# 申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

## 招募说明书(第六次更新)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,投资人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。

● 本摘要根据本基金之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。

● 本招募说明书(更新)所载内容截止日为2007年11月30日,有关财务数据和净值表现截止日为2007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 6335 3535

6、联系人:王菲萍

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,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、党组秘书。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。

Max DIULIUS先生,董事,1963年出生。巴黎工商联会商学院毕业;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部和资产偿还部主管等。

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。

卢骐先生,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

过振华先生,代理总裁,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。

**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334,018,850,026元

联系电话:010-66106912

联系人:蒋松云

**三、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)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

客户服务电话:95533

传真:(010)66275654

联系人:王琳

(3)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

电话:+86 21 54033888

传真:+86 21 54035333

联系人:邓寒冰

客服电话:021-962505

公司网站:www.sw2000.com.cn

(4)海通证券股份有限公司

地址:广东路689号10楼

法定代表人:王开国

电话:+86 21 63410340

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

(5)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:4008888666

公司网站:www.gtja.com

(6)中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市东城区新中街68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

(7) 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:4008888111、+86 755 26951111

公司网站:www.newone.com.cn

(8)中国银河证券股份有限公司

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:肖时庆

电话:+86 10 66568587

传真:+86 10 66568536

联系人:李洋

公司网址:www.chinastock.com.cn

(9)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

(10)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

(11)光大证券股份有限公司

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15-16楼

办公地址:上海市浦东新区浦东南路528号上海证券大厦南塔14楼

法定代表人:王明权

联系人:刘晨

电话:021-68823685

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(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:陈景新

(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

**四、基金的名称**

本基金的名称:申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

**五、基金的类型**

本基金的类型:契约型开放式

本基金的类别:混合型

**六、基金的投资目标**

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。

**七、基金的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。

**八、基金的投资策略**

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产品的目的,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。

**九、基金的业绩基准**

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。

**十、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委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<br>监察稽核部<br>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<br>分析师<br>风险管理部 |

**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2007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 | 33,240,645.60 | 23.47% |
| 债券 | 62,822,658.00 | 44.36% |
| 权证 | - | - |
| 银行存款和清算备付金 | 42,320,229.40 | 29.88% |
| 其他资产 | 3,235,714.05 | 2.29% |
| 合　计 | 141,619,247.05 | 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 | - | - |
| B | 采掘业 | 3,959,510.00 | 3.64% |
| C | 制造业 | 14,469,850.00 | 13.29% |
| C0 | 食品、饮料 | 2,786,200.00 | 2.56% |
| C1 | 纺织、服装、皮毛 | - | - |
| C2 | 木材、家具 | - | - |
| C3 | 造纸、印刷 | - | - |
| C4 | 石油、化学、塑胶、塑料 | 2,490,950.00 | 2.29% |
| C5 | 电子 | - | - |
| C6 | 金属、非金属 | 1,077,600.00 | 0.99% |
| C7 | 机械、设备、仪表 | 7,134,800.00 | 6.56% |
| C8 | 医药、生物制品 | 724,000.00 | 0.67% |
| C99 | 其他制造业 | 256,300.00 | 0.24% |
| D | 电力、煤气及水的生产和供应业 | 772,800.00 | 0.71% |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 交通运输、仓储业 | 1,347,900.00 | 1.24% |
| G | 信息技术业 | 34,092.00 | 0.03% |
| H | 批发和零售贸易 | 3,577,150.00 | 3.29% |
| I | 金融、保险业 | 3,001,658.00 | 2.76% |
| J | 房地产业 | 4,561,800.00 | 4.19% |
| K | 社会服务业 | 839,385.60 | 0.77% |
| L | 传播与文化产业 | - | - |
| M | 综合类 | 676,500.00 | 0.62% |
| | 合　计 | 33,240,645.60 | 30.54% |

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 | 600675 | 中华企业 | 80,000 | 2,478,400.00 | 2.28% |
| 2 | 000858 | 五 粮 液 | 50,000 | 2,122,500.00 | 1.95% |
| 3 | 600616 | 第一食品 | 50,000 | 1,656,000.00 | 1.52% |
| 4 | 600000 | 浦发银行 | 30,000 | 1,575,000.00 | 1.45% |
| 5 | 600673 | 阳之光 | 45,000 | 1,529,550.00 | 1.41% |
| 6 | 600096 | 云天化 | 30,000 | 1,510,200.00 | 1.39% |
| 7 | 600150 | 中国船舶 | 5,000 | 1,369,950.00 | 1.26% |
| 8 | 000651 | 格力电器 | 30,000 | 1,292,400.00 | 1.19% |
| 9 | 000937 | 金牛能源 | 40,000 | 1,258,000.00 | 1.16% |
| 10 | 600748 | 上实发展 | 25,000 | 1,200,000.00 | 1.10% |

