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）

2013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：2013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。

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。

本招募说明书所载内容截止日为2013年12月10日，有关财务数据和净值表现截止日为2013年6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：2.4亿元
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

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。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。现任安盛投资管理公司亚洲股东代表。自2009年3月起兼任本公司副董事长。

林道峰先生，董事，工商管理硕士，高级会计师。1985年8月参加工作，1994年3月调入上海浦东发展银行，任杭州分行计划信贷部负责人，2000年3月起任上海浦东发展银行杭州分行行长助理、副行长。2008年3月至今担任上海浦东发展银行个人银行总部副总经理。自2012年3月起兼任本公司董事。

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。

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）有限公司财务总监，2006年3月起至今担任上海建筑材料（集团）总公司副总裁。此前，章曦先生曾历任上海张江集成电路产业区开发有限公司总经理，上海张江高科技园区开发股份有限公司审计法务室主任、董事会秘书、副总经理、财务总监。自2010年1月起兼任本公司董事。

廖正旭先生，董事，斯坦福大学理学硕士和纽约科技大学理学硕士。现任安盛罗森堡投资管理有限公司亚太地区高级研究主任。自2012年3月起兼任本公司董事。

郁蓓华女士，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。

王家祥女士，独立董事。1980年至1985年担任上海侨办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年担任正信值业有限公司（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。

谢百三先生，独立董事。北京大学经济系硕士研究生毕业，1988年起担任清华大学经济管理学院副教授，1990年起担任复旦大学管理学院教授、博士生导师，现同时担任复旦大学金融与资本市场研究中心主任。自2012年7月起兼任本公司独立董事。

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。

2、监事会成员

黄跃民先生，监事长，华东师范大学国际关系专业硕士研究生，现任上海盛融投资有限公司总裁。自2007年8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），历任固定收益产品专家、固定收益产品经理、基金会计师和组合控制。2008年6月至今担任安盛投资管理公司（英国伦敦）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12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

郁蓓华女士，本公司总经理，董事，并任投资决策委员会主席。

李宏宇先生，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股票型证券投资基金、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，公司旗下浦银安盛增利分级债券型证券投资基金、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6个月定期开放债券型证券投资基金及浦银安盛季季添利定期开放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股票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

杨新丰，投资托管业务部总经理，曾就职于中国建设银行江苏省分行、广东省分行、中国建设银行总行会计部、营运管理部，长期从事计划财务、会计结算、营运管理等工作，具有丰富的客户服务和业务管理经验。

纪伟，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行南通分行、中国建设银行总行计划财务部、信贷经营部、公司业务部，长期从事大客户的客户管理及服务工作，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。

郑绍平，投资托管业务部副总经理，曾就职于中国建设银行总行投资部、委托代理部，长期从事客户服务、信贷业务管理等工作，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2013年6月30日，中国建设银行已托管311只证券投资基金。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。中国建设银行在2005年及自2009年起连续四年被国际权威杂志《全球托管人》评为“中国最佳托管银行”，在2007年及2008年连续被《财资》杂志评为“国内最佳托管银行”奖，并获和讯网2011年度和2012年度中国“最佳资产托管银行”奖，和境内权威经济媒体《每日经济观察》2012年度“最佳基金托管银行”奖。

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
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：傅育宁
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）申银万国证券股份有限公司
注册地址：上海市常熟路171 号
办公地址：上海市常熟路171 号
法定代表人：储晓明
客服电话：962533 或 4008895523
网址：www.sywg.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：袁长清
客服电话：4008888788、10108998
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、4008888111
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：021-95553 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：林治海
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：高冠江
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99号标力大厦
法定代表人：兰荣
客户服务电话：4008888123
网址：www.xyzq.com.cn

（15）宏源证券股份有限公司
注册地址：新疆维吾尔自治区乌鲁木齐市建设路2号
办公地址：北京市西城区太平桥大街19号
法定代表人：冯戎
客服电话：4008-000-562
网址：www.hysec.com

（16）上海证券有限责任公司
地址：上海市黄浦区西藏中路336号
法定代表人：郁忠民
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：4008-888-8888
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：010-66045566
网址：www.txsec.com

（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：北京市西城区金融街5号新盛大厦A座6-9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深南大道7088号招商银行大厦第A层
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：400-666-5589
网址：www.cs.ecitic.com

（24）华泰联合证券有限责任公司
注册地址：深圳市福田区中心区中心广场香港中旅大厦第五层
法定代表人：马昭明
客户服务热线：95513
网址：www.lhzq.com

（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
办公地址：深圳市福田区深南大道2008号中国凤凰大厦1栋9层
法定代表人：牛冠兴
联系人：陈剑虹
客服电话：4008001001
网址：www.essence.com.cn

（26）齐鲁证券股份有限公司
注册地址：山东省济南市经十路128号
法定代表人：李玮
客服电话：95538
网址：www.qlzq.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
法定代表人：岳献春
客服电话：4006198888
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：范一飞
咨询电话：021-962888
网址：www.bankofshanghai.com

（30）中信万通证券有限责任公司
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
客户电话：0532-96577
公司网址：www.zxwt.com.cn

