浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金招募说明书摘要（更新）

2015年第2号

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
内容截止日：2015年12月10日

重要提示

本基金经2010年7月14日中国证券监督管理委员会证监许可【2010】961号文核准募集。本基金的基金合同于2010年12月10日正式生效。

基金管理人保证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核准，但中国证监会对本基金募集的核准，并不表明其对本基金的价值和收益作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、谨慎勤勉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，对认（申）购基金的意愿、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，由于基金投资人连续大量赎回基金份额产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金投资策略所特有的风险等等。

投资有风险，投资人在认（申）购本基金前应认真阅读本基金的《招募说明书》和《基金合同》。过往业绩并不代表将来表现。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。

本摘要根据基金合同和基金招募说明书编写，并经中国证监会核准。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2015年12月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2015年9月30日（财务数据未经审计）。

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：上海市浦东新区浦东大道981号3幢316室
办公地址：上海市淮海中路381号中环广场38楼
邮政编码：200020
法定代表人：姜明生
成立时间：2007年8月5日
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
组织形式：有限责任公司
注册资本：2.8亿元
存续期间：持续经营
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：徐莹

（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。自2009年11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技术学院。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。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。

廖汇旭先生，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。

郁蓉华女士，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。

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。

王家祥女士，独立董事。1980年至1985年担任上海外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。

金杰先生，董事。上海财经大学工商管理硕士。曾先后就职于上海上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。

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。董叶顺先生拥有7年投资行业经历，曾任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），历任国定收益产品专家、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

郁蓉华女士，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。

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。历任中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。

李宗宇先生，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日起兼任本基金基金经理，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。陈士俊先生具有14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

郁蓉华女士，本公司总经理，董事，并任投资决策委员会主席。

李宗宇先生，本公司副总经理兼首席市场营销官。

黄列先生，本公司研究部总监。

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以及浦银安盛中证锐联基本面400指数基金基金经理并兼任本公司职工监事。

吴勇先生，本公司权益投资部总监，公司旗下浦银安盛红利精选混合型证券投资基金、浦银安盛精致生活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及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。

薛铮先生，本公司固定收益投资部总监，公司旗下浦银安盛优化收益债券型证券投资基金、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及浦银安盛月月盈安心养老定期支付债券型证券投资基金基金经理。

蒋建伟先生，本公司旗下浦银安盛价值成长混合型证券投资基金、浦银安盛新经济结构灵活配置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）基本情况

名称：中国建设银行股份有限公司(简称：中国建设银行)
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
成立时间：2004年09月17日
组织形式：股份有限公司
注册资本：贰仟伍佰亿壹仟零玖拾柒万柒仟肆佰捌拾陆元整
存续期间：持续经营
基金托管资格批文及文号：中国证监会证监基字[1998]12号
联系人：田青
联系电话：(010) 6759 5096

（二）主要人员情况

赵观甫，投资托管业务部总经理，曾先后在中国建设银行郑州市分行、总行信贷部、总行信贷二部、行长办公室工作，并在中国建设银行河北省分行营业部、总行个人银行业务部、总行审计部担任领导职务，长期从事信贷业务、个人银行业务和内部审计等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张军红，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行青岛分行、中国建设银行总行零售业务部、个人银行业务部、行长办公室，长期从事零售业务和个人存款业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

张力钟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行建筑经济部、信贷二部、信贷部、信贷管理部、信贷经营部、公司业务部，并在总行集团客户部和中国建设银行北京市分行担任领导职务，长期从事信贷业务和集团客户业务等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

黄秀莲，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行会计部，长期从事托管业务管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

（三）基金托管业务经营情况

作为国内首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国建设银行一直秉持“以客户为中心”的经营理念，不断加强风险管理和内部控制，严格履行托管人的各项职责，切实维护资产持有人的合法权益，为资产委托人提供高质量的托管服务。经过多年稳步发展，中国建设银行托管资产规模不断扩大，托管业务品种不断增加，已形成包括证券投资基金、社保基金、保险资金、基本养老个人账户、QFII、企业年金等产品在内的托管业务体系，是目前国内托管业务品种最齐全的商业银行之一。截至2015年9月末，中国建设银行已托管537只证券投资基金。中国建设银行专业高效的托管服务能力和业务水平，赢得了业内的高度认同。中国建设银行自2009年至今连续五年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”。

