

# 申万菱信收益宝货币市场基金

## 2020 年中期报告

### 2020 年 6 月 30 日

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月二十九日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 月 26 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
5	托管人报告	13
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	13
5.3	托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	15
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4	报表附注	17
7	投资组合报告	35
7.1	期末基金资产组合情况	35
7.2	债券回购融资情况	36
7.3	基金投资组合平均剩余期限	36
7.4	报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	37
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	37
7.6	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	38
7.7	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	38
7.8	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细	38
7.9	投资组合报告附注	38
8	基金份额持有人信息	40
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
8.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	40
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	41
8.4	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	41

9 开放式基金份额变动 .....	41
10 重大事件揭示 .....	41
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	41
10.2 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 .....	41
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	42
10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况 .....	42
10.10 其他重大事件 .....	42
11 备查文件目录 .....	43
11.1 备查文件目录 .....	43
11.2 存放地点 .....	43
11.3 查阅方式 .....	43

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信收益宝货币市场基金	
基金简称	申万菱信收益宝货币	
基金主代码	310338	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2006 年 7 月 7 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	18,071,448,319.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B
下属分级基金的交易代码	310338	310339
报告期末下属分级基金的份额总额	594,851,247.49 份	17,476,597,071.73 份

### 2.2 基金产品说明

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。
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	银行活期存款利率（税后）
风险收益特征	低风险、高流动性和持续稳定收益。

### 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		申万菱信基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	郭明
	联系电话	021-23261188	010-66105799
	电子邮箱	service@swsmu.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4008808588	95588
传真		021-23261199	010-66105798
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		200010	100140
法定代表人		刘郎	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.swsmu.com
基金中期报告备置地点	申万菱信基金管理有限公司 中国工商银行股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 11 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2020 年 1 月 1 日-2020 年 6 月 30 日）	
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B
本期已实现收益	3,102,764.31	122,691,500.03
本期利润	3,102,764.31	122,691,500.03
本期净值收益率	0.8569%	0.9767%
3.1.2 期末 数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B
期末基金资产净值	594,851,247.49	17,476,597,071.73
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)	
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B
累计净值收益率	45.9826%	27.8494%

注：1、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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场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。

2、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”。

### 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

##### 1. 申万菱信收益宝货币 A:

阶段	份额净值收	净值收益率	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④
----	-------	-------	------	-------	-----	-----

	益率①	标准差②	基准收益 率③	准收益率标 准差④		
过去一个月	0.1127%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.0839%	0.0010%
过去三个月	0.3360%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.2487%	0.0011%
过去六个月	0.8569%	0.0014%	0.1745%	0.0000%	0.6824%	0.0014%
过去一年	1.9111%	0.0012%	0.3510%	0.0000%	1.5601%	0.0012%
过去三年	8.2736%	0.0026%	1.0547%	0.0000%	7.2189%	0.0026%
过去五年	14.0723%	0.0023%	1.7643%	0.0000%	12.3080%	0.0023%
自基金合同生效 起至今	45.9826%	0.0050%	12.7438%	0.0027%	33.2388%	0.0023%

## 2. 申万菱信收益宝货币 B:

阶段	份额净值收 益率①	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
过去一个月	0.1324%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.1036%	0.0010%
过去三个月	0.3958%	0.0011%	0.0873%	0.0000%	0.3085%	0.0011%
过去六个月	0.9767%	0.0014%	0.1745%	0.0000%	0.8022%	0.0014%
过去一年	2.1586%	0.0012%	0.3510%	0.0000%	1.8076%	0.0012%
过去三年	9.0587%	0.0026%	1.0547%	0.0000%	8.0040%	0.0026%
过去五年	15.4545%	0.0023%	1.7643%	0.0000%	13.6902%	0.0023%
自基金合同生效 起至今	27.8494%	0.0041%	2.6351%	0.0000%	25.2143%	0.0041%

