# 申万巴黎收益宝货币市场基金 2008年半年度报告摘要

**(未经审计) 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,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半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。

本基金托管人一中国工商银行股份有限公司,根据本基金基金合同规定,于 2008 年 8 月 18 日复核了本报告中的财务指标、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。

基金的过往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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

### 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
期末基金份额总额:261,650,018.55 份

（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回报。

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。

业绩比较基准:同期银行半年期定期存款利率（税后）
风险收益特征:低风险、高流动性和持续稳定收益。

（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:来肖贤
联系电话:021–63353535
传真:021–63353858
电子邮箱:service@swbnpp.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”）
信息披露负责人:蒋松云
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.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

### 二.主要财务指标和基金净值表现

（一）主要财务指标

| | 2008年1月1日–2008年6月30日 |
|---|---|
| 基金本期利润 | 3,063,577.93 |
| 期末基金资产净值 | 261,650,018.55 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 |
| 本期基金净值利润率 | 1.1803% |
| 累计基金净值利润率 | 4.8966% |

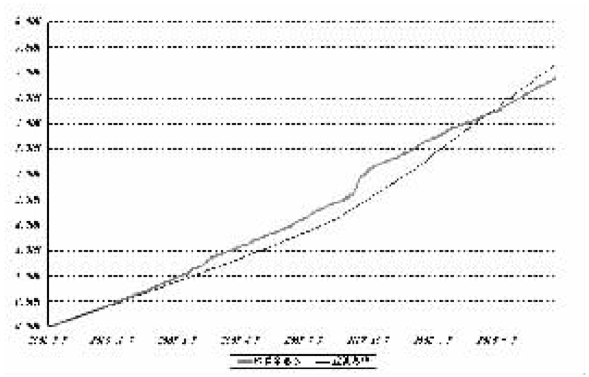
注：本基金收益分配方式是“按日分配收益，按月结转份额，当日分配的收益参与下一日收益分配”。

（二）基金净值表现

1、本基金历史各时间段收益率与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 基金净值收益率① | 基金净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 最近一个月 | 0.2127% | 0.0005% | 0.2943% | 0.0000% | (0.0816%) | 0.0005% |
| 最近三个月 | 0.6454% | 0.0012% | 0.8928% | 0.0000% | (0.2474%) | 0.0012% |
| 最近六个月 | 1.1803% | 0.0022% | 1.7857% | 0.0000% | (0.6054%) | 0.0022% |
| 最近一年 | 2.7523% | 0.0051% | 3.2788% | 0.0012% | (0.5265%) | 0.0039% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.8966% | 0.0039% | 5.1710% | 0.0022% | (0.2744%) | 0.0017% |

2、自基金合同生效以来基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比



### 三.管理人报告

（一）基金经理及基金管理经验

王成先生,北京大学经济学学士。自 2001 年起从事金融工作,曾在上海银行从事存贷款业务和债券投资业务;2004 年起从事基金行业,历任长信基金管理有限公司交易部交易主管,固定收益部债券投资基金经理,2005 年 11 月至 2006 年 9 月任长信利息基金（原利息收益基金）基金经理;2007 年 7 月起任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理。

（二）基金运作的遵规守信情况

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,在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定,信息披露及时、准确、完整;本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开;没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中,无任何损害基金持有人利益的行为,并通过稳健经营、规范运作、规避风险,保护了基金持有人的合法权益。

（三）投资报告与业绩表现

在刚刚过去的 2008 年上半年,央行五次提高存款准备金率,目前存款类金融机构的准备金率已经从年初的 14.5%提高到了目前的 17.5%,央行同时通过公开市场操作,净回笼资金超过 2112 亿。央行在上半年净回笼的资金在 1.5 万亿左右。

一季度,由于央行对于贷款投放的控制严格,银行间市场上的资金充裕,在美国连续减息,人民币持续快速升值的背景下,市场普遍认为央行未来的加息空间有限,这造成了中长债出现了一波明显的上涨行情;二季度,特别是进入 6 月份,央行连续上调存款准备金使得资金面出现紧张,加上 CPI 维持高水平,我国又启动能源价格改革,市场上的加息与其上升,所以债券市场出现了一波明显的下跌,收益率水平回到了年初的位置。

收益宝货币市场基金通过分析,在一季度,一方面通过品种的调整,提高了组合的流动性,一方面调高了组合的剩余期限,这些操作对于收益宝基金的积极影响在 3 月份开始显现;在二季度,特别是 5 月份后,经过认真分析,我们认为紧缩政策会持续,债券市场将不可避免受到影响,因此我们缩短了投资组合的剩余期限,较好地规避了利率波动的风险。

（四）基金管理人对宏观经济环境、市场环境的判断

我们认为在今年的下半年,CPI 在国家资源价格改革的情况下,依然将维持高位,因此紧缩政策将仍然是宏观调控的主基调,不管是采取利率手段还是数量工具,都会对债券市场的收益率水平产生明显的影响,我们将会继续保持高流动性的组合特征,力求规避利率波动风险。

