

申万巴黎收益宝货币市场基金

2007 年半年度报告

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

2007 年 8 月 29 日

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，根据本基金基金合同规定，于 2007 年 8 月 20 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。

目 录

一、	基金简介	4
二、	主要财务指标和基金净值表现	6
(一)	主要财务指标	6
(二)	基金净值表现	6
三、	管理人报告	8
四、	托管人报告	9
五、	财务会计报告	10
(一)	半年度基金会计报表	10
(二)	会计报表附注	13
六、	投资组合报告	18
(一)	期末基金资产组合	18
(二)	本期债券回购融资情况	18
(三)	基金投资组合平均剩余期限	18
(四)	期末债券投资组合:	19
(五)	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	19
(六)	投资组合报告附注	20
七、	基金份额持有人情况	21
八、	开放式基金份额变动	21
九、	重大事件揭示	22
十、	备查文件目录	24

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：473,012,013.38 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

注册地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

办公地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

邮政编码：200021

法定代表人：姜国芳

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”）

注册地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码：100032

法定代表人：姜建清

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

(六) 注册登记人：申万巴黎基金管理有限公司

办公地址：上海市淮海中路 300 号香港新世界大厦 40 层

二、 主要财务指标和基金净值表现

（一） 主要财务指标

2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日

基金本期净收益	7,608,009.82
期末基金资产净值	473,012,013.38
期末基金份额资产净值	1.0000
本期基金净值收益率	1.1413%
累计基金净值收益率	2.0868%

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”。

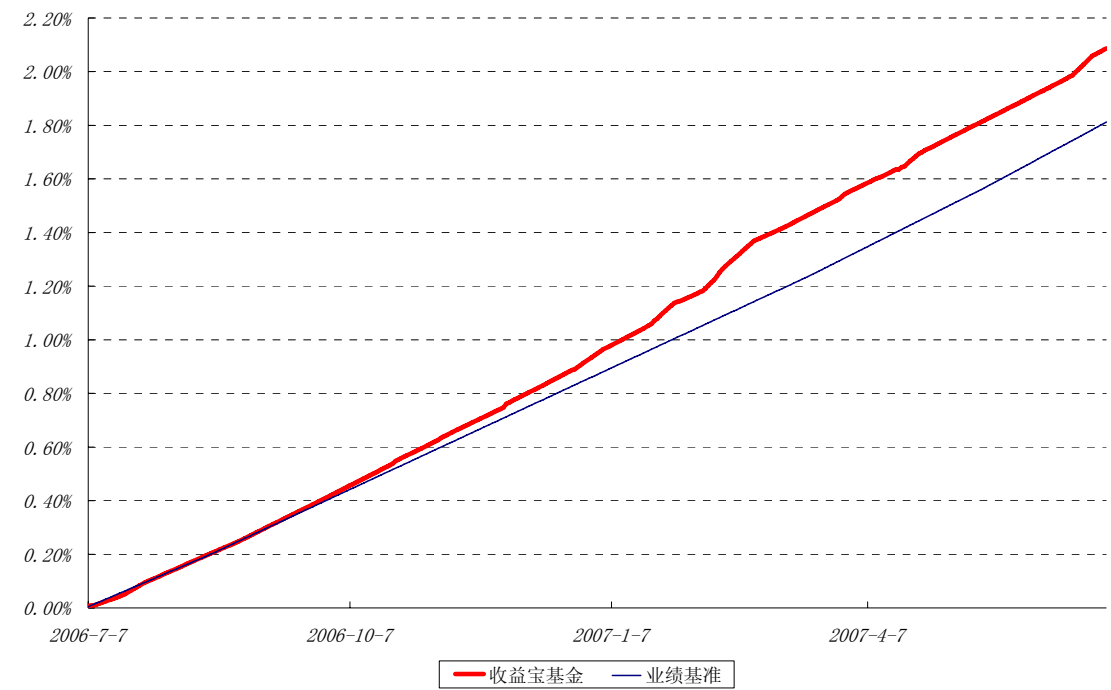
（二） 基金净值表现

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	0.1952%	0.0021%	0.1716%	-	0.0236%	0.0021%
最近三个月	0.5295%	0.0017%	0.5016%	0.0002%	0.0279%	0.0015%
最近六个月	1.1413%	0.0022%	0.9510%	0.0003%	0.1903%	0.0019%
自基金合同生效起至今	2.0868%	0.0018%	1.8118%	0.0003%	0.2750%	0.0015%

注 2：本基金的业绩比较基准半年期定期存款利率（税前）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标准差的计算已相应调整。

