申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金

招募说明书(第七次更新)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2008年5月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2008年3月31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。

毛剑鸣先生,董事,1969年出生。美国肯特州立大学金融博士毕业。1992年至1994年在阿克隆大学任经济系助教,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年任富兰克林邓普顿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,现任公司副总裁。

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。

Vincent Trouillard-Perrot,自2007年12月起任申万巴黎基金管理有限公司监事。法国巴黎金融市场研究院硕士毕业。1991年至2000年先后在法国巴黎银行韩国首尔分公司,法国巴黎银行总部及法国巴黎银行香港分公司工作。2000年至2003年在法国巴黎巴私人银行香港分公司任香港及北亚地区首席营运官。2003年至2007年任法国巴黎资产管理有限公司日本分公司首席代表及总裁。2007年10月至今兼任法国巴黎资产管理有限公司亚洲分公司首席执行官。

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)高级管理人员

毛剑鸣先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。

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。

(4)督察长:

来肖贤先生,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。

(5)基金经理

李源海先生,武汉大学经济学硕士。自1999年起从事金融工作,曾在中国银行深圳分行从事外汇、产品开发、风险管理业务;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年起从事基金行业,历任万家基金管理有限公司(原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,2004年9月至2005年10月任万家增强收益债券型证券投资基金(原天同保本增值证券投资基金)基金经理;2006年7月至2007年7月任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理,2006年2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,2008年7月起同时任申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金基金经理。

(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)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)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)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:95568
联系人:李群
电话:010－58351666－8240
传真:010－58560794
网址:www.cmbc.com.cn

(4)中信银行股份有限公司
法定代表人:孔丹
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
客户服务电话:95558
电话:010－65541405
传真:010－65541281
联系人:秦莉

(5)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

(6)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:上海市浦东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝幼一
联系人:芮敏祺
电话:021－3867 6161－161
传真:021－3867 0161
客户服务热线:4008888666
公司网站:www.gtja.com

(7)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
联系人:魏明
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:(010)65182261
公司网站:www.csc108.com

(8)海通证券股份有限公司
地址:上海市广东路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

(9)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

(10)中国银河证券股份有限公司
注册地址:北京西城区金融大街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

(11)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

(12)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:上海市浦东新区浦电路438号双鸽大厦17楼A-C
法定代表人:王明权
联系人:刘晨
电话:021－68823685
网站:www.ebscn.com

(13)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号教育出版大厦6楼
法定代表人:姚江涛
联系人:余雅娜
电话:0791－6768763
网站:www.scstock.com

(14)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: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机构。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供的资产配置方案,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投资的投资建议报告。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

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2008年3月31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	21,346,956.00	19.62%
债券	63,377,503.00	58.25%
权证	–	
银行存款和清算备付金	22,763,915.14	20.92%
其他资产	1,314,043.70	1.21%
合　计	108,802,417.84	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	3,327,650.00	3.10%
C	制造业	9,920,600.00	9.24%
C0	其中:食品、饮料	2,261,000.00	2.11%
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	3,644,500.00	3.39%
C5	电子	–	–
C6	金属、非金属	1,172,200.00	1.09%
C7	机械、设备、仪表	2,056,900.00	1.92%
C8	医药、生物制品	786,000.00	0.73%
C99	其他	–	–
D	电力、煤气及水的生产和供应业	–	–
E	建筑业	–	–
F	交通运输、仓储业	692,000.00	0.64%
G	信息技术业	–	–
H	批发和零售贸易	1,739,450.00	1.62%
I	金融、保险业	3,642,250.00	3.39%
J	房地产业	719,400.00	0.67%
K	社会服务业	1,305,606.00	1.22%
L	传播与文化产业	–	–
M	综合类	–	–
	合　计	21,346,956.00	19.88%