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
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、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）

交易网站：www.py-axa.com
客服电话：400-8828-999；（021）33079999

2、场外代销机构

（1）中国建设银行股份有限公司
住所：北京市西城区金融大街25号
办公地址：北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
法定代表人：王洪章
客户服务电话：95533
网址：www.ccb.com

（2）上海浦东发展银行股份有限公司
注册地址：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
公司网站：www.spdb.com.cn

（3）交通银行股份有限公司
办公地址：上海市浦东新区银城中路188号
法定代表人：牛锡明
客服电话：95559
网址：www.bankcomm.com

（4）中信银行股份有限公司
住所：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
办公地址：北京市东城区朝阳门北大街富华大厦C座
法定代表人：常振明
客服电话：95558
网址：bank.ecitic.com

（5）招商银行股份有限公司
地址：深圳市福田区深南大道7088号招商银行大厦
法定代表人：李建红
客服电话：95555
网址：www.cmbchina.com

（6）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
客服电话：400-8888-666
网址：www.gtja.com

（7）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
客服电话：95523 或 4008895523
网址：www.swhysc.com

（8）光大证券股份有限公司
住所：上海市静安区新闸路1508号
法定代表人：薛峰
客服电话：95525
网址：www.ebscn.com

（9）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—45层
法定代表人：宫少林
客户服务热线：95565
网址：www.newone.com.cn

（10）海通证券股份有限公司
注册地址：上海市淮海中路98号
办公地址：上海市广东路689号1001A室
法定代表人：王开国
客户服务电话：95553 或4008888001
网址：www.htsec.com

（11）华福证券有限责任公司
注册地址：福州市五四路157号新天地大厦7、8层
法定代表人：黄金琳
客服热线：0591-96326
网址：www.hfzq.com.cn

（12）广发证券股份有限公司
住所：广州市天河北路183号大都会广场43楼
法定代表人：孙树明
客户服务电话：95575
网址：www.gf.com.cn

（13）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
客服热线：400-800-8899
网址：www.cindasc.com

（14）兴业证券股份有限公司
注册地址：福州市湖东路268号
法定代表人：兰荣
客户服务电话：95562
网址：www.xyzq.com.cn

（15）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
法定代表人：许建平
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（16）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
客户服务电话：021-962518客户服务电话：962518
网址：www.962518.com

（17）中信建投证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址：北京市朝阳门内大街188号
法定代表人：王常青
客户服务电话：400-8888-108
公司网址：www.csc108.com

（18）中国银河证券股份有限公司
地址：北京市西城区金融大街35 号国际企业大厦C 座
法定代表人：陈有安
客户服务电话：4008-888-888
网址：www.chinastock.com.cn

（19）华泰证券股份有限公司
地址：江苏省南京市中山东路90号华泰证券大厦
法定代表人：吴万善
客户服务电话：95597
网址：www.htsc.com.cn

（20）天相投资顾问有限公司
地址：北京市西城区金融街19号富凯大厦B座701
法定代表人：林义相
客户咨询电话：010-66045678
网址：www.txsec.com
天相基金网网址：www.jjm.com.cn

（21）中国工商银行股份有限公司
住所：北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址：北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人：姜建清
客户服务热线：95588
公司网址：www.icbc.com.cn

（22）民族证券有限责任公司
注册地址：北京市朝阳区北四环中路27号院5号楼40层-43层
法定代表人：赵大建
客户服务热线：40088－95618
网址：www.e5618.com

（23）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

（24）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

（25）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
法定代表人：牛冠兴
客服电话：4008001001
网址：www.essence.com.cn

（26）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

（27）民生证券股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门内大街28号民生金融中心A座16－18层
客服电话：95558
网址：www.mszq.com

（28）华夏银行股份有限公司
注册地址：北京市东城区建国门那大街22号
法定代表人：吴建
客服电话：95577
网址：www.hxb.com.cn

（29）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
咨询电话：95594
网址：www.bankofshanghai.com

