申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(第七次更新)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2009年12月31日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为2009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 2326 1188

6、联系人:王菲萍

7、注册资本:人民币1.5亿元

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副总裁,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市长秘书、主任科员。1993年初至1998年初在交通银行总行秘书处、条法处先后担任副行长秘书、行长秘书、党组秘书。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1983年任职于中国工商银行上海分行,1983年至1986年任职于中国驻加蓬大使馆经参处。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,现任公司副总裁。

Max Diulius先生,董事,1963年出生。巴黎工商联会商学院毕业;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和资产偿还部主管等。

毛应樑先生,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。1985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年任上海证券交易所理事会理事长、顾问。

王大东先生,独立董事,1955年出生。1984年至1988年任中国驻法国大使馆二等秘书,1991年至1993年任国家行政学院筹建办公室处长,1994年至2000年供职于法国雷诺汽车公司北京代表处,先后任副代表和首席代表。2001年至2004年在法国雷诺卡车公司北京代表处任首席代表,2004年至2007年任法国阿尔斯通(中国)投资公司副总裁,2007年9月至今担任欧洲宇航防务集团中国公司副总裁。

袁恩桢先生,独立董事,1938年出生。曾任社会科学院经济研究所研究室主任、所长,现任上海市经济学会会长、上海社会科学院经济研究所顾问。

赵霄洛先生,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、香港何耀棣律师事务所、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:

刘鸿儒先生,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。

Jean Audibert先生,监事,1951年出生。1975年加入法国巴黎银行,先后在科威特、新加坡、韩国等地工作。1996年至2001年任法国巴黎银行总部国际贸易服务部门负责人。2001年至2005年任法国巴黎银行总部现金管理业务负责人。2005年至2008年任新韩巴黎资产信托管理有限公司总裁兼CEO。2009年1月至今,任法国巴黎资产管理有限公司亚洲新兴市场主席。

王厚谊先生,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年起任职上海船舶研究设计院;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总部薪酬部经理。2004年1月加盟本公司。

(3)高级管理人员

毛剑鸣先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。

过振华先生,副总裁,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年任申万泛达投资管理(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。

(4)督察长:

来肖贤先生,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、部门副经理。

(5)基金经理

周鸣女士,清华大学工商管理硕士。自2001年起从事金融工作,先后就职于天相投资顾问公司、太平人寿保险公司、太平养老保险公司等,从事基金投资、企业年金投资等工作。2009年5月加盟申万巴黎基金管理有限公司投资管理总部,2009年6月起任申万巴黎收益宝货币市场基金基金经理及申万巴黎添益宝债券型证券投资基金基金经理。

(6)投资决策委员会组成

投资决策委员会由下述执行委员组成:总裁、副总裁、投资总监、基金经理代表、组合投资经理代表。委员会执行委员在会议期间对所决策事项有投票权。

非执行委员有下列人员组成:研究负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资经理。非执行委员对需决策事项可发表观点,但不参与决策事项的投票表决。

本公司总裁担任投资决策委员会主席,投资总监担任投资决策委员会会议召集人。

本公司董事长、督察长和风险管理总监和首席金融工程师有权列席投资决策委员会的任何会议。

(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334,018,850,026元

联系电话:010-66105799

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:姜国芳

电话:+86 21 23261188

传真:+86 21 23261199

联系人:陈继红 陈景新

客户服务中心电话:+86 21 962299,或400 880 8588

2、代销机构

(1)名称: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

客户服务电话:95588

传真:+86 10 66107914

网址:www.icbc.com.cn

(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

联系人:王琳

客户服务电话:95533

传真:(010)66275654

网址:www.ccb.com

(3)名称:中国农业银行股份有限公司

注册地址:北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人:项俊波

传真:+86-10-85109219

联系人:蒋浩

客户服务电话:95599

网址:www.abchina.com

(4)名称:交通银行股份有限公司

住所:上海市浦东新区银城中路188号

办公地址:上海市银城中路188号

法定代表人:胡怀邦

电话:(021)58781234

传真:(021)58408842

联系人:曹榕

客户服务电话:95559

网址:http://www.bankcomm.com/

(5)名称: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:陆红霞

传真:010-83914283

网址:www.cmbc.com.cn

(6)名称:深圳发展银行股份有限公司

注册办公所:广东省深圳市罗湖区深南东路5047号

法定代表人:法兰克纽曼(Frank.N.Newman)

