



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（2012）

報告單位： 上海證券有限公司

報告日期： 2013年3月20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（2012）

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	117.94 亿元	净资产	41.87 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	12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，12 年 证券从业经验	升任总部负责人
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	学士	

高琛	S0870512010001	学士	
李颖	S0870512110001	硕士研究生	转为分析师资格编号。
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	S0870112060010	硕士研究生	
蔡云瀚	S0870112070012	学士	2012 年入职

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，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，取得了良好的工作成效。

(1) 拓宽加深基金评价研究范围，加强创新力度

顺应基金市场创新发展的趋势，上海证券基金评价研究中心积极主动拓展研究范围，加大了的创新类产品的研究力度，同时开展了对非基金类金融产品的研究和交易型基金配对交易策略的研究，取得了初步成果。在基金创新产品研究方面，2012 年上海证券跟进基金产品创新的前沿，对结构化分级产品、ETF 产品及配对交易策略等进行了深度研究，并对 ETN 等新型产品做了前瞻性探索，为基金公司的产品设计和加深投资者对产品的理解提供了助力。在基金产品评价与研究之外，上海证券将研究范围扩展到日益壮大的集合理财产品、私募基金等，进行了日常跟踪，并探索相应的风险评级模式；在宏观市场方面，上海证券针对基金业发展改革大趋势，推出系列美国基金历史变迁、费率、清盘、共同监管、外部治理、组织形式等主题的深度研究，以为推动市场成熟规范提供思路借鉴。

同时,上海证券基金评价研究中心夯实基础研究工作,成果多次获得交易所和协会的肯定。上海证券参与中国证券业协会论文征选活动和上海证券交易所研究课题,取得优异成绩。基金评价研究中心和研究所共同组织的上海证券交易所交易所交易债券研究课题经专家评审获得优秀奖;基金评价研究中心员工提交的论文获中国证券业协会 2012 年度优秀论文奖。

(2) 巩固与扩大基金研究的影响力

2012 年,上海证券在巩固前期成果的同时,立足于创新特色,实现了较全面的基金研究覆盖和多种形式的媒体传播,研究数量和质量在 2012 年均得到进一步提升,影响力得到加强加深。在研究成果方面,截止 2012 年 11 月底,基金评价研究中心完成基金评价研究报告 564 篇,在主流媒体上发表 149 篇,其中专题报告 139 篇,评级报告 10 篇,在三大报及专业杂志发表研究报告超过 120 篇。在利用公开媒体平台普及基金评价和研究成果方面,基金评价研究中心持续加强与三大报、十多家网络媒体和杂志的良好合作关系,有记录的参与财经节目录制及访谈逾 39 次,并作为证券时报和上海证券报的顾问,参与基金评奖活动,对获奖基金和基金公司进行点评和发布专版。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 7 期服务,累计印刷发布超过 5000 册。

(3) 加强基金评价研究在银行、基金公司、券商等的应用落地

2012 年,基金评价研究中心与多家基金公司、银行、保险、券商的相关人员进行了广泛的交流,就基风险评价、销售适用、交易策略以及固定收益投资、ETF 基金、分级产品等多种主题内容,以现场培训、课程制作、产品设计、投资者教育、专题研究等多种方式进行了合作,为基金公司、银行、保险以及券商在基金方面的运作提供了知识的普及和科学的理念指导,助力于基金相关业务开展的效率提升。其中,在银行方面,基金评价研究中心成功中标建设银行总行基金和券商集合理财产品评价研究服务项目,为今后将基金评价研究落地银行服务打下了坚实基础。在券商服务方面,基金评价研究中心为公司 56 家营业部持续提供视频、现场等基金培训服务,支持基金年销售,为券商加强基金通路业务积累了丰富经验。

(4) 坚持举办基金论坛,广泛展开业界交流

上海证券积极参与各大论坛和座谈活动,并持续举办基金论坛逾 3 年,为推动业界交流做出了贡献。2012 年基金评价研究中心成功举办 2012 年基金产品创新专题研讨会,会议上对创新型产品进行了深度的探讨,得到与会者的高度评价。在日常工作中,积极出席中国证

监会、证券业协会和基金业协会组织的各项活动，包括基金公平交易等座谈会，强化了与监管层的沟通，并且积极参与基金公司举办的专题研讨会，提高对基金市场服务的针对性。

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。