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



制作:

校核:

签发:

三. 管理人报告

(一) 基金经理及基金管理经验

基金经理：李源海 先生

李源海先生，自 1999 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 月起从事证券行业，历任湘财证券有限责任公司投资银行部项目经理、证券投资部投资经理；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高级经理、基金管理部基金经理；2005 年 9 月加盟本公司，2006 年 2 月起担任盛利强化配置基金的基金经理。拥有 6 年以上金融从业经验，4 年以上证券投资管理经验和 3 年以上基金从业经历。

(二) 基金运作的合规守信情况

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

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。央行在上半年 5 次上调存款准备金率，每次上调 0.5%；两次存贷款加息，并且在 5 月份进行的第二次加息采用了结构化加息的方式，中长期存款的加息幅度大于短期，中长期贷款的加息幅度小于短期；央行在上半年还多次发行定向央行票据回笼资金。上半年央行通过公开市场操作总共净回笼资金 6500 多亿。

随着央行各项紧缩政策的出台，货币市场收益率的在上半年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。中长期品种在供应增加和紧缩预期的影响下，涨幅更加明显。回购利率水平则相对较低，其中大盘新股的发行对于回购利率水平形成了比较明显的冲击。

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高企的机会，成功地进行跨市场套利。

(四) 基金管理人对宏观经济环境、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，一是特别国债的发行，总体上来看，特别国债的发行将收紧流动性，对于中长期债券将会造成较大的冲击；一是我们预测央行在下半年至少会再一次加息；还有是存款利息税可能会取消。有鉴于此，我们在下半年将继续采取谨慎的投资策略，积极把握市场机会，规避利率和流动性风险，争取为持有人提供良好的流动性和安全性管理的基础上，创造良好的收益。

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,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基金托管人应尽的义务。

2007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,基本遵循《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》等有关法律法规。

2007年上半年,申万巴黎收益宝货币市场基金出现过组合平均剩余期限超限等情况,我行及时向申万巴黎基金管理有限公司发送提示函件,申万巴黎基金管理有限公司在规定时间内及时采取了措施,未造成基金损失。

本托管人依法对申万巴黎基金管理有限公司在2007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、净值收益率、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

2007 年 8 月 20 日

五. 财务会计报告

(一) 半年度基金会计报表

资产负债表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 6 月 30 日	2006 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	5 (1)	1, 800, 763. 71	8, 471, 581. 91
清算备付金		-	138, 182. 68
交易保证金		-	-
应收证券清算款		-	-
应收股利		-	-
应收利息	5 (2)	1, 307, 745. 56	4, 362, 399. 42
应收申购款		16, 236, 965. 63	-
其他应收款		-	-
股票投资市值		-	-
其中：股票投资成本		-	-
债券投资市值		456, 563, 773. 82	378, 099, 238. 50
其中：债券投资成本		456, 563, 773. 82	378, 099, 238. 50
权证投资市值		-	-
其中：权证投资成本		-	-
买入返售证券		-	81, 600, 000. 00
待摊费用		-	-
其他资产		-	-
资产总计		475, 909, 248. 72	472, 671, 402. 51

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	-	-

制作：

校核：

签发：

应付管理人报酬		135,094.32	134,706.76
应付托管费		40,937.65	40,820.24
应付销售服务费		102,344.18	102,050.56
应付利息		—	4,602.71
应付收益		—	—
未交税金		—	—
其他应付款	5 (3)	11,862.93	11,236.87
卖出回购证券款		—	10,000,000.00
预提费用	5 (4)	238,117.87	170,781.96
其他负债		—	—
负债合计		2,897,235.34	10,514,624.81

所有者权益：

实收基金	5 (5)	473,012,013.38	462,156,777.70
未实现利得		—	—
未分配收益		—	—
所有者权益合计		473,012,013.38	462,156,777.70
基金份额		473,012,013.38	462,156,777.70
基金份额资产净值		1.0000	1.0000

经营业绩表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
一、收入		10,347,257.03
1、股票差价收入		-
2、债券差价收入	5(6)	282.95
3、权证差价收入		-
4、债券利息收入		8,448,713.10
5、存款利息收入		66,218.18
6、股利收入		-
7、买入返售证券收入		1,832,042.80
8、其他收入		-
二、费用		2,739,247.21
1、基金管理人报酬		1,118,534.76
2、基金托管费		338,949.90
3、基金销售服务费		847,374.83
4、卖出回购证券支出		216,758.28
5、利息支出		-
6、其他费用	5(7)	217,629.44
其中：信息披露费		92,820.42
审计费用		49,588.57
三、基金净收益		7,608,009.82
加：未实现利得		-
四、基金经营业绩		7,608,009.82

