

申万巴黎沪深300 价值指数证券投资基金

招募说明书(第一次更新)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2010年2月11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2010年8月31日,有关财务数据和净值表现截止日为2010年6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
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C000211
法定代表人:姜国芳
设立日期:2004年4月15日
批准设立机关及批准设立文号:中国证监会监管委员会,证监基金字[2003]1144号文。
组织形式:有限责任公司
注册资本:壹亿伍仟万元人民币
存续期限:三十年
联系电话:+86-21-23261188
联系人:王非群
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
0 董事成员
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公司,曾任副经理、党委书记。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上海万国证券有限公司董事长。
毛鸿钧先生,董事,1969年出生,美国密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学教授,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。
杜志先生,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秘书长、主任科员。1993年初至1998年初在交通银行总行处室、条线处先后担任副行长、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,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年任职于中国驻加拿大大使馆经济处。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 Duhaun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开发及运营主管,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营运部主管等。
毛应楼先生,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兼理事长,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处办公室主任,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年在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代表。
袁惠娟女士,独立董事,1938年出生。曾任社会科学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。

赵清洛先生,独立董事,1950年出生。曾任职于司法部香港中国法律服务局、香港何耀权律师事务所、信达律师事务所。现任北京众鑫律师事务所上海分所主任、律师。
0 高级管理人员
姜国芳先生,董事,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研究生毕业,获副博士学位,回国后,先后任中国人民银行行长、局长、农业银行副行长、中国人民银行副行长、国务院体制改革委员会副主任、中国证监会主任。
Jean Audibert先生,董事,1951年出生。1975年毕业于法国巴黎银行,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年任法国巴黎银行总部现金管理业务负责人。2005年至2008年任新加坡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。
王卫滨先生,监事,申万巴黎基金管理有限公司行政管理部门负责人。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副经理。2004年1月加盟本公司。

0 高级管理人员
毛鸿钧先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。
赵国辉先生,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年任申万信达投资管理(亚洲)有限公司副总裁,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。

0 督察长
朱再晋先生,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。
0 基金经理
魏立先生,特许金融分析师(CFA),英国帝国理工大学管理学硕士,上海交通大学工学士。1997年起任上海华虹NEC电子有限公司工程师。2004年起从事金融工作,先后任职于东方证券股份有限公司研究所,富国基金管理有限公司。2006年7月加盟申万巴黎基金管理有限公司任高级行业分析师,2007年9月起任申万巴黎经济混合型证券投资基金基金经理助理兼策略分析师,2009年6月起担任申万巴黎消费增长股票型证券投资基金基金经理。

0 投资决策委员会成员
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,组合投资管理代表,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:研究员负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资管理。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。
0 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
住所:北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址:北京市西城区复兴门内大街55号
法定代表人:姜建清
成立时间:1984年1月1日
注册资本:人民币334,018,850,026元
联系人:蒋晓光
联系电话:010-66105799

三、相关服务机构
(一)基金发售机构
1.直销机构
申万巴黎基金管理有限公司直销中心
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:陈海红 陈翠新
客户服务电话:400 880 8588 或 +86 21 962299

2.代销机构
0 1 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
联系人:田耕
客户服务电话:95588
传真:+86 10 66107914
网址:www.icbc.com.cn
0 2 名称:中国建设银行股份有限公司
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:95533
传真:010 67626544
网址:www.ccb.com.cn
0 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:蒋浩洁
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

0 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188号
法定代表人:胡怀唐
电话:021 58781234
传真:010 83480482
联系人:曹辉
客户服务电话:95559
网址:http://www.bankcomm.com/
0 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:吉晓辉
传真:021 63604199
联系人:汤嘉惠、龚谷云
客户服务电话:95528
公司网址:www.spdb.com.cn

0 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:95568
联系人:陆虹霞
传真:010-83914283
网址:www.cmbc.com.cn

0 7 名称:中信银行股份有限公司
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:孔丹
客服电话:95558
联系人:姜国芳
电话:+86-10-65550827
网址:http://bank.ecitic.com
0 8 名称:深圳发展银行股份有限公司
注册地址:广东省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:周勤
传真:0755 82080406
网址:www.sdb.com.cn

