



上海證券有限公司
SHANGHAI SECURITIES CO.,LTD.

上海證券基金評價業務信息披露（2011）

報告單位： 上海證券有限公司

報告日期： 2012年4月13日

声明

本公司承诺按照信息披露材料的内容开展基金评价业务，不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对内容的真实性、准确性、完整性负责。

上海证券基金评价业务信息披露(2011)

一、基本情况

公司名称	上海证券有限责任公司	公司网址	http://www.shzq.com
注册地址	上海市西藏中路 336 号	邮编	200001
办公地址	上海市西藏中路 336 号		200001
成立时间	2001.4	注册资本	26.1 亿元
总资产	102.88 亿元	净资产	41.52 亿元
法定代表人	郁忠民	总经理	郁忠民
基金评价业务开始时间	2009.7	基金评价业务部门名称	上海证券基金评价研究中心
基金评价业务范围	基金评级、单一指标排名	基金评价人数	13人
基金评价结果发布渠道	公司网站、证券时报	基金评价结果发布网址	www.shzq.com
联系电话	021-53519888-1978	传真	021-33303055

注：“基金评价业务范围”包括基金评级、单一指标排名、基金管理公司评级、评奖。

二、基金评价人员及其变化情况

基金评价从业人员情况表			
评价业务负责人			
姓名	职业资格证书编号	基本情况	变化情况
王毅	S0870511030005	博士研究生, 12 年海外金融行业工作经验	
基金评价人员			
姓名	职业资格证书编号	基本情况	变化情况
李艳	S0870511010001	硕士研究生, FRM, 11 年证券从业经验	

代宏坤	S0870511060001	博士研究生	转为分析师资格编号。
刘亦千	S0870511040001	学士，4年从业经验	
高琛	S0870512010001	学士	转为分析师资格编号。
李颖	S0870110110004	硕士研究生	
张桐	S0870111010020	硕士研究生	
庄宇飞	S0870111050010	硕士研究生	
马真真	S0870111100011	学士	
许行志	S0870111100009	硕士研究生	
杨志远	S0870111090002	硕士研究生	
高云鹏	S0870112010002	硕士研究生	
沈露轶	---	硕士研究生	
备注：沈露轶已通过从业考试，正在获取证书编号中。			

三、基金评价标准、方法、程序以及调整情况

上海证券基金评价研究中心对基金产品的评价标准、方法、程序等没有做调整。

四、基金评价业务开展情况

上海证券基金评价研究中心严格按照《中国证券业协会证券投资基金评价业务自律管理规则》展开评价业务，在中国证监会、中国证券业协会的领导下，秉承“专业、客观、诚信”的理念展开基金评价业务，取得了良好的工作成效。

1. 深化产品研究和创新，拓展研究的对象和范围，满足市场多层次的需求。

2011年度在基金评价系统的完善、研究产品的丰富和研究范围的拓展方面，展开了探索和创新工作。首先，继续完善已上报证券业协会的基金公司评价方法和体系，并在过去的一年中不断实践跟踪，积累了一定运作经验；同时，综合量化和配置等研究角度，形成了基金池和基金组合的构建程序，予以持续跟踪和维护，为基金投资者提供了较丰富的资产配置思路；在研究范围方面，上海证券跟进市场的前沿，将对基金的研究范围扩展到日益壮大的私募基金，对私募基金评价方法和体系进行了探索和研究。具体在研究成果方面，截止2011年12月底，上海证券完成基金评价研究报告686篇（在主流报刊媒体公开发表研究报告172篇；并根据季度更新的上海证券基金评价结果，推出了《上海证券五星基金季刊》，解读五

星基金的季报数据与投资价值，定期提供给监管层、相关机构高层、媒体、营业部等做参考。

2. 与媒体的合作范围更广、形式更多元化，进一步提升基金评价及研究成果的影响力。

2011 年度，上海证券在原有的媒体合作和指定信息披露工作内容上，新拓展了地方媒体、新媒体等，并采用了更多元化的合作形式。2011 年度巩固了之前合作的媒体关系，包括中证报、上证报和证券时报三大报、13 家网络媒体和 2 本杂志以及 2 家数据商等，日常的媒体采访、节目参与、专题约稿等合作得到进一步的加强。同时，新增与财汇信息、数米网的合作协议，加强对上海（解放日报、理财周刊等）、温州（温州晚报）等地方媒体的合作关系，提升品牌在网络和区域的影响力。在形式上，本中心实现了多元化的媒体合作，具体涵括了媒体采访、电视节目参与、论坛与评奖的专业支持、专题约稿、网络专栏，以及上证报和新浪网等网络在线互动等，较为有效的将基金评价与研究成果通过多种渠道传递给市场，提升了影响力。具体截止 2011 年 12 月底，基金评价中心共计接受媒体采访以及参与电视节目超过 110 余次，每周分析师参与各大主流媒体主办的网络在线互动约 3 次。

