

# 宝盈货币市场证券投资基金 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 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：2020 年 8 月 31 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。

基金托管人中国建设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> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>6</b>
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> .....	<b>8</b>
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合规守信情况的说明 .....	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 .....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	12
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 .....	12
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	12
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 .....	12
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> .....	<b>12</b>
6.1 资产负债表 .....	12
6.2 利润表 .....	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表 .....	15
6.4 报表附注 .....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况 .....	33
7.2 债券回购融资情况 .....	33
7.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	34
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 .....	34
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序的前十名债券投资明细 .....	35
7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离 .....	35
7.8 期末按摊余成本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 .....	36
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>38</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	38
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	38

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	38
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 .....	39
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>39</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>39</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	39
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 .....	39
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	39
10.4 基金投资策略的改变 .....	39
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	39
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 .....	39
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	39
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	40
10.9 其他重大事件 .....	40
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>41</b>
11.1 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 .....	41
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	42
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>42</b>
12.1 备查文件目录 .....	42
12.2 存放地点 .....	42
12.3 查阅方式 .....	42

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈货币市场证券投资基金	
基金简称	宝盈货币	
基金主代码	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	5,671,299,409.89 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	3,167,911,164.42 份	2,503,388,245.47 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	张磊
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	021-60637111
传真	0755-83515599	021-60635778
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华一	北京市西城区闹市口大街 1 号

	路 115 号投行大厦 10 层	院 1 号楼
邮政编码	518034	100033
法定代表人	马永红	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 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

基金级别	宝盈货币 A	宝盈货币 B
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)	报告期(2020年1月1日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	28,627,440.16	25,614,831.11
本期利润	28,627,440.16	25,614,831.11
本期净值收益率	0.9330%	1.0531%
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	3,167,911,164.42	2,503,388,245.47
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)	
累计净值收益率	41.5097%	45.2643%

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
过去一个月	0.1188%	0.0014%	0.0288%	0.0000%	0.0900%	0.0014%
过去三个月	0.3629%	0.0024%	0.0873%	0.0000%	0.2756%	0.0024%

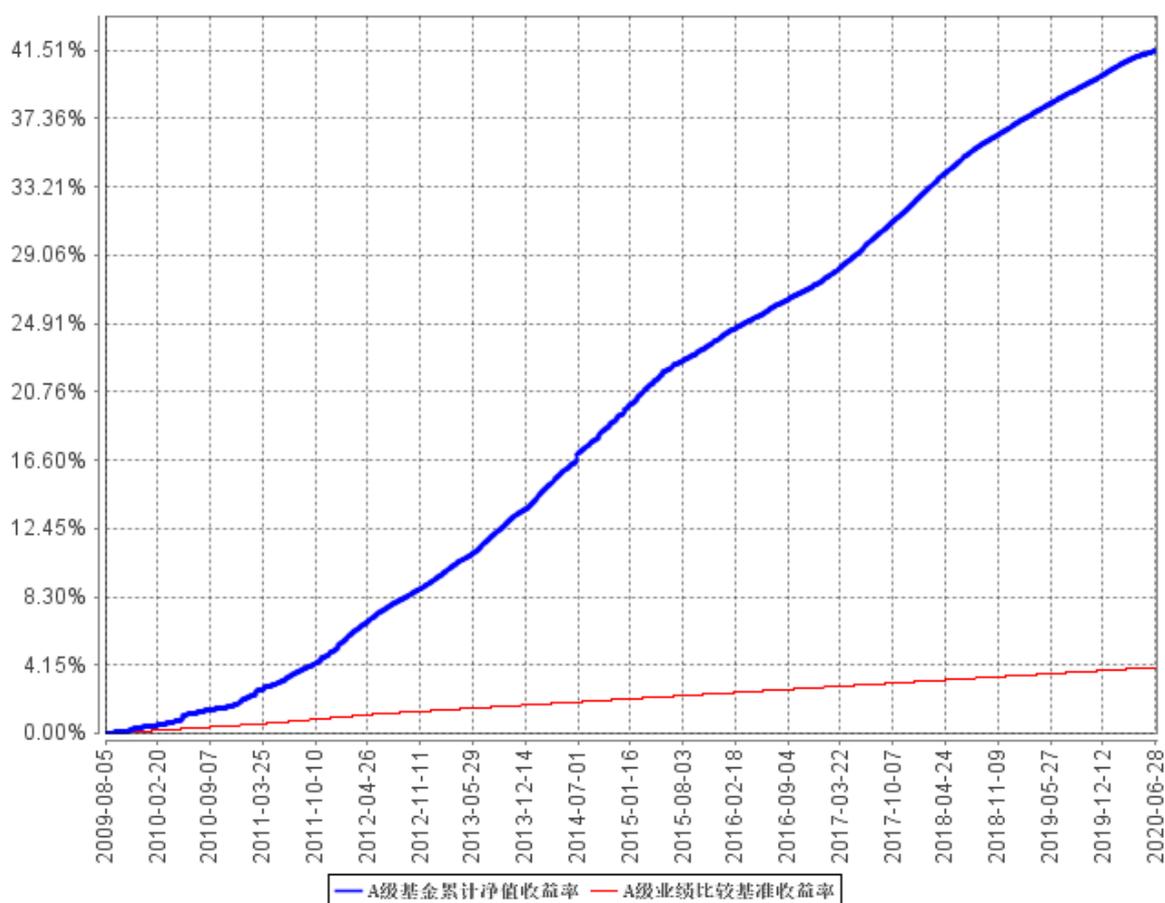
过去六个月	0.9330%	0.0023%	0.1745%	0.0000%	0.7585%	0.0023%
过去一年	2.1020%	0.0022%	0.3510%	0.0000%	1.7510%	0.0022%
过去三年	9.0784%	0.0029%	1.0510%	0.0000%	8.0274%	0.0029%
自基金合同生效起至今	41.5097%	0.0096%	4.0223%	0.0001%	37.4874%	0.0095%

