

申万巴黎收益宝货币市场基金

招募说明书(第三次更新)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2006年7月7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12月31日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为2007年12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,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董事,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年在湖北省武汉市人民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主任科员、主任科员,1993年初至1998年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副主任科长、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1993年任职于中国工商银行上海分行,1993年至1996年任职于中国驻加拿大使领馆经商处。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资产偿还部主管等。

毛应傑先生,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。1986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年任上海证券交易委员会理事、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事务所,1976年至1999年任香港胡百全律师事务所律师,合伙人。1999年至今任蔡克刚律师事务所首席合伙人。

袁恩树先生,独立董事,1939年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长,现任上海市投资学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。
赵高洛先生,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、香港何耀栋律师事务所、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:

刘瑞儒先生,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 先生,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巴公司香港分公司工作。2000年至2003年在法国巴黎银行巴黎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。

王厚宜先生,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年起任职上海船舶设计院所,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部薪酬部副经理。2004年2月加入本公司。

(3) 督察长:

朱肖贤先生,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、国际副经理。

(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

王成生,经济学学士,毕业于北大光华管理学院,自2001年起从事金融工作,曾在上海银行从事信贷业务和债券投资业务,2004年起从事基金行业,先后在长信基金管理有限公司交易部任交易主管,后在该公司固定收益部任债券投资基金经理。2006年5月起加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部。有6年的金融行业经验和3年多的基金管理经验。

(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会组成:投资总监、总裁、副总裁和基金经理。公司总裁兼任投资决策委员会主席和召集人。

(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324,018,860,026元
联系电话:010-66106912
联系人:蒋松云

三、相关服务机构

(一) 基金份额发售机构

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:姜建清
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. 代销机构

(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) 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) 中信建投证券股份有限公司
注册地址:北京市东城区新闻街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
5) 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
(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:上海浦东东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝一帆
联系人:李晔
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) 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:4008881111 + 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:广东省珠海市广东大道光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河区北路大都会广场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) 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:王明凯
联系人:刘晨
电话:021-68823685
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com
(11) 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
(二) 注册登记人

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:韩朝
电话:+86 21 68818100
电话:+86 21 68816880
经办律师:秦悦民、王利民
(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:郑树松
电话:+86 21 61418888
传真:+86 21 63350177
联系人:刘明华
经办注册会计师:刘明华、王明静

四、基金的产品名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资范围
八、基金的投资策略
九、业绩比较基准
十、风险收益特征
十一、基金的投资组合报告
十二、基金的投资组合报告
十三、基金的投资组合报告
十四、基金的投资组合报告
十五、基金的投资组合报告
十六、基金的投资组合报告
十七、基金的投资组合报告
十八、基金的投资组合报告
十九、基金的投资组合报告
二十、基金的投资组合报告
二十一、基金的投资组合报告
二十二、基金的投资组合报告
二十三、基金的投资组合报告
二十四、基金的投资组合报告
二十五、基金的投资组合报告
二十六、基金的投资组合报告
二十七、基金的投资组合报告
二十八、基金的投资组合报告
二十九、基金的投资组合报告
三十、基金的投资组合报告
三十一、基金的投资组合报告
三十二、基金的投资组合报告
三十三、基金的投资组合报告
三十四、基金的投资组合报告
三十五、基金的投资组合报告
三十六、基金的投资组合报告
三十七、基金的投资组合报告
三十八、基金的投资组合报告
三十九、基金的投资组合报告
四十、基金的投资组合报告
四十一、基金的投资组合报告
四十二、基金的投资组合报告
四十三、基金的投资组合报告
四十四、基金的投资组合报告
四十五、基金的投资组合报告
四十六、基金的投资组合报告
四十七、基金的投资组合报告
四十八、基金的投资组合报告
四十九、基金的投资组合报告
五十、基金的投资组合报告
五十一、基金的投资组合报告
五十二、基金的投资组合报告
五十三、基金的投资组合报告
五十四、基金的投资组合报告
五十五、基金的投资组合报告
五十六、基金的投资组合报告
五十七、基金的投资组合报告
五十八、基金的投资组合报告
五十九、基金的投资组合报告
六十、基金的投资组合报告
六十一、基金的投资组合报告
六十二、基金的投资组合报告
六十三、基金的投资组合报告
六十四、基金的投资组合报告
六十五、基金的投资组合报告
六十六、基金的投资组合报告
六十七、基金的投资组合报告
六十八、基金的投资组合报告
六十九、基金的投资组合报告
七十、基金的投资组合报告
七十一、基金的投资组合报告
七十二、基金的投资组合报告
七十三、基金的投资组合报告
七十四、基金的投资组合报告
七十五、基金的投资组合报告
七十六、基金的投资组合报告
七十七、基金的投资组合报告
七十八、基金的投资组合报告
七十九、基金的投资组合报告
八十、基金的投资组合报告
八十一、基金的投资组合报告
八十二、基金的投资组合报告
八十三、基金的投资组合报告
八十四、基金的投资组合报告
八十五、基金的投资组合报告
八十六、基金的投资组合报告
八十七、基金的投资组合报告
八十八、基金的投资组合报告
八十九、基金的投资组合报告
九十、基金的投资组合报告
九十一、基金的投资组合报告
九十二、基金的投资组合报告
九十三、基金的投资组合报告
九十四、基金的投资组合报告
九十五、基金的投资组合报告
九十六、基金的投资组合报告
九十七、基金的投资组合报告
九十八、基金的投资组合报告
九十九、基金的投资组合报告
一百、基金的投资组合报告

