

**宝盈货币市场证券投资基金**  
**2011 年年度报告**  
**2011 年 12 月 31 日**

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：二〇一二年三月二十八日

## § 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2012 年 3 月 27 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。

普华永道中天会计师事务所有限公司为基金财务出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1	重要提示及目录.....	1
1.1	重要提示.....	1
1.2	目录.....	2
§ 2	基金简介.....	4
2.1	基金基本情况.....	4
2.2	基金产品说明.....	4
2.3	基金管理人和基金托管人.....	4
2.4	信息披露方式.....	5
2.5	其他相关资料.....	5
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	5
3.1	主要会计数据和财务指标.....	5
3.2	基金净值表现.....	6
3.3	自基金合同生效以来基金的利润分配情况.....	9
§ 4	管理人报告.....	9
4.1	基金管理人及基金经理情况.....	9
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.....	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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§ 5	托管人报告.....	13
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2	托管人对报告期内本基金运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§ 6	审计报告.....	14
6.1	管理层对财务报表的责任.....	14
6.2	注册会计师的责任.....	14
6.3	审计意见.....	15
§ 7	年度财务报表.....	15
7.1	资产负债表.....	15
7.2	利润表.....	17
7.3	所有者权益（基金净值）变动表.....	18
7.4	报表附注.....	19
§ 8	投资组合报告.....	36
8.1	期末基金资产组合情况.....	36
8.2	债券回购融资情况.....	36
8.3	基金投资组合平均剩余期限.....	37
8.4	期末按债券品种分类的债券投资组合.....	38
8.5	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

8.6	“影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	39
8.7	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	39
8.8	投资组合报告附注	39
§ 9	基金份额持有人信息	40
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	40
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	40
§ 10	开放式基金份额变动	40
§ 11	重大事件揭示	41
11.1	基金份额持有人大会决议	41
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	41
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
11.4	基金投资策略的改变	41
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	42
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	42
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	42
11.9	其他重大事件	43
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	43
§ 13	备查文件目录	44
13.1	备查文件目录	44
13.2	存放地点	44
13.3	查阅方式	44

## § 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	
交易代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 5 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	259,677,499.02 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	85,719,798.50 份	173,957,700.52 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	活期存款利率(税后)。
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	孙胜华	尹东
	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853
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	深圳市深南路6008号特区报业大厦1501	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	518034	100033
法定代表人	李建生	王洪章

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所有限公司	上海市浦东新区陆家嘴环路1318号星展银行大厦6楼
注册登记机构	宝盈基金管理有限公司	深圳市深南路6008号特区报业大厦1501

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2011 年		2010 年		2009 年 8 月 5 日（基金合同生效日）至 2009 年 12 月 31 日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
本期已实现收益	1,945,414.68	3,640,779.68	457,204.61	1,809,646.43	520,637.25	783,323.49
本期利润	1,945,414.68	3,640,779.68	457,204.61	1,809,646.43	520,637.25	783,323.49
本期基金份额净值收益率	3.1654%	3.4143%	1.5283%	1.7733%	0.4013%	0.4998%
3.1.2 期末数据和指标	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期末基金资产净值	85,719,798.50	173,957,700.52	99,653,274.69	303,482,665.56	151,132,620.84	1,269,149,125.33
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000

值						
3.1.3 累计期末	2011 年末		2010 年末		2009 年末	
指标	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金份额累计净值收益率	5.1624%	5.7743%	1.9357%	2.2820%	0.4013%	0.4998%

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。

5、本基金合同生效日为 2009 年 8 月 5 日。

## 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. 宝盈货币 A

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
过去三个月	0.9640%	0.0151%	0.1260%	0.0000%	0.8380%	0.0151%
过去六个月	1.6805%	0.0108%	0.2521%	0.0000%	1.4284%	0.0108%
过去一年	3.1654%	0.0145%	0.4697%	0.0001%	2.6957%	0.0144%
自基金合同生效起至今	5.1624%	0.0147%	0.9767%	0.0002%	4.1857%	0.0145%

