

# 申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 招募说明书（第四次更新）

**基金管理人：申万巴黎基金管理有限公司**

**基金托管人：中国工商银行股份有限公司**

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，  
但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

## 重要提示

本基金由基金管理人依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关规定募集，并经中国证监会 2004 年 10 月 13 日证监基金字【2004】158 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作出的任何决定，均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、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

投资有风险，投资者认购或申购基金时应认真阅读本招募说明书。

基金的过往业绩并不预示其未来的表现。

本招募说明书（更新）所载内容截止日为 2006 年 11 月 30 日，有关基金的财务数据和净值表现截止日为 2006 年 9 月 30 日（财务数据未经审计）。

# 目 录

一 绪 言.....	1
二 释 义.....	2
三 基金管理人 .....	8
四 基金托管人 .....	18
五 相关服务机构.....	<u>23</u>
六 基金份额的申购和赎回.....	<u>27</u>
七 基金的非交易过户、基金转换和冻结 .....	<u>35</u>
八 基金的转托管 .....	<u>37</u>
九 基金的投资 .....	<u>38</u>
十 基金的业绩 .....	<u>46</u>
十一 基金财产 .....	<u>48</u>
十二 基金资产估值 .....	<u>50</u>
十三 基金收益分配 .....	<u>55</u>
十四 基金的费用与税收 .....	<u>57</u>
十五 基金的会计和审计 .....	<u>60</u>
十六 基金的信息披露.....	<u>61</u>
十七 风险揭示 .....	<u>63</u>
十八 基金合同的终止与基金财产的清算 .....	<u>65</u>
十九 基金合同内容摘要 .....	<u>67</u>
二十 基金托管协议内容摘要.....	<u>83</u>
二十一 对基金份额持有人的服务 .....	<u>87</u>
二十二 招募说明书存放及查阅方式 .....	<u>89</u>
二十四 备查文件.....	<u>91</u>

删除的内容: 23

删除的内容: 24

删除的内容: 27

删除的内容: 28

删除的内容: 35

删除的内容: 36

删除的内容: 37

删除的内容: 38

删除的内容: 38

删除的内容: 39

删除的内容: 46

删除的内容: 47

删除的内容: 48

删除的内容: 49

删除的内容: 50

删除的内容: 51

删除的内容: 55

删除的内容: 56

删除的内容: 57

删除的内容: 58

删除的内容: 60

删除的内容: 61

删除的内容: 61

删除的内容: 62

删除的内容: 63

删除的内容: 64

删除的内容: 65

删除的内容: 66

删除的内容: 67

删除的内容: 68

删除的内容: 83

删除的内容: 84

删除的内容: 87

删除的内容: 88

删除的内容: 89

删除的内容: 90

删除的内容: 91

删除的内容: 93

## 一 绪 言

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》和其他相关法律法规以及《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》(“《基金合同》”)编写。

基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其真实性、准确性、完整性承担法律责任。本基金是根据本招募说明书所载明的资料募集的。基金管理人没有委托或授权任何其他人提供未在本招募说明书中载明的信息,或对本招募说明书作任何解释或者说明。

本招募说明书由基金管理人根据《基金合同》编写,并经中国证监会核准,主要向投资者披露本基金及与本基金相关事项的信息,是投资者据以选择及决定是否投资于本基金的要约邀请文件。

《基金合同》是规定《基金合同》当事人之间权利、义务的法律文件。投资者缴纳认购和申购基金份额的款项时,《基金合同》成立,其认购(或申购)基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受。投资者按照法律法规和《基金合同》的规定享有权利、承担义务;基金投资者欲了解基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅《基金合同》。

## 二 释 义

本招募说明书中除非文意另有所指，下列词语具有如下含义：

《基金合同》	指《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》及不时对其作出的任何修订和补充
中国	指中华人民共和国（不包括香港特别行政区、澳门特别行政区及台湾地区）
法律法规	指中国现时有效并公布实施的法律、行政法规、行政规章及规范性文件、地方法规、地方规章及规范性文件
《基金法》	指《中华人民共和国证券投资基金法》
《运作办法》	指《证券投资基金运作管理办法》
《销售办法》	指《证券投资基金销售管理办法》
《信息披露办法》	指《证券投资基金信息披露管理办法》
元	指中国法定货币人民币元
基金或本基金	指依据《基金合同》所设立的申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金
《招募说明书》或本招募说明书	指《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金招募说明书》，一份公开基金管理人、基金托管人及有关服务机构、

基金募集、基金合同生效、基金份额的申购及赎回、基金的非交易过户、转托管、基金的投资、基金财产、基金资产估值、基金收益分配、基金的费用及税收、基金会计及审计、基金的信息披露、风险揭示、基金合同终止和基金资产的清算等涉及本基金的信息，供基金投资者选择并决定是否提出基金认购或申购申请的要约邀请文件，及其定期的更新

发售公告	指《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金发售公告》
业务规则	指《申万巴黎基金管理有限公司开放式基金业务规则》
中国证监会	指中国证券监督管理委员会
银行监管机构	指中国银行业监督管理委员会或其他经国务院授权的机构
基金管理人	指申万巴黎基金管理有限公司
基金托管人	指中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)
基金销售代理人	指依据有关基金销售与服务代理协议办理本基金认购、申购、赎回和其他基金业务的代理机构
销售机构	指申万巴黎基金管理有限公司及基金销售代理人的统称
基金销售网点	指申万巴黎基金管理有限公司的直销中心及基金销售代理人的代销网点

注册与过户登记业务	指基金登记、存管、清算和交收业务，具体内容包括投资者基金账户管理、基金份额注册与过户登记、清算及基金交易确认、发放红利、建立并保管基金份额持有人名册等
基金注册与过户登记人	指申万巴黎基金管理有限公司，或其委托的其它符合条件办理基金注册与过户登记业务的机构
《基金合同》当事人	指受《基金合同》约束，根据《基金合同》享受权利并承担义务的法律主体
个人投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的自然人
机构投资者	指符合法律法规规定的条件可以投资证券投资基金的在中华人民共和国注册登记或经政府有权部门批准设立的机构
合格境外机构投资者	指符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理暂行办法》的条件可投资中国境内证券的中国境外的机构投资者
投资者	指个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者的合称
基金存续期	指《基金合同》生效后，基金合法存续的不定期之期间
日/天	指公历日
月	指公历月
工作日	指上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日

T日	指申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n日	指自T日起第n个工作日（不包含T日）
认购	指在本基金募集期内，投资者购买本基金份额的行为
申购	指《基金合同》生效后，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人购买基金份额的行为。基金的申购在《基金合同》生效后不超过二个月的时间开始办理
赎回	指《基金合同》生效后，基金投资者根据基金销售网点规定的手续，向基金管理人卖出基金份额的行为。基金的赎回在《基金合同》生效后不超过二个月的时间开始办理
基金转换	指持有本基金管理人管理的任一开放式基金份额的投资者向本基金管理人提出申请，将其原来持有的开放式基金（转出基金）的全部或部分基金份额转换为本基金管理人管理的任何其他开放式基金（转入基金）的基金份额的行为
基金账户	指基金注册与过户登记人给投资者开立的用于记录投资者持有基金管理人管理的开放式基金份额情况的帐户
交易账户	交易账户指销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构买卖开放式基金份额的变动及结余情况的账户
转托管	指投资者将其持有的同一基金账户下的基金份额从某一交易账户转入另一交易账户的业务

定期定额投资计划	指投资者通过销售机构提交基金定期定额业务申请，约定每期扣款日、扣款金额、扣款方式及申购基金品种等，由销售机构于每期约定扣款日在投资者指定银行账户内自动完成扣款并申购投资者指定的基金品种的行为
基金收益	指基金投资所得红利、股息、债券利息、买卖证券差价、银行存款利息以及其他收益
基准底线	指按照本基金每个基金年度的年初基金份额净值而计算的基准底线。其中，首个基金年度的基准底线为0.9000元，从第二个基金年度开始，该基金年度的基准底线为该基金年度年初的基金份额净值的90%和0.9000元中的较大者，即任何基金年度的基准底线均不低于0.9000元
基金年度	首个基金年度是指从《基金合同》生效日起至次年的同一日的前一日的时段；其余基金年度以此类推
基金资产总值	指基金所购买各类证券价值、银行存款本息和本基金应收的申购基金款以及其他投资所形成的价值总和
基金资产净值	指基金资产总值减去基金负债后的价值
基金份额净值	指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数
基金资产估值	指计算评估基金资产和负债的价值，以确定基金资产净值和基金份额净值的过程

中国证监会指定的信息披露媒体 指中国证监会指定的用以进行有关基金信息披露的报纸和互联网网站

不可抗力 指《基金合同》当事人无法预见、无法抗拒、无法避免且在《基金合同》由基金托管人、基金管理人签署之日后发生的，使《基金合同》当事人无法履行或迟延履行《基金合同》全部或部分义务的任何事件，包括但不限于洪水、地震及其它自然灾害、战争、骚乱、火灾、政府征用、没收、法律法规变化、突发停电或其他突发事件、证券交易所非正常暂停或停止交易

### 三 基金管理人

#### (一) 基金管理人概况

申万巴黎基金管理有限公司

- 1、 设立日期：2004 年 1 月 15 日
- 2、 注册地址：中国上海淮海中路 300 号 40 层
- 3、 法定代表人：姜国芳
- 4、 办公地址：中国上海淮海中路 300 号 40 层
- 5、 办公电话：+ 86 21 6335 3535
- 6、 联系人：来肖贤
- 7、 注册资本：人民币 1 亿元
- 8、 股本结构：申银万国证券股份有限公司持有 67% 的股权，法国巴黎资产管理有限公司持有 33% 的股权

#### (二) 主要人员情况

##### (1) 董事会成员：

姜国芳先生，董事长，男，1957 年出生。高级经济师，工商管理硕士。1980 年至 1984 年任职于中国人民银行上海市分行，1984 年至 1992 年任职于中国工商银行上海市分行组织处，1992 年至 1996 年任职于上海申银证券有限公司，董事副总经理、党委副书记。1996 年至 2004 年 2 月任申银万国证券股份有限公司执行副总裁，兼申银万国（香港）有限公司董事长。

唐熹明先生，副董事长兼总裁，1956 年出生。毕业于伦敦大学。1977 年至 1988 年任职于美国花旗银行，1988 年至 1992 年先后出任东京花旗信托银行总经理和东京 JP 摩根信托银行副总裁，1992 年至 1995 年出任标准渣打银行董事。1995 年至 2004 年 2 月任法国巴黎资产管理公司亚太区市场推广总监。

杜平先生，董事，男，1963 年出生。经济师，法学硕士。1989 年至 1990 年在湖北省武汉市政府政策研究室任科员、副主任科员，1990 年底至 1993 年初在湖北省武汉市政府办公厅任副市长秘书、主任科员。1993 年初至 1998 年初在交通银行总行秘书处、

条法处先后担任副行长秘书、行长秘书、党组书记。1998年起任交通银行深圳分行副行长，2000年7月任交通银行新加坡分行行长。2003年10月起加盟申银万国证券股份有限公司，任公司副总裁。

陆文清先生，董事，男，1958年出生。高级经济师，硕士。1981年至1983年任职于中国工商银行上海分行，1983年至1986年任职于中国驻加蓬大使馆经参处。1986年至1990年任职于中国工商银行上海信托投资公司，1990年至1996年任上海申银证券公司总裁助理兼国际业务总部总经理，1996年至今任职于申银万国证券股份有限公司，现任总裁助理兼国际业务总部总经理。

Francois Petit-Jean 先生，董事，1962年出生。巴黎政治学院经济与大众科学硕士；现任法国巴黎资产管理有限公司新兴市场部负责人、战略发展部负责人；曾任法国巴黎银行资产管理服务部门发展部负责人，法国巴黎银行 Banexi 公司投资银行执行副总裁，法国农业银行投资银行副总裁。

毛应樑先生，独立董事，1937年出生。1961年至1985年任职于中国人民银行，曾任中国人民银行上海分行副行长。1985年至1991年任中国工商银行上海分行行长、党委副书记、书记，1991年至1999年任中国人民银行上海市分行行长、党组书记。1999年至2003年任上海证券交易所理事会理事长、顾问。

蔡克刚先生，独立董事，1951年出生，法学硕士。1974年至1976年任职于英国伦敦艾理士活特律师行，1976年至1999年任香港胡百全律师事务所助理律师、合伙人。1999年至今任蔡克刚律师事务所首席合伙人。

袁恩桢先生，独立董事，1938年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长，现任上海市经济学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。

赵霄洛先生，独立董事，1950年出生。曾任职于司法部香港中国法律服务有限公司、香港何耀棣律师事务所、康达律师事务所。现任北京众鑫律师事务所上海分所主任、律师。

## (2) 监事会成员：

刘鸿儒先生，监事，1930年出生。全国政协经济委员会副主任，教授，博士生导师。1959年在莫斯科大学经济系研究生毕业，获副博士学位，回国后，先后任中国人民银行的处长、局长、农业银行副行长、中国人民银行副行长、国家经济体制改革委员会

副主任、中国证监会首任主席。

卢骏先生，英国伦敦政治经济学院经济学硕士；现任法国巴黎资产管理公司亚太区董事总经理；曾任巴黎巴银行集团资产管理及私人银行集团亚太区董事总经理、渣打银行资产管理及信托服务董事；曾任职花旗银行，历经该银行各业务部门工作，包括：金融机构部，资本市场部和资产管理部。持有香港证监会颁发之投资顾问、交易员顾问、商品交易顾问牌照。

王厚谊先生，监事，申万巴黎基金管理有限公司行政管理总部负责人。1951年出生，研究生学历。自1978年起任职上海船舶研究设计院；1994年任职万国房地产开发公司任办公室主任；1997年任职申银万国证券股份有限公司人力资源总部薪酬部经理。2004年1月加盟本公司。

**(3) 督察长：**

来肖贤先生，督察长，1969年出生，经济学硕士；曾任本公司监察稽核总部副总经理；在本公司任职之前，曾任申银万国证券股份有限公司国际业务总部投资分析师、部门副经理。

**(4) 高级管理人员**

唐熹明先生，总裁（简历请参见上述关于董事的介绍）。

过振华先生，副总裁，1964年出生，工商管理硕士。1983年至1990年任职于中国工商银行上海分行，1990年至1993年任上海申银证券公司国际业务部经理。1997年至1999年任申万泛达投资管理（亚洲）有限公司联席总裁，1999年至2004年2月任申银万国证券股份有限公司国际业务总部副总经理。2004年3月至2005年2月任申万巴黎基金管理有限公司督察长。

**(5) 基金经理**

李源海先生，自1999年起从事金融工作，在中国银行深圳分行从事外汇业务、并任产品开发小组组长、分行风险管理委员会秘书；2001年起从事证券行业，历任湘财证券有限责任公司投资银行部项目经理、证券投资部投资经理；2002年起担任天同基金管理有限公司研究部高级经理、基金管理部基金经理；2005年底加入本公司。

**(6) 投资决策委员会委员名单**

投资决策委员会由下述执行委员组成：投资总监、总裁、副总裁和基金经理。公司总裁担任投资决策委员会主席和召集人。

公司董事长、督察长、监察稽核部经理和风险管理部经理作为非执行委员有权列席投资决策委员会的任何会议。

(7) 上述人员之间不存在近亲属关系。

### (三) 基金管理人的职责

- (1) 遵守《基金合同》；
- (2) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
- (3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
- (4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托符合条件的其它机构代理该项业务；
- (5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施办理基金份额的注册与过户登记业务或委托符合条件的其它机构代理该项业务；
- (6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
- (7) 除依据法律法规和《基金合同》及其它有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金资产；
- (8) 依法接受基金托管人的监督；
- (9) 按规定计算并公告基金资产净值及基金份额净值；
- (10) 严格按照法律法规和《基金合同》的规定，履行信息披露及报告义务；
- (11) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规和《基金合同》及其它有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (12) 按《基金合同》规定向基金份额持有人分配基金收益；
- (13) 按照法律法规和《基金合同》的规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；

- (15) 依据法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 进行基金会计核算并编制基金财务会计报告，按规定保存基金财产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、被依法撤销或被依法宣告破产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金资产的损失或损害基金份额持有人大会合法权益，承担赔偿责任，其赔偿责任不因退任而免除；
- (21) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (22) 法律法规和《基金合同》规定的其它义务。