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	600036	招商银行	85,000	2,734,450.00	2.55%
2	600309	烟台万华	50,000	1,674,500.00	1.56%
3	600096	云天化	25,000	1,550,000.00	1.44%
4	000858	五粮液	55,000	1,331,000.00	1.24%
5	000983	西山煤电	30,000	1,231,500.00	1.15%
6	000069	华侨城A	30,000	1,223,700.00	1.14%
7	600628	新世界	80,000	1,038,400.00	0.97%
8	600582	天地科技	20,000	955,200.00	0.89%
9	000937	金牛能源	25,000	949,750.00	0.88%
10	000568	泸州老窖	15,000	930,000.00	0.87%

4. 期末债券投资组合

券种	市值(元)	占净值比例
央行票据	48,154,000.00	44.84%
国家债券	14,021,981.70	13.06%
企业债券	1,201,521.30	1.12%
合　计	63,377,503.00	59.01%

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	21国债⒂	11,063,981.70	10.30%
2	07央票31	9,712,000.00	9.04%
3	08央票07	9,614,000.00	8.95%
4	08央票16	9,610,000.00	8.95%
5	08央票25	9,609,000.00	8.95%

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)
应收利息	607,587.99
深交所交易保证金	500,000.00
应收申购款	107,675.22
权证保证金	98,780.49
应收证券清算款	–
合　计	1,314,043.70

(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

7. 基金因投资可分离可转换债券而被动获得的权证

代码	名称	获得数量	成本	期末持有数量	期末持有市值
580018	中远CWB1	686	4,782.77	–	–
580019	石化CWB1	157,459	367,192.87	–	–

十二、基金的业绩

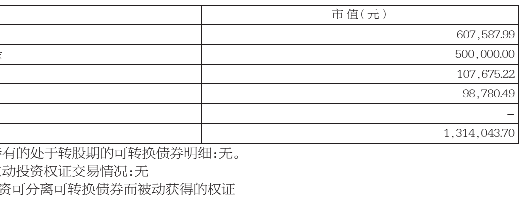
本基金的过往业绩不代表未来表现。

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	57.53%	0.84%	3.21%	0	54.32%	0.84%
2008年1月1日至2008年3月31日	-5.25%	0.73%	1.03%	0	-6.28%	0.73%
自基金合同生效日至2008年3月31日	87.70%	0.58%	9.34%	0	78.36%	0.58%

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收益率的变动比较。



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图

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:

$H = E \times 1.2\% \div$ 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:

$H = E \times 0.25\% \div$ 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
持有不满1年	0.5%
持有满1年、不满2年	0.25%
持有满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、变更了基金管理人董事会董事信息。经本公司2007年12月6日举行的第三次股东会选举,毛剑鸣先生担任本公司第二届董事会董事,唐熹明先生不再担任董事;Max Diulius先生担任本公司第二届董事会董事,Francois Petit-Jean先生不再担任董事。董事会其他成员不变;

2、变更了基金管理人监事会监事信息。经本公司2007年12月6日举行的第三次股东会选举,Vincent Trouillard-Perrot先生担任本公司第二届监事会监事,卢骐先生不再担任监事。监事会其他成员不变;

3、变更了基金管理人高级管理人员部分信息。经中国证监会证监许可(2008)472号文批准,毛剑鸣先生担任本公司总裁。过振华先生不再担任本公司代理总裁;

4、变更了基金托管人的部分信息;

5、变更了部分代销机构的联系信息;

6、更新了投资组合报告,数据截至日期为2008年3月31日;

7、更新了基金的业绩部分,数据截至日期为2008年3月31日;

8、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2007年12月1日至2008年5月31日发布的有关公告。

十五、其他应披露事项

自2007年12月1日至2008年5月31日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2007年12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》的关于在中国建设银行推出开放式证券投资基金定期定额投资计划的公告;

2、2007年12月7日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的关于开通中国建设银行龙卡基金网上交易的提示性公告;

3、2007年12月11日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的关于开通中国建设银行龙卡基金网上交易的公告;

4、2007年12月11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电话直销交易申购费率优惠的公告;

5、2008年1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》(第六次);

6、2008年1月18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在国泰君安证券股份有限公司开展网上费率优惠的公告;

7、2008年1月21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民生银行为旗下基金代销机构的公告;

8、2008年1月21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年第四季度报告》;

9、2008年1月26日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加江南证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告;

