浦银安盛增利分级债券型证券投资基金招募说明书摘要 便新)

重要提示 基金募集申请核准文件名称:《关于核准浦银安盛增利分级债券型证券投资基金募集的批复》《证监许

核准日期:2011年10月25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

宏闪平盘重频采的线框,并个表明共闪平盘重的引围和权益计印头原证并则的政体证。这个表明权对了平盘 金投有风险。 证券投资基金(以下简称 基金")是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所 带来的个别风险。基金不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资者购买基金、既可 能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所所来的损失。 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。投资有风险,投资人认购 钺

中购基金的设计证券印动。基金中国实际为证券印动成别等因系产生效动。投资有风感、投资人队购 申购基金的运动,直阅读本程察说明书。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,对认购基金的意愿。时机、数量等投资行为作出独立决策。投资者在获得基金 投资收益的同时,亦实担基金投资中出现的各类风险。可能包括:证券市场整体环境引发的系统性风险、 别证券特有的非系统性风险、大量赎回或暴跌导致的流动性风险、基金管理人在投资经营过程中产生的操 作风险以及本基金特有风险等。基金管理人提醒投资者基金投资的,实者自负"原则,在投资者作出投资决

策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资者自行负责。 本基金基金合同主效后进入身团期,封闭期为3年。在封闭期内,如符合上市条件,基金管理人将向深 圳证券交易所申请请银牌 A 份额和浦银增 B 份额的上市交易,封切期届满、基金管理人将按照本合同约定 的折資规则,将浦银增 A 份额和浦银增 B 份额分别折算为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF)基

金份额,并继续上市交易。 本基金在封闭期内,浦银增 A 表现为较为稳定的预期收益水平和较低的风险水平,但在本基金资产出 · 母語並注到可例外、開設自 在死力级少稳定的规则以监州下中保证机的公应水下,已经中基金更 自 現機構及 情况下,清報增 B 价可能面临无法取得为定应得收益为至投资本金变贵的风险。 消報增 B 份 则表现出较高的预期收益水平和较高的风险水平,由于本基金的资产及收益的分配将优先满足清粮增 A 的约定应得收益的分配,在本基金资产出现极端损失而仅能乃至未能满足清粮增 A 的约定应得收益与投资本金的情况下,则浦银增 B 基金份额可能面临投资本金亏损。 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

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,

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: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:姜明生 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

下简称 安盛投资" 持有 39%的股权;上海盛融投资有限公司 以下简称"上海盛融")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

章曦先生,董事,经济学博士,高级经济师。2009年12月起至今担任上海国盛 集团)有限公司财务总

(中裁监管部)董事,执行董事、副主席、首席运营官,中国证监会顾问,中国证监会策略和发展委员会委员、汇富金融控股有限公司中国区主席。Michael WU先生现阶段同时兼任了汇富金融控股有限公司、深圳投资有限公司、贸易通电子贸易有限公司、第一电讯集团有限公司及首华金融控股有限公司的独立董事,上海证 交易所指数咨询委员会主席,中证指数有限公司指数咨询委员会主席。自2008年10月起兼任本公司独 立董事。 尹应能 Richard Yin 光生,独立董事,澳大利亚国籍,英格兰及威尔士特许会计师协会和澳大利亚特许

的资深会员,有十年以上在各类监管机构任职的经历。现任 First Vanguard Group Ltd 集团主 席。自2007年8月起兼任本公司独立董事。

□ 压事会成员 黄跃民先生,监事长,华东师范大学世界现代史专业硕士研究生,现任上海盛融投资有限公司总裁。 James Young 先生,监事,本科学位,新西兰国籍。2006年1月起担任AXA Rosenberg 亚太地区首席运营官,自2012年3月起兼任本公司监事。

营官,目 2012 年 3 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。

(三 公司总经理及其他高级管理人员
钱华先生。北京大学政治经济学专业硕士研究生学历、经济学硕士学位。曾先后在江苏省委党校、中国
人民银行总行和中国华阳金融租赁有限公司从事研究、管理等岗位工作;1994 年 1 月至 1998 年 3 月间,在
国泰证券有限公司担任基金部副总经理;1998 年 3 月至 2003 年 1 月间,任职国泰基金管理有限公司投资总监。2003 年 1 月至 2006 年 10 月期间,在国联发基金管理有限公司担任副总经理之职;2006 年 11 月至 2008
年 5 月间,在安信证券股份有限公司公司任职管理委员会委员、拟任副总裁;2008 年 6 月至 2010 年 9 月期。 间,担任万家基金管理有限公司主管投资管理的副总经理;自2010年12月23日起,担任本公司总经理之