联系人:周勤

传真:(0755)82080406

客户服务电话:95501

网址:www.sdb.com.cn

(7)上海农村商业银行股份有限公司

注册地址:上海市浦东新区浦东大道981号

法定代表人:李秀仑

客服电话:021-962999

联系人:吴海平,翁敏芬

传真:021-62521689

网址:www.shrcb.com

(8)南京银行股份有限公司

注册地址:南京市白下区淮海路50号

办公地址:南京市白下区淮海路50号

法定代表人:林复

传真:025-84544129

联系人:贺坚

客户服务电话:4008896400

网址:www.njcb.com.cn

(9)名称: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

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

(10)名称:中信建投证券有限责任公司

注册地址:北京市朝阳区安立路66号4号楼

办公地址:北京市朝阳门内大街188号

法定代表人:张佑君

联系人:权唐

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

(11)名称:海通证券股份有限公司

注册地址:上海市淮海中路98号

办公地址:上海市广东路689号

法定代表人:王开国

联系人:金芸、李笑鸣

客户服务电话:400-8888-001(全国),021-95553,或拨打各城市营业网点咨询电话

公司网站:www.htsec.com

(12)名称: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:上海浦东新区银城中路168号上海银行大厦29层

法定代表人:祝幼一

传真:021-38670161

客户服务热线:4008888666

公司网站:www.gtja.com

(13)名称: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38—45层

法定代表人:宫少林

传真:+86 755 82943636

联系人:黄健

客户服务热线:4008888111、95565

公司网站:www.newone.com.cn

(14)名称: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:胡长生

客户服务热线:400 8888 888

传真:+86 10 66568536

联系人:李洋

公司网址:www.chinastock.com.cn

(15)名称:广发证券股份有限公司

住所:广东省天河北路183号大都会广场43楼

办公地址:广东广州天河北路大都会广场18、19、36、38、41和42楼

法定代表人:王志伟

电话:95575或致电各营业网点

传真:(020)87555417

联系人:黄岚

公司网站:www.gf.com.cn

(16)名称:光大证券股份有限公司

注册地址:上海市静安区新闸路1508号

法定代表人:徐浩明

联系人:刘晨

客户服务电话: 400 8888 788、10108998

传真:021-68815009

公司网站:www.ebscn.com

(17)名称:东方证券股份有限公司

注册地址:上海市中山南路318号2号楼22层-29层

法定代表人:王益民

联系人:吴宇

传真:021-63326173

客户服务电话:+86-21-95503

东方证券网站:www.dfzq.com.cn

(18)国元证券股份有限公司

注册地址:安徽省合肥市寿春路179号

法定代表人:凤良志

传真:0551-2207965

联系人:祝丽萍

客户服务电话:400-8888-777,95578

网址:www.gyzq.com.cn

(19)名称:信达证券有限责任公司

注册地址:北京市西城区三里河东路5号中商大厦10层

办公地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼信达金融中心

法定代表人:张志刚

联系人:唐静

客服电话:400-800-8899

公司网址:www.cindasc.com

(20)名称:江南证券有限责任公司

注册地址:江西省南昌市抚河北路291号

法定代表人:姚江涛

联系人:余雅娜

客服电话:0791-6768763

网址:www.scstock.com

(21)国信证券有限责任公司

注册地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信证券大厦十六层至二十六层

办公地址:深圳市罗湖区红岭中路1012号国信信托大厦9楼

法定代表人:何如

联系人:齐晓燕

传真:0755-82133302

客户服务电话:95536

网址:www.guosen.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 23261188

传真:+86 21 23261199

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:上海市银城中路68号,时代金融中心19楼

负责人:韩炯

电话:+86 21 31358666

传真:+86 21 31358600

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:普华永道中天会计师事务所有限公司

注册地址:上海市浦东新区陆家嘴环路1233号汇亚大厦1604-1608室

办公地址:上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

法定代表人姓名:杨绍信

电话:+86 -21-23238888

传真:+86-21-23238800

联系人姓名:陈宇

经办注册会计师姓名:汪棣、陈宇

四、基金的名称

本基金的名称:申万巴黎收益宝货币市场基金

五、基金的类型

本基金的类型:契约型开放式

本基金的类别:货币市场基金

六、基金的投资目标

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比较基准的回报。

本基金奉行主动式投资管理。本基金以价值分析为基础,定性与定量分析相结合,通过积极的投资策略,在严格控制风险的前提下,力争基金资产获得持续稳定的收益,为投资者实现资产的保值和增值。

七、基金的投资范围和投资对象

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。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资限制:

