

申万巴黎收益宝货币市场基金 2007年半年度报告摘要

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 本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏...

创建良好的收益。 四、 托管人报告 2007年上半年,本基金托管人在对申万巴黎收益宝货币市场基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》、《货币市场基金信息披露特别规定》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定...

1.基金的基本情况 本基金是经中国证监会监督管理委员会核准(见证监基金字[2006]89号文,“关于同意申万巴黎收益宝货币市场基金募集的批复”)募集设立的契约型开放式货币市场基金...

Table with 6 columns: 序号, 股票代码, 数量, 买入成本, 期末余额, 占基金资产净值比例

Table with 2 columns: 项目, 偏离情况. 本期偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.50%间的次数: 0

基金的投资业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

五.财务会计报告 (一)半年度资产负债表 单位:人民币元

2.本半年度会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。 3.本报告期内,本基金未发生重大会计差错更正事项。

(六)投资组合报告附注 1.基金计价方法说明 本基金采用摊余成本法计价,即计价对象以买入成本列示,按票面利率或商定利率每日计提利息,并考虑其买入时的溢价与折价在其剩余期限内摊销。

一.基金简介 (一)基金名称:申万巴黎收益宝货币市场基金 基金简称:收益宝 交易代码:310338

资产: 银行存款 5(1) 1,800,763.71 8,471,581.91 清算备付金 -- 138,182.68

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。 A.通过关联方席位进行的交易:无。 B.关联方担保

Table with 3 columns: 序号, 其他资产, 金额(元). 1. 交易所保证金: -- 2. 应收证券清算款: --

(二)基金投资目标:在力保基金资产安全和高流动性的基础上,追求稳定的高于业绩基准的收益。

负债: 应付证券清算款 -- 应付赎回款 2,368,878.39 50,425.71 应付赎回费 --

支付基金管理人申万巴黎基金管理有限公司的管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

七.基金份额持有人情况 期末基金份额持有人户数:5,146户 期末平均每户持有基金份额:9.19万份

基金投资策略:本基金基于市场价值分析,平衡投资组合的流动性和收益性,以价值研究为导向,利用基本分析和数量化分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,追求稳定的当期收益。

其他应收款 5(3) 11,862.93 11,236.87 卖出回购证券款 -- 10,000,000.00

(b)基金托管费 支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日的基金资产净值的0.10%年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

Table with 3 columns: 机构投资者, 持有基金份额, 占总额比例. 机构投资者: 196,199,296.19 41.48%

(三)基金管理人:申万巴黎基金管理有限公司 信息披露负责人:朱尚贤 联系电话:021-63363535

公允价值变动损益 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

支付基金销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付给申万巴黎基金管理有限公司,再由申万巴黎基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。

八.开放式基金份额变动 (一)基金合同生效日基金份额总额:1,269,604,476.00份。

(四)基金托管人:中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”) 基金托管人:蒋松云 联系电话:(010)66106912

其他流动资产 -- 资产总计 475,909,248.72 472,671,402.51

本基金在会计期间需支付基金托管费1,118,534.76元。

(二)本期基金份额变动: 期初基金份额总额 462,156,777.70 本期基金总申购份额 2,235,798,570.03

(五)管理人互联网网址:http://www.swbnpp.com 本报告置备地点:申万巴黎基金管理有限公司 中国工商银行

预提费用 5(4) 238,117.87 170,781.96 其他负债 --

C.基金与关联方进行的银行间同业市场的债券和债券回购交易

本期基金份额总额 473,012,013.38 期末基金份额总额 473,012,013.38

(二)主要财务指标和基金净值表现 (一)主要财务指标 基金本期净收益 7,608,009.82 期末基金资产净值 473,012,013.38

其他应收款 -- 其他应收款 -- 其中:股票公允价值变动 --

Table with 5 columns: 关联方名称, 2007年1月1日至2007年6月30日, 金额

九.重大事件揭示 (一)本基金在本报告期内未召开基金份额持有人大会。

注:1.本基金收益分配方式是“按日分配收益,按月结转份额,当日分配收益参与下一日收益分配”。

公允价值变动损益 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

D.关联方投资本基金的情况 (a)本基金管理人本期和上期均未投资本基金。

(二)本基金管理人在本报告期内内的重大人事变动: 本期报告期内,本公司股东会对于新一届董事会的董事会成员进行了重新选举

(二)基金净值表现 1.本基金历史各时段期间收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

F.由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入。 本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,并按银行同期存款利率计息。