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 月起加盟公司,历任公司产品开发部总监、市场营销部总监和首席市场营销官。自 2012 年 5 月 2 日起,担任本公司副总经理 在公司,他仍及即心血、中國自由的心血和自由中國自由自己自己的2十五月2日度,自己至今日期心之至 兼首席市场营销官。 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

收益研究员。2008年6月至2009年6月,在上海证券有限公司固定收益部担任投资经理助理之职。2009年 7 月进入浦银安盛基金管理公司,任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理助理兼固定收益研究员。2011 年 6 月起,担任浦银安盛优化收益债券型基金基金经理。2011 年 12 月起,兼任本基金基金经理。2012 年 2 月起,兼任浦银安盛货币市场基金基金经理。薛铮先生拥有6年证券从业经验。薛铮先生从未被监管机构予

李宏宇先生,本公司副总经理兼首席市场营销官。

字宏十元生,本公司研究部总监。 廣列先生,本公司研究部总监。 陈士俊先生,本公司金融工程部总监,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 铝联基本面 400 指数基金基金经理并兼任本公司职工监事。 吳男先生,本公司旅下浦银安盛红利股票基金发油银安盛情致生活混合基金基金经理。 蒋建伟先生,本公司旅下浦银安盛化和成长股票基金基金经理。 薛等先生,本公司旅下浦银安盛化和成长股票基金基金经理。 薛等先生,本公司旅下浦银安盛化和成长股票基金基金经理。 648.84886年,建市全级平成上级市场上级工程,2018年,20

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。 二、基金托管人

名称:上海银行股份有限公司 住所:上海市浦东新区银城东路 168 号 办公地址:上海市浦东新区银城东路 168 号

法定代表人:宁黎明 注册日期:1995 年 12 月 29 日 主册资本:42.34 亿元人民币

传真:021-68475888

上海银行总行下设资产杆管部 县从事资产杆管业务的职能部门 内设杆管运作团队 稽核监督团队

上海银行于2009年8月21日获得中国证监会、中国银监会核准开办证券投资基金托管业务,批准文 号:中国证监会证监许可 2009 814号。

基金份额发售机构

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 23212899 传真: 021 23212890 客服电话:400-8828-999; 021 33079999 联系人:徐莹

网址:www.py-axa.com 甫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)

(1)上海银行股份有限公司 住所: 上海市浦东新区银城中路 168 号 在州土海市福东新区银城中路 168 号办公地址:上海市福东新区银城中路 168 号法定代表人: 范一飞容询电话:021-962888

联系人:张萍 网址: www.bankofshanghai.co ②上海浦东发展银行股份有限公司 住所:上海市浦东新区浦东南路 500 号 联系人:唐苑、虞谷云

客户服务热线:95528 各户版夯纸线: 93528 公司网址: www.spdb.com.cn 6 炤商银行股份有限公司 地址: 深圳市福田区深南大道 7088 号 法定代表上: 傅耷宁 客服电话: 95555

网址: www.embehina.com 4)交通银行股份有限公司

网址:bank.ecitic.com 6)申银万国证券股份有限公司

注册地址:上海市常熟路 171 号

网址:www.bankcomm.com 6)中信银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 办公地址:北京市东城区朝阳门北大街 8 号富华大厦 C 座 法定代表人:田国立 联系人:赵树林 客服电话:95558

基金管理人:浦银安盛基金管理有限公司 基金托管人:上海银行股份有限公司

内容截止日:2012年06月13日

家服电话:021-962505 或 4008895523 网址:www.sywg.com 7)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 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 1001B 室 冬服电话:400-8888-001、021-95553 地址:福州市湖东路 99 号标力大厦 法定代表人:兰荣 联系人:谢高得 客服电话:4006515988 公司网站:www.xyzq.com.cn (10)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 **交户服条执线** . 95565 公司网址: www.newone.com.cn ①1 / 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:高冠江 客户服务热线:400-800-8899

地址:上海市静安区新闸路 1508 号 法定代表人:徐浩明 客服电话:400-888-8788

注册地址:北京市西城区金融大街 35 号国际企业大厦 C 座 主加地址:北京市四城区; 去定代表人:顾伟国 客服电话:4008-888-888 公司网站: www.chinastock.com.cn (4) 渤海证券股份有限公司 注册地址:天津经济技术开发区第二大街 42 号写字楼 101 室