[1]、本基金不得投资于以下金融工具:

(1)股票;

(2)可转换债券;

(3)剩余期限超过397天的债券;

(4)信用等级在AAA级以下的企业债券;

(5)以定期存款为基准利率的浮动利率债券;

(6)中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。

法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。

[2]、本基金的投资组合应当符合下列规定:

(1)投资于同一公司发行的短期融资券及短期企业债券的比例,不得超过基金资产净值的10%;

(2)与本基金管理人管理的其他基金合计持有一家公司发行的证券,不超过该证券的10%;

(3)存放在具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的30%;存放在不具有基金托管资格的同一商业银行的存款,不得超过基金资产净值的5%;

(4)基金投资于定期存款的比例,不得超过基金资产净值的30%;

(5)除发生巨额赎回情形外,债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。因发生巨额赎回导致债券正回购的资金余额超过基金资产净值20%的,基金管理人应在5个交易日内进行调整;

(6)投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过180天;

(7)持有的剩余期限不超过397天但剩余存续期超过397天的浮动利率债券的摊余成本总计不得超过当日基金资产净值的20%;

(8)通过买断式回购融入的基础债券的剩余期限不得超过397天;

(9)法律法规或中国证监会、中国人民银行规定的其他比例限制。

由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外的原因导致的投资组合不符合上述约定的比例不在限制之内,但基金管理人应在10个交易日内进行调整,以达到标准。

法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。

[3]、基金投资的短期融资券的信用评级应不低于以下标准:

(1)国内信用评级机构评定的A-1级或相当于A-1级的短期信用级别;

(2)根据有关规定予以豁免信用评级的短期融资券,其发行人最近三年的信用评级和跟踪评级具备下列条件之一:

① 国内信用评级机构评定的AAA级或相当于AAA级的长期信用级别;

② 国际信用评级机构评定的低于中国主权评级一个级别的信用级别(例如,若中国主权评级为A-级,则低于中国主权评级一个级别的为BBB+级)。

同一发行人同时具有国内信用评级和国际信用评级的,以国内信用级别为准。

基金持有短期融资券期间,如果其信用等级下降、不再符合投资标准,应在评级报告发布之日起二十个交易日内予以全部减持。?

法律法规或监管部门取消上述限制,本基金不受上述限制。

八、基金的投资策略

1、本基金的投资策略

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、投资管理的方法和标准

(1)投资计划和项目方案的制定: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(附带详细的研究报告)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)投资授权和方案实施: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、市场心理变化等,进一步分析判断,并据此调整投资组合。如果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)。

当市场上出现更加合适的业绩基准时,基金管理人有权对业绩比较基准进行调整,并按届时有效的法律法规进行公告,但无需召开基金份额持有人大会。

十、风险收益特征

低风险、高流动性和持续稳定收益

十一、基金的投资组合报告

本投资组合报告所载数据截止日为2009年12月31日,本报告中所列财务数据未经审计。

1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	185,154,117.39	1.80
	其中:债券	185,154,117.39	1.80
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,254,806,491.25	41.36
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	5,395,857,505.27	52.45
4	其他资产	452,394,868.24	4.40
5	合计	10,288,212,982.15	100.00

2 报告期债券回购融资情况

序号	项目		占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额		0.02
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

3 基金投资组合平均剩余期限

3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	5
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	90
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	5

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

本基金本报告期内不存在投资组合平均剩余期限超过180天的情况。

3.2 报告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	96.70	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.05	-
2	30天(含)—60天	0.39	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—180天	0.19	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)—397天(含)	0.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	97.96	-

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	79,910,362.67	0.78
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,000,000.00	0.05
5	企业短期融资券	100,243,754.72	0.97
6	其他	-	-
7	合计	185,154,117.39	1.80
8	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	5,000,000.00	0.05

5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	0901038	09央票38	300,000	29,652,972.17	0.29
2	0701085	07央票85	200,000	20,224,899.01	0.20
3	0981010	09新矿CP01	200,000	20,058,586.66	0.20
4	0981027	09保利CP01	200,000	20,056,047.22	0.19
5	0701013	07央票13	200,000	20,037,401.72	0.19
6	0981009	09京热电CP01	100,000	10,063,318.48	0.10
7	0981012	09日照港CP01	100,000	10,034,223.33	0.10
8	0981097	09东安CP01	100,000	10,014,234.37	0.10
9	0981106	09中牧CP01	100,000	10,009,648.13	0.10
10	0981229	09福耀CP02	100,000	10,006,998.87	0.10