#### **(四) 基金管理人的承诺**

- 1、基金管理人于此承诺将遵守适用的法律法规和《基金合同》。
- 2、基金管理人承诺禁止用本基金财产从事以下行为：
  - (1) 将其固有财产或者他人财产混同于基金财产从事证券投资；
  - (2) 不公平地对待其管理的不同基金；
  - (3) 利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；
  - (4) 向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；
  - (5) 届时有效的法律法规及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。
- 3、本基金基金经理承诺
  - (1) 依照有关法律法规和《基金合同》的规定，本着谨慎的原则为基金份额持有人谋取最大利益；
  - (2) 不为自己、其代理人、代表人、受雇人或任何第三人谋取非法利益；
  - (3) 不泄露在任职期间知悉的有关证券、基金的商业秘密、尚未依法公开的基金投资内容、基金投资计划等信息；

- (4) 不协助、接受委托或以其他任何形式为除基金管理人以外的其他组织或个人进行证券交易。

## (五) 基金管理人的内部控制制度概述

### 1、内控体系设计依据

本基金管理人内控体系的设计基于满足国家有关法律法规的要求，以及本基金管理人对相关法律法规精神的深入理解，结合本基金管理人对基金管理业务的理解和规划并借鉴股东单位在资产管理业务领域长期的实践经验。

### 2、内控体系设计原则

- (1) 健全性原则：内部控制覆盖公司的各项业务、部门或机构和各级人员，并贯穿到决策、执行、监督、反馈等各个环节。
- (2) 有效性原则：本基金管理人内控体系注重于建立不同层次的风险控制和监察程序，同时各业务部门和岗位均设立并遵循合理的管理制度和有效率的工作流程。本基金管理人内部控制体系的建立在各项业务的运行过程中将发挥事前防范风险、事中监控和事后稽核的作用。
- (3) 独立性原则：本基金管理人各机构、部门和岗位职责应当保持相对独立，公司旗下基金资产、自有资产、其他资产的运作应当分离。设立独立于各业务和管理部门的风险管理部对各部门、岗位进行流程监控和风险管理。此外，更具独立性的督察长和监察稽核部，对各部门的业务开展进行合规监察，并代表董事会对公司的运营进行独立的稽核。
- (4) 相互制约原则：公司内部部门和岗位的设置权责分明、相互制衡。
- (5) 成本效益原则：公司运用科学化的经营管理方法降低运作成本，提高经济效益，通过合理的成本控制达到最佳的内部控制效果。

### 3、风险管理及内部风险控制的组织结构

- (1) 风险管理委员会：风险管理委员会为公司非常设议事机构，由公司总裁、副总裁、督察长、风险管理部经理组成。主要负责审核本基金管理人的风险控制制度和风险管理流程，确保对公司整体风险进行风险评估的识别、监控与管理；对公司存在的风险隐患或出现的风险问题进行研究，提出解决方法；负责对公司的基金各投资品

种进行风险评估并设定风险控制参数，向投资决策委员会提供相关的风险测算、风险分析之咨询建议；对基金资产运作的风险进行预测、评估和控制管理；决定对本基金管理人内部员工严重违法、违规事件的调查，并依据调查结果做出相应的处罚决定。

- (2) 督察长：本基金管理人设督察长，对董事会负责。主要负责行使法律（和其不时修改的规定）赋予其的所有职权，可列席本基金管理人的任何会议，对基金运作、内部管理、制度执行及遵纪守法情况进行内部监察、稽核，独立出具稽核报告；根据本基金管理人监察稽核工作的需要在董事会授权范围内，督察长可以调阅本基金管理人相关档案，就内部控制制度的执行情况独立地履行检查、评价、报告、建议职能；定期和不定期向董事会报告内部控制执行情况，董事会应当对督察长的报告进行审议。
- (3) 监察稽核部：该部门直接向督察长负责。监察稽核部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控；监察稽核部有权对基金投资交易过程实施实时监控；有权对公司各部门内部控制制度的建立和落实情况进行检查稽核；对违规事件进行调查并提出处理意见；对设立的内部风险控制制度的合理性、有效性进行分析，提出改进方案，上报督察长或在必要时上报风险管理委员会进行讨论。
- (4) 风险管理部：该部门直接向总裁负责。风险管理部职责在于对本基金管理人的各项经营活动中的风险进行评估及管理；对基金投资、研究、交易、基金业务管理、基金营销、基金会计、IT 系统、人力资源、财务管理等各业务部门及运作流程中的各个环节进行监控，检查其遵守公司的规章、指引和流程的情况；针对此类事项，定期向总裁出具独立的风险控制报告，该报告须抄送督察长。

## （六）基金管理人内部控制要素

### 1、内部控制环境

- (1) 内部控制环境包括经营理念和内控文化，公司治理结构、组织结构、员工道德素质等内容；
- (2) 本基金管理人致力于营造一个强调内控和风险管理的文化氛围；
- (3) 本基金管理人按现代企业制度的要求，建立了符合公司发展需要的组织结构和运行

机制，充分发挥独立董事、监事会对公司管理层和经营活动的监督，通过在董事会、监事会层面建立专业化、民主、透明的决策程序和管理、议事规则，防止不正当的关联交易、利益输送和公司内部人控制的现象并确保基金份额持有人的利益不受侵犯；

- (4) 本基金管理人建立了科学的聘用、培训、评估考核、晋升、淘汰等人力资源管理制度，建立了健全的激励与约束机制，确保公司职员具备和保持良好的职业操守和专业素养；
- (5) 本基金管理人建立了贯穿于公司整体的、层次明晰、权责统一、监管明确的四层内部控制防线，包括：
  - 第一层：员工的自律与岗位之间的相互制衡与监督；
  - 第二层：严格的授权管理及等级监督制度；
  - 第三层：独立于各部门、服务于公司高级管理层的由风险管理部对各业务部门实施的日常常规风险检查；
  - 第四层：服务于董事会的独立的合规监察与稽核；
- (6) 本基金管理人建立了重要业务处理凭据传递和信息沟通制度，有关部门和岗位之间相互监督、相互制衡。

## 2、风险评估

- (1) 风险评估，包括风险鉴别和风险测算两大部分，是风险控制管理的前提；
- (2) 风险鉴别指公司需要确认并了解它所面临风险的特征；
- (3) 风险测算则在风险鉴别的基础上进一步对风险可能产生的损失作出较为科学和准确的估测；
- (4) 风险管理委员会需要从风险损失的领域进行划分，确认某项风险将导致公司承担相应法律责任、社会和公众责任、经济损失或是在以上三个领域的任何组合损失；
- (5) 各部门应负责落实其相关的风险控制措施；
- (6) 风险管理部需要在预期风险损失发生的情景下，评估风险对各方面产生的冲击效应。

## 3、控制活动

- (1) 严格的流程控制是公司进行有效的内部控制的基础。
  - 1) 本基金管理人各项业务操作均应严格遵守公司制定的相应流程，主要的基本业

务流程包括：销售和基金募集管理流程、客户开户和注册与过户登记管理流程、客户服务与客户关系处理流程、投资决策管理流程、投资交易管理流程、基金清算与基金会计管理流程、产品开发流程、信息披露管理流程、信息技术管理与操作流程、紧急应变程序、绩效评估与考核程序、授权管理程序、风险控制流程和监察稽核程序等；

- 2) 在主要基本业务流程体系的基础上，各部门结合基本业务流程和其部门、岗位的职责进一步制定具体的、涵盖操作细节的操作流程；在销售、注册与过户登记、投资、交易、基金清算及授权管理等重要操作流程设计与执行中应产生和保留详细的书面记录；
  - 3) 风险管理部在日常业务运行过程中对操作流程的遵守情况进行全面监督和记录；
  - 4) 各部门主管负责对本部门的流程运作进行实时监控以保证本部门的工作严格遵守相关业务流程；
  - 5) 监察稽核部以定期稽核的方式检查各业务部门对相关流程运作与遵守情况，并对该流程的合理性、可操作性以及得到遵守的实际状况进行评估；
- (2) 严格的分级授权是公司内部控制的基本方式；
  - (3) 建立完善的资产分离制度，基金资产与公司资产、不同基金的资产和其他委托资产实行独立运作，分别核算；
  - (4) 严格执行岗位分离制度，明确制定了岗位职责；
  - (5) 建立科学的业绩评估和考核体系，定期对各项业务开展作出综合评价并对各部门和岗位人员的业绩进行评估、考核；
  - (6) 制定切实有效的紧急应变制度，建立危机处理的机制，明确危机处理的程序。
- 4、信息沟通
- (1) 建立公司内部的信息沟通渠道，保障信息的及时、准确的传递，并且维护渠道的畅通；
  - (2) 建立清晰的报告系统；
  - (3) 如果遇到紧急情况无法联络上级主管，可以越级汇报。

#### 5、内部监控

本基金管理人建立了有效的内部监控体系，设置督察长和独立的监察稽核部，对公司内部控制制度的执行情况进行持续的监督，保证内控制度落实。

- (1) 设督察长，对董事会负责，经董事会聘任，报中国证监会核准。根据公司监察稽核工作的需要和董事会授权开展工作；
- (2) 设独立于公司运营管理部门的监察稽核部，督察长是监察稽核部门的负责人。监察稽核部通过定期稽核计划以及不定期的抽查稽核实现对公司的内部风险监控；
- (3) 设独立于各业务部门的风险管理部，该部门直接向总裁负责；
- (4) 各部门主管负责本部门对于内控制度的执行和监督；在具体的业务运营中，授权管理、岗位间相互监督与相互制衡以及业务流程中跨部门之间的相互校验与会签制度的执行将赋予各岗位具体的监督职能；
- (5) 督察长、风险管理部和投资总监对整个投资交易过程有权实施全程跟踪的在线监控；信息技术部在信息技术方面对这项实时监控提供充分的技术支持。监控者根据其授权范围和监控领域对于投资交易过程中的控制参数进行预设置；
- (6) 各部门在发现任何有违内控原则的行为时，应立即根据报告流程逐级上报，遇到紧急情况可以越级上报；
- (7) 对于员工个人违反法律法规和有关规定，视其给公司造成的损失及影响程度进行处理。对各项规定制度完善、风险防范工作积极主动并卓有成效的部门，公司将给予适当表彰与鼓励。由于部门制度不合适或管理不完善而造成较大风险并给公司带来损失的，公司将追究部门主要负责人的责任。

#### **(七) 基金管理人内部控制制度声明**

- 1、 本基金管理人承诺以上关于内部控制的披露真实、准确；
- 2、 本基金管理人承诺根据市场变化和公司发展不断完善内部合规控制。

## 四 基金托管人

### （一）基金托管人基本情况

名称：中国工商银行股份有限公司

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

成立时间：1984 年 1 月 1 日

法定代表人：姜建清

注册资本：人民币 286,509,130,026 元

联系电话：010-66106912

联系人：蒋松云

### （二）主要人员情况

中国工商银行资产托管部共有员工 77 人，平均年龄 30 岁，90%以上员工拥有大学本科以上学历，高管人员均拥有硕士以上学位或高级职称。

### （三）基金托管业务经营情况

作为中国首批开办证券投资基金托管业务的商业银行，中国工商银行始终坚持“诚实信用、勤勉尽责”的原则，严格履行着资产托管人的责任和义务，依靠严密科学的风险管理和内部控制体系、规范的业务管理模式、健全的托管业务系统、强大的市场营销能力，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业的托管服务，取得了优异业绩。截至2006年9月，托管证券投资基金67只，其中封闭式16只，开放式51只。托管资产规模年均递增73%。至今已形成包括证券投资基金、信托资产、保险资产、社保基金、企业年金、产业基金、QFII资产、履约类产品等十大类14项产品的托管业务体系。“继2004年先后获得《亚洲货币》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号后，2005年，又分别获得《财资》和《全球托管人》评选的“中国最佳托管银行”称号。”

### （四）基金托管人的职责

（1） 遵守《基金合同》；

（2） 以诚实信用、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金资产；设立专门的资产托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基

金资产托管事宜；

- (3) 建立健全内部控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据法律法规和基金合同的规定外，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；
- (6) 按规定开设基金财产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
- (7) 保守基金商业秘密，除法律法规和《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
- (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额净值；
- (9) 按规定出具基金托管情况的报告，并报中国证监会和银行监管机构以及按照规定复核基金业绩；
- (10) 在定期报告内出具托管人意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照基金合同的规定进行；如果基金管理人未执行基金合同规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
- (11) 基金托管人应当按照相关法律法规、中国证监会的规定和《基金合同》的约定，对基金管理人编制的基金资产净值、基金份额净值、基金份额申购赎回价格、基金定期报告和定期更新的招募说明书等公开披露的相关基金信息进行复核、审查，并向基金管理人出具书面文件或者盖章确认。
- (12) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
- (13) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
- (14) 依据基金管理人的指令或有关规定，向基金份额持有人支付基金收益和赎回款项；
- (15) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按照规定监督基金管理人的投资运作；

- (17) 参加基金财产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (18) 面临解散、依法被撤销或破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
- (19) 因违反《基金合同》导致基金资产的损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
- (20) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

### **(五) 基金托管人的内部控制制度**

中国工商银行资产托管部自成立以来，各项业务飞速发展，始终保持在资产托管行业的优势地位。这些成绩的取得，是与资产托管部“一手抓业务拓展，一手抓内控建设”的做法是分不开的。资产托管部非常重视改进和加强内部风险管理工作，在积极拓展各项托管业务的同时，把加强风险防范和控制的力度，精心培育内控文化，完善风险控制机制，强化业务项目全过程风险管理作为重要工作来做。2005年，中国工商银行资产托管部一次性通过了评估组织内部控制和安全措施是否充分的最权威的国际资格认证SAS70（审计标准第70号），成为国内首个通过此认证的托管银行。

#### **1、内部风险控制目标**

保证业务运作严格遵守国家有关法律法规和行业监管规则，强化和建立守法经营、规范运作的经营思想和经营风格，形成一个运作规范化、管理科学化、监控制度化的内控体系；防范和化解经营风险，保证托管资产的安全完整；维护持有人的权益；保障资产托管业务安全、有效、稳健运行。

#### **2、内部风险控制组织结构**

中国工商银行资产托管业务内部风险控制组织结构由中国工商银行稽核监察部门（内控合规部、内部审计局）、资产托管部内设风险控制处及资产托管部各业务处室共同组成。总行稽核监察部门负责制定全行风险管理政策，对各业务部门风险控制工作进行指导、监督。资产托管部内部设置专门负责稽核监察工作的内部风险控制处，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，对业务的运行独立行使稽核监察职权。各业务处室在各自职责范围内实施具体的风险控制措施。

#### **3、内部风险控制原则**

(1) 合法性原则。内控制度应当符合国家法律法规及监管机构的监管要求，并贯穿于托管业务经营管理活动的始终。

(2) 完整性原则。托管业务的各项经营管理活动都必须有相应的规范程序和监督制约；监督制约应渗透到托管业务的全过程和各个操作环节，覆盖所有的部门、岗位和人员。

(3) 及时性原则。托管业务经营活动必须在发生时能准确及时地记录；按照“内控优先”的原则，新设机构或新增业务品种时，必须做到已建立相关的规章制度。

(4) 审慎性原则。各项业务经营活动必须防范风险，审慎经营，保证基金资产和其他委托资产的安全与完整。

(5) 有效性原则。内控制度应根据国家政策、法律及经营管理的需要适时修改完善，并保证得到全面落实执行，不得有任何空间、时限及人员的例外。

(6) 独立性原则。资产托管部托管的基金资产、托管人的自有资产、托管人托管的其他资产应

当分离；直接操作人员和控制人员应相对独立，适当分离；内控制度的检查、评价部门必须独立于内控制度的制定和执行部门。

#### 4、内部风险控制措施实施

(1) **严格的隔离制度。**资产托管业务与传统业务实行严格分离，建立了明确的岗位职责、科学的业务流程、详细的操作手册、严格的人员行为规范等一系列规章制度，并采取了良好的防火墙隔离制度，能够确保资产独立、环境独立、人员独立、业务制度和管理独立、网络独立。

