

宝盈货币市场证券投资基金 2018 年年度报告摘要

2018 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2019 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。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。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2018 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
交易代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 5 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,541,414,901.72 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称:	宝盈货币 A	宝盈货币 B
下属分级基金的交易代码:	213009	213909
报告期末下属分级基金的份额总额	1,089,267,049.31 份	12,452,147,852.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征，把风险控制在预算之内，在不增加风险的基础上保持高流动性，最终追求稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。 本基金定位于现金管理的工具，采用活期存款税后利率作为本基金的业绩

	比较基准，更能体现本基金良好的流动性与安全性。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾	田青
	联系电话	0755-83276688	010-67595096
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com	tianqingl.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018 年		2017 年		2016 年	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
本期已实现收益	53,278,628.50	991,565,564.75	100,627,928.75	477,155,680.13	93,363,887.32	652,507,368.55
本期利润	53,278,628.50	991,565,564.75	100,627,928.75	477,155,680.13	93,363,887.32	652,507,368.55
本期净值收益率	3.4289%	3.6782%	3.9027%	4.1524%	2.5975%	2.8442%
3.1.2 期末数据和指标	2018 年末		2017 年末		2016 年末	
期末基金资产净值	1,089,267,049.31	12,452,147,852.41	3,132,759,760.24	27,522,438,885.83	3,121,511,397.92	14,287,189,319.34
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

注：1、本基金收益分配是按日结转份额。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相

关费用后的余额。

3、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，本基金采用摊余成本法核算，因此公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

4、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

宝盈货币 A

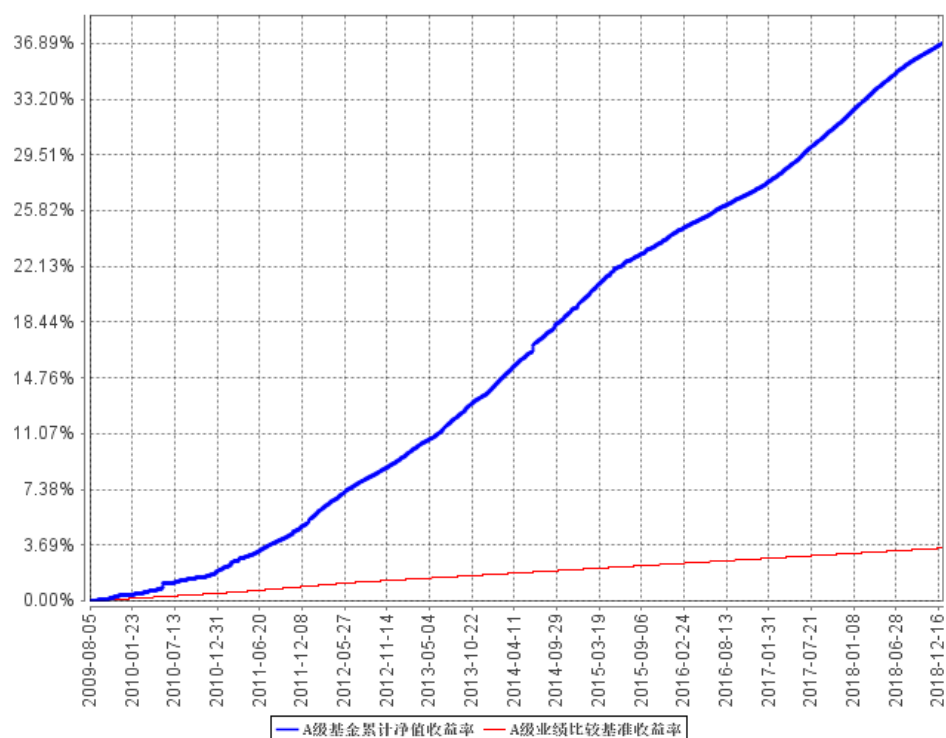
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.6551%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.5669%	0.0010%
过去六个月	1.4347%	0.0019%	0.1764%	0.0000%	1.2583%	0.0019%
过去一年	3.4289%	0.0023%	0.3500%	0.0000%	3.0789%	0.0023%
过去三年	10.2568%	0.0037%	1.0510%	0.0000%	9.2058%	0.0037%
过去五年	20.2560%	0.0082%	1.7510%	0.0000%	18.5050%	0.0082%
自基金合同 生效起至今	36.8926%	0.0102%	3.4978%	0.0001%	33.3948%	0.0101%