## 宝盈货币 B

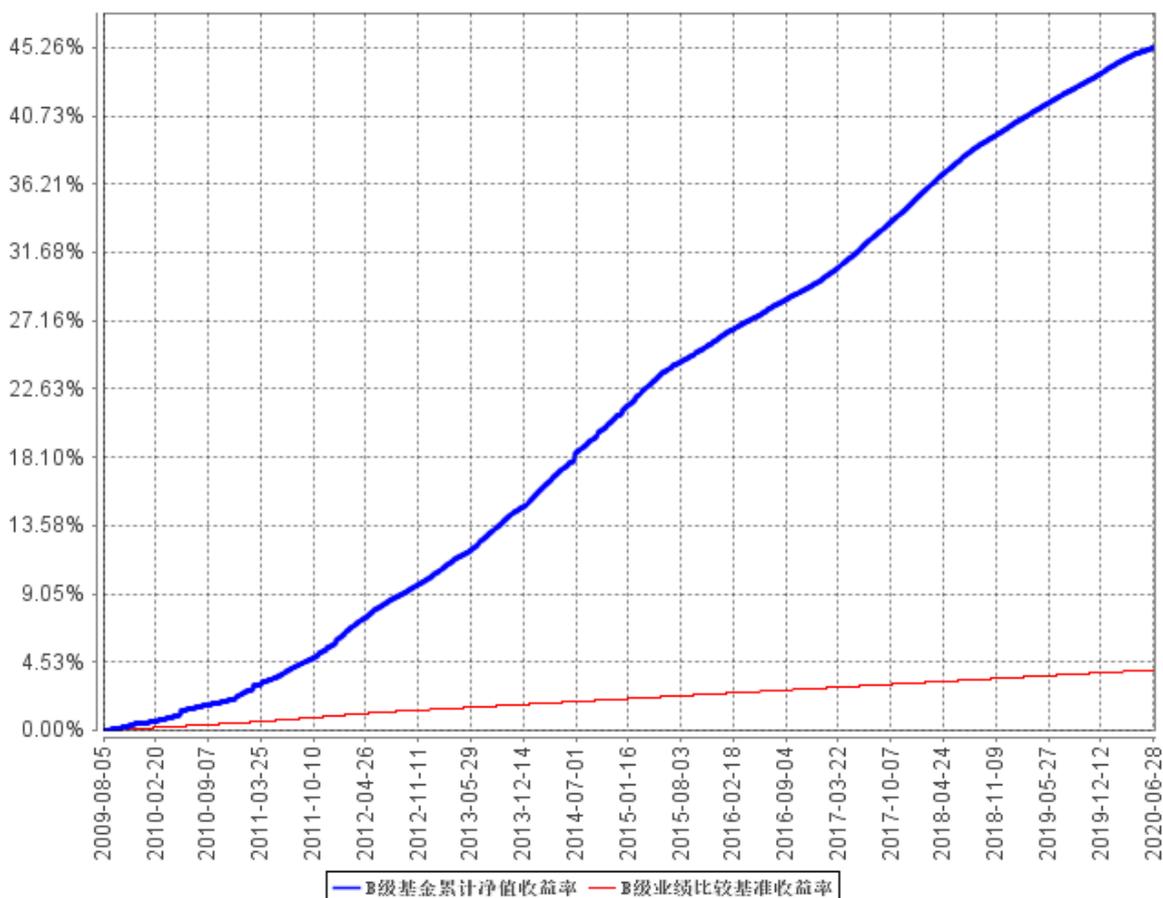
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1385%	0.0014%	0.0288%	0.0000%	0.1097%	0.0014%
过去三个月	0.4228%	0.0024%	0.0873%	0.0000%	0.3355%	0.0024%
过去六个月	1.0531%	0.0023%	0.1745%	0.0000%	0.8786%	0.0023%
过去一年	2.3469%	0.0022%	0.3510%	0.0000%	1.9959%	0.0022%
过去三年	9.8674%	0.0029%	1.0510%	0.0000%	8.8164%	0.0029%
自基金合同生效起至今	45.2643%	0.0096%	4.0223%	0.0001%	41.2420%	0.0095%