收益分配表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
本期基金净收益		7,608,009.82
加：期初基金净收益		-
加：本期损益平准金		-
可供分配基金净收益		7,608,009.82
减：本期已分配基金净收益	5(8)	7,608,009.82
期末未分配净收益		-

基金净值变动表

单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
一、期初基金净值		462,156,777.70
二、本期经营活动：		
基金净收益		7,608,009.82
未实现经营利得变动数		-
经营活动产生的基金净值变动数		7,608,009.82
三、本期基金单位交易		
基金申购款		2,243,406,579.85
其中包括：收益结转份额		7,608,009.82
基金赎回款		2,232,551,344.17
基金单位交易产生的基金净值变动数		10,855,235.68
四、本期向持有人分配收益：		
向持有人分配收益产生的基金净值变动数	5(8)	7,608,009.82
五、期末基金净值		473,012,013.38

(二) 会计报表附注

1、基金的基本情况

制作：

校核：

签发：

本基金是经中国证券监督管理委员会核准（见证监基金字[2006]98 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，基金管理人为申万巴黎基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行，基金合同于 2006 年 7 月 7 日生效，该日基金份额总额为 1,259,604,476.00 份。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《申万巴黎收益宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于以下金融工具，包括：(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。

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及更正事项。

4、关联方关系及关联方交易

(1) 本报告期内，关联方关系未发生变化。

(2) 关联方交易

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. 关联方报酬

(a) 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。其计算公式为：

日基金管理费 = 前一日基金资产净值 * 0.33% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付基金管理费 1,118,534.76 元。

(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。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。

本基金在本会计期间需支付基金托管费 338,949.90 元。

(c) 基金销售服务费

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。其计算公式为：

日基金销售服务费 = 前一日基金资产净值 * 0.25% ÷ 当年天数。

本基金在本会计期间需支付给各关联方的基金销售服务费情况如下：

关联方名称	2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日
申万巴黎基金管理有限公司	155,316.26
中国工商银行	583,477.16
申银万国证券股份有限公司	58,714.68
合计	797,508.10

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

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	89,526,530.00	-	-	-
本期 申银万国	-	-	-	-

D. 关联方投资本基金的情况

(a) 本基金管理人本期内和上期内未投资本基金。

(b) 本基金管理人主要股东及其控制的机构在本期末和上期末未持有本基金份额。

E. 本期末管理人基金从业人员持有本基金的情况

持有基金份额	占基金总份额比例
336,325.12	0.07%

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，并按银行间同业存款利率计息。

关 联 人	银行存款余额	存款利息收入
本期间 中国工商银行	1,800,763.71	47,092.52

5、基金会计报表重要项目

(1) 银行存款：

期末数

活期存款	1,800,763.71
定期存款	二
合 计	<u>1,800,763.71</u>

(2) 应收利息:

	期末数
应收银行存款利息	363.57
应收债券利息	<u>1,307,381.99</u>
合 计	<u>1,307,745.56</u>

(3) 其他应付款:

	期末数
应付银行间结算服务费	9,150.00
应付银行间交易手续费	<u>2,712.93</u>
合 计	<u>11,862.93</u>

(4) 预提费用:

	期末数
信息披露费	184,102.38
审计费	49,588.57
银行间帐户维护费	<u>4,426.92</u>
合 计	<u>238,117.87</u>

(5) 实收基金:

	本期数
期初数	462,156,777.70
申购增加数	2,235,798,570.03
收益结转份额增加数	7,608,009.82
赎回减少数	<u>2,232,551,344.17</u>
期末数	<u>473,012,013.38</u>

(6) 债券差价收入:

	本期数
卖出债券成交总额(收到全部价款)	1,689,978,338.63

卖出债券成本总额	1,683,470,775.39
应收利息总额	<u>6,507,280.29</u>
债券差价收入	<u>282.95</u>
(7) 其他费用:	
	本期数
信息披露费	92,820.42
审计费	49,588.57
证券交易费用	38,924.93
银行汇划费	27,368.60
银行间账户维护费	<u>8,926.92</u>
合 计	<u>217,629.44</u>
(8) 已分配基金净收益:	
	本期数
收益分配金额	7,608,009.82

