

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
报告送出日期:二〇一三年八月二十七日

1 重要提示

基金管理人、基金托管人、基金份额持有人应当遵守基金合同,不得损害基金份额持有人和其他基金合同当事人的合法权益。基金财产的营运,应当以基金合同为依据,不得违反基金合同的约定。本基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等基金合同当事人因基金合同而产生的任何纠纷,应本着诚实信用、勤勉尽责的原则处理。基金合同当事人在履行本合同过程中,应当遵守有关法律、法规、规章、基金合同及本基金管理人、基金托管人、基金份额持有人等基金合同当事人所达成的其他协议。

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。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其摘要。

本年度报告摘要将摘要自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告全文。

本报告期从2013年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称:浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金
基金主代码:519116
交易代码:519116
基金运作方式:契约型开放式
基金合同生效日:2010年12月10日
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
报告期末基金份额总额:212,756,169.68份
基金会计核算办法:定期报告

2.2 基金产品说明

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管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,基金资产的长期增值。

本基金对业绩比较基准的跟踪误差目标是: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%。

本基金为沪深300指数为目标指数,采用指数化投资为手段,增强型策略为基础的投资策略,在有效控制目标指数的基础上,通过本基金自有资金的运用,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。

业绩比较基准:沪深300指数收益率×95%+1%
(%指年收益率,平均时长为10年,累计数折算)。

本基金为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,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。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目 基金管理人 基金托管人
名称 浦银安盛基金管理有限公司 中国建设银行股份有限公司

姓名 顾佳 田青

信息披露负责人 联系电话 021-23212888 电子邮箱 compliance@py-axa.com

客户服务电话 021-33079999 900 088-8828-999 010-67595096

传真 021-23212985 010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址:www.py-axa.com

基金半年度报告置备地点:基金管理人、基金托管人的办公场所

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标 报告期(2013年1月1日至2013年6月30日)

本期已实现收益 9,150,700.95

本期利润 -18,528,991.70

加权平均基金份额本期利润 -0.0846

本期基金份额净值增长率为 -10.93%

3.1.2 期末数据和指标 报告期末(2013年6月30日)

期末可供分配基金份额利润 -0.2746

期末基金份额净值 154,330,627.81

期末基金份额净值 0.725

注:1.上述业绩指标不包括持有人申购、赎回基金等各项交易费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。

3.本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

4.期末可供分配利润指期末资产负债表中未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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 份额净值增长率为% 增长标准差(%) 业绩比较基准收益率(%) ①-③ ②-④

过去一个月 -14.20% 1.79% -14.76% 1.77% 0.56% 0.02%

过去三个月 -10.60% 1.36% -11.00% 1.38% 0.40% -0.02%

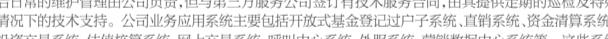
过去六个月 -10.93% 1.36% -11.68% 1.42% 0.75% -0.06%

过去一年 -8.92% 1.27% -9.10% 1.30% 0.18% -0.03%

自基金合同生效起至今 -27.50% 1.24% -26.24% 1.27% -1.26% -0.03%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动与其同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
2010年1月10日至2013年6月30日



4 管理人报告

4.1 基金管理人及其基金经理的情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

浦银安盛基金管理有限公司(以下简称“浦银安盛”)成立于2007年8月,由上海浦东发展银行股份有限公司、AX Investment Managers S.A.及上海海盛投资有限公司共同创建,公司总部设在上海,注册资本人民币2亿元,股东持股比例分别为51%、39%和10%。公司主要从事基金募集、基金销售、资产管理及证监会许可的其他业务。

截至2013年6月30日止,浦银安盛旗下12只基金,即浦银安盛价值成长股票型证券投资基金、浦银安盛优化配置证券型投资基金、浦银安盛货币基金、浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金、浦银安盛幸福回报定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛战略新兴产业混合型证券投资基金、浦银安盛6个月定期开放债券型证券投资基金、浦银安盛季季利定期开放债券型证券投资基金。

公司信息技术系统由信息技术系统基础设施以及行业业务系统所组成。信息技术系统基础设施包括机房、网络、操作系统、这些系统由公司筹建之初由专业的系统集成公司负责建设,之后日常的维护将由公司负责。公司应用系统主要分为行业系统、直销系统、资金清算系统、投资交易系统、估值系统、网上交易系统、呼叫中心系统、营销系统、营销支持系统等。这些系统的应用将随着公司的系统升级,升级后的系统也是系统提供的对外提供的应用系统。公司应用系统日常的维护由公司负责,但系统提供商将有技术服务合同,由其提供定期的巡检及特殊情况下技术支持。除上述情况外,我公司未委托服务机构代为办理必要的、特定的信息技术系统开发、维护事宜。

另外,本公司可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。

4.1.2 基金经理(基金经理小组)及基金经理助理的简介

姓名 职务 任本基金的基金经理(助理)期限 证券从业年限 说明

陈士俊 陈士俊,清华大学博士学历。2001年至2003年间曾在中国泰安证券有限公司研究所担任金融工程研究员,2003年8月至2007年10月任中国银河基金管理有限公司工作,先后担任金融工程部研究员、研究部主管,2007年10月至今年,任本公司金融工程部总监,并担任本公司金融工程部总监,同时兼任公司金融工程部总监,2010年12月起兼任本公司金融工程部总监,2012年5月起,兼任浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理助理。