6 "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
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0次
报告期内偏离度的最高值	0.0118%
报告期内偏离度的最低值	-0.0364%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0144%

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8 投资组合报告附注

8.1 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。

8.2 本报告期内本基金内不存在持有剩余期限小于397天但剩余存续期超过397的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值20%的情况。

8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.4 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	240,879,997.31
3	应收利息	3,998,547.27
4	应收申购款	207,516,323.66
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	452,394,868.24

十二、基金的业绩

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。

本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。

1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较(数据截止时间2009年12月31日):

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
2006年7月7日至2006年12月31日	0.9348%	0.0011%	0.8608%	0.0002%	0.0740%	0.0009%
2007年	2.7128%	0.0051%	2.4441%	0.0017%	0.2687%	0.0034%
2008年	2.8694%	0.0074%	3.4246%	0.0011%	-0.5552%	0.0063%
2009年	0.8559%	0.0054%	1.5007%	0.0020%	-0.6448%	0.0034%
自基金合同生效起至2009年12月31日	7.5605%	0.0061%	8.4682%	0.0026%	-0.9077%	0.0035%

注:本基金收益分配方式是"按日分配收益,按月结转份额"。

2. 自《基金合同》生效以来基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准的变动比较。

申万巴黎收益宝基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比

十三、基金的费用与税收

(一)与基金运作有关的费用

1、与基金运作有关的费用的种类:

(1)、基金管理人的管理费;

(2)、基金托管人的托管费;

(3)、基金销售服务费;

(4)、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用;

(5)、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费和律师费;

(6)、基金份额持有人大会费用;

(7)、基金的证券交易费用;

(8)、银行汇划费用;

(9)、按照国家有关规定和《基金合同》约定,可以在基金资产中列支的其他费用。

上述第4-8项费用由基金托管人根据有关法律法规及相应协议规定,按费用实际支出金额列入当期费用,从基金资产中支付。

本基金终止清算时所发生费用,按实际支出额从基金资产中扣除。

2、基金管理人的管理费计提方法、计提标准和支付方式

基金管理费按前一日基金资产净值的0.33%年费率计提。计算方法如下:

H = E ×0.33% ÷ 当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人,若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

3、基金托管人的托管费计提方法、计提标准和支付方式

基金托管费按前一日基金资产净值的0.1%年费率计提。计算方法如下:

H = E × 0.1% ÷ 当年天数,其中:

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计算,逐日累计至每个月月末,按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令,基金托管人复核后于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等,支付日期顺延。

4、基金销售服务费

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下:

H=E×0.25%÷当年天数

H为每日应计提的销售服务费

E为前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划款指令,基金托管人复核后于次月前2个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等,支付日期顺延。

销售服务费主要用于支付销售机构佣金、以及基金管理人的基金行销广告费、促销活动费、持有人服务费等。

(二)与基金销售有关的费用

1、认购费用

本基金认购采取金额认购的方式,认购费率为0。

2、申购费用

本基金申购采取金额申购的方式,认购费率为0。

3、赎回费用

本基金赎回采取份额申请赎回到方式,赎回费率为0。

(三)不列入基金费用的项目

基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金资产的损失,以及处理与基金运作无关的事项发生的费用等不列入基金费用。《基金合同》生效前的相关费用,包括但不限于验资费、会计师和律师费、信息披露费用等不列入基金费用。

(四)费用调整

基金管理人和基金托管人协商一致后,可根据基金发展情况调整基金管理费率、基金托管费率、基金销售费率等相关费率。

调高基金管理费率、基金托管费率或基金销售费率等费率,须召开基金份额持有人大会审议;调低基金管理费率、基金托管费率或基金销售服务费率等费率,无须召开基金份额持有人大会。

基金管理人必须最迟于新的费率实施日前2日在至少一种中国证监会指定媒体上公告。

(五)基金的税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体,其纳税义务按国家税收的有关法律法规执行。

十四、对招募说明书本次更新部分的说明

本招募说明书(更新)依据《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》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求,并根据基金管理人在《基金合同》生效后对本基金实施的投资经营活动进行了内容补充和更新,主要更新的内容如下:

1、变更了基金托管人的部分信息;

2、变更了代销机构的部分信息;

3、更新了投资组合报告,数据截止日期为2009年12月31日;

4、更新了基金的业绩部分,数据截止日期为2009年12月31日;