宝盈货币 B

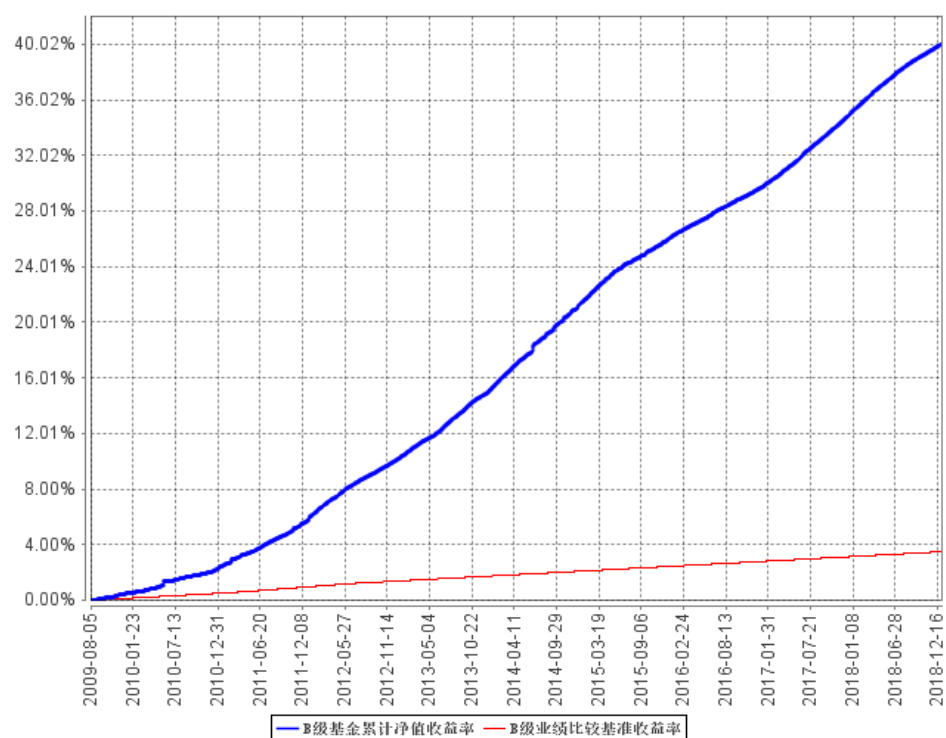
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.7161%	0.0010%	0.0882%	0.0000%	0.6279%	0.0010%
过去六个月	1.5576%	0.0019%	0.1764%	0.0000%	1.3812%	0.0019%
过去一年	3.6782%	0.0023%	0.3500%	0.0000%	3.3282%	0.0023%
过去三年	11.0545%	0.0037%	1.0510%	0.0000%	10.0035%	0.0037%
过去五年	21.7087%	0.0082%	1.7510%	0.0000%	19.9577%	0.0082%
自基金合同 生效起至今	40.0214%	0.0102%	3.4978%	0.0001%	36.5236%	0.0101%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