(2) **高层检查。**主管行领导与部门高级管理层作为工行托管业务政策和策略的制定者和管理者，要求下级部门及时报告经营管理情况和特别情况，以检查资产托管部在实现内部控制目标方面的进展，并根据检查情况提出内部控制措施，督促职能部门改进。

(3) **人事控制。**资产托管部严格落实岗位责任制，建立“自控防线”、“互控防线”、“监控防线”三道控制防线，健全绩效考核和激励机制，树立“以人为本”的内控文化，增强员工的责任心和荣誉感，培育团队精神和核心竞争力。并通过进行定期、定向的业务与职业道德培训、签订承诺书，使员工树立风险防范与控制理念。

(4) **经营控制。**资产托管部通过制定计划、编制预算等方法开展各种业务营销活动、处理各项事务，从而有效地控制和配置组织资源，达到资源利用和效益最大化目的。

(5) **内部风险管理。**资产托管部通过稽核监察、风险评估等方式加强内部风险管理，定期或不定期对业务运作状况进行检查、监控，指导业务部门进行风险识别、评估，制定并实施风险控制措施，排查风险隐患。

(6) **数据安全控制。**我们通过业务操作区相对独立、数据和传真加密、数据传输线路的冗余备份、监控设施的运用和保障等措施来保障数据安全。

(7) **应急准备与响应。**资产托管业务建立了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难应急方案，并组织员工定期演练。除了在数据服务端和应用服务端实时同步备份与数据更新外，资产托管部还建立了操作端的异地备份中心，能够确保交易的及时清算和交割，保证业务不中断。

#### 5、资产托管部内部控制情况

(1) 资产托管部内部设置专职稽核监察部门，配备专职稽核监察人员，在总经理的直接领导下，依照有关法律规章，全面贯彻落实全程监控思想，确保资产托管业务健康、稳定地发展。

(2) 完善组织结构，实施全员风险管理。完善的风险管理体系需要从上至下每个员工共同参与，只有这样，风险控制制度和措施才会全面、有效。资产托管部实施全员风险管理，将风险控制责任落实到具体业务部门和业务岗位，每位员工对自己岗位职责范围内的风险负责，通过建立纵向双人制、横向多部门制的内部组织结构，形成不同部门、不同岗位相互制衡的组织结构。

(3) 建立健全规章制度。资产托管部十分重视内控制度的建设，一贯坚持把风险防范和控制的理念和方法融入岗位职责、制度建设和工作流程中。经过多年努力，资产托管部已经建立了一整套内部风险控制制度，包括：岗位职责、业务操作流程、稽核监察制度、信息披露制度等，覆盖所有部门和岗位，渗透各项业务过程，形成各个业务环节之间的相互制约机制。

(4) 内部控制始终是托管部工作重点之一，保持与业务发展同等地位。资产托管业务是商业银行新兴的中间业务，资产托管部从成立之日起就特别强调规范运作，一直将建立一个系统、高效的风险防范和控制体系作为工作重点。随着市场环境的变化和托管业务的快速发展，新问题、新情况不断出现，资产托管部始终将风险管理放在与业务发展同等重要的位置，视风险防范和控

制为托管业务生存和发展的生命线。

#### **（六）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序**

根据《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规的规定，对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金托管人报酬的计提和支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配等行为的合法性、合规性进行监督和核查。

基金托管人发现基金管理人的违反《基金法》、《运作办法》、《基金合同》和有关基金法律法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对确认并以书面形式对基金托管人发出回函。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。

基金托管人发现基金管理人存在重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

## 五 相关服务机构

### (一) 销售机构

#### 1、申万巴黎基金管理有限公司直销中心

申万巴黎基金管理有限公司

注册地址：中国上海淮海中路 300 号 40 层

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 63353535

传真：+86 21 63353858

联系人：王伟

客户服务中心电话：+86 21 962299

#### 2、销售代理人

##### (1) 名称：中国工商银行股份有限公司

法定代表人：姜建清

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

联系人：田耕

电话：+86 10 66107900

传真：+86 10 66107914

##### (2) 申银万国证券股份有限公司

注册地址：上海市常熟路 171 号

法定代表人：谢平

电话：+86 21 54033888

传真：+86 21 54035333

联系人：胡洁静

客服电话：021-962505

公司网站：www.sw2000.com.cn

##### (3) 海通证券股份有限公司

地址：上海市淮海中路 98 号

法定代表人：王开国

电话：+ 86 21 53594566

联系人：金芸

客户服务热线：+ 86 21 962503 或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站：[www.htsec.com](http://www.htsec.com)

(4) 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：上海市延平路 135 号

法定代表人：祝幼一

联系人：芮敏祺

电话：021-62580818-213

传真：021-52610172

客户服务热线：4008886666

公司网站：[www.gtja.com](http://www.gtja.com)

(5) 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：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：黎晓宏

开放式基金咨询电话：400-8888-108

开放式基金业务传真：(010) 65182261

联系人：魏明

公司网站：[www.csc108.com](http://www.csc108.com)

(6) 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 39—45 层

法定代表人：宫少林

电话：+ 86 755 82943141

传真：+ 86 755 82943237

联系人：黄健

客户服务热线：4008881111、+ 86 755 26951111

公司网站： [www.newone.com.cn](http://www.newone.com.cn)

(7) 中国银河证券有限责任公司

注册地址：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：朱利

电话：+86 10 66568587

联系人：郭京华

公司网址：[www.chinastock.com.cn](http://www.chinastock.com.cn)

(8) 广发证券股份有限公司

注册地址：广东省珠海市吉大海滨路光大国际贸易中心 26 楼 2611 室

办公地址：广东广州天河北路大都会广场 36、38、41 和 42 楼

法定代表人：王志伟

联系人：肖中梅

开放式基金咨询电话：+86 20 87555888 转各营业网点

开放式基金业务传真：+86 20 87557985

公司网站：<http://www.gf.com.cn>

(9) 东方证券股份有限公司

注册地址：上海市浦东大道 720 号 20 楼

法定代表人：王益民

电话：+86 21 50367888

传真：+86 21 50366868

联系人：吴宇

**(二) 注册与过户登记人**

申万巴黎基金管理有限公司

注册地址：上海淮海中路 300 号，香港新世界大厦 40 层

法定代表人：姜国芳

电话：+86 21 63353535

传真：+86 21 63353858

联系人：秦谊

**(三) 律师事务所和经办律师**

律师事务所：通力律师事务所

注册地址：上海市浦东新区浦东南路 528 号，上海证券大厦南塔 21 楼

负责人：韩炯

电话：+86 21 68818100

传真：+86 21 68816880

经办律师：韩炯、秦悦民

**(四) 会计师事务所和经办注册会计师**

会计师事务所：德勤华永会计师事务所有限公司

注册地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

办公地址：上海市延安东路 222 号 30 楼

法定代表人：郑树成

电话：+86 21 63350202

传真：+86 21 63350003

联系人：陶坚

经办注册会计师：周华、陶坚

## 六 基金份额的申购和赎回

### (一) 基金投资者范围

个人投资者、机构投资者及合格境外机构投资者。

### (二) 申购和赎回场所

1、申万巴黎基金管理有限公司直销中心

2、各基金销售代理人开办开放式基金业务的营业网点，具体名单见本基金管理人公告。

基金管理人可以依据实际情况增加或在不对投资者的实质利益造成影响的前提下减少基金销售代理人或代销网点，并另行公告。

### (三) 申购和赎回的开放日及时间

1、本基金已于 2005 年 1 月 28 日起开始办理包括日常申购、赎回在内的日常交易业务。

2、申购和赎回的开放日为证券交易所交易日，开放日的具体业务办理时间为上海证券交易所、深圳证券交易所交易日的交易时间。目前，上海证券交易所、深圳证券交易所的交易时间为交易日上午 9:30-11:30，下午 1:00-3:00。投资者在《基金合同》约定的日期和时间之外提出申购、赎回或转换申请的，其基金份额申购、赎回价格为下次办理基金份额申购、赎回时间所在开放日的价格。

3、若出现新的证券交易市场或交易所交易时间更改或实际情况需要，基金管理人可对申购、赎回时间进行调整，但此项调整不应影响投资者利益造成实质影响并应报中国证监会备案，并在实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

### (四) 申购和赎回的原则

1、“未知价”原则，即申购、赎回价格以申请当日的基金份额净值为基准进行计算；

2、“金额申购、份额赎回”原则，即申购以金额申请，赎回以份额申请；

3、当日的申购和赎回申请可以在基金管理人规定的时间以前撤销。

4、基金管理人可根据基金运作的实际情况并在不影响投资者实质利益的前提下调整上述原

则。基金管理人必须在新规则开始实施 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

### **(五) 申购和赎回的程序**

#### **1、 申购和赎回的申请方式**

投资者必须根据基金销售机构规定的程序，在业务办理时间，向基金销售机构提出申购或赎回的申请。

投资者在申购本基金基金份额时须按销售机构规定的方式足额缴付申购资金，投资者在提交赎回申请时，其在销售机构（网点）必须有足够可用的基金份额余额，否则所提交的申购、赎回的申请无效而不予成交。

#### **2、 申购和赎回申请的确认**

在 T 日规定时间之前受理的申请正常情况下基金注册与过户登记人在 T+1 日内为投资者对该交易的有效性进行确认，投资者在 T+2 日后（包括该日）可向基金销售网点按照其规定的方式查询申购与赎回的成交情况。

#### **3、 申购和赎回的款项支付**

申购采用全额缴款方式，若申购资金在规定时间内未全额到账则申购不成功。若申购不成功或无效，申购款项将退回投资者账户。

投资者赎回申请成功后，基金管理人应指示基金托管人按有关规定将赎回款项在 T+7 日（包括该日）内向赎回人支付。在发生巨额赎回的情形时，款项的支付办法参照《基金合同》及本招募说明书的有关条款处理。

### **(六) 申购和赎回数额限制**

- 1、 每个基金账户首次申购的最低金额为人民币 1,000 元，每次追加申购的最低金额为 1,000 元；投资者当期分配的基金收益转购基金份额时，不受最低申购金额的限制；
- 2、 赎回的最低份额为 1,000 份基金份额，基金账户中基金份额不足 1,000 份的，应一次性赎回；
- 3、 基金管理人可以根据市场情况，在法律法规允许的情况下，调整上述申购金额和赎回份额的数量限制，基金管理人必须在调整日 3 个工作日前至少在一种中国证监会指定的信息披露

露媒体上刊登公告并报中国证监会备案；

### (七) 申购费率与赎回费率

本基金申购费用在申购时收取并由申购人承担，可用于本基金的市场推广、销售和注册与过户登记等各项费用。

基金管理人有权规定投资者在赎回基金份额时收取该部分基金份额的申购费用，具体办理规则和费率由基金管理人届时在公告或更新的招募说明书中明确后执行。

申购费率根据申购金额分段设定如下：

申购金额(元)	申购费率
100 万以下	1.5%
100 万(含)-500 万	1.2%
500 万(含) -1,000 万	0.75%
1,000 万(含) - 2,000 万	0.3%
2,000 万(含) 以上	每笔 2000 元

赎回费率按基金份额持有人持有该部分基金份额的时间分段设定如下：

持有时间	赎回费率
1 年以下	0.5%
1 年(含 1 年) 至 2 年	0.25%
2 年以上(含 2 年)	0%

基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申购费率和赎回费率在最新的招募说明书中列示。上述费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取，扣除赎回手续费后的余额归基金资产，赎回费归基金资产的部分为赎回费的 25%。

基金管理人可以在遵守法律法规及《基金合同》规定的条件下，根据市场情况制定基金促销计划。基金促销计划可以针对特定地域范围、特定行业、特定职业等的投资者或以特定交易方式（如网上交易、电话交易等）进行基金交易的投资者等开展。在基金促销活动期间，基金管理人可以对促销活动范围内的投资者调整基金申购费率。

### (八) 申购份额和赎回金额的计算方法

#### 1、基金申购份额的计算

本基金的申购金额包括申购费用和净申购金额。其中：

$$\text{申购费用} = \text{申购金额} \times \text{申购费率}$$

$$\text{净申购金额} = \text{申购金额} - \text{申购费用}$$

$$\text{申购份额} = \text{净申购金额} \div \text{申购申请当日的基金份额净值}$$

例一，某投资者投资追加 10,000 元申购本基金，对应费率为 1.5%，假设申购当日基金份额净值为 1.00 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 10,000 \times 1.5\% = 150 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000 - 150 = 9,850 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,850 \div 1.00 = 9,850 \text{ 份}$$

即：投资者追加投资 10,000 元申购本基金，假设申购当日基金份额净值为 1.00 元，则可得到 9,850 份基金份额。

例二，某投资者首次投资 10,000,000 元申购本基金，对应费率为 0.3%，假设申购当日基金份额净值为 1.00 元，则其可得到的申购份额为：

$$\text{申购费用} = 10,000,000 \times 0.3\% = 30,000 \text{ 元}$$

$$\text{净申购金额} = 10,000,000 - 30,000 = 9,970,000 \text{ 元}$$

$$\text{申购份额} = 9,970,000 \div 1.00 = 9,970,000 \text{ 份}$$

即：投资者投资 1,000 万元申购本基金，假设申购当日基金份额净值是 1.00 元，则可得到 9,970,000 份基金份额。

申购份额、余额的处理方式：申购的有效份额为按实际确认的申购金额在扣除相应的费用后，以当日基金份额净值为基准计算，计算结果保留 2 位小数，第 3 位小数四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支；

## 2、基金赎回金额的计算

$$\text{赎回费} = \text{赎回申请当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} \times \text{赎回费率}$$

$$\text{赎回金额} = \text{赎回申请当日基金份额净值} \times \text{赎回份额} - \text{赎回费}$$

例如，某投资者赎回本基金 10,000 份基金份额且持有时间不满 1 年，赎回费率为 0.5%，假设赎回申请当日基金份额净值是 1.00 元，则可得到的赎回金额为：

$$\text{赎回费用} = 10,000 \times 1.00 \times 0.5\% = 50 \text{ 元}$$

$$\text{赎回金额} = 10,000 - 50 = 9,950 \text{ 元}$$

即：投资者赎回本基金 10,000 份基金份额且持有时间不满 1 年，假设赎回当日基金份额净值是 1.00 元，则其可得到的赎回金额为 9,950 元。

赎回金额的处理方式：赎回金额为按实际确认的有效赎回份额以当日基金份额净值为基准计算并扣除相应的费用，计算结果保留 2 位小数，第 3 位小数四舍五入，由此产生的误差在基金资产中列支。

- 3、基金份额净值指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。T 日的基金份额净值在当天收市后计算，并在 T+1 日内公告。遇特殊情况，基金份额净值可以适当延迟计算或公告，并报中国证监会备案。

### **(九) 申购和赎回的注册与过户登记**

投资者申购基金份额成功后，注册与过户登记人在 T+1 日为投资者登记权益并办理注册与过户登记手续，投资者自 T+2 日（含该日）后有权赎回该部分基金份额。

投资者赎回基金份额成功后，注册与过户登记人在 T+1 日为投资者办理扣除权益的注册与过户登记手续。

基金管理人可以在法律法规允许的范围内，对上述注册与过户登记办理时间进行调整，但不得实质影响投资者的合法权益，并最迟于实施日 3 个工作日前在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登公告。

### **(十) 拒绝或暂停申购、赎回的情形及处理方式**

- 1、除出现如下情形，基金管理人不得拒绝或暂停基金投资者的申购申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致无法计算当日的基金资产净值；
- (3) 基金资产规模过大，使基金管理人无法找到合适的投资品种，或可能对基金业绩产生负面影响，从而损害现有基金份额持有人的利益；
- (4) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停申购的情形；
- (5) 基金管理人认为会有损于现有基金份额持有人利益的某笔申购；

发生上述（1）到（4）项暂停申购情形时，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告并备案。

2、除下列情形外，基金管理人不得拒绝接受或暂停基金投资者的赎回申请：

- (1) 不可抗力；
- (2) 证券交易场所交易时间非正常停市，导致无法计算当日基金资产净值；
- (3) 因市场剧烈波动或其它原因而出现连续巨额赎回，导致本基金的现金支付出现困难；
- (4) 法律法规规定或中国证监会认定的其它可暂停审核的情形。