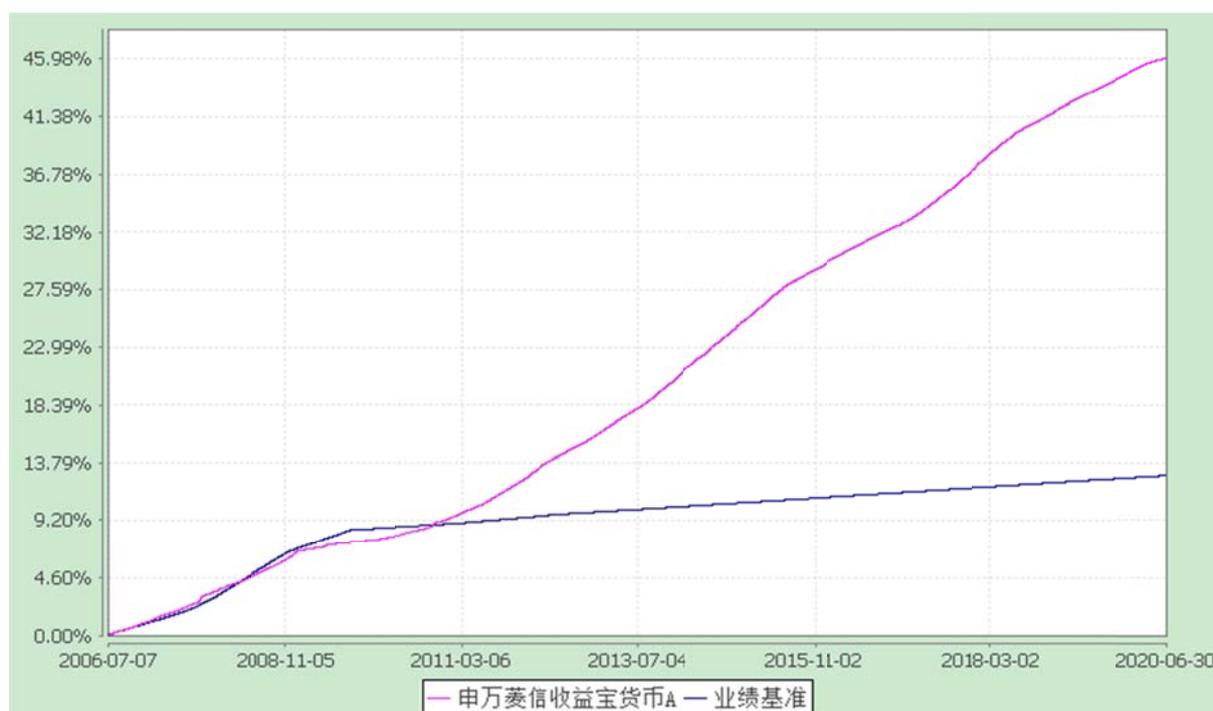
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

#### 申万菱信收益宝货币市场基金

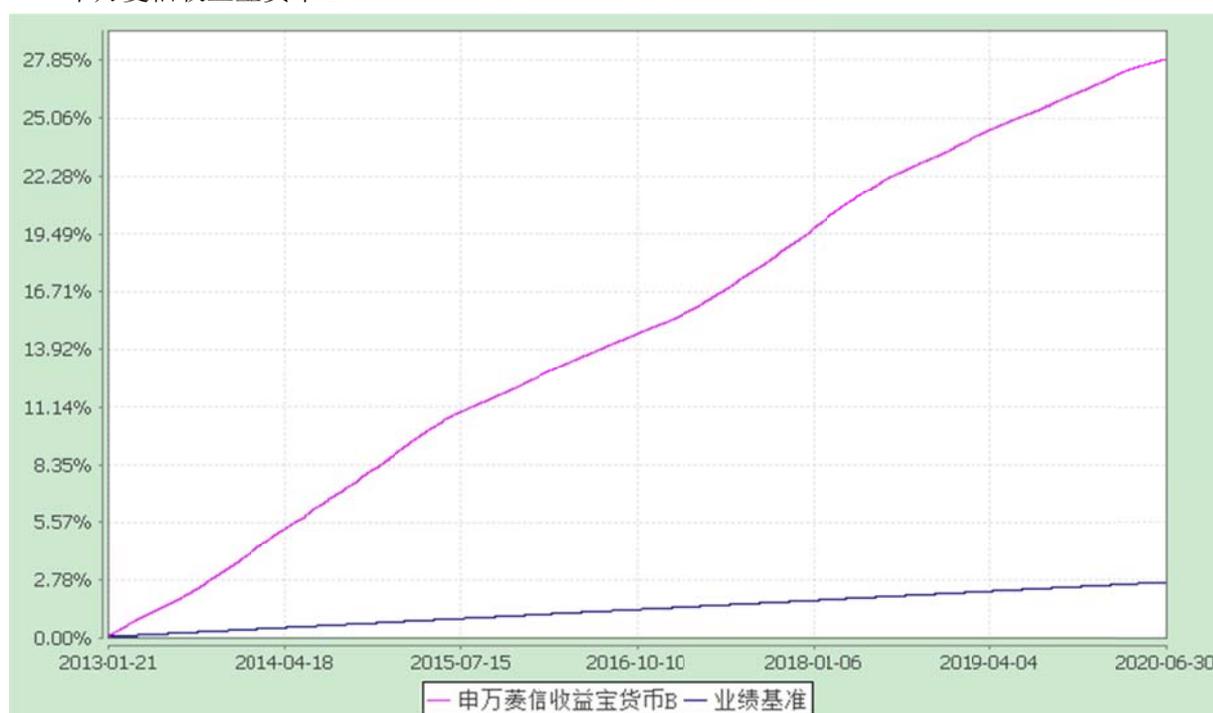
自基金合同生效以来累计份额净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2006 年 7 月 7 日至 2020 年 6 月 30 日)

申万菱信收益宝货币 A



申万菱信收益宝货币 B



## 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

申万菱信基金管理有限公司（简称“申万菱信”）成立于 2004 年 1 月 15 日，公司总部设在上海，

注册资本 1.5 亿元，净资产超过 9 亿元。现有股东申万宏源证券持股比例 67%，日本三菱 UFJ 信托银行持股比例 33%。公司拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人等业务资格。