（五）公平交易制度执行情况

1、关于公平交易制度执行情况的说明

我司于 2004 年年底管理两只开放式基金开始,就着手讨论多基金公平交易问题。2004 年年底就颁布了关于旗下基金交易情况的内部管理规则,包括《关于基金投资交叉交易行为的管理规则》、《关于基金投资公平交易行为的管理规则》,《标准交易指引》等,并且多次予以修订。原则上我司在日内禁止多基金之间的反向交易,要求严格执行多基金日内的公平交易。

依据中国证监会 2008 年 3 月 20 日颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》指引的精神,我司已经完善了公平交易、异常交易等相关制度的修订,正在着手建立系统以执行相关内容。截至上半年度末,我司已经建立了多组合日内、5 日内、10 日内同向交易价差分析模块,目前正在完善异常交易检查模块。

依据要求,本期我司对于旗下多个组合进行了两两之间的公平交易检查,未发现可能导致不公平交易和利益输送的行为。

为确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合,严格禁止并切实防范利益输送行为,我司一方面不断优化投资决策和研究流程,强化内部风险控制,另一方面强化日常对投资人员行为规范和职业操守的教育培训,并加强投资人员个人投资行为的申报管理。

我司建立并实施了严格的投资授权制度,投资备选库管理制度和集中交易制度,来切实规范基金经理投资决策行为。首先,基金经理只能在授权的范围内,依据投资策略会议决定的投资策略,结合投资决策委员会及分析师的资产及行业或板块配置的建议进行操作, 超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序;第二,基金经理只能投资纳入其管理基金的股票备选库中的股票,而且对于我司内部严格定义的重大投资决策,必须经投资决策委员会讨论备案后方可实施;第三,所有的投资指令必须通过集中交易室执行,集中交易室与投资部门相隔离。交易部必须确保日内公平交易的合规执行,执行结果须于当日报风险管理部独立检查。在上述基础上,我司内部控制部门（风险管理部和监察稽核部）还将通过对投资组合各项合规性指标的日常风险检查提示,以及对投资、研究、交易等全流程的独立的监察稽核,督促落实以上制度的措施,并促进投资运作的规范性。

2、本基金与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较。

根据投资风格划分,我司旗下没有与本基金相似的投资组合。

3、异常交易行为说明:无。

### 四.托管人报告

2008年上半年,本托管人在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》及其他有关法律法规、基金合同,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

2008 年上半年, 申万巴黎收益宝货币市场基金的管理人——申万巴黎基金管理有限公司在申万巴黎收益宝货币市场基金的投资运作、每万份基金净收益和 7 日年化收益率、基金收益分配、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在所有重要方面的运作严格按照有关法律法规、基金合同的规定进行。

本托管人依法对申万巴黎基金管理有限公司在 2008 年上半年所编制和披露的申万巴黎收益宝货币市场基金半年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部
2008 年 8 月 18 日

### 五.财务会计报告

（一）半年度基金会计报表

资产负债表
2008 年 6 月 30 日　单位:人民币元

| 项 目 | 附注 6 | 期末余额 | 年初余额 |
|---|---|---|---|
| 资产: | | | |
| 银行存款 | | 649,216.26 | 6,469,067.77 |
| 结算备付金 | | – | 1,172,727.27 |
| 交易保证金 | | – | – |
| 交易性金融资产 | (1) | 208,914,160.52 | 204,598,329.58 |
| 其中:债券投资 | | 208,914,160.52 | 204,598,329.58 |
| 资产支持证券投资 | | – | – |
| 买入返售金融资产 | (2) | – | 122,000,720.50 |
| 应收证券清算款 | | – | – |
| 应收利息 | (3) | 316,389.57 | 75,568.49 |
| 应收股利 | | – | – |
| 应收申购款 | | 52,411,742.98 | 251,656.44 |
| 其他资产 | | – | – |
| 资产总计 | | 262,291,509.33 | 334,568,070.05 |
| 负债: | | | |
| 交易性金融负债 | | – | – |
| 卖出回购金融资产款 | | – | – |
| 应付证券清算款 | | – | – |
| 应付赎回款 | | 169,317.88 | 2,025,897.06 |
| 应付管理人报酬 | | 62,362.91 | 83,376.82 |
| 应付托管费 | | 18,897.85 | 25,265.70 |
| 应付销售服务费 | | 47,244.61 | 63,164.24 |
| 应付交易费用 | (4) | 7,715.35 | 9,845.40 |
| 应付利息 | | – | – |
| 应付利润 | | – | – |
| 其他负债 | (5) | 335,952.18 | 261,643.12 |
| 负债合计 | | 641,490.78 | 2,469,192.34 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | (6) | 261,650,018.55 | 332,098,877.71 |
| 未分配利润 | | – | – |
| 所有者权益合计 | | 261,650,018.55 | 332,098,877.71 |
| 负债和所有者权益总计 | | 262,291,509.33 | 334,568,070.05 |
| 基金份额总额(份) | | 261,650,018.55 | 332,098,877.71 |
| 基金份额净值 | | 1.0000 | 1.0000 |