## 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



## § 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、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈盈顺纯债债券、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈辉纯债三十九只基

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		
杨献忠	本基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈盈润纯债债券型证券投资基金基金经理	2018年4月21日	-	7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。
吕姝仪	本基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、宝盈祥泽混合型证券投资基金基金经理	2019年3月30日	-	7年	吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。2012年7月至2013年9月在中山证券有限责任公司任投资经理助理，2013年10月至2015年9月在民生加银基金管理有限公司任债券交易员，2015年9月至2017年12月在东兴证券股份有限公司基金业务部任基金经理。2017年12月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资经理。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；  
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2020年6月30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。

### 4.3.2 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，新冠肺炎疫情在全球爆发，国内外先后加码宽松货币政策，主要宏观经济指标受疫情影响明显下降后修复。通胀方面，主要工业品和农业品价格先下后上、呈 V 型走势，居民消费价格阶梯式下行。

报告期内，人民银行创新和完善宏观调控，稳健的货币政策要更加灵活适度，把支持实体经济恢复与可持续发展放到更加突出的位置。坚持总量政策适度，促进金融与实体经济良性循环，全力支持做好“六稳”、“六保”工作。春节前，人民银行下调金融机构存款准备金率支持实体经济发展，与春节前的现金投放形成对冲，资金面维持宽松；春节后，为强化金融支持防控新冠肺炎疫情、支持企业复工复产，人民银行综合运用量价工具进行逆周期调节，一方面通过公开市场操作、常备借贷便利、再贷款、再贴现、降准等多种货币政策工具，提供充足流动性，另一方面先后下调 OMO、MLF 和 LPR 等利率，资金面维持宽松；4 月，人民银行对中小银行定向降准，并下调金融机构在央行超额存款准备金利率，资金面超预期宽松，货币市场利率连创新低；5 月，人民银行货币政策宽松暂缓，资金面维持平稳，货币市场利率低位震荡并于月底显著走高；6 月，

人民银行货币政策更注重结构性，市场全面宽松预期落空，资金面维持紧平衡，货币市场利率迅速上行完成调整。报告期内，商业银行同业融资压力先降后升，尤其是 5 月下旬后协议存款和同业存单利率快速抬升。债券市场方面，短期品种 1 年期国开债先下后上，上半年最低 1.19%，半年末上行至 2.19% 左右；长期品种 10 年期国开债先下后上，上半年最低 2.79%，半年末上行至 3.10% 左右。

报告期内，资金面先松后紧，货币市场利率大幅波动，我们灵活调整了组合久期和组合杠杆水平，在 1 季度末和 6 月份择机配置了收益率较高的同业存款、同业存单和信用债。

#### 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 0.9330%，本报告期宝盈货币 B 的基金份额净值收益率为 1.0531%，同期业绩比较基准收益率为 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

展望下半年，名义增速继续向上是大概率事件。具体来看，海外经济的重启有利于出口和制造业投资的进一步修复，地产投资在销售和融资改善支撑下保持韧性，基建投资在财政支持力度加大带动下有望持续高位，疫情对消费负面影响逐渐弱化。CPI 逐季下行趋势不改但 PPI 触底回升。在疫情缓和、经济回暖背景下，稳健的货币政策进入观察期，短期在经济缓慢修复背景下也无需转向。

名义增速向上背景下，长端利率缺乏趋势性下行机会，短期关注经历了经济预期调整、政策预期调整、风险偏好切换、供给等多重冲击超跌后的交易价值。信用债绝对收益率仍处于历史相对低位区间，关注短久期高票息品种。货币市场短期有望维持宽松格局，可择机配置高评级高收益的同业存款、同业存单和信用债。

#### 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（协管）领导、督察长及研究部、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、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经验。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，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 A 类 28,627,440.16 元，B 类 25,614,831.11 元。

#### 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 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 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：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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	907,265,881.21	964,929,189.57

