

# 申万巴黎收益宝货币市场基金

## 2007年年度报告摘要

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、基金托管人、基金销售机构均不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。  
本基金托管人——中国工商银行股份有限公司，根据本基金合同规定，于2008年3月28日复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。  
本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。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。  
本年度报告摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

**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  
深交所行情代码：163104  
基金运作方式：契约型开放式货币市场基金  
基金合同生效日：2006年7月7日  
前基金总份额：322,008,877.71份  
(二) 基金投资目标：在力求基金资产安全和流动性的基础上，追求稳定的高于业绩基准的回报。  
本基金投资策略：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，以价值分析为导向，利用基本分析和数量化分析方法，通过对短期金融工具积极投资，在控制风险的前提下追求流动性的基础上，追求稳定的当期收益。  
业绩比较基准：同期银行半年定期存款利率（税后）  
风险控制措施：低风险、高流动性并持续稳定收益。  
(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：束内贤  
联系电话：021-63363536  
传真：021-63363588  
电子邮箱：service@swpp.com  
(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：中国工商银行股份有限公司  
联系电话：010-66106912  
传真：010-66106904  
电子邮箱：custody@icbc.com.cn  
(五) 基金选定的信息披露报纸：《上海证券报》、《证券时报》  
管理人互联网网址：http://www.swpp.com.cn  
本年度报告备置地点：申万巴黎基金管理有限公司  
中国工商银行

**二、主要财务指标和基金净值表现**

(一) 主要财务指标

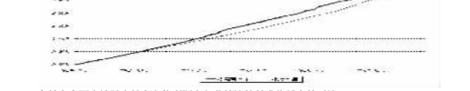
主要财务指标	2007年	2006年7月7日-2006年12月31日
本期利润	12,740,792.62	5,496,051.28
期末基金资产净值	322,008,877.71	462,156,777.00
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
本期基金净值增长率	2.7128%	0.9348%
累计基金净值增长率	3.6703%	0.9348%

注：1、上述2006年7月7日-2006年12月31日各项指标按实际存续期间计算，未按完整自然年度进行折算；  
2、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计算”；  
3、自2007年7月1日基金实施新会计准则后，会计报表的列报、主要财务指标的名称都按新准则的要求进行了相应的调整。

(二) 本基金净值表现

1. 本基金收益分配与同期业绩比较基准收益率对比

阶段	基金净值增长率①	基金净值增长率基准差②	业绩比较基准收益率③	基金净值增长率①-③	①-③	②-④
最近一个月	0.6578%	0.005%	0.6228%	0.0003%	-0.195%	0.0022%
最近三个月	1.5575%	0.007%	1.4931%	0.0013%	0.0696%	0.0054%
最近一年	2.7128%	0.0061%	2.4441%	0.0017%	0.2877%	0.0034%
自基金合同生效至今	3.6703%	0.0043%	3.3295%	0.0016%	0.3471%	0.0027%



注4：上述图表中2006年数据按基金实际存续期间计算，未按完整自然年度进行折算；  
5、本基金业绩比较基准采用半年定期存款利率，自2007年3月10日起由2.25%（税前）调整为2.43%（税前），自2007年5月15日起由2.43%（税前）调整为2.61%（税前），自2007年7月21日起由2.61%（税前）调整为2.88%（税前），自2007年8月22日起由2.88%（税前）调整为3.15%（税前），自2007年9月15日起由3.15%（税前）调整为3.42%（税前），自2007年12月1日起由3.42%（税前）调整为3.78%（税前），自2008年1月15日起由3.78%（税前）调整为4.14%（税前），上述业绩比较基准收益率及基准差的计算已相应调整。

(三) 本基金合同生效以来的基金收益分配情况

年度	每万份基金份额分红数	备注
2006年	93.0656	
2007年	267.0775	
合计	360.1431	

**三、管理人报告**  
(一) 基金管理人及基金管理团队  
2007年1月1日至2007年7月26日，李海峰先生，自1989年起从事金融工作，在中国银行深圳市分行从事外汇业务，并任产品开发小组组长、分行风险管理委员会秘书，2001年4月起从事证券业务，历任湘财证券有限责任公司投资银行部项目经理、证券发行部副经理，2002年4月起担任万家（原天同）基金管理有限公司研究发展部副经理、基金管理部副经理，2005年6月加盟本公司，2006年2月起担任盛利源量化投资基金的基金经理，拥有6年以上基金从业经验，4年以上证券投资管理经验及3年以上基金从业经历。  
2007年7月27日至至今，王洪先生，经济学学士，毕业于中国人民大学管理学院，自2001年起从事金融工作，曾在上海银行从事信贷及资产管理业务，2004年起从事基金业务，先后在长信基金管理有限责任公司交易部任交易主管，后在该公司固定收益部担任债券投资部基金经理，2006年5月起加盟申万巴黎基金管理有限公司任总经理，拥有6年的金融行业工作经验和3年的基金管理工作经验。  
(二) 基金管理人及基金管理团队  
(三) 基金管理人及基金管理团队

