

**中银活期宝货币市场基金**  
**2020 年中期报告**  
**2020 年 6 月 30 日**

基金管理人：中银基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二〇年八月三十一日

## 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。本中期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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2020 年 8 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

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
<b>2 基金简介</b> .....	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.....	5
2.5 其他相关资料.....	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	6
<b>4 管理人报告</b> .....	7
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
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.....	8
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	11
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.....	11
<b>5 托管人报告</b> .....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
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.....	11
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.....	12
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	15
<b>7 投资组合报告</b> .....	32
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 债券回购融资情况.....	32
<b>7.3 基金投资组合平均剩余期限</b> .....	33
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.....	33
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	34
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.....	34
7.7“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.8 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.....	35
7.9 投资组合报告附注.....	35
<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	36
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	36
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况.....	36
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
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.....	36

<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	37
<b>10 重大事件揭示</b> .....	37
10.1 基金份额持有人大会决议.....	37
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.....	37
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	37
10.4 基金投资策略的改变.....	37
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	37
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.....	37
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	37
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	38
10.9 其他重大事件.....	39
<b>11 备查文件目录</b> .....	39
11.1 备查文件目录.....	39
11.2 存放地点.....	40
11.3 查阅方式.....	40

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中银活期宝货币市场基金
基金简称	中银活期宝货币
基金主代码	000539
交易代码	000539
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 2 月 14 日
基金管理人	中银基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	47,121,784,117.03 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在有效控制投资风险和保持较高流动性的基础上，力争获得超过业绩比较基准的稳定回报。
投资策略	本基金通过综合考虑各类资产的收益性、流动性和风险特征，根据定量和定性方法，在保持投资组合较低风险和良好流动性的基础上，力争获得高于业绩比较基准的稳定投资回报。
业绩比较基准	同期七天通知存款税后利率。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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	中银基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	欧阳向军
	联系电话	021-38834999
	电子邮箱	clientservice@bocim.com
客户服务电话	021-38834788 400-888-5566	95558
传真	021-68873488	010-85230024
注册地址	上海市银城中路200号中银大厦45层	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址	上海市银城中路200号中银大厦26层、27层、45层	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码	200120	100010
法定代表人	章砚	李庆萍

### 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	<a href="http://www.bocim.com">http://www.bocim.com</a>
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区银城中路 200 号 26 楼

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中银基金管理有限公司	上海市银城中路 200 号中银大厦 26 层、27 层、45 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 日至 2020 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	608,961,975.66
本期利润	608,961,975.66
本期净值收益率	1.0897%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	47,121,784,117.03
期末基金份额净值	1.000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	24.4364%

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。

2、本基金利润分配是按日结转份额。

### 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

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
过去一个月	0.1410%	0.0005%	0.1125%	0.0000%	0.0285%	0.0005%
过去三个月	0.4676%	0.0006%	0.3413%	0.0000%	0.1263%	0.0006%
过去六个月	1.0897%	0.0011%	0.6825%	0.0000%	0.4072%	0.0011%
过去一年	2.3665%	0.0010%	1.3725%	0.0000%	0.9940%	0.0010%
过去三年	9.8546%	0.0022%	4.1100%	0.0000%	5.7446%	0.0022%
自基金合同生效日起	24.4364%	0.0035%	8.7338%	0.0000%	15.7026%	0.0035%