申万菱信始终将投资业绩放在首位，秉持“以客为先、创新求变、专业管理、业绩之上”的经营理念，以负责的态度、高效的管理、专业的服务，全心全意为投资者提供丰厚的投资回报。截止 2020 年 6 月 30 日，公司现有开放式公募基金 42 只，资产管理总规模 923 亿元，产品累计分红 126 亿元。

申万菱信多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及中国工商银行资管委托投资“最佳风控奖”、中国平安银行“优秀投资管理人”、东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉，并连续多年获得上海市黄浦区人民政府授予的“高端服务业 100 强企业证书”。

申万菱信将紧紧依托双方股东优势，以市场发展逻辑为导向、以客户需求为中心、以自身专业为引领，通过实施精品化、差异化的发展战略，不断丰富和完善产品线，以优异的投资业绩为投资人创造可持续的价值回报，努力打造一家以指数量化为核心特色、多元并举发展的国内一流资产管理机构。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
叶瑜珍	本基金基金经理	2013-07-30	-	15 年	叶瑜珍女士，硕士研究生，2005 年 01 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任风险分析师、信用分析师、基金经理助理，申万菱信添益宝债券型证券投资基金、申万菱信安鑫精选混合型证券投资基金、申万菱信可转换债券债券型证券投资基金、申万菱信安泰惠利纯债债券型证券投资基金基金经理，现任申万菱信收益宝货币市场基金、申万菱信安鑫优选混合型证券投资基金、申万菱信安泰瑞利中短债债券型证券投资基金、申万菱信安泰鼎利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、申万菱信安泰鑫利纯债一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

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。

## 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《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。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格

优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 2 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 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

2020 年上半年，国内宏观经济受新冠疫情影响较大。一季度经济面临较大的下行压力，二季度随着疫情防控进入常态化后，国内经济活动逐步恢复，生产逐步进入平稳期。国家加大宏观政策调节和实施力度，重心和落脚点主要在推进复工和扩大内需方面，财政和货币政策同时发力。

债市方面，一季度货币政策偏宽松，资金面宽裕，市场对宏观基本面预期持续下调，债券收益率稳步下行。5 月以来，债券市场遭遇基本面修复、货币政策向常态化转变以及债券供给压力上升的轮番冲击，债券收益率在 4 月阶段性低点后出现较大幅度的调整。随着资金利率向常态化回归，短端利率中枢上行，长端收益率波动加大，收益率曲线平坦化上行。

报告期内，基金规模有所增长，基金操作以流动性管理为首要目标，合理控制组合久期，在资金面出现波动时，积极利用回购、存单、存款等工具增厚组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金 A 类产品报告期内净值表现为 0.8569%，同期业绩比较基准表现为 0.1745%。

本基金 B 类产品报告期内净值表现为 0.9767%，同期业绩比较基准表现为 0.1745%。

#### 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 2020 年下半年，国内疫情防控常态化，随着前期社融信贷持续超增，预示经济增速在下半年有望缓慢回升。疫情以来全球央行大宽松，通胀预期暗潮涌动，下半年部分价格上涨可能会带来通胀预期的自我实现，长期通胀风险抬升。就下半年的货币政策基调而言，“总量适度”定调下，并不意味着短期货币政策方向逆转为收紧，“合理充裕”仍然维持，但整体进一步宽松的空间不大。在此背景下，债券投资以票息策略为主，灵活控制组合久期。在宏观经济弱复苏遭遇疫情干扰背景下，企业经营压力增大，信用风险有所提升，注意规避行业景气度较差的中低等级信用债。

#### 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、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所参与本基金的估值流程，上述各方不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人按照有关法规确定的原则进行估值，将导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，即就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性征求本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所的意见。本基金聘请的会计师事务所对相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。

本基金管理人设立资产估值委员会，负责根据法规要求，尽可能科学、合理地制定估值政策，审议批准估值程序，并在特定状态下就拟采用的相关估值模型、假设及参数的适当性进行确认，以保护基金份额持有人的利益。

资产估值委员会由本基金管理人分管基金运营的副总经理，督察长，分管基金投资的副总经理，基金运营部、法律合规与审计部、风险管理部负责人组成。其中，分管基金运营的副总经理张丽红女士，拥有 16 年的基金行业运营、财务管理相关经验；督察长王菲萍女士，拥有 16 年的基金行业合规管理经验；分管基金投资的副总经理周小波先生，拥有 14 年的证券研究、投资相关经验；基金运营部负责人严嘉惠先生，拥有 13 年的基金会计经验；法律合规与审计部负责人（代）赵鹏先生，拥有 20 年的金融行业合规管理经验；风险管理部负责人葛诚亮先生，拥有 9 年的基金行业风险管理经验。

基金经理不参与决定本基金估值的程序。本公司已与中央国债登记结算有限责任公司签订协议，采用其提供的估值数据对银行间债券进行估值；采用中证指数有限公司提供的估值数据对交易所债

券进行估值。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内，根据法律法规及本基金基金合同的约定，本基金每日进行收益分配。本基金收益根据每日基金收益公告为投资者每日计算当日收益并分配，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，收益自动结转为基金份额。