六.基金投资组合报告 (一)期末基金资产组合

注:2.本基金的业绩比较基准半年期定期存款利率(税后)2007年3月18日起由2.25%调整为2.43%,2007年5月19日起由2.43%调整为2.61%,上述业绩比较基准收益率及其基准差别的计算已相应调整。

一.收入 10,347,257.03 2.股票差价收入 --

持有基金份额 338,325.12 占基金总份额比例 0.07%

本期累计收益分配金额 7,608,009.82 本基金在本报告期内共进行了6次基金收益集中支付并结转为基金份额:

注:3.本基金的业绩比较基准半年期定期存款利率(税后)2007年3月18日起由2.25%调整为2.43%,2007年5月19日起由2.43%调整为2.61%,上述业绩比较基准收益率及其基准差别的计算已相应调整。

3.权益差价收入 -- 4.债券利息收入 8,448,713.10

总资产比例 债券投资 456,563,773.82 95.94%

第一次 2007年1月18日 第二次 2007年2月26日

(二)基金净值表现 1.本基金历史各时段期间收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比

2.费用 2,739,247.21 1.基金管理人报酬 1,118,534.76

买入返售证券 0.00 0.00% 其中:买断式回购的买入返售证券 --

第三次 2007年3月19日 第四次 2007年4月18日

(二)基金运作情况 本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定,严格遵守基金合同约定,本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产

3.基金销售服务费 847,374.83 4.卖出回购证券支出 216,758.28

其他资产 17,544,711.19 3.69% 合计 475,909,248.72 100.00%

第五次 2007年6月18日 第六次 2007年6月18日

(三)投资报告与业绩表现 2007年上半年,央行频繁采用各种货币政策工具来进行宏观经济调控,其力度超过了往年。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

本基金在会计期间需支付基金托管费1,118,534.76元。

关于调整旗下基金申购赎回计算方法及修改基金合同相关条款的公告 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

随着央行各项紧缩政策的出台,货币市场收益率的在上半也出现了比较明显的上涨。短期债券品种大约上涨了30个基点。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

六.基金投资组合报告 (二)本期债券回购融资情况

关于申万巴黎收益宝货币市场基金春节假期前暂停申购及基金转换转入交易的提示公告 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

注:基金管理人已及时梳理,调整了测算流程以防止此类情况的发生。

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书更新摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

(四)基金管理人对于宏观经济环境、市场环境的判断 在下半年,我们认为国内宏观经济依旧将会保持强劲增长势头,债券市场存在一下几个较大不利因素。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

七.基金份额持有人情况 期末基金份额持有人户数:5,146户

关于申万巴黎收益宝货币市场基金“五一”假期前暂停申购及基金转换转入交易的提示公告 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

随着央行各项紧缩政策的出台,货币市场收益率的在上半也出现了比较明显的上涨。短期债券品种大约上涨了30个基点。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.开放式基金份额变动 (一)基金合同生效日基金份额总额:1,269,604,476.00份。

关于在中国工商银行股份有限公司开通新动力股票基金与收益宝货币市场基金之间转换业务的公告 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》

收益宝基金在操作上,自年初开始压缩投资组合的剩余期限,规避利率风险,把流动性管理放在第一位。收益宝基金同时也把握大盘新股发行所带来的回购利率升高的机会,成功地进行了市场套利。

其他公允价值变动 -- 其他公允价值变动 -- 其中:股票公允价值变动 --

八.其他重要事项: 申万巴黎基金管理有限公司 二零零七年八月二十九日

关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要 《中国证券报》《上海证券报》《证券时报》《证券日报》