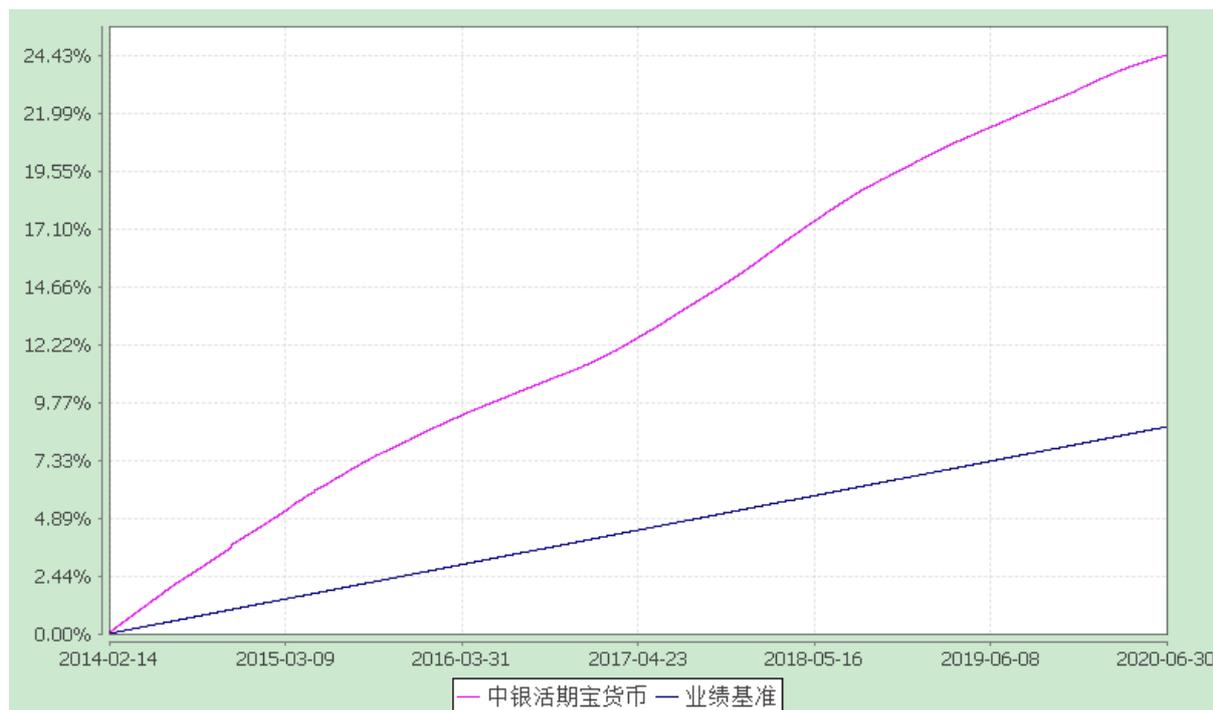
注：本基金的收益分配按日结转份额。

#### 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

中银活期宝货币市场基金

自基金合同生效以来累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014 年 2 月 14 日至 2020 年 6 月 30 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，截至建仓结束时各项资产配置比例均符合基金合同约定。

## 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

本基金管理人为中银基金管理有限公司，由中国银行股份有限公司和贝莱德投资管理有限公司两大全球著名领先金融品牌强强联合组建的中外合资基金管理公司，致力于长期参与中国基金业的发展，努力成为国内领先的基金管理公司。

截至 2020 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理中银中国精选混合型开放式证券投资基金、中银货币市场证券投资基金、中银持续增长混合型证券投资基金、中银收益混合型证券投资基金等 124 只开放式证券投资基金，同时管理着多个私募资产管理计划。

#### 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		
范静	基金经理	2014-02-14	-	15	中银基金管理有限公司董事（D），金融市场学硕士。曾任日本瑞穗银行（中国）有限公司资金部交

					易员。2007 年加入中银基金管理有限公司，历任债券交易员、固定收益研究员、专户投资经理、固定收益基金经理助理。2013 年 12 月至今任中银惠利纯债基金基金经理，2014 年 2 月至今任中银活期宝货币基金基金经理，2014 年 6 月至今担任中银薪钱包货币基金基金经理，2019 年 9 月至今任中银瑞福基金基金经理，2020 年 3 月至今任中银宁享基金基金经理。特许公认会计师公会（ACCA）准会员。具有 15 年证券从业年限。具备基金、银行间本币市场交易员从业资格。
--	--	--	--	--	---

注：1、首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，非首任基金经理的“任职日期”为根据公司决定确定的聘任日期，基金经理的“离任日期”均为根据公司决定确定的解聘日期；2、证券从业年限的计算标准及含义遵从《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《中华人民共和国证券投资基金法》、中国证监会的有关规则和其他有关法律、法规的规定，严格遵循本基金基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，本报告期内公司整体公平交易制度执行情况良好，未发现违背公平交易的相关情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未发现异常交易行为。

本报告期内，基金管理人未发生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。

#### 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

## 1. 宏观经济分析

国外经济方面，上半年全球经济受疫情影响大幅下挫，主要国家大幅加码财政和货币政策。美国二季度 GDP 环比大幅负增长已成定局，4 月 14.7% 的失业率为峰值水平，在美联储大幅放松货币政策、财政政策不断加码背景下，6 月 ISM 制造业 PMI 已回到荣枯线以上，3、4 季度就业和消费复苏的斜率仍掣肘于疫情控制不佳。欧元区疫情控制及经济开放情况好于美国，制造业及服务业 PMI 回到荣枯线附近，日本经济恢复情况则逊于欧洲。综合来看，全球经济在下半年将进入缓慢复苏区间，主要央行货币政策维持宽松基调，发达经济体财政政策继续加码，美国大选压力对中美关系、资产波动率都将带来脉冲式影响。

国内经济方面，内外需均遭受新冠疫情大幅冲击，后均出现缓慢恢复，经济下行压力持续较大，通胀预期回落。具体来看，上半年领先指标中采制造业 PMI 见底回升至 50.9，同步指标工业增加值 1-6 月累计同比回落 1.3%，较 2019 年末下滑 7 个百分点。从经济增长动力来看，出口消费投资全面见底回升但尚未转正：1-6 月美元计价累计出口增速较 2019 年末回落 6.7 个百分点至 -6.2% 左右，6 月社会消费品零售总额增速较 2019 年末回落 9.8 个百分点至 -1.8%，制造业、房地产、基建投资均出现修复但仍有回升空间，1-6 月固定资产投资增速较 2019 年末小幅回落 8.5 个百分点至 -3.1% 的水平。通胀方面，CPI 快速下行，6 月同比增速从 2019 年末的 4.5% 下降 2 个百分点至 2.5%，PPI 触底后略有回升，6 月同比增速从 2019 年末的 -0.5% 下行 2.5 个百分点至 -3.0%。