#### 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

无。

### 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

本报告期内，本基金托管人在对申万菱信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。

#### 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

本报告期内，申万菱信收益宝货币市场基金的管理人——申万菱信基金管理有限公司在申万菱信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、基金利润分配、基金费用开支等问题上，严格遵循《证券投资基金法》、《货币市场基金信息披露特别规定》等有关法律法规。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对申万菱信基金管理有限公司编制和披露的申万菱信收益宝货币市场基金 2020 年中期报告中财务指标、利润分配情况、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。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：申万菱信收益宝货币市场基金

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年6月30日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款		1,747,256,120.60	1,986,398,203.14
结算备付金		2,666,666.67	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		9,692,486,030.64	5,709,195,026.97
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		9,692,486,030.64	5,709,195,026.97
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		5,259,337,688.99	4,165,278,607.91
应收证券清算款		-	-
应收利息		35,448,869.03	21,761,178.09
应收股利		-	-
应收申购款		1,340,159,228.00	371,283,708.65
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		18,077,354,603.93	12,253,916,724.76
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年6月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负债：</b>		-	-
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		161,629.34	118,530.93
应付管理人报酬		3,931,258.07	2,128,355.09
应付托管费		1,191,290.32	644,956.09
应付销售服务费		235,845.08	86,268.27
应付交易费用		267,028.26	122,117.03
应交税费		17,342.86	1,016.85
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		101,890.78	196,000.00
负债合计		5,906,284.71	3,297,244.26
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金		18,071,448,319.22	12,250,619,480.50
未分配利润		-	-

所有者权益合计		18,071,448,319.22	12,250,619,480.50
负债和所有者权益总计		18,077,354,603.93	12,253,916,724.76

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，收益宝货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额为 594,851,247.49 份；收益宝货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额为 17,476,597,071.73 份，基金份额总额 18,071,448,319.22 份。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信收益宝货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>156,532,364.84</b>	<b>107,628,454.18</b>
1.利息收入		143,900,045.35	105,533,130.64
其中：存款利息收入		16,595,567.27	20,746,491.80
债券利息收入		76,657,528.35	47,522,543.70
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		50,646,949.73	37,264,095.14
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		12,632,319.49	2,095,323.54
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		12,632,319.49	2,095,323.54
资产支持证券投资收益		-	-
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）		-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>30,738,100.50</b>	<b>17,044,152.42</b>
1. 管理人报酬		22,135,525.83	12,114,581.80
2. 托管费		6,707,735.08	3,671,085.32
3. 销售服务费		1,138,301.69	617,623.00
4. 交易费用		-	-
5. 利息支出		601,697.53	477,002.61
其中：卖出回购金融资产支出		601,697.53	477,002.61
6.税金及附加		8,511.65	4,265.06

7. 其他费用		146,328.72	159,594.63
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>125,794,264.34</b>	<b>90,584,301.76</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>125,794,264.34</b>	<b>90,584,301.76</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信收益宝货币市场基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 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）	12,250,619,480.50	-	12,250,619,480.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	125,794,264.34	125,794,264.34
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）	5,820,828,838.72	-	5,820,828,838.72
其中：1.基金申购款	46,682,516,673.22	-	46,682,516,673.22
2.基金赎回款	-40,861,687,834.50	-	-40,861,687,834.50
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）	-	-125,794,264.34	-125,794,264.34
五、期末所有者权益（基金净值）	18,071,448,319.22	-	18,071,448,319.22
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 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）	9,288,381,580.97	-	9,288,381,580.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	90,584,301.76	90,584,301.76
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）	-3,240,889,395.80	-	-3,240,889,395.80
其中：1.基金申购款	20,950,275,237.98	-	20,950,275,237.98
2.基金赎回款	-24,191,164,633.78	-	-24,191,164,633.78
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）	-	-90,584,301.76	-90,584,301.76

五、期末所有者权益（基金净值）	6,047,492,185.17	-	6,047,492,185.17
-----------------	------------------	---	------------------

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：张丽红，会计机构负责人：严嘉惠

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信收益宝货币市场基金（原名为申万巴黎收益宝货币市场基金，以下简称“本基金”）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 号文核准，由申万菱信基金管理有限公司（原名为“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》和《申万巴黎收益宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,259,517,823.38 元，业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(06)第 0025 号验资报告予以验证。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》于 2006 年 7 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 1,259,604,476.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 86,652.62 份基金份额。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

经中国证监会证监许可[2011]106 号《关于核准申万巴黎基金管理有限公司变更股权、公司名称及修改章程的批复》批准，申万巴黎基金管理有限公司已于 2011 年 3 月 3 日完成相关工商变更登记手续，并于 2011 年 3 月 4 日变更公司名称为“申万菱信基金管理有限公司”。本基金的基金管理人报请中国证监会备案，将申万巴黎收益宝货币市场基金更名为申万菱信收益宝货币市场基金，并于 2011 年 4 月 6 日公告。