ご司网址: www.bhzq.con (15)齐鲁证券有限公司 注册地址:山东省济南市经七路86号

户服务热线:95538 注册地址: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

客户服务热线: 010-66045678 天相投顾网址: www.txsec.com 天相基金网网址: www.txjijin.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

公司网站:www.csc108.com 08)中航证券有限公司 注册地址:江西省南昌市抚河北路 291号江西教育出版社六楼

公司阿曼:www.avissec.com 2.场内代销机构为具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位.具体代销机构见. 俊曹公告》。本基金 募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可新增为本基金的场内代销机构。

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

基金管理从一种货售整金法,整计办法外。 构代理销售本基金,并及时履行信息披露义务。 二、注册登记机构 名称:中国证券登记结算有限责任公司 任所: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:金颖

住所:上海市闸北区裕通路 100 号洲际中心 15,16 层 办公地址:上海市闸北区裕通路 100 号洲际中心 15,16 层

定20/FPIP: 国冬冬, IR/FIBE 四、审计基金财产的会计师事务所和经办注册会计师 名称:安永华明会计师事务所 住所:北京市东城区东长安街1号东方广场东方经贸城安永大楼 陈三办公楼 116层 办公地址:上海市世纪大道100号环球金融中心50楼 计安任事上,直明

经办注册会计师:徐艳、蒋燕华

本基金通过基金资产及收益的不同分配安排,将基金份额分成预期收益与预期风险不同的两个类别, 即A类份额和B类份额

基金份额类别的交易规则 本基金通过场外、场内两种方式公开发售。基金发售结束后,场外、场内认购的全部份额均将按照73例确认为A类份额和B类份额。场外的A类份额和B类份额。适分的A类份额和B类份额登记在注册登记系统;场内的A类份额和

存续,在封闭期内,如符合上市条件,基金管理人将向深圳证券交易所申请 A 类份额和 B 类份额上市交易。 基金投资者可以将其持有的登记在证券登记结算系统中的 A 类份额和 B 类份额在交易所市场交易,也可 L将其持有的登记在注册登记系统的 A 类份额和 B 类份额跨系统转登记到证券登记结算系统后在交易所

中场文为。 本基金在封闭期结束后进入折算期,折算期不超过10个工作日。基金管理人将按照本合同约定的折算规则,将A类份额和B类份额为别折算为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF)基金份额。份额折算后,基金份额持有人不再持有A类份额或者B类份额,而是持有浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 异口, 基金好碗付有人个冉疛有 A 尖份鄉以香 B 尖份湖, 而是行有無致安施稳使增利而夯望证券经效益变化0.F 基金份鄉。 含记在注册登记系统的 A 类份鄉,基 坐份鄉所實已形成的油模安盛稳健增利费型证券投资基金 LOF 基金份額,仍然登记在注册登记系统;登记在证券登记结算系统的 A 类份額, B 类份額折算后形成的油键安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 基金份額,仍然登记在证券登记结算系统。本基金在 A 类份额与 B 类份额折算完成后,将转型为油银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 从金号和债券型证券投资基金 LOF 从金号和的存续期自本基金转型为油银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 上至年期限为不定期。在本基金转型为油银安盛稳度级高健增利债券型证券投资基金 LOF 上至于2011年的,其存获期限为不定期。在本基金转型为油银安盛稳度,是是是是一种企业,是是是是一种企业,是是是是一种企业,是是是一种企业,是是是一种企业,是是一种企业,是是一种企业,是一种,是一种企业,是一种企业,是一种企业,是一种企业,是一种企业,

健增利债券型证券投资基金 (LOF)后,基金管理人将开放浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)基