## 2. 市场回顾

整体来看，上半年债市利率债品种出现了不同程度的上涨，但信用债出现小幅下跌。其中，一季度，中债总全价指数上涨 2.59%，中债银行间国债全价指数上涨 3.10%，中债企业债总全价指数上涨 1.03%；二季度中债总全价指数下跌 1.70%，中债银行间国债全价指数下跌 1.89%，中债企业债总全价指数下跌 1.14%。反映在收益率曲线上，上半年收益率曲线略有平坦化。其中，一季度，10 年期国债收益率从 3.14% 下行 55bp 至 2.59%，10 年期金融债（国开）收益率从 3.58% 下行 63 个 bp 至 2.95%；二季度，10 年期国债收益率从 2.59% 上行 23bp 至 2.82%，10 年期金融债（国开）收益率从 2.95% 上行 15 个 bp 至 3.10%。货币市场方面，上半年央行保持较高公开市场投放力度，并新增再贷款再贴现额度，银行间资金面总体宽松，但随着打击资金空转资金面边际出现收紧。其中，一季度，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.67% 左右，较上季度均值下行 55bp，银行间 7 天回购利率均值在 2.33% 左右，较上季度均值下行 36bp；二季度，银行间 1 天回购加权平均利率均值在 1.38% 左右，较上季度均值下行 29bp，银行间 7 天回购利率均值在 1.76% 左右，较上季度均值下行 57bp。

## 3. 运行分析

2020 年，一季度债市各品种出现上涨，二季度随着央行货币政策的边际收紧，债券市场出现一

定幅度的调整。资金面呈现总体宽松，资金利率中枢有所下行。本基金积极参与同业存单和存款的配置，维持一定的杠杆比例，优化配置结构，合理分配类属资产，积极参与利率波动中交易性机会，保证了在低风险状况下的较好回报。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为 1.0897%，同期业绩比较基准收益率为 0.6825%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，全球经济复苏依然面临着比较大的不确定性，美国疫情打断经济重启的概率在提升；国内经济保持复苏态势，但就业和消费修复面临较大压力。国内宏观政策以“六稳”、“六保”工作为主，积极的财政政策更加积极有为，特别国债和地方专项债有助于稳定基建投资；货币政策稳健灵活，有助于保持流动性合理充裕，“防风险”压力可能影响货币宽松的节奏。

我们对 2020 年下半年债券市场的走势保持谨慎态度。宏观经济整体保持复苏态势，地产投资和基建投资对经济复苏形成较强支撑，净出口对经济有正贡献，制造业投资和消费修复偏弱，预计年底经济增速有望修复至潜在水平。通胀方面，受基数效应影响，CPI 同比增速预计保持整体下降的趋势，而伴随着经济逐步复苏，PPI 同比增速降幅逐步收窄，但整体仍保持负增长。货币政策整体稳健偏宽松，“防风险”限制传统货币政策操作空间，但“稳增长”压力依然存在，政策收紧概率不高，流动性保持合理充裕状态，短端利率有望保持稳定。全球疫情风险仍未消除，海外主要央行货币政策仍将保持宽松状态，预计美债收益率维持在较低水平，中美利差仍将处于历史高位，境外资金对国内债市有持续增量配置需求。综合上述分析，预计下半年债券收益率可能呈震荡上行走势。信用债方面，宽信用环境下的整体信用风险可控，但疫情对企业盈利影响较大，尾部风险仍有暴露压力。我们将坚持从自上而下的角度预判市场走势，并从自下而上的角度严防信用风险。在做好组合流动性管理的基础上，我们将合理控制组合剩余期限和回购比例，精选个券，积极把握短融、同业存单和存款市场的投资机会，把握票息收入和资本利得，借此提升基金的业绩表现。

作为基金管理者，我们将一如既往地依靠团队的努力和智慧，为投资人创造应有的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

##### 4.6.1 有关参与估值流程各方及人员的职责分工、专业胜任能力和相关工作经历的描述

根据证监会的相关规定，本公司为建立健全有效的估值政策和程序，经公司执行委员会批准，公司成立估值委员会，明确参与估值流程各方的人员分工和职责，由研究部、风险管理部、基金运营部及投资相关部门的相关人员担任委员会委员。估值委员会委员具备应有的经验、专业胜任能力和独立性，分工明确，在上市公司研究和估值、基金投资、投资品种所属行业的专业研究、估值政策、估值流程和程序、基金的风险控制与绩效评估、会计政策与基金核算以及相关事项的合法合规

性审核和监督等各个方面具备专业能力和丰富经验。估值委员会严格按照工作流程诚实守信、勤勉尽责地讨论和决策估值事项。估值委员会审议并依据行业协会提供的估值模型和行业做法选定与当时市场环境相适应的估值方法，基金运营部应征询会计师事务所、托管行的相关意见。公司按特殊流程改变估值技术时，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，应就基金管理人所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见，会计师事务所应对公司所采用的相关估值模型、假设、参数及输入的适当性发表审核意见，同时公司按照相关法律法规要求履行信息披露义务。另外，对于特定品种或者投资品种相同，但具有不同特征的，若协会有特定调整估值方法的通知的，比如《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》的，应参照协会通知执行。可根据指引的指导意见，并经估值委员会审议，采用第三方估值机构提供的估值相关的数据服务。