0 9 名称:上海农村商业银行股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号
法定代表人:胡晋
客服电话:021-96299
联系人:吴海清
传真:021-50105124
网址:www.srb.com.cn
0 10 名称:南京银行股份有限公司
注册地址:南京市白下区淮海路50号
办公地址:南京市白下区淮海路50号
法定代表人:林夏
传真:025-85441129
联系人:贺奕
客户服务电话:4008896400
网址:www.njrb.com.cn
0 11 名称:甲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 54053333
联系人:范荣杰
客服电话:021-962505
公司网站:www.sw2000.com.cn
0 12 名称:中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址:北京市朝内大街188号
法定代表人:张佑军
联系人:权唐
开放式基金业务电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010 65182261
公司网站:www.csc108.com
0 13 名称:南通证券股份有限公司
注册地址:上海市南汇区城南路98号
办公地址:上海市广西路689号
法定代表人:王开国
联系人:姜芸、李翠娟
客户服务电话:400-8888-010(全国),021-95553。
或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com
0 14 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号上海银行大厦29层
法定代表人:祝幼一
传真:021-38670161
客户服务热线:4008886666
公司网站:www.gtja.com
0 15 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38-45层
法定代表人:李肖生
联系人:姜芸、林慧思
客户服务电话:400-8888-010(全国),021-95553。
或拨打各城市营业网点咨询电话
公司网站:www.htsec.com
0 16 名称:国寿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号上海银行大厦29层
法定代表人:祝幼一
传真:021-38670161
客户服务热线:4008886666
公司网站:www.gtja.com
0 17 名称:广发证券股份有限公司
注册地址:广东省天河区珠江东路11号高德置地广场43楼
办公地址:广东省广州市天河区珠江东路11号高德置地广场43楼
法定代表人:王志伟
电话:95575 广发证券企业客户服务热线:020-85554417
联系人:黄炎
公司网站:www.gf.com.cn
0 18 名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:徐浩明
联系人:刘晨
客户服务电话:400 8888 788,10108998
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com
0 19 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:吴宇
传真:021-63261273
客户服务热线:+86-21-95503
东方证券网站:www.dfq.com.cn
0 20 名称: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:吴凤志
传真:0551-2209765
联系人:倪晓雨
客户服务电话:400-8888-777, 95578
网址:www.gyzq.com.cn
0 21 名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层
办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心
法定代表人:张志刚
联系人:唐静
客服电话:400-800-8899
公司网站:www.cindasc.com
0 22 名称:中航证券有限责任公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:余维娜
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com
0 23 名称:国信证券股份有限公司
注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六至二十六层
办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信信托大厦9楼
法定代表人:何如
联系人:齐晓燕
电话:0755-82131302
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn
0 24 名称:长江证券股份有限公司
注册地址:武汉市新华路特8号长江证券大厦
法定代表人:胡润秋
联系人:李良
传真:027-48548190
客户服务电话:95579或4008-888-999
网址:www.95579.com

二、基金注册登记机构
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 23261188
传真:+86 21 23261199
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:上海市银城中路68号,时代金融中心19楼
负责人:韩炯
电话:+86 21 31358666
传真:+86 21 31358600
经办律师:秦悦民、王利军
四、会计师事务所和经办注册会计师
会计师事务所:普华永道中天会计师事务所有限公司
注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室
办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
法定代表人:姓名:杨绍信
电话:+86-21-23238888
传真:+86-21-23238800

联系人姓名:张鸿
经办注册会计师姓名:汪豫、张鸿
四、基金的名称
本基金名称:申万巴黎沪深300价值指数型证券投资基金
五、基金的类型
本基金类型:契约型开放式
六、基金的投资目标
本基金采用指数化投资方式,通过严格的投资程序约束和数量化风险管理手段,力争控制本基金的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪误差不得超过0.35%,年跟踪误差不超过4%,实现对沪深300价值指数的有效跟踪。
七、基金的投资范围和投资对象
本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300价值指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,沪深300价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。
本基金还可投资于法律法规或监管机构允许基金投资的其他金融工具,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