10、2008年2月26日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于在中国建设银行开通旗下基金之间转换业务的公告;

11、2008年3月5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参与中国建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告;

12、2008年3月5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在中国银河证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告;

13、2008年3月7日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的本公司关于申万巴黎盛利强化配置混合型证券投资基金分红的公告;

14、2008年3月29日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的本基金2007年年度报告;

15、2008年4月1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继续参与中国工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告;

16、2008年4月4日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司总经理任职公告;

17、2008年4月11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信银行为旗下基金代销机构的公告;

18、2008年4月19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2008年第一季度报告》;

19、2008年5月6日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的本公司关于旗下基金参与中国民生银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告;

20、2008年5月28日刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》的关于开通中国农业银行金穗卡基金网上交易的公告。

签署日期:2008年6月25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7月12日

证券代码:600601　证券简称:方正科技　编号:临2008-009号

方正科技集团股份有限公司为控股子公司提供担保的公告

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。

(一)担保情况概述

本公司为上海北大方正科技电脑系统有限公司向中国农业银行上海市分行营业部申请流动资金贷款总额为人民币贰亿元及其相关费用提供连带责任担保,期限一年。

(二)被担保人基本情况

上海北大方正科技电脑系统有限公司,注册资本人民币5,000万元,主营业务为生产和销售电子计算机及配件、软件、文教用品、办公机械设备、电子产品等。截至2007年12月31日,该公司净资产为人民币605,912,444.05元,负债率为25.6%,2007年实现净利润人民币45,411,052.64元。

本公司持有上海北大方正科技电脑系统有限公司100%的股权。

(三)　担保协议的主要内容

本公司将与中国农业银行上海市分行营业部签署担保合同,为上海北大方正科技电脑系统有限公司向中国农业银行上海市分行营业部申请流动资金贷款总额为人民币贰亿元及其相关费用提供连带责任担保,期限一年。

(四)董事会意见

公司于2008年7月10日以通讯表决方式召开公司第八届董事会2008年第五次会议,会议符合《公司法》、《证券法》及公司章程的有关规定,会议审议通过了本公司为上海北大方正科技电脑系统有限公司向中国农业银行上海市分行营业部申请流动资金贷款总额为人民币贰亿元及其相关费用提供连带责任担保,期限一年的议案。

(五)累计对外担保数量及逾期担保的数量

截止2008年3月31日,本公司实际发生的对控股子公司担保总计6.47亿元,对控股股东担保4.1亿元,无逾期担保。

(六)备查文件目录

1、《担保合同》

2、上海北大方正科技电脑系统有限公司的营业执照复印件

方正科技集团股份有限公司董事会
2008年7月11日

股票代码:600817　股票名称:ST宏盛　编号:临2008-048

上海宏盛科技发展股份有限公司董事会决议公告

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。

公司于2008年7月7日通过传真、电子邮件方式向全体董事、监事及高级管理人员发出了召开2008年度董事会第三次临时会议的通知。公司董事会2008年度第三次临时会议于2008年7月10日下午在公司会议室召开,本次董事会应出席董事6名,实际出席董事4名。董事朱方明、吴崇林、张禹顺、贾鲁燕出席了会议,全体监事和公司高级管理人员列席了会议。会议由董事朱方明主持。根据公司章程的规定,本次会议有效。会议审议通过了以下议案:

一、关于修改《董事会审计委员会工作细则》部分内容的议案;

原细则第三条为:审计委员会成员由四名董事组成,独立董事占多数,委员中至少有一名独立董事为专业会计人士。

修改为:审计委员会成员由三名董事组成,独立董事占多数,委员中至少有一名独立董事为专业会计人士。

二、关于修改《董事会薪酬与考核委员会工作细则》部分内容的议案;

原细则第四条为:薪酬与考核委员会成员由四名董事组成,独立董事占多数。

修改为:薪酬与考核委员会成员由三名董事组成,独立董事占多数。

三、关于调整第六届董事会专门委员会人员构成的议案;

