申万巴黎深证成指分级证券投资基金招募说明书

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
2010年9月

本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财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。

重要提示

申万巴黎深证成指分级证券投资基金(以下简称"本基金")由申万巴黎基金管理有限公司(以下简称"本公司"或"本基金管理人")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》、《申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金合同》(以下简称《基金合同》)及其他有关规定募集,并经中国证监会2010年8月9日证监许可【2010】1066号文核准募集。

本基金管理人保证《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。

本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本基金财产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。

基金的过往业绩并不预示其未来的表现。

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回基金产生的流动性风险,基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险(如申万收益份额与申万进取份额持有人的特有风险、基金份额的折/溢价交易风险、运作终止风险、份额配对转换及份额折算风险)等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

一、绪 言

《申万巴黎深证成指分级证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书"或"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》、《深圳证券交易所证券投资基金上市规则》及其他相关法律法规及《申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金合同》("《基金合同》")编写。

本基金管理人承诺本招募说明书不存在任何虚假内容、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。本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。

本招募说明书由本基金管理人根据《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。投资者自依《基金合同》取得基金份额,即成为基金份额持有人和《基金合同》当事人,其持有本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。本基金投资者欲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》。

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:

《招募说明书》或本招募说明书	《申万巴黎深证成指分级证券投资基金招募说明书》,即用于公开披露本基金的基金管理人及基金托管人、相关服务机构、基金份额分级、基金的募集、基金合同的备案、申万深成份额的申购与赎回、申万收益份额和申万进取份额的上市交易、基金份额的登记、系统内转托管和跨系统转登记等其他相关业务、基金的份额配对转换、基金份额的交易、基金份额的申购和赎回、基金的投资、基金的财产、基金资产的估值、基金的收益与分配、基金的费用与税收、申万收益份额与申万进取份额的终止运作、基金的信息披露、风险揭示、基金的终止与清算、基金合同的内容摘要、基金托管协议的内容摘要、对基金份额持有人的服务、其他应披露事项、招募说明书的存放及查阅方式、备查文件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
《基金合同》	《申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金合同》及对基金合同的任何有效的修订和补充
《托管协议》	基金管理人与基金托管人签订的《申万巴黎深证成指分级证券投资基金托管协议》及其任何有效修订和补充
中国	中华人民共和国(仅为《基金合同》目的的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	中国现行有效并公布实施的法律、行政法规、部门规章及规范性文件
《基金法》	《中华人民共和国证券投资基金法》
《销售办法》	《证券投资基金销售管理办法》
《运作办法》	《证券投资基金运作管理办法》
《信息披露办法》	《证券投资基金信息披露管理办法》
元	中国法定货币人民币元
基金或本基金	依据《基金合同》所募集的申万巴黎深证成指分级证券投资基金
申万深成份额	申万巴黎深证成指分级证券投资基金之基础份额
申万收益份额	申万巴黎深证成指分级证券投资基金之稳健收益类份额
申万进取份额	申万巴黎深证成指分级证券投资基金之积极进取类份额
基金份额分级	本基金的基金份额包括申万巴黎深证成指分级证券投资基金之基础份额、申万巴黎深证成指分级证券投资基金之稳健收益类份额与申万巴黎深证成指分级证券投资基金之积极进取类份额。申万收益份额、申万进取份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变
年基准收益率	本基金为申万收益份额设定的每年附条件可实现的收益率,申万收益份额在本基金符合《基金合同》约定的条件下每个自然年度都可实现年基准收益率,年基准收益率=一年期银行定期存款利率(税后)+3.00%。年基准收益率对应的日分配金额称为日基准收益,日基准收益以1.000元面值为基准采取单利进行计算
《发售公告》	《申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金份额发售公告》
上市交易公告书	《申万巴黎深证成指分级证券投资基金之申万收益份额与申万进取份额上市交易公告书》
《业务规则》	申万巴黎基金管理有限公司、深圳证券交易所和中国证券登记结算有限责任公司的相关业务规则
中国证监会	中国证券监督管理委员会
银行监管机构	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	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
基金份额持有人	根据《基金合同》及相关文件合法取得本基金基金份额的投资者
基金代销机构	符合《销售办法》和中国证监会规定的其他条件,取得基金代销业务资格,并与基金管理人签订基金销售与服务代理协议,代为办理本基金发售、申购、赎回和其他基金业务的代理机构,以及可通过深圳证券交易所交易系统办理基金销售业务的会员单位
会员单位	指深圳证券交易所会员单位
销售机构	基金管理人及基金代销机构
基金销售网点	基金管理人的直销中心及基金代销机构的代销网点
注册登记业务	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
基金注册登记机构	申万巴黎基金管理有限公司或其委托的其他符合条件的办理基金注册登记业务的机构。本基金的注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司
上市交易所	深圳证券交易所
《基金合同》当事人	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,包括基金管理人、基金托管人和基金份额持有人
个人投资者	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	符合法律法规规定可以投资证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织
合格境外机构投资者	符合《合格境外机构投资者境内证券投资管理办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构
投资者	个人投资者、机构投资者和合格境外机构投资者和法律法规或中国证监会允许购买开放式证券投资基金的其他投资者的总称
基金合同生效日	基金募集达到法律规定及《基金合同》规定的条件,基金管理人聘请法定机构验资并办理完毕基金备案手续,获得中国证监会书面确认之日
募集期	自基金份额发售之日起不超过3个月的期限
基金存续期	《基金合同》生效后合法存续的不定期之期间
日/天	公历日
月	公历月
工作日	上海证券交易所和深圳证券交易所的正常交易日
开放日	销售机构办理本基金份额申购、赎回等业务的工作日
T日	申购、赎回或办理其他基金业务的申请日
T+n日	自T日起第n个工作日(不包含T日)
销售场所	场外销售场所和场内销售场所,分别简称"场外"和"场内"
场外	通过深圳证券交易所交易系统外的销售机构办理本基金基金份额的认购(场外认购的全部份额将确认为申万深成份额)、申万深成份额的申购和赎回的场所
场内	通过深圳证券交易所内具有相应业务资格的会员单位利用深圳证券交易所交易系统办理本基金基金份额的认购(场内认购的全部份额将按1:1的比率确认为申万收益份额与申万进取份额)、申万收益份额与申万进取份额上市交易、申万深成份额的申购和赎回的场所
认购	在本基金募集期内投资者通过场内或场外购买本基金基金份额的行为
发售	在本基金募集期内,销售机构向投资者销售本基金份额的行为
申购	基金投资者根据基金销售网点规定的手续,向基金管理人通过场内或场外购买申万深成份额的行为。申万深成份额的日常申购自《基金合同》生效后不超过3个月的时间开始办理
赎回	基金投资者根据基金销售网点规定的手续,通过场内或场外向基金管理人卖出申万深成份额的行为。申万深成份额的日常赎回自《基金合同》生效后不超过3个月的时间开始办理
巨额赎回	在单个开放日,申万深成份额的基金份额净赎回申请(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)超过上一日本基金总份额(包括申万深成份额、申万收益份额、申万进取份额)的基金总份额的10%时的情形
上市交易	投资者通过场内会员单位以集中竞价的方式买卖申万收益份额、申万进取份额的行为
基金账户	基金注册登记机构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余额及其变动情况的账户
交易账户	各销售机构为投资者开立的记录投资者通过该销售机构办理基金交易所引起的基金份额的变动及结余情况的账户
注册登记系统	中国证券登记结算有限责任公司开放式基金注册登记系统,通过场外销售机构认购、申购的基金份额登记在注册登记系统
证券登记结算系统	中国证券登记结算有限责任公司深圳分公司证券登记结算系统,通过场内会员单位认购、申购或买入的基金份额登记在证券登记结算系统
场外份额	登记在注册登记系统下的基金份额
场内份额	登记在证券登记结算系统下的基金份额
系统内转托管	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统内不同销售机构(网点)之间或证券登记结算系统内不同会员单位(席位)之间进行转托管的行为
跨系统转登记	基金份额持有人将其持有的基金份额在注册登记系统和证券登记结算系统之间进行转登记的行为
份额配对转换	根据《基金合同》的约定,本基金的申万深成份额与申万收益份额、申万进取份额之间的配对转换,包括分拆与合并两个方面
分拆	根据《基金合同》的约定,基金份额持有人将其持有的每两份申万深成份额的场内份额申请转换成一份申万收益份额与一份申万进取份额的行为
合并	根据《基金合同》的约定,基金份额持有人将其持有的每一份申万收益份额与一份申万进取份额进行配对申请转换成两份申万深成份额的场内份额的行为
基金转换	按照本基金合同和基金管理人届时有效公告规定的条件,投资者向基金管理人提出申请将其所持有的基金管理人管理的任一开放式基金(转出基金)的全部或部分基金份额转换为基金管理人管理的其他开放式基金(转入基金)的基金份额的行为
定期定额投资计划	指投资者通过有关销售机构提出申请,约定每期扣款日、扣款金额及扣款方式,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及基金申购申请的一种投资方式
深证成指	由深圳证券市场中选取40只A股作为样本编制而成的成份股指数。深证成指兼具价值尺度与投资标的功能。作为价值尺度,深证成指相对于综合指数能更敏锐、准确地反映出市场波动趋势,具有"先行指标"特性。作为投资标的,深证成指的收益性和流动性指标皆较为突出。
基金收益	基金投资所得的股票红利、股息、债券利息、证券投资收益、证券持有期间的公允价值变动、银行存款利息以及其他收益和因运用基金财产带来的成本或费用的节约
基金资产总值	基金拥有的各类证券及票据价值、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	基金资产总值扣除负债后的净资产值
基金资产估值	计算评估基金资产和负债的价值,以确定基金资产净值的过程
货币市场工具	现金;一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单;剩余期限在三百九十七天以内(含三百九十七天)的债券;期限在一年以内(含一年)的债券回购;期限在一年以内(含一年)的中央银行票据;中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具
指定媒体	中国证监会指定的用以进行信息披露的报刊和互联网网站
不可抗力	《基金合同》当事人不能预见、不能避免且不能克服的客观事件