A级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图

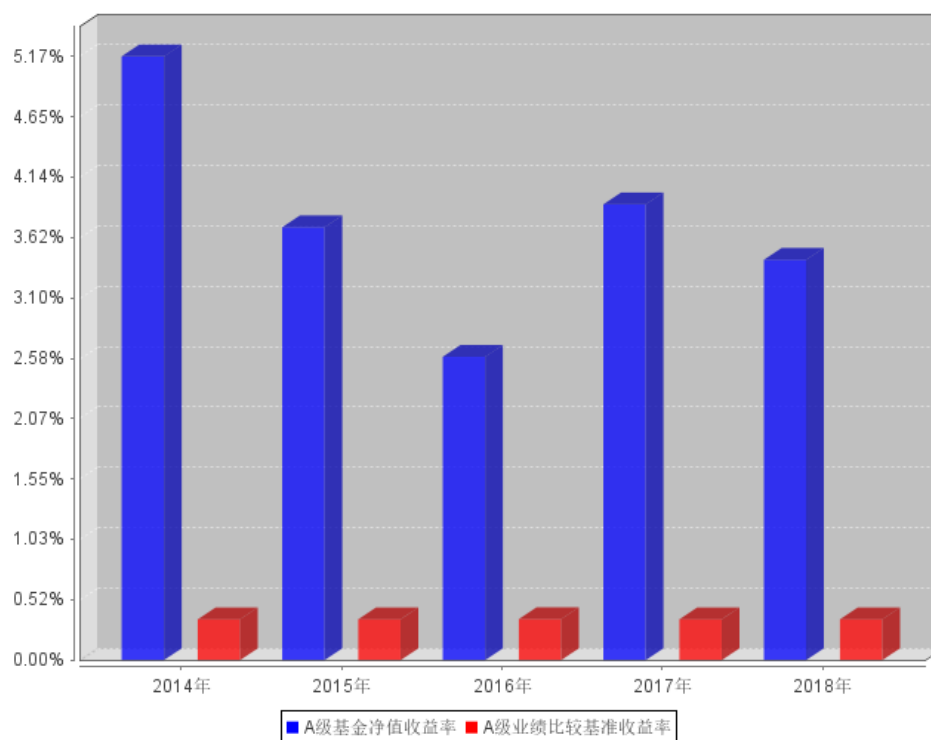


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

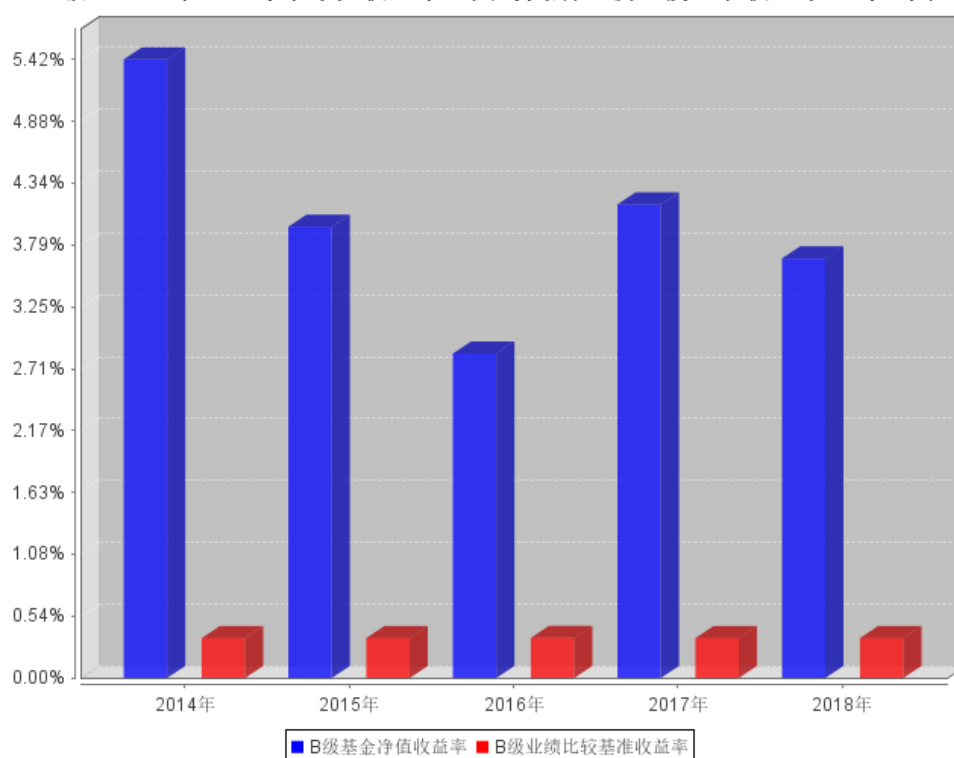


3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

宝盈货币 A					
年度	已按再投资形式	直接通过应付	应付利润	年度利润	备注

	转实收基金	赎回款转出金额	本年变动	分配合计	
2018	54,228,558.61	-	-949,930.11	53,278,628.50	
2017	99,802,430.49	-	825,498.26	100,627,928.75	
2016	93,060,008.46	-	303,878.86	93,363,887.32	
合计	247,090,997.56	-	179,447.01	247,270,444.57	