4.6.2 本公司参与估值流程各方之间没有存在任何重大利益冲突。

4.6.3 定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同有关规定：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。

#### 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

本基金在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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中银活期宝货币市场基金 2020 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

### 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

本托管人认为，中银基金管理有限公司在中银活期宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，中银基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2020 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## 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：中银活期宝货币市场基金

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	6.4.7.1	17,675,036,158.77	21,859,800,931.49
结算备付金		31,600,000.00	-
存出保证金		15,787.75	-
交易性金融资产	6.4.7.2	22,393,125,000.84	41,335,704,539.52
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		20,287,818,969.98	39,773,975,356.27
资产支持证券投资		2,105,306,030.86	1,561,729,183.25
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	8,300,267,287.72	2,822,128,144.69
应收证券清算款		86,170.95	-
应收利息	6.4.7.5	112,403,692.54	202,775,453.31
应收股利		-	-
应收申购款		779,483,563.14	1,228,136,539.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	14,914.75
资产总计		49,292,017,661.71	67,448,560,523.15
<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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		2,145,998,800.00	8,560,880,627.63
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		604,519.48	180,937.64

应付管理人报酬		10,754,968.58	13,858,236.64
应付托管费		1,991,660.85	2,566,340.11
应付销售服务费		9,958,304.25	12,831,700.59
应付交易费用	6.4.7.7	324,696.90	449,957.49
应交税费		218,678.88	264,550.33
应付利息		121,728.77	1,307,154.24
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	260,186.97	256,189.47
负债合计		2,170,233,544.68	8,592,595,694.14
<b>所有者权益：</b>		-	-
实收基金	6.4.7.9	47,121,784,117.03	58,855,964,829.01
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		47,121,784,117.03	58,855,964,829.01
负债和所有者权益总计		49,292,017,661.71	67,448,560,523.15

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 47,121,784,117.03 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中银活期宝货币市场基金

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>800,939,638.73</b>	<b>1,693,051,603.97</b>
1.利息收入		794,439,299.38	1,671,784,236.26
其中：存款利息收入	6.4.7.11	268,370,333.16	590,695,427.04
债券利息收入		433,737,009.28	994,260,280.15
资产支持证券利息收入		35,353,917.01	26,462,394.28
买入返售金融资产收入		56,978,039.93	60,366,134.79
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		6,474,152.00	21,266,171.21
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.12	3,818,520.17	21,271,337.21
资产支持证券投资	6.4.7.12	2,655,631.83	-5,166.00
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）	6.4.7.13	26,187.35	1,196.50
<b>减：二、费用</b>		<b>191,977,663.07</b>	<b>333,980,101.27</b>
1. 管理人报酬	<b>6.4.10.2</b>	74,511,866.51	136,007,069.38
2. 托管费	6.4.10.2	13,798,493.78	25,186,494.32
3. 销售服务费		68,992,468.99	125,932,471.70
4. 交易费用	6.4.7.14	-	-
5. 利息支出		34,376,492.73	46,439,731.83
其中：卖出回购金融资产支出		34,376,492.73	46,439,731.83
6.税金及附加		132,717.53	202,216.66
7. 其他费用	6.4.7.15	165,623.53	212,117.38
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>608,961,975.66</b>	<b>1,359,071,502.70</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>608,961,975.66</b>	<b>1,359,071,502.70</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中银活期宝货币市场基金

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）	58,855,964,829.01	-	58,855,964,829.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	608,961,975.66	608,961,975.66
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）	-11,734,180,711.98	-	-11,734,180,711.98
其中：1.基金申购款	55,582,698,933.80	-	55,582,698,933.80
2.基金赎回款	-67,316,879,645.78	-	-67,316,879,645.78
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）	-	-608,961,975.66	-608,961,975.66
五、期末所有者权益（基金净值）	47,121,784,117.03	-	47,121,784,117.03
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）	117,144,401,674.65	-	117,144,401,674.65
二、本期经营活动产生的基	-	1,359,071,502.70	1,359,071,502.70

金净值变动数（本期利润）			
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）	-40,426,242,901.67	-	-40,426,242,901.67
其中：1.基金申购款	98,094,430,706.92	-	98,094,430,706.92
2.基金赎回款	-138,520,673,608.59	-	-138,520,673,608.59
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）	-	-1,359,071,502.70	-1,359,071,502.70
五、期末所有者权益（基金净值）	76,718,158,772.98	-	76,718,158,772.98

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：李道滨，主管会计工作负责人：张家文，会计机构负责人：乐妮