附注为财务报表的组成部分。

利润表
2008 年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日　单位:人民币元

| 项 目 | 附注 6 | 本期金额 | 上期金额（已重述） |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 4,172,950.51 | 10,317,729.90 |
| 1、利息收入 | | 4,297,123.03 | 10,337,146.95 |
| 其中:存款利息收入 | | 108,249.35 | 66,218.18 |
| 债券利息收入 | | 3,648,176.12 | 8,448,713.10 |
| 资产支持证券利息收入 | | – | – |
| 买入返售金融资产收入 | | 540,697.56 | 1,822,215.67 |
| 2、投资收益 /(损失) | | (124,172.52) | (19,417.05) |
| 其中:债券投资收益 /(损失) | (7) | (124,172.52) | (19,417.05) |
| 3、公允价值变动收益 /(损失) | | – | – |
| 4、其他收入 | | – | – |
| 二、费用 | | (1,109,372.58) | (2,709,720.08) |
| 1、管理人报酬 | | (436,724.08) | (1,118,534.76) |
| 2、托管费 | | (132,340.61) | (338,949.90) |
| 3、销售服务费 | | (330,851.57) | (847,374.83) |
| 4、交易费用 | | (25.00) | – |
| 5、利息支出 | | (38,956.37) | (226,156.08) |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | (38,956.37) | (226,156.08) |
| 6、其他费用 | (8) | (170,474.95) | (178,704.51) |
| 三、利润总额 | | 3,063,577.93 | 7,608,009.82 |

附注为财务报表的组成部分。

所有者权益(基金净值)变动表
2008年 1 月 1 日至 2008 年 6 月 30 日　单位:人民币元

| 项 目 | 本期金额 | | | 上期金额(已重述) | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益（基金净值） | 332,098,877.71 | – | 332,098,877.71 | 462,156,777.70 | – | 462,156,777.70 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润总额） | – | 3,063,577.93 | 3,063,577.93 | – | 7,608,009.82 | 7,608,009.82 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 | (70,448,859.16) | – | (70,448,859.16) | 10,855,235.68 | – | 10,855,235.68 |
| 其中:1、基金申购款 | 1,385,617,575.07 | – | 1,385,617,575.07 | 2,243,406,579.85 | – | 2,243,406,579.85 |
| 2、基金赎回款 | (1,456,066,434.23) | – | (1,456,066,434.23) | (2,232,551,344.17) | – | (2,232,551,344.17) |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动数 | – | (3,063,577.93) | (3,063,577.93) | – | (7,608,009.82) | (7,608,009.82) |
| 五、期末所有者权益（基金净值） | 261,650,018.55 | – | 261,650,018.55 | 473,012,013.38 | – | 473,012,013.38 |

附注为财务报表的组成部分。

（二）会计报表附注

1、基金的基本情况

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依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《申万巴黎收益宝货币市场基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2006]98 号文件批准公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集基金份额为 1,259,604,476.00 份,其中募集期间的银行利息折合基金份额为 86,652.62 份,经德勤华永会计师事务所有限公司验证,并出具了编号为德师报(验)字(06)第 0025 号的验资报告。经向中国证监会备案,《申万巴黎收益宝货币市场基金基金合同》(以下简称 “原基金合同”) 于 2006 年 7 月 7 日正式生效。本基金因执行企业会计准则,于 2007 年 9 月 29 日公告了修改后基金合同 (以下简称“修改后的基金合同”)。本基金的管理人为申万巴黎基金管理有限公司,托管人为中国工商银行股份有限公司(以下简称“中国工商银行”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和基金合同的有关规定,本基金的投资范围为:(1)现金;(2)通知存款;(3)1 年以内(含 1 年)的银行定期存款、大额存单;(4)剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券;(5)期限在 1 年以内(含 1 年)的债券回购;(6)期限在 1 年以内(含 1 年)的中央银行票据;(7)短期融资券;(8)中国证监会、中国人民银行认可并允许货币市场基金投资的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金投资组合的平均剩余到期期限不得超过 180 天。本基金的业绩比较基准为:半年期银行定期存款利率(税后)。

2、财务报表编制基础

首次执行 2006 年 2 月 15 日颁布的企业会计准则及相关规定(以下统称“新会计准则”)