决定调整第六届董事会专门委员会人员构成如下,战略委员会:召集人朱方明,委员吴崇林、张禹顺;审计委员会:召集人张禹顺,委员朱方明、贾鲁燕;提名委员会:召集人贾鲁燕,委员朱方明、张禹顺;薪酬与考核委员会:召集人张禹顺,委员吴崇林、贾鲁燕。

四、关于发放独立董事津贴的议案;

董事会同意每年给予独立董事五万元的独立董事津贴(含税)。

五、关于确定2008年度公司董事会临时负责人薪酬标准的议案;

公司董事会临时负责人朱方明先生年薪人民币50万元。在公司状况没有根本性改变之前,只维持原薪酬人民币30万元,即制定年薪的60%。

六、关于确定2008年度公司董事兼代理总经理薪酬标准的议案;

公司董事兼代理总经理吴崇林先生年薪人民币30万元。在公司状况没有根本性改变之前,只维持原薪酬人民币18万元,即制定年薪的60%。

七、关于确定2008年度公司高级管理人员年度薪酬的议案;

公司副总经理陶正德先生年薪人民币12万元;公司副总经理唐宝华先生年薪人民币12万元。

根据《公司章程》的相关规定,上述第四、五、六项议案尚需提交公司股东大会审议通过。

特此公告。

上海宏盛科技发展股份有限公司董事会
二〇〇八年七月十二日

新世纪基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券有限责任公司基金定投优惠活动的公告

为满足广大投资人的理财需求,经与中信建投证券有限责任公司(以下简称"中信建投证券")协商一致,新世纪基金管理有限公司(以下简称"本公司")决定自2008年7月14日起至2009年12月31日参加中信建投证券推出的基金定投优惠活动。

开放式基金定投指投资人可通过本公司指定的基金销售机构提交申请,约定每月扣款时间和扣款金额,由销售机构于每月约定扣款日在投资人指定资金账户内自动完成扣款和基金申购申请的一种长期投资方式。

该项业务目前适用于本公司管理的新世纪优选分红混合型证券投资基金(简称:世纪分红,基金代码:519087),本公司今后发行的开放式基金将根据具体情况确定是否适用于上述业务。现将有关事宜公告如下:

一、活动时间:

2008年7月14日至2009年12月31日全部法定基金交易日。

二、活动内容:

1.投资者通过中信建投证券网上交易系统签订定期定额申购上述基金的,原申购费率高于0.6%的,享受费率4折优惠,若优惠折扣后费率低于0.6%,则按0.6%执行;原申购费率等于或低于0.6%的,则按原费率执行。

2.投资者通过中信建投证券柜台现场办理定期定额申购上述基金的,原申购费率高于0.6%的,享受费率8折优惠,若优惠折扣后费率低于0.6%,则按0.6%执行;原申购费率等于或低于0.6%的,则按原费率执行。

3.世纪分红基金申购费率请参见《基金合同》、《招募说明书》及相关公告。

三、投资者可以通过以下途径咨询有关事宜:

(一)中信建投证券客户服务电话:400-888-8108
(二)中信建投证券网站:http://www.csc108.com
(三)新世纪基金管理有限公司客户服务热线:400-710-8866(免长途)
(四)新世纪基金管理有限公司网站:http://www.ncfund.com.cn

四、风险提示:

新世纪基金管理有限公司以保障投资者利益为己任,充分重视投资者教育工作,特此提醒广大投资者正确认识投资基金所存在的风险,慎重考虑、谨慎决策,做理性的基金投资者,享受长期投资理财的快乐!