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中银活期宝货币市场基金(以下简称“本基金”)，系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]127 号文《关于核准中银活期宝货币市场基金募集的批复》的核准，由基金管理人中银基金管理有限公司向社会公开募集，基金合同于 2014 年 2 月 14 日正式生效。首次设立募集规模为 300,056,196.44 份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为中银基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金投资于法律法规或监管机构允许投资的金融工具，包括：现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大量存单；剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据；期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、短期融资券，及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但须符合中国证监会的相关规定。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为：同期七天通知存款税后利率。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下合称“企业会计准则”)编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、

《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号

《半年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 5 号《货币市场基金信息披露特别规定》、《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>》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 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

本基金在本报告期间没有需作说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### 6.4.6.1 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资

管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

#### 6.4.6.2 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个体，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

#### 6.4.6.3 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

#### 6.4.6.4 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

### 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	5,036,158.77
定期存款	17,670,000,000.00
存款期限 1-3 个月	9,900,000,000.00
存款期限 3 个月以上	7,770,000,000.00
其他存款	-
合计	17,675,036,158.77

## 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	269,221,880. 57	268,488,000.00	-733,880.57	-0.0016
	银行间市场	20,018,597,0 89.41	20,021,542,000 .00	2,944,910.59	0.0062
	合计	20,287,818,9 69.98	20,290,030,000 .00	2,211,030.02	0.0047
资产支持证券		2,105,306,03 0.86	2,111,065,400. 00	5,759,369.14	0.0122
合计		22,393,125,0 00.84	22,401,095,400 .00	7,970,399.16	0.0169

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

## 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	1,594,000,000.00	-
银行间市场	6,706,267,287.72	-
合计	8,300,267,287.72	-

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**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	4,617.31
应收定期存款利息	34,595,541.44
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	14,220.00
应收债券利息	45,413,421.88
应收资产支持证券利息	27,073,502.81
应收买入返售证券利息	5,302,382.00
应收申购款利息	-
应收出借证券利息	-
其他	7.10
合计	112,403,692.54

**6.4.7.6 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**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	324,696.90
合计	324,696.90

**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	8,859.31
应付证券出借违约金	-
应付审计费	62,655.32
应付信息披露费	179,672.34
应付账户维护费	9,000.00
合计	260,186.97

**6.4.7.9 实收基金**

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	58,855,964,829.01	58,855,964,829.01
本期申购	55,582,698,933.80	55,582,698,933.80
本期赎回（以“-”号填列）	-67,316,879,645.78	-67,316,879,645.78
本期末	47,121,784,117.03	47,121,784,117.03

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

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	608,961,975.66	-	608,961,975.66
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	-608,961,975.66	-	-608,961,975.66
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	197,652.83
定期存款利息收入	268,096,879.29
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	75,762.34
其他	38.70
合计	268,370,333.16

#### 6.4.7.12 债券投资收益

##### 6.4.7.12.1 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	56,476,090,921.67
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	56,295,107,662.79
减：应收利息总额	177,164,738.71
买卖债券差价收入	3,818,520.17

##### 6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	1,416,334,627.80
减：卖出资产支持证券成本总额	1,393,453,331.42
减：应收利息总额	20,225,664.55
资产支持证券投资收益	2,655,631.83

#### 6.4.7.13 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年6月30日
基金赎回费收入	-
其他	26,187.35
合计	26,187.35

#### 6.4.7.14 交易费用

本基金本报告期无交易费用。

#### 6.4.7.15 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	62,655.32
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	23,395.91
银行间账户维护费	18,000.00
其他	1,899.96
合计	165,623.53

#### 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

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

##### 6.4.8.2资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 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
中银基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构

中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金管理人的控股股东、基金销售机构
中银国际证券股份有限公司	受中国银行重大影响

注：以下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

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

##### 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	74,511,866.51	136,007,069.38
其中：支付销售机构的客户维护费	38,275,209.46	82,716,808.40

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.27% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

###### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	13,798,493.78	25,186,494.32

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

###### 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	本期
-----------	----

关联方名称	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
中银基金管理有限 公司	19,961,124.21
中国银行	49,005,479.97
中信银行	3,596.52
合计	68,970,200.70
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
中银基金管理有限 公司	78,672,945.55
中国银行	47,259,526.15
合计	125,932,471.70

注：基金销售服务费可用于本基金的市场推广、销售以及基金份额持有人服务等各项费用。基金销售服务费每日计提，按月支付。本基金基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，具体的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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

#### 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

单位：人民币元

本期 2020年1月1日至2020年6月30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
-	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30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
中信银行	-	599,260,90 0.00	-	-	-	-

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证

券出借业务。

#### 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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
期初持有的基金份额	-	39,111,537.38
期间申购/买入总份额	-	457,571,773.74
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	256,000,000.00
期末持有的基金份额	-	240,683,311.12
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.31%

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用自有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的新公告规定的费率结构。

##### 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年6月30日		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
中银国际证券股 份有限公司	100,030,669.43	0.21%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

##### 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
中信银行-活期存款	5,036,158.77	197,652.83	9,349,124.92	412,629.81
中信银行-定期存款	1,000,000,000.00	23,730,555.41	1,310,000,000.00	11,023,944.53
中国银行-定期存款	-	19,239,583.28	1,000,000,000.00	77,710,280.69
合计	1,005,036,158.77	43,167,791.52	2,319,349,124.92	89,146,855.03