#### 2. 宝盈货币 B

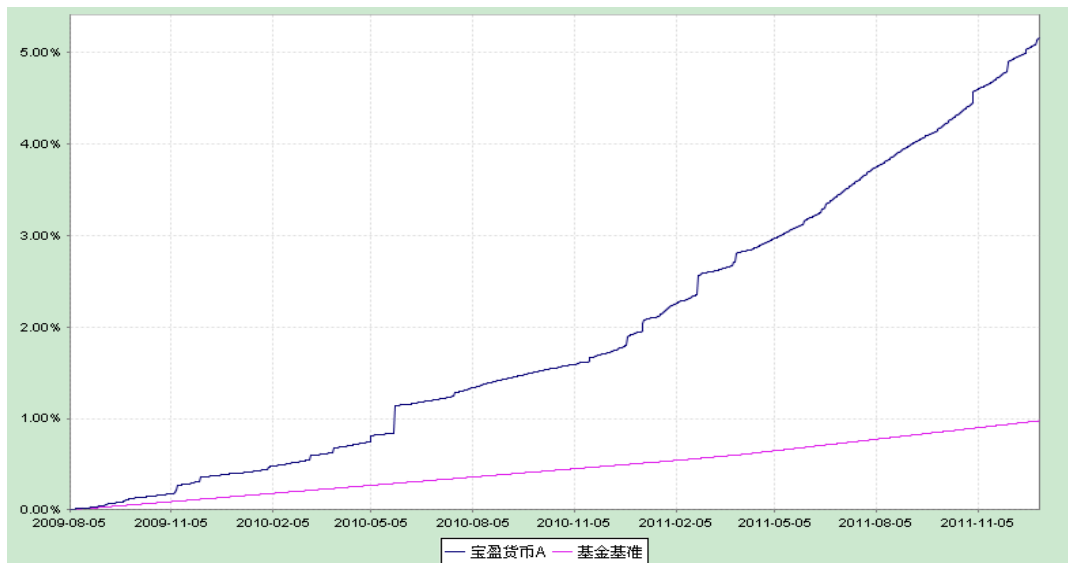
阶段	份额净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.0246%	0.0151%	0.1260%	0.0000%	0.8986%	0.0151%
过去六个月	1.8037%	0.0108%	0.2521%	0.0000%	1.5516%	0.0108%
过去一年	3.4143%	0.0145%	0.4697%	0.0001%	2.9446%	0.0144%
自基金合同生效起至今	5.7743%	0.0147%	0.9767%	0.0002%	4.7976%	0.0145%

### 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

宝盈货币市场证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2009 年 8 月 5 日至 2011 年 12 月 31 日)

#### 1、宝盈货币 A

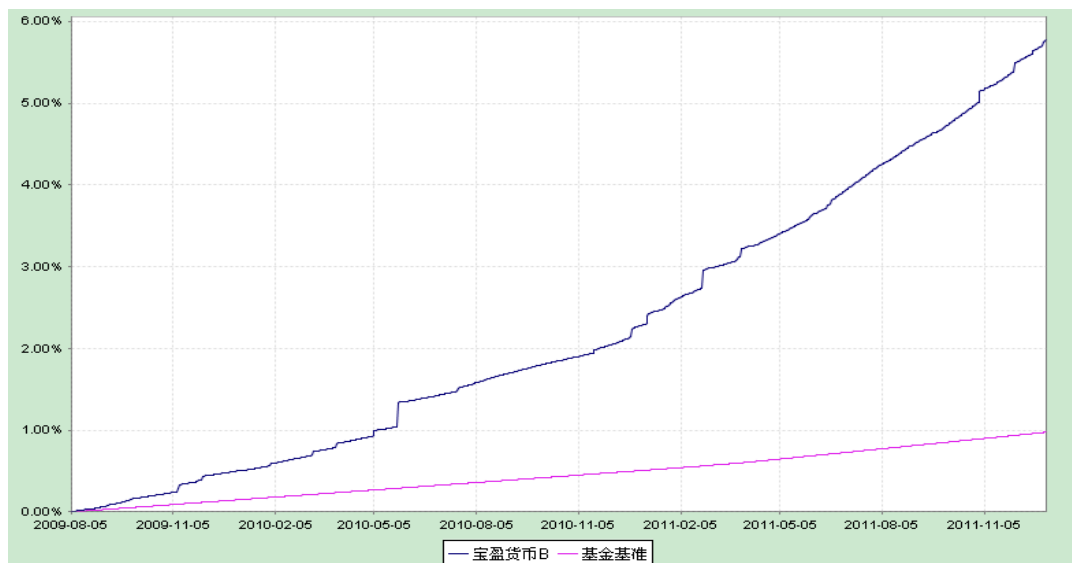
(2009 年 8 月 5 日至 2011 年 12 月 31 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