本基金的基金管理人于 2013 年 1 月 17 日发布《申万菱信基金管理有限公司关于申万菱信收益宝货币市场基金实施基金份额分级及修改基金合同、托管协议和招募说明书的公告》，决定自 2013 年 1 月 21 日起对本基金实施基金份额分级，根据投资者持有本基金的份额数量不同，对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用，因此形成 A 类和 B 类两类基金份额；并根据投资者基金账户所持有份额数量是否不低于 500 万份进行不同类别基金份额的判断和处理，其中不低于 500 万份的为 B 类份额，低于 500 万份的为 A 类份额。两类基金份额分别设置基金代码，其中原基金代码 310338 作为 A 级基金代码，新增 310339 为 B 级基金代码，两级基金份额单独公布每万份基金净收益和基金七日年化收益率。

根据《货币市场基金管理暂行规定》和《申万菱信收益宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、债券回购、中央银行票据、同业存单；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券；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税后银行活期存款利率。

本财务报表由本基金的基金管理人申万菱信基金管理有限公司于 2020 年 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2020 年 6 月 30 日的财务状况、2020 年 01 月 01 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 140 号文《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 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2015] 125 号文《关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税 [2017] 56

号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a) 证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入暂免征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营基金过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对基金在 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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 对投资者从基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(d) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	7,256,120.60
定期存款	1,740,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	500,000,000.00
存款期限 1-3 个月	690,000,000.00
存款期限 3 个月以上	550,000,000.00
其他存款	-
合计	1,747,256,120.60

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020年6月30日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度(%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	9,692,486,030.64	9,688,981,000.00	-3,505,030.64	-0.0194
	合计	9,692,486,030.64	9,688,981,000.00	-3,505,030.64	-0.0194
资产支持证券		-	-	-	-
合计		9,692,486,030.64	9,688,981,000.00	-3,505,030.64	-0.0194

注：1. 偏离金额=影子定价-摊余成本；

2. 偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	
银行间市场	5,259,337,688.99	
合计	5,259,337,688.99	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	1,888.89
应收定期存款利息	9,169,304.06
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,200.00
应收债券利息	23,751,767.17
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	2,524,708.91
应收申购款利息	-

应收出借证券利息	-
其他	-
合计	35,448,869.03

**6.4.7.6 其他资产**

无余额。

**6.4.7.7 应付交易费用**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	-
银行间市场应付交易费用	267,028.26
合计	267,028.26

**6.4.7.8 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	101,890.78
合计	101,890.78

**6.4.7.9 实收基金****申万菱信收益宝货币 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	174,162,031.94	174,162,031.94
本期申购	6,771,749,892.76	6,771,749,892.76
本期赎回（以“-”号填列）	-6,351,060,677.21	-6,351,060,677.21
本期末	594,851,247.49	594,851,247.49

注：申购含红利再投、转换转入；赎回含转换转出。

**申万菱信收益宝货币 B**

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年1月1日至2020年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,076,457,448.56	12,076,457,448.56
本期申购	39,910,766,780.46	39,910,766,780.46
本期赎回（以“-”号填列）	-34,510,627,157.29	-34,510,627,157.29
本期末	17,476,597,071.73	17,476,597,071.73

注：申购含红利再投、转换转入；赎回含转换转出。

#### 6.4.7.10 未分配利润

##### 申万菱信收益宝货币 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	3,102,764.31	-	3,102,764.31
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-3,102,764.31	-	-3,102,764.31
本期末	-	-	-

##### 申万菱信收益宝货币 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	122,691,500.03	-	122,691,500.03
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	-
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-122,691,500.03	-	-122,691,500.03
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
活期存款利息收入	49,469.10
定期存款利息收入	16,541,909.42
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	4,188.75
其他	-
合计	16,595,567.27

#### 6.4.7.12 股票投资收益

不适用。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	16,813,275,922.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,742,273,157.79
减：应收利息总额	58,370,444.98
买卖债券差价收入	12,632,319.49

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

不适用。

#### 6.4.7.15 股利收益

不适用。

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

不适用。

#### 6.4.7.17 其他收入

无。

#### 6.4.7.18 交易费用

无。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年1月1日至2020年6月30日
审计费用	33,316.92
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	33,863.51
账户维护费	17,901.52
其他	1,574.43

合计	146,328.72
----	------------

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司	基金管理人 基金销售机构 基金注册 登记机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东 基金代销机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国工商银行股份有限公司	基金托管人 基金代销机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期和上年度可比期间内，未通过关联方交易单元进行交易，无应支付关联方的佣金。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

###### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	22,135,525.83	12,114,581.80
其中：支付销售机构的客户	1,570,845.25	823,711.30

维护费		
-----	--	--

注：支付基金管理人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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020年1月1日至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,707,735.08	3,671,085.32

注：支付基金托管人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。

#### 6.4.10.2.3 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		
	2020年1月1日至2020年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B	合计
中国工商银行	10,665.57	-	10,665.57
申万宏源	438,380.73	857.58	439,238.31
申万菱信基金管理有限公司	22,912.23	560,646.87	583,559.10
合计	471,958.53	561,504.45	1,033,462.98
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2019年1月1日至2019年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B	合计
中国工商银行	15,286.36	-	15,286.36
申万宏源	5,276.12	782.15	6,058.27
申万菱信基金管理有限公司	225,429.71	294,720.82	520,150.53
合计	245,992.19	295,502.97	541,495.16