2007 年 7 月 1 日前,本基金执行原企业会计准则、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、原基金合同及相关规定(以下统称“原会计准则”)。自 2007 年 7 月 1 日起,本基金执行新会计准则及中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》(以下简称 “指引”)、修改后的基金合同及中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定。本基金已按照《企业会计准则第 38 号 – 首次执行企业会计准则》第五条至第十九条及其他相关规定,对 2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日止期间(以下简称“2007 年上半年”)的财务报表予以追溯调整。除了要求追溯调整的项目外,本基金 2007 年上半年的财务报表仍按根据原会计准则厘定的会计政策编制,该等会计政策与本基金自 2007 年 7 月 1 日起采用的会计政策存在一些差异,这些会计政策差异已于附注 4 披露。

对于本基金财务报表项目分类、名称等列报方式的变化,财务报表已按照新会计准则和指引的要求进行了重述。本基金无因首次执行新会计准则而需要对按原会计准则列报的 2007 年上半年末的所有者权益(基金净值),以及 2007 年上半年的利润总额进行调整的事项。

3、遵循会计准则的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2008 年 6 月 30 日的财务状况以及 2008 年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

4、重要会计政策和会计估计

会计年度

本基金的会计年度为公历年度,即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

记账基础

本基金会计核算以权责发生制为记账基础。

金融工具

当本基金成为金融工具合同条款中的一方时,确认相应的金融资产或金融负债。

金融工具的分类

– 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和贷款及应收款项。

本基金持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的各类应收款项、买入返售金融资产等在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产分类为贷款及应收款项。

– 金融负债的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。

本基金持有的金融负债全部为其他金融负债,包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

金融工具的确认与初始计量

– 债券投资

2007 年 7 月 1 日前,买入银行间市场交易的债券于资金交收日确认为债券投资,债券投资成本按交易日应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用直接计入当期损益。

自 2007 年 7 月 1 日起,买入银行间市场交易的债券时于交易日确认为债券投资。债券投资成本于交易日按应付或实际支付的全部价款(不含应收利息)入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

买入央行票据和零息债券等贴现债券,债券投资成本于交易日按应付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入债券投资的初始成本。

2007 年 7 月 1 日前,卖出银行间市场交易的债券于资金交收日确认投资收益。

自 2007 年 7 月 1 日起,卖出银行间市场交易的债券于交易日确认债券投资收益 /(损失)。卖出债券的成本按移动加权平均法于交易日结转。

– 买入返售金融资产

买入返售金融资产为本基金按照返售协议约定先买入再按固定价格返售证券等金融资产所融出的资金。

2007 年 7 月 1 日前,银行间市场买入返售金融资产于资金交收日确认,交易所买入返售金融资产于交易日确认。买入返售金融资产成本按返售协议金额入账,相关交易费用计入当期损益。

自 2007 年 7 月 1 日起,买入返售金融资产按交易日应支付或实际支付的全部价款入账,相关交易费用计入初始成本。于返售日按账面余额结转。

– 卖出回购金融资产款

卖出回购金融资产款为本基金按照回购协议先卖出再按固定价格买入票据、证券等金融资产所融入的资金。

2007 年 7 月 1 日前,银行间市场卖出回购金融资产款于资金交收日确认,交易所卖出回购金融资产款于交易日确认。卖出回购金融资产款按回购协议融入金额入账,相关交易费用计入当期损益。

自 2007 年 7 月 1 日起,卖出回购金融资产款按交易日应收到或实际收到的全部价款入账,相关交易费用计入初始成本。于回购日按账面余额结转。

金融工具的后续计量

本基金持有的金融资产和金融负债的后续计量与其分类相关联。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债,按照公允价值进行后续计量,公允价值变动计入当期损益;对于其他类别的金融资产或金融负债,采用实际利率法,按摊余成本计量 。

基金资产的估值原则

本基金的债券投资等金融资产,均采用实际利率法摊余成本估算公允价值。在本基金存续期间,基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度, 并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的(偏离度超过 0.5%),按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为 " 公允价值变动损益 ",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元,恢复使用摊余成本估算公允价值。

金融资产与金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利,且目前可执行该种法定权利,同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时, 金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外,金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示,不予相互抵销。

实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于交易确认日认列。

收入 /(损失)的确认和计量

– 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日前,债券利息收入在持有债券期内,按债券票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额, 并根据买入债券时溢价与折价的摊销数调整后的金额确认,在债券实际持有期内逐日计提;贴现债券按买入债券时的成本和到期日应收金额的差额采用直线法逐日计提。自 2007 年 7 月 1 日起,基金持有的附息债券、贴现券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

2007 年 7 月 1 日前,买入返售金融资产收入按合同金额与合同利率在返售期内以直线法逐日计提;自 2007 年 7 月 1 日起,买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息收入。

– 投资收益

2007 年 7 月 1 日前,债券投资收益 /(损失)于资金交收日按卖出债券的成交总额扣除应结转的债券投资成本与应收利息(若有)后的差额确认;自 2007 年 7 月 1 日起,债券投资收益 /(损失) 于交易日按卖出债券成交金额扣除应结转的债券投资成本、应收利息(若有)与相关费用后的差额确认。