（30）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

（31）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

(32)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

(33) 德邦证券有限责任公司
注册地址：上海市普陀区曹杨路510号南半幢9楼
办公地址：上海市浦东新区福山路500号26楼
法定代表人：姚文平
客户服务电话：4008888128
网址：www.tebon.com.cn

(34) 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：400-076-1623
网址：www.fund123.cn

(35)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

(36)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

(37) 北京晨信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

（38）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

（39）万银财富（北京）基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区北四环中路27号盘古大观3201
法定代表人：李招弟
服务热线：400-059-8888
网址：www.wy-fund.com

（40）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

（41）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

（42）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

（43）东北证券股份有限公司
地址：长春市自由大路1138号
法定代表人：杨树财
服务热线：400-600-0686
网址：www.nesc.cn

（44）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

（45）广州证券股份有限公司
注册地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
办公地址：广州市天河区珠江西路5号广州国际金融中心主塔19层、20层
法定代表人：邱三发
服务热线：020-961303
网址：www.gzs.com.cn

（46）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：400-678-5095
网址：www.niuji.net

（47）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室
法定代表人：吴雪秀
客服电话：400-001-1566
网址：www.yilucaifu.com

（48）深圳宜投基金销售有限公司
注册地址：深圳市前海深港合作区前湾一路鲤鱼门街1号深港合作区管理局综合办公楼A栋201
办公地址：深圳市福田区金田路2028号皇岗商务中心2405
法定代表人：华建强
客服电话：4008-955-811
公司网站：www.yitfund.com

（49）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

（50）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

（51）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：400-062-6766
公司网站：www.leadbank.com.cn

（52）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

（53）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

（54）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

（55）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

（56）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

3、场内代销机构

投资者可通过“上证基金通”办理本基金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。

（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：上海通力律师事务所
办公地址：上海市银城中路68号时代金融中心19楼
负责人：韩炯
电话：（021）31358666
传真：（021）31358600
联系人：安冬
经办律师：安冬、吕红

（四）审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师

公司全称：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
传真：（021）23238800
联系人：黄靖妤
经办注册会计师：薛竞、黄靖妤

（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

浦银安盛沪深300指数增强型证券投资基金

五、基金的类型

契约型开放式

六、基金的投资目标

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控制，力争获得超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金对业绩比较基准的跟踪目标是：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%。

七、基金的投资范围

本基金资产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、债券、权证以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。其中，股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的80%。现金、债券资产及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%－10%，其中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的5%，权证及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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。

八、投资策略

本基金以沪深300指数为目标指数，采用“指数化投资为主、增强型策略为辅”的投资策略。在有效复制目标指数的基础上，通过公司自有量化增强模型，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。

（一）资产配置策略

在各类投资资产配置上，本基金为保持对目标指数的紧密跟踪，股票资产占基金资产的比例不低于90%，投资于沪深300指数成份股和备选成份股的资产比例不低于股票资产的80%。本基金还将根据宏观经济趋势、资产估值水平、市场投资者情绪以及宏观经济、市场政策等因素的变化在本基金的投资范围内进行适度动态调整股票和债券等资产的配置比例，在控制与目标指数的跟踪误差的前提下，适度获取超越目标指数的收益。

（二）股票投资策略

1、指数化投资

本基金投资策略是复制目标指数并增强收益表现，即根据目标指数的成份股在指数中的权重比例，在严格控制跟踪误差的基础上构建基金实际投资组合。在控制跟踪误差的过程中，首先要保持对目标指数的深入研究和跟踪调整。

（1）定期调整

本基金将按照沪深300指数对成份股及其权重的定期调整方案，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

（2）不定期调整

根据指数编制规则，当沪深300指数成份股因增发、送配等股权变动而需进行成份股权重调整时，本基金将根据中证指数有限公司发布的临时调整决定，在考虑跟踪误差风险的基础上，对股票投资组合进行相应调整。