注：支付基金销售机构的销售服务费，收益宝 A 级份额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，按月支付给申万菱信基金管理有限公司，再由申万菱信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。日销售服务费 = 前一日基金资产净值 \* 0.25% / 当年天数；收益宝 B 级份额按前一日基金资产净值 0.01% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给申万菱信基金管理有限公司，再由申万菱信基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。日销售服务费 = 前一日基金资产净值 \* 0.01% / 当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

**6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况**

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	申万菱信收益宝货币A	申万菱信收益宝货币B	申万菱信收益宝货币A	申万菱信收益宝货币B
基金合同生效日（2006年7月7日）持有的基金份额	-	-	-	-
期初持有的基金份额	-	153,508,952.63	-	23,082,606.55
期间申购/买入总份额	-	1,501,237.52	-	201,230.19
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	2,000.00	-	7,084,611.10
期末持有的基金份额	-	155,008,190.15	-	16,199,225.64
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.89%	-	0.29%

注：报告期内，本基金管理人申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

**6.4.10.5.2 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****申万菱信收益宝货币 A**

份额单位：份

关联方名称	申万菱信收益宝货币A本期末 2020年6月30日		申万菱信收益宝货币A上年度末 2019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
申万菱信（上海）资产管理有限公司	469,285.95	0.08%	465,298.69	0.27%

**申万菱信收益宝货币 B**

份额单位：份

关联方名称	申万菱信收益宝货币B本期末 2020年6月30日		申万菱信收益宝货币B上年度末 2019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
申万菱信（上海）资 产管理有限公司	171,757,842.45	0.98%	170,096,578.29	1.41%
申万宏源证券有限 公司	1,304,553,848.46	7.46%	1,128,625,276.30	9.35%

#### 6.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	7,256,120.60	49,469.10	3,409,230.76	47,619.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期内，本基金在承销期内未参与关联方承销证券买卖。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

##### 6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

##### 1、申万菱信收益宝货币 A

单位：人民币元

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	本期利润分 配合计	备注
3,102,764.31	-	-	3,102,764.31	-

##### 2、申万菱信收益宝货币 B

单位：人民币元

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	本期利润分 配合计	备注
122,691,500.03	-	-	122,691,500.	-

			03	
--	--	--	----	--

#### 6.4.12 期末（2020 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

不适用。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金无债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额，无相关抵押证券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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，并且形成了由本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，本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：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是利率风险。

#### 6.4.13.2 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等来管理。于 2020 年 6 月 30 日，由于本基金均投资于信用等级良好的债券，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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国工商银行；定期存款存放在具有基金托管资格的上海银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、广东发展银行股份有限公司。本基金管理人认为与以上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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	2,280,032,056.88	390,005,780.79
A-1 以下	-	-
未评级	1,302,051,051.29	420,114,132.68
合计	3,582,083,108.17	810,119,913.47

注：未评级债券均为超级短期融资券以及无信用风险的政策性金融债和国债。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-

未评级	5,687,612,012.66	4,698,787,239.39
合计	5,687,612,012.66	4,698,787,239.39

#### 6.4.13.2.3 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020年6月30日	上年末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	422,790,909.81	200,287,874.11
合计	422,790,909.81	200,287,874.11

注：未评级债券均为无信用风险的政策性金融债。

#### 6.4.13.3 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基金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。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；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。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券),并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天,平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天,且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天,平均剩余存续期不得超过 180 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%;当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时,本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天,平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天;投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2020 年 6 月 30 日,本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 39.30%,本基金投资组合的平均剩余期限为 54 天,平均剩余存续期为 54 天,本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为 34.79%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%,且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。

本基金所持有的资产大部分是流动性良好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具,其余是银行存款,银行存款主要为活期存款及可无条件提前支取且支取无利息损失的银行存款。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%,于 2020 年 6 月 30 日,本基金未持有流动性受限资产。除附注 6.4.12 披露的流通受限不能自由转让的基金资产外,本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。于 2020 年 6 月 30 日,本基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的账面价值为 17,754,325,563.33 元,超过经确认的当日净赎回金额。此外,本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,除

发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20% 以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30% 以上的情形外，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%。于 2020 年 6 月 30 日，本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### **6.4.13.4 市场风险**

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### **6.4.13.4.1 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 2020 年 6 月 30 日，本基金持有的利率敏感性金融工具主要是银行存款、债券投资以及买入返售金融资产等。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。

## 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,207,256,120.60	370,000,000.00	170,000,000.00	-	-	-	1,747,256,120.60
结算备付金	2,666,666.67	-	-	-	-	-	2,666,666.67
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,287,564,436.15	2,448,683,838.91	2,956,237,755.58	-	-	-	9,692,486,030.64
买入返售金融资产	5,259,337,688.99	-	-	-	-	-	5,259,337,688.99
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	35,448,869.03	35,448,869.03
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	1,340,159,228.00	1,340,159,228.00
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	10,756,824,912.41	2,818,683,838.91	3,126,237,755.58	-	-	1,375,608,097.03	18,077,354,603.93
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	161,629.34	161,629.34
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,931,258.07	3,931,258.07
应付托管费	-	-	-	-	-	1,191,290.32	1,191,290.32
应付销售服务费	-	-	-	-	-	235,845.08	235,845.08
应付交易费用	-	-	-	-	-	267,028.26	267,028.26
应交税费	-	-	-	-	-	17,342.86	17,342.86
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	101,890.78	101,890.78
负债总计	-	-	-	-	-	5,906,284.71	5,906,284.71
利率敏感度缺口	10,756,824,912.41	2,818,683,838.91	3,126,237,755.58	-	-	1,369,701,812.32	18,071,448,319.22
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,586,398,203.14	210,000,000.00	190,000,000.00	-	-	-	1,986,398,203.14
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-	-	-

