

浦银安盛中证锐联基本面400指数证券投资基金

[2014]第三季度报告

基金管理人：浦银安盛基金管理有限公司
基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期：2014年10月24日

§1 重要提示

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。
本基金托管人（中国邮政储蓄银行股份有限公司）根据基金合同规定，于2014年10月22日复核了本报告中的全部内容，净值表示和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期末财务资料自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称 沪银安盛基本面400指数

基金主代码 519117

交易代码 519117

基金运作方式 约定型开放式

基金合同生效日 2012年5月14日

报告期末基金份额总额 47,618,371.28份

投资目标 本基金采取量化指数化投资策略，通过严格的投资纪律约束和数量化的风险管理指标，追求对标的指数的跟踪误差。本基金力争在扣除基金管理费后的净值增长率与标的指数收益率之间的日平均跟踪误差绝对值不超过0.35%，年化跟踪误差不超过4%，以实现对业绩基准的基准。

投资策略 本基金采行完全复制方法进行指数化投资，依据中证锐联基本面400指数成份股的分布，按照行业权重配置，使股票组合能有效跟踪标的指数并降低跟踪误差。本基金在日常管理中定期评估跟踪误差，当跟踪误差超过4%时，将通过增加或减少对某些股票的配置比例，以降低跟踪误差。

业绩比较基准 中证锐联基本面400指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

风险收益特征 本基金主要采用被动指数化操作的股票型基金，其预期的风险和收益低于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，为证券投资基金中的较低风险、较高收益品种。

基金管理人 沪银安盛基金管理有限公司

基金托管人 中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标 单位：人民币元

主要财务指标 报告期(2014年7月1日-2014年9月30日)

1.本期已实现收益 3,977,318.72

2.本期利润 13,908,094.54

3.加权平均基金份额本期利润 0.2235

4.期末基金资产净值 57,408,236.28

5.期末基金份额净值 1.206

注1. 上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平将低于列示数字。

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。

3.2 本期报告期基金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 累计净值增长 率① 年化标准差 率② 基准收益 率③ 基准年化标准差 率④ ①-③ ②-④

过去三个月 23.10% 0.88% 23.67% 0.08% -0.48% -0.01%

3.2.2 本基金合同生效以来基金累计增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

浦银安盛基本面400指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2012年6月14日-2014年9月30日)

该图显示了浦银安盛基本面400指数证券投资基金成立以来的份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比情况。

该图显示了浦银安盛基本面400指数