#### 2、宝盈货币 B

(2009 年 8 月 5 日至 2011 年 12 月 31 日)



注：按基金合同规定，本基金自基金合同生效之日起的 6 个月内为建仓期。建仓期结束时



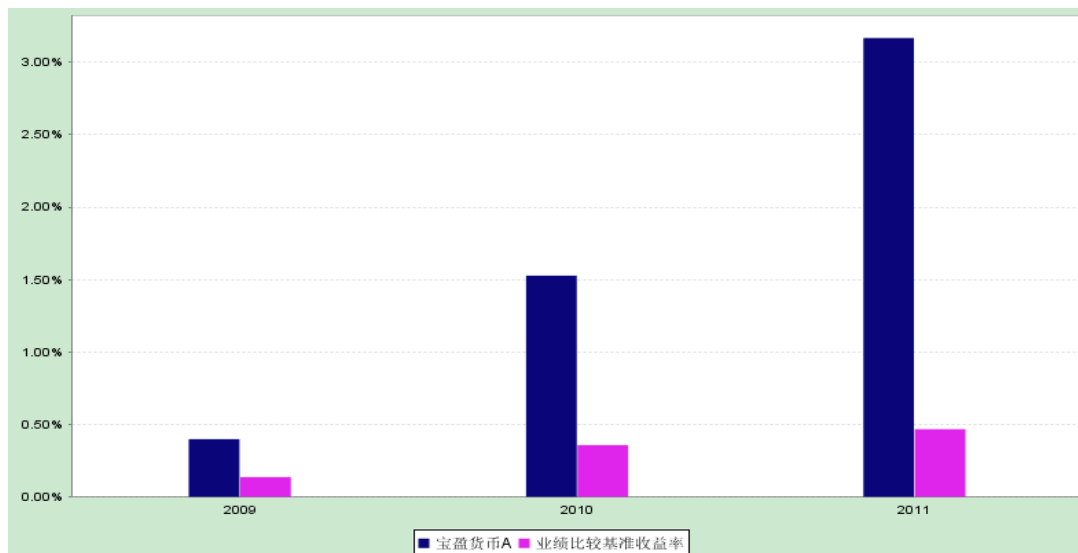
本基金的各项资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