6、期末流通转让受到限制的基金资产：无。

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	456,563,773.82	95.94%
2	买入返售证券	0.00	0.00%
	其中：买断式回购的买入返售证券	0.00	0.00%
3	银行存款和清算备付金合计	1,800,763.71	0.38%
4	其他资产	17,544,711.19	3.69%
	合 计	475,909,248.72	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	3,447,655,900.00	2.86%
	其中：买断式回购融入的资金	91,635,900.00	0.07%
2	期末债券回购融资余额	0.00	0.00%
	其中：买断式回购融入的资金	0.00	0.00%

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。

(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	53
本期投资组合平均剩余期限最高值	194
本期投资组合平均剩余期限最低值	40

本期投资组合平均剩余期限超过 180 天的情况

序号	发生日期	平均剩余期限 (天)	原因	调整期
1	2007-1-30	194	因一笔债券测算误差导致	1 个交易日

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。

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	26.16%	—
2	30 天 (含) -60 天	40.03%	—
3	60 天 (含) -90 天	22.10%	—

4	90 天（含）-180 天	2.10%	-
5	180 天（含）-397 天（含）	6.51%	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券	6.51%	-
合 计		96.90%	-

（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	80,796,001.21	17.08%
	其中：政策性金融债	49,999,433.00	10.57%
3	央行票据	375,767,772.61	79.44%
4	企业债券	-	-
5	其他	-	-
合 计		456,563,773.82	96.52%
剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债券		30,796,568.21	6.51%

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	06 央票 64	950,000	-	94,587,178.43	20.00%
2	06 央票 60	700,000	-	69,768,680.49	14.75%
3	06 央票 48	600,000	-	59,953,387.50	12.67%
4	06 央票 58	600,000	-	59,833,926.10	12.65%
5	06 央票 62	600,000	-	59,765,724.37	12.64%
6	06 农发 08	500,000	-	49,999,433.00	10.57%
7	04 建行 03 浮	300,000	-	30,796,568.21	6.51%
8	07 央票 33	120,000	-	11,995,000.00	2.54%
9	07 央票 61	100,000	-	9,943,425.92	2.10%
10	06 央票 74	100,000	-	9,920,449.80	2.10%

（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	0

本期偏离度的最高值	-0.0525%
本期偏离度的最低值	-0.2219%
本期每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1134%

（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	1,307,745.56
4	应收申购款	16,236,965.63
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
	合 计	17,544,711.19

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

持有人结构：

	持有基金份额	占总份额比例
机构投资者	196,199,295.19	41.48%
个人投资者	276,812,718.19	58.52%

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：

	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
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
本期收益结转的份额	7,608,009.82
本期基金总赎回份额	2,232,551,344.17
期末基金份额总额	473,012,013.38

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，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，本公司原董事 Francois Petit-Jean 先生不再担任本公司第二届董事会的董事，Max Diulius 先生新任本公司第二届董事会董事。除上述变动事项之外，本基金管理人在本报告期内无其他重大人事变动事项。

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：

	2007 年 1 月 1 日-2007 年 6 月 30 日
本报告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：

	收益支付日
第一次	2007 年 1 月 18 日
第二次	2007 年 2 月 26 日
第三次	2007 年 3 月 19 日
第四次	2007 年 4 月 18 日
第五次	2007 年 5 月 18 日
第六次	2007 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（2007 第 1 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-01-16
申万巴黎收益宝货币市场基金 2006 年第 4 季度季度报告	《上海证券报》 《证券时报》	2007-01-22
关于开通新经济混合型基金及其他基金之间转换业务	《中国证券报》	2007-02-09

的公告	《上海证券报》 《证券时报》 《证券日报》	
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》 《证券时报》	2007-02-13
申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2007 第 2 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-02-16
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》 《证券时报》	2007-02-16
申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2007 第 3 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-03-17
申万巴黎收益宝货币市场基金 2006 年年度报告摘要	《上海证券报》 《证券时报》	2007-03-27
申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2007 第 4 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-17
申万巴黎收益宝货币市场基金 2007 年第 1 季度季度报告	《上海证券报》 《证券时报》	2007-04-19
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》 《证券时报》	2007-04-26
申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2007 第 5 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-05-17
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》	2007-06-05
申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付公告（2007 第 6 号）	《上海证券报》 《证券时报》	2007-06-16

十. 备查文件目录

备查文件：基金合同；

招募说明书及其定期更新；

发售公告；

基金合同生效公告；

开放日常交易业务公告；

定期报告；

其他临时公告。

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、发售公告和基金合同生效公告均放置于本基金管理人及基金托管人的住所；开放日常交易业务公告、基金定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。上述文件均可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：www.swbnpp.com。

申万巴黎基金管理有限公司

二零零七年八月二十九日