发生上述情形之一的，基金管理人应在当日立即向中国证监会报告并备案。已接受的赎回申请，基金管理人将足额支付；如暂时不能支付的，可支付部分按每个赎回申请人已被接受的赎回申请量占已接受赎回申请总量的比例分配给赎回申请人，未支付部分由基金管理人按照发生的情况制定相应的处理办法在后续开放日予以支付。同时在出现上述第(3)款的情形时，对已接受的赎回申请可延期支付赎回款项，最长不超过正常支付时间 20 个工作日，并在中国证监会指定的信息披露媒体上公告。投资者在申请赎回时可事先选择将当日可能未获受理部分予以撤销。

- 3、发生《基金合同》、招募说明书中未予载明的重大事项，但基金管理人认为有正当理由认为需要暂停接受基金申购、赎回申请的，经报中国证监会核准后可以暂停接受投资者的申购、赎回申请。
- 4、在暂停申购或赎回的情况消除时，基金管理人应及时恢复申购或赎回业务的办理。
- 5、暂停或恢复基金的申购或赎回，基金管理人应及时在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

### (十一) 巨额赎回的情形及处理方式

#### 1、巨额赎回的认定

本基金单个开放日，基金净赎回申请（赎回申请份额总数加上基金转换中转出申请份额总数后扣除申购申请份额总数及基金转换中转入申请份额总数后的余额）超过上一日基金总份额的 10% 时，即认为发生了巨额赎回。

#### 2、巨额赎回的处理方式

当出现巨额赎回时，基金管理人可以根据本基金当时的资产组合状况决定全额赎回或部分顺延赎回。

- (1) 全额赎回：当基金管理人认为有能力支付投资者的赎回申请时，按正常赎回程序执

行。

- (2) 部分顺延赎回：当基金管理人认为支付投资者的赎回申请有困难或认为支付投资者的赎回申请可能会对基金的资产净值造成较大波动时，基金管理人在当日接受赎回比例不低于基金总份额的 10%的前提下，对其余赎回申请延期予以办理。对于当日的赎回申请，应当按单个账户赎回申请量占赎回申请总量的比例，确定当日受理的赎回份额；投资者未能赎回部分，投资者在提交赎回申请时可以选择延期赎回或取消赎回。选择延期赎回的，将自动转入下一个开放日继续赎回，直到全部赎回为止；选择取消赎回的，当日未获赎回的部分申请将被撤消。延期的赎回申请与下一开放日赎回申请一并处理，无优先权并以该开放日的基金份额净值为基础计算赎回金额。如投资者在提交赎回申请时未作明确选择，投资者未能赎回部分作自动延期赎回处理。

依照上述规定转入下一个开放日的赎回不享有赎回优先权并将以下一个开放日的基金份额净值为准进行计算，并以此类推，直到全部赎回为止。部分顺延赎回不受单笔赎回最低份额的限制。

- (3) 巨额赎回的公告：当发生巨额赎回并部分顺延赎回时，基金管理人应立即向中国证监会备案并在 2 日内通过中国证监会指定的信息披露媒体、基金管理人的公司网站或销售代理人的网点刊登公告，并说明有关处理方法。

### 3、连续巨额赎回的情形及处理方式

本基金连续两个开放日以上发生巨额赎回，如基金管理人认为有必要，可暂停接受赎回申请；已经接受的赎回申请可以延缓支付赎回款项，但不得超过正常支付时间 20 个工作日，并应当在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上进行公告。

## (十二) 重新开放申购或赎回的公告

如果发生暂停的时间为一天，第二个工作日基金管理人应在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告并公布最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过一天但少于两周，暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前一个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上刊登基金重新开放申购或赎回公告，并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

如果发生暂停的时间超过两周，暂停期间，基金管理人应每两周至少重复刊登暂停公告一次，当连续暂停时间超过两个月，可将重复刊登暂停公告的时间频率改为每月一次。暂停结束基金重新开放申购或赎回时，基金管理人应提前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体上连续刊登基金重新开放申购或赎回公告并在重新开放申购或赎回日公告最近一个工作日的基金份额净值。

## 七 基金的非交易过户、基金转换和冻结

### （一）非交易过户

非交易过户是指不采用申购、赎回等基金交易方式，将一定数量的基金份额按照一定规则从某一投资者基金账户转移到另一投资者基金账户的行为。基金注册与过户登记人只受理继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产、国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构清算、企业破产清算、司法执行等情况下的非交易过户。无论在上述何种情况下，接受划转的主体必须是适格的个人投资者或机构投资者或合格境外投资者。

“继承”指基金份额持有人死亡，其持有的基金份额由其合法的继承人继承；“捐赠”指基金份额持有人将其持有的基金份额捐赠给福利性质的基金会或其他社会团体；“遗赠”指基金份额持有人立遗嘱将其持有的基金份额赠给法定继承人以外的其他人；“自愿离婚”指原属夫妻共同财产的基金份额因基金份额持有人自愿离婚而使原在某一方名下的部分或全部基金份额划转至另一方名下；“分家析产”指原属家庭共有（如父子共有、兄弟共有等）的基金份额从某一家庭成员名下划转至其他家庭成员名下的行为；“国有资产无偿划转”指因管理体制变革、组织形式调整或资产重组等原因引起的作为国有资产的基金份额在不同国有产权主体之间的无偿转移；“机构合并或分立”指因机构的合并或分立而导致的基金份额的划转；“资产售卖”指一企业出售它的下属部门（独立部门、分支机构或生产线）的整体资产给另一企业的交易，在这种交易中，前者持有的基金份额随其他经营性资产一同转让给后者，由后者一并支付对价；“机构清算”是指机构因组织文件规定的期限届满或出现其他解散事由，或因其权力机关作出解散决议，或依法被责令关闭或撤销而导致解散，或因其他原因解散，从而进入清算程序（破产清算程序除外），清算组（或类似组织，下同）将该机构持有的基金份额分配给该机构的债权人以清偿债务，或将清偿债务后的剩余财产中的基金份额分配给机构的股东、成员、出资者或开办人；“企业破产清算”是指一企业法人根据《中华人民共和国企业破产法（试行）》或《中华人民共和国民事诉讼法》第十九章的有关规定被宣告破产，清算组依法将破产企业持有的基金份额直接分配给该破产企业的债权人所导致的基金份额的划转；“司法执行”是指根据生效法律文书，有履行义务的当事人（基金份额持有人）将其持有的基金份额依生效法律文书之规定主动过户给其他人，或法院依据生效法律文书将有履行义务的当事人（基金份额持有人）持有的基金份额强制划转给其他人。投资者办理因继承、捐赠、遗赠、自愿离婚、分家析产原因的非交易过户可到转出方的基金份额托管机构申请办理。投资者

办理因国有资产无偿划转、机构合并或分立、资产售卖、机构解散、企业破产、司法执行原因引起的非交易过户须到基金注册与过户登记人处办理。对于符合条件的非交易过户申请按《申万巴黎基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定办理。

## **(二) 基金的转换**

为方便基金份额持有人，未来在各项技术条件和准备完备的情况下，投资者可以选择在本基金和基金管理人旗下其他基金之间进行基金转换。基金转换的数额限制、转换费率等具体规定可以由基金管理人届时另行规定并公告。

## **(三) 基金的冻结**

基金注册与过户登记人只受理国家有权机关依法要求的基金账户或基金份额的冻结与解冻。基金账户或基金份额被冻结的，被冻结部分产生的权益一并冻结。

## **(四) 定期定额投资计划**

基金管理人可以为投资者办理定期定额投资计划，具体规则由基金管理人在届时发布公告或更新的招募说明书中确定。投资者在办理定期定额投资计划时可自行约定每期扣款金额，该等每期扣款金额必须不低于基金管理人在相关公告或更新的招募说明书中所规定的定期定额投资计划最低申购金额。

## **(五) 其他**

在不违反届时有效的法律法规的条件下，基金管理人可以开办基金份额的质押业务或其他非交易过户业务，并制订、修改和公布相应的业务规则。

## 八 基金的转托管

本基金目前实行份额托管的交易制度。投资者可将所持有的基金份额从一个交易账户转入另一个交易账户进行交易。

进行份额转托管时，投资者可以将其某个交易账户下的基金份额全部或部分转托管。办理转托管业务的基金份额持有人需在转出方办理基金份额转出手续，在转入方办理基金份额转入手续。对于有效的转托管申请，转出的基金份额将在投资者办理转托管转入手续后转入其指定的交易账户。具体办理方法参照《申万巴黎基金管理有限公司开放式基金业务规则》的有关规定以及基金销售代理人的业务规则。

## 九 基金的投资

### （一）基金投资目标

本基金为争取绝对收益概念的基金产品，其投资管理秉承本基金管理人的主动型投资管理模式。

本基金管理人以积极主动和深入的研究为基础结合先进的投资组合模型，通过灵活的动态资产配置和组合保险策略，尽最大努力规避证券市场投资的系统性和波动性风险以尽可能保护投资本金安全，并分享股市上涨带来的回报，实现最优化的风险调整后的投资收益为目标，但本基金管理人并不对投资本金进行保本承诺。

### （二）基金投资范围和投资对象

根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

具体投资对象将根据公司研究成果以及流动性分析，以优质债券与央行票据和具有优秀成长性和投资价值并具良好流动性的上市公司股票为主。

在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：固定收益证券55% - 100%，股票0% - 45%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述限定。法律法规另有规定时，从其规定。

### （三）投资理念

构成本基金管理人投资哲学的两个关键点为：

- (1) 在证券市场投资工具欠完备的情形下，动态资产配置与分散投资法是降低总体投资风险与取得合理投资回报的有效手段；
- (2) 采用风险管理工具监控和准确跟踪投资组合风险。

### （四）基金投资策略

本基金采用主动型投资管理模式，在积极主动和深入的宏观研究分析和判断的基础上，结合本基金管理人自主开发的主动式资产配置模型进行一级资产配置，以配置基金总资产在股票、固定

收益证券的比例；参考选时模型判断市场走势而决定是否调整投资组合或进行融资以适当扩大固定收益证券的投资规模以争取更好的收益，但以不超过基金资产净值的25%为限；采用基于投资组合保险策略开发的资产再平衡模型，控制整体投资组合的可能损失。

股票投资采用“行业配置”与“个股选择”双线并行的投资策略，由主动式行业矩阵模型确定行业配置，个股选择采取“自下而上”的选股过程，投资具有良好流动性的高成长性股票争取当期收益；固定收益证券投资使用利率预期策略、收益率曲线策略和久期策略进行组合管理。

本基金为追求绝对收益，以战胜一年期定期存款利率为投资目标的基金产品。因此，本基金的投资操作应以争取正的投资收益为首要目标；一年期定期存款利率是一个相对稳定的基准，在有效控制基金跟踪误差的大前提下，基金的收益风险特征将会呈现一个长期稳健增长的态势。由此，在本基金运作过程中，风险控制乃为实现投资目标之关键所在，基金管理人应在控制风险最小的前提下追求收益。

此外，将本基金定位为追求绝对收益的目的，是让基金管理人对资产配置有更大的主动权和灵活性。在投资的过程中，基金管理人必须严格遵循风险管理的限制，系统化地管理对各类资产的投资，特别是控制风险资产的投资进程。基金管理人将相对较大部分的基金资产投资于固定收益类证券，以获取相对稳定的利息收益，然后在市场形势有利的时候，再逐步加大对相对高风险、高收益的股票的的投资比例，以提高基金的收益，并应在适当的时机实现股票的投资收益。相反，在市场存在较大的下跌风险时，本基金可以全面回避风险资产的投资，而主要通过固定收益证券的投资获取一定的收益。

由于本基金将以基金年度为周期调整基准底线的风险控制水平并不间断地考察基金的投资绩效，在每个投资周期内，通过对固定收益证券和股票投资比例的动态调整，争取到本基金能够在承担较低风险的基础上获取高于银行存款利率的收益。

以数量化模型为基础的资产配置策略和严格的风险控制是本基金争取绝对收益的重要工具。灵活的主动式资产配置模型（AAAM）和选时模型（MTM）的合理应用是本基金提高收益的关键；而以投资组合保险技术和VAR值跟踪为基础的资产再平衡模型则是降低风险的关键。

#### **（五）投资程序**

本基金管理人的投资决策程序基本包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、构建备选池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估、信息反馈七个步骤。在本基金的投资管理过程中，这七个步骤的决策内容分配如下：

表 1：投资决策程序

	步骤名称	主要内容	负责人/部门
1	投资决策委员会决策	投资决策委员会是公司的最高投资决策层。对投资总监提交的投资策略和资产配置进行讨论，做出判断并形成决策报告，交由投资总监组织执行。	投资决策委员会
2	投资总监决策	投资总监根据基金经理和分析师的研究结果和建议，结合主动式资产配置模型提示的资产配置方案，拟定资产配置方案提交投资决策委员会批准，并负责贯彻执行已经形成决议的资产配置方案，同时负责在其授权范围内决定资产配置的调整。	投资总监
3	构建备选池	金融工程师负责建立股票池和固定收益证券备选池，以此作为深入研究的基础；就具体的投资工具和方法提出建议，与基金经理和分析师讨论如何完善量化模型。	金融工程师
4	研究个股和个券选择及确认资产配置	股票分析师根据投资总监下达的任务进行独立的研究工作，包括公司调研，建立财务模型及撰写投资报告等；固定收益分析师对宏观经济和利率变化趋势进行研究并撰写固定收益证券的投资建议报告。研究结果经投资会议讨论后达成结论，必要时做出修改并备案。	分析师
5	建立投资组合	基金经理根据投资总监下达的资产配置指令和投资会议作出的结论构建投资组合。在构建投资组合的过程中，基金经理必须严格遵守基金合同的投资限制及其他要求，同时其对组合调整的幅度必须在被授权的范围内进行。	基金经理
6	风险评估	风险管理委员会、监察稽核部和风险管理部执行监督、检查和风险评估等功能，并依风险评估结果建议投资部门调整投资组合以达到兼顾投资报酬及承受风险的最佳平衡点。	风险管理委员会 监察稽核部 风险管理部
7	信息反馈	基金经理与分析师根据有系统的公司调研、产业分析及宏观政策分析和风险管理部门不间断的绩效评估，适时反映最新信息并做出投资组合的及时调整，并向投资总监提交一级资产配置的调整建议。	基金经理 分析师 风险管理部

## （六）业绩基准

本基金定位于一个以绝对报酬率评估投资业绩的混合型基金，以争取超越同期银行一年期存款利率的收益为目标。

## （七）风险管理

本基金强调追求风险调整后的收益，这是本基金区别其他股票型基金的最大特点。因此，本基金管理人在进行主动型投资管理的过程中，将尤为关注风险管理。本基金管理人结合了外方股东法国巴黎资产管理公司的风险控制体系和中方股东申银万国证券股份有限公司的风险管理经验，根据国际化标准建立了完善的内部控制制度，严格规范投资流程，并引入了先进的投资风险管理和控制技术。

在内部控制制度方面，本基金管理人本着健全性、有效性、独立性、相互制约和成本效益原则，设立风险管理委员会、督察长、监察稽核部和专门的风险管理部，并由精通投资组合管理的专业人士全过程实施投资风险管理。

本基金管理人的投资决策程序基本包括：投资决策委员会决策、投资总监决策、构建股票池、研究选股及确认资产配置、建立投资组合、风险评估、信息反馈七个步骤，风险管理和控制渗透在其中的每一个步骤。

在投资风险控制技术方面，本基金的管理引入外方股东法国巴黎资产管理公司的技术，对整个投资过程，从投资组合的资产配置、行业配置到选股，都有不同的风险指标做全程紧密监控。

为体现本基金管理人把保护投资者利益放在首位，致力于为投资者创造更高的价值，设身处地的从投资者角度控制投资风险，以认真、积极、专业的精神与态度管理本基金，特设定本基金投资的基准底线，基金管理人应当在投资管理中利用基于投资组合保险策略和VAR值跟踪的资产再平衡模型控制基金的投资风险，以争取达到本基金的基金份额净值不能低于基准底线值的风险控制目标。