虚分额的方律电方,及设备型 从"加工总型"自己人们对从国际公型。2. 基金份额类别的权益分量规则 1、持有 条约额的基金份额并有人在份额折算时享有份额折算优先权,即有权在基金资产净值范围内,优先按照 A 类份额的金金份额持有人在份额折算时享有份额折算优先权,即有权在基金资产净值范围内,优先按照 A 类份额金金和约定目标收益率计算的应得收益的合计价值,折算为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 基金份额。上述优先权仅限于基金资产净值范围内,即在份额扩展基准日,如盐金金菱产净值,扩第为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 基金份额 不足部分将不再予以弥补。在板端情况下、A 类份额的应得收益可能无法兑现,A 类价额的本金也存在亏损的风险。
2. 持有 B 类份额的基金份额持有人在份额折算时享有剩余财产分配权,即有权在基金资产净值范围内,按照基金资产净值扣除 A 类份额企金和 A 类份额论定目标收益率计算的应得收益的合计价值的剩余资产价值,扩展为浦银安盛稳健增和债券型证券投资基金 LOF 基金份额,即本基金在扣除 A 类份额本金和 A 类份额约定目标收益率计算的应得收益的合计价值后的全部剩余收益归 B 类份额享有,亏损以 B 类份额的资产净值为限由 B 类份额重担,超出 多类份额产净值的亏损部分则全部由 A 类份额利和

比,在极端情况下,A类份额的应得收益可能无法兑现,A类份额的本金也存在亏损的风险。B类份额存在本

1、约定目标收益率指基金管理人按照本合同的约定设定并公告的每份 A 类份额在封闭期内的年目标

2、本基金封闭期的约定目标收益率为年收益率 2个并基础多利的加少少证目的现在中分子下处理的。 约定目标处益率34年期银行定期存款利率40.25% 3年期银行定期存款利率指基金合同生效日中国人民银行公布并执行的同期金融机构人民币存款基准利率。3年期银行定期存款利率按照四金五人的方法保留到小数点后第2位单位为百分数)。基金合同地与15年次,基本分配与15年次第五代

生效后,本基金的约定目标收益率在封闭期内保持不变。

基金份额净值=计算日基金资产净值/计算日发行在外的基金份额总数

即, 1、在封闭期内基金份额净值计算公式为; 基金份额净值计算日基金资产净值计算日发行在外的 A 类份额和 B 类份额数量的合计 2、在基金份额所算日及之后的基金份额净值计算公式为; 基金份额净值计算日基金资产净值计算日折算后发行在外的浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金

基金份额净值的计算,保留到小数点后3位,小数点后第4位四舍五人,由此产生的误差计人基金财 按照本基金合同约定的 A 类份额及 B 类份额权益分配规则,在封闭期截止日分别计算 A 类份额与 B 类份额的份额净值,并按各自的份额净值进行资产分配。

NAV 为本基金在封闭期截止日基金份额净值 NAVa 为封闭期截止日 A 类份额的份额净值 NAVb 为封闭期截止日 B 类份额的份额净值

Ra 为约定目标收益率 则封闭期截止日 A 类份额与 B 类份额的份额净值计算公式如下: 、当 NAV> (1+ Rax3)×0.70 时,则在封闭期截止日 A 类份额及 B 类份额的份额净值分别为:

1.3 | NAVS u+ 1.43xMa NAVa = 1+3xMa NAVb= (NAV-0.70x)NAVa)0.30; 2.当 NAV≤ (1+ Rax3 №0.70 时,则在封闭期截止日 A 类份额及 B 类份额的份额争值分别为: NAVa=NAV \(\delta 0.70 NAVb=0

NAV 为 T 日基金份额净值 NAVa为T日A类份额的份额参考净值NAVb为T日B类份额的份额参考净值 Tc 为自基金合同生效日至 T 日的实际天数

Th 为自基金合同生效之日始至封闭期截止日所包含的实际总天数则 $_{
m T}$ 日 A 类份额及 B 类份额的份额参考净值的计算公式如下: 1,当 NAV> $_{
m Q}$ + Rax3xToTn $_{
m N}$ 0.70 时,则 $_{
m T}$ 日 A 类份额及 B 类份额的份额参考净值分别为: NAVa=1+3×Ra×Tc/Tt

NAVb= (NAV-0.70×NAVa)0.30;

2.9 NAV ≤ 0+ Rax3xTe/ft > 0.070 时,则 T 日 A 类份额及 B 类份额的份额参考净值分别为: NAVa=NAV0.70 NAVb=0 A 类份额及 B 类份额的份额参考净值的计算保留到小数点后 3 位,小数点后第 4 位四舍五人。

五、基金的名称 浦银安盛增利分级债券型证券投资基金

六、基金的类型 七、基金份额的上市交易与份额折算

本基金封闭期的起始日为《基金合同》生效日。

本基金封闭期的截止日为《甚金合同》生效日后第3年的对应日,如该日为非工作日,则顺延至下一个

二、基金份额的上市交易基金份合法律法规和深圳证券交易所规定的上市条件的情况下,本基金在封闭期内,基金份额所分成的A类份额与B类份额两类基金份额同时申请上市交易。 在本基金材润期后满,A类份额与B类份额内类基金份额同时申请上市交易。 开放式基金 (LOF)基金份额,转换后的基金份额继续在深圳证券交易所上市交易