注：除上表列示的金额外，本基金的证券交易结算资金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算有限责任公司，2020 年上半年获得的利息收入为人民币 75,762.34 元（2019 年上半年获得的利息收入为人民币 657,036.81 元），2020 年上半年末结算备付金余额为人民币 31,600,000.00 元（2019 年上半年末余额为人民币 49,122,500.00 元）。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
608,961,975.66	-	-	608,961,975.66	-

#### 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购金融资产款余额为人民币 2,145,998,800.00 元，是以如下债券作为质押：

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
150220	15 国开 20	2020-07-01	100.33	800,000	80,266,356.08
160206	16 国开 06	2020-07-01	101.10	1,500,000	151,655,693.93
170411	17 农发 11	2020-07-01	100.30	2,200,000	220,662,696.16
190307	19 进出 07	2020-07-01	100.06	2,300,000	230,137,067.66

170209	17 国开 09	2020-07-01	100.31	1,700,000	170,528,328.93
190211	19 国开 11	2020-07-01	100.05	290,000	29,015,557.32
209906	20 贴现国债 06	2020-07-01	99.90	1,000,000	99,901,979.84
207701	20 贴现国开 01	2020-07-01	99.72	2,000,000	199,435,364.73
150316	15 进出 16	2020-07-01	100.39	6,000,000	602,338,198.51
200401	20 农发 01	2020-07-01	100.60	700,000	70,419,492.40
170310	17 进出 10	2020-07-01	100.31	1,000,000	100,308,874.12
200201	20 国开 01	2020-07-01	100.12	2,000,000	200,245,782.98
合计				21,490,000	2,154,915,392.66

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金投资的金融工具主要包括现金、通知存款、一年以内（含一年）的银行定期存款和大额存单、剩余期限（或回售期限）在 397 天以内（含 397 天）的债券、资产支持证券、中期票据、期限在一年以内（含一年）的债券回购、期限在一年以内（含一年）的中央银行票据、短期融资券，及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金在日常经营活动中面临的相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了包括风险管理委员会、风险控制委员会、督察长、风险管理部、内控与法律合规部、审计部和相关业务部门构成的多级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。本基金的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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2020 年 06 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据、同业存单和政策性金融债以外的固定收益投资占基金资产净值的比例为 9.16%(2019 年 12 月 31 日：8.94%)。

本基金固定收益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	2,210,029,533.35	3,700,180,476.98
A-1 以下	-	-
未评级	1,139,399,120.33	2,300,008,794.33
合计	3,349,428,653.68	6,000,189,271.31

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、超短期融资券、中央票据。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

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	1,915,306,030.86	1,251,729,183.25
A-1 以下	-	-
未评级	90,000,000.00	210,000,000.00
合计	2,005,306,030.86	1,461,729,183.25

注：短期信用评级 A-1 所填列的资产支持证券均为 AAA 级的短期资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 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	14,994,706,325.59	29,996,871,608.55
A-1 以下	617,923,842.98	2,582,464,359.61
未评级	-	-
合计	15,612,630,168.57	32,579,335,968.16

注：本表列示期限在一年以内的同业存单。短期信用评级 A-1 所填列的为主体评级 AAA 的同业存单，短期信用评级 A-1 以下所填列的为主体评级 AAA 以下的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 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	1,325,760,147.73	1,194,450,116.80
合计	1,325,760,147.73	1,194,450,116.80

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中央票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

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	100,000,000.00	100,000,000.00
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	100,000,000.00	100,000,000.00

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指在履行以交付现金或其他金融资产的方式结算的义务时发生资金短缺的风险。对于本基金而言，体现在所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

##### 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》等有关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控流动性受限资产比例、份额持有人集中度、调整平均剩余期限和平均剩余存续期、压力测试等方式防范流动性风险。同时，对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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公司的证券不得超过该证券的 10%。本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于 2020 年 06 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额人民币 2,145,998,800.00 元将在一个月以内到期且计息外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量因市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临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影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期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	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
-----	--------	----------	-------	-----	----

2020 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	-	-	-	-	17,675,036,158.77
结算备付金	-	-	-	-	31,600,000.00
存出保证金	-	-	-	-	15,787.75
交易性金融资产	-	-	-	-	22,393,125,000.84
买入返售金融资产	-	-	-	-	8,300,267,287.72
应收证券清算款	-	-	-	86,170.95	86,170.95
应收利息	-	-	-	112,403,692.54	112,403,692.54
应收申购款	-	-	-	779,483,563.14	779,483,563.14
资产总计	-	-	-	891,973,426.63	49,292,017,661.71
负债					
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	2,145,998,800.00
应付赎回款	-	-	-	604,519.48	604,519.48
应付管理人报酬	-	-	-	10,754,968.58	10,754,968.58
应付托管费	-	-	-	1,991,660.85	1,991,660.85
应付销售服务费	-	-	-	9,958,304.25	9,958,304.25
应付交易费用	-	-	-	324,696.90	324,696.90
应交税费	-	-	-	218,678.88	218,678.88
应付利息	-	-	-	121,728.77	121,728.77
其他负债	-	-	-	260,186.97	260,186.97
负债总计	-	-	-	24,234,744.68	2,170,233,544.68
利率敏感度缺口	-	-	-	867,738,681.95	47,121,784,117.03
上年度末 2019 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	-	-	-	-	21,859,800,