费用的确认和计量

本基金的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率逐日计提。

本基金的基金托管费按前一日基金资产净值 0.1%的年费率逐日计提。

本基金的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提。

2007 年 7 月 1 日前,卖出回购金融资产支出按合同金额与合同利率在回购期内以直线法逐日计提;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逐日计提,若合同利率与实际利率差异较小,则采用合同利率计算确定利息支出。

关联方

如果本基金有能力直接或间接地控制及共同控制另一方或对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,均被视为关联方。

基金的收益分配政策

（1）每一基金份额享有同等分配权;

（2）本基金份额面值为人民币 1.00 元,采用固定份额净值交易方式。当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益;当日赎回的基金份额自下一工作日起,不享有基金的分配权益;

（3）基金收益分配方式为红利再投资,每日进行收益分配;

（4）“每日分配、按月支付”,当日分配的收益参与下一工作日收益分配,每月集中支付收益;

（5）法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

5、重大关联方关系及交易

（1）重大关联方及其关系

| 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<br>基金销售机构<br>基金注册登记机构 |
| 中国工商银行 | 基金托管人<br>基金代销机构 |
| 申银万国证券股份有限公司（以下简称“申银万国”） | 基金管理人的股东<br>基金代销机构 |
| 法国巴黎资产管理公司 | 基金管理人的股东 |

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

（2）基金管理人报酬

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。其计算公式为:

日基金管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% ÷ 当年天数

本基金的基金管理人报酬情况如下:

| | 本期数 | 上期数 |
|---|---|---|
| 应付管理人报酬期初余额 | 83,376.82 | 134,706.76 |
| 本期计提数 | 436,724.08 | 1,118,534.76 |
| 本期支付数 | 457,737.99 | 1,118,147.20 |
| 应付管理人报酬期末余额 | 62,362.91 | 135,094.32 |

（3）基金托管费

支付基金托管人中国工商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日基金托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% ÷ 当年天数

本基金的基金托管费情况如下:

| | 本期数 | 上期数 |
|---|---|---|
| 应付托管费期初余额 | 25,265.70 | 40,820.24 |
| 本期计提数 | 132,340.61 | 338,949.90 |
| 本期支付数 | 138,708.46 | 338,832.49 |
| 应付托管费期末余额 | 18,897.85 | 40,937.65 |

（4）销售服务费

销售服务费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:

日销售服务费 = 前一日基金资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数

本基金需向关联方支付的销售服务费情况如下:

| | 本期数 | 上期数 |
|---|---|---|
| 中国工商银行(托管人) | 164,177.58 | 583,477.16 |
| 申万巴黎基金管理有限公司(管理人) | 87,934.55 | 155,316.26 |
| 申银万国(管理人的股东) | 43,341.30 | 58,714.68 |
| 合计 | 295,453.43 | 797,508.10 |

（5）与关联方通过银行间同业市场进行的债券(含回购)交易

| | 关 联 人 | 债券成交金额 | 回购成交金额 | 回购利息收入 | 回购利息支出 |
|---|---|---|---|---|---|
| 本期 | 中国工商银行 | 19,977,006.10 | – | – | – |
| 上期 | 中国工商银行 | 89,526,530.00 | – | – | – |

（6）关联方保管的银行存款及银行存款利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,并按银行间同业存款利率计息。基金托管人于资产负债表日保管的本基金的银行存款及当年度 /(期间)所保管的银行存款产生的利息收入情况如下:

| | 本期数 | 上期数 |
|---|---|---|
| 期末银行存款余额 | 649,216.26 | 1,800,763.71 |
| 银行存款利息收入 | 90,792.08 | 47,092.52 |

（7）关联方持有的基金份额

截止资产负债表日,无关联方投资本基金的情况。

6、流通受限不能自由转让的基金资产

截止 2008 年 6 月 30 日,本基金未持有流通受限不能自由转让的基金资产。

7、资产负债表日后事项

本基金管理人于 2008 年 7 月 16 日宣告本基金 2008 年第 7 号基金收益支付公告， 对本基金自 2008 年 6 月 18 日至 2008 年 7 月 17 日止的累计收益进行集中支付,并按人民币 1.00 元的份额面值自动结转为基金份额,不进行现金支付。

本基金管理人于 2008 年 8 月 15 日宣告本基金 2008 年第 8 号基金收益支付公告， 对本基金自 2008 年 7 月 18 日至 2008 年 8 月 17 日止的累计收益进行集中支付,并按人民币 1.00 元的份额面值自动结转为基金份额,不进行现金支付。

8、风险管理

本基金为货币型基金。本基金主要投资于具有良好流动性的货币市场工具,包括债券投资、买入返售金融资产以及银行存款等。与以上金融工具有关的风险以及本基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

（1）风险管理概述

本基金是一只货币型证券投资基金,属于低风险合理稳定收益品种,本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内， 使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现 “低风险、高流动性和持续稳定收益” 的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度， 并且形成了由基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改,基金管理人风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