结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	4,100,165,817.06	2,838,430,545.79
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		4,100,165,817.06	2,838,430,545.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	1,209,409,374.13	883,158,684.74
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	12,098,581.78	11,433,402.72
应收股利		-	-
应收申购款		21,686,296.33	5,046,992.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	694,766.67	694,766.67
资产总计		6,251,320,717.18	4,703,693,581.96
<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		572,499,273.75	450,799,020.60
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		4,149,962.37	457,921.88
应付管理人报酬		1,517,621.11	1,080,528.83
应付托管费		459,885.18	327,432.96
应付销售服务费		676,802.84	255,486.77
应付交易费用	6.4.7.7	145,306.64	79,820.33
应交税费		61,747.58	8,619.39
应付利息		39,616.67	38,832.73
应付利润		243,848.10	298,934.29
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	227,243.05	359,675.24
负债合计		580,021,307.29	453,706,273.02
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	5,671,299,409.89	4,249,987,308.94
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		5,671,299,409.89	4,249,987,308.94
负债和所有者权益总计		6,251,320,717.18	4,703,693,581.96

注：报告截止日 2020 年 6 月 30 日，宝盈货币 A 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 3,167,911,164.42 份；宝盈货币 B 基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 2,503,388,245.47 份。

宝盈货币份额总额合计为 5,671,299,409.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

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>		75,445,913.72	177,781,599.65
1. 利息收入		70,582,326.41	167,549,902.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,828,876.11	34,439,583.55
债券利息收入		45,673,961.18	97,428,414.76
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		15,079,489.12	35,681,904.52
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,863,587.31	10,231,696.82
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	4,863,587.31	10,231,696.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.1	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
<b>减：二、费用</b>		21,203,642.45	34,267,407.64
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	9,294,848.69	17,455,732.96
2. 托管费	6.4.10.2.2	2,816,620.77	5,289,616.05
3. 销售服务费		4,114,557.04	1,738,194.54
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		4,788,443.21	9,557,971.41
其中：卖出回购金融资产支出		4,788,443.21	9,557,971.41
6. 税金及附加		29,898.51	35,028.95
7. 其他费用	6.4.7.20	159,274.23	190,863.73
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		54,242,271.27	143,514,192.01

减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		54,242,271.27	143,514,192.01

### 6.3 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：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）	4,249,987,308.94	-	4,249,987,308.94
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	54,242,271.27	54,242,271.27
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）	1,421,312,100.95	-	1,421,312,100.95
其中：1. 基金申购款	59,706,598,672.56	-	59,706,598,672.56
2. 基金赎回款	-58,285,286,571.61	-	-58,285,286,571.61
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）	-	-54,242,271.27	-54,242,271.27
五、期末所有者权益（基金净值）	5,671,299,409.89	-	5,671,299,409.89
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）	13,541,414,901.72	-	13,541,414,901.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	143,514,192.01	143,514,192.01
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-8,683,864,791.49	-	-8,683,864,791.49

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	18,944,140,512.99	-	18,944,140,512.99
2. 基金赎回款	-27,628,005,304.48	-	-27,628,005,304.48
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)	-	-143,514,192.01	-143,514,192.01
五、期末所有者权益(基金净值)	4,857,550,110.23	-	4,857,550,110.23

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：

_____ 杨凯 _____	_____ 张献锦 _____	_____ 何瑜 _____
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

宝盈货币市场证券投资基金(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”)证监许可[2009]第 532 号《关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈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《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》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 1,455,089,424.24 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(09)第 0014 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,455,160,265.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 70,841.24 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》和《宝盈货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据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,并据此将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金按照 0.25%年费率计提销售服务费;B 类基金按照 0.01%年费率计提销售服务费的。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算每万份基金净收益和七日年化收益率。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基

金份额低于 50 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金,通知存款,短期融资券,一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券,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)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:活期存款利率(税后)。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2020 年半年度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 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本基金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

本基金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。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 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。

#### 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	7,265,881.21
定期存款	—
其中：存款期限 1 个月以内	—
存款期限 1-3 个月	—
存款期限 3 个月以上	—
其他存款	900,000,000.00
合计：	907,265,881.21

注：其他存款均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

## 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	10,101,812.54	10,044,000.00	-57,812.54	-0.0010%
	银行间市场	4,090,064,004.52	4,092,361,000.00	2,296,995.48	0.0405%
	合计	4,100,165,817.06	4,102,405,000.00	2,239,182.94	0.0395%
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	4,100,165,817.06	4,102,405,000.00	2,239,182.94	0.0395%

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

不适用。

## 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	1,209,409,374.13	-
合计	1,209,409,374.13	-

## 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	1,056.98
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	2,329,417.13