八、基金的投资策略
本基金主要采取完全复制法进行投资,即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动对投资组合进行相应地调整,但在特殊情况下,如流动性不足,导致无法获得足够数量的股票时,基金管理人将运用其他合理的投资方法构建基金的实际投资组合,追求尽可能接近目标指数的表现。
特殊情况主要是指在标的指数成份股发生变动、增发、配股、分红等行为导致成份股的构成及其权重发生变化时,由于交易成本、交易制度、个别成份股停牌或者流动性不足等原因导致基金无法及时完成投资组合的同步调整,基金管理人需要采用其他合理的投资方法进行建仓尽可能接近目标指数的基金组合。
在法律法规许可时,基金管理人可运用股指期货、期权等衍生金融衍生工具,以提高投资效率,更好地达到本基金的投资目标。基金管理人运用上述金融衍生工具必须是由于追求基金充分投资、减少交易费用、降低跟踪误差的目的,不得将之应用于投机目的或作为杠杆工具放大基金的投资。本基金投资于股票期货、期权等衍生金融衍生工具必须经过投资决策委员会的批准。

九、业绩比较基准
本基金以沪深300价值指数为标的指数。
业绩比较基准为:95%×沪深300价值指数增长率+5%×银行同业存款利率。

十、基金投资组合报告
本基金投资组合报告截止日期为2010年6月30日,本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值的比例(%)
1	权益投资	608,463,189.08	92.27
2	固定收益投资	608,463,189.08	92.27
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	金融衍生品投资	-	-
4	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
5	银行存款和结算备付金合计	38,965,673.81	5.91
6	其他各项资产	12,026,385.26	1.82
7	合计	659,455,248.15	100.00

2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	82,494,597.16	12.77
B	采掘业	104,051,014.70	16.11
C	制造业	217,007,540.84	33.37
C0	食品、饮料	2,107,008.54	0.33
C1	纺织、服装、皮毛	3,834,154.40	0.59
C2	木材、家具	-	-
C3	造纸、印刷	1,922,381.18	0.30
C4	石油、化学、塑胶、塑料	3,251,456.13	0.50
C5	电子	-	-
C6	金属、非金属	47,736,340.83	7.39
C7	机械、设备、仪表	34,993,980.20	5.42
C8	医药、生物制品	8,204,798.34	1.27
C9	其他制造业	2,000,898.08	0.31
D	电力、煤气及水的生产和供应业	23,466,627.91	3.63
E	建筑业	13,332,725.38	2.06
F	交通运输、仓储业	24,455,546.55	3.79
G	信息技术业	15,108,099.65	2.31
H	批发和零售业	4,968,965.61	0.74
I	金融、保险业	327,904,969.23	50.77
J	房地产业	7,753,774.93	1.20
K	社会服务业	1,050,245.52	0.16
L	传播和文化产业	-	-
M	综合类	3,875,624.64	0.60
	合计	608,463,189.08	92.27

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600036	招商银行	4,133,586	53,777,953.86	8.33
2	601328	交通银行	7,078,142	42,539,633.42	6.59
3	600016	民生银行	6,292,115	48,866,295.75	5.89
4	601166	兴业银行	1,402,038	32,288,935.14	5.00
5	600000	浦发银行	2,302,437	31,313,143.20	4.85
6	601088	中国神华	1,102,588	24,223,858.36	3.75
7	601601	中国广核	1,680,856	23,927,901.12	3.70
8	000001	深发展A	1,607,959	18,174,662.09	2.81
9	601169	北京银行	1,457,227	17,676,163.51	2.74
10	600050	中国联通	2,834,165	15,106,099.45	2.34

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合
5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名债券投资明细
6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前十名资产支持证券投资明细
7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资明细
8 投资组合报告附注
8.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现在监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。
8.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。
8.3 其他各项资产构成