5、在"其他应披露事项"一章,列举了本基金自2009年7月1日至2009年12月31日发布的有关公告。

十五、其他应披露事项

自2009年7月1日至2009年12月31日,与本基金和本基金管理人有关的公告如下:

1、2009年7月1日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下开放式基金2009年半年度最后一个交易日基金资产净值和基金份额净值的公告。

2、2009年7月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于开通中国民生银行借记卡网上直销交易并实施申购费率优惠的公告。

3、2009年7月17日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第7号)。

4、2009年7月20日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金2009年第二季度报告。

5、2009年7月20日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加中国农业银行为旗下部分基金代销机构并在中国农业银行开通旗下全部基金转换业务的公告。

6、2009年8月13日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于变更在招商银行上海分行直销中心专户银行账号的提示性公告。

7、2009年8月14日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第8号)。

8、2009年8月20日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金招募说明书(第六次更新)摘要。

9、2009年8月25日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金2009年半年度报告。

10、2009年9月1日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金半年度报告内容更正公告。

11、2009年9月7日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下部分基金参与中国农业银行网上银行基金申购费率优惠活动的公告。

12、2009年9月11日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于变更申万巴黎收益宝货币市场基金业绩比较基准及修改相关基金合同的公告。

13、2009年9月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告。

14、2009年9月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第9号)。

15、2009年9月23日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金在国庆、中秋长假前暂停申购及基金转换转入交易的提示性公告。

16、2009年9月24日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于旗下基金参与创业板证券投资及相关风险提示的公告。

17、2009年9月25日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于关于提示直销客户及时补充客户身份基本信息及更新过期身份证明文件的公告。

18、2009年9月25日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于在招商银行上海分行直销中心专户的原银行账号停止使用的提示性公告。

19、2009年10月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司申万巴黎关于开通中国建设银行借记卡E付通网上直销交易并实施申购费率优惠的公告。

20、2009年10月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第10号)。

21、2009年10月20日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司申万巴黎关于旗下基金对停牌的股票变更估值方法的提示性公告。

22、2009年10月22日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于恢复对旗下基金持有的"美的电器"股票进行市价估值的公告。

23、2009年10月27日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金2009年第三季度报告。

24、2009年11月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第11号)。

25、2009年11月18日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加信达证券为旗下基金代销机构的公告。

26、2009年11月18日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于对通过中国农业银行、中国建设银行借记卡进行旗下基金网上直销转换申购补差费实施费率优惠的公告。

27、2009年12月11日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加南京银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告。

28、2009年12月16日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》和《证券时报》的本公司关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告(2009年第12号)。

29、2009年12月21日,刊登于《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》和《证券日报》的本公司关于增加国信证券股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告。

签署日期:2010年1月28日

以上内容仅为摘要,须与本《招募说明书》(更新)正文所载之详细资料一并阅读。

申万巴黎基金管理有限公司

2010年2月12日

申万巴黎基金管理有限公司 关于增聘基金经理的公告

经申万巴黎基金管理有限公司第二届董事会审议通过,公司决定:

增聘张少华先生担任申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金的基金经理。

张少华先生从未被监管机构予以行政处罚或采取行政监管措施。上述事项已按有关规定向监管机构报备。

特此公告。

申万巴黎基金管理有限公司

二零一零年二月十二日

附:基金经理简历

张少华先生,复旦大学数量经济学硕士。自1999年起从事金融工作,1999年7月至2003年1月在申银万国证券股份有限公司任职,2003年1月加入申万巴黎基金管理有限公司筹备组。2004年2月加盟申万巴黎基金管理有限公司,历任风险管理总部高级风险分析师、风险管理总部副总监,2009年3月起任风险管理总部总监,2010年2月起任投资管理总部副总监。

申万巴黎基金管理有限公司 关于申万巴黎收益宝货币市场基金收益支付的公告

(2010年第2号)

申万巴黎收益宝货币市场基金(以下简称"本基金")基金合同于2006年7月7日生效。根据《申万巴黎收益宝货币市场基金基金合同》的规定,经本基金管理人申万巴黎基金管理有限公司(以下简称"本基金管理人")计算,本基金管理人定于2010年2月22日对本基金自2010年1月18日起的收益进行集中支付并自动结转为基金份额,不进行现金支付。现将有关具体事宜公告如下:

一、收益支付说明

本基金管理人定于2010年2月22日将基金份额持有人所拥有的自2010年1月18日起至2010年2月21日止的累计收益进行集中支付,并按1.00元的份额面值自动结转为基金份额,不进行现金支付。