开放式基金业务传真:(010)65182261
公司网站:www.csc108.com
5) 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
(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:上海浦东东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝一帆
联系人:李晔
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) 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:4008881111 + 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:广东省珠海市广东大道光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河区北路大都会广场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) 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:王明凯
联系人:刘晨
电话:021-68823685
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com
(11) 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
(二) 注册登记人

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:韩朝
电话:+86 21 68818100
电话:+86 21 68816880
经办律师:秦悦民、王利民
(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:郑树松
电话:+86 21 61418888
传真:+86 21 63350177
联系人:刘明华
经办注册会计师:刘明华、王明静

四、基金的产品名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资范围
八、基金的投资策略
九、业绩比较基准
十、风险收益特征
十一、基金的投资组合报告
十二、基金的投资组合报告
十三、基金的投资组合报告
十四、基金的投资组合报告
十五、基金的投资组合报告
十六、基金的投资组合报告
十七、基金的投资组合报告
十八、基金的投资组合报告
十九、基金的投资组合报告
二十、基金的投资组合报告
二十一、基金的投资组合报告
二十二、基金的投资组合报告
二十三、基金的投资组合报告
二十四、基金的投资组合报告
二十五、基金的投资组合报告
二十六、基金的投资组合报告
二十七、基金的投资组合报告
二十八、基金的投资组合报告
二十九、基金的投资组合报告
三十、基金的投资组合报告
三十一、基金的投资组合报告
三十二、基金的投资组合报告
三十三、基金的投资组合报告
三十四、基金的投资组合报告
三十五、基金的投资组合报告
三十六、基金的投资组合报告
三十七、基金的投资组合报告
三十八、基金的投资组合报告
三十九、基金的投资组合报告
四十、基金的投资组合报告
四十一、基金的投资组合报告
四十二、基金的投资组合报告
四十三、基金的投资组合报告
四十四、基金的投资组合报告
四十五、基金的投资组合报告
四十六、基金的投资组合报告
四十七、基金的投资组合报告
四十八、基金的投资组合报告
四十九、基金的投资组合报告
五十、基金的投资组合报告
五十一、基金的投资组合报告
五十二、基金的投资组合报告
五十三、基金的投资组合报告
五十四、基金的投资组合报告
五十五、基金的投资组合报告
五十六、基金的投资组合报告
五十七、基金的投资组合报告
五十八、基金的投资组合报告
五十九、基金的投资组合报告
六十、基金的投资组合报告
六十一、基金的投资组合报告
六十二、基金的投资组合报告
六十三、基金的投资组合报告
六十四、基金的投资组合报告
六十五、基金的投资组合报告
六十六、基金的投资组合报告
六十七、基金的投资组合报告
六十八、基金的投资组合报告
六十九、基金的投资组合报告
七十、基金的投资组合报告
七十一、基金的投资组合报告
七十二、基金的投资组合报告
七十三、基金的投资组合报告
七十四、基金的投资组合报告
七十五、基金的投资组合报告
七十六、基金的投资组合报告
七十七、基金的投资组合报告
七十八、基金的投资组合报告
七十九、基金的投资组合报告
八十、基金的投资组合报告
八十一、基金的投资组合报告
八十二、基金的投资组合报告
八十三、基金的投资组合报告
八十四、基金的投资组合报告
八十五、基金的投资组合报告
八十六、基金的投资组合报告
八十七、基金的投资组合报告
八十八、基金的投资组合报告
八十九、基金的投资组合报告
九十、基金的投资组合报告
九十一、基金的投资组合报告
九十二、基金的投资组合报告
九十三、基金的投资组合报告
九十四、基金的投资组合报告
九十五、基金的投资组合报告
九十六、基金的投资组合报告
九十七、基金的投资组合报告
九十八、基金的投资组合报告
九十九、基金的投资组合报告
一百、基金的投资组合报告

开放式基金业务传真:(010)65182261
公司网站:www.csc108.com
5) 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
(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:上海浦东东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝一帆
联系人:李晔
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) 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:4008881111 + 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:广东省珠海市广东大道光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河区北路大都会广场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) 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:王明凯
联系人:刘晨
电话:021-68823685
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com
(11) 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
(二) 注册登记人