4.期末债券投资组合

| 券种 | 市值(元) | 占净值比例 |
|---|---|---|
| 国家债券 | 33,671,658.00 | 30.94% |
| 央行票据 | 29,151,000.00 | 26.78% |
| 合 计 | 62,822,658.00 | 57.72% |

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 | 02国债⒁ | 24,040,800.00 | 22.09% |
| 2 | 06央票92 | 9,725,000.00 | 8.94% |
| 3 | 07央票04 | 9,724,000.00 | 8.93% |
| 4 | 07央票31 | 9,702,000.00 | 8.91% |
| 5 | 20国债⑽ | 8,320,888.00 | 7.65% |

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 | 500,000.00 |
| 权证保证金 | 98,780.49 |
| 应收证券清算款 | - |
| 应收利息 | 1,395,923.22 |
| 应收申购款 | 1,241,010.34 |
| 买入返售证券 | - |
| 合　计 | 3,235,714.05 |

(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:无

**十二、基金的业绩**

本基金的过往业绩不代表未来表现。

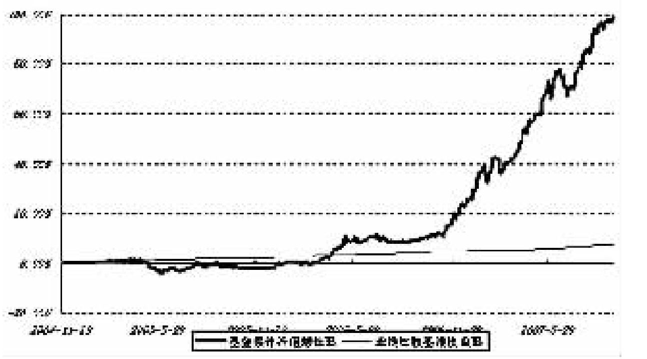
1.净值增长率与业绩比较基准收益率比较:

| 阶段 | 基金份额净值增长率① | 基金份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 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 | 27.59% | 0.45% | 2.35% | 0 | 25.24% | 0.45% |
| 2007年1月1日至2007年9月30日 | 57.95% | 0.92% | 2.23% | 0 | 55.72% | 0.92% |
| 自基金合同生效日至2007年9月30日 | 98.63% | 0.57% | 7.03% | 0 | 91.60% | 0.57% |

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。

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。

**十三、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 ×1.2% ÷ 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 × 0.25% ÷ 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纳税主体,其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

**十四、对招募说明书本次更新部分的说明**

本招募说明书(更新)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》及其它有关法律法规的要求,并根据基金管理人在本次更新期间实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、本公司原总经理唐熹明先生因个人原因提出辞职,本公司董事会已于2007年8月30日批准其辞职,并同时指定过振华先生为代理总经理。上述事项已于9月3日进行了公开披露;

2、更新了基金托管人的部分信息;

3、更新了部分基金代销机构的联系信息,增加了建设银行和光大证券为基金的代销机构;

4、更新了投资组合报告,数据截至日期为2007年9月30日;

5、更新了基金的业绩部分,数据截至日期为2007年9月30日;

6、在基金的估值部分,根据本基金《基金合同》估值部分的修改,调整了基金估值部分的表述。

7、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2007年6月1日至2007年11月30日发布的有关公告。

**十五、其他应披露事项**

自2007年6月1日至2007年11月30日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2007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基金招募说明书更新》;

2、2007年7月18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2007年第二季度报告》;

3、2007年8月24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基金在中国工商银行开通定期定额业务公告》;

4、2007年8月29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2007年中期报告》;

5、2007年8月30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基金分红公告》;

6、2007年9月3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《申万巴黎基金管理有限公司关于高管人员变更的公告》;

7、2007年9月19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《关于增加中国建设银行旗下基金代销机构的公告》;

8、2007年9月27日刊登于中国证券报、上海证券报和证券时报的《申万巴黎基金管理有限公司关于旗下基金申购中海油服的公告》;

9、2007年9月29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《关于旗下基金根据《关于基金管理公司及证券投资基金执行〈企业会计准则〉的通知》修改基金合同的公告》;

10、2007年10月26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2007年第三季度报告》;

11、2007年11月15日刊登于中国证券报、上海证券报、证券时报和证券日报的《关于增加光大证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告》;