本基金份额 封闭期内 A 类份额与 B 类份额)上市后,登记在证券登记结算系统中的基金份额可直接 在深圳证券交易所上市交易;登记在注册登记系统中的基金份额通过办理跨系统转托管业务将基金份额转至证券登记结算系统后,方可上市交易。

3、上市交易的规则 ① A 类价额。B 类价额分别采用不同的交易代码上市交易; ② A 类价额。B 类价额上市首日的开盘参考价分别为各目前一工作日的基金份额参考净值; ② A 类价额。B 类价额实行价格涨跌幅限制,涨跌幅比例为 10%。自上市首日起实行; ④ A 类价额。B 类价额买入申报数量为 100 分或其整数倍; ⑤ A 类价额。B 类价额所入申报数量为 100 分或其整数倍; ⑥ A 类价额。B 类价额上有效量值等的量量值等的量量值等的是一个。 ② A 类价额。B 类价额上市交易遵循深别证券交易所相关业务规则及规定。 4 上市交易的费用

4、上市交易的费用 上市交易的费用按照深圳证券交易所有关规定办理。

3.1.10之列的1月18647。 A 类的额及 B 类的额在深圳证券交易所挂牌交易,交易行情通过行情发布系统揭示。行情发布系统同 时揭示基金前一交易日的基金份额参考净值。 6.上市交易的停复牌。管停上市、恢复上市和终止上市 0.距离本基金封闭期截止日不足 1 个月时,基金管理人可以向深圳证券交易所申请暂停 A 类份额和

2)A 类份额和 B 类份额的停复牌、暂停上市、恢复上市和终止上市按照深圳证券交易所的相关规定执

7.相关法律法规,中国证监会及深圳证券交易所对基金上市交易的规则等相关规定内容进行调整的,本基金合同相应予以修改,并按照新规定执行,且此项修改无须召开基金份额持有人大会。 三.基金份额持算 1.份额持算的目的 分额折算的目的是将 A 类份额 、B 类份额按照本合同相关约定折算为浦银安盛稳健增利债券型证券投

资基金 LOF 基金份额。 2.份额扩算期及份额扩算基准日 份额扩算期股份额扩算起始日至份额扩算截止日之间的一段时期,最长不超过10个工作日。 份额扩算基准日为封闭期截止日,份额折算期的起始日为份额折算基准日下一自然日。

3、份额折算权益登记日 份额折算权益登记日为份额折算基准日。

预折算的对象为基金份额折算权益登记日登记在册的 A 类份额和 B 类份额。

(1)A 类份额折算公式

Wa 为折算前 A 类份额的数量 NAVa 为份额折算基准日 A 类份额的份额净值

后浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (LOF)基金份额净值调整为 1.000 元。

上述计算结果。场内份额采用截位法保留到整数位。场外份额采用截位法保留到小数点后 2 位、小数点以后的部分舍去。含去部分计人基金财产。例如某基金投资者折算前持有 10000 份 A 类份额,封闭期截止日 A 类份额的份额争值为 1.13500000 元,则折算后该基金投资者持有 11350 份浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 LOF 基金份额,不再持有

2)B 类份额折算公式

W2 为折算后基金份额的数量

W2=WbxAAVb1.000 上述计算结果、场内的额采用截位法保留到整数位、场外份额采用截位法保留到小数点后两位、小数点 以后的部分舍去、含去部分计入基金财产。 例如某基金投资者折算前特有 10000 份 A 类份额 场内),10000 份 B 份额 场内),份额折算基准日 A 类份额的净值为 1,13500000 元, B 份额的份额净值为 1,79500000 元,则折算后该基金投资者持有 29300 份 0,1350+17950=29300)浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金 (.0F)基金份额 场内),不再持有 A 类份额

6、份额折算的变更登记 本基金的注册登记机构将根据份额折算结果于变更登记日完成基金份额的变更登记。 7. 份额折管结果的公告 注册登记机构变更登记结束后,基金管理人应在指定媒体对份额折算结果予以公告。