应收结算备付金利息	-
应收债券利息	8,899,055.98
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	869,051.69
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	-
合计	12,098,581.78

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
其他应收款	694,766.67
待摊费用	-
其他	-
合计	694,766.67

#### 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	145,306.64
合计	145,306.64

#### 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
应付赎回费	3,870.61
应付证券出借违约金	-
预提费用	223,372.44
合计	227,243.05

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈货币 A	
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	1,517,372,869.90	1,517,372,869.90
本期申购	57,706,836,806.35	57,706,836,806.35
本期赎回(以“-”号填列)	-56,056,298,511.83	-56,056,298,511.83
本期末	3,167,911,164.42	3,167,911,164.42

金额单位：人民币元

宝盈货币 B		
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	2,732,614,439.04	2,732,614,439.04
本期申购	1,999,761,866.21	1,999,761,866.21
本期赎回(以“-”号填列)	-2,228,988,059.78	-2,228,988,059.78
本期末	2,503,388,245.47	2,503,388,245.47

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	28,627,440.16	-	28,627,440.16
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	-28,627,440.16	-	-28,627,440.16
本期末	-	-	-

单位：人民币元

宝盈货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	25,614,831.11	-	25,614,831.11
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	-25,614,831.11	-	-25,614,831.11
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	31,845.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	9,797,031.03
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	9,828,876.11

**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（及债券到期兑付）成交总额	9,734,306,699.44
减：卖出债券（及债券到期兑付）成本总额	9,695,507,696.08
减：应收利息总额	33,935,416.05
买卖债券差价收入	4,863,587.31

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.14 贵金属投资收益**

不适用。

**6.4.7.15 衍生工具收益**

不适用。

**6.4.7.16 股利收益**

不适用。

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.18 其他收入**

无。

**6.4.7.19 交易费用**

无。

**6.4.7.20 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	54,700.10
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	18,000.00
银行费用	26,301.79
其他	600.00
合计	159,274.23

**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，本基金无须作披露的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

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**

本基金本报告期不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。

**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
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。

**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**

本基金本报告期内及上年度可比期间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	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管理费	9,294,848.69	17,455,732.96
其中：支付销售机构的客户维护费	3,526,882.11	1,405,543.05

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 X 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	2,816,620.77	5,289,616.05

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 X 0.1% / 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		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	135,649.77	1,119.35	136,769.12
宝盈基金	155,486.64	109,519.09	265,005.73
合计	291,136.41	110,638.44	401,774.85
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		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	199,732.45	2,430.53	202,162.98

宝盈基金	167,413.09	434,196.23	601,609.32
合计	367,145.54	436,626.76	803,772.30

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 X 0.25 % / 当年天数。

日销售服务费 = 前一日 B 类基金资产净值 X 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

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
中国建设银行	-	50,488,327.32	-	-	-	-
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
中国建设银行	-	750,004,712.94	-	-	1,350,000,000.00	74,555.00

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
报告期初持有的基金份额	-	181,992,806.23
报告期间申购/买入总份额	-	115,340,719.62
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	112,601,000.00
报告期末持有的基金份额	-	184,732,525.85
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	7.38%
项目	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金合同生效日（2009 年 8 月 5 日）持有的基金份额	-	-

报告期初持有的基金份额	-	206,805,393.91
报告期内申购/买入总份额	-	90,967,225.44
报告期内因拆分变动份额	-	-
减:报告期内赎回/卖出总份额	-	98,900,000.00
报告期末持有的基金份额	-	198,872,619.35
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.00%

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半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%。

#### 6.4.10.4.2 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 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
中铁信托有限责任公司	304,925,615.11	5.38%	203,737,882.13	4.19%
中铁宝盈资产管理有限公司	84,518,339.15	1.49%	79,275,586.33	1.63%

#### 6.4.10.5 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 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
中国建设银行	7,265,881.21	31,845.08	6,116,477.12	56,438.91

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。

#### 6.4.10.6 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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.11 利润分配情况

金额单位: 人民币元

##### 宝盈货币 A

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
28,601,067.41	-	26,372.75	28,627,440.16	-

## 宝盈货币B

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
25,696,290.05	-	-81,458.94	25,614,831.11	-

## 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

## 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

## 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余额为 572,499,273.75 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
111910506	19 兴业银行 CD506	2020 年 7 月 1 日	98.63	1,000,000	98,631,990.67
111907143	19 招商银行 CD143	2020 年 7 月 1 日	99.80	860,000	85,827,977.23
111910341	19 兴业银行 CD341	2020 年 7 月 1 日	99.79	1,000,000	99,788,562.10
111914167	19 江苏银行 CD167	2020 年 7 月 1 日	99.65	1,000,000	99,648,346.69
091918001	19 农发清发 01	2020 年 7 月 1 日	100.74	2,100,000	211,545,730.50
合计				5,960,000	595,442,607.19