#### 宝盈货币市场证券投资基金

合同生效日以来净值收益率与业绩比较基准收益率的对比图

##### 1、宝盈货币 A

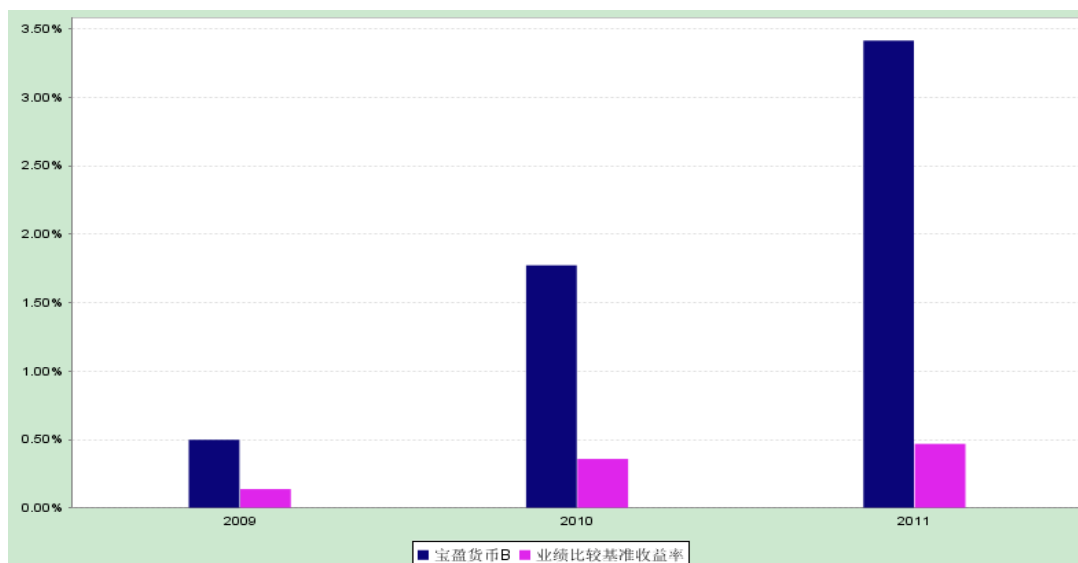


注：1、宝盈货币 A 基金合同生效日为 2009 年 8 月 5 日，合同生效不足五年；

2、本基金合同生效当年，基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较是按照基金合同生效当年实际存续期计算，不按照整个自然年度进行折算；

3、本柱状图显示的 2009 年的宝盈货币 A 收益率和业绩比较基准收益率从 2009 年 8 月 5 日到 2009 年 12 月 31 日之间的收益率。

##### 2、宝盈货币 B



- 注：1、宝盈货币 B 基金合同生效日为 2009 年 8 月 5 日，合同生效不足五年；
- 2、本基金合同生效当年，基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较是按照基金合同生效当年实际存续期计算，不按照整个自然年度进行折算；
- 3、本柱状图显示的 2009 年的宝盈货币 B 收益率和业绩比较基准收益率从 2009 年 8 月 5 日到 2009 年 12 月 31 日之间的收益率。

### 3.3 自基金合同生效以来基金的利润分配情况

#### 1、宝盈货币 A

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回 款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配合 计	备注
2011	1,927,498.52	-	17,916.16	1,945,414.68	-
2010	455,962.93	-	1,241.68	457,204.61	-
2009	518,584.33	-	2,052.92	520,637.25	-
合计	2,902,045.78	-	21,210.76	2,923,256.54	-

#### 2、宝盈货币 B

金额单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎回 款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润分配合 计	备注
2011	3,606,693.83	-	34,085.85	3,640,779.68	-
2010	1,821,240.75	-	-11,594.32	1,809,646.43	-
2009	760,471.37	-	22,852.12	783,323.49	-
合计	6,188,405.95	-	45,343.65	6,233,749.60	-

## § 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。公司目前管理基金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货币、宝盈中证 100 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		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理兼固定收益部总监	2009-08-06	-	8 年	陈若劲，女，1971 年生，香港中文大学金融 MBA。曾在第一创业证券有限责任公司固定收益部从事债券投资、研究及交易等工作，2008 年 4 月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。现同时兼任宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、固定收益部总监。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

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 2011 年 12 月 31 日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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。经检查，公平交易制度执行情况良好。本报告期内，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，无损害组合持有人利益的行为。