特此公告。

新世纪基金管理有限公司
二〇〇八年七月十二日

新世纪基金管理有限公司关于暂停中国农业银行网上交易的公告

新世纪基金管理有限公司(以下简称"公司")根据中国农业银行(以下简称"农行")的通知,由于受农行系统演练的影响,公司于2008年7月13日(周日)凌晨2:00至下午5:00暂停农行网上交易业务。持有农行金穗卡的用户在上述时间段不能通过公司网站进行网上交易,包括基金日常交易业务(包括开户、认/申购、赎回、分红方式选择等)。请广大投资者提前做好相关安排。由此给您带来不便,敬请谅解。

特此公告。

新世纪基金管理有限公司
二零零八年七月十二日

证券代码:600057　股票简称:夏新电子　编号:临2008-026号

夏新电子股份有限公司
控股股东股权质押及质押解除情况公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,对公告的虚假记载、误导性陈述或重大遗漏负连带责任

本公司控股股东夏新电子有限公司对分别于2007年8月23日和2007年9月27日质押给中国进出口银行的3500万股和5300万股本公司限售流通股(共计8800万股)办理了质押登记解除,质押登记解除日期为2008年7月11日。

以上股权质押解除已在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了相关手续。

特此公告。

夏新电子股份有限公司董事会
二〇〇八年七月十二日

证券简称:兴发集团　证券代码:600141　公告编号:临2008—32

湖北兴发化工集团股份有限公司股权质押公告

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、误导性陈述或重大遗漏负连带责任。

根据《上海证券交易所股票上市规则》的有关规定,现将本公司控股股东宜昌兴发集团有限责任公司所持本公司股票质押的有关事宜公告如下:

宜昌兴发集团有限责任公司(持有本公司股票46,971,434股股份,占本公司总股本的18.64%)已于2008年7月10日在中国证券登记结算有限责任公司上海分公司办理了质押登记手续,将其所持有的本公司800万股无限售流通股股份质押给兴山县农村信用合作联社,质押登记日为2008年7月10日,质押期限为五年。

特此公告。

湖北兴发化工集团股份有限公司
董 事 会
二〇〇八年七月十二日

股票简称:亚盛集团　股票代码:600108　编号:临2008—018

甘肃亚盛实业(集团)股份有限公司
非公开发行股票工作进展公告

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。

本公司于2007年11月29日召开的第四届董事会十六次会议审议通过了公司非公开发行股票相关议案(所涉及资产未经评估、审计),相关公告于2007年11月30日在《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和上海证券交易所网站上披露。

目前本公司的非公开发行股票工作仍在积极推进之中,因该工作涉及的内容较多,地域分布较广,评估、审计等相关准备工作所需时间较长,暂无法估计评估、审计工作所需的时间,敬请广大投资者注意投资风险。

特此公告。

甘肃亚盛实业(集团)股份有限公司董事会
二〇〇八年七月十一日

银华基金管理有限公司关于基金经理变更公告

因工作需要,经银华基金管理有限公司研究决定,蒋伯龙先生不再担任"银华核心价值优选股票型证券投资基金"和"银华优质增长股票型证券投资基金"的基金经理。况群峰先生将继续担任上述两只基金的基金经理。

上述基金经理调整事项已按规定报中国证监会及北京证监局备案。

特此公告。

银华基金管理有限公司
2008年7月12日

证券代码:002205　证券简称:国统股份　编号:2008-035

新疆国统管道股份有限公司中标公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

2008年7月11日,我公司收到东莞市城建工程管理局《中标通知书》,通知确定本公司为东莞市东江与水库联网供水水源工程B1标(东江取水泵站至秦岗圩泵站段)输水管材采购中标单位,中标价为人民币壹亿玖仟壹佰叁拾捌万捌仟陆佰柒拾零元零角叁分(191,388,670.03元)。

公司将于近期签订工程合同,具体内容待合同签订后另行公告。

特此公告

新疆国统管道股份有限公司董事会
二〇〇八年七月十一日

证券代码:002234　证券简称:民和股份　公告编号:2008-003

山东民和牧业股份有限公司关于更换保荐代表人的公告

本公司及董事会全体成员保证信息披露的内容真实、准确、完整,没有虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

本公司接到保荐机构华泰证券股份有限公司《关于更换保荐代表人的函》,原保荐代表人周学群先生提出辞职且正在办理离职手续,华泰证券股份有限公司决定委派保荐代表人王天红先生接替周学群先生的工作,执行对本公司的持续督导保荐责任。

本次变更后,本公司保荐代表人为刘惠萍女士和王天红先生。

特此公告。

山东民和牧业股份有限公司董事会
二〇〇八年七月十一日