三、基金管理人

(一)基金管理人概况
名称:申万巴黎基金管理有限公司
住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40楼(200021)
法定代表人:姜国芳
设立日期:2004年1月15日
批准设立机关及批准设立文号:中国证券监督管理委员会,证监基金字【2003】144号文。
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿五仟万元人民币
联系电话:+86-21-23261188
联系人:王菲萍
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,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,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任秘书处、条法处先后担任副主任秘书、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,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。巴黎工商联合商学院毕业;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。

王大东先生,独立董事,1955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年供职于法国雷诺汽车公司北京代表处,先后任副代表和首席代表。2001年至2004年任法国雷诺卡车公司北京代表处任首席代表,2004年至2007年任法国阿尔斯通(中国)投资公司副总裁,2007年9月至今担任欧洲宇航防务集团中国公司副总裁。

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。

赵雷洛先生,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。

Jean Audibert先生,监事,1951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门负责人。2001年至2005年任法国巴黎银行总部现金管理业务负责人。2005年至2008年任新韩巴黎资产信托管理有限公司总裁兼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。

王厚宣先生,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经理、部门副经理。

(5)基金经理

张少华,复旦大学数量经济学硕士。自1999年起从事金融工作,1999年7月至2003年1月在申银万国证券股份有限公司任职,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组。2004年2月加盟申万巴黎基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师、风险管理总部副总监,2009年3月起任风险管理总部总监。2010年2月起任投资管理总部副总监及申万巴黎沪深300价值指数型基金基金经理。

(6)投资决策委员会成员名单

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、基金经理代表、组合投资经理代表。委员会执行委员在会议期间对所决策事项拥有投票权。

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、组合投资经理。非执行委员对需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)依法募集基金,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)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本基金财产;

(5)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,保证所管理的本基金财产和本基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用本基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算本基金份额认购、申购和赎回价格的方法符合《基金合同》等法律文件的规定,按有关规定计算并公告本基金资产净值,确定本基金份额申购、赎回的价格;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他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;

(13)按《基金合同》的约定确定本基金收益分配方案,及时向本基金基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关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召集基金份额持有人大会;

(16)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15年以上;