本基金面临的主要风险包括:市场风险、信用风险和流动性风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

（2）市场风险(利率风险)

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。于资产负债日,本基金持有的利率敏感性金融工具主要是银行存款、债券投资与买入返售金融资产。基于本基金产品性质,生息资产占基金资产绝对比重,因此本基金存在相应的利率风险。

对于固定利率类金融工具， 面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险。

对于浮动利率类金融工具,主要面临两方面利率风险:第一,每个付息期间内面临由于市场利率走高而导致的债券资产的市场价格低于购买成本的风险;第二,每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流的影响的风险。

本基金管理人主要通过定期对利率水平的预测、以及严格控制投资品种到期天数等方法对上述利率风险进行管理。

于 2008 年 6 月 30 日,本基金金融资产和金融负债的重新定价日或到期日(较早者)的情况如下:

| | 1个月以内 人民币千元 | 1至 3 个月 人民币千元 | 3个月至 1 年 人民币千元 | 不计息 人民币千元 | 合计 人民币千元 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 649 | – | – | – | 649 |
| 结算备付金 | – | – | – | – | – |
| 交易性金融资产 | – | 159,343 | 49,571 | – | 208,914 |
| 买入返售金融资产 | – | – | – | – | – |
| 应收利息 | – | – | – | 316 | 316 |
| 应收申购款 | – | – | – | 52,412 | 52,412 |
| 资产总计 | 649 | 159,343 | 49,571 | 52,728 | 262,291 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | – | – | – | 169 | 169 |
| 应付管理人报酬 | – | – | – | 62 | 62 |
| 应付托管费 | – | – | – | 19 | 19 |
| 应付销售服务费 | – | – | – | 47 | 47 |
| 应付交易费用 | – | – | – | 8 | 8 |
| 其他负债 | – | – | – | 336 | 336 |
| 负债总计 | – | – | – | 641 | 641 |
| 利率敏感度缺口 | 649 | 159,343 | 49,571 | 52,087 | 261,650 |

于 2007 年 12 月 31 日,本基金金融资产和金融负债的重新定价日或到期日(较早者)的情况如下:

| | 1个月以内 人民币千元 | 1至 3 个月 人民币千元 | 3个月至 1 年 人民币千元 | 不计息 人民币千元 | 合计 人民币千元 |
|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | |
| 银行存款 | 6,469 | – | – | – | 6,469 |
| 结算备付金 | 1,173 | – | – | – | 1,173 |
| 交易性金融资产 | 109,874 | 74,483 | 20,241 | – | 204,598 |
| 买入返售金融资产 | 122,001 | – | – | – | 122,001 |
| 应收利息 | – | – | – | 75 | 75 |
| 应收申购款 | – | – | – | 252 | 252 |
| 资产总计 | 239,517 | 74,483 | 20,241 | 327 | 334,568 |
| 负债 | | | | | |
| 应付赎回款 | – | – | – | 2,026 | 2,026 |
| 应付管理人报酬 | – | – | – | 83 | 83 |
| 应付托管费 | – | – | – | 25 | 25 |
| 应付销售服务费 | – | – | – | 63 | 63 |
| 应付交易费用 | – | – | – | 10 | 10 |
| 其他负债 | – | – | – | 262 | 262 |
| 负债总计 | – | – | – | 2,469 | 2,469 |
| 利率敏感度缺口 | 239,517 | 74,483 | 20,241 | (2,142) | 332,099 |

于 2008 年 6 月 30 日,若市场利率平行上升 50 个基点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值将相应下降约人民币 220 千元(2007 年 12 月 31 日:人民币 730 千元);反之,若市场利率平行下降 50 个基点且其他市场变量保持不变,本基金资产净值则将相应增加约人民币 221 千元(2007 年 12 月 31 日:人民币 753 千元)。

（3）信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

对于发行者的信用风险控制， 本基金管理人主要通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象,并限制单个投资品种的持有比例以及按发行者行业来分的投资限制比例来管理。于资产负债表日,由于本基金全部投资于信用等级优良的政府和金融债券,所以本基金管理人认为本基金与债券发行者有关的信用风险不重大。

对于交易对手的风险控制,(1)对于定期存款的银行,本基金管理人主要通过内部设立符合资格的银行库,并设立相应的最高存款限额来管理风险。本基金的银行存款目前存放在本基金的托管行 – 中国工商银行,本基金管理人认为与该银行相关的信用风险不重大。(2)对于银行间债券等品种的交易,本基金管理人主要通过限制交割方式、交易对手以及相应额度来管理风险。(3)本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成债券等投资品种的交收和款项清算， 因此违约风险发生的可能性很小,本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

（4）流动性风险

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于开放式基金每日兑付赎回资金的流动性风险， 以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。