## （八）投资限制

- 1、基金管理人应依据有关法律法规及《基金合同》规定，运作管理本基金，本基金投资组合应遵循下列规定：

- (1) 本基金持有 1 家上市公司股票的市值，不超过本基金资产净值的 10%；
  - (2) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有 1 家公司发行的证券的总和，不超过该证券的 10%；
  - (3) 基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过基金总资产，本基金申报的股票数量不得超过拟发行股票的总量；
  - (4) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长时间为 1 年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
  - (5) 不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
  - (6) 中国证监会规定的其它比例限制；
  - (7) 上述比例受限于法律法规的不时修改和中国证监会不时颁布的规范性文件的规定。
- 2、禁止用本基金资产从事以下行为：
- (1) 承销证券；
  - (2) 向他人贷款或者提供担保；
  - (3) 从事承担无限责任的投资；
  - (4) 买卖其他基金份额，但是国务院另有规定的除外；
  - (5) 向基金管理人、基金托管人出资或者买卖其基金管理人、基金托管人发行的股票或者债券；
  - (6) 买卖与基金管理人及托管人有控股关系的股东或者与基金管理人、基金托管人有其他重大利害关系的公司发行的证券或承销期内承销的证券；
  - (7) 从事内幕交易、操纵证券市场交易价格及其他不正当的证券交易活动；
  - (8) 届时有效的法律法规、中国证监会及《基金合同》规定禁止从事的其他行为。

#### **(九) 基金管理人代表基金份额持有人利益行使股东权利的处理原则及方法**

- 1、不谋求对上市公司的控股，不参与所投资上市公司的经营管理；
- 2、有利于基金资产的安全与增值；
- 3、基金管理人按照法律法规的有关规定代表基金独立行使股东权利，保护基金投资者的利益。

**(十) 基金的融资**

本基金的融资应当按照届时有效的法律法规的规定进行。

在法律法规允许的前提下,本基金融入资金再投资于固定收益证券的最大比例为基金资产净值的25%。

**(十一) 基金投资组合报告**

本投资组合报告所载数据截止日为 2006 年 9 月 30 日,本报告中所列财务数据未经审计。

## 1. 期末基金资产组合：

	市 值 (元)	占总资产比例
股票	31,398,078.23	20.16%
债券	66,215,792.69	42.51%
权证	117,230.00	0.08%
银行存款和清算备付金	30,194,396.92	19.38%
其他资产	27,851,766.61	17.88%
合 计	155,777,264.45	100.00%

## 2. 期末股票投资组合：

序号	分 类	市 值 (元)	占净值比例
A	农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B	采掘业	6,111,000.00	3.99%
C	制造业	18,051,799.46	11.78%
C0	其中：食品、饮料	1,250,000.00	0.82%
C1	纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2	木材、家具	0.00	0.00%
C3	造纸、印刷	0.00	0.00%
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,022,623.91	1.97%
C5	电子	1,533,196.55	1.00%
C6	金属、非金属	1,881,000.00	1.23%
C7	机械、设备、仪表	9,245,686.08	6.03%

C8	医药、生物制品	0.00	0.00%
C99	其他	1,119,292.92	0.73%
D	电力、煤气及水的生产和供应业	0.00	0.00%
E	建筑业	0.00	0.00%
F	交通运输、仓储业	1,598,000.00	1.04%
G	信息技术业	2,324,570.67	1.52%
H	批发和零售贸易	1,589,980.00	1.04%
I	金融、保险业	1,570,328.10	1.02%
J	房地产业	152,400.00	0.10%
K	社会服务业	0.00	0.00%
L	传播与文化产业	0.00	0.00%
M	综合类	0.00	0.00%
合 计		31,398,078.23	20.48%

## 3. 期末前十名股票明细：

序号	股票代码	股票名称	数量	市值(元)	占净值比例
1	600028	中国石化	900,000	6,111,000.00	3.99%
2	000400	许继电气	300,000	3,201,000.00	2.09%
3	000063	中兴通讯	72,711	2,324,570.67	1.52%
4	600026	中海发展	200,000	1,598,000.00	1.04%
5	600327	大厦股份	277,000	1,589,980.00	1.04%
6	601988	中国银行	471,570	1,570,328.10	1.02%
7	600585	海螺水泥	100,000	1,550,000.00	1.01%
8	000777	中核科技	174,342	1,549,900.38	1.01%
9	600879	火箭股份	100,000	1,412,000.00	0.92%
10	600495	晋西车轴	100,000	1,402,000.00	0.91%

## 4. 期末债券投资组合：

券种	市值(元)	占净值比例
----	-------	-------

国家债券	26,856,651.60	17.52%
央行票据	39,231,261.09	25.59%
可转换债券	127,880.00	0.08%
合 计	66,215,792.69	43.20%

## 5. 期末前五名债券明细：

序号	债券名称	市 值 ( 元 )	占净值比例
1	20 国债	26,856,651.60	17.52%
2	06 央票 02	19,626,975.34	12.80%
3	05 央票 117	19,604,285.75	12.79%
4	招商转债	127,880.00	0.08%
5	-	-	-

## 6. 投资组合报告附注：

(1) 本报告期内，基金投资的前十名证券的发行主体无被监管部门立案调查，或受到公开谴责、处罚的。

(2) 基金投资的前十名股票中，无超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

(3) 其他资产的构成：

	市 值 ( 元 )
深交所交易保证金	332,769.33
权证保证金	98,780.49
应收证券清算款	2,208,977.42
应收利息	1,210,254.37
应收申购款	985.00
买入返售证券	24,000,000.00
合 计	27,851,766.61

(4) 基金持有的处于转股期的可转换债券明细：无。

(5) 基金主动投资权证交易情况：

序号	日期	权证代码	权证名称	交易方向	交易数量	交易金额
1	2006-7-5	580005	万华 HXB1	买入	50,000	614,489.51
2	2006-8-2	580005	万华 HXB1	卖出	40,000	416,138.15

## 十 基金的业绩

本基金的过往业绩不代表未来表现。

1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较（数据截止时间 2006 年 9 月 30 日）：

阶段	基金份额 净值增长 率	基金份额 净值增长 率标准差	业绩比较 基准收益 率	业绩比较 基准收益 率标准差	-	-
2004 年 11 月 29 日(基 金合同生效日)至 2005 年 12 月 31 日	-1.44%	0.24%	2.45%	0	-3.89%	0.24%
2006 年 1 月 1 日至 2006 年 9 月 30 日	11.06%	0.39%	1.71%	0	9.35%	0.39%
基金合同生效日至 2006 年 9 月 30 日	9.46%	0.31%	4.17%	0	5.29%	0.31%

注：上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金的各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

2. 自《基金合同》生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准的变动比较。

申万巴黎盛利配置基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比



注：

1). 根据本基金基金合同，在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：固定收益证券 55% - 100%（含不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券），股票 0% - 45%。在本基金合同生效后六个月内，达到上述比例限制。

2). 本基金的上述业绩表现数据已经过基金托管人的复核。

## 十一 基金财产

### （一）基金财产的构成

基金财产的构成主要有：

- 1、银行存款及其应计利息；
- 2、根据有关规定缴纳的保证金；
- 3、应收证券交易清算款；
- 4、应收申购款；
- 5、股票投资及其估值调整；
- 6、债券投资及其估值调整和应计利息；
- 7、其它投资及其估值调整；
- 8、其它财产等。

### （二）基金资产总值与基金资产净值

基金资产总值是指基金财产的总价值，是基金通过发售基金份额方式募集资金，并进行证券投资等交易所形成的各类资产的价值总和。

基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。

基金资产净值的构成主要有：

- 1、基金份额持有人认购、申购基金份额（扣除认购和申购费用后）所支付的款项；
- 2、运用基金资产所获得的（已实现的和尚未实现的）收益（亏损）；
- 3、以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发行在外的基金份额总数。

### （三）基金财产的账户

本基金以基金托管人的名义开立资金结算账户和托管专户用于基金的资金结算业务，并以基金托管人和“申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金”联名的方式开立基金证券账户、以“申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金”的名义开立银行间债券托管账户并报中国人民银行备案。开立的基金专用账户与基金管理人、基金托管人、基金销售代理人 and 基金注册与过户登记人

自有的财产账户以及其他基金财产账户相独立。

#### **（四）基金财产的保管和处分**

本基金的基金财产独立于基金管理人、基金托管人、基金注册与过户登记人和基金销售代理人的财产，并由基金托管人保管。基金管理人、基金托管人、基金注册与过户登记人和基金销售代理人以其自有的财产承担其自身的法律责任，其债权人不得对本基金的基金财产行使请求冻结、扣押或其它权利。

基金管理人、基金托管人因基金财产的管理、运用或者其他情形而取得的财产和收益，归入基金财产。

除法律法规和《基金合同》的规定处分外，基金财产不得被处分。

## 十二 基金资产估值

### （一）估值目的

基金资产估值的目的是客观、准确地反映基金资产的价值，依据经基金资产估值后确定的基金资产净值而计算出的基金份额净值，是计算基金申购与赎回价格的基础。

### （二）估值日

本基金的估值日为相关的证券交易所的正常营业日。

### （三）估值方法

本基金按以下方式进行估值：

#### 1、已上市流通的有价证券的估值

（1）上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

（2）在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

A、实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

B、未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

#### 2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

（1）送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

（2）首次公开发行的股票，按成本估值；

（3）未上市债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

#### 3、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按估值日市价高于配股价的差额估值；收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

- 4、股权分置改革所获得的权证，未上市的权证采用经中国证券监督管理委员会许可的外部独立估值结果为其公允价值；已上市的权证以估值日市价（收盘价）估值，该日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。
- 5、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。
- 6、如有新增事项，按国家最新规定估值。

根据有关法律法规，开放式基金的基金会计责任方由基金管理人担任。因此，就与本基金有关的会计问题，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一致的意见，按照基金管理人对于基金资产净值的计算结果对外予以公布。

#### **（四）估值对象**

基金所持有的股票、债券、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产。

#### **（五）估值程序**

基金日常估值由基金管理人进行。基金资产净值由基金管理人完成估值后，将估值结果加盖业务公章以书面形式传真至基金托管人，基金托管人按法律法规、《基金合同》规定的估值方法、时间、程序进行复核；基金托管人复核无误后加盖业务公章返回给基金管理人；月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

#### **（六）估值错误的处理**

基金份额净值的计算采用四舍五入的方法保留小数点后四位，法律法规另有规定的从其规定。

基金管理人和基金托管人应当采取必要、适当、合理的措施确保基金资产估值的准确性和及时性。

当基金估值出现错误时，基金管理人应当立即纠正，并采取合理的措施防止损失进一步扩大；估值错误偏差达到基金资产净值的 0.5% 时，基金管理人应当在 2 日内公告并报中国证监会备案。

因基金估值错误给投资者造成损失的应先从基金管理人承担，基金管理人对其不应由其承担的责任，有权向过错人追偿。《基金合同》的当事人应将按照以下约定处理：

##### **1、差错类型**

本基金运作过程中，如果由于基金管理人或基金托管人、或注册与过户登记人、或销售代理人、或投资者自身的过错造成差错，导致其它当事人遭受损失的，过错的责任人应当对由于该差错遭受损失的当事人（“受损方”）按下述“差错处理原则”给予赔偿承担赔偿责任。

上述差错的主要类型包括但不限于：资料申报差错、数据传输差错、数据计算差错、系统故障差错、下达指令差错等；对于因技术原因引起的差错，若系同行业现有技术水平无法预见、无法避免、无法抗拒，则属不可抗力，按照下述规定执行。

由于不可抗力原因造成投资者的交易资料灭失或被错误处理或造成其它差错，因不可抗力原因出现差错的当事人不对其它当事人承担赔偿责任，但因该差错取得不当得利的当事人仍应负有返还不当得利的义务。

## 2、差错处理原则

- (1) 差错已发生，但尚未给当事人造成损失时，差错责任方应及时协调各方，及时进行更正，因更正差错发生的费用由差错责任方承担；由于差错责任方未及时更正已产生的差错，给当事人造成损失的由差错责任方承担；若差错责任方已经积极协调，并且有协助义务的当事人有足够的时间进行更正而未更正，则其应当承担相应赔偿责任。差错责任方应对更正的情况向有关当事人进行确认，确保差错已得到更正。
- (2) 差错的责任方对可能导致有关当事人的直接损失负责，不对间接损失负责，并且仅对差错的有关直接当事人负责，不对第三方负责；
- (3) 因差错而获得不当得利的当事人负有及时返还不当得利的义务。但差错责任方仍应对差错负责，如果由于获得不当得利的当事人不返还或不全部返还不当得利造成其它当事人的利益损失（“受损方”），则差错责任方应赔偿受损方的损失，并在其支付的赔偿金额的范围内对获得不当得利的当事人享有要求交付不当得利的权利；如果获得不当得利的当事人已经将此部分不当得利返还给受损方，则受损方应当将其已经获得的赔偿额加上已经获得的不当得利返还的总和超过其实际损失的差额部分支付给差错责任方。
- (4) 差错调整采用尽量恢复至假设未发生差错的正确情形的方式。
- (5) 差错责任方拒绝进行赔偿时，如果因基金管理人过错造成基金资产损失时，基金托管人应为基金的利益向基金管理人追偿，如果因基金托管人过错造成基金资产损失

时，基金管理人应为基金的利益向基金托管人追偿。除基金管理人和托管人之外的第三方造成基金资产的损失，并拒绝进行赔偿时，由基金管理人负责向差错方追偿。

(6) 如果出现差错的当事人未按规定对受损方进行赔偿，并且依据法律、行政法规、《基金合同》或其它规定，基金管理人自行或依据法院判决、仲裁裁决对受损方承担了赔偿责任，则基金管理人有权向出现过错的当事人进行追索，并有权要求其赔偿或补偿由此发生的费用和遭受的损失。

(7) 按法律法规规定的其它原则处理差错。

### 3、差错处理程序

差错被发现后，有关的当事人应当及时进行处理，处理的程序如下：

- (1) 查明差错发生的原因，列明所有的当事人，并根据差错发生的原因确定差错的责任方；
- (2) 根据差错处理原则或当事人协商的方法对因差错造成的损失进行评估；
- (3) 根据差错处理原则或当事人协商的方法由差错的责任方进行更正和赔偿损失；
- (4) 根据差错处理的方法，需要修改基金注册与过户登记人的交易数据的，由基金注册与过户登记人进行更正，并就差错的更正向有关当事人进行确认；
- (5) 基金管理人及基金托管人基金资产净值计算错误偏差达到基金资产净值 0.5% 时，基金管理人应当通报基金托管人并报中国证监会备案。

### (七) 暂停估值的情形

- 1、与本基金投资有关的证券交易场所遇法定节假日或因其它原因暂停营业时；
- 2、因不可抗力或其它情形致使基金管理人无法准确评估基金资产价值时。

### (八) 特殊情形的处理

- 1、基金管理人按估值方法的第5条中的方法进行估值时，所造成的误差不作为基金份额净值错误处理；
- 2、由于证券交易所及其登记结算公司发送的数据错误，或由于其他不可抗力原因，基金管理人和基金托管人虽然已经采取必要、适当、合理的措施进行检查，但是未能发现该错误的，由此造成的基金资产估值错误，基金管理人和基金托管人可以免除赔偿责任。但基金管理

人应当积极采取必要的措施消除由此造成的影响。

## 十三 基金收益分配

### （一）基金收益的构成

基金收益包括：基金投资所得红利、股息、债券利息、票据投资收益、买卖证券差价、银行存款利息以及其它收入。因运用基金资产带来的成本或费用的节约计入收益。

### （二）基金净收益

基金净收益为基金收益扣除按照有关规定可以在基金收益中扣除的费用后的余额。

### （三）基金收益分配原则

- 1、 单次分红不低于此次基金可分配收益的50%；每基金年度累计分配的收益不得低于该基金年度基金可分配收益的80%；
- 2、 本基金收益分配方式分两种：现金红利与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，则以现金红利方式分配收益；
- 3、 当符合基金分红条件时，每基金年度至少分红一次，至多分红四次；
- 4、 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、 基金收益分配后每基金份额净值不能低于面值；
- 6、 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、 每一基金份额享有同等分配权；
- 8、 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### （四）收益分配方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