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:韩朝
电话:+86 21 68818100
电话:+86 21 68816880
经办律师:秦悦民、王利民
(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:郑树松
电话:+86 21 61418888
传真:+86 21 63350177
联系人:刘明华
经办注册会计师:刘明华、王明静

四、基金的产品名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资范围
八、基金的投资策略
九、业绩比较基准
十、风险收益特征
十一、基金的投资组合报告
十二、基金的投资组合报告
十三、基金的投资组合报告
十四、基金的投资组合报告
十五、基金的投资组合报告
十六、基金的投资组合报告
十七、基金的投资组合报告
十八、基金的投资组合报告
十九、基金的投资组合报告
二十、基金的投资组合报告
二十一、基金的投资组合报告
二十二、基金的投资组合报告
二十三、基金的投资组合报告
二十四、基金的投资组合报告
二十五、基金的投资组合报告
二十六、基金的投资组合报告
二十七、基金的投资组合报告
二十八、基金的投资组合报告
二十九、基金的投资组合报告
三十、基金的投资组合报告
三十一、基金的投资组合报告
三十二、基金的投资组合报告
三十三、基金的投资组合报告
三十四、基金的投资组合报告
三十五、基金的投资组合报告
三十六、基金的投资组合报告
三十七、基金的投资组合报告
三十八、基金的投资组合报告
三十九、基金的投资组合报告
四十、基金的投资组合报告
四十一、基金的投资组合报告
四十二、基金的投资组合报告
四十三、基金的投资组合报告
四十四、基金的投资组合报告
四十五、基金的投资组合报告
四十六、基金的投资组合报告
四十七、基金的投资组合报告
四十八、基金的投资组合报告
四十九、基金的投资组合报告
五十、基金的投资组合报告
五十一、基金的投资组合报告
五十二、基金的投资组合报告
五十三、基金的投资组合报告
五十四、基金的投资组合报告
五十五、基金的投资组合报告
五十六、基金的投资组合报告
五十七、基金的投资组合报告
五十八、基金的投资组合报告
五十九、基金的投资组合报告
六十、基金的投资组合报告
六十一、基金的投资组合报告
六十二、基金的投资组合报告
六十三、基金的投资组合报告
六十四、基金的投资组合报告
六十五、基金的投资组合报告
六十六、基金的投资组合报告
六十七、基金的投资组合报告
六十八、基金的投资组合报告
六十九、基金的投资组合报告
七十、基金的投资组合报告
七十一、基金的投资组合报告
七十二、基金的投资组合报告
七十三、基金的投资组合报告
七十四、基金的投资组合报告
七十五、基金的投资组合报告
七十六、基金的投资组合报告
七十七、基金的投资组合报告
七十八、基金的投资组合报告
七十九、基金的投资组合报告
八十、基金的投资组合报告
八十一、基金的投资组合报告
八十二、基金的投资组合报告
八十三、基金的投资组合报告
八十四、基金的投资组合报告
八十五、基金的投资组合报告
八十六、基金的投资组合报告
八十七、基金的投资组合报告
八十八、基金的投资组合报告
八十九、基金的投资组合报告
九十、基金的投资组合报告
九十一、基金的投资组合报告
九十二、基金的投资组合报告
九十三、基金的投资组合报告
九十四、基金的投资组合报告
九十五、基金的投资组合报告
九十六、基金的投资组合报告
九十七、基金的投资组合报告
九十八、基金的投资组合报告
九十九、基金的投资组合报告
一百、基金的投资组合报告

开放式基金业务传真:(010)65182261
公司网站:www.csc108.com
5) 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
(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:上海浦东东新区银城中路168号上海银行大厦
法定代表人:祝一帆
联系人:李晔
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) 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:4008881111 + 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:广东省珠海市广东大道光大国际贸易中心26楼2611室
办公地址:广东广州天河区北路大都会广场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) 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:王明凯
联系人:刘晨
电话:021-68823685
传真:021-68815009
公司网站:www.ebscn.com
(11) 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
(二) 注册登记人

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:韩朝
电话:+86 21 68818100
电话:+86 21 68816880
经办律师:秦悦民、王利民
(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:郑树松
电话:+86 21 61418888
传真:+86 21 63350177
联系人:刘明华
经办注册会计师:刘明华、王明静