单位：人民币元

宝盈货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金 额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2018	999,056,722.11	-	-7,491,157.36	991,565,564.75	
2017	467,327,964.31	-	9,827,715.82	477,155,680.13	
2016	651,625,672.16	-	881,696.39	652,507,368.55	
合计	2,118,010,358.58	-	3,218,254.85	2,121,228,613.43	

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券二十五只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
高宇	本基金、宝盈增强	2017 年 9 月 30 日	-	10 年	高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008 年 6 月

	收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金基金经理；固定收益部副总经理				至 2009 年 8 月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009 年 8 月至 2010 年 10 月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师；2010 年 10 月至 2016 年 6 月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位；2016 年 7 月至 2017 年 8 月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司，现担任宝盈基金固定收益部副总经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
杨献忠	本基金基金经理	2018 年 4 月 21 日	-	5 年	杨献忠先生，中国人民大学金融学硕士，具有 5 年证券从业经历。2013 年 8 月至 2016 年 11 月在中国工商银行总行金融市场部担任交易员；2016 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部，先后担任研究员、宝盈货币市场证券投资基金基金经理助理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
杨献忠	本基金基金经理助理	2017 年 11 月 24 日	2018 年 4 月 21 日	5 年	杨献忠先生，经济学硕士。6 年证券从业经历。曾任中国工商银行股份有限公司总行金融市场部交易员，2016 年 11 月加入宝盈基金管理有限公司，历任固定收益部研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2018 年 12 月 31 日。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《宝盈基金管理有限公司公平交易制度》对本基金的日常交易行为进行监控，并定期制作公平交易分析报告，对不同投资组合的收益率、同向交易价差、反向交易价差作专项分析。报告结果表明，本基金在本报告期内的同向交易价差均在可合理解释范围之内；在本报告期内基金管理人严格遵守法律法规关于公

平交易的相关规定，在投资活动中公平对待不同投资组合，公平交易制度执行情况良好，无损害基金持有人利益的行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球经济的增长动力在减弱，国内经济运行保持在合理区间但下行压力加大。国际大宗商品价格剧烈波动，国内主要工业品大幅震荡、农产品趋势下行，物价温和上涨。

报告期内，央行增强了货币政策的前瞻性、灵活性、针对性，采取了一系列逆周期措施，通过四次降准、增量开展中期借贷便利（MLF）等提供了充裕的中长期流动性，货币市场资金利率中枢显著下行。报告期内，商业银行同业融资压力逐步缓解，协议存款和同业存单利率连创新低。报告期内，年初落地的定向降准和实施的临时准备金动用安排等已意味着货币政策从 2017 年的稳健中性偏紧走向真正意义上的稳健中性，但是否转为稳健中性偏宽松，市场仍存在疑问。直到 2018 年 4 月 17 日的意外降准，货币政策的边际宽松得以最终确认，但受缴税影响货币市场利率短暂纠结。随后 6 月再次降准，公开市场利率也未再跟随美联储上调，货币政策宽松的共识形成，货币市场利率显著下行，连创历史新低。8 月中旬以来，短端政策利率和短端市场利率的矛盾得到央行关注，央行通过指导隔夜利率、连续暂停公开市场逆回购等措施维持短端价格，市场预期宽货币格局不变，货币市场利率低位震荡。

报告期内，货币市场先紧后松，资金面从紧平衡走向宽松，资金利率中枢显著下移、区间波动加大，我们整体维持了较低久期和较高评级的投资组合，并择机配置了收益率较高的同业存款和同业存单。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期宝盈货币 A 的基金份额净值收益率为 3.4289%，本报告期宝盈货币 B 的基金份额净值收益率为 3.6782%，同期业绩比较基准收益率为 0.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2019 年，我们认为全球经济增速下行、美国基本面开始回落，国内经济下行伴随政策托底有望企稳。受经济需求回落、基数因素等叠加影响，通胀压力可控。

货币市场方面，根据保持经济稳定增长和防范系统性风险的要求，我们预计稳健货币政策更加注重松紧适度。央行加大逆周期调节的力度，进一步改善货币政策传导机制，维护银行体系流动性合理充裕，资金面有望维持宽松格局。