### （五）收益分配方案的确定、公告与实施

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后

2 日内公告。

#### **(六) 基金收益分配中发生的费用**

- 1、 红利分配采用再投资方式免收再投资的费用；采用现金红利方式， 则可从现金红利中提取一定的数额或者一定的比例用于支付注册与过户登记作业手续费， 如收取该项费用， 具体提取标准和方法在相关公告中规定。
- 2、 收益分配时所发生的银行转账或其他手续费用由投资者自行承担。当投资者的现金红利小于一定金额， 不足于支付银行转账或其他手续费用时， 基金注册与过户登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额。

## 十四 基金的费用与税收

### (一) 与基金运作有关的费用

#### 1、与基金运作有关的费用的种类：

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 投资交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定执行；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### 2、基金管理人的管理费计提方法、计提标准和支付方式

基金管理费按前一日基金资产净值的 1.2% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 3、基金托管人的托管费计提方法、计提标准和支付方式

基金托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数，其中：}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支

付给基金托管人，若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

## （二）与基金销售有关的费用

### 1、 申购费用

本基金申购费用在申购时收取并由申购人承担，

基金管理人有权规定投资者在赎回基金份额时收取该部分基金份额的申购费用，具体办理规则和费率由基金管理人届时在公告或更新的招募说明书中明确后执行。

申购费率为最高不超过 1.5%，按申购金额分段设定如下：

申购金额（元）	申购费率
100 万以下	1.5%
100 万（含）-500 万	1.2%
500 万（含）-1,000 万	0.75%
1,000 万（含）-2,000 万	0.3%
2,000 万（含）以上	每笔 2000 元

### 2、 赎回费用

赎回费率为最高不超过 0.5%，按持有时间分段设定如下：

持有时间	赎回费率
1 年以下	0.5%
1 年（含 1 年）至 2 年	0.25%
2 年以上（含 2 年）	0%

### 3、 费率调整

基金管理人可以在《基金合同》规定的范围内调整申购费率和赎回费率，调整后的申购费率和赎回费率在最新的招募说明书中列示。基金管理人调低费率需与基金托管人协商一致并经相关部门批准之后，酌情调整。上述费率如发生变更，基金管理人最迟应于新的费率实施前 3 个工作日在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。本基金的赎回费在投资者赎回基金份额时收取，扣除赎回手续费后的余额归基金资产，赎回费归基金资产的部分为赎回费的 25%。

## （三）不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失，以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。《基金合同》生效前的相关费用，包括

但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

#### **(四) 费用调整**

基金管理人和基金托管人可磋商酌情调低基金管理费和基金托管费,此项调整不需要基金份额持有人大会决议通过。

#### **(五) 基金的税收**

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体,其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

## 十五 基金的会计和审计

### (一) 基金会计政策

- 1、基金管理人为本基金的基金会计责任方；
- 2、基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日；基金首次募集的会计年度按如下原则：如果《基金合同》生效少于3个月，并入下一个会计年度；
- 3、基金的会计核算以人民币为记帐本位币，记帐单位是人民币元；
- 4、会计制度执行国家有关的会计制度；
- 5、本基金独立建帐、独立核算；
- 6、基金管理人及基金托管人各自保留完整的基金会计帐目、凭证（原始凭证由托管行保管）并进行日常的会计核算，按照有关规定编制基金会计报表；
- 7、基金托管人每月与基金管理人就基金的会计核算、报表编制等进行核对并以书面方式确认。

### (二) 基金的年度审计

- 1、本基金管理人聘请具有证券从业资格的德勤华永会计师事务所有限公司及其注册会计师对本基金的年度财务报表进行审计。

### (三) 会计师事务所的更换程序

- 1、会计师事务所更换经办注册会计师，应事先征得基金管理人和基金托管人同意，并报中国证监会备案。
- 2、基金管理人（或基金托管人）认为有充足理由更换会计师事务所，须经基金托管人（或基金管理人）同意，并报中国证监会备案后可以更换。更换会计师事务所在2日内公告。

## 十六 基金的信息披露

本基金的信息披露将严格按照《基金法》、《运作办法》、《信息披露办法》的规定和中国证监会颁布的有关证券投资基金信息披露内容与格式的相关文件、《基金合同》和其他有关规定进行。本基金的信息披露事项将至少在中国证监会指定的一种媒体上公告。

### （一）定期报告

本基金定期报告由基金管理人和基金托管人按照有关证券投资基金信息披露的法规编制,包括年度报告、半年度报告、季度报告、基金资产净值公告及更新的招募说明书,并在指定媒体公告,同时报中国证监会备案或核准。

年度报告:经注册会计师审计后在本基金会会计年度结束后的90日内公告。

中期报告:在本基金会会计年度前6个月结束后的60日内公告。

季度报告:每季度公告一次,于截止日后15个工作日内公告。

基金份额净值公告:每开放日的次日披露该开放日本基金的基金份额净值和基金份额累计净值。

### （二）更新招募说明书

《基金合同》生效后,按有关规定于每6个月结束之日起45日内编制更新的招募说明书,更新的招募说明书于公告的15日前向中国证监会报送,并按规定在指定媒体公告。

### （三）临时报告与公告

基金在运作过程中发生下列可能对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的事项之一时,信息披露义务人应按照法律、法规及中国证监会的有关规定及时报告并公告。

- 1、基金份额持有人大会的召开;
- 2、提前终止基金合同;
- 3、基金扩募;
- 4、延长基金合同期限;
- 5、转换基金运作方式;
- 6、更换基金管理人、基金托管人;
- 7、基金管理人、基金托管人的法定名称、住所发生变更;
- 8、基金管理人股东及其出资比例发生变更;

9、基金募集期延长；

10、基金管理人的董事长、总经理及其他高级管理人员、基金经理和基金托管人基金托管部门负责人发生变动；

11、基金管理人的董事在一年内变更超过百分之50%；

12、基金管理人、基金托管人基金托管部门的主要业务人员在一年内变动超过30%；

13、涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼；

14、基金管理人、基金托管人受到监管部门的调查；

15、基金管理人及其董事、总经理及其他高级管理人员、基金经理受到严重行政处罚,基金托管人及其基金托管部门负责人受到严重行政处罚；

16、重大关联交易事项；

17、基金收益分配事项；

18、管理费、托管费等费用计提标准、计提方式和费率发生变更；

19、基金份额净值计价错误达基金份额净值百分之零点五；

20、基金改聘会计师事务所；

21、变更基金份额发售机构；

22、基金更换注册与过户登记机构；

23、开放式基金开始办理申购、赎回；

24、基金申购、赎回费率及其收费方式发生变更；

25、基金发生巨额赎回并延期支付；

26、基金连续发生巨额赎回并暂停接受赎回申请；

27、基金暂停接受申购、赎回申请后重新接受申购、赎回；

28、其他事项。

#### **(四) 信息披露文件的存放与查阅**

《基金合同》、本招募说明书、《申万巴黎基金管理有限公司开放式基金业务规则》文本存放在基金管理人、基金托管人和基金销售网点的营业场所，投资者可在营业时间免费查阅。在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件复印件。投资者也可以直接登录基金管理人的网站进行查阅。对投资者按上述方式所获得的文件及其复印件，基金管理人和基金托管人应保证与所公告的内容完全一致。

## 十七 风险揭示

本基金面临的风险主要有：市场风险、流动性风险、政策风险、信用风险、道德风险、营运风险、管理风险和其他风险。

### （一）市场风险

指金融工具或证券的价值对市场参数变化的敏感性,是基金资产运作中所不可避免地承受因市场任何波动而产生的风险；其中包括:

经济周期风险：市场的收益水平随经济运行的周期性变动而变动，基金所投资于国债与上市公司股票的收益水平也会随之变化，从而产生风险；

利率风险：金融市场利率波动会导致证券市场价格和收益率的变动，直接影响基金所投资的国债与股票的价格和收益率，从而给基金的投资带来风险；

上市公司经营风险：如果基金所投资的上市公司经营不善，会导致其股票价格的下跌，或股息、红利减少，使基金投资收益下降，从而给基金的投资带来风险；

购买力风险：基金的收益主要通过现金的形式来分配，而现金可能因为通货膨胀影响而使购买力下降，从而使基金的实际投资收益下降。

### （二）流动性风险

流动性风险包括两类。一是指在市场中的投资操作由于市场的深度限制或由于市场剧烈波动而导致投资交易无法实现或不能以当前合理的价格实现，从而可能为基金带来投资损失的风险。二是指开放式基金由于申购赎回要求可能导致流动资金不足的风险。

### （三）政策风险

指政府各种经济和非经济政策的变化给公司所管理的基金资产带来的风险；政策风险包括：货币政策的变动、财政政策的波动、税收政策的变动、产业政策的变动、进出口政策的变动等政策的变动引发的市场价格变动，对公司所管理的基金资产带来的风险。

#### **(四) 信用风险**

基金在交易过程中可能发生交收违约或者所投资债券的发行人违约、拒绝支付到期本息等情况，从而导致基金资产损失。

#### **(五) 道德风险**

是由员工之行为违反法律法规、监管部门之规定及公认的道德标准，损害客户或公司利益所造成的风险。

#### **(六) 营运风险**

指由于公司组织结构不健全，内部管理的漏洞与人为失误所蕴藏的风险。营运风险可以分内在和外在外在风险两方面。

内在风险包括因人员、系统和程序而衍生的风险如人为错失、犯法行为、未授权活动、人员损失等操作风险、技术风险、系统稳定安装等风险和决策及程序风险；

外在风险主要因其他风险如法规、法律、公共责任等产生的营运风险。

#### **(七) 管理风险**

基金管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响基金的投资收益水平。同时，基金管理人的投资管理制度、风险管理和内部控制制度是否健全，能否有效防范道德风险和其他合规性风险，以及基金管理人的职业道德水平等，也会对基金的风险收益水平造成影响。

#### **(八) 其他风险**

- 1、因金融市场危机、行业竞争压力可能产生的风险；
- 2、战争、自然灾害等不可抗力因素的出现，可能严重影响证券市场运行，导致基金资产损失；和其他意外导致的风险。

## 十八 基金合同的终止与基金财产的清算

### (一)《基金合同》的终止

有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- 1、存续期间内，基金份额持有人数量连续60个工作日达不到200人，或连续60个工作日基金资产净值低于人民币5,000万元，基金管理人将宣布《基金合同》终止；
- 2、《基金合同》经份额持有人大会表决终止的；
- 3、因重大违法、违规行为，《基金合同》被中国证监会责令终止的；
- 4、基金管理人职责终止，而在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- 5、基金托管人职责终止，而六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- 6、中国证监会规定的其它情况。

### (二) 基金财产清算

- 1、基金财产清算组：自出现《基金合同》终止事由之日起30个工作日内成立基金财产清算组，基金管理人组织基金财产清算组并在中国证监会的监督下进行基金财产清算。
- 2、基金财产清算组组成：基金财产清算组成员由基金管理人、基金托管人、具有从事证券相关业务资格的注册会计师、律师组成。基金财产清算组可以聘用必要的工作人员。
- 3、基金财产清算组职责：基金财产清算组负责基金资产的保管、清理、估价、变现和分配。基金财产清算组可以依法以自己的名义进行必要的民事活动。

### (三) 基金财产清算程序

- 1、《基金合同》终止后，由基金财产清算组统一接管基金资产；
- 2、对基金资产和债权债务进行清理和确认；
- 3、对基金资产进行估值和变现；
- 4、对基金资产进行分配；
- 5、制作基金财产清算报告；
- 6、聘请会计师事务所对基金财产清算报告进行外部审计，聘请律师事务所对基金财产清算报告出具法律意见书；

7、将基金财产清算报告报中国证监会备案并公告。

#### **(四) 基金财产清算费用**

基金财产清算费用是指基金财产清算组在进行基金财产清算过程中发生的所有合理费用,基金财产清算费用由基金财产清算组优先从基金资产中支付。

#### **(五) 基金剩余资产的分配**

基金财产清算后的全部剩余资产由基金份额持有人按持有的基金份额比例进行分配。

#### **(六) 基金财产清算的公告**

基金财产清算报告报中国证监会备案后5个工作日内由基金财产清算组公告;基金财产清算过程中的有关重大事项须及时公告。

#### **(七) 清算账册及文件的保存**

基金财产清算账册及有关文件由基金托管人保存15年以上。

## 十九 基金合同内容摘要

### （一）前言

《基金合同》是规定《基金合同》当事人之间权利义务的基本法律文件，其他与本基金相关的涉及《基金合同》当事人之间权利义务关系的任何文件或表述，均以《基金合同》为准。《基金合同》的当事人包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人。基金投资者自取得依《基金合同》所发行的基金份额，即成为基金份额持有人和《基金合同》的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对《基金合同》的承认和接受。《基金合同》的当事人按照法律法规和《基金合同》的规定享有权利，同时需承担相应的义务。

基金管理人保证恪尽职守，并将按照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但由于证券投资具有一定的风险，因此不保证本基金一定盈利，也不保证基金份额持有人的最低收益。

基金管理人和基金托管人在《基金合同》之外披露的涉及本基金的信息，其内容涉及界定《基金合同》当事人之间权利义务关系的，以《基金合同》的规定为准。

### （二）基金合同当事人的权利和义务

- 1、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的权利包括但不限于：
  - （1） 依法募集基金，办理基金备案手续；
  - （2） 自《基金合同》生效日起，根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金资产；
  - （3） 依据《基金合同》获得基金认购和申购费用、基金赎回手续费以及基金管理费等其他法律法规规定的费用；
  - （4） 销售基金份额；
  - （5） 担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册与过户登记人办理基金注册与过户登记业务并获得《基金合同》规定的费用；
  - （6） 依据《基金合同》及有关法律法规规定监督基金托管人，如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
  - （7） 在基金托管人更换时，提名新的基金托管人；
  - （8） 选择、委托、更换基金销售代理人，对基金销售代理人的相关行为进行监督和处理。

如认为基金销售代理人违反本《基金合同》、基金销售与服务代理协议及国家有关法律法规规定，应呈报中国证监会和其它监管部门，并采取必要措施保护基金投资者的利益；

- (9) 依据本《基金合同》及有关法律法规规定决定基金收益的分配方案；
  - (10) 在《基金合同》约定的范围内，拒绝或暂停受理申购与赎回申请；
  - (11) 在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下，制订和调整开放式基金业务规则，决定基金的除托管费率之外的相关费率结构和收费方式；
  - (12) 依据法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利，为基金的利益行使基金所投资的证券项下的权利；
  - (13) 在法律法规允许的前提下，为基金的利益依法为基金进行融资；
  - (14) 以基金管理人的名义，代表基金份额持有人的利益行使诉讼权利或者实施其他法律行为；
  - (15) 选择、更换律师、审计师、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构；
  - (16) 法律法规和《基金合同》规定的其它权利。
- 2、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金管理人的义务包括但不限于：
- (1) 依法募集基金，办理基金备案手续；
  - (2) 自《基金合同》生效之日起，以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产；
  - (3) 配备足够的具有专业资格的人员进行基金投资分析、决策，以专业化的经营方式管理和运作基金资产；
  - (4) 配备足够的专业人员办理基金份额的认购、申购与赎回业务或委托符合条件的其它机构代理该项业务；
  - (5) 配备足够的专业人员和相应的技术设施办理基金的注册与登记业务或委托符合条件的其它机构代理该项业务；
  - (6) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，保证所管理的基金资产和基金管理人的资产相互独立，保证不同基金在资产运作、财务管理等方面相互独立，对所管理的不同基金分别管理，分别记账，进行证券投资；
  - (7) 除依据法律法规和《基金合同》及其它有关规定外，不得以基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人运作基金资产；