## 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，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

## 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

本基金为货币市场基金，主要投资于各类货币市场工具，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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具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“在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，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管理委员会，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监察稽核部负责，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，督察长负责组织指导监察稽核工作。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行；定期存款存放在具有基金托管资格的中国民生银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、交通银行股份有限公司以及恒丰银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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。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的净资产的 10%。

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	上年度末 2019年12月31日
A-1	349,958,748.30	260,014,683.04
A-1 以下	-	-
未评级	1,548,048,706.00	259,989,878.91
合计	1,898,007,454.30	520,004,561.95

注：未评级部分为国债、短期融资券、同业存单。

## 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	上年度末 2019年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,858,660,000.00	2,218,240,945.56
合计	1,858,660,000.00	2,218,240,945.56

注：未评级部分为国债、短期融资券、同业存单。

## 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	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	333,396,550.20	100,185,038.28
合计	333,396,550.20	100,185,038.28

注：未评级部分为国债、短期融资券、同业存单。

## 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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一方面来自于基金份额持有人可随时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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2020 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 572499273.8 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)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。

#### 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 36.44%，本基金投资组合的平均剩余期限为 73 天，平均剩余存续期为 73 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 23.20%。

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%。完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制。

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。

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。

#### 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受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 2020 年 6 月 30	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产						
银行存款	907,265,881.21	-	-	-	-	907,265,881.21
交易性金融资产	3,756,667,454.34	343,498,362.72	-	-	-	4,100,165,817.06
买入返售金融资产	1,209,409,374.13	-	-	-	-	1,209,409,374.13
应收利息	-	-	-	-	12,098,581.78	12,098,581.78
应收申购款	-	-	-	-	21,686,296.33	21,686,296.33
其他资产	-	-	-	-	694,766.67	694,766.67
资产总计	5,873,342,709.68	343,498,362.72	-	-	34,479,644.78	6,251,320,717.18
负债						

卖出回购金融资产款	572,499,273.75	-	-	-	-	572,499,273.75
应付赎回款	-	-	-	-	4,149,962.37	4,149,962.37
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,517,621.11	1,517,621.11
应付托管费	-	-	-	-	459,885.18	459,885.18
应付销售服务费	-	-	-	-	676,802.84	676,802.84
应付交易费用	-	-	-	-	145,306.64	145,306.64
应付利息	-	-	-	-	39,616.67	39,616.67
应交税费	-	-	-	-	61,747.58	61,747.58
应付利润	-	-	-	-	243,848.10	243,848.10
其他负债	-	-	-	-	227,243.05	227,243.05
负债总计	572,499,273.75	-	-	-	7,522,033.54	580,021,307.29
利率敏感度缺口	5,300,843,435.93	343,498,362.72	-	-	-26,957,611.24	5,671,299,409.89
上年度末 2019年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	964,929,189.57	-	-	-	-	964,929,189.57
交易性金融资产	2,506,697,214.10	331,733,331.69	-	-	-	2,838,430,545.79
买入返售金融资产	883,158,684.74	-	-	-	-	883,158,684.74
应收利息	-	-	-	-	11,433,402.72	11,433,402.72
应收申购款	-	-	-	-	5,046,992.47	5,046,992.47
其他资产	-	-	-	-	694,766.67	694,766.67
资产总计	4,354,785,088.41	331,733,331.69	-	-	17,175,161.86	4,703,693,581.96
负债						
卖出回购金融资产款	450,799,020.60	-	-	-	-	450,799,020.60
应付赎回款	-	-	-	-	457,921.88	457,921.88
应付管理人报酬	-	-	-	-	1,080,528.83	1,080,528.83
应付托管费	-	-	-	-	327,432.96	327,432.96
应付销售服务费	-	-	-	-	255,486.77	255,486.77
应付交易费用	-	-	-	-	79,820.33	79,820.33
应付利息	-	-	-	-	38,832.73	38,832.73
应交税费	-	-	-	-	8,619.39	8,619.39
应付利润	-	-	-	-	298,934.29	298,934.29
其他负债	-	-	-	-	359,675.24	359,675.24
负债总计	450,799,020.60	-	-	-	2,907,252.42	453,706,273.02
利率敏感度缺口	3,903,986,067.81	331,733,331.69	-	-	-14,267,909.44	4,249,987,308.94

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	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
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	607,874.17	2,048,277.30
	市场利率上升 25 个基点	-605,644.38	-2,041,091.23