2019 年，我们将持续跟踪基本面数据、货币政策以及资金面的变化，择机配置高评级高收益的同业存款、同业存单和信用债，保持适度的杠杆水平。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值委员会，由公司投研、运营的分管领导及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部负责人共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值委员会负责制定、修订和完善公司估值政策和程序，定期评价估值政策和程序修订的适用性。日常基金资产的估值程序，由基金运营部负责执行。对需要进行估值调整的投资品种，管理人启动估值调整程序，并与基金托管人协商一致，必要时征求会计师事务所的专业意见，由估值委员会议定估值方案，基金运营部具体执行。

截止报告期末，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司建立业务合作关系，由其按约定提供有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在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。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 A 类 53,278,628.50 元，B 类 991,565,564.75 元。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、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。

§ 6 审计报告

本基金 2018 年年度财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计，注册会计师签字出具了普华永道中天审字(2019)第 20993 号“标准无保留意见的审计报告”，投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

报告截止日：2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	4,207,165,655.22	9,306,871,724.73
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	8,840,977,963.07	16,730,168,734.23
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	8,840,977,963.07	16,730,168,734.23
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,705,832,758.75	5,106,869,840.28
应收证券清算款	-	-
应收利息	53,335,111.44	96,170,842.34
应收股利	-	-
应收申购款	10,869.43	38,471,236.99
递延所得税资产	-	-
其他资产	694,766.67	737,173.35
资产总计	14,808,017,124.58	31,279,289,551.92
负债和所有者权益	本期末 2018 年 12 月 31 日	上年度末 2017 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-

交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	1,252,897,360.65	600,999,029.50
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	111,496.43	369,673.54
应付管理人报酬	5,017,342.97	5,682,976.58
应付托管费	1,520,406.95	1,722,114.13
应付销售服务费	355,964.97	644,387.37
应付交易费用	284,623.18	301,987.83
应交税费	47,887.79	-
应付利息	638,617.68	300,128.97
应付利润	5,349,342.81	13,790,430.28
递延所得税负债	-	-
其他负债	379,179.43	280,177.65
负债合计	1,266,602,222.86	624,090,905.85
所有者权益：		
实收基金	13,541,414,901.72	30,655,198,646.07
未分配利润	-	-
所有者权益合计	13,541,414,901.72	30,655,198,646.07
负债和所有者权益总计	14,808,017,124.58	31,279,289,551.92

注：报告期截止日 2018 年 12 月 31 日，宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 1,089,267,049.31 份。宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 12,452,147,852.41 份。宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金和宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金的合计份额总数 13,541,414,901.72 份。

7.2 利润表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
一、收入	1,227,892,717.05	689,776,631.27
1. 利息收入	1,191,799,927.22	681,576,786.54
其中：存款利息收入	323,878,157.33	172,269,091.29
债券利息收入	601,722,745.60	488,827,034.34
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	266,199,024.29	20,480,660.91
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	36,092,789.83	8,166,544.73
其中：股票投资收益	-	-

基金投资收益	-	-
债券投资收益	36,092,789.83	8,166,544.73
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	33,300.00
减：二、费用	183,048,523.80	111,993,022.39
1. 管理人报酬	93,509,330.70	46,666,405.84
2. 托管费	28,336,160.80	14,141,335.22
3. 销售服务费	6,492,955.26	7,742,906.04
4. 交易费用	1,323.00	7,653.82
5. 利息支出	54,177,781.76	43,024,045.42
其中：卖出回购金融资产支出	54,177,781.76	43,024,045.42
6. 税金及附加	122,800.26	-
7. 其他费用	408,172.02	410,676.05
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	1,044,844,193.25	577,783,608.88
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	1,044,844,193.25	577,783,608.88

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		
	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）	30,655,198,646.07	-	30,655,198,646.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	1,044,844,193.25	1,044,844,193.25
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-17,113,783,744.35	-	-17,113,783,744.35
其中：1. 基金申购款	161,353,357,488.36	-	161,353,357,488.36
2. 基金赎回款	-178,467,141,232.71	-	-178,467,141,232.71
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基	-	-1,044,844,193.25	-1,044,844,193.25