交易性金融资产	1,378,336,492.28	2,462,592,083.90	1,868,266,450.79	-	-	-	5,709,195,026.97
买入返售金融资产	4,165,278,607.91	-	-	-	-	-	4,165,278,607.91
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	21,761,178.09	21,761,178.09
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	371,283,708.65	371,283,708.65
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	7,130,013,303.33	2,672,592,083.90	2,058,266,450.79	-	-	393,044,886.74	12,253,916,724.76
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	118,530.93	118,530.93
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,128,355.09	2,128,355.09
应付托管费	-	-	-	-	-	644,956.09	644,956.09
应付销售服务费	-	-	-	-	-	86,268.27	86,268.27
应付交易费用	-	-	-	-	-	122,117.03	122,117.03
应交税费	-	-	-	-	-	1,016.85	1,016.85
应付利息	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	196,000.00	196,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,297,244.26	3,297,244.26
利率敏感度缺口	7,130,013,303.33	2,672,592,083.90	2,058,266,450.79	-	-	389,747,642.48	12,250,619,480.50

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币万元）	
		本期末	上年度末
		2020年6月30日	2019年12月31日
	1.市场利率平行下降50个基点	增加约1,107	增加约751
	2.市场利率平行上升50个基点	减少约1,102	减少约747

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

一、本基金在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

于 2020 年 06 月 30 日，属于第一层次的公允价值计量为 0 元；属于第二层次的公允价值为 9,692,486,030.64 元。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2020 年 06 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 二、其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括买入返售金融资产、应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## 7 投资组合报告

### 7.1 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	9,692,486,030.64	53.62

	其中：债券	9,692,486,030.64	53.62
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,259,337,688.99	29.09
	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	1,749,922,787.27	9.68
4	其他各项资产	1,375,608,097.03	7.61
5	合计	18,077,354,603.93	100.00

## 7.2 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	0.73	
	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

本基金本报告期内不存在正回购的资金余额超过基金资产净值 20% 的情况。

## 7.3 基金投资组合平均剩余期限

### 7.3.1 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	54
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	84
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	49

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未发生超过 120 天的情况。

### 7.3.2 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	58.70	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.27	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	2.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	1.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	15.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		92.42	-

#### 7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本基金本报告期内未发生投资组合平均剩余存续期超过 240 天的情况。

#### 7.5 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	39,951,998.20	0.22
2	央行票据	-	-
3	金融债券	914,377,148.23	5.06
	其中：政策性金融债	914,377,148.23	5.06
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	3,050,544,871.55	16.88
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,687,612,012.66	31.47
8	其他	-	-
9	合计	9,692,486,030.64	53.63
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

**7.6 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**

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	112081288	20 重庆银行 CD085	4,000,000.00	399,615,881.80	2.21
2	111915312	19 民生银行 CD312	3,700,000.00	369,454,290.13	2.04
3	072000095	20 广发证券 CP004	3,000,000.00	300,015,895.42	1.66
4	111983056	19 南京银行 CD049	2,500,000.00	249,682,608.96	1.38
5	200201	20 国开 01	2,400,000.00	241,568,263.60	1.34
6	111911114	19 平安银行 CD114	2,200,000.00	219,798,797.87	1.22
7	012000209	20 电网 SCP005	2,000,000.00	200,331,593.46	1.11
8	200306	20 进出 06	2,000,000.00	199,892,807.52	1.11
9	111911113	19 平安银行 CD113	2,000,000.00	199,826,936.35	1.11
10	111910309	19 兴业银行 CD309	2,000,000.00	199,746,044.77	1.11

**7.7“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	0.1633%
报告期内偏离度的最低值	-0.0501%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0766%

**报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明**

本基金本报告期内未发生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**

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

**7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

**7.9 投资组合报告附注****7.9.1 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。

**7.9.2 本基金投资的前十大证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查的情形。**

本基金投资的前十大证券的发行主体除 19 民生银行 CD312 (111915312.IB)、20 广发证券 CP004(072000095.IB)、19 南京银行 CD049 (111983056.IB)、19 平安银行 CD114 (111911114.IB)、19 平安银行 CD113(111911113.IB)外, 在报告编制日前一年内, 没有收到公开谴责和处罚的情形。

本报告编制日前一年内, 民生银行股份有限公司由于未按规定履行客户身份识别义务、民生银行总行同业票据业务管理失控等多个违法违规事实而收到中国银行保险监督管理委员会及其派出机构的责令改正并处以罚款。