八、基金的投资目标 本基金在严格控制投资风险的基础上,力争 ... 計比较基准的投资收益。 九、基金的投资范围

本基金的投资对象是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。含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律、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)。
本基金主要投资于国内依法发行、上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、短期融资系可分离债券、资产支持证券、债券回购和银行存款等固定收益类证券品种。本基金也可投资于非固定收益类证券品中。本基金也可投资于非固定收益类证券品中。本基金也可投资于非固定收益类证券品中。本基金尤直接从二级市场买人股票、权证等权益类资产。但可以参与一级市场新股或增发

收益类证券品种。本基金不直接从二级市场买入股票,权证等权益类资产。但可以参与一级市场游散使增发新股的申购,并可持有因可转债转股所形成的股票。因即持股票的派发的权证以及因投资可免债债券布产生的权证等以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他非固定收益类证券品种。因上述原因持有的股票和权证等资产。本基金将在其可交易之日起的90个交易日内卖出。如法律法规或监管和权以后允许基金投资并但品中,基金管理。在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围,并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金在封闭期间,投资于固定收益类资产的比例不低于基金资产的80%。投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的20%。在开放期间,投资于固定收益类资产的比例不乐于基金资产的80%,投资于非固定收益类资产的比例不高于基金资产的的0%。在开放期间,投资于固定收益类资产的比例不乐于基金资产的的份外不高于基金资产的比例不高于基金资产的比例不高于基金资产的比例不高于基金资产的价值。56%。

定收益。 产净值的5%。 本基金在转型为浦银安盛稳健增利债券型证券投资基金(LOF)后,其投资目标,投资范围、投资策略、 投资限制、业绩比较基准等将保持不变。

十,基金的投资策略 本基金一方面按照自上而下的方法对基金的资产配置 人期管理、类属配置进行动态管理,寻找各类资产的潜在良好投资机会,一方面在个券选择上采用自下而上的方法,通过流动性考察和信用分析策略进行筛选。整体投资通过对风险的严格控制,运用多种积极的资产管理增值策略,实现投资目标。

势、市场资金供求情况、经济周期等要素的定性与定量的考察,预测各大类资产未来收益率变化情况,在不同的大类资产之间进行动态调整和优化,以规避市场风险,提高基金收益率。

C. 周定収益亲证券投资票略 1、外期与期限结构管理策略 利率风险是债券投资最主要的风险来源和收益来源之一,衡量债券利率风险的核心指标是久期。本基 金通过对宏观经济状况和货币政策的分析,对债券市场走势作出判断,并形成对未来市场利率变动方向的 预期,动态调整债券结合的久期。在久期确定的基础。上根据对收益率由线形状变化情景的分分别采用 子弹型策略、哑铃型策略或梯形策略,在长期、中期和短期债券间进行合理配置,以从长、中、短期债券的相

公共间距且東明 在保证流光时的基础上,本基金将通过国债,央行票据、金融债、企业债、公司债、可转换债券、短期融资可分离债券、资产支持证券、回购和银行存款等资产的合理组合实现稳定的投资收益。 类属配置主要策略包括研究国债与金融债之间的利差、交易所与银行间的市场利差、企业债与国债的 信用利差等,寻找价值相对低估的投资品种。 3、个券选择策略

5、17 5/26年749时 ① 施式姓達路 在封闭期间,本基金对个券的流动性要求不高,在封闭期届满,本基金转换为上市开放式基金 **4.0**F) 后,将通过对各类流动性指标的设置与监控,管理由于基金的申购、赎回或个券的交易难易程度而引致的潜

分析企业经营效益对未来偿债能力的支持能力

4、1回网来响 该策略在本基金封闭期内是风险较低的投资策略。即在基础组合的基础上,使用基础组合持有的债券 进行回购融入短期资金滚动操作,同时选择适宜期限的交易所和银行间品种进行投资以获取骑乘及短期债 5、可转债投资策略

不可令的人及\$P\$——一种的于股票和债券之间的固定收益类投资品种,其理论价值等于作为普通债券的 纯债券价值加上可转债内含选择权的价值。 2010组经理等等 司基本面进行深入分析研究的基础上,利用可转债的纯债券价值和到期收益率来判断可转债的债性,以增强本金投资的安全性,利用可转债转换价值相对于纯债价值的溢价率来判断可转债的股性,在市场出现投资机会时,优先选择股性强的品种,获取超额收益。