本基金管理人对于流动性风险管理的目标是监控基金组合流动性指标,确保市场出现剧烈波动时,基金仍能应付大量赎回和其他负债,灵活调整组合结构,而且不影响组合估值。

针对兑付赎回资金和其他负债的流动性风险， 本基金管理人通过对基金资产按流动性分类计算未来现金流并设立相应目标,同时对基金申购赎回状况和其他负债到期情况进行严密监控和分析预测,保持基金投资组合中的流动性资产与之相匹配。此外,本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款,设计了非常情况下赎回资金的处理模式,控制因开放模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

针对投资交易品种变现的流动性风险,本基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易不活跃品种(企业债或短期融资券)以及基金影子价格偏离度来实现。

此外,本基金在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金,以缓解流动性风险。

于资产负债表日， 本基金所持有的资产大部分是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具(没有投资于任何企业债或短期融资券),其余是在交易所上市的金融工具以及银行存款,因此比较容易变现来满足投资者对于基金资产的赎回和其他负债。从本基金资产和负债的情况来看,本基金管理人认为本基金面临的流动性风险较小。

9、公允价值信息

本基金的交易性金融资产的公允价值的确定方法详见附注 4 – 重要会计政策和会计估计。

贷款及应收款项类金融资产及其他金融负债均属于流动性资产 / 负债,其公允价值接近账面价值。

### 六.投资组合报告

（一）期末基金资产组合

| 序号 | 资产组合 | 金 额（元） | 占总资产比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 债券投资 | 208,914,160.52 | 79.65% |
| 2 | 买入返售证券 | – | – |
| | 其中:买断式回购的买入返售证券 | – | – |
| 3 | 银行存款和清算备付金合计 | 649,216.26 | 0.25% |
| 4 | 其他资产 | 52,728,132.55 | 20.10% |
| | 合 计 | 262,291,509.33 | 100.00% |

（二）本期债券回购融资情况

| 序号 | 项 目 | 金 额（元） | 占净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 本期债券回购融资余额 | 564,414,357.79 | 1.35% |
| | 其中:买断式回购融入的资金 | – | – |
| 2 | 期末债券回购融资余额 | – | – |
| | 其中:买断式回购融入的资金 | – | – |

本报告期内未发生债券正回购资金余额超过基金资产净值 20%的情况:

| | 发生日期 | 融资余额占基金资产净值的比例(%) | 原因 | 调整期 |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 2008–01–23 | 24.65% | 大额赎回导致 | 1个工作日 |

（三）基金投资组合平均剩余期限

1、投资组合平均剩余期限基本情况

| 项 目 | 天 数 |
|---|---|
| 期末投资组合平均剩余期限 | 76 |
| 本期投资组合平均剩余期限最高值 | 158 |
| 本期投资组合平均剩余期限最低值 | 24 |

本期投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况: 无

2、期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例 | 各期限负债占基金资产净值的比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 30天以内 | 0.25% | – |
| 2 | 30天（含）–60 天 | 41.89% | – |
| 3 | 60天（含）–90 天 | 19.00% | – |
| 4 | 90天（含）–180 天 | 7.60% | – |
| 5 | 180天（含）–397 天（含） | 11.34% | – |
| | 其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | 3.86% | – |
| | 合 计 | 80.08% | – |

（四）期末债券投资组合

1、按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 成 本（元） | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | – | – |
| 2 | 金融债券 | 29,992,365.35 | 11.46% |
| | 其中:政策性金融债 | 19,894,041.75 | 7.60% |
| 3 | 央行票据 | 178,921,795.17 | 68.38% |
| 4 | 企业债券 | – | – |
| 5 | 其他 | – | – |
| 合 计 | | 208,914,160.52 | 79.84% |
| 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | | 10,098,323.60 | 3.86% |

2、基金投资前十名债券明细

| 序号 | 债券名称 | 债券数量（张） | | 成本（元） | 占基金资产净值比例 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 自有投资 | 买断式回购 | | |
| 1 | 07央票 84 | 1,100,000 | – | 109,617,876.59 | 41.89% |
| 2 | 07央票 94 | 500,000 | – | 49,724,861.97 | 19.00% |
| 3 | 05农发 16 | 200,000 | – | 19,894,041.75 | 7.60% |
| 4 | 04建行 03 浮 | 100,000 | – | 10,098,323.60 | 3.86% |
| 5 | 08央票 04 | 100,000 | – | 9,802,177.11 | 3.75% |
| 6 | 08央票 13 | 100,000 | – | 9,776,879.50 | 3.74% |
| 7 | – | – | – | – | – |
| 8 | – | – | – | – | – |
| 9 | – | – | – | – | – |
| 10 | – | – | – | – | – |

（五）“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 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 | – |
| 本期偏离度的最高值 | –0.0204% |
| 本期偏离度的最低值 | –0.1574% |
| 本期每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0849% |

（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。本基金通过每日分配收益使基金份额净值保持在 1.00 元。

