

申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

招募说明书(第十次更新)摘要

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

【重要提示】

- 本基金基金合同已于2004年11月29日生效。
- 投资有风险,投资者申购基金时应认真阅读招募说明书。
- 基金的过往业绩并不预示其未来的表现。
- 本招募说明书所载基金合同和基金招募说明书编写,并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额,即成为基金份额持有人和本基金基金合同的当事人。其持有基金份额的行为本身即表明其对本基金合同的承认和接受,并按照《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》、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人了解本基金份额持有人的权利和义务,应详细查阅基金合同。
- 本招募说明书更新所载内容截止日为2009年11月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2009年9月30日(财务数据未经审计)。

一、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 23261188
- 6、联系人:王菲菲
- 7、注册资本:人民币15亿元
- 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分行行长,党委副书记,1991年至1999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月任任银万国证券股份有限公司执行董事,兼申银万国(香港)有限公司董事长。

毛鸿鸣先生,董事,1969年出生,美国肯特州立大学金融硕士学位,1992年至1994年在阿克隆大学任经济助教,1995年至1999年在肯特州立大学任金融系讲师,1999年至2002年任 HFR 资产管理公司董事总经理,2002年至2007年任荷兰克林普普基金集团副总裁及高级投资策略师。

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主任科员、主任科员,1993年初至1998年初在交通银行总行任处长,条线处先后担任副行长、行长、党委书记,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,1968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,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理事长、副所,王大为先生,独立董事,1965年出生,1984年至1988年任中国驻法国大使馆二等秘书,1991年至1993年任国家行政学院筹建办公室处长,1994年至2000年任职于法国雷诺汽车公司北京代表处,先后任副总经理和首席代表。2001年至2004年任上海申银证券公司总裁助理兼国际业务部总经理,1996年至今任职于申银万国证券股份有限公司,现任公司副总裁。

Max DiLulio 先生,董事,1963年出生,巴黎工商商会商学院毕业,现任法国巴黎资产管理有限公司新兴市场与开发部主管,曾任法国巴黎银行固定收益基金经理,法国巴黎银行并购融资、法国巴黎银行公司发展和资产保护部主管等。

毛晓麟先生,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,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理事长、副所,王大为先生,独立董事,1965年出生,1984年至1988年任中国驻法国大使馆二等秘书,1991年至1993年任国家行政学院筹建办公室处长,1994年至2000年任职于法国雷诺汽车公司北京代表处,先后任副总经理和首席代表。2001年至2004年任上海申银证券公司总裁助理兼国际业务部总经理,1996年至今任职于申银万国证券股份有限公司,现任公司副总裁。

袁晓峰先生,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,上海市经济学会会长,上海社会科学院经济研究所顾问。

赵蔚海先生,独立董事,1960年出生,曾任司法部香港中国法律服务有限公司、香港何耀庭律师事务所、康达律师事务所律师。现任北京鑫泽律师事务所上海分所主任、律师。

(2)监事会成员:

刘瑞麟先生,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学院研究生毕业,获副博士学位,回国后,先后任中国人民银行处长、局长、建设银行副行长、中国人民大学经济体制改革委员会副主任、中国证监会前任主席。

Jean Audibert 先生,监事,1961年出生,1975年加入法国巴黎银行,先后在科威特、新加坡、韩国等地工作,1996年至2001年任法国巴黎银行总部国际贸易服务部负责人,2001年至2005年任法国巴黎银行东亚国际业务负责人,2005年至2008年任招商局巴黎资产管理(香港)有限公司总裁兼 CEO,2009年1月至今,任法国巴黎资产管理有限公司亚洲新兴市场主席。

王理道先生,监事,申万巴黎基金管理有限公司行政管理部负责人,1961年出生,研究生学历,自1978年起任上海船舶研究设计院,1994年任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部,2004年1月加盟本公司。

(3)高级管理人员

毛鸿鸣先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。

过耀华先生,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总经理,1997年至1999年任申万信达投资管理(亚洲)有限公司联席总裁,1999年至2004年2月任任银万国证券股份有限公司国际业务部副总经理。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。

(4)督察长:

奚肖霞先生,1969年出生,经济学硕士;曾任本公司监察稽核部副总经理;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。

(5)基金经理

张维维先生,英国华威大学经济与金融学硕士,自2005年起从事金融工作,历任北京天相投资顾问公司分析师,2007年3月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部任分析员,2009年6月至2009年9月任申万巴黎盛利强化配置证券投资基金基金经理助理,2009年9月起任申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金基金经理。

徐嘉舜先生,2004年11月至2006年2月任本基金基金经理。

李源海先生,2006年2月至2009年8月任本基金基金经理。

(6)投资决策委员会组成

投资决策委员会由下述执行委员组成:总裁、副总裁、投资总监、基金基金经理、组合投资管理代表、委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。

非执行委员有下列人员组成:研究负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资管理、非执行董事对决策事项可发表观点,但不参与决策事项的投票表决。