#### 4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较

本投资组合与管理人旗下的其他投资组合的投资风格存在较大的差异。由于投资风格的差异，本基金投资组合的业绩与管理人旗下其它组合的投资业绩不具有可比性。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2011 年上半年，通胀压力高企，央行持续收紧货币政策，累计六次上调存款准备金率，三次加息。下半年，随着海外经济增长不确定性加大，以及前期紧缩政策逐渐发挥作用，经济增速有所放缓，但由于通胀水平仍居高不下，央行仍维持稳健的货币政策，只在 11 月份下调 1 次存款准备金率以对冲公开市场到期资金和外汇占款大幅减少对市场流动性紧张的负面影响。

报告期内，由于货币政策基调基本以紧缩为主，货币市场资金利率中枢水平较前年有明显提高。简单算术平均看，2010 年银行间 1 天回购利率、7 天回购利率均值为 1.72% 和 2.14%，2011 年银行间 1 天回购利率、7 天回购利率均值为 3.28% 和 4.04%，分别大幅上行 156bp 和 190bp。

报告期内，央票收益率先上后下，上半年在政策收紧和资金利率上行的带动下，央票收益率持续走高，3 个月央票和 1 年央票收益率在年中一度达到 3.72% 和 4.05% 的水平，较年初大幅上行 63bp 和 69bp。下半年，随着经济增速放缓，以及市场对政策放松预期，3 个月央票和 1 年央票收益率又有所回落，到年末较年中高点下行 28bp 和 58bp。信用产品收益率走势则受信用风险加大的担忧，AAA 短融和 AA 短融的信用利差持续扩大。

报告期内，基于对全年货币市场资金面总体保持偏紧状态的判断，我们维持以 shibor 浮息债和短融券为主的组合，并择机增加银行协议存款配置，以提高组合的收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

货币 A:

本基金在本报告期内净值增长率是 3.1654%，同期业绩比较基准增长率是 0.4697%。

货币 B:

本基金在本报告期内净值增长率是 3.4143%，同期业绩比较基准增长率是 0.4697%。

#### 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 2012 年，我们认为经济增长和通货膨胀在上半年仍将处于下降周期，而本轮经济下滑很大程度上缘于通胀压力下政府主动采取持续紧缩的调控措施。随着经济增长下行，通胀压力减轻，在“稳增长”的基调下，未来货币政策将逐渐趋于宽松。2012 年上半年，经济增长有望触底回升，经济出现硬着陆的可能性很低，而通胀压力或在 2012 年下半年重新显现。

随着紧缩货币政策逐渐趋于宽松，银行间资金面偏紧态势有望改善，资金利率中枢水平将逐步下行，从而对债券市场收益率构成支撑。经济基本面的好转，也将在一定程度上缓解市场对于信用风险的担忧，前期信用利差持续扩大的信用产品或将迎来较好的投资机会。而银行由于存贷比限制放贷能力，吸存压力依然较大，预计银行协议存款利率仍将居高不下。

基于以上判断，我们将择机减持短久期 shibor 浮息债，增加银行协议存款配置，同时谨慎选择信用资质良好的短融券，以提高组合收益率。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，公司监察稽核部门通过加强对基金投资交易业务的日常投资监控、交易流程检查、注册登记、客户服务等业务进行日常跟踪检查等工作，不断加强和完善对投资交易的事前、事中和事后控制，并定期出具专项监察报告及合规性报告等，对基金投资运作的合规性情况等总结和报告。

通过以上工作，在本报告期内本基金运作过程中未发生关联交易、内幕交易，也不存在本基金管理人管理的各基金之间的违规交叉交易，基金运作整体合法合规。

本基金管理人将继续坚持一贯的内部控制理念，提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金持有人的合法权益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照新会计准则、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。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。基金托管人负责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工作小组，估值工作小组由本基金管理人的总经理任小组长，由投资部、研究部、金融工程部、基金事务部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。投资部、研究部负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和程序进行评价；金融工程部负责对估值模型及方法进行筛选，选择最具适用性的估值模型及参数，并负责估值模型的选择及测算；基金事务部负责进行日常估值，并与托管行的估值结果核对一致；监察稽核部负责审核估值政策和程序的一致性，监督估值委员会工作流程中的风险控制，并负责估值调整事项的信息披露工作。