					931.49
交易性金融资产					41,335,704,539.52
买入返售金融资产					2,822,128,144.69
应收利息			202,775,453.31		202,775,453.31
应收申购款			1,228,136,539.39		1,228,136,539.39
其他资产			14,914.75		14,914.75
资产总计			1,430,926,907.45		67,448,560,523.15
负债					
卖出回购金融资产款					8,560,880,627.63
应付赎回款			180,937.64		180,937.64
应付管理人报酬			13,858,236.64		13,858,236.64
应付托管费			2,566,340.11		2,566,340.11
应付销售服务费			12,831,700.59		12,831,700.59
应付交易费用			449,957.49		449,957.49
应交税费			264,550.33		264,550.33
应付利息			1,307,154.24		1,307,154.24
其他负债			256,189.47		256,189.47
负债总计			31,715,066.51		8,592,595,694.14
利率敏感度缺口			1,399,211,840.94		58,855,964,829.01

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况；2. 该利率敏感性分析假定所有期限利率均以相同幅度变动 25 个基点，且除利率之外的其他市场变量保持不变；3. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动；4. 银行存款、结算备付金、存出保证金和部分应收申购款均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响；买入返售金融资产的利息收益和卖出回购金融资产款的利息支出在交易时已确定，不受利率变化影响。	
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 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 1,243	增加约 2,750
	市场利率上升 25 个基点	减少约 1,242	减少约 2,746

#### 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

本报告期内没有有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 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	22,393,125,000.84	45.43
	其中：债券	20,287,818,969.98	41.16
	资产支持证券	2,105,306,030.86	4.27
2	买入返售金融资产	8,300,267,287.72	16.84
	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	17,706,636,158.77	35.92
4	其他各项资产	891,989,214.38	1.81
5	合计	49,292,017,661.71	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	6.62	
	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	2,145,998,800.00	4.55
	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

本基金合同约定：“本基金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%”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	93
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	34

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未出现超过 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	21.21	4.55
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.28	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	53.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	9.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		102.71	4.55

### 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

本报告期内投资组合平均剩余存续期未出现超过 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	99,901,979.84	0.21
2	央行票据	-	-
3	金融债券	2,365,257,288.22	5.02
	其中：政策性金融债	2,365,257,288.22	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	2,210,029,533.35	4.69
6	中期票据	-	-
7	同业存单	15,612,630,168.57	33.13
8	其他	-	-
9	合计	20,287,818,969.98	43.05
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	112010214	20 兴业银行 CD214	10,500,000	1,045,185,611.46	2.22
2	112020102	20 广发银行 CD102	10,000,000	995,434,315.29	2.11
3	112005027	20 建设银行 CD027	9,000,000	895,714,284.22	1.90
4	112008099	20 中信银行 CD099	8,000,000	796,331,371.14	1.69
5	112018174	20 华夏银行 CD174	7,000,000	696,799,837.58	1.48
6	150316	15 进出 16	6,000,000	602,338,198.51	1.28
7	111905116	19 建设银行 CD116	6,000,000	598,059,498.77	1.27
8	112020085	20 广发银行 CD085	5,500,000	548,418,708.23	1.16
9	112081465	20 北京农商银行 CD118	5,500,000	547,430,385.47	1.16
10	111983983	19 长沙银行 CD140	5,000,000	498,496,170.10	1.06

## 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	0
报告期内偏离度的最高值	0.1775%
报告期内偏离度的最低值	0.0060%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0893%

## 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内无负偏离度绝对值达到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前十名资产支持证券投资明细

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	165982	信润 01A1	4,430,000	443,000,000.00	0.94
2	168001	4 如日 A02	2,180,000	218,000,000.00	0.46
3	165334	信泽 06A1	1,460,000	146,000,000.00	0.31
4	139812	天著优 04	1,450,000	145,000,000.00	0.31
5	138265	国链 16A1	1,360,000	136,000,000.00	0.29
6	168270	信润 02A1	1,000,000	100,000,000.00	0.21
7	138410	南链优 04	1,000,000	100,000,000.00	0.21
8	138379	永熙优 22	1,000,000	100,000,000.00	0.21
9	138307	万科 12 优	1,000,000	100,000,000.00	0.21
10	138380	永熙优 23	700,000	70,000,000.00	0.15