(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条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,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》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方在基金管理人的授权范围内处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方在基金管理人的授权范围内处理有关基金事务的行为导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

(23)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;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《基金合同》不能生效,本基金管理人承担因募集行为而产生的债务和费用,将已募集资金并加计银行同期存款利息在本基金募集期结束后30日内退还认购本基金份额的投资者;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(26)建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(四)基金管理人的承诺

1、本基金管理人承诺将遵守适用的法律法规和《基金合同》。

2、本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本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财产;

(3)利用本基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益;

(4)向本基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失;

(5)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。

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,本着谨慎的原则为本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)不违反现行有效的有关法律法规、《基金合同》和中国证监会的有关规定,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本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。设立独立于各业务部门和管理部门的风险管理总部对各部门、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总部,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,由公司总经理、副总经理、督察长、风险管理总部总监组成。该委员会主要负责审核本公司的风险控制制度和风险管理流程,以确保对公司整体风险进行风险评估的识别、监控与管理;对本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;负责对本公司所管理的基金的投资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控制、评估和控制管理;决定对公司内部员工严重违法、违规事件的调查,并依据调查结果向公司管理层建议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《公司章程》赋予督察长的所有职权,可列席本基金管理人的任何会议,对基金运作、内部管理、制度执行及遵规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并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)监察稽核总部:该部门的工作主要对公司董事会负责。监察稽核总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风险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)风险管理总部:该部门的工作主要对公司管理层负责,为公司管理层提供有关风险评估、测算、日常风险点检查、风险控制措施等方面的报告以及提出有针对性的解决建议。同时,对基金投资、研究、交易、基金业务管理、基金营销、基金会计、信息技术系统、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日常检查,并核查对公司的规章、指引和流程的遵守与执行情况。将检查、核查情况定期向总经理提交独立的风险控制报告,并抄送督察长。

(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、监督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总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比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、经济损失以上三个领域的任何组合损失;

(5)各部门应负责落实相关的风险控制措施;

(6)风险管理总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、客户开户和注册登记管理流程、风险管理流程、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风险管理总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监察稽核总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总部,对公司内控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总部,监察稽核总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总部,该部门的工作主要对公司管理层负责;

(4)各部门主管负有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约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、风险管理总部和投资总监有权对整个投资交易过程实施全程跟踪的在线监控;信息技术总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反内控原则的行为时,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。对各项规范制度完善、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334,018,850,026元
联系电话:010-66105799
联系人:蒋松云

(二)主要人员情况

截至2010年6月末,中国工商银行资产托管部共有员工121人,平均年龄30岁,95%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,依靠严格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2010年6月,托管证券投资基金165只,其中封闭式9只,开放式156只。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、股权基金、QFII资产、QDII资产等产品在内的托管业务体系。2010年初,中国工商银行凭借在2009年国内外托管领域的杰出表现和品牌影响力,先后被英国《全球托管人》和香港《财资》评选为"2009年度中国最佳托管银行",本届《财资》评选首次设立了在亚太地区证券和基金服务领域有突出贡献的年度行业领导者奖项,中国工商银行资产托管部周月秋总经理荣获"年度最佳托管银行家"称号,是仅有的两位获奖人之一。自2004年以来,中国工商银行资产托管服务已经获得23项国内外大奖。

(四)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。2008年,中国工商银行资产托管部再次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性认证SAS70(审计标准第70号)。通过SAS70国际专项认证,表明独立第三方对我行托管服务在风险管理、内部控制方面的健全性和有效性的全面认可。也证明中国工商银行托管服务的风险控制能力已经与国际大型托管银行接轨,达到国际先进水平。目前,已经启动SAS70审计年度化、常规化的项目。

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,督促职能管理部门改进。

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的目的。

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,定期或不定期地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。资产托管部建立专门的灾难恢复中心,制定了基于数据、应用、操作、环境四个层面的完备的灾难恢复方案,并组织员工定期演练。为使演练更加接近实战,资产托管部不断提高演练标准,从最初的按照预订时间演练发展到现在的"随机演练"。从演练结果看,资产托管部完全有能力在发生灾难的情况下两个小时内恢复业务。

5、资产托管部内部风险控制情况

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的共同参与,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)内部风险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。

(五)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

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基金管理人的投资运作,并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人运作基金的其他行为。

当基金托管人发现基金管理人违反《基金法》、《基金合同》或有关法律法规规定的行为时,基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理:

1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题,电话提示基金管理人;

2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题,以书面方式对基金管理人进行提示;

3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他违规交易等行为,书面提示有关基金管理人并报告中国证监会。

五、相关服务机构

(一)基金份额发售机构
1、场外发售机构
(1)直销机构
申万巴黎基金管理有限公司直销中心
住所:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层
法定代表人:姜国芳
电话:+86 21 23261188

(下转A30版)

申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金份额发售公告

申万巴黎基金管理有限公司
2010年9月

重要提示

1、申万巴黎深证成指分级证券投资基金(以下简称"本基金")的募集已于2010年8月11日获中国证监会证监许可【2010】1066号文核准。中国证监会对本基金的核准并不代表中国证监会对本基金的风险和收益作出实质性判断、推荐或者保证。

2、本基金为契约型、开放式、股票型证券投资基金。

3、本基金自2010年9月13日至10月15日,通过申万巴黎基金管理有限公司(以下简称"本公司")直销中心和中国工商银行、申银万国证券股份有限公司以及其他代销机构的代销网点公开发售。

4、本基金的基金份额包括申万巴黎深证成指分级证券投资基金之基础份额(简称"申万深成份额")、申万巴黎深证成指分级证券投资基金之稳健收益类份额(简称"申万收益份额")与申万巴黎深证成指分级证券投资基金之积极进取类份额(简称"申万进取份额")。申万收益份额、申万进取份额的基金份额配比始终保持1:1的比率不变。

5、本基金通过场内、场外两种方式公开发售,其中,场外发售机构包括本公司直销中心和场外代销机构,场内发售机构为本公司直销中心和具有基金销售资格的深圳证券交易所会员单位。