20一级市场中域市场 20一级市场申购商品 目前,可转债均采取定价发行,对于那些发行条款优惠、期权价值较高、公司基本面优良的可转债,因供 求不平衡、全产生较大的—、二级市场价差。因此,为增加组合收益、本基金将在充分研究的基础上,参与可 转换债券的一级市场申购,在严格控制风险的前提下获得稳定收益。 6、资产支持证券投资策略

υ、攻厂工人均Ⅲ环纹效理响 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。 仨 新股申购策略 在股票发行市场上,股票供求关系不平衡经常导致股票发行价格与二级市场价格之间存在一定的价

差,从而使得新股申购成为一种风险较低的投资方式。本基金将研究首次发行 (PO)股票及增发新股的上市公司基本面,根据股票市场整体定价水平,估计新股上市交易的合理价格,同时参考一级市场资金供求关 ,谨慎参与新股申购。本基金对于通过参与新股认购所获得的股票,在可上市交易后90个交易日内全部 本基金将因为所持股票以及投资可分离债券等原因而被动获得权证。本基金进行权证投资时,将在对

权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上,结合股价波动率等参数,运用数量化期权定价模型,确定其合理内在价值,从而构建套利交易或避险交易组合以及持有价值出现较为显著的低估的权证品种。 本基金业绩比较基准;中信标普全债指数 中信标等全债指数的编制方为中信标普全债指数。 现务提供商 S&P 共同编制和充单合作等指数信息服务有限公司,由中信证券以及全球富有盛名的指数服务提供商 S&P 共同编制和维护,体现了指数编制的先进性; 中信标音全债指数是一个全面反映整个债券市场、佼易所债券市场、银行间债券市场)的综合性权威债券指数。涵盖了在上海证券交易所、深圳证券交易所和银行间市场上市的债券。对于交易所交易债券、剩余期限在1年以上、票面余额超过1亿人民币、信用评级在投资级以上的债券均包含在该指数当中。对于银行

间债券、根据债券类型和期限运用分层取样的方法进行了选择、更能够敏锐、直接、全面地反映市场对利率的预期及市场的走势。该指数具有广泛的市场代表性、能够全面反映债券市场总体走势;该指数基期为2002年11月29日、于每个交易日收市予以公布、每半年调整一次;该指数编制方法、指数数据等相关指数信息透明度高、适合作为本基金的业绩比较基准。如果上述基准指数停止计算编制或更改名称、或者今后法律法规发生变化、或者有更权威的、更能为市场潜途接受的业绩比较基准推出或者是市场上出现更加运合用于本基金的业绩基准的股票指数时,本基本可以有使用国现的公务是产资更必须使从数据推订发现。

金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公会 10人性的代码组成成立首条口及关业,并一人网验收益特征。 本基金为债券型证券投资基金,属于证券投资基金中的较低风险品种。一般情形下,其风险收益预期低

于股票型基金,混合型基金。高于货币型基金。 从本基金所分成的两类基金的输来看,由于本基金资产及收益的分配安排。A类份额为预期风险低、预 期收益相对稳定的基金份额;B类份额为预期风险较高

等所以無相对构起的送金近7碗(B 吳77碗)/刘琬明(A)安花南(为迎界)(本政帝南)必金近7碗。 十三、基金投资组合报告 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、误导性除述或重大遗漏,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。 本基金的托管人——上海银行股份有限公司报报本基金合同规定、复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性除述或者重大遗漏。 本投资组合报告所载数据截至 2012 年 03 月 31 日 休经审计)。

1 报告	5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	=	=
	其中:股票	=	=
2	固定收益投资	1,383,807,122.99	93.62
	其中:债券	1,383,807,122.99	93.62
	资产支持证券	=	-
3	金融衍生品投资	=	-
4	买人返售金融资产	=	-
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	=	=
5	银行存款和结算备付金合计	80,662,593.26	5.46
6	其他各项资产	13,708,386.37	0.93
7	公 社	1 479 179 103 63	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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本基金本报告期末未持有股票。 序号 债券品种 公允价值 (元) 13,824,200.00 1.48 金融债券 中:政策性金融债 126.73 心心短期融资 40,490,000.00 4.32 6 142,276,000.00 15.19 可转债 505,400.00 0.05

9	合计		1,383	,807,122.99	147.77			
5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名债券投资明细								
序号	债券代码	债券名称	数量 (张)	公允价值 玩)	占基金资产净值 比例 %)			
1	122112	11沪大众	500,000	50,300,000.0	0 5.37			
2	122880	10天业债	499,990	50,298,994.0	0 5.37			
3	122115	11华锐 01	500,000	50,100,000.0	0 5.35			
4	1280081	12贵阳经开债	500,000	50,000,000.0	0 5.34			
5	122921	10郴州债	435,710	43,810,640.5	60 4.68			