（3）特殊情形下的调整

本基金在某些特殊情形下将选择其他股票或股票组合对目标指数中的成份股票加以替换，这些情形包括：①法律法规的限制；②目标指数成份股流动性严重不足；③本基金资产规模过大导致本基金持有该股票比例过高；④成份股上市公司存在重大虚假陈述等违规行为，或者面临重大的不利行政处罚或司法诉讼等，本基金进行替换遵循以下原则：①用于替换的股票与被替换的股票属于同一行业，经营业务相似度高；②用于替换的股票与被替换的股票的市场价格收益表现具有很强的相关性，能较好地代表被替换股票的收益表现；③用于替换的股票优先从目标指数的其他成份股中挑选，如不能挑选出较合适的替换股票，再考虑从非目标指数成份股的股票中挑选。

2、增强型策略

本基金的增强型策略主要包括：A、成份股多因子量化α增强策略；B、非成份股优选增强策略。本基金的增强型策略的核心是成份股多因子量化α增强策略。

（1）成份股多因子量化α增强策略

本基金的成份股量化增强策略通过公司自主研发的多因子量化α模型来实现。该模型包括：价值、盈利动量、质量和技术等四个因子，每个因子分别由多项指标组合而成。其中，价值因子是衡量股票的估值水平，指标包括市盈率、市净率、预测动态市盈率等；盈利动量因子是反映上市公司业绩增长的情况，指标包括盈利增长率、盈利预测修正等；质量因子是反映上市公司资产盈利水平和财务状况，指标包括盈利性、运营效率、债务杠杆和流动性等；技术因子是反映股票市场交易的情况，指标包括价格动量/反转、规模、换手率等。以上四个因子既相互独立，又综合反映了股票市场的诸多驱动因素，并且在不同的市场阶段具有显著不同的收益表现，因此本基金通过该多因子模型能够较好地分析股票市场的运行特征，寻找良好的投资机会。

该模型所使用的数据来自本公司的金融数据库和外部咨询机构的数据库，数据包括上市公司公开披露的各类报表信息，股票市场交易价格信息，以及分析师盈利预测数据等等。模型对上述基础数据进行数据整理，定期计算股票的各因子指标数值，检测各因子指标的市场收益表现，筛选出具有稳定且显著超额收益的优势指标，构建多因子评分体系。本基金将密切跟踪模型各因子、指标的收益表现及变化，定期对各因子、指标进行回顾分析，并结合当前市场情况，形成对模型因子的收益预期的判断，适时调整各因子的配置权重以及各因子内部指标的构成和权重，以期最终上述多因子评分体系。

根据每个成份股的因子评分结果，以成份股在目标指数中的基准权重为基础，在一定的比例范围内进行超配或低配选择，获取增强型投资收益。

（2）非成份股优选增强策略

本基金采用定性和定量相结合的方法，在非目标指数成份股中，选择优秀的成长型上市公司股票。非成份股优选的原则包括：①具有高于行业平均的资产收益率和净经营性现金流回报率；②具有高于行业平均的营业收入增长率和盈利增长率；③具有较高的行业技术壁垒，较高的研发投入等。在严格控制非成份股风险暴露度和组合跟踪误差的前提下，本基金通过适度投资于优选的成长型上市公司股票，获取一定的超额收益，增强整体投资组合的收益表现。

3、风险预估和控制

为有效地控制基金的跟踪误差，本基金采用公司自有的风险预算模型，根据基金投资组合相对业绩比较基准的资产配置暴露度、行业配置暴露度和个股投资比例暴露度，计算跟踪误差的预估值，对基金的跟踪误差进行估计和控制，预先防范基金收益表现偏离业绩比较基准过大的风险。

同时，本基金还将密切跟踪基金的实际跟踪误差，及时分析跟踪误差的来源，调整基金投资组合，将跟踪误差控制在跟踪目标以内。

4、本基金通过适当投资一级市场申购的股票（包括新股与增发）以在不增加额外风险的前提下提高收益水平。

（三）债券投资策略

本基金债券投资的目的是保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。

本基金基于对国内外宏观经济形势、财政货币政策、以及流动性等因素及其对债券市场影响的深入分析，进行合理的利率预期，判断债券市场的基本走势，制定以目标久期管理为核心的债券资产配置策略。在债券投资组合构建和管理过程中，本基金将采用期限结构配置、类属信用利差策略、流动性管理等手段进行个券投资。

（四）权证投资策略

本基金将按照法律法规相关规定进行权证投资，将在对权证标的证券进行基本面研究