6、本基金的认购代码为:163109。本基金场内认购的基金称为申万深成分级。

7、本基金的发售期为2010年9月13日至10月15日。

8、本基金的募集规模下限为2亿份。

9、本基金发售结束后,投资者场外认购所得的全部份额将确认为申万深成份额;投资者场内认购所得的全部份额将按1:1的比率确认为申万收益份额和申万进取份额。

10、本基金向中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者及合格的境外机构投资者(QFII)募集(法律、法规、规章及其他有关规定禁止投资证券投资基金的除外)。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可以投资开放式证券投资基金的在中国合法注册登记并存续或经政府有关部门批准设立并存续的企业法人、事业法人、社会团体和其他组织;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办法》及相关法律法规规定的可投资于中国境内合法募集的证券投资基金的中国境外的基金管理机构、保险公司、证券公司以及其他资产管理机构。

11、本基金注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司。投资者欲通过场外认购本基金,须开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销中心和指定的基金销售代理机构网点同时为投资者办理场外认购的开户和认购手续;投资者欲通过场内认购本基金,应使用深圳交易所A股帐户或基金账户,已经有该类帐户的投资者不需另行开立。募集期内具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位为投资者办理场内认购的开户和认购手续。

12、本基金《基金合同》生效后,基金管理人将根据有关规定,申请申万收益份额、申万进取份额上市交易。上市交易的有关事项将另行公告。

13、投资者在募集期内可多次认购本基金。认购申请一经销售机构受理,不可以撤销。

14、本基金场外认购采取金额认购的方式,场内认购采取份额认购的方式。认购费在认购时收取并由投资者承担,可用于本基金的市场推广、销售、注册登记等募集期间发生的各项费用。

15、本基金场外认购首次单笔认购最低金额为人民币1,000元,(含认购费,下同),追加认购的单笔认购最低金额为人民币1,000元。本基金场内认购的单笔最低认购份额为1,000份,超过1,000份的须是1,000份的整数倍,且每笔认购最大不得超过99,999,000份。

当发生末日比例配售的情形时,认购申请确认份额不受认购最低限额的限制。

16、投资者认购款项在募集期内产生的利息将折合成基金份额归投资者所有,其中利息转份额以基金注册登记机构的记录为准。

17、销售机构(指本公司的直销中心和代销机构的代销网点)对认购申请的受理并不代表该申请一定成功,而仅代表销售机构确实接受了认购申请,申请的成功与否应以基金注册登记机构的确认结果为准。投资者可在《基金合同》生效后第二天起到原认购网点打印认购成交确认凭证或查询认购成交确认信息。

18、本公告仅对本基金募集的有关事项和规定予以说明。投资者欲了解本基金的详细情况,请详细阅读刊登在2010年9月9日中国证券报、上海证券报和证券时报上的《申万巴黎深证成指分级证券投资基金招募说明书》。

19、本基金的《基金合同》、《招募说明书》、《托管协议》及本公告将同时发布在本公司网站(www.swbnpp.com)和中国工商银行网站(www.icbc.com.cn)。投资者亦可通过本公司网站下载基金业务申请表格和了解本基金募集的相关事宜。

20、各代销机构代销本基金的营业网点以及开户和认购等事项详见各代销机构相关的业务公告。

21、在募集期内,本基金有可能新增代销机构,敬请留意近期本公司及各代销机构的公告,或拨打本公司及各代销机构客户服务电话咨询。

22、对位于未开设代销网点的地区的投资者,可拨打本公司的客户服务电话+86-400 880 8588(免长途话费)或+86-21-962299及直销专线电话+86-21-23261088或代销机构客户服务电话垂询认购事宜。对认购金额在500万元(含)人民币以上的机构投资者和100万元(含)人民币以上的个人投资者,经预约,本公司可提供上门服务。

23、风险提示:

本基金投资于证券市场,基金净值会因为证券市场波动等因素产生波动,投资者在投资本基金前,需充分了解本基金的产品特性,并承担基金投资中出现的各类风险,包括:因政治、经济、社会等环境因素对证券价格产生影响而形成的系统性风险,个别证券特有的非系统性风险,由于基金投资者连续大量赎回本基金产生的流动性风险,本基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险,本基金的特定风险等等。投资者在进行投资决策前,请仔细阅读本基金的《招募说明书》及《基金合同》。

24、本公司可综合各种情况对募集安排做适当调整。

一、本次募集的基本情况

(一)基金名称和基金代码
基金全称:申万巴黎深证成指分级证券投资基金。
场外基金简称:申万巴黎深证成指分级
场内基金简称:申万深成
基金代码:163109。

(二)基金类型与类别
契约型、开放式、股票型证券投资基金。

(三)基金存续期限
本基金的存续期限为不定期。

(四)基金份额面值
每份基金份额初始发售面值为1.00元人民币。

(五)募集规模
本基金最低募集规模为2亿份。

(六)募集对象
本基金向中华人民共和国境内的个人投资者、机构投资者及合格的境外机构投资者(QFII)募集(法律、法规和规章禁止投资证券投资基金的除外)。

(七)募集方式
投资者可通过场内认购和场外认购两种方式认购本基金。

(八)认购账户
投资者欲通过场外认购本基金,须开立中国证券登记结算有限责任公司的深圳开放式基金账户。已经在中国证券登记结算有限责任公司开立深圳开放式基金账户的,则不需要再次办理开户手续。募集期内本公司直销中心和指定的基金销售代理机构网点同时为投资者办理场外认购的开户和认购手续。

投资者欲通过场内认购本基金,应使用深圳交易所A股帐户或基金账户,已经有该类帐户的投资者不需另行开立。募集期内具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位为投资者办理场内认购的开户和认购手续。

(九)认购申请的确认
投资者对本基金的认购申请可能全部确认或部分确认,认购申请成功与否及其确认情况应以本基金《基金合同》生效后基金注册登记机构的确认为准。投资者可在《基金合同》生效后第2个工作日起到各销售网点查询确认情况和认购的基金份额。

(十)认购份额的确认
本基金发售结束后,投资者场外认购所得的全部份额将确认为申万深成份额;投资者场内认购所得的全部份额将按照1:1的比率确认为申万收益份额和申万进取份额。

