

浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金

[2015]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:中银银行股份有限公司
报告送出日期:2015年10月27日
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。

基金托管人对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。

基金合同由基金管理人和基金托管人根据法律法规及基金合同约定,于2010年1月10日签署了基金合同,该基金合同自同日成立。

基金合同的任何修订均需经基金份额持有人大会审议批准。

基金财产的运作严格按照基金合同的规定进行。

本基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本报告期自2015年7月1日起至9月30日止。

§ 2 基本产品概况

基金简称:浦银安盛沪深300指数增强

场内简称:—

基金主代码:619116

交易代码:619116

基金运作方式:契约型开放式

基金合同生效日:2010年1月10日

报告期末基金份额总额:74,326,637.34份

投资目标

本基金主要投资于指数增强型基金,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指数的指数组合管理与风险管理,力争超越业绩比较基准的绝对收益,谋求基金的长期稳健增值。

本基金在严格控制风险的前提下,力争超越业绩比较基准的绝对收益,力争基金的长期稳健增值与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.20%,年化跟踪误差不超过0.75%。

投资策略

本基金的300指数收益率*95%+1%*(指收益,评价时按时间算计系数评价)

风险收益特征

本基金是一只股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的基金品种。

基金管理人

浦银安盛基金管理有限公司

基金托管人

中国银行股份有限公司

§ 3 主要财务指标

基金简称:浦银安盛沪深300指数增强

报告期:2015年7月1日-2015年9月30日

单位:人民币元

1.本期已实现收益 6,999,790.07

2.本期利润 -27,409,064.76

3.期初至报告期期末的利润 -3,032.4

4.期末基金净值 -28,322,932.04

5.期末基金份额净值 1.0864

注:1.本基金的财务指标不包括持有人认购或交易基金的各笔费用,计入费用后实际收益水平将低于所列数字。

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.基金净值

4.本期利润指基金利润与已实现收益的差额。

5.期末基金份额净值=期末基金资产净值/期末基金份额总额。

6.本期基金份额净值增长率=报告期利润/报告期初基金份额净值。

7.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

8.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

9.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

10.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

11.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

12.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

13.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

14.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

15.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

16.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

17.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

18.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

19.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

20.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

21.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

22.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

23.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

24.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

25.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

26.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

27.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

28.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

29.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

30.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

31.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

32.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

33.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

34.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

35.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

36.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

37.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

38.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

39.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

40.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

41.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

42.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

43.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

44.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

45.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

46.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

47.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

48.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

49.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

50.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

51.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

52.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

53.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

54.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

55.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

56.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

57.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

58.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

59.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

60.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

61.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

62.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

63.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

64.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

65.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

66.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

67.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

68.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

69.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

70.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

71.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

72.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

73.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

74.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

75.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

76.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

77.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

78.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

79.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

80.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

81.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

82.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

83.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

84.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

85.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

86.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

87.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

88.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

89.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

90.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

91.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

92.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

93.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

94.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

95.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

96.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

97.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

98.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

99.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

100.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

101.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

102.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

103.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

104.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

105.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

106.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

107.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

108.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

109.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

110.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

111.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

112.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

113.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

114.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

115.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

116.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法

117.报告期基金份额净值增长率和净值增长率标准差的计算方法