（31）中信证券（浙江）有限责任公司
办公地址：浙江省杭州市滨江区江南大道588号恒鑫大厦主楼19、20层
法定代表人：沈强
客服电话：0571-96598
公司网址：www.bigsun.com.cn

(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：96528或962528
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：4000-766-123
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：4000-891-289
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)北京展恒基金销售有限公司
办公地址：北京市朝阳区华严北里2号民建大厦6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

3、场内代销机构

名单详见基金份额发售公告。

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
住所：北京西城区金融大街27号投资广场23层
办公地址：北京西城区金融大街27号投资广场23层
法定代表人：金颖
联系人：朱立元
电话：（010）58598839
传真：（010）58598907

（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有限公司
住所：上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
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：单峰
经办注册会计师：汪棣、单峰

（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，更新调整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。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在合同许可投资比例范围内的投资于价值出现较为显著的低估的权证品种。

九、业绩比较基准

本基金业绩比较基准：沪深300指数收益率×95%＋1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）。

沪深300指数是由上海证券交易所和深圳证券交易所授权，由中证指数有限公司开发的中国A股市场指数，它的样本选自沪深两个证券市场，覆盖了大部分流通市值，其成份股票为中国A股市场中代表性强、流动性高的股票，能够反映A股市场总体发展趋势。

1%（指年收益率，评价时按期间累计天数折算）是基于沪深300指数成份股的年红利收益率以及主动量化策略增强效应而作为业绩比较基准的一部分。

本基金认为，该业绩比较基准目前能够忠实地反映本基金的风险收益特征。如果今后法律法规发生变化，或者沪深300指数停止编制或发布，或者由于证券市场重大变化或沪深300指数编制方法重大变更导致其不适合继续作为本基金的目标指数，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准的股票指数时，本基金可以变更业绩比较基准，但应与基金托管人协商一致，在履行适当程序后报中国证监会核准或备案，并在指定媒体上及时公告。

十、风险收益特征

本基金是一只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品种，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。

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截至2013年9月30日。

（一）报告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	152,297,407.46	93.71
	其中：股票	152,297,407.46	93.71
2	固定收益投资	－	－
	其中：债券	－	－
	资产支持证券	－	－
3	金融衍生品投资	－	－
4	买入返售金融资产	－	－
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	－	－
5	银行存款和结算备付金合计	10,194,696.38	6.27
6	其他各项资产	30,264.29	0.02
7	合计	162,522,368.13	100.00

（二）报告期末按行业分类的股票投资组合

1 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

2 指数投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	408,195.40	0.25
B	采矿业	9,834,712.22	6.07
C	制造业	64,007,888.30	39.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,593,724.47	4.07
E	建筑业	8,157,155.77	5.04
F	批发和零售业	5,681,015.97	3.51
G	交通运输、仓储和邮政业	1,322,378.00	0.82
H	住宿和餐饮业	－	－
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,503,161.78	2.16
J	金融业	40,912,770.03	25.26
K	房地产业	8,351,811.72	5.16
L	租赁和商务服务业	843,305.40	0.52
M	科学研究和技术服务业	－	－
N	水利、环境和公共设施管理业	630,460.00	0.39
O	居民服务、修理和其他服务业	－	－
P	教育	－	－
Q	卫生和社会工作	－	－
R	文化、体育和娱乐业	1,192,947.60	0.74
S	综合	857,880.80	0.53
	合计	152,297,407.46	94.05

（三）期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

1期末指数投资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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600016	民生银行	747,923	7,150,143.88	4.42
2	600036	招商银行	493,862	5,392,973.04	3.33
3	601166	兴业银行	429,102	4,793,069.34	2.96
4	601318	中国平安	94,887	3,387,465.90	2.09
5	600837	海通证券	247,147	3,091,808.97	1.91
6	000002	万 科A	311,811	2,846,834.43	1.76
7	000651	格力电器	93,799	2,491,301.44	1.54
8	600030	中信证券	179,279	2,203,338.91	1.36
9	600519	贵州茅台	13,560	1,843,346.40	1.14
10	600887	伊利股份	36,673	1,638,549.64	1.01

2期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

（四） 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

（五）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

本基金本报告期末未持有债券。

（六）报告期末按公允价值占基金资产净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。

（七）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。

（八）报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

（九）报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

1 本基金投资国债期货的投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

3 本基金投资国债期货的投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

（十）投资组合报告附注

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受到公开谴责、处罚的情况。

2 本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库的范围。

3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	10,989.21
2	应收证券清算款	－
3	应收股利	14,208.70
4	应收利息	1,904.33
5	应收申购款	3,162.05
6	其他应收款	－
7	待摊费用	－
8	其他	－
9	合计	30,264.29

4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.1期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

十二、基金业绩

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，也不保证最低收益。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。

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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
2010/12/10-2010/12/31	-0.40%	0.38%	0.22%	1.42%	-0.62%	-1.04%
2011/01/01-2011/12/31	-24.80%	1.19%	-23.09%	1.23%	-1.71%	-0.04%
2012/01/01-2012/06/30	6.28%	1.