



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（2015）

報告單位： 上海證券有限公司

報告日期： 2016年8月8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（2015）

### 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	上海市四川中路 213 号	邮编	200002
办公地址	上海市四川中路 213 号		200002
成立时间	2001.4	注册资本	26.1 亿元
总资产	352.50 亿元	净资产	62.35 亿元
法定代表人	李俊杰	总经理	李俊杰
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	9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	021-53686101	传真	021-53686100-7002

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
刘亦千	S0870511040001	硕士研究生，具备证券投资咨询资格，10 年基金评价研究经验	在 2015 年被新任为上海证券创新发展总部负责人，分管基金评价业务
基金评价人员			
姓名	职业资格证书编号	基本情况	变化情况

高琛	S0870512010001	硕士研究生，具备证券投资咨询资格，6年基金评价研究经验	
李颖	S0870512110001	硕士研究生，具备证券投资咨询资格，6年基金评价研究经验	
高云鹏	S0870513120002	硕士研究生，具备证券投资咨询资格，4年基金评价研究经验	
蔡云瀚	S0870112070012	学士，具备证券投资咨询资格，4年基金评价研究经验	
赵威	S0870115050014	学士，CFA，具有6年基金评价研究经验	
闻嘉琦	S0870115050013	硕士研究生	
代宏坤	S0870511060001	博士研究生。	
庄宇飞	S0870111050010	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、更新公募基金分类体系，与新基金法规定保持一致。

2015年新基金法颁布，其中公募基金的股票型、混合型分类标准发生较大变化，上海证券相应对公募基金分类体系、风险等级评价体系均进行了调整，使之与新基金法的规定和

精神保持一致。

此外，在公募基金产品品类日益丰富，混合型基金成为多策略实验栖息地的现实之下，上海证券基金评价中心对公募基金分类体系进行了丰富和拓展，形成二级分类体系、标签体系相结合的独特系统，以为公募基金风险收益的精细刻画提供有益参考。

#### 2、优化私募基金评价体系，为私募基金研究提供专业支持。

上海证券在 2015 年落地私募评价数据，对私募基金评价体系不断优化，并配置了专门私募基金研究员，基于私募评级体系展开私募研究咨询业务拓展。上海证券私募业务一经落地就取得了业界广泛的认可，为多项私募活动提供专业支持，包括：2015 年年初为上证报私募评奖技术支持；作为中证报金牛私募评奖的参评机构之一，协助中证报私募评奖活动；在今年 7 月份、12 月份先后 6 次参加 6 次由中证报组织的私募调研活动，并参与其评奖资格讨论。

#### 3、加强基金评价研究工作，开发年金和养老金基金指数，积极筹备 FOF 研究框架。

上海证券基金评价研究中心长期致力于基金市场的投资教育服务，为提升基金市场各环节的专业性持续而努力。研究成果来看：截止 2015 年 12 月 15 日，基金评价研究中心完成基金评价研究报告共计完成 1381 篇报告，研究报告数量和专题质量持续提升，广泛覆盖市场热点、基金绩效考察、基金公司战略发展、基金业创新发展等诸多方面。

上海证券研发的中国主动股票基金指数、混合基金指数和债券基金指数于 2015 年 1 月 4 日正式发布。随后继续与证券时报和深圳信息技术公司合作，于 2015 年 7 月完成初步验证，11 月 23 日正式发布。养老金指数（包括中国企业年金、中国生命周期基金系列指数）于 11 月 23 日完成发布。此系列指数获得基金业协会和市场的高度认可，在协会网站和万德终端予以展示。

此外，新基金法中首次明确了 FOF 产品的界定和产品形态，上海证券基于此积极展开 FOF 策略构建，于 2015 年 10 月初步形成 FOF 产品策略框架。FOF 产品框架主要基于长期投资、资产配置为主要的理念，期望为未来业界开发和普及 FOF 投资提供合理预期和高效策略。

#### 4、继续拓展和深化与基金市场各参与者的交流，提升专业影响力。

为基金销售机构提供研究支持：2015 年上海证券继续为多家银行机构、第三方销售机构提供销售研究支持，通过为相关理财师提供专业培训、为基金 APP 建设提供专业思路和数

据支持、销售适用性方案以及专题研究服务等方式，将理性投资、长期配置的思路广泛输入到基金销售服务各环节。

与基金管理人展开深入交流：上海证券与基金公司保持了良好的沟通和交流，紧密关注基金行业的动态，对基金产品进行跟踪和定性研究，并基于第三方立场为基金公司提供公司战略、产品设计、产品绩效评估等多方面的专业意见。

通过媒体广泛扩散基金的专业研究成果：截至 2015 年 12 月 15 日上海证券在主流媒体上共计发表 217 篇报告。此外，参与财经类广播电视节目录制 14 次。主要为包括中国证券报、上海证券报和证券时报三大报在内的 27 家媒体（报纸 12 家，网络媒体 16 家）和 2 本杂志（其中《中国外汇》为国家外汇管理局主管的国家级期刊）以及 2 家数据商，提供基金评价数据和稿件。同时，作为中证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并发布专版。

此外，上海证券积极参与协会组织的各项基金相关的培训和学习，完成协会委托的中国基金年报撰写。

## 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。