本报告编制日前一年内, 广发证券股份有限公司由于在担任中铁宝盈广发新三板特定资产管理计划财务顾问过程中, 存在对相关项目尽职调查、投资决策、投后管理不够审慎, 内部业务授权管控不足等问题、以及对境外子公司风控缺失等违规事实而被中国证券监督管理委员会及其派出机构分别出具警示函、限制增加新业务种类 6 个月等行政监管措施。

本报告编制日前一年内, 南京银行股份有限公司由于未将部分银行承担风险的业务纳入统一授信管理等违法违规行为而被中国银行业监督管理委员会及其派出机构处以罚款。

本报告编制日前一年内, 平安银行股份有限公司由于汽车金融事业部将贷款调查的核心事项委托第三方完成、代理保险销售的人员为非商业银行人员等多个违法违规事实而被中国银行保险监督管理委员会及其派出机构处以罚款。

本基金管理人认为上述事件不会对该证券的投资价值构成影响, 因此也不影响基金管理人对该证券的投资决策。

### 7.9.3 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	35,448,869.03
4	应收申购款	1,340,159,228.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-

7	其他	-
8	合计	1,375,608,097.03

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 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
申万菱信收益宝货币 A	30,899	19,251.47	57,881,397.46	9.73%	536,969,850.03	90.27%
申万菱信收益宝货币 B	123	142,086,155.05	17,439,174,184.98	99.79%	37,422,886.75	0.21%
合计	31,020	582,574.09	17,497,055,582.44	96.82%	574,392,736.78	3.18%

注：“持有人户数”合计数小于各份额级别持有人户数的总和，是由于一个持有人同时持有多个级别基金份额。

### 8.2 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	券商类机构	1,304,553,848.46	7.22%
2	银行类机构	1,000,350,896.45	5.54%
3	银行类机构	712,114,444.90	3.94%
4	保险类机构	700,095,115.24	3.87%
5	保险类机构	666,796,587.83	3.69%
6	银行类机构	600,742,908.66	3.32%
7	其他机构	600,029,923.12	3.32%
8	保险类机构	509,941,810.73	2.82%
9	银行类机构	503,743,668.70	2.79%
10	银行类机构	503,042,211.37	2.78%

**8.3 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	申万菱信收益宝货币 A	1,983,803.46	0.33%
	申万菱信收益宝货币 B	0.00	0.00%
	合计	1,983,803.46	0.01%

注：分级基金管理人的从业人员持有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）。

**8.4 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	申万菱信收益宝货币 A	>100
	申万菱信收益宝货币 B	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信收益宝货币 A	0
	申万菱信收益宝货币 B	0
	合计	0

**9 开放式基金份额变动**

单位：份

项目	申万菱信收益宝货币 A	申万菱信收益宝货币 B
本报告期期初基金份额总额	174,162,031.94	12,076,457,448.56
本报告期基金总申购份额	6,771,749,892.76	39,910,766,780.46
减：本报告期基金总赎回份额	6,351,060,677.21	34,510,627,157.29
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	594,851,247.49	17,476,597,071.73

注：申购含红利再投、转换转入；赎回含转换转出。

**10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 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、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意独立董事由 WEI/SHANGJIN（魏尚进）先生变更为白硕先生。

2、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意公司董事由来肖贤先生变更为汪涛先生。

3、本报告期内，经本基金管理人股东会决议，同意外方股东提名的董事由斋藤正宪先生变更为福井雄介先生。

4、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意汪涛先生担任公司总经理。

5、本报告期内，经本基金管理人董事会决议，同意周小波先生担任公司副总经理。

6、本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

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。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

不适用。

### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况

本报告期内，本货币市场基金未发生偏离度绝对值超过 0.5% 的情况。

### 10.10 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	申万菱信收益宝货币市场基金 2019 年第 4 季度报告	《证券日报》	2020-01-20
2	申万菱信收益宝货币市场基金基金暂停申购、转换转入的公告	《证券日报》	2020-01-20
3	申万菱信收益宝货币市场基金 2020 年第 1 季度报告	《证券日报》	2020-04-22
4	申万菱信收益宝货币市场基金暂停申购、转换转入的公告	《证券日报》	2020-04-27
5	申万菱信收益宝货币市场基金恢复申购、转换转入业务的公告	《证券日报》	2020-04-29
6	申万菱信收益宝货币市场基金 2019 年年度报告	《证券日报》	2020-04-30
7	申万菱信收益宝货币市场基金 B 份额增加招商银行招	《证券日报》	2020-05-28

	赢通平台办理基金销售业务的公告		
--	-----------------	--	--

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

基金合同；  
招募说明书及其定期更新；  
发售公告；  
成立公告；  
开放日常交易业务公告；  
定期报告；  
其他临时公告。

### 11.2 存放地点

上述备查文件中基金合同、招募说明书及其定期更新、基金发售公告和基金成立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、定期报告和其他临时公告放置于本基金管理人的住所。本基金管理人住所地址为：中国上海市中山南路 100 号 11 层。

### 11.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅，也可在本基金管理人的网站进行查阅，查询网址：[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)

申万菱信基金管理有限公司

二〇二〇年八月二十九日