- (8) 依法接受基金托管人的监督；
- (9) 采取适当合理的措施，计算基金份额认购、申购、赎回的方法符合《基金合同》等法律文件的规定，按有关规定计算并公告基金资产净值，确定基金份额申购、赎回的价格；
- (10) 严格按照《基金法》等法律法规和《基金合同》的规定，履行信息披露及报告义务；
- (11) 保守基金商业秘密，不泄露基金投资计划、投资意向等。除法律法规和《基金合同》及其它有关规定另有规定外，在基金信息公开披露前应予保密，不向他人泄露；
- (12) 按《基金合同》规定向基金份额持有人分配基金收益；
- (13) 按照法律法规和《基金合同》的规定受理申购与赎回申请，及时、足额支付赎回款项；
- (14) 不谋求对上市公司的控股和直接管理；
- (15) 依据《基金法》等法律法规和《基金合同》的规定召集基金份额持有人大会或配合基金托管人、基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
- (16) 按规定保存基金资产管理业务活动的会计账册、报表、记录和其他相关资料；
- (17) 确保需要向基金投资者提供的各项文件或资料在规定时间内发出，并且保证投资者能够按照《基金合同》规定的时间和方式，随时查阅到与基金有关的公开资料，并在支付合理成本的前提下得到有关资料的复印件；
- (18) 组织并参加基金财产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
- (19) 面临解散、被依法撤销、被依法宣告破产或被接管人接管其资产时，及时报告中国证监会并通知基金托管人；
- (20) 因违反《基金合同》导致基金资产损失或损害基金份额持有人大会合法权益，应当承担赔偿责任，其赔偿责任不因退任而免除；
- (21) 基金托管人因违反《基金合同》造成基金资产损失时，应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿；
- (22) 以基金管理人名义，代表基金份额持有人利益行使诉讼权利或实施其他法律行为；
- (23) 基金管理人在募集期间未能使基金达到备案条件，《基金合同》不能生效，基金管理人承担全部募集费用，将已募集资金并加计银行同期活期存款利息在募集期结束后

30 天内退还基金认购人；

(24) 法规和《基金合同》规定的其它义务。

3、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的权利包括但不限于：

- (1) 自《基金合同》生效之日起，依据法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金资产；
- (2) 依据《基金合同》的约定获得基金托管费、其他法定收入和其他法律法规允许或监管部门批准的约定收入；
- (3) 监督基金管理人对本基金的投资运作，如发现基金管理人违反《基金合同》及国家法律法规的行为，应呈报中国证监会，并采取必要措施保护基金投资者的利益；
- (4) 以基金托管人和基金联名的方式在中国证券登记结算有限公司上海分公司和深圳分公司开设证券账户；
- (5) 以基金托管人名义开立证券交易资金账户，用于证券交易资金清算；
- (6) 以基金的名义在中央国债登记结算有限公司开设银行间债券托管账户，负责基金的债券及资金的清算；
- (7) 提议召开基金份额持有人大会；
- (8) 在基金管理人更换时，提名新的基金管理人；
- (9) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

4、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金托管人的义务包括但不限于：

- (1) 以诚实信用、勤勉尽责的原则安全保管基金资产；
- (2) 设立专门的资产托管部，具有符合要求的营业场所，配备足够的、合格的熟悉基金托管业务的专职人员，负责基金资产托管事宜；
- (3) 建立健全内部风险控制、监察与稽核、财务管理及人事管理等制度，确保基金资产的安全，保证其托管的基金资产与基金托管人自有资产以及不同的基金资产相互独立；对不同的基金分别设置账户，独立核算，分账管理，保证不同基金之间在名册登记、账户设置、资金划拨、账册记录等方面相互独立；
- (4) 除依据法律法规和《基金合同》的规定外，不得利用基金资产为自己及任何第三人谋取非法利益，不得委托第三人托管基金资产；
- (5) 保管由基金管理人代表基金签订的与基金有关的重大合同及有关凭证；

- (6) 按规定开设基金资产的资金账户和证券账户，按照《基金合同》的约定，根据基金管理人的投资指令，及时办理清算、交割事宜；
  - (7) 保守基金商业秘密，除法律法规和《基金合同》另有规定外，在基金信息公开披露前予以保密，不得向他人泄露；
  - (8) 复核、审查基金管理人计算的基金资产净值、基金份额申购、赎回价格；
  - (9) 办理与基金托管业务活动有关的信息披露事项；
  - (10) 对基金财务会计报告、中期和年度基金报告出具意见，说明基金管理人在各重要方面的运作是否严格按照《基金合同》的规定进行；如果基金管理人未执行《基金合同》规定的行为，还应当说明基金托管人是否采取了适当的措施；
  - (11) 按有关规定，保存基金托管业务活动的记录、账册、报表和其他相关资料 15 年以上；
  - (12) 按规定制作相关账册并与基金管理人核对；
  - (13) 依据基金管理人的指令或有关规定，将基金份额持有人的基金赎回和分红款项划往指定账户；
  - (14) 按照规定召集基金份额持有人大会或配合基金份额持有人依法自行召集基金份额持有人大会；
  - (15) 按照规定监督基金管理人的投资运作；
  - (16) 参加基金财产清算组，参与基金资产的保管、清理、估价、变现和分配；
  - (17) 面临解散、被依法撤销或被依法宣告破产时，及时报告中国证监会和银行监管机构，并通知基金管理人；
  - (18) 因违反基金合同导致基金资产损失时，应承担赔偿责任，其赔偿责任不因其退任而免除；
  - (19) 基金管理人因违反基金合同造成基金资产损失时，应为基金份额持有人的利益向基金管理人追偿；
  - (20) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。
- 5、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的权利包括但不限于：
- (1) 分享基金资产收益；
  - (2) 参与分配清算后的剩余基金资产；
  - (3) 按《基金合同》的规定赎回其持有的基金份额；

- (4) 按照《基金合同》的规定要求召开基金份额持有人大会；
  - (5) 出席或者委派代表出席基金份额持有人大会，对基金份额持有人大会审议事项行使表决权；
  - (6) 查阅或者复制公开披露的基金信息资料；
  - (7) 因基金管理人、基金托管人、销售机构损害基金份额持有人合法权益的行为依法提起诉讼；
  - (8) 法律法规和《基金合同》规定的其他权利。
- 6、根据《基金法》、《运作办法》及其他有关规定，基金份额持有人的义务包括但不限于：
- (1) 遵守《基金合同》；
  - (2) 缴纳基金认购、申购款项及法律法规和《基金合同》规定的费用；
  - (3) 承担基金亏损或者《基金合同》终止的有限责任；
  - (4) 不从事任何有损基金及其他《基金合同》当事人利益的活动；
  - (5) 返还在基金交易过程中因任何原因，自基金管理人、基金托管人及基金管理人的代理人处获得的不当得利；
  - (6) 法律法规和《基金合同》规定的其他义务。

### **(三) 基金份额持有人大会**

基金份额持有人大会由基金份额持有人或基金份额持有人的合法授权代表共同组成。基金份额持有人持有的每一基金份额拥有平等的投票权。

### **(四) 基金份额持有人大会召开事由**

- 1、当出现或需要决定下列事由之一的，应当召开基金份额持有人大会：
  - (1) 提前终止《基金合同》；
  - (2) 更换基金管理人；
  - (3) 更换基金托管人；
  - (4) 转换基金运作方式；
  - (5) 提高基金管理人、基金托管人的报酬标准，但根据法律法规的要求提高该等报酬标准的除外；

- (6) 对《基金合同》当事人权利和义务产生重大影响的事项；
  - (7) 变更基金类别；
  - (8) 变更基金投资目标、范围或策略；
  - (9) 变更基金份额持有人大会程序；
  - (10) 法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其它应当召开基金份额持有人大会的事项。
- 2、以下情况可由基金管理人和基金托管人协商后修改，不需召开基金份额持有人大会：
- (1) 调低基金管理费、基金托管费；
  - (2) 在《基金合同》规定的范围内变更本基金的申购费率、赎回费率或收费方式；
  - (3) 因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改；
  - (4) 对《基金合同》的修改对基金份额持有人利益无实质性不利影响或修改不涉及《基金合同》当事人权利义务关系发生变化；
  - (5) 除按照法律法规和《基金合同》的规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其它情形。

#### **(五) 基金份额持有人大会的会议召集方式**

- 1、除法律法规规定或《基金合同》另有约定外，基金份额持有人大会由基金管理人召集；
- 2、基金管理人未按规定召集或不能召集时，由基金托管人召集；
- 3、基金托管人认为有必要召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，基金托管人仍认为有必要召开的，应当由基金托管人自行召集。
- 4、代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人就同一事项书面要求召开基金份额持有人大会的，应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金托管人。基金管理人决定召集的，应当自出具书面决定之日起六十日内召开；基金管理人决定不召集，代表基金份额10%（含10%）以上的基金份额持有人仍认为有必要召开的，应当向基金托管人提出书面提议。基金托管人应当自收到书面提议之日起十日内决定是否召集，并书面告知提出提议的基金份额持有人代表和基金管理人；基金托管人决定召集的，应当自出具书面

决定之日起六十日内召开。

- 5、如在上述第4条情况下，基金管理人、基金托管人都不召集的，单独或合计代表基金份额10%以上（含10%）的基金份额持有人有权自行召集，并至少提前三十日报中国证监会备案。
- 6、基金份额持有人大会的召集人（以下简称“大会召集人”）负责选择确定开会时间、地点、方式和权益登记日。

#### **（六）基金份额持有人大会的通知**

- 1、召开基金份额持有人大会，大会召集人应于会议召开前30日，在中国证监会指定的至少一种全国性信息披露报刊上公告通知。基金份额持有人大会通知应至少载明以下内容：
  - （1） 会议召开的时间、地点、方式；
  - （2） 会议拟审议的事项、议事程序；
  - （3） 有权出席基金份额持有人大会的基金份额持有人的权利登记日；
  - （4） 代理投票授权委托书送达时间和地点；
  - （5） 会务常设联系人姓名及联系电话。
- 2、采取通讯开会方式并进行表决的情况下，由大会召集人决定通讯方式和书面表决方式，并在会议通知中说明本次基金份额持有人大会所采取的具体通讯方式、委托的公证机关及其联系方式和联系人、书面表决意见寄交的截止时间和收取方式。

#### **（七）基金份额持有人大会的会议召开方式**

基金份额持有人大会可通过现场开会方式或通讯开会方式召开。

会议的召开方式由大会召集人确定，但更换基金管理人或更换基金托管人必须以现场开会方式召开。

- 1、现场开会：由基金份额持有人本人出席或以代理投票授权委托书委派代表出席，现场开会时基金管理人和基金托管人的授权代表应当列席基金份额持有人大会。现场开会同时符合以下条件时，可以进行基金份额持有人大会议程：
  - （1） 亲自出席会议者持有基金份额的凭证、受托出席会议者出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知

的规定；

- (2) 经核对，汇总到会者出示的在权利登记日持有基金份额的凭证显示，有效的基金份额不少于本基金在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）。

## 2、通讯开会：通讯开会应以书面方式进行表决。

在同时符合以下条件时，通讯开会的方式视为有效：

- (1) 大会召集人按《基金合同》规定公布会议通知后，在两个工作日内连续公布相关提示性公告；
- (2) 大会召集人在基金托管人和公证机关的监督下按照会议通知规定的方式收取基金份额持有人的书面表决意见；
- (3) 本人直接出具书面意见或授权他人代表出具书面意见的，基金份额持有人所持有的基金份额不小于在权利登记日基金总份额的 50%（含 50%）；
- (4) 上述第（3）项中直接出具书面意见的基金份额持有人或受托代表他人出具书面意见的代理人，同时提交的持有基金份额的凭证、受托出具书面意见的代理人出具的委托人持有基金份额的凭证及委托人的代理投票授权委托书符合法律法规、《基金合同》和会议通知的规定；
- (5) 会议通知公布前报中国证监会备案。

采取通讯方式进行表决时，除非在计票时有充分的相反证据证明，否则提交符合会议通知中规定的确认基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人；表面符合法律法规和会议通知规定的书面表决意见即视为有效的表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

## （八）基金份额持有人大会的议事内容与程序

### 1、议事内容及提案权

议事内容为关系基金份额持有人利益的重大事项，如《基金合同》的重大修改、决定提前终止《基金合同》、更换基金管理人、更换基金托管人、与其他基金合并、法律法规及《基金合同》规定的其他事项以及大会召集人认为需提交基金份额持有人大会讨论的其他事项。

基金管理人、基金托管人、单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人可以在大会召集人发出会议通知前向大会召集人提交需由基金份额持有人大

会审议表决的提案。

基金份额持有人大会不得对未事先公告的议事内容进行表决。

大会召集人应当按照以下原则对提案进行审核：

- (1) **关联性。**大会召集人对于提案涉及事项与基金有直接关系，并且不超出法律法规和《基金合同》规定的基金份额持有人大会职权范围的，应提交大会审议；对于不符合上述要求的，不提交基金份额持有人大会审议。如果大会召集人决定不将基金份额持有人提案提交大会表决，应当在该次基金份额持有人大会上进行解释和说明。
- (2) **程序性。**大会召集人可以对提案涉及的程序性问题做出决定。如将提案进行分拆或合并表决，需征得原提案人同意；原提案人不同意变更的，大会召集人可以就程序性问题提请基金份额持有人大会做出决定，并按照基金份额持有人大会决定的程序进行审议。

单独或合并持有权利登记日基金总份额 10%（含 10%）以上的基金份额持有人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，或基金管理人或基金托管人提交基金份额持有人大会审议表决的提案，未获基金份额持有人大会审议通过，就同一提案再次提请基金份额持有人大会审议，其时间间隔不少于 6 个月。

## 2、议事程序

### (1) 现场开会

在现场开会的方式下，首先由大会主持人按照下列第七条规定程序确定和公布监票人，然后由大会主持人宣读提案，经讨论后进行表决，并形成大会决议。大会主持人为基金管理人授权出席会议的代表，在基金管理人授权代表未能主持大会的情况下，由基金托管人授权其出席会议的代表主持；如果基金管理人授权代表和基金托管人授权代表均未能主持大会，则由出席大会的基金份额持有人所持表决权的 50%以上（含 50%）选举产生一名基金份额持有人作为该次基金份额持有人大会的主持人。

### (2) 通讯开会

在通讯开会的情况下，公告会议通知时应当同时公布提案，在所通知的表决截止日期后 2 个工作日内统计全部有效表决，在公证机关监督下形成决议。

### (九) 基金份额持有人大会的表决

基金份额持有人所持每份基金份额有一票表决权。

基金份额持有人大会决议分为一般决议和特别决议：

- 1、**一般决议**，一般决议须经参加大会的基金份额持有人所持表决权的50%以上（含50%）通过方为有效；除下列第2项所规定的须以特别决议通过事项以外的其他事项均以一般决议的方式通过。
- 2、**特别决议**，特别决议应当经参加大会的基金份额持有人所持表决权的三分之二（含三分之二）以上通过方可做出。转换基金运作方式、更换基金管理人或者更换基金托管人、提前终止《基金合同》以特别决议通过方为有效。

基金份额持有人大会采取记名方式进行投票表决。

采取通讯方式进行表决时，提交符合会议通知中规定的确认基金份额持有人身份文件的表决视为有效出席的基金份额持有人，符合会议通知规定的书面表决意见视为有效表决，表决意见模糊不清或相互矛盾的视为弃权表决，但应当计入出具书面意见的基金份额持有人所代表的基金份额总数。

基金份额持有人大会的各项提案或同一项提案内并列的各项议题应当分开审议、逐项表决。

### (十) 基金份额持有人大会的计票

#### 1、现场开会

- (1) 如基金份额持有人大会由基金管理人或基金托管人召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举两名基金份额持有人代表与大会召集人授权的一名监督员共同担任监票人；如大会由基金份额持有人自行召集，基金份额持有人大会的主持人应当在会议开始后宣布在出席会议的基金份额持有人中选举三名基金份额持有人代表担任监票人。
- (2) 监票人应当在基金份额持有人表决后立即进行清点并由大会主持人当场公布计票结果。
- (3) 如果大会主持人或基金份额持有人对于提交的表决结果有怀疑，可以在宣布表决结果后立即对所投票数要求进行重新清点。监票人应当进行重新清点，重新清点

以一次为限。重新清点后，大会主持人应当当场公布重新清点结果。

(4) 计票过程应由公证机关予以公证。

## 2、通讯开会

在通讯开会的情况下，计票方式为：由大会召集人授权的两名监票员在基金托管人授权代表（若由基金托管人召集，则为基金管理人授权代表）的监督下进行计票，并由公证机关对其计票过程予以公证。