本公司总裁担任投资决策委员会主席,投资总监担任投资决策委员会会议召集人。

本公司董事长、督察长和风险管理总监和首席金融工程师有权利向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。

二、基金托管人

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65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334,018,860,026元

联系电话:010-66105799

三、基金服务机构

(一)销售机构

1.直销机构

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 23261188

传真:+86 21 23261199

联系人:陈莹红 陈景新

客户服务中心电话:400 980 8588 或 +86 21 962299

2.代销机构

(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65号

联系人:田耕

客户服务电话:96588

传真:+86 10 66107914

网址:www.icbc.com.cn

(2)名称:中国建设银行股份有限公司

法定代表人:郭树清

注册地址:北京市西城区金融大街25号

办公地址:北京市西城区闹市口大街1号院1号楼

联系人:王琳

客户服务电话:96533

传真:(010) 66276654

网址:www.ccb.com

(3)名称:中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

传真:+86-10-85109219

联系人:蒋浩

客户服务电话:96599

网址:www.abchina.com

(4)名称:交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市银城中路168号

法定代表人:胡怀桥

电话:(021) 58781234

传真:(021) 58408842

联系人:曹榕

客户服务电话:96599

网址:http://www.bankcomm.com/

(5)名称:上海浦东发展银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东南路500号

办公地址:上海市中山东一路12号

法定代表人:吉炳钧

传真:(021) 63860499

联系人:汤嘉惠 虞谷珍

客户服务热线:96528

公司网站:www.spdb.com.cn

(6)名称:中国民生银行股份有限公司

注册地址:北京市西城区复兴门内大街2号

办公地址:北京市西城区西长安街88号

法定代表人:董文标

客服电话:96568

联系人:陆文霞

传真:010-83914283

网址:www.cmbc.com.cn

(7)名称:中国银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

办公地址:北京市东城区朝阳门北大街8号富华大厦C座

法定代表人:尹丹

客服电话:96568

联系人:金雷

传真:+86-10-65550827

网址:http://bank.ecitic.com

(8)名称:深圳发展银行股份有限公司

注册地址:广东深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人:法兰克纽曼(Frank N. Newman)

联系人:张勤

传真:(0755) 82800406

客户服务电话:96501

网址:www.sdb.com.cn

(9)名称: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:丁国荣

传真:+86 21 54036333

联系人:郑寒冰

客服电话:021-962506

公司网站:www.sw2000.com.cn

(10)名称:中信建投证券股份有限公司

注册地址:北京朝朝安义里66号4号楼

办公地址:北京朝朝安义里66号4号楼

法定代表人:张吉君

联系人:刘晨

客服电话:400-8888-108

开放日基金业务传真:(010) 65182261

公司网站:www.citics.com

(11)名称:海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:金芸 李笑鸣

客户服务电话:400-8888-001(全国),021-96653,或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站:www.htsec.com

(12)名称: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:上海浦东新区银城中路168号上海国信大厦29层

法定代表人:祝一帆

传真:021-38670161

客户服务电话:4008888666

公司网站:www.gtja.com

(13)名称: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3-45层

法定代表人:宫少林

联系人:袁劲松

客服电话:400-8888-333

(14)名称:中国银河证券股份有限公司

注册地址:北京朝朝安义里66号4号楼

办公地址:北京朝朝安义里66号4号楼

法定代表人:张吉君

联系人:刘晨

客服电话:400-8888-108

开放日基金业务传真:(010) 65182261

公司网站:www.chinastock.com.cn

(15)名称:广发证券股份有限公司

住所:广东省广州市天河区路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18,19,26,38,41和42楼

法定代表人:王健

电话:0651-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gfyzq.com.cn

(16)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(2)名称:江南证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

联系人:余珊珊

客服电话:0791-6788763

网址:www.jnsc.com

(3)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:姜宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-965603

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:魏阳群

客户服务电话:400-8888-777, 96578

网址:www.gyazq.com.cn

(19)名称:信达证券股份有限公司

注册(办公)地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

法定代表人:张志刚

联系人:田耕

客服电话:400-800-8939

公司网站:www.cindasc.com

(20)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话:400 8888 788,1010898

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

-45%。因基金规模或市场环境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,以符合上述规定。法律法规另有规定的,从其规定。

八、基金的投资策略

本基金采用主动型投资管理方式,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,但不超过基金总资产净值的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,控制投资组合的可能损失。

股票投资采用“行业驱动”与“个股选择”双线并行的投资策略,由主动式行业驱动模型确定行业配置,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成长性股票争取当期收益;固定收益证券投资利用利率预期策略,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一个相对稳定的基准,在有效控制基金跟踪误差的前提下,基金的收益风险特征将呈现一个长期稳健增长态势。由此,在本基金运作过程中,风险控制乃为资产配置目标之关键所在,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产品目的,是让基金管理人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、高收益的股票的投资比例,以提高基金的收益,并在适当的时候实现取利的投资收益。相反,在市场存在较大的下跌风险时,本基金将以全面回避高风险资产的投资,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线的风险控制水平并不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。