

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
本基金经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...

六、财务会计报告

(一)年度基金财务报表

资产负债表
2007年12月31日
单位:人民币元
资产: 银行存款 6,469,067.77 8,471,581.91

利润表

2007年12月31日止年度
单位:人民币元
项目 2007年12月31日止年度 上年同期(人民币)

附注为财务报表的组成部分。
所有者权益(基金净值)变动表
2007年12月31日止年度
单位:人民币元

所有者权益(基金净值)变动表
2007年12月31日止年度
单位:人民币元
项目 2007年12月31日止年度 上年同期(人民币)

附注为财务报表的组成部分。
(一)财务报表附注
1.基金的基本情况
(申)申万巴黎收益宝货币市场基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人申万巴黎基金管理有限公司...

3.投资组合报告
(一)基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

2.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

3.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

4.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

5.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

6.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

7.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

8.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

9.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

10.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

11.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

12.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

13.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

14.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

15.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

16.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

17.基金资产组合情况
截至2007年12月31日,本基金资产组合如下:
1.基金资产组合情况

据:自2007年7月1日起,卖出回购金融资产支出按卖出回购金融资产款的摊余成本在回购期内以实际利率法日计提,若合同利率与实际利率差异较大,则采用合同利率计算确定利息支出。

如果本基金有能力直接或间接控制或共同控制另一方或另一方施加重大影响;或本基金与另一方或多方同受一方控制,共同控制或重大影响,均按照权益法核算。

基金的收益分配政策
(1)基金收益分配原则:
1.本基金收益分配方式为现金分红;
2.本基金收益分配方式为红利再投资,每月进行收益分配;

关联方关系
关联方名称 与基金关系
申万巴黎基金管理有限公司 基金管理人
中国工商银行 基金托管人

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
支付基金管理人申万巴黎基金管理有限公司的基金管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。

应付管理人报酬-前期末余额 134,790.76
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付管理人报酬-期末余额 83,459.82
应付托管人报酬-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付托管人报酬-期末余额 40,820.24
应付销售服务费-前期末余额 6,489,067.77
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付销售服务费-期末余额 6,489,067.77
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息收入-期末余额 131,826.62
应付利息支出-前期末余额 40,820.24
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

应付利息支出-期末余额 40,820.24
应付利息收入-前期末余额 131,826.62
本年本期增加 1,676,945.41
本年本期支付 (1,727,276.36)

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 融资余额占净资产净值的比例(%), 原因, 调整期

Table with 2 columns: 项目, 天数

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 序号, 发生日期, 平均净值(元/天), 原因, 调整期

Table with 5 columns: 主要财务指标, 2007年, 2006年7月7日-2006年12月31日

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 阶段, 基金净值增长率①, 基金净值增长率标准差②, 业绩比较基准收益率③, 业绩比较基准收益率标准差④, ①-③, ②-④

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分配”;

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。

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

(五)“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

Table with 5 columns: 序号, 债券名称, 债券数量(张), 持有比例, 买入/卖出, 买入/卖出价格, 成本(元), 占基金资产净值比例

注:投资者欲知本报告期内未兑付债券的所有债券明细,应阅读该基金托管人网站(http://www.swppfund.com)的申万巴黎收益宝货币市场基金2007年年度报告正文。

中国注册会计师:李海峰 李健

2008年3月29日

申万巴黎基金管理有限公司 二零零八年三月二十九日