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服务。

#### 4.8 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。

### § 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运作合规守信、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 1,945,414.68 元，B 类 3,640,779.68 元。

## 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## § 6 审计报告

普华永道中天审字(2012)第 20693 号

宝盈货币市场证券投资基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的宝盈货币市场证券投资基金(以下简称“宝盈货币市场基金”)的财务报表，包括 2011 年 12 月 31 日的资产负债表、2011 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。

### 6.1 管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是宝盈货币市场基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：

(1) 按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映；

(2) 设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

### 6.2 注册会计师的责任

我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计

师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。

我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

### 6.3 审计意见

我们认为，上述宝盈货币市场基金的财务报表在所有重大方面按照按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了宝盈货币市场基金 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天会计师事务所有限公司 注册会计师 汪棣 单峰

上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

2012-03-23

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

报告截止日：2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	127,997,725.62	6,317,023.22
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	90,401,076.23	389,140,817.78
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-



债券投资		90,401,076.23	389,140,817.78
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	40,000,180.00	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,238,116.28	1,651,190.82
应收股利		-	-
应收申购款		321,181.84	155,726,053.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		259,958,279.97	552,835,085.67
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2011年12月31日</b>	<b>上年度末 2010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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	149,530,928.73
应付赎回款		42,751.72	5,102.29
应付管理人报酬		62,681.64	61,569.52
应付托管费		18,994.45	18,657.41
应付销售服务费		23,001.17	7,963.86
应付交易费用	7.4.7.7	12,023.43	5,806.97
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		66,554.41	14,552.40
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	54,774.13	54,564.24
负债合计		280,780.95	149,699,145.42
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	259,677,499.02	403,135,940.25
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		259,677,499.02	403,135,940.25
负债和所有者权益总计		259,958,279.97	552,835,085.67

注：报告期截止日 2011 年 12 月 31 日，宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 85,719,798.50 份。宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 173,957,700.52 份。宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金和宝盈货币市场证券投资基金 B 类基金的合计份额总数 259,677,499.02 份。

## 7.2 利润表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2011年1月1日至2011年12 月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12 月31日
<b>一、收入</b>		<b>6,831,139.98</b>	<b>3,216,710.73</b>
1. 利息收入		5,856,413.96	2,541,619.09
其中：存款利息收入	7.4.7.11	241,193.97	320,689.87
债券利息收入		4,365,401.21	2,062,585.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,249,818.78	158,343.96
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		974,726.02	675,091.64
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	974,726.02	675,091.64
资产支持证券投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
<b>减：二、费用</b>		<b>1,244,945.62</b>	<b>949,859.69</b>
1. 管理人报酬		648,989.16	514,089.70
2. 托管费		196,663.47	158,209.11
3. 销售服务费		200,124.80	97,302.23
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		11,229.37	2,868.78
其中：卖出回购金融资产支出		11,229.37	2,868.78
6. 其他费用	7.4.7.19	187,938.82	177,389.87
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>5,586,194.36</b>	<b>2,266,851.04</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>5,586,194.36</b>	<b>2,266,851.04</b>

## 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2011 年 1 月 1 日至 2011 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	403,135,940.25	-	403,135,940.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	5,586,194.36	5,586,194.36
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）	-143,458,441.23	-	-143,458,441.23
其中：1. 基金申购款	2,986,343,838.03	-	2,986,343,838.03
2. 基金赎回款	-3,129,802,279.26	-	-3,129,802,279.26
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）	-	-5,586,194.36	-5,586,194.36
五、期末所有者权益（基金净值）	259,677,499.02	-	259,677,499.02
项目	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,420,281,746.17	-	1,420,281,746.17
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,266,851.04	2,266,851.04
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）	-1,017,145,805.92	-	-1,017,145,805.92
其中：1. 基金申购款	1,598,031,057.41	-	1,598,031,057.41
2. 基金赎回款	-2,615,176,863.33	-	-2,615,176,863.33
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）	-	-2,266,851.04	-2,266,851.04
五、期末所有者权益（基金净值）	403,135,940.25	-	403,135,940.25