## （十一）基金份额持有人大会的生效与公告

基金份额持有人大会决议应当由大会召集人自通过之日起五日内报中国证监会核准或者备案，并自中国证监会依法核准或者出具无异议意见之日起生效。

除非《基金合同》或法律法规另有规定，生效的基金份额持有人大会决议对全体基金份额持有人、基金管理人和基金托管人均有法律约束力。

基金份额持有人大会决议应当依照法律法规的规定在至少一种中国证监会指定的信息披露媒体公告。

## （十二）基金收益分配原则

- 1、 单次分红不低于此次基金可分配收益的50%；每基金年度累计分配的收益不得低于该基金年度基金可分配收益的80%；
- 2、 本基金收益分配方式分两种：现金红利与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，则以现金红利方式分配收益；
- 3、 当符合基金分红条件时，每基金年度至少分红一次，至多分红四次；
- 4、 基金当年收益先弥补上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；
- 5、 基金收益分配后每一基金份额净值不能低于面值；
- 6、 如果基金投资当期出现净亏损，则不进行收益分配；
- 7、 每一基金份额享有同等分配权；
- 8、 法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

### (十三) 基金收益分配的方案

基金收益分配方案中载明基金收益的范围、基金净收益、基金收益分配对象、分配原则、分配时间、分配数额及比例、分配方式等内容。

本基金收益分配方案由基金管理人拟定，并由基金托管人核实后确定，在报中国证监会备案后2日内公告。

### (十四) 基金的费用

#### 1、基金的费用种类

- (1) 基金管理人的管理费；
- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 投资交易费用；
- (4) 基金信息披露费用；
- (5) 基金份额持有人大会费用；
- (6) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费；
- (7) 基金销售服务费，具体计提办法按中国证监会的具体规定执行；
- (8) 按照国家有关规定可以列入的其他费用。

#### 2、基金管理人的管理费

基金管理费按前一日基金资产净值的1.2%的年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.2\% \div \text{当年天数}, \text{其中:}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 3、基金托管人的托管费

基金托管人的托管费按前一日的基金资产净值的0.25%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}, \text{其中}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇节假日、公休假等，支付日期顺延。

4、上述第1条基金费用中第(3) - (8)项费用由基金托管人根据有关法律法规、《基金合同》及相应协议规定，按费用实际支出金额，列入当期费用，从基金资产中支付。

## (十五) 基金的投资

### 1、投资范围和投资对象

根据法律法规的规定，本基金的投资范围为在中华人民共和国境内依法发行上市交易的股票和固定收益证券以及国务院证券监督管理机构规定的其他证券品种和法律法规允许的金融工具。

具体投资对象将根据公司研究成果以及流动性分析，以优质债券与央行票据和具有优秀成长性和投资价值并具良好流动性的上市公司股票为主。

在一级资产配置层面，本基金原则上可能的资产配置比例为：固定收益证券55% - 100%，股票0% - 45%。因基金规模或市场变化等因素导致投资组合不符合上述规定的，基金管理人应在合理的期限内调整基金的投资组合，以符合上述限定。法律法规另有规定时，从其规定。

### 2、本基金投资组合应遵循下列规定：

- (1) 本基金持有 1 家上市公司股票的市值，不超过本基金资产净值的 10%；
- (2) 本基金与由本基金管理人管理的其它基金持有 1 家公司发行的证券的总和，不超过该证券的 10%；
- (3) 基金资产参与股票发行申购，本基金所申报的金额不得超过基金总资产，本基金申报的股票数量不得超过拟发行股票的总量；
- (4) 在全国银行间同业市场中的债券回购最长时间为 1 年，债券回购到期后不展期；债券回购融入的资金余额不超过基金资产净值的 40%；
- (5) 不得违反《基金合同》关于投资范围、投资策略和投资比例等约定；
- (6) 中国证监会规定的其它比例限制；
- (7) 上述比例受限于法律法规的不时修改和中国证监会不时颁布的规范性文件的规定。

## （十六）基金资产净值的计算方式和公告

1、基金资产净值是指基金资产总值减去基金负债后的价值。基金资产净值的构成主要有：

- （1） 基金份额持有人认购、申购基金份额（扣除认购、申购费用后）所支付的款项；
- （2） 运用基金资产所获得的（已实现和未实现）收益（亏损）；
- （3） 以前年度实现的尚未分配的收益或尚未弥补的亏损。

基金份额净值是指计算日基金资产净值除以计算日发售在外的基金份额总数。

2、在《基金合同》生效后开始办理基金份额申购或者赎回前，基金管理人应当至少每周公告一次基金资产净值和基金份额净值。基金管理人应当每个开放日的下一个工作日，通过网站、基金份额销售网点以及中国证监会指定的信息披露媒体披露开放日的基金份额净值和基金份额累计净值。基金管理人应当在中国证监会指定的信息披露媒体公告半年度和年度最后一个市场交易日的基金资产净值和基金份额净值。

## （十七）《基金合同》的终止与基金财产的清算

1、有下列情形之一的，《基金合同》应当终止：

- （1） 存续期间内，基金份额持有人数量连续 60 个工作日达不到 200 人，或连续 60 个工作日基金资产净值低于人民币 5000 万元，基金管理人将宣布《基金合同》终止；
- （2） 《基金合同》经持有人大会表决终止的；
- （3） 因重大违法、违规行为，《基金合同》被中国证监会责令终止的；
- （4） 基金管理人职责终止，而在六个月内没有新基金管理人承接其原有职责的；
- （5） 基金托管人职责终止，而六个月内没有新基金托管人承接其原有职责的；
- （6） 中国证监会规定的其它情况。

2、基金财产的清算

《基金合同》终止时，基金管理人应当组织基金财产清算组对基金资产进行清算。基金财产清算组由基金管理人、基金托管人以及相关中介服务机构组成。基金财产清算组作出的基金财产清算报告经会计师事务所审计，律师事务所出具法律意见书后，报中国证监会备案并公告。

**(十八) 争议的处理和适用的法律**

各方当事人同意，因《基金合同》而产生的或与《基金合同》有关的一切争议，如经友好协商未能解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在上海，仲裁裁决是终局性的并对各方当事人具有约束力，仲裁费由败诉方承担。《基金合同》受中国法律管辖。

**(十九) 《基金合同》存放地和投资者取得《基金合同》的方式**

《基金合同》存放在基金管理人和基金托管人的营业场所，投资者可免费查阅；也可按工本费购买《基金合同》印制件或复印件；如涉及争议事项需协商、仲裁或诉讼的，《基金合同》条款及内容应以《基金合同》正本为准。

## 二十 基金托管协议内容摘要

### (一) 托管协议当事人

- 1、基金管理人 - 申万巴黎基金管理有限公司
- 2、基金托管人 - 中国工商银行股份有限公司

### (二) 基金托管人和基金管理人之间的业务监督、核查

1、根据《基金法》、《基金合同》、本协议和有关基金法规的规定，基金托管人对基金的投资对象、基金资产的投资组合比例、基金资产的核算、基金资产净值的计算、基金管理人报酬的计提和支付、基金费用的支付、基金申购资金的到账和赎回资金的划付、基金收益分配、基金的融资条件等行为的合法性、合规性进行监督和核查，其中对基金的投资比例的监督和检查自本基金的《基金合同》生效之后六个月开始。

基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》、本协议或有关基金法规规定的行为，应及时以书面形式通知基金管理人限期纠正，基金管理人收到通知后应及时核对，并以书面形式对基金托管人发出回函确认。在限期内，基金托管人有权随时对通知事项进行复查，督促基金管理人改正。基金管理人对于基金托管人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金托管人应报告中国证监会。基金托管人有义务要求基金管理人赔偿因其过失致使投资者遭受的损失。基金托管人发现基金管理人具有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金管理人限期纠正。

2、根据《基金法》、《基金合同》、本协议及其他有关规定，基金管理人就基金托管人是否及时执行基金管理人的划款指令、是否擅自动用基金资产、是否按时将分配给基金份额持有人的收益划入分红派息账户等事项，对基金托管人进行监督和核查。

基金管理人定期对基金托管人保管的基金资产进行核查。基金管理人发现基金托管人未对基金资产实行分账管理、擅自挪用基金资产、因基金托管人的过错导致基金资产灭失、减损或处于危险状态的，基金管理人应立即以书面的方式要求基金托管人予以纠正并采取必要的补救措施。基金管理人有权要求基金托管人赔偿基金因此所遭受的损失。

基金管理人发现基金托管人的行为违反《基金法》、《基金合同》、本协议或有关基金法规的规定，应及时以书面形式通知基金托管人限期纠正，基金托管人收到通知后应及时核对并以

书面形式对基金管理人发出回函。在限期内，基金管理人有权随时对通知事项进行复查，督促基金托管人改正。基金托管人对基金管理人通知的违规事项未能在限期内纠正的，基金管理人应报告中国证监会。

基金管理人发现基金托管人有重大违规行为，应立即报告中国证监会，同时通知基金托管人限期纠正。

3、基金管理人和基金托管人有义务配合和协助对方依照本协议对基金业务执行监督、核查。基金管理人或基金托管人无正当理由，拒绝、阻挠对方根据本协议规定行使监督权，或采取拖延、欺诈等手段妨碍对方进行有效监督，情节严重或经监督方提出警告仍不改正的，监督方应报告中国证监会。

### **(三) 基金资产保管**

#### **1、 资产保管原则**

基金托管人依法持有基金资产，应安全保管所收到的基金的全部资产。基金资产应独立于基金管理人、基金托管人的自有资产。基金托管人必须为基金设立独立的账户，与基金托管人的其他业务和其他基金的托管业务实行严格的分账管理。基金托管人应安全、完整地保管基金资产；未经基金管理人的正当指令，不得自行运用、处分、分配基金的任何资产。属于基金托管人实际有效控制下的实物证券在基金托管人保管期间的损坏、灭失，由此产生的责任应由基金托管人承担。

#### **2、 募集资金的验证**

#### **3、 投资者申购资金和赎回资金的划付**

#### **4、 基金资产银行账户的开设和管理**

#### **5、 基金的证券账户与证券交易资金账户的开设和管理**

#### **6、 债券托管乙类账户的开设和管理**

#### **7、 基金资产投资的有关实物证券的保管**

#### **8、 与基金资产有关的重大合同的保管**

### **(四) 基金资产净值的计算和复核**

基金资产净值是指基金资产总值减去负债后的价值。基金份额净值是指计算日基金资产净值

除以计算日基金份额总额后的价值。

基金管理人应每日对基金资产估值。用于基金信息披露的基金资产净值和基金份额净值由基金管理人负责计算，基金托管人复核。基金管理人应于每个工作日交易结束后计算当日的基金资产净值并以加密传真方式发送给基金托管人。基金托管人对净值计算结果复核后，签名、盖章并以加密传真方式传送给基金管理人，由基金管理人对外公布。

本基金按以下方式进行估值：

1、已上市流通的有价证券的估值

(1) 上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值；

(2) 在证券交易所市场流通的债券，按如下估值方式处理：

A. 实行净价交易的债券按估值日收盘价估值，估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值。

B. 未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

2、处于未上市期间的有价证券应区分如下情况处理：

(1) 送股、转增股、配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；该日无交易的，以最近一日的市价（收盘价）估值；

(2) 首次公开发行的股票，按成本估值；

(3) 未上市债券按由基金管理人和基金托管人综合考虑成本价、收益率曲线等因素确定的反映公允价值的价格估值。

3、配股权证，从配股除权日起到配股确认日止，按估值日市价高于配股价的差额估值；收盘价等于或低于配股价，则估值为零。

4、如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

5、如有新增事项，按国家最新规定估值。

基金资产净值计算和基金会计核算的义务由基金管理人承担。因此，就与本基金有关的会计问题，本基金的会计责任方是基金管理人，如经相关各方在平等基础上充分讨论后，仍无法达成一

致的意见，按照基金管理人对基金净值的计算结果对外予以公布。

#### **（五）基金份额持有人名册的登记和保管**

基金份额持有人名册，包括基金设立募集期结束时的基金份额持有人名册、基金权益登记日的基金份额持有人名册、基金份额持有人大会登记日的基金份额持有人名册、每月最后一个交易日的基金份额持有人名册由基金过户与注册登记人负责制定。基金过户与注册登记人对基金份额持有人名册负保管义务。

#### **（六）争议处理和法律适用**

相关各方当事人同意，因本协议而产生的或与本协议有关的一切争议，除经友好协商可以解决的，应提交中国国际经济贸易仲裁委员会根据该会当时有效的仲裁规则进行仲裁，仲裁的地点在北京，仲裁裁决是终局性的并对相关各方均有约束力，仲裁费用由败诉方承担。

争议处理期间，相关各方当事人应恪守基金管理人和基金托管人职责，继续忠实、勤勉、尽责地履行《基金合同》和托管协议规定的义务，维护基金份额持有人的合法权益。

本协议受中国法律管辖。

#### **（七）托管协议的修改和终止**

- 1、本协议相关各方当事人经协商一致，可以对协议进行修改。修改后的新协议，其内容不得与《基金合同》的规定有任何冲突。修改后的新协议向中国证监会办理完必要的核准或备案手续后生效。
- 2、发生以下情况，本托管协议终止：
  - （1）《基金合同》终止；
  - （2）因基金托管人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金托管人；
  - （3）因基金管理人解散、依法被撤销、破产或其他事由造成本基金更换基金管理人；
  - （4）发生《基金法》或其他法律法规规定的终止事项。

## 二十一 对基金份额持有人的服务

基金管理人承诺为基金份额持有人提供一系列的服务。以下是主要的服务内容，基金管理人根据基金份额持有人的需要和市场的变化，有权增加、修改这些服务项目：

### （一）为基金份额持有人提供的服务

#### 1、基金份额持有人注册与过户登记服务

本基金管理人同时兼任本基金的注册与过户登记人，在公司内部设立了专门的运营部门负责基金份额持有人的注册与过户登记业务，配备先进、高效的电脑系统及通讯系统，准确、及时地为基金投资者办理基金账户业务、汇总和存储并管理基金的所有认购、申购与赎回信息，确保基金份额持有人的注册与过户登记工作的准确和顺利进行。

#### 2、基金份额持有人投资记录对帐服务

基金份额持有人将得到定期的投资记录对帐服务。

#### 3、基金收益分配申购基金份额

若基金份额持有人选择本基金的收益分配以基金份额形式进行，该持有人当期分配所得基金收益将按红利发放日的基金份额净值自动转基金份额，且不收取任何申购费用。

#### 4、网络在线服务

在技术条件成熟时，基金管理人可利用自己的网站为基金投资者提供各类在线服务。

#### 5、基金间转换服务

投资者可在本基金管理人管理的不同开放式基金间转换基金份额，并享受费率优惠。基金间转换服务的办理时间、费率和有关规则由基金管理人另行公告。

#### 6、定期定额投资计划

在技术条件成熟时，基金管理人将利用直销网点或代销网点为投资者提供定期投资的服务。通

过定期定额投资计划，投资者可以通过固定的渠道，定期定额申购基金份额。该定期定额投资计划的办理时间、费率和有关规则由基金管理人另行公告。

## （二）服务渠道

（一）咨询电话：+ 86 - 21 - 962299

（二）网站：[www.swbnpp.com](http://www.swbnpp.com)

（三）其他，如邮寄等

## 二十二 招募说明书存放及查阅方式

本招募说明书存放在基金管理人、基金托管人及基金代销网点的营业场所，投资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件。

## 二十三 其他应披露事项

自 2006 年 6 月 17 日至 2006 年 11 月 30 日，与本基金和本基金管理人有关的公告如下：

- 1、2006 年 6 月 28 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报和证券日报的本公司《关于所管理的部分证券投资基金运用基金财产投资资产支持证券的公告》；
- 2、2006 年 7 月 12 日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金招募说明书更新的公告》；
- 3、2006 年 7 月 13 日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报和证券日报的本公司关于《开通申万巴黎收益宝货币市场基金与其所管理其他基金之间转换业务的公告》；
- 4、2006 年 7 月 20 日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2006 年第二季度报告》；
- 5、2006 年 8 月 25 日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2006 年半年度报告》；
- 7、2006 年 10 月 25 日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金 2006 年第三季度报告》；
- 8、2006 年 11 月 10 日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金第三次分红公告》。

## 二十四 备查文件

- (一) 中国证监会核准申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金募集的文件
- (二) 《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金合同》
- (三) 《申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金托管协议》
- (四) 《法律意见书》
- (五) 基金管理人业务资格批件和营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件和营业执照
- (七) 中国证监会要求的其他文件