦银安盛沪港深基本面LOF 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



十三、基金费用概况

(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费、律师费、诉讼费和仲裁费；
- 5、基金份额持有人大会费用；
- 6、基金的证券、期货交易费用或结算而产生的费用；
- 7、基金的银行汇划费用；
- 8、基金的指数许可使用费；
- 9、基金上市费用及年费；
- 10、账户开户费用和账户维护费；
- 11、因投资港股通标的股票而产生的各项合理费用；
- 12、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 1.00% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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 0.22% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.22\% \div \text{当年天数}$$

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 5 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、基金的指数许可使用费

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指数许可使用费。如上述指数许可使用协议约定的指数许可使用费的费率、计算方法及其他相关条款发生变更，本条款将相应变更，而无需召开基金份额持有人大会。基金管理人应及时按照《信息披露办法》的规定在指定媒介进行公告。指数许可使用费自基金合同生效之日起从基金资产中计收，计算方法如下：

指数许可使用费按前一日的基金资产净值的 0.09% 的年费率计提。指数许可

使用基点费每日计算, 逐日累计, 按季支付。计算方法如下:

$$H=E \times 0.09\% \div \text{当年天数}$$

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

基金合同生效之日所在季度的指数许可使用费, 按实际计提金额收取, 不设下限。自基金合同生效之日所在季度的下一个季度起, 指数许可使用费的收取下限为每季度 5 万元。指数许可使用费将按照上述指数许可协议的约定进行支付。

除管理费、托管费和基金的指数许可使用费之外的基金费用, 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

在法律法规规定的范围内, 经与基金托管人协商一致, 在履行相应程序后, 基金管理人可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率, 此项调整需召开基金份额持有人大会审议。

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

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资

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、在“重要提示”部分,更新了招募说明书所载内容截止日和有关财务数据和净值表现截止日;
- 2、在“第三部分 基金管理人”部分,对基金管理人概况、主要人员情况及基金管理人的内部控制制度进行了更新;
- 3、在“第四部分 基金托管人”部分,更新了基金托管人基本情况、发展概况及财务状况及基金托管业务的经营情况;
- 4、在“第五部分 相关服务机构”部分,对基金份额发售机构部分内容进行了更新;
- 5、在“第六部分 基金的募集”部分,更新了部分内容;
- 6、在“第七部分 基金合同的生效”部分,更新了部分内容;
- 7、在“第十部分 基金的投资”部分,更新并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 2017 年 9 月 30 日的投资业绩;
- 8、在“第二十部分 基金托管协议的内容摘要”部分,更新了托管协议当事人;
- 9、在“第二十二部分 其他应披露事项”部分,更新了截至 2017 年 10 月 27 日刊登于《中国证券报》和公司网站的与本基金相关的公告及基金管理人和基金管理人子公司投资本基金的情况。

浦银安盛基金管理有限公司

二〇一七年十二月九日