金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	13,541,414,901.72	-	13,541,414,901.72
项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	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）	17,408,700,717.26	-	17,408,700,717.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	577,783,608.88	577,783,608.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	13,246,497,928.81	-	13,246,497,928.81
其中：1. 基金申购款	115,374,144,995.43	-	115,374,144,995.43
2. 基金赎回款	-102,127,647,066.62	-	-102,127,647,066.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-577,783,608.88	-577,783,608.88
五、期末所有者权益（基金净值）	30,655,198,646.07	-	30,655,198,646.07

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>杨凯</u>	<u>彭玖雯</u>	<u>何瑜</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

7.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.3 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。

(4) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.4 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金公司”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东

中国对外经济贸易信托有限公司（“对外经贸信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.5.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.5.2 关联方报酬

7.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	93,509,330.70	46,666,405.84
其中：支付销售机构的客户维护费	5,184,554.32	5,740,094.94

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的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：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.33% / 当年天数。

7.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	28,336,160.80	14,141,335.22

注：支付基金托管人中国建设银行的托管费按前一日基金资产净值 0.1%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：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.1% / 当年天数。

7.4.5.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日
----------------	--

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	697,018.15	21,297.65	718,315.80
宝盈基金公司	421,757.20	2,401,963.73	2,823,720.93
合计	1,118,775.35	2,423,261.38	3,542,036.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	885,962.23	32,574.50	918,536.73
宝盈基金公司	711,769.94	987,600.21	1,699,370.15
合计	1,597,732.17	1,020,174.71	2,617,906.88

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金资产净值 0.25% 的年费率以及 B 类基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给宝盈基金管理有限公司，再由宝盈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：

日销售服务费 = 前一日 A 类基金资产净值 × 0.25 % / 当年天数。

日销售服务费 = 前一日 B 类基金资产净值 × 0.01 % / 当年天数。

7.4.5.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	2,419,417,217.88	5,816,297,326.61	-	-	13,219,600,000.00	1,499,452.74
上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	1,613,651,567.44	2,661,399,715.87	-	-	7,863,150,000.00	2,023,848.75

7.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.5.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B

期初持有的基金份额	—	76,724,948.54
期间申购/买入总份额	—	450,980,445.37
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	320,900,000.00
期末持有的基金份额	—	206,805,393.91
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	1.66%

项目	上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期初持有的基金份额	—	73,855,095.30
期间申购/买入总份额	—	2,869,853.24
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	—	76,724,948.54
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	0.28%

注：1、 期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2、基金管理人宝盈基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托宝盈基金管理有限公司直销柜台办理，适用费率为 0%。

7.4.5.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

宝盈货币 B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2018 年 12 月 31 日		上年度末 2017 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例
中铁信托	400,000,000.00	3.21%	—	—
对外经贸信托	—	—	25,000,000.00	0.09%

7.4.5.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	7,165,655.22	115,463.45	6,871,724.73	94,642.95

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.5.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

7.4.5.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.6 期末（2018 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.6.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

不适用。

7.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的余额为 1,252,897,360.65 元。正回购交易中作为抵押的债券如下：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
160415	16 农发 15	2019 年 1 月 4 日	100.00	1,500,000	149,998,618.12
111809276	18 浦发银行 CD276	2019 年 1 月 2 日	99.32	1,400,000	139,041,160.76
180201	18 国开 01	2019 年 1 月 2 日	100.04	3,500,000	350,124,114.57
160415	16 农发 15	2019 年 1 月 2 日	100.00	2,500,000	249,997,696.88
180404	18 农发 04	2019 年 1 月 2 日	100.10	1,500,000	150,148,106.07
180305	18 进出 05	2019 年 1 月 2 日	100.15	2,300,000	230,348,708.65
140202	14 国开 02	2019 年 1 月 2 日	100.08	300,000	30,022,835.34
合计				13,000,000	1,299,681,240.39

7.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2018 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.7 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于 2018 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 8,840,977,963.07 元，无属于第一或第三层次的余额(2017 年 12 月 31 日：第二层次 16,730,168,734.23 元，无第一或第三层次)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2018 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017 年 12 月 31 日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
----	----	----	---------------