12、2007年11月30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分红公告》。

签署日期:2007年12月21日

以上内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(更新)(正文)所载之详细资料一并阅读。

**申万巴黎基金管理有限公司**

2008年1月12日

---

# 嘉实基金管理有限公司
# 关于嘉实增长、嘉实稳健和嘉实策略基金参与中国工商银行基金定投费率优惠活动的公告

为满足广大投资者的理财需求,嘉实基金管理有限公司和中国工商银行股份有限公司(以下简称"中国工商银行")决定,在2008年1月15日至2008年12月31日期间中所有的法定基金交易日,嘉实增长证券投资基金、嘉实稳健证券投资基金、嘉实策略增长证券投资基金(以下分别简称"嘉实增长"、"嘉实稳健"、"嘉实策略")参加中国工商银行推出的"2008倾心回馈"基金定投费率优惠活动。

一、活动内容

投资者与中国工商银行签订基金定投业务协议。在活动期间,投资者享受嘉实增长、嘉实稳健和嘉实策略基金定投申购费率八折优惠。

二、注意事项

1、该活动适用中国工商银行基金定投业务的新老客户。对于已在本次活动前享有中国工商银行基金定投费率优惠活动的老客户,在活动期间内,其基金定投申购费率一律按八折优惠;本次优惠活动结束后,老客户的基金定投优惠继续按原标准实施。

2、本次优惠活动结束后,投资者定投申购不继续享受此费率优惠;因客户违约导致在优惠活动期内基金定投申购不成功,亦不能享受此费率优惠。

3、原申购费率高于0.6%的,基金定投申购费率按8折优惠(即实收申购费率=原申购费率×0.8),但优惠后费率不得低于0.6%;原申购费率低于0.6%的,则按原费率执行。

4、具体各基金的申购费率请参见相应基金的《基金合同》、《招募说明书》及相关公告。

5.凡在规定时间、规定业务范围以外的基金定投申购不享受以上优惠。

三、业务咨询方式

1、中国工商银行开放式基金咨询电话:95588,网址:www.icbc.com.cn;

2、嘉实基金管理有限公司客户服务电话:400-600-8800、(010)65185566,网址:www.jsfund.cn。

特此公告。

**嘉实基金管理有限公司**

2008年1月12日

---

**证券代码:600087　证券简称:长航油运　编号:临2008-002**

# 中国长江航运集团南京油运股份有限公司2008年第一次临时股东大会决议公告

本公司及董事会全体成员保证公告内容真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏承担连带责任。

重要内容提示:

1、本次会议无否决和修改提案的情况;

2、本次会议无新的提案提交表决。

一、会议召开和出席情况

中国长江航运集团南京油运股份有限公司2008年第一次临时股东大会于2008年1月11日在南京市中山北路324号南京油运大厦16楼会议室召开。出席本次股东大会的股东及授权代表共9人,代表股份443,976,912股,占公司有表决权股份总数的49.62%。受董事长刘锡汉先生的委托,常务副董事长朱宁先生主持了本次会议,公司部分董事、监事和高级管理人员出席会议,会议符合《公司法》、《证券法》及本公司《章程》的有关规定。

二、议案审议情况

大会采取现场记名投票表决的方式,审议通过了如下决议:

1、表决通过了《关于对外处置一艘单壳VLCC的议案》:

443,976,912股同意(占出席会议股东有表决权股份总数的　100%);0股反对;0股弃权。

2、表决通过了《关于投资新建4艘5500吨级化学品船的议案》:

443,976,912股同意(占出席会议股东有表决权股份总数的　100%);0股反对;0股弃权。

3、表决通过了《关于公司非公开发行募集资金投向增加1艘4万吨级油轮的议案》:

443,976,912股同意(占出席会议股东有表决权股份总数的　100%);0股反对;0股弃权。

4、以特别决议表决通过了《关于修改公司〈章程〉有关条款的议案》:

443,976,712股同意(占出席会议股东有表决权股份总数的　100%);0股反对;200股弃权。

5、表决通过了《关于为全资子公司南京扬洋化工运贸有限公司银行借款提供担保的议案》:

443,976,912股同意(占出席会议股东有表决权股份总数的　100%);0股反对;0股弃权。

三、律师见证情况

江苏法德永衡律师事务所景忠、周浩律师对本次股东大会进行了现场见证,并出具了法律意见书,认为本次股东大会的召集、召开及表决程序符合法律、行政法规及本公司《章程》的规定,表决结果合法有效。

四、备查文件

1、中国长江航运集团南京油运股份有限公司2008年第一次临时股东大会会议记录;

2、江苏法德永衡律师事务所《关于中国长江航运集团南京油运股份有限公司2008年第一次临时股东大会的法律意见书》。

**中国长江航运集团南京油运股份有限公司**

**董 事 会**

**二〇〇八年一月十一日**

---

**股票简称:上海家化　股票代码:600315　编号:临2008-002**

# 上海家化联合股份有限公司2008年第一次临时股东大会决议公告

特别提示

本公司及董事会全体成员保证公告内容的真实、准确和完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏负连带责任。