3. 拓展和加强了与基金公司、保险公司等机构的沟通合作，共同推进证券市场的创新。

2011 年度，上海证券通过一对一发送研究成果、深度调研、参加会议、产品研发合作等多种形式，将基金研究的合作领域拓展至保险公司，并与基金公司、保险公司等在产品研发、创新方面展开了深入的交流，共同促进证券市场的创新。上海证券成立了产品研究小组，为基金公司、保险公司等相关机构提供产品研发、创新方面的成果参考，具体有：一是国外基金产品的发展沿革（如生命周期基金等）的系统研究，为国内基金产品的研发和销售提供参考思路；二是对国内创新产品的产品结构和收益分配特征等方面，进行了深入研究和持续的跟踪，尤其在分级基金的研究上取得了一定成果，为国内基金公司的产品创新、发掘市场需求等方面提供建议；三是对国内外基金行业生态上展开了系列的探索，包括基金的绩效评估、基金公司的发展模式、能力评估、基金经理的行为研究、销售渠道的创新等课题。

4. 向营业部、代销银行等渠道销售人员传播基金评价与研究成果，积极传导正确的基金投资理念，促进基金的销售。

上海证券通过发送研究报告、培训、会议交流等方式，帮助营业部和代销银行等渠道销售人员传导正确的基金投资理念，促进基金销售。上海证券拥有近 60 家营业部，年基金销售近 10 亿元，具有较好的客户资源。上海证券借助于营业部员工培训、营业部客户会议交流、上证五星基金季刊等方式，为营业部提供基金投资、销售的专业支持。在与代销银行渠

道的交流方面，上海证券与约 21 家具具备代销资格的银行建立了联系，定期发送相关基金评价和研究成果，并多次进行了路演等深入交流，帮助渠道销售人员形成合理、长期的基金投资规划。

5. 参与和举办各种研讨会等活动，强化与监管层、行业机构和投资者之间的交流。

上海证券积极出席中国证监会和证券业协会组织的各项活动，包括针对基金公平交易等方面的座谈会、基金公司举办的产品设计专题研讨会以及举办创新型基金研讨会等，强化了与监管层、行业机构之间的交流。2011 年 9 月，基金评价研究中心主办针对基金产品部总监、保险投资基金的创新基金专题研讨会，分享了对 ETF、分级基金等创新型基金的研究成果，取得了较好的反响。基金评价中心每季度发布《上海证券五星基金季刊》，定期提供给监管层、媒体、基金公司、银行、营业部投资者等，并搜集相应的反馈，加强了与业界的交流。

五、履行信息披露义务情况

上海证券有限责任公司认真履行信息披露义务，定期发布基金评价结果，目前主要信息披露方式和渠道为：在中国证券行业网站公示，公司网站（www.shzq.com）和证监会指定媒体进行发布。《证券时报》为公司指定法定纸质信息披露媒体，同时上海证券还在和讯、新浪等多家网络媒体上发布评级结果和研究成果。目前，主要公开披露过信息为上海证券基金评价业务信息。基金综合评级结果 3 个月以上更新发布一次，单一指标排名 1 个月以上更新发布一次。

六、为避免与评级或评奖对象产生利益冲突采取的措施

1、制度保证

上海证券作为创新类券商，一直将加强内部控制作为公司重要经营管理目标，把公司内部控制机制和内部控制制度的建设放在首位。在基金评价业务方面，除了有公司层面《上海证券有限责任公司信息隔离墙制度》、《上海证券有限责任公司合规管理制度》等制度约束外，基金评价研究中心也专门制定了《上海证券基金评价业务管理办法》等，从制度上保证基金评价业务的合规开展。

2、人员、业务独立

上海证券成立独立的基金评价研究部门，与基金销售等业务部门独立运作，建立了高效基金评价业务系统，与原有经纪业务核心系统完全独立，保证基金评价业务操作的独立开展。

3、方法客观

上海证券基金评价方法基于评价规则和基础数据，不掺杂任何主观的参数设置，最大程度减少主观因素的影响。

七、奖惩情况

无。

八、其他需要说明的情况

无。