

申万巴黎收益宝货币基金

招募说明书(第八次更新)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,并接受《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,应仔细阅读基金合同。
- 本招募说明书(更新)所载内容截止日为2010年6月30日,有关基金的财务数据和净值表现截止日为2010年6月30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
办公地址:中国上海淮海中路300号40层
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:王菲菲
7、注册资本:人民币1.5亿元
8、股权结构: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责任公司持有33%的股权

C 主要人员情况
Q 董事会成员:
姜国芳先生,董事长,1952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。
毛鸿鸣先生,董事,1969年出生。美国肯特州立大学金融硕士学位。1992年至1994年在阿克隆大学任经济系讲师,1995年至1999年在肯特州立大学金融系讲师,1999年至2002年在HFA“资产管理公司”董事总经理。2002年至2007年任富达克林顿罗斯福基金集团美国总部高级投资经理。
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秘书长、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、党组书记。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。

陆克清先生,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年任职于中国建设银行上海分行,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年任上海申银证券有限公司总裁助理兼国际业务部总经理,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 Dulinu先生,董事,1963年出生。巴黎工商联合商学院毕业,现任法国巴黎资产管理(中国)有限公司新兴市场开发及市场部主管,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资产还本主管等。

毛应楼先生,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年任中国工商银行上海市分行行长,党委书记。1999年至2003年任上海证券交易所副所长兼理事长、顾问。
王天庆先生,独立董事,1955年出生。1984年至1988年任中国建设银行上海分行副行长,1991年至1993年任国家行政学院基建办公室处长,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、主任科员,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年任法国阿赫斯通(中国)投资公司副总裁,2007年9月至今担任欧洲华航财务集团中国公司副总裁。
吴恩祺先生,独立董事,1938年出生。曾任中国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。

赵磊清先生,监事,1950年出生。曾任职于司法部香港中国法律服务有限公司,香港何耀康律师事务所,信达律师事务所,现任北京众鑫律师事务所上海分所主任,律师。
邓锦雄先生,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,中国证监会主任。

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交易服务部负责人。2001年至2005年任法国巴黎银行总部国际管理业务负责人。2005年至2008年任新加坡巴黎银行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(中国)有限公司副董事长。
王天庆先生,监事,曾任法国巴黎基金管理有限公司行政管理部门负责人。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。

Q 高级管理人员
Q 高级管理人员
毛鸿鸣先生,总裁,相关介绍见董事会成员部分。
姜国芳先生,副总裁,1964年出生,工商管理硕士。1983年至1990年任职于上海申银证券(亚洲)有限公司国际业务部,1999年至2004年2月任申银万国证券股份有限公司国际业务部副总经理。2004年3月至2007年4月任申万巴黎基金管理有限公司督察长。
Q 督察长:
米晋岩先生,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,副经理。

Q 基金经理
周鸣志先生,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,太平人寿保险有限公司,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担任基金经理,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蓝筹债债券基金基金经理。
Q 投资决策委员会成员

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、组合投资管理代表、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:研究员负责人、宏观及策略分析师、基金经理、组合投资管理。非执行委员对相关事项可发表观点,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任,投资总监担任投资决策委员会会议召集人。

二、基金托管人
Q 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334,018,820.02元
联系电话:010-66105799
网址:www.icbc.com.cn

三、销售服务机构
(一)基金销售机构
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 9629299 ,或400 880 8888

2、代销机构
Q 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:田梅
客户服务电话:95588
传真:+86 10 66107914
网址:www.icbc.com.cn

Q 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:010-62762654
网址:www.ccb.com

Q 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:蒋卫华
客户服务电话:95599
网址:www.abchina.com

Q 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 88781234
传真:021 88408422
联系人:曾刚
客户服务电话:95559
网址:http://www.bankcomm.com/

Q 名称:民生证券股份有限公司
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:程红霞
电话:010-83914283
网址:www.msbc.com.cn

Q 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
电话:0755 82080406
客户服务电话:95501
网址:www.sfb.com.cn

Q 名称: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:胡晋才
客服电话:021-962999
联系人:吴海平,周蕾
传真:021-50105124
网址:www.srb.com.cn

Q 名称: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
电话:025-84544129
联系人:贺慧
客户服务电话:4008896400
网址:www.njbc.com.cn

Q 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:丁国葵

传真:+86 21 54035333
联系人:邓寒冰
客服电话:021-962505
公司网址:www.sw2000.com.cn
Q 0) 名称:中信建投证券有限责任公司
注册地址:北京市朝内大街166号4号楼
办公地址:北京市朝内大街166号188号
法定代表人:张佑君
联系人:权童
开放式基金咨询电话:400-8888-108
开放式基金业务传真:010 65182261
公司网址:www.citic108.com

Q 1) 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68号
法定代表人:王浩
联系人:金芸,李奕鸣
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
公司网址:www.htsec.com