重要内容提示:

1、本次会议无否决或修改议案的情况;

2、本次会议无新增提案情况。

一、会议的召开情况

1、　会议召开的时间和地点:

2、　时间:2008年1月11日下午

3、　地点:上海市保定路527号公司8楼

4、　会议召集人:公司董事会

5、　会议召开方式:本次会议采取现场投票的方式,其中股权激励议案采取现场投票和独立董事征集投票相结合的表决方式。

6、　会议主持人:公司董事长葛文耀先生

7、　本次会议的召集、召开符合《公司法》、《公司章程》及相关法律法规的规定。

二、会议的出席情况

参加本次会议表决的股东及股东代理人共35名,代表股份103,248,375股,占公司总股本的58.9118%;公司董事、监事和高级管理人员,公司聘请的律师出席了本次会议。

三、议案的审议和表决情况

本次会议记名投票表决,审议通过了如下事项:

1、以特别决议审议通过《上海家化联合股份有限公司限制性股票激励计划(草案修订稿)》,并逐项审议通过《上海家化联合股份有限公司限制性股票激励计划(草案修订稿)》中的以下内容:

(1)限制性股票的种类、来源和数量;

(2)激励对象的确定依据和范围;

(3)董事、高级管理人员各自被授予的限制性股票数量;

(4)激励计划的有效期、限制性股票的禁售期和解锁期;

(5)限制性股票的授予条件和解锁条件;

(6)限制性股票的授予价格;

(7)限制性股票的授予数量和授予价格的调整方法和程序;

(8)激励计划的变更与终止;

(9)授权董事会办理激励计划实施的相关手续(包括但不限于信息披露、股份登记、过户等)。

2、审议通过《上海家化联合股份有限公司股东大会累积投票制实施细则》。

具体表决结果见附件。

四、律师见证情况

本次会议公司董事会聘请国浩律师集团(上海)事务所律师方杰先生出席会议见证并出具法律意见书,该所律师认为,公司本次股东大会的召集、召开程序符合法律、法规和《公司章程》的规定;召集人和出席会议的人员的资格合法、有效;表决程序符合《公司章程》的规定,表决结果合法有效。

五、备查文件目录

1、上海家化联合股份有限公司2008年第一次临时股东大会决议;

2、律师事务所出具的法律意见书。

**上海家化联合股份有限公司董事会**

**2008年1月12日**

附:大会表决结果:

1、限制性股票的种类、来源和数量

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:100(一佰)股

占0.0001 %

弃权:1,283(一仟二佰八拾三)股

占0.0012 %

2、激励对象的确定依据和范围

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:100(一佰)股

占0.0001 %

弃权:1,283(一仟二佰八拾三)股

占0.0012 %

3、董事、高级管理人员各自被授予的限制性股票数量

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:100(一佰)股

占0.0001 %

弃权:1,283(一仟二佰八拾三)股

占0.0012 %

4、激励计划的有效期、限制性股票的禁售期和解锁期

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:100(一佰)股

占0.0001 %

弃权:1,283(一仟二佰八拾三)股

占0.0012 %

5、限制性股票的授予条件和解锁条件

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:100(一佰)股

占0.0001 %

弃权:1,283(一仟二佰八拾三)股

占0.0012 %

6、限制性股票的授予价格

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:0(零)股

占0.0000 %

弃权:1,383(一仟三佰八拾三)股

占0.0013 %

7、限制性股票的授予数量和授予价格的调整方法和程序

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:0(零)股

占0.0000 %

弃权:1,383(一仟三佰八拾三)股

占0.0013 %

8、激励计划的变更与终止

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:0(零)股

占0.0000 %

弃权:1,383(一仟三佰八拾三)股

占0.0013 %

9、授权董事会办理激励计划实施的相关手续(包括但不限于信息披露、股份登记、过户等)。

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,246,992(一亿零三佰二拾四万六仟九佰九拾二)股

占99.9987 %

反对:0(零)股

占0.0000 %

弃权:1,383(一仟三佰八拾三)股

占0.0013 %

10、审议《上海家化联合股份有限公司股东大会累积投票制实施细则》

参加表决的股数为:103,248,375(一亿零三佰二拾四万八仟三佰七拾五)股,意见如下:

同意:103,247,092(一亿零三佰二拾四万七仟零九拾二)股

占99.9988 %

反对:141(一佰四拾一)股

占0.0001 %

弃权:1,142(一仟一佰四拾二)股

占0.0011 %