#### 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

无。

## § 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	4,100,165,817.06	65.59
	其中：债券	4,100,165,817.06	65.59
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,209,409,374.13	19.35
	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	907,265,881.21	14.51
4	其他各项资产	34,479,644.78	0.55
5	合计	6,251,320,717.18	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	9.66	
	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	572,499,273.75	10.09
	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。

## 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	73
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

### 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。

### 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	44.37	10.09
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	21.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	18.66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	5.26	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	19.84	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		109.62	10.09

### 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

本基金本报告期内无投资组合剩余存续期超过 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	99,822,041.17	1.76
2	央行票据	-	-
3	金融债券	383,166,796.73	6.76
	其中：政策性金融债	383,166,796.73	6.76
4	企业债券	10,101,812.54	0.18
5	企业短期融资券	1,749,434,487.88	30.85
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,857,640,678.74	32.76
8	其他	-	-
9	合计	4,100,165,817.06	72.30
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	012000390	20 电网 SCP013	3,000,000	299,985,116.94	5.29
2	091918001	19 农发清发 01	2,300,000	231,692,942.93	4.09
3	012000866	20 中石化 SCP002	2,000,000	200,001,724.59	3.53
4	112021235	20 渤海银行 CD235	2,000,000	199,116,831.68	3.51
5	112020108	20 广发银行 CD108	2,000,000	198,946,046.73	3.51
6	112006020	20 交通银行 CD020	2,000,000	196,625,954.99	3.47
7	012000280	20 赣高速 SCP002	1,000,000	100,023,317.78	1.76
8	012000426	20 中油股 SCP005	1,000,000	100,003,391.73	1.76
9	072000092	20 国信证券 CP005	1,000,000	100,000,423.86	1.76
10	072000156	20 华泰证券 CP006	1,000,000	99,988,241.00	1.76

### 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	0.2419%
报告期内偏离度的最低值	0.0197%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0976%

#### 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。

### 7.8 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.9 投资组合报告附注

### 7.9.1 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。

### 7.9.2 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

本基金投资的前十名证券的发行主体在报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 20 华泰证券 CP006、20 广发银行 CD108 和 20 交通银行 CD020 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2019 年 8 月 23 号，江苏证监局向华泰证券股份有限公司出具《关于对华泰证券股份有限公司采取责令改正监督管理措施的决定》[2019]65 号，指出公司在代销“聚潮资产-中科招商新三板 I 期 A、B 专项资管计划”过程中，存在使用未经报备的宣传推介材料的情形。该行为违反《证券公司代销金融产品管理规定》第十条的规定，反映出公司内部控制不完善。根据《证券公司监督管理条例》第七十条的规定，江苏证监局决定对华泰证券采取责令改正的监督管理措施。

2020 年 2 月 14 号，中国人民银行向华泰证券股份有限公司出具行政处罚通知书（银罚字（2020）23 号），指出公司存在以下问题：1. 未按规定履行客户身份识别义务；2. 未按规定报送可疑交易报告；3. 与身份不明的客户进行交易。人民银行决定对华泰证券处以 1010 万元罚款。

2020 年 3 月 17 日，深圳证监局向华泰证券股份有限公司深圳红荔路证券营业部出具《深圳证监局关于对华泰证券深圳红荔路证券营业部采取出具警示函行政监管措施的决定》[2020]19 号，指出该营业部存在以下问题：一是在 2018 年 5 月至 2019 年 3 月期间，该营业部监测发现客户邓某某有 14 个交易日出现交易异常预警，但仅通过电话询问和发送提示短信即排除可疑；二是邓某某在电话回访中已表示将账户交他人操作，但该营业部未充分了解实际操作人、实际受益人、账户资金来源归属等重要信息并防范风险；三是未审慎核查交易异常预警的关联客户，未及时上报重大异常行为。上述行为不符合《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第六条的有关规定。按照《证券公司和证券投资基金管理公司合规管理办法》第三十二条的有关规定，深圳证监局决定对该营业部采取出具警示函的行政监管措施。该营业部应进一步加强客户交易监控和预警处置工作，完善相关工作流程，勤勉尽责核实账户异常，防止为客户违规从事交易活动提供便利。

2019 年 8 月 19 日，广东证监局向广发银行股份有限公司出具《行政监管措施决定书（2019）60 号》，指出公司存在以下问题：（一）基金销售业务部门负责人未取得基金从业资格；（二）部分从事基金销售业务的人员未取得基金从业资格；（三）部分从事基金核算业务的人员未取得基金

从业资格。上述行为分别违反了《证券投资基金销售管理办法》第十条、第五十七条和《证券投资基金托管业务管理办法》第八条的规定。根据《证券投资基金销售管理办法》第八十七条和《证券投资基金托管业务管理办法》第三十八条的规定，广东证监局决定对广发银行采取责令改正的监管措施，要求完成整改并提交书面整改报告。