Q 2) 名称:国泰君安证券股份有限公司
注册地址:上海市浦东新区世纪大道168号
办公地址:上海浦东新区世纪大道168号上海银行大厦29层
法定代表人:杨功一
电话:021-38670161
客户服务电话:4008888666
公司网址:www.gtja.com

Q 3) 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:李少林
电话:86 755 82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:4008881111-95565
公司网址:www.newone.com.cn

Q 4) 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:李伟
客户服务电话:400 8888 888
传真:86 1010-66566114
联系人:田薇
公司网址:www.chinastock.com.cn

Q 5) 名称:广发证券股份有限公司
住所:广东省天河区北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东省天河区北路大都会广场18,19,36,38,41和42楼
法定代表人:王传伟
电话:95575(致电广发证券营业网点)
传真:020 85545147
联系人:黄爽
公司网站:www.gf.com.cn

Q 6) 名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘鹏
客户服务电话:400 8888 788,10108998
电话:021-68815009
公司网站:www.ebsen.com

Q 7) 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
电话:021-63326123
客户服务电话:+86 21-95503
东方证券网站:www.dfq.com.cn

Q 8) 名称: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
联系人:倪超
电话:0551-22079065
客户服务电话:400-8888-777, 95578
网址:www.gy.com.cn

Q 9) 名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼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

Q 0) 名称:信达证券股份有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:余雅璐
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

Q 1) 名称:国信证券股份有限公司
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
电话:0755-82133302
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

Q 2) 名称:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3.5层
法定代表人:丁之锁
联系人:康宇
客户服务电话:010-58568062
网址:www.hrsec.com.cn

C 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

C 律师事务所和经办律师
律师事务所:上海律师事务所
律师事务所:上海律师事务所
地址:上海市银城中路68号,时代金融中心19楼
负责人:李刚
电话:+86 21 31358660
传真:+86 21 31358666
经办律师:秦悦民,王利民

Q 4) 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:上海市湖南路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

四、基金名称
本基金名称: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
在严格控制风险和保持流动性的基础上,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:
Q 现金
Q 通知存款
Q 3个月以内(含)3个月的定期存款,大额存单
Q 4) 期限在397天以内(含)397天的债券
Q 5) 期限在1年以内(含)1年的附息债券
Q 6) 期限在1年以内(含)1年的中央银行票据
Q 7) 短期融资券
Q 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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
本基金的投资限制:
Q 1) 本基金不得投资于以下金融工具:
Q 1) 股票;
Q 2) 可转换债券;
Q 3) 剩余期限超过397天的债券;
Q 4) 信用等级在AAA级以下的企业债券;
Q 5) 以定期存款为基础而获得的浮动利率债券;
Q 6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。
法律法规或监管机构取消上述限制,本基金不受上述限制。

八、基金的投资组合
D 1) 与本基金的投资组合应当符合下列规定:
Q 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%;
Q 2) 与本基金投资的其他基金合计持有同一基金公司的股票,不得超过该基金的10%;
Q 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%;
Q 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%;
Q 5) 除发生巨额赎回情况外,债券正回购的资金余额在每交易日均不得超过该基金资产净值的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个工作日内进

行调整;
Q 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;
Q 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%;

Q 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;
Q 9) 法律法规和中国证监会、中国人民银行规定的其它比例限制。
由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外原因导致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。
法律法规或监管机构取消上述限制,本基金不受上述限制。

Q 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;
Q 2) 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;
Q 3) 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:
Q 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;
Q 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,则国际信用评级一个级别的或为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予以全部减持。
法律法规或监管机构取消上述限制,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,通过对短债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。
Q 1) 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:李少林
电话:86 755 82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:4008881111-95565
公司网址:www.newone.com.cn

Q 4) 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:李伟
客户服务电话:400 8888 888
传真:86 1010-66566114
联系人:田薇
公司网址:www.chinastock.com.cn

Q 5) 名称:广发证券股份有限公司
住所:广东省天河区北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东省天河区北路大都会广场18,19,36,38,41和42楼
法定代表人:王传伟
电话:95575(致电广发证券营业网点)
传真:020 85545147
联系人:黄爽
公司网站:www.gf.com.cn

Q 6) 名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘鹏
客户服务电话:400 8888 788,10108998
电话:021-68815009
公司网站:www.ebsen.com

Q 7) 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
电话:021-63326123
客户服务电话:+86 21-95503
东方证券网站:www.dfq.com.cn

Q 8) 名称: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
联系人:倪超
电话:0551-22079065
客户服务电话:400-8888-777, 95578
网址:www.gy.com.cn

Q 9) 名称:信达证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区闹市口大街9号院1号楼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

Q 0) 名称:信达证券股份有限公司
注册地址:江西省南昌市抚河北路291号
法定代表人:杜航
联系人:余雅璐
客服电话:400-8866-567
网址:www.avicsec.com

Q 1) 名称:国信证券股份有限公司
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
电话:0755-82133302
客户服务电话:95536
网址:www.guosen.com.cn