2.本报告期内,本基金持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券,该类债券的摊余成本超过当日基金资产净值 20%的情况:无。

3. 本报告期内需说明的证券投资决策程序

本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体不存在被监管部门立案调查的,在本报告编制日前一年内也不存在受到公开谴责、处罚的情况。

4. 其他资产的构成:

| 序号 | 其他资产 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 交易保证金 | – |
| 2 | 应收证券清算款 | – |
| 3 | 应收利息 | 316,389.57 |
| 4 | 应收申购款 | 52,411,742.98 |
| 5 | 其他应收款 | – |
| 6 | 待摊费用 | – |
| 7 | 其他 | – |
| | 合 计 | 52,728,132.55 |

### 七.基金份额持有人情况

(一) 期末基金份额持有人户数:3,474 户,期末平均每户持有基金份额:7.53 万份。

(二) 持有人结构:

| | 持有基金份额 | 占总份额比例 |
|---|---|---|
| 机构投资者 | 123,851,320.15 | 47.33% |
| 个人投资者 | 137,798,698.40 | 52.67% |

(三) 期末基金管理公司从业人员人员投资开放式基金情况

| | 期末持有本开放式基金份额的总量(份) | 占本基金总份额比例 |
|---|---|---|
| 基金管理公司持有本基金的所有从业人员 | 36,181.77 | 0.01% |

### 八.开放式基金份额变动

(一)基金合同生效日基金份额总额:1,259,604,476.00 份。

(二)本期基金份额变动:

| | 2008年 1 月 1 日 –2008 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 期初基金份额总额 | 332,098,877.71 |
| 本期基金总申购份额 | 1,385,617,575.07 |
| 其中:本期收益结转的份额 | 3,063,577.93 |
| 本期基金总赎回份额 | (1,456,066,434.23) |
| 期末基金份额总额 | 261,650,018.55 |

### 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。

(二) 本基金管理人在本报告期内的重大人事变动:

本报告期内,经中国证监会证监许可（2008）472 号文批准,毛剑鸣先生担任本公司总裁。过振华先生不再担任本公司代理总裁,上述信息已于 2008 年 4 月 4 日在指定媒体披露。

本基金托管人的专门基金托管部门在本报告期内未发生重大人事变动。

(三) 本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

(四) 本报告期内,本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略,未发生显著的改变。

(五) 本基金本期收益分配事项如下:

| | 2008年 1 月 1 日 –2008 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 本报告期累计收益分配金额 | 3,063,577.93 |

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:

| | 收益支付日 |
|---|---|
| 第一次 | 2008年 1 月 18 日 |
| 第二次 | 2008年 2 月 18 日 |
| 第三次 | 2008年 3 月 18 日 |
| 第四次 | 2008年 4 月 18 日 |
| 第五次 | 2008年 5 月 19 日 |
| 第六次 | 2008年 6 月 18 日 |

(六) 本报告期内,本基金聘用德勤华永会计师事务所有限公司负责基金审计事务,未发生改聘会计师事务所事宜。

(七) 本报告期内,基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

(八) 基金租用证券公司专用交易单元的情况:无。

(九)其他重要事项:

| 事 项 | 信息披露报纸 | 披露日期 |
|---|---|---|
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 1 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–1–16 |
| 关于旗下基金在国泰君安证券股份有限公司开展网上交易费率优惠的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–1–18 |
| 关于增加中国民生银行为旗下基金代销机构的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–1–21 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金 2007 年第四季度报告 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–1–21 |
| 关于增加江南证券有限责任公司为旗下基金代销机构的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–1–26 |
| 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 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–1–31 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 2 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–2–16 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书更新（摘要） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–2–20 |
| 关于在中国建设银行开通旗下基金之间转换业务的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–2–26 |
| 关于旗下基金参与中国建设银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–3–5 |
| 关于旗下基金在中国银河证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–3–5 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 3 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–3–15 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金 2007 年年度报告 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–3–29 |
| 关于旗下基金继续参与中国工商银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–4–1 |
| 关于增加中信银行为旗下基金代销机构的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–4–11 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 4 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–4–16 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金 2008 年第一季度报告 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–4–19 |
| 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 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–4–26 |
| 关于旗下基金参与中国民生银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–5–6 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 5 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–5–16 |
| 关于增加中国农业银行为旗下基金代销机构的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–5–24 |
| 关于申万巴黎收益宝货币市场基金参加中国工商银行开办的“利添利”账户理财业务的公告 | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–5–24 |
| 关于开通中国农业银行金穗卡基金网上交易的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–5–28 |
| 申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2008 年第 6 号） | 《上海证券报》<br>《证券时报》 | 2008–6–16 |
| 关于增加上海农业商业银行为旗下基金代销机构的公告 | 《中国证券报》<br>《上海证券报》<br>《证券时报》<br>《证券日报》 | 2008–6–23 |

**申万巴黎基金管理有限公司**
**二零零八年八月二十七日**