(十一)销售机构
1、场外销售机构
(1)申万巴黎基金管理有限公司直销中心
地址:上海市淮海中路300号香港新世界大厦40层
邮编:200021
客户服务电话:+86-21-962299或400-880-8588
传真:+86-21- 63353816
网址:www.swbnpp.com

(2)中国工商银行股份有限公司
中国工商银行在全国各省市自治区的37个一级分行的18000多个理财网点为机构和个人投资者办理开户和认购业务。

在发售期间,投资者可以拨打中国工商银行客户服务电话:95588,或访问中国工商银行网址www.icbc.com.cn,进行相关查询。

(3)中国农业银行股份有限公司
中国农业银行在以下省、市的37家分行的指定网点为投资者办理开户和认购业务:北京、上海、深圳、河北、山东、宁夏、福建、黑龙江、安徽、新疆、江苏、江西、湖北、湖南、河南、浙江、内蒙古、山西、辽宁、广西、西藏、宁波、大连、广东、四川、云南、青岛、厦门、新疆兵团、贵州、陕西、甘肃、天津、重庆、吉林、海南、青海。

在发售期间,投资者可以拨打中国农业银行客户服务电话:95599,或访问中国农业银行网址www.abchina.com,进行相关查询。

(4)上海浦东发展银行股份有限公司
浦发银行在以下34个分行的550家指定营业网点办理基金的开户、认购等业务:上海、北京、杭州、宁波、南京、温州、苏州、重庆、广州、深圳、昆明、芜湖、天津、郑州、大连、济南、成都、西安、沈阳、武汉、青岛、太原、长沙、哈尔滨、南宁、南昌、乌鲁木齐、长春、呼和浩特、合肥、兰州、石家庄、福州、贵阳等。

在发售期间,投资者可以拨打浦发银行客户服务电话:95528,或访问浦发银行网址www.spdb.com.cn,进行相关查询。

(5)中国民生银行股份有限公司
民生银行在北京、上海、广州、武汉、大连、杭州、南京、太原、石家庄、重庆、西安、福州、汕头、济南、深圳、宁波、成都、天津、昆明、泉州、苏州、青岛、温州、厦门、郑州、长沙26家分行的300多个网点为投资者办理开户和认购业务。

在发售期间,投资者可以拨打中国民生银行客户服务电话:95568,或访问中国民生银行网址www.cmbc.com.cn,进行相关查询。

(6)中信银行股份有限公司
中信银行在以下55个城市的500多个指定网点办理对所有投资者的开户和认购业务:北京、长沙、成都、昆明、广州、东莞、佛山、武汉、天津、沈阳、重庆、石家庄、青岛、济南、威海、烟台、淄博、济宁、西安、郑州、福州、厦门、泉州、深圳、大连、葫芦岛、抚顺、鞍山、南京、扬州、江都、仪征、常州、武进、无锡、锡山、合肥、泰州、苏州、昆山、常熟、吴江、上海、杭州、绍兴、嘉兴、宁波、温州、上虞、海宁、平湖、余姚、慈溪、富阳、萧山。

在发售期间,投资者可以拨打中信银行客户服务电话95558,或访问中信银行网站http://bank.ecitic.com,进行相关查询。

(7)上海农村商业银行股份有限公司
上海农商银行将在上海市内280个网点为投资者办理开户和认购业务。

在本基金发售期间,投资者可以拨打962999银行客户服务电话,或拨打各营业网点咨询电话,或访问上海农村商业银行网站www.shrcb.com,进行相关查询。

(8)南京银行股份有限公司
南京银行将在以下5个城市中的66个网点为投资者办理开户和认购业务:北京、上海、南京、泰州、无锡。

在本基金发售期间,投资者可以拨打96400公司客户服务电话,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问南京银行网站www.njcb.com.cn,进行相关查询。

(9)申银万国证券股份有限公司
在本基金募集期间,申银万国证券将在以下16个省、4个直辖市、2个自治区的45个城市109家营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:上海、宁波、杭州、温州、嘉兴、衢州、桐乡、金华、南京、无锡、靖江、扬州、南通、苏州、镇江、成都、眉山、泸州、武汉、襄樊、宜昌、黄石、长春、深圳、广州、珠海、重庆、沈阳、大连、南昌、九江、上饶、北京、福州、厦门、哈尔滨、天津、长沙、青岛、海口、西安、合肥、南宁、兰州、乌鲁木齐。

在募集期间,投资者可以拨打申银万国证券客户服务电话:021-962505,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问申银万国证券公司网站www.sw2000.com.cn,进行相关查询。

(10)中信建投证券有限责任公司
中信建投证券有限责任公司在以下20个省、市,64个城市的116家营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:

北京、上海、天津、重庆、深圳、广州、佛山、清远、潮州、揭阳、海口、沈阳、大连、鞍山、锦州、长春、大安、哈尔滨、阿城、武汉、黄石、荆州、宜昌、襄樊、老河口、十堰、长沙、株洲、张家界、上饶、郴州、成都、邛崃、简阳、泸州、广元、合川、黔江、南京、江宁、常州、泰州、兴化、苏州、连云港、杭州、宁波、福州、福清、厦门、南昌、吉安、赣州、瑞金、南康、济南、淄博、烟台、青岛、石家庄、辛集、西安、兰州、金昌。

在发售期间,投资者可以拨打中信建投证券有限责任公司客户服务电话400-8888-108,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问中信建投证券有限责任公司网站www.csc108.com,进行相关查询。

(11)海通证券股份有限公司
海通证券在以下55个主要城市的124家营业部57个服务部共181个营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:深圳、武汉、沈阳、大连、上海、杭州、上虞、北京、长春、吉林、辽源、青岛、广州、汕头、济南、烟台、淄博、泰安、南京、蚌埠、淮安、合肥、南通、绍兴、宁波、苏州、无锡、常州、扬州、福州、海口、昆明、贵阳、遵义、新余、长沙、重庆、成都、威海、天津、郑州、石家庄、太原、西安、营口、鞍山、哈尔滨、大庆、乌鲁木齐、常熟、芜湖、金昌、兰州、南宁、青岛、咸阳。在发售期间,投资者可以拨打海通证券有限责任公司客户服务电话021-962503,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问海通证券有限责任公司网站www.htsec.com,进行相关查询。