投资者的累计收益具体计算公式如下:

份额持有人的累计收益=∑Ri(i为日期,即份额持有人的日收益逐日累加)

份额持有人的日收益Ri=[份额持有人(i-1)日的持有份额余额+份额持有人(i-1)日的累计未支付收益]×基金i日的每万份净收益/10000(计算精度为0.01元,小数点后第3位采取去尾原则,因去尾形成的余额进行再次分配,直到分完为止。)

二、收益支付时间

1、收益支付日:2010年2月22日;

2、收益结转基金份额日:2010年2月22日;

3、收益结转的基金份额,份额持有人可赎回起始日:2010年2月23日。

三、收益支付对象

收益支付日的前一个工作日在本基金管理人登记注册的本基金份额持有人。

四、收益支付办法

本基金收益支付方式为收益再投资方式,投资者收益结转的基金份额将于2010年2月22日直接计入其基金账户,2010年2月23日起可通过相应的销售机构及其网点查询及赎回。

五、有关税收和费用的说明

1、根据财政部、国家税务总局《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》(财税字[2002]128号),对投资者(包括个人和机构投资者)从基金分配中取得的收入,暂不征收个人所得税和企业所得税。

2、本基金本次收益支付免收分红手续费和再投资手续费。

六、提示

1、2010年2月12日申请申购、转换转入的有效基金份额不享有当日至收益支付日前一日止期间的收益,2010年2月12日申请赎回、转换转出的有效基金份额享有当日至收益支付日前一日止期间的收益;

2、本基金投资者的累计收益将于每月18日集中支付并按1.00元的份额面值自动结转为基金份额,若该日为非工作日,则顺延至下一工作日。

七、咨询办法

1、申万巴黎基金管理有限公司网站:www.swbnpp.com

2、申万巴黎基金管理有限公司全国统一客户服务电话:400 880 8588(免长途话费);或者021-962299。

3、通过中国工商银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、深圳发展银行股份有限公司、南京银行股份有限公司、上海农村商业银行股份有限公司、申银万国证券股份有限公司、中信建投证券股份有限责任公司、海通证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、国元证券股份有限公司、江南证券有限责任公司等销售机构咨询。

特此公告。

申万巴黎基金管理有限公司

二零一零年二月十二日

申万巴黎基金管理有限公司 关于申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金基金合同生效公告

申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金(以下简称"本基金")的募集工作已于2010年2月5日结束。经普华永道会计师事务所验资,确认本次发行的有效认购总金额为人民币933,186,314.72元,其中净销售额为人民币925,091,640.13元。

依照《申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金基金合同》的有关规定,认购资金的银行利息76,388.09元折算成基金份额已分别计入各基金持有人的基金账户,归各基金持有人所有。上述资金总额已于2010年2月9日全额划入本基金在基金托管人中国工商银行的托管专户。

按照每份基金份额面值人民币1.00元计算,本基金设立募集期间含本息共募集925,168,028.22份基金单位,有效认购户数为12,983户。其中,本基金管理人的基金从业人员认购持有的基金份额总额为247,525.75份(含募集期利息结转的份额),占本基金总份额的比例为0.0268%。

本基金于2010年2月11日收到中国证监会书面确认的函(中国证监会基金部函[2010]73号),基金备案手续办理完毕。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金基金合同》的有关规定,申万巴黎沪深300价值指数证券投资基金已符合基金合同生效的条件,于2010年2月11日起基金合同正式生效。自合同生效日起,本基金管理人——申万巴黎基金管理有限公司,正式开始管理本基金。根据有关规定,本基金合同生效前的律师费、会计师费、信息披露费等费用由本基金管理人承担,不另从基金资产支付。

基金持有人可以在本基金合同生效之日起到销售机构的网点进行交易确认单的查询和打印,也可以通过本基金管理人的客户服务电话400 880 8588(免长途话费)或021-962299和网站www.swbnpp.com查询交易确认情况。

本基金管理人将自本基金成立之日起30个工作日内向所有本基金持有人寄送交易确认书。请本基金持有人注意确认开户时填写的地址是否准确、完整(包括省、市、区、具体地址及邮政编码等),若需补充或更改,请及时到原开户机构变更相关资料。

本基金的日常申购、赎回业务将根据本基金合同的规定尽快开始办理,本基金管理人将在开始办理申购、赎回的具体日期前2日在指定报刊和网站上刊登公告,届时请注意阅读。

特此公告。

申万巴黎基金管理有限公司

二零一零年二月十二日