(二) 基金管理人及基金管理团队  
(三) 基金管理人及基金管理团队

(三) 基金管理人及基金管理团队  
(四) 基金管理人及基金管理团队

(四) 基金管理人及基金管理团队  
(五) 基金管理人及基金管理团队

(五) 基金管理人及基金管理团队  
(六) 基金管理人及基金管理团队

(六) 基金管理人及基金管理团队  
(七) 基金管理人及基金管理团队

(七) 基金管理人及基金管理团队  
(八) 基金管理人及基金管理团队

(八) 基金管理人及基金管理团队  
(九) 基金管理人及基金管理团队

(九) 基金管理人及基金管理团队  
(十) 基金管理人及基金管理团队

(十) 基金管理人及基金管理团队  
(十一) 基金管理人及基金管理团队

(十一) 基金管理人及基金管理团队  
(十二) 基金管理人及基金管理团队

(十二) 基金管理人及基金管理团队  
(十三) 基金管理人及基金管理团队

(十三) 基金管理人及基金管理团队  
(十四) 基金管理人及基金管理团队

**六、财务会计报告**  
(一) 年度基金财务报表

项目	2007年12月31日		单位:人民币元	
	年末数	年初数	期末数	期初数
资产:				
银行存款	6,469,067.77	-	8,471,581.91	-
结算备付金	1,172,727.27	-	138,162.06	-
交易保证金	-	-	-	-
应收申购资金	204,568,258.58	-	276,099,238.50	-
其中:应收证券清算款	204,568,258.58	-	276,099,238.50	-
应收利息	122,000,720.00	-	81,600,000.00	-
应收股利	76,568.49	-	4,382,389.42	-
应收申购款	251,656.44	-	-	-
其他资产	-	-	-	-
资产总计	334,568,070.06	-	472,671,402.51	-
负债:				
应付赎回款	-	-	-	-
应付基金管理人报酬	38,376.82	-	134,706.76	-
应付托管费	26,205.70	-	40,820.24	-
应付销售服务费	63,162.24	-	102,063.96	-
应付利息	9,956.00	-	11,226.67	-
应付股利	-	-	4,602.71	-
其他负债	-	-	-	-
负债合计	261,943.24	-	170,716.96	-
所有者权益:				
未分配利润	2,489,126.82	-	10,514,624.51	-
所有者权益合计	332,068,877.71	-	462,156,777.00	-
资产总计	332,068,877.71	-	462,156,777.00	-
负债合计	261,943.24	-	170,716.96	-
所有者权益合计	332,068,877.71	-	462,156,777.00	-
基金净值合计	322,008,877.71	-	462,156,777.00	-
基金份额合计	322,008,877.71	-	462,156,777.00	-
基金份额净值	1.0000	-	1.0000	-

附注为财务报表的组成部分。

项目	2007年12月31日止年度		单位:人民币元	
	年末数	年初数	期末数	期初数
一、收入	16,580,062.26	-	17,973,549.06	-
1.利息收入	17,988,900.08	-	7,885,156.86	-
其中:存款利息收入	173,727.67	-	227,533.47	-
2.投资收益	12,591,792.28	-	6,749,611.29	-
其中:买卖证券差价收入	3,516,461.12	-	886,061.11	-
2.1.债券投资收益	648,847.79	-	67,846.76	-
其中:国债投资收益	648,847.79	-	67,846.76	-
2.2.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.3.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.4.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.5.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.6.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.7.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.8.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.9.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.10.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.11.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.12.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.13.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.14.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.15.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.16.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.17.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.18.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.19.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.20.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.21.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.22.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.23.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.24.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.25.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.26.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.27.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.28.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.29.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.30.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.31.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.32.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.33.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.34.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.35.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.36.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.37.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.38.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.39.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.40.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.41.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.42.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.43.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.44.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.45.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.46.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.47.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.48.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.49.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.50.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.51.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.52.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.53.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.54.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.55.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.56.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.57.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.58.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.59.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.60.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.61.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.62.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.63.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.64.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.65.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.66.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.67.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.68.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.69.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.70.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.71.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.72.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.73.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.74.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.75.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.76.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.77.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.78.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.79.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.80.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.81.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.82.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.83.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.84.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.85.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.86.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.87.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.88.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.89.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.90.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.91.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.92.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.93.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.94.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.95.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.96.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.97.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.98.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.99.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.100.其他债券投资收益	-	-	-	-

附注为财务报表的组成部分。

项目	2007年12月31日止年度		单位:人民币元	
	年末数	年初数	期末数	期初数
一、收入	16,580,062.26	-	17,973,549.06	-
1.利息收入	17,988,900.08	-	7,885,156.86	-
其中:存款利息收入	173,727.67	-	227,533.47	-
2.投资收益	12,591,792.28	-	6,749,611.29	-
其中:买卖证券差价收入	3,516,461.12	-	886,061.11	-
2.1.债券投资收益	648,847.79	-	67,846.76	-
其中:国债投资收益	648,847.79	-	67,846.76	-
2.2.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.3.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.4.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.5.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.6.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.7.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.8.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.9.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.10.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.11.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.12.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.13.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.14.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.15.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.16.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.17.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.18.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.19.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.20.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.21.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.22.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.23.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.24.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.25.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.26.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.27.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.28.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.29.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.30.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.31.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.32.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.33.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.34.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.35.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.36.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.37.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.38.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.39.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.40.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.41.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.42.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.43.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.44.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.45.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.46.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.47.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.48.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.49.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.50.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.51.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.52.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.53.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.54.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.55.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.56.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.57.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.58.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.59.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.60.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.61.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.62.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.63.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.64.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.65.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.66.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.67.其他债券投资收益	-	-	-	-
2.68.其他债券投资收益	-	-	-	-</