注:1.陈士俊作为本基金的首任基金经理,其任职日期为本基金成立之日。
2.证券从业的含义遵从《证券业从业人员执业行为准则》的规定。
3.罗雯的任命日期根据公司公告确定的聘任日期。

4.2 管理人对报告期内基金运作的说明

本报告期内,基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定,公司的管理制度、本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理运用基金资产,在严格控制风险的前提下,以保护基金份额持有人利益为最高宗旨。

4.3 管理人对报告期公平交易的专项说明

本基金管理人已制定了《公平交易管理规定》,建立健全有效的公平交易执行体系,保证公平对待每一个基金组合。

在具体执行中,在投资决策流程上,构建统一的研究平台,为所有投资组合公平的提供研究支持。同时,在投资决策过程中,严格遵守公司的所有投资决策制度和投资授权制度,保证基金经理及专户业务的独立投资决策机制,在交易执行环节上,详细规定了对不同投资组合的投资指令的交易执行的流程和规定,以保证投资组合执行公平性原则,从事后监督角度上,一方是定期对投资交易情况进行分析,对不同时间窗口(日、3日)内发生的不同组合对同一股票的向同方向反向交易进行价差分析,并进行统计显著性的检验,以确定交易行为是否公平。另一方面是公司对公平交易制度的遵守和相关业务流程的执行情况进行定期检查,并及时进行定期的报告。

4.3.2 异常交易专项说明

本报告期内未发现本基金管理人存在违反法律、法规、中国证监会和证券交易所颁布的相关规范性文件中认定的异常交易行为,报告期内未发生影响公平交易的事件。

4.4 管理人对报告期内基金的经营业绩和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金管理人运作分析

2013年上半年,中国经济延续2011年以来的增速下滑趋势,但幅度有所收窄。新一届政府的经济政策取向更加注重经济的平稳增长,严格限制产能过剩行业的发展,同时节能环保在预期和落实方面,股票市场的表现也作出了相应反应,上半年期指和创业板指数表现不佳,在量化因子角度看,股票价格变

化呈现强者恒强的态势,质量和盈利动量因子表现突出,价值因子表现较差。本报告期内,本基金严格执行量化增强策略,组合表现优于同期业绩基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年6月30日,本基金份额净值为0.725元,报告期基金份额净值增长率为-10.93%,同期业绩基准净值增长率为-11.68%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及基金市场的展望

展望下半年,经济结构转型将更加深入,经济增速也将趋于平稳。股票市场目前估值水平处于历史低位,投资者对中国经济前景的悲观预期已经反映在股价之中,伴随着经济增速逐渐企稳,相信下半年股票市场将会有较好的表现。

4.6 基金的组合策略

本基金对股票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管理,力争获得超越业绩比较基准的投资收益,基金资产的长期增值。

本基金对业绩比较基准的跟踪误差目标是: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%。

本基金为沪深300指数为目标指数,采用指数化投资为手段,增强型策略为基础的投资策略,在有效控制目标指数的基础上,通过本基金自有资金的运用,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。

4.7 管理人对报告期内基金的经营情况的说明

本报告期内,本基金无重大投资决策和运作情况。

4.8 管理人对基金未来投资运作的展望

展望下半年,经济结构转型将更加深入,经济增速也将趋于平稳。股票市场目前估值水平处于历史低位,投资者对中国经济前景的悲观预期已经反映在股价之中,伴随着经济增速逐渐企稳,相信下半年股票市场将会有较好的表现。

4.9 基金的估值方法

本基金的估值方法参见本招募说明书“基金的估值”部分。

4.10 基金的费用

本基金的费用参见本招募说明书“基金的费用”部分。

4.11 基金的税收

本基金的税收参见本招募说明书“基金的税收”部分。

4.12 基金的会计政策

本基金的会计政策参见本招募说明书“基金的会计政策”部分。

4.13 基金的审计

本基金的审计报告参见本招募说明书“基金的审计”部分。

4.14 基金的复核和公告

本基金的复核和公告参见本招募说明书“基金的复核和公告”部分。

4.15 基金的接触

本基金的接触参见本招募说明书“基金的接触”部分。

4.16 基金的上市

本基金的上市参见本招募说明书“基金的上市”部分。

4.17 基金的交易

本基金的交易参见本招募说明书“基金的交易”部分。

4.18 基金的转托管

本基金的转托管参见本招募说明书“基金的转托管”部分。

4.19 基金的定期定额投资

本基金的定期定额投资参见本招募说明书“基金的定期定额投资”部分。

4.20 基金的转换

本基金的转换参见本招募说明书“基金的转换”部分。

4.21 基金的开放

本基金的开放参见本招募说明书“基金的开放”部分。

4.22 基金的暂停

本基金的暂停参见本招募说明书“基金的暂停”部分。

4.23 基金的终止

本基金的终止参见本招募说明书“基金的终止”部分。

4.24 基金的清算

本基金的清算参见本招募说明书“基金的清算”部分。

4.25 基金的上市交易

本基金的上市交易参见本招募说明书“基金的上市交易”部分。

4.26 基金的上市地

本基金的上市地参见本招募说明书“基金的上市地”部分。

4.27 基金的上市交易日

本基金的上市交易日参见本招募说明书“基金的上市交易日”部分。

4.28 基金的上市交易时间