6报告期末按公允价值占基金资产单值比例大小排名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。 7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细本基金本报告期末未持有权证。

8.1 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

8.1 报台州内华盛金坟员的前十名记 到公开谴责、处罚的情况。 8.2 本基金本报告期末未持有股票。 8.3 其他各项资产构成 250,000.00 2 应收证券清算款 3 应收股利 13,385,053.1 应收申购需 待摊费用 13,708,386.37

8.4 报告期末持有 基金资产净值出 债券代码 债券名称 公允价值 (元)

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, 「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 1)-3) 3.19% 0.08% 0.88% 2012/01/01-2012/03/31 0.04% 2.31% 0.04%

2011/12/13-2012/03/31 3.40% 0.08% 1.14% 0.03% 2.26% 0.05% 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 Simple of half-man reading

十五、费用概览

6、概金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费;7、基金份额持有人大会费用;

9. 盛速的號引起列訊: 10. 接烟国家 存美规矩和 藍金合同》的定:可以在基金财产中列支的其他费用。 本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金财产总值中扣除。 二、上述基金费用由基金管理人在法律法规规定的范围内按照公允的市场价格确定,法律法规另有规 定时从其规定。
三、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 1.基金官里共和官理按 在通常情况下,本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.7%年费率计提。管理费的计算方法如下: H=Ex0.7%;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,遂日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划 數指令,基金托管人复核后于次月前 2 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 八片 日常 支付口即赔偿

2.基金托管人的托管费 在通常情况下,本基金的托管费按前一日基金资产争值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下: H=kx0.7%;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 数指令,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 数指令,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

3. 基金销售服务费

3. 金金田自成分以 基金销售服务费用于支付销售机构佣金、基金的营销费用以及基金份额持有人服务费等。 在通常情况下,本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.35%年费率计提。基金销售服务 费的计算方法如下; H=Ex0.35%+当年天数 H 为每日应计提的基金销售服务费 2 为前一日的基金资产净值 5.75前,自15年至5.76年12日 基金销售服务费每日计算,涿日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送基金销售

·墨亚特自协办设计口,并完全专门。 服务费切除指令、基金社省人复核后于次月前2个工作目内从基金财产中划出、由基金管组人按相关各同规定支付给基金销售机构。若遇法定节假日、公休日等、支付日期顺延。 上述一基金费用的标案中第4-9页费用、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、由基金代各人从基金财产中支付。 下列费用不列入基金费用

下刘政州个刘人基金贺用: 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,建设前的相关费用,包括但不限于验资费,会计师和律师费,信息披露费用等费用; 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。 五.费用调整

甚金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销 调高基金管理费率或基金托管费率或基金销售服务费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调 低基金管理费率或基金杆管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大 基金管理人必须最迟于新的费率实施日前依照 信息披露办法 的有关规定至少在一种指定媒体和基金管理人网站上公告。

六、基金税收 本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义多

十六、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》、征券投资基金运作管理办法》、征券投资基金销售管理办法》、征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:

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 更新了 重要提示"部分的内容截止日;
2 更新了 第二部分 基金管理人概况"和 生要人员情况";
3 更新了 第四部分 基金管理人 电基金管理人概况"和 生要人员情况"、基金托管业务经营情况"、基金托管人的内部控制制度";
4 更新了 第五部分 相关服务机构"中更新了代销机构的基本情况;
5 更新了 第七部分 基金的等等,中更新了基金募集情况
6 更新了 第九部分 基金的等的上市交易与份额折算中的上市交易时间
8 更新了 第九部分 基金份额的上市交易与份额折算中的上市交易时间
8 更新了 第九部分 基金份额的上ຫ交易与份额折算中的上市交易时间
8 更新了 第十部分 基金份额的丰购与赎回"中关于基金的转换及定期定额投资计划部分的内容
9 更新了 第十一部分 基金的投资中就 基金的投资组合报告"和 基金的业绩"。
10 更新了 第二十二部分 对基金份额持有人的服务"中关于 红利再投资"的内容
11 更新了 第二十二部分 对基金份额持有人的服务"中关于 红利再投资"的内容

11 更新了 第二十三部分 其他应披露事项"中的相关内容 浦银安盛基金管理有限公司