序号	项目	名称	金额(元)
1	存出保证金		242,183.87
2	应收证券清算款		10,956,246.90
3	应收利息		47,348.73
4	应收股利		7,219.40
5	应收中票款		773,366.78
6	其他应收款		-
7	待摊费用		-
8	其他		-
9	合计		12,026,385.26

8.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
8.5 报告期末持有的处于转股期的可转换债券
8.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名可转换债券
8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名前五名权证投资明细

十一、基金的业绩
本基金的过往业绩并不代表未来表现。
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	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率标准差③	①-③	②-③
最近一个月	-6.20%	1.73%	-6.31%	0.11%	0.02%
最近三个月	-23.44%	1.85%	-23.27%	1.83%	-0.17%
自基金合同生效起至今	-22.90%	1.53%	-19.31%	1.65%	-0.12%

注:上述基金业绩指标已扣除了基金管理费、托管费和其他交易费用,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累计份额净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较
申万巴黎沪深300股票型证券投资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
2010年2月11日至2010年6月30日



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

注:1 自基金合同生效日至本报告期末,本基金运作时间未满一年;
2 根据本基金合同,本基金投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括沪深300价值指数成份股、备选成份股、新股(一级市场初次发行或增发)、现金或者到期日在一年以内的政府债券等。其中,沪深300价值指数成份股及其备选成份股的投资比例不低于基金资产净值的90%,现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。在本基金合同生效日起3个月内,达到上述比例限制,基金合同生效满3个月时,本基金已达到上述比例限制。
十二、基金的费用与税收
(一)与基金运作有关费用
1. 基金费用的种类:
0 基金管理人的管理费;
0 基金托管人的托管费;
0 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
0 基金份额持有人大会费用;
0 基金合同生效后与基金有关的会计师费和律师费;
0 基金的证券交易费用;
0 基金的银行汇划费用;
0 基金的指数使用费;
0 按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金财产中列支的其他费用。
本基金终止清算时发生费用,按实际支出从基金财产中扣除。
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0.65%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.65% × 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款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休日等,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0.15%年费率计提。计算方法如下:
H = E × 0.15% × 当年天数
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款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。
上述二项基金费用的种类中前3-8项费用,根据有关法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,由基金托管人从基金财产中支付。
4. 与基金估值有关费用
1. 认购费用
本基金份额的认购采取金额认购的方式,认购费率最高不超过认购金额的1%,在认购时收取并由投资者承担,认购金额分段设定如下:

认购金额(元)	认购费率
100元以下	1%
1000元<=10000元	0.6%
10000元<=100000元	0.2%
100000元以上	1000元/笔

2. 申购费用
本基金份额的申购费率最高不超过申购金额的1.2%,在申购时收取并由投资者承担,申购金额分段设定如下:

申购金额(元)	申购费率
100元以下	1.2%
1000元<=10000元	0.8%
10000元<=100000元	0.2%
100000元以上	1000元/笔

3. 赎回费用
本基金份额的赎回费率最高不超过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年以上 0.2%
2年以上 0%

本基金份额的赎回费用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%。
C 还列入基金费用的项目
下列费用不列入基金费用:
1. 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财产的损失;
2. 基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用;
3. 基金合同生效前的相关费用,包括但不限于律师费、会计师和审计费、信息披露费用等费用;
4. 其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。
D 费用处理
基金管理人、基金托管人和基金持有人一致,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率,调高基金管理费率、基金托管费率,须经召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率,由基金管理人必须通过新的费率实施日前2日在至少一种指定媒体和基金管理人网站上公告。
E 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法律、法规执行。

十三、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》及其他有关法律法规的要求,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金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. 增加了本基金的基金经理;
2. 变更了基金托管人的部分信息;
3. 变更了代销机构的部分信息;
4. 变更了本基金的经审计注册会计师的信息;
5. 更新了投资组合报告,数据截止日期为2010年6月30日;
6. 更新了本基金的业绩部分,数据截止日期为2010年6月30日;
7. 在“其他应披露事项”项,列举了本基金自2010年2月11日至2010年8月31日发布的有关公告。

十四、其它应披露事项
自2010年2月11日至201