(12)国泰君安证券股份有限公司
国泰君安证券有限责任公司在以下28个省、市、自治区100个主要城市的163家营业网点接受办理投资者的注册开放式基金账户和认购业务:

北京、通州、怀柔、天津、石家庄、太原、任丘、晋城、呼和浩特、济源、赤峰、沈阳、大连、长春、吉林、桦甸、舒兰、哈尔滨、齐齐哈尔、深圳、平湖、广州、汕头、顺德、东莞、海口、琼海、儋州、福州、闽清、永泰、厦门、泉州、南宁、南昌、九江、庐山、浔阳、鹰潭、余江、贵溪市、宜春、萍乡、高安、抚州、南丰、上海、南京、无锡、溧水、常州、徐州、邳州、杭州、宁波、余姚、绍兴、衢州、台州、天台、仙居、合肥、济南、临沂、青岛、郑州、荥阳、武汉、荆州、襄樊、宜昌、长沙、常德、桃源、衡阳、衡阳县、株洲、株洲县、成都、金堂、泸州、纳溪、贵阳、清镇、昆明、丽江、个旧、芒市、文山、重庆、石柱、华岩、奉节、巫山、西安、兰州、敦煌市、嘉峪关、酒泉、张掖、乌鲁木齐。

在发行期间,投资者可以拨打国泰君安证券股份有限公司咨询电话:4008888666,或拨打各城市营业网点咨询电话。

(13)招商证券股份有限公司
招商证券股份有限公司在以下的31个主要城市的70家营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:北京、上海、南京、杭州、无锡、武汉、广州、哈尔滨、沈阳、成都、扬州、东莞、珠海、昆明、南宁、佛山、长沙、合肥、福州、深圳、桂林、天津、苏州、西安、柳州、济南、重庆、青岛、郑州、温州、南昌。

在发行期间,投资者可以拨打招商证券股份有限公司咨询电话:95565、4008888111,或拨打各城市营业网点咨询电话。

(14)中国银河证券股份有限公司
中国银河证券股份有限公司在以下59个城市的167家营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:北京、天津、石家庄、秦皇岛、太原、晋中、临汾、呼和浩特、包头、沈阳、长春、哈尔滨、上海、南京、杭州、嘉兴、绍兴、湖州、德清、金华、兰溪、台州、温州、丽水、合肥、马鞍山、福州、南昌、烟台、郑州、武汉、襄樊、宜昌、荆门、长沙、广州、佛山、顺德、汕头、湛江、中山、廉江、南宁、海口、重庆、江津、成都、昆明、西安、兰州、西宁、乌鲁木齐、大连、宁波、厦门、青岛、济南、深圳、东莞。

在发售期间,投资者可以拨打中国银河证券有限责任公司客户服务电话010-68016655,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问中国银河证券有限责任公司网站www.chinastock.com.cn,进行相关查询。

(15)广发证券股份有限公司
广发证券在以下78个城市的189个营业网点为投资人办理开户和认购业务:广州、北京、武汉、荆州、黄石、宜昌、济南、烟台、青岛、东营、合肥、石家庄、保定、秦皇岛、张家口、郑州、天津、长春、沈阳、吉林、辽阳、锦州、葫芦岛、廊坊、哈尔滨、太原、上海、杭州、绍兴、温州、宁波、无锡、南京、南通、苏州、深圳、海口、珠海、汕头、佛山、中山、湛江、昆明、重庆、南宁、兰州、西安、福州、厦门、南平、顺德、东莞、肇庆、清远、惠州、梅州、台山、韶关、普宁、南海、高明、开平、新会、江门、罗定、云浮、南雄、英德、连州、高要、廉江、泉州等。

在本基金发售期间,投资者可以拨打961133公司客户服务电话,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问广发证券公司网站http://www.gf.com.cn,进行相关查询。

(16)光大证券股份有限公司
光大证券股份有限公司在以下33个城市49个营业网点办理对所有投资者的开户和认购业务:北京、天津、哈尔滨、黑河、大庆、齐齐哈尔、长春、沈阳、上海、深圳、福州、佛山、江门、武汉、长沙、东莞、惠州、海口、顺德、广州、南宁、湛江、重庆、成都、遵义、内江、乌鲁木齐、昆明、西安、南京、丹阳、太原、济南。

在募集期间,投资人可以拨打光大证券股份有限公司客户服务电话:10108998或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问光大证券股份有限公司网址www.ebscn.com,进行相关查询。

(17)东方证券股份有限公司
东方证券股份有限公司在以下20个城市的57家营业网点接受办理投资者的基金开户和开放式基金认购、申购、赎回、基金转换等业务:上海、北京、天津、杭州、苏州、武汉、南京、广州、深圳、福州、汕头、南宁、北海、桂林、成都、长沙、沈阳、抚顺、长春、济南。

在发行期间,投资者可以拨打东方证券客户服务热线:95503,或拨打各城市营业网点咨询电话。

(18)信达证券股份有限公司
信达证券在以下37个主要城市的68家营业网点接受办理投资者的开放式基金账户开户、认购、申购、赎回等业务:

北京、上海、天津、成都、杭州、海口、南京、常州、深圳、广州、湛江、茂名、蚌埠、沈阳、新民、大连、盘锦、辽阳、本溪、丹东、东港、阜新、葫芦岛、兴城、朝阳、凌源、营口、盖州、铁岭、调兵山、开源、锦州、福州、郑州、青岛、义务、石家庄。

在本基金发售期间,投资者可以拨打95501公司客户服务电话,或拨打各城市营业网点咨询电话,或访问www.sdb.com.cn公司网站,进行相关查询。

(19)国信证券股份有限公司
国信证券在以下34个主要城市的49家营业网点为投资者办理开户和认购业务:深圳、北京、上海、广州、佛山、惠州、珠海、肇庆、天津、成都、绵阳、宜宾、重庆、福州、厦门、长春、大连、哈尔滨、烟台、青岛、长沙、武汉、西安、南京、杭州、萧山、义乌、无锡、宁波、昆明、合肥、沈阳、太原、郑州。