Q 2) 名称:华融证券股份有限公司
注册地址:北京市西城区月坛北街26号
办公地址:北京市西城区金融大街8号A座3.5层
法定代表人:丁之锁
联系人:康宇
客户服务电话:010-58568062
网址:www.hrsec.com.cn

C 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

C 律师事务所和经办律师
律师事务所:上海律师事务所
律师事务所:上海律师事务所
地址:上海市银城中路68号,时代金融中心19楼
负责人:李刚
电话:+86 21 31358660
传真:+86 21 31358666
经办律师:秦悦民,王利民

Q 4) 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:上海市湖南路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

四、基金名称
本基金名称: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
在严格控制风险和保持流动性的基础上,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:
Q 现金
Q 通知存款
Q 3个月以内(含)3个月的定期存款,大额存单
Q 4) 期限在397天以内(含)397天的债券
Q 5) 期限在1年以内(含)1年的附息债券
Q 6) 期限在1年以内(含)1年的中央银行票据
Q 7) 短期融资券
Q 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,基金管理人可在履行适当程序后,将其纳入投资范围。
本基金的投资限制:
Q 1) 本基金不得投资于以下金融工具:
Q 1) 股票;
Q 2) 可转换债券;
Q 3) 剩余期限超过397天的债券;
Q 4) 信用等级在AAA级以下的企业债券;
Q 5) 以定期存款为基础而获得的浮动利率债券;
Q 6) 中国证监会、中国人民银行禁止投资的其他金融工具。
法律法规或监管机构取消上述限制,本基金不受上述限制。

八、基金的投资组合
D 1) 与本基金的投资组合应当符合下列规定:
Q 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%;
Q 2) 与本基金投资的其他基金合计持有同一基金公司的股票,不得超过该基金的10%;
Q 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%;
Q 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%;
Q 5) 除发生巨额赎回情况外,债券正回购的资金余额在每交易日均不得超过该基金资产净值的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个工作日内进

行调整;
Q 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;
Q 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%;

Q 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;
Q 9) 法律法规和中国证监会、中国人民银行规定的其它比例限制。
由于证券市场波动或基金规模变动等基金管理人之外原因导致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。
法律法规或监管机构取消上述限制,本基金不受上述限制。

Q 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;
Q 2) 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;
Q 3) 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:
Q 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;
Q 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,则国际信用评级一个级别的或为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予以全部减持。
法律法规或监管机构取消上述限制,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,通过对短债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。
Q 1) 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:李少林
电话:86 755 82943636
联系人:林生迎
客户服务电话:4008881111-95565
公司网址:www.newone.com.cn

Q 4) 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:李伟
客户服务电话:400 8888 888
传真:86 1010-66566114
联系人:田薇
公司网址:www.chinastock.com.cn

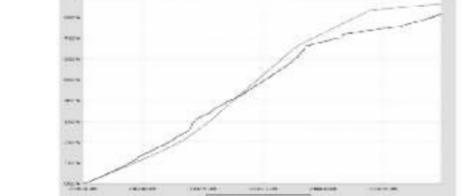
Q 5) 名称:广发证券股份有限公司
住所:广东省天河区北路183号大都会广场43楼
办公地址:广东省天河区北路大都会广场18,19,36,38,41和42楼
法定代表人:王传伟
电话:95575(致电广发证券营业网点)
传真:020 85545147
联系人:黄爽
公司网站:www.gf.com.cn

Q 6) 名称:光大证券股份有限公司
注册地址:上海市静安区新闻路1508号
法定代表人:薛峰
联系人:刘鹏
客户服务电话:400 8888 788,10108998
电话:021-68815009
公司网站:www.ebsen.com

1. 净值增长率与业绩比较基准收益率比较 数据截止止时间 2010年06月30日):

阶段	基金净值收益率①	业绩比较基准收益率②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
2006年7月7日至2006年12月31日	0.9348%	0.0011%	0.8668%	0.0002%	0.0740%	0.0009%
2007年	2.7128%	0.0051%	2.4441%	0.0017%	0.2687%	0.0034%
2008年	2.8049%	0.0074%	3.4246%	0.0011%	-0.5532%	0.0063%
2009年	0.8559%	0.0054%	1.5007%	0.0020%	-0.6448%	0.0034%
2010年1月1日至2010年6月30日	0.5768%	0.0040%	0.1785%	0.0009%	0.3983%	0.0040%
自基金合同生效起至2010年6月30日	8.1810%	0.0059%	8.6618%	0.0030%	-0.4808%	0.0029%

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)与基金运作有关费用
1、基金运作有关费用的种类:
Q 1) 基金管理人的管理费;
Q 2) 基金托管人的托管费;
Q 3) 基金销售服务费;
Q 4) 基金合同生效后与基金相关的信息披露费用;
Q 5) 基金合同生效后与基金相关的会计师事务所审计费;
Q 6) 基金的销售交易费用;
Q 7) 基金的证券交易费用;
Q 8) 银行划款费用;
Q 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,由基金资产中支付。
本基金从清算资产中发生费用,按实际支出金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为每日应计提的管理费
E