### 7.9 投资组合报告附注

7.9.1020 年上半年，本基金投资的前十大债券的发行主体中，兴业银行、广发银行、建设银行、中信银行、华夏银行、进出口银行、建设银行、北京农商银行和长沙银行等受到中国银行保险监督管理委员会或地方银保监局的行政处罚。基金管理人通过对上述发行人进一步了解分析后，认为以上处分不会对所持有的 20 兴业银行 CD214 (112010214.IB)、20 广发银行 CD102 (112020102.IB)、20 建设银行 CD027 (112005027.IB)、20 中信银行 CD099 (112008099.IB)、20 华夏银行 CD174 (112018174.IB)、15 进出 16 (150316)、19 建设银行 CD116 (111905116.IB)、20 广发银行 CD085 (112020085.IB)、20 北京农商银行 CD118 (112081465.IB) 和 19 长沙银行 CD140 (111983983.IB) 的投资价值构成实质性影响，因此未披露处罚事宜。

报告期内，本基金投资的前十名债券的其余债券的发行主体没有被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.9.2 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，按票面利率或商定利率每日计提应收利息，并按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价。

#### 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	15,787.75
2	应收证券清算款	86,170.95
3	应收利息	112,403,692.54
4	应收申购款	779,483,563.14

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	891,989,214.38

#### 7.9.4 其他需说明的重要事项

由于计算中四舍五入的原因，本报告分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 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

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
7,944,740	5,931.19	7,390,161,997.51	15.6831%	39,731,622,119.52	84.3169%

### 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	银行类机构	1,602,373,442.29	3.4005%
2	信托类机构	1,068,385,632.69	2.2673%
3	券商类机构	565,323,742.55	1.1997%
4	银行类机构	503,000,060.53	1.0674%
5	银行类机构	500,153,347.16	1.0614%
6	券商类机构	305,298,889.46	0.6479%
7	银行类机构	300,000,000.00	0.6366%
8	银行类机构	250,416,119.69	0.5314%
9	银行类机构	250,416,119.69	0.5314%
10	银行类机构	207,270,273.10	0.4399%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	7,172,567.05	0.0152%

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 2 月 14 日）基金份额总额	300,109,959.31
本报告期期初基金份额总额	58,855,964,829.01
本报告期基金总申购份额	55,582,698,933.80
减：本报告期基金总赎回份额	67,316,879,645.78
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	47,121,784,117.03

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

本报告期内，基金管理人副总经理陈军离任。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

### 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

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有受到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

#### 10.7.1 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	
国金证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：根据中国证监会《关于加强证券投资基金监管有关问题的通知》（证监基字<1998>29号）及《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》有关规定，本公司租用证券公司专用交易单元的选择标准主要包括：券商基本面评价（财务状况、经营状况）、券商研究机构评价（报告质量、及时性和数量）、券商每日信息评价（及时性和有效性）和券商协作表现评价等方面。本公司租用证券公司专用交易单元的选择程序：首先根据租用证券公司专用交易单元的选择标准形成《券商研究所服务质量评分表》，然后根据评分高低选择基金专用交易单元并与其签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：无。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	103,872,986.43	15.89%	16,964,000,000.00	100.00%	-	-
中金公司	549,895,520.80	84.11%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内偏离度绝对值均未超过 0.5%。

**10.9 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	中银基金管理有限公司关于旗下部分货币市场基金在电子直销平台暂停快速赎回业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-01-10
2	中银活期宝货币市场基金更新招募说明书（2020 年第 1 号）	规定网站	2020-01-17
3	中银活期宝货币市场基金更新招募说明书摘要（2020 年第 1 号）	规定网站	2020-01-17
4	中银活期宝货币市场基金 2019 年第 4 季度报告	规定网站	2020-01-18
5	中银基金管理有限公司关于调整旗下基金 2020 年春节假期延长期间申购赎回等交易业务及清算交收安排的提示性公告	规定报刊及规定网站	2020-01-30
6	中银基金管理有限公司关于使用自有资金投资本公司旗下权益类基金的公告	规定报刊及规定网站	2020-02-06
7	中银基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定报刊及规定网站	2020-02-29
8	关于中银活期宝货币市场基金恢复大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-03-09
9	关于中银活期宝货币市场基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-03-10
10	中银基金管理有限公司关于旗下公募基金 2019 年年度报告延期披露的提示公告	规定报刊及规定网站	2020-03-26
11	中银活期宝货币市场基金 2020 年第 1 季度报告	规定网站	2020-04-03
12	中银活期宝货币市场基金 2019 年年度报告	规定网站	2020-04-08
13	中银基金管理有限公司关于旗下部分货币市场基金在电子直销平台暂停快速赎回业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-04-23
14	关于中银活期宝货币市场基金增加销售机构及参与其费率优惠的公告	规定报刊及规定网站	2020-04-28
15	关于中银活期宝货币市场基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-05-25
16	关于中银活期宝货币市场基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-06-03
17	关于中银活期宝货币市场基金暂停大额申购、定期定额投资及转换转入业务的公告	规定报刊及规定网站	2020-06-18

**11 备查文件目录****11.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准中银活期宝货币市场基金募集的文件；

- 2、《中银活期宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《中银活期宝货币市场基金托管协议》；
- 4、《中银活期宝货币市场基金招募说明书》；
- 5、法律意见书；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 8、报告期内在指定报刊上披露的各项公告；
- 9、中国证监会要求的其他文件。

### 11.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，部分文件同时登载于基金管理人互联网站。

### 11.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

中银基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日