在发行期间,投资者可以拨打国信证券客户服务热线:95536,或拨打各城市营业网点咨询电话。

(20)华融证券股份有限公司
华融证券在以下23个主要城市的29家营业网点为投资者办理开户和认购业务:北京、上海、广州、深圳、武汉、西安、福州、南京、长沙、株洲、娄底、益阳、衡阳、常德、重庆、成都、合肥、沈阳、太原、天津、乌鲁木齐、阿克苏、克拉玛依。

在发行期间,投资者可以拨打华融证券客户服务热线:010-58568118,或拨打各城市营业网点咨询电话。

(21)长江证券股份有限公司
长江证券在以下49个城市77个营业网点为投资者办理开户和认购业务:武汉、黄石、荆门、钟祥、京山、荆州、公安、十堰、丹江口、仙桃、天门、宜昌、襄樊、孝感、鄂州、黄冈、随州、咸宁、恩施、郑州、新乡、长沙、广州、佛山、惠州、江门、深圳、福州、泉州、厦门、南京、泰州、杭州、慈溪、上海、哈尔滨、齐齐哈尔、大庆、沈阳、大连、济南、青岛、北京、天津、乌鲁木齐、克拉玛依独山子、成都、重庆和西安。

投资者可以拨打长江证券客户服务热线:95579或4008-888-999,也可以拨打各城市营业网点咨询电话,或访问长江证券客户服务网站:www.95579.com。

(22)国联证券股份有限公司
国联证券股份有限公司在以下13个城市的23个营业网点为投资者办理基金销售业务:无锡、宜兴、江阴、上海、杭州、南京、广州、北京、镇江、常州、南通、苏州、泰州。

投资者可以拨打国联证券客户服务热线:0510-82588168,也可以拨打各城市营业网点咨询电话,或访问国联证券客户服务网站:www.glsc.com.cn。

如在募集期内新增代销机构,本公司将另行公告。

2、场内销售机构

(1)直销机构:申万巴黎基金管理有限公司直销中心。

(2)申银万国证券股份有限公司及其他具有基金代销资格的深圳证券交易所会员单位(具体名单可在深交所网站查询)。

(3)本基金募集结束前获得基金代销资格的深圳证券交易所会员单位可通过深圳证券交易所系统办理本基金的场内认购业务。

(十二)募集时间安排与《基金合同》生效

本基金的募集期为2010年9月13日至2010年10月15日。本基金管理人可以根据认购的情况提前终止或延迟募集期,但募集期最多不超过三个月。如遇突发事件,以上基金募集时间可以适当调整。

在本基金的募集期内,在净认购金额达到或超过人民币2亿元,且基金份额持有人不少于200人的条件下,本基金管理人可以根据法律法规及《招募说明书》决定停止本基金的基金份额募集,并在聘请法定验资机构验资后向中国证监会办理本基金的备案手续。本基金管理人办理完毕本基金备案手续后,《基金合同》生效。若未达到法定备案条件,本基金将在自《招募说明书》公告之日起的3个月内继续发售。若3个月日期届满,本基金仍未达到法定备案条件,则《基金合同》不能生效。本基金管理人承担全部募集费用,并将已募集资金加计银行同期活期存款利息在募集期结束后30日内退还给基金认购人。

若《基金合同》生效,投资者的认购资金在募集期间形成的利息收入折算成认购的基金份额,归投资者所有。认购资金利息以注册登记机构的确认结果为准。利息折成认购基金的份额不收取认购费、不受最低认购份额数限制。

二、发售方式及相关规定

(一)场外认购
1、认购方式
本基金的场外认购采用全额缴款、金额认购的方式。
2、认购费率
本基金的场外认购费率如下表:

认购金额(元)	认购费率
100万以下	1%
100万(含)~500万	0.60%
500万(含)~1000万	0.10%
1000万(含)以上	1000元/笔

(下转A30版)

申万巴黎基金管理有限公司申万巴黎深证成指分级证券投资基金基金合同(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
2010年9月

一、基金份额持有人、基金管理人和基金托管人的权利、义务

(一)基金管理人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额,即成为本基金的基金份额持有人和《基金合同》的当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

本基金除申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值计算、《基金合同》终止时的基金清算财产分配、终止申万收益份额与申万进取份额运作后的份额转换外,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。如果申万收益份额与申万进取份额的运作出现终止,则在终止申万收益份额与申万进取份额的运作后,本基金每份基金份额具有同等的合法权益。

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;

(2)自《基金合同》生效之日起,根据法律法规和《基金合同》独立运用并管理基金财产;

(3)依照《基金合同》收取基金管理费以及法律法规规定或中国证监会批准的其他费用;

(4)销售基金份额;

(5)召集基金份额持有人大会;

(6)依据《基金合同》及有关法律规定监督基金托管人,如认为基金托管人违反了《基金合同》及国家有关法律规定,应呈报中国证监会和其他监管部门,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、更换基金代销机构,对基金代销机构的相关行为进行监督和处理;

(9)担任或委托其他符合条件的机构担任基金注册登记机构办理基金注册登记业务并获得《基金合同》规定的费用;

(10)依据《基金合同》及有关法律规定决定基金收益的分配方案;

(11)在《基金合同》约定的范围内,拒绝或暂停受理申万深成份额申购与赎回申请;

(12)在符合有关法律法规和《基金合同》的前提下,制订和调整《业务规则》,决定和调整除调高管理费率和托管费率之外的基金相关费率结构和收费方式;

(13)依照法律法规为基金的利益对被投资公司行使股东权利,为基金的利益行使因基金财产投资于证券所产生的权利;

(14)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;

(15)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;

(16)选择、更换律师事务所、会计师事务所、证券经纪商或其他为基金提供服务的外部机构;

(17)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

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,办理或者委托经中国证监会认定的其他机构代为办理基金份额的发售、申购、赎回和登记事宜;

(2)办理基金备案手续;

(3)自《基金合同》生效之日起,以诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产;

(4)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财产;

(5)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,保证所管理的基金财产和基金管理人的财产相互独立,对所管理的不同基金分别管理,分别记账,进行证券投资;

(6)除依据《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人运作基金财产;

(7)依法接受基金托管人的监督;

(8)采取适当合理的措施使计算基金份额认购、申购、赎回价格的方法符合《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,申万深成份额、申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值,申万收益份额与申万进取份额终止运作后的份额转换比例;

