



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（2013）

報告單位： 上海證券有限公司

報告日期： 2014年4月10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（2013）

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	139.92 亿元	净资产	43.63 亿元
法定代表人	龚德雄	总经理	龚德雄
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	11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
李艳	S0870511010001	硕士研究生, FRM, 13 年证券从业经验	
基金评价人员			
姓名	职业资格证书编号	基本情况	变化情况
代宏坤	S0870511060001	博士研究生	
刘亦千	S0870511040001	硕士研究生	学位变为硕士研究生

高琛	S0870512010001	学士	
李颖	S0870512110001	硕士研究生	
马真真	S0870513120001	学士	证券投资咨询业务（分析师）
许行志	S0870513110001	硕士研究生	证券投资咨询业务（分析师）
高云鹏	S0870513120002	硕士研究生	证券投资咨询业务（分析师）
沈露映	S0870112060010	硕士研究生	
蔡云瀚	S0870112070012	学士	
王学磊	S0870112120030	硕士研究生	

三、基金评价标准、方法、程序以及调整情况

上海证券投资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

在严格遵守中国证监会、中国证券业协会的监管和指导下，上海证券投资基金评价研究中心秉承“专业、客观、诚信”的理念，紧跟基金市场创新发展的趋势，展开基金评价业务，并就基金研究和评价的成果广泛展开交流与创新应用，取得了进一步的工作成效。

1、深挖特定主题，研究数量大幅攀升

在研究创新方面，2013年上海证券结合市场发展新阶段需求，加强了对特定主题的聚焦和深度挖掘，研究数量和深度均有提升。

2013年上海证券重点在债券基金评价、基金组合配置、基金池构建等方面展开了系统深入的研究和实践。结合国外研究成果和中国债券市场特性，构建了债券投资组合评价体系，并以国内债券基金为对象进行了实证研究；对FOF投资运作的机制、策略和风险等进行了系统评估和模拟操作；在基金评级系统基础上建立了特有的基金池系统；对基金组合的绩效进行持续的跟踪评估，结合量化策略和定性分析不断优化。

2013年基金研究报告数量大幅提升，报告影响力持续增强。截止2013年11月底，基金评价研究中心完成基金评价研究报告共计1738篇报告，研究报告数量较2012年报告数量增长了2倍。数量提升的同时，研究影响力也进一步加强，共计164篇报告发表在主流媒体

上的报告，其中专题研究报告 94 篇，在证券时报发布基金评级结果 11 篇，提供证券时报明星基金奖点评 40 篇、基金公司奖点评 19 篇，参与各种财经节目录制及访问 55 次。特色刊物《上海证券五星基金季刊》，定期解读上海证券五星基金的季报数据与长期投资价值，已持续为监管层、相关机构高层、媒体、营业部等提供了 11 期服务，累计印刷发布超过 8000 册，并在不断改良创新中。

2、充分利用新媒体等多种渠道，更广泛普及基金研究成果

上海证券 2013 年继续加深与三大报、报纸、杂志、电视、网络媒体等的良好合作，充分利用公开媒体平台、尤其是新媒体渠道普及基金评价和研究成果。

2013 年上海证券共计为包括中国证券报、上海证券报和证券时报三大报在内的 28 家媒体（报纸 12 家，网络媒体 16 家）和 2 本杂志以及 2 家数据商，提供基金评价数据和稿件。上海证券全年参加第一财经、东方财经及其他卫视、广播电台等公众电广媒体节目传递理性投资基金的讯息，全年有记录的参与财经节目录制及访谈逾 55 次。同时，继续作为证券时报和上海证券报基金评奖的技术顾问，对获奖基金和基金公司进行点评、发布专版，并开拓成为中国证券报金牛基金评奖的评委，将参与 2013 年度金牛基金的评奖。上海证券保持定期在新浪等网络平台与投资者交流互动的传统，积极加深与东方财富网、和讯网、数米网等新媒体平台的基金资讯专栏合作，探索互联网金融服务的新路径。

3、持续深化基金评价研究成果的应用落地

2013 年，上海证券基金评价和研究成果在银行、基金公司、第三方理财机构、上海证券公司内部等领域进一步应用落地，为市场提供更深入的基金配置、绩效评估等贴近基金市场需求的服务。

在基金行业持续创新发展大背景下，上海证券 2013 年对第三方销售机构、具备基金代销资格的互联网公司等保持了广泛联系，密切关注创新动态。为夯实第三方销售机构的专业性、培育理性互联网金融市场贡献一份力量。

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。