2019 年 12 月 27 日，中国银保监会向交通银行股份有限公司出具《行政处罚决定书（银保监罚决字〔2019〕24 号）》，指出公司存在以下问题：（一）授信审批不审慎；（二）总行对分支机构管控不力承担管理责任。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项的规定和相关内控管理和业务审慎经营规则，银保监会决定对交通银行采取罚款合计 150 万元的处罚措施。

2020 年 4 月 20 日，中国银保监会向交通银行股份有限公司出具《行政处罚决定书（银保监罚决字〔2020〕6 号）》，指出交通银行监管标准化数据（EAST）系统数据质量及数据报送存在以下违法违规行为：（一）理财产品数量漏报；（二）资金交易信息漏报严重；（三）贸易融资业务漏报；（四）信贷业务担保合同漏报；（五）分户账明细记录应报未报；（六）分户账账户数据应报未报；（七）关键且应报字段漏报或填报错误。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十七条和相关内控管理、审慎经营规定，银保监会决定对交通银行采取罚款合计 260 万元的处罚措施。

相关处罚措施对华泰证券、广发银行和交通银行的正常经营影响可控，本基金投资 20 华泰证券 CP006、20 广发银行 CD108 和 20 交通银行 CD020 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

### 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	12,098,581.78
4	应收申购款	21,686,296.33
5	其他应收款	694,766.67
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	34,479,644.78

### 7.9.4 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。

## § 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
宝盈货币 A	1,001,159	3,164.24	13,303,406.20	0.42%	3,154,607,758.22	99.58%
宝盈货币 B	42	59,604,482.04	2,478,400,457.18	99.00%	24,987,788.29	1.00%
合计	1,001,201	5,664.50	2,491,703,863.38	43.94%	3,179,595,546.51	56.06%

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。

## 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	502,812,574.58	8.87%
2	信托类机构	304,925,615.11	5.38%
3	银行类机构	300,005,568.69	5.29%
4	保险类机构	209,394,389.92	3.69%
5	保险类机构	202,653,433.60	3.58%
6	基金类机构	184,732,525.85	3.26%
7	保险类机构	100,149,680.09	1.77%
8	其他机构	95,000,000.00	1.68%
9	其他机构	84,518,339.15	1.49%
10	银行类机构	80,000,000.00	1.41%

## 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	宝盈货币 A	3,631,577.19	0.1146%
	宝盈货币 B	0.00	0.0000%
	合计	3,631,577.19	0.0640%

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）。

## 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	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

## § 9 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	1,517,372,869.90	2,732,614,439.04
本报告期基金总申购份额	57,706,836,806.35	1,999,761,866.21
减：本报告期基金总赎回份额	56,056,298,511.83	2,228,988,059.78
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	3,167,911,164.42	2,503,388,245.47

## § 10 重大事件揭示

## 10.1 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。

## 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

报告期内基金管理人、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

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。

## 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遵循本基金《基金合同》中规定的投资策略，未发生显著改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

## 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

## 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	
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。
- (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。

### 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券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
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	10,128,901.37	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 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。

### 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	关于宝盈货币市场证券投资基金开展直销渠道转换费率优惠活动的公告	上海证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020年6月30日
2	宝盈基金管理有限公司关于新增中国人寿保险股份有限公司为旗下基金代销机构及参与相	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网	2020年6月24日

	关费率优惠活动的公告	站	
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加渤海证券股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 6 月 3 日
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中信证券华南股份有限公司相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 28 日
5	宝盈货币市场证券投资基金 2020 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 22 日
6	宝盈基金管理有限公司旗下 34 只基金 2020 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 22 日
7	宝盈货币市场证券投资基金 2019 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 11 日
8	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 4 月 11 日
9	宝盈基金管理有限公司关于新增泛华普益基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 4 月 10 日
10	宝盈基金管理有限公司关于新增嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 31 日
11	宝盈基金管理有限公司关于延期披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 25 日
12	宝盈基金管理有限公司关于新增大连网金基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 3 月 24 日
13	宝盈货币市场证券投资基金 2019 年第 4 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2020 年 1 月 17 日
14	宝盈基金管理有限公司旗下 31 只基金 2019 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2020 年 1 月 17 日

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 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。

## 11.2 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。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的文件。

《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》。

《宝盈货币市场证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

### 12.3 查阅方式

上述备查文件文本分别存放在基金管理人和基金托管人的办公场所，在办公时间内基金持有人可免费查阅。

宝盈基金管理有限公司

2020 年 8 月 31 日