(9)进行基金会计核算并编制基金财务会计报告;

(10)编制季度、半年度和年度基金报告;

(11)严格按照《基金法》、《基金合同》及其他有关规定,履行信息披露及报告义务;

(12)保守基金商业秘密,不泄露基金投资计划、投资意向等。除《基金法》、《基金合同》及其他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;

(13)按《基金合同》的约定确定基金收益分配方案,及时向基金份额持有人分配基金收益;

(14)按规定受理申万深成份额申购与赎回申请,及时、足额支付赎回款项;

(15)依据《基金法》、《基金合同》及其他有关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召集基金份额持有人大会;

(16)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15年以上;

(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条件下得到有关资料的复印件;

(18)组织并参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(19)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,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》导致基金财产的损失或损害基金份额持有人合法权益时,应当承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(21)监督基金托管人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金托管人违反《基金合同》造成基金财产损失时,基金管理人应为基金份额持有人利益向基金托管人追偿;

(22)当基金管理人将其义务委托第三方处理时,应当对第三方在基金管理人的授权范围内处理有关基金事务的行为承担责任;但因第三方在基金管理人的授权范围内处理有关基金事务的行为导致基金财产或基金份额持有人利益受到损失,而基金管理人首先承担了责任的情况下,基金管理人有权向第三方追偿;

(23)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;

(24)基金管理人在募集期间未能达到基金的备案条件,《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存款利息在基金募集期结束后30日内退还认购基金份额的投资者;

(25)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(26)建立并保存基金份额持有人名册,定期或不定期向基金托管人提供基金份额持有人名册;

(27)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(二)基金托管人的权利与义务

1、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,依法律法规和《基金合同》的规定安全保管基金财产;

(2)依《基金合同》约定获得基金托管费以及法律法规规定或监管部门批准的其他收入;

(3)监督基金管理人对本基金的投资运作,如发现基金管理人有违反《基金合同》及国家法律法规行为,对基金财产、其他当事人的利益造成重大损失的情形,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责任公司开设银行间债券托管账户,负责基金投资债券的后台匹配及资金的清算;

(7)提议召开或召集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。

2、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、勤勉尽责的原则持有并安全保管基金财产;

(2)设立专门的基金托管部门,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,负责基金财产托管事宜;

(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,确保基金财产的安全,保证其托管的基金财产与基金托管人自有财产以及不同的基金财产相互独立;对所托管的不同的基金分别设置账户,独立核算,分账管理,保证基金财产的完整以及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《基金法》、《基金合同》及其他有关规定外,不得利用基金财产为自己及任何第三人谋取利益,不得委托第三人托管基金财产;

(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《基金法》、《基金合同》及其他有关规定另有规定外,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、申万深成份额、申万收益份额与申万进取份额的基金份额净值,申万收益份额与申万进取份额终止运作后的份额转换比例;

(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、季度、半年度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;如果基金管理人有未执行《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)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)建立并保存基金份额持有人名册;

(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)按照法律法规和《基金合同》的规定监督基金管理人的投资运作;

(17)参加基金财产清算小组,参与基金财产的保管、清理、估价、变现和分配;

(18)面临解散、依法被撤销或者被依法宣告破产时,及时报告中国证监会和银行监管机构,并通知基金管理人;

(19)因违反《基金合同》导致基金财产损失时,应承担赔偿责任,其赔偿责任不因其退任而免除;

(20)按规定监督基金管理人按法律法规和《基金合同》规定履行自己的义务,基金管理人因违反《基金合同》造成基金财产损失时,应为基金利益向基金管理人追偿;

(21)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(22)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

(三)基金份额持有人的权利与义务

基金投资者购买本基金基金份额的行为即视为对《基金合同》的承认和接受,基金投资者自取得依据《基金合同》募集的基金份额,即成为本基金份额持有人和《基金合同》当事人,直至其不再持有本基金的基金份额。基金份额持有人作为《基金合同》当事人并不以在《基金合同》上书面签章或签字为必要条件。

每份基金份额具有同等的合法权益。

1、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)分享基金财产收益;

(2)参与分配清算后的剩余基金财产;

(3)依照法律法规及《基金合同》的规定,依法转让其持有的申万收益份额与申万进取份额,依法申请赎回其持有的申万深成份额;

(4)按照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)监督基金管理人的投资运作;

(8)对基金管理人、基金托管人、销售机构损害其合法权益的行为依法提起诉讼;

(9)法律法规和《基金合同》规定的其他权利。

2、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、赎回款项及法律法规和《基金合同》所规定的费用;

(3)在其持有的基金份额范围内,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》当事人合法权益的活动;

(5)返还在基金交易过程中因任何原因,自基金管理人、基金托管人及代销机构处获得的不当得利;

(6)执行生效的基金份额持有人大会的决定;

(7)法律法规及中国证监会规定的和《基金合同》约定的其他义务。

二、基金份额持有人大会召集、议事及表决的程序和规则

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。基金份额持有人大会的审议事项应分别由申万深成份额、申万收益份额与申万进取份额的基金份额持有人独立进行表决。基金份额持有人持有的每一基金份额在其对应的份额级别内拥有平等的投票权。

(一)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)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;

(6)变更基金类别;

(7)本基金与其他基金的合并;

(8)终止申万收益份额与申万进取份额的运作;

(9)变更基金投资目标、范围或策略(法律法规和中国证监会另有规定的除外);

(10)变更基金份额持有人大会程序;

(11)对基金当事人权利和义务产生重大影响的其他事项;

(12)法律法规、《基金合同》或中国证监会规定的其他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)法律法规要求增加的基金费用的收取;

(3)在法律法规和《基金合同》规定的范围内调低整本基金的申购费率、调低赎回费率;

(4)因相应的法律法规发生变动而应当对《基金合同》进行修改;

(5)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;

(6)除按照法律法规和《基金合同》规定应当召开基金份额持有人大会的以外的其他情形。

(二)会议召集人及召集方式

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10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60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、单独或合计代表申万深成份额、申万收益份额与申万进取份额各自基金份额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,应当向基金管理人提出书面提议。基金管理人应当自

(下转A30版)