1	固定收益投资	8,840,977,963.07	59.70
	其中：债券	8,840,977,963.07	59.70
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	1,705,832,758.75	11.52
	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	4,207,165,655.22	28.41
4	其他各项资产	54,040,747.54	0.36
5	合计	14,808,017,124.58	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	7.67	
	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	1,252,897,360.65	9.25
	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

本基金本报告期内无债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	69
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	86
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	31

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

8.3.2 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	23.43	9.25
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天(含)—60 天	31.51	—

	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	35.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	6.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	11.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		108.95	9.25

8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内无投资组合剩余存续期超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,160,640,079.63	8.57
	其中：政策性金融债	1,160,640,079.63	8.57
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	590,190,520.14	4.36
6	中期票据	-	-
7	同业存单	7,090,147,363.30	52.36
8	其他	-	-
9	合计	8,840,977,963.07	65.29
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111809276	18 浦发银行 CD276	14,000,000	1,390,411,607.55	10.27
2	111810073	18 兴业银行 CD073	5,000,000	498,213,946.96	3.68
3	111818051	18 华夏银行 CD051	5,000,000	498,170,642.16	3.68
4	160415	16 农发 15	4,000,000	399,996,315.00	2.95
5	111803149	18 农业银行 CD149	4,000,000	394,408,079.95	2.91
6	111817176	18 光大银行 CD176	4,000,000	391,647,450.16	2.89
7	180201	18 国开 01	3,500,000	350,124,114.57	2.59
8	111820221	18 广发银行 CD221	3,000,000	298,687,712.61	2.21

9	111814258	18 江苏银行 CD258	3,000,000	298,667,017.48	2.21
10	111803145	18 农业银行 CD145	3,000,000	298,486,400.43	2.20

8.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.1995%
报告期内偏离度的最低值	-0.0212%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0545%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期末无负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内无正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”计价，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

8.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	53,335,111.44
4	应收申购款	10,869.43
5	其他应收款	694,766.67
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	54,040,747.54

8.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈货币 A	266,804	4,082.65	53,181,029.94	4.88%	1,036,086,019.37	95.12%
宝盈货币 B	167	74,563,759.60	12,130,352,049.07	97.42%	321,795,803.34	2.58%
合计	266,971	50,722.42	12,183,533,079.01	89.97%	1,357,881,822.71	10.03%

注：1、本基金采用分级模式核算，机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中分母采用各自级别的基金份额来计算。

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	2,000,000,000.00	14.79%
2	信托类机构	1,000,000,000.00	7.39%
3	银行类机构	604,125,472.87	4.47%
4	银行类机构	505,217,430.48	3.74%
5	其他机构	500,000,000.00	3.70%
6	信托类机构	400,000,000.00	2.96%
7	保险类机构	310,090,415.70	2.29%
8	保险类机构	305,898,410.60	2.26%
9	保险类机构	301,247,696.50	2.23%
10	其他机构	301,090,030.96	2.23%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	宝盈货币 A	3,590,178.38	0.3296%
	宝盈货币 B	0.00	0.0000%
	合计	3,590,178.38	0.0265%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的

分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	宝盈货币 A	0~10
	宝盈货币 B	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	宝盈货币 A	0
	宝盈货币 B	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金合同生效日（2009 年 8 月 5 日）基金份额总额	428,312,282.49	1,026,847,982.99
本报告期期初基金份额总额	3,132,759,760.24	27,522,438,885.83
本报告期间基金总申购份额	4,015,069,939.10	157,338,287,549.26
减：本报告期间基金总赎回份额	6,058,562,650.03	172,408,578,582.68
本报告期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	1,089,267,049.31	12,452,147,852.41

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次临时会议决议，同意张新元辞去副总经理职务。该变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金管理人的基金投资策略遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 170,000 元，目前事务所已连续 10 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- （1）实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- （2）财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- （3）经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- （4）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。
- （5）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需，并能为本基金提供全面的信息服务。
- （6）研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：**（1）租用交易单元情况**

本报告期内未租用交易单元。

（2）退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内无偏离度绝对值超过 0.5%的情况。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

宝盈基金管理有限公司

2019 年 3 月 29 日