四、基金的产品名称
五、基金的类型
六、基金的投资目标
七、基金的投资范围
八、基金的投资策略
九、业绩比较基准
十、风险收益特征
十一、基金的投资组合报告
十二、基金的投资组合报告
十三、基金的投资组合报告
十四、基金的投资组合报告
十五、基金的投资组合报告
十六、基金的投资组合报告
十七、基金的投资组合报告
十八、基金的投资组合报告
十九、基金的投资组合报告
二十、基金的投资组合报告
二十一、基金的投资组合报告
二十二、基金的投资组合报告
二十三、基金的投资组合报告
二十四、基金的投资组合报告
二十五、基金的投资组合报告
二十六、基金的投资组合报告
二十七、基金的投资组合报告
二十八、基金的投资组合报告
二十九、基金的投资组合报告
三十、基金的投资组合报告
三十一、基金的投资组合报告
三十二、基金的投资组合报告
三十三、基金的投资组合报告
三十四、基金的投资组合报告
三十五、基金的投资组合报告
三十六、基金的投资组合报告
三十七、基金的投资组合报告
三十八、基金的投资组合报告
三十九、基金的投资组合报告
四十、基金的投资组合报告
四十一、基金的投资组合报告
四十二、基金的投资组合报告
四十三、基金的投资组合报告
四十四、基金的投资组合报告
四十五、基金的投资组合报告
四十六、基金的投资组合报告
四十七、基金的投资组合报告
四十八、基金的投资组合报告
四十九、基金的投资组合报告
五十、基金的投资组合报告
五十一、基金的投资组合报告
五十二、基金的投资组合报告
五十三、基金的投资组合报告
五十四、基金的投资组合报告
五十五、基金的投资组合报告
五十六、基金的投资组合报告
五十七、基金的投资组合报告
五十八、基金的投资组合报告
五十九、基金的投资组合报告
六十、基金的投资组合报告
六十一、基金的投资组合报告
六十二、基金的投资组合报告
六十三、基金的投资组合报告
六十四、基金的投资组合报告
六十五、基金的投资组合报告
六十六、基金的投资组合报告
六十七、基金的投资组合报告
六十八、基金的投资组合报告
六十九、基金的投资组合报告
七十、基金的投资组合报告
七十一、基金的投资组合报告
七十二、基金的投资组合报告
七十三、基金的投资组合报告
七十四、基金的投资组合报告
七十五、基金的投资组合报告
七十六、基金的投资组合报告
七十七、基金的投资组合报告
七十八、基金的投资组合报告
七十九、基金的投资组合报告
八十、基金的投资组合报告
八十一、基金的投资组合报告
八十二、基金的投资组合报告
八十三、基金的投资组合报告
八十四、基金的投资组合报告
八十五、基金的投资组合报告
八十六、基金的投资组合报告
八十七、基金的投资组合报告
八十八、基金的投资组合报告
八十九、基金的投资组合报告
九十、基金的投资组合报告
九十一、基金的投资组合报告
九十二、基金的投资组合报告
九十三、基金的投资组合报告
九十四、基金的投资组合报告
九十五、基金的投资组合报告
九十六、基金的投资组合报告
九十七、基金的投资组合报告
九十八、基金的投资组合报告
九十九、基金的投资组合报告
一百、基金的投资组合报告

八、基金的投资策略

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,将以价值研究为导向,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。本基金战略资产配置策略有:利率预期策略、估值策略、平均剩余期限控制策略以及现金流管理策略。本基金战术资产配置策略包括债券回购的套利策略、滚动配置策略和时机选择策略,短期债券的投资主要采用收益率曲线策略、收益率利差策略、一级市场参与策略和个券选择策略。

2、投资决策依据

以《基金法》、《货币市场基金管理暂行办法》等有关法律法规和《基金合同》为决策依据,并以维护基金份额持有人利益作为最高准则。

3、投资管理方法和标准

(1) 投资计划 and 项目方案的制定:基金经理根据本基金的投资目标和投资限制等规定性要求,结合证券市场运行特点及研究部门的推荐意见,进行分析和判断,制定具体的投资计划和项目方案。
(2) 重要投资方案的论证和审批:在投资决策委员会的授权范围内,一般投资可由基金经理自主决定,并向投资总监备案,重要投资(附带详细研究报告)必须根据投资决策委员会制定的投资审批程序和相关规定向投资总监和投资决策委员会报告,并取得相应的批准。投资决策委员会在审批投资计划和项目方案之前必须召开投资决策听证会,由基金经理和相关研究人员阐述投资理由和投资依据。

(3) 投资建议和方案实施:重要投资计划和项目方案得到批准后,投资决策委员会向基金经理授权,由基金经理在授权的范围内组织实施。
(4) 反馈与投资计划调整:基金经理根据投资计划的实施情况和执行效果、市场环境变化等,进一步分析判断,并据此调整投资组合。如遇有重大变化需要修改投资计划和项目方案,必须报投资决策委员会批准后方可实施。

九、业绩比较基准

综合考虑本基金的风险收益特性,业绩比较基准定为银行半年期定期存款利率(税后)(截至2007年12月31日的半年定期存款利率为3.78%,税后收益率为3.5501%)。