报告附注为财务报表的组成部分

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理公司负责人：汪钦，主管会计工作负责人：胡坤，会计机构负责人：何瑜

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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)。

### 7.4.2 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 日颁布的《企业会计准则—基本准则》

和 38 项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会公告[2010]5 号《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会于 2007 年 5 月 15 日颁布的《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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### **7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本基金 2011 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 2011 年 12 月 31 日的财务状况以及 2011 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### **7.4.4 重要会计政策和会计估计**

##### **7.4.4.1 会计年度**

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### **7.4.4.2 记账本位币**

本基金的记账本位币为人民币。

##### **7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类**

###### **(1) 金融资产的分类**

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### **(2) 金融负债的分类**

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

##### **7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,于交易日按公允价值在资产

负债表内确认。对于取得债券投资支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，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；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少,以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

#### 7.4.4.8 损益平准金

不适用。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金每一类别的基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有申请当日的分红权益,而赎回的基金份额享有申请当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目,每月以红利再投资方式集中支付累计收益。本基金的 A、B 类基金份额所对应的可分配收益可能有所不同。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条

件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

##### 重要会计估计及其关键假设

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 基金买卖债券的差价收入暂免征营业税和企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，由发行债券的企业在向基金派发利息时代扣代缴20%的个人所得税，暂不征收企业所得税。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日



活期存款	2,997,725.62	6,317,023.22
定期存款	-	-
其他存款	125,000,000.00	-
合计	127,997,725.62	6,317,023.22

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。

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2011年12月31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	90,401,076.23	90,648,000.00	246,923.77	0.0951
	合计	90,401,076.23	90,648,000.00	246,923.77	0.0951
项目		上年度末 2010年12月31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	389,140,817.78	389,216,000.00	75,182.22	0.0186
	合计	389,140,817.78	389,216,000.00	75,182.22	0.0186

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

不适用。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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 2011年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售资产	40,000,180.00	-
合计	40,000,180.00	-
项目	上年度末 2010年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间买入返售资产	-	-
合计	-	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度报告期末无余额。

## 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应收活期存款利息	2,518.74	8,191.31
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	41,980.10	-
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	1,178,848.08	1,642,975.50
应收买入返售证券利息	12,213.98	-
应收申购款利息	2,555.38	24.01
其他	-	-
合计	1,238,116.28	1,651,190.82

## 7.4.7.6 其他资产

本报告期末及上年度报告期末无余额。

## 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	12,023.43	5,806.97
合计	12,023.43	5,806.97

## 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
预提费用	54,500.00	54,500.00
应付补差费	274.13	64.24
合计	54,774.13	54,564.24

## 7.4.7.9 实收基金

## 宝盈货币 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	99,653,274.69	99,653,274.69

本期申购	1,266,213,657.41	1,266,213,657.41
本期赎回（以“-”号填列）	-1,280,147,133.60	-1,280,147,133.60
本期末	85,719,798.50	85,719,798.50

**宝盈货币 B**

金额单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	303,482,665.56	303,482,665.56
本期申购	1,720,130,180.62	1,720,130,180.62
本期赎回（以“-”号填列）	-1,849,655,145.66	-1,849,655,145.66
本期末	173,957,700.52	173,957,700.52

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

**7.4.7.10 未分配利润****宝盈货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	1,945,414.68	-	1,945,414.68
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	-1,945,414.68	-	-1,945,414.68
本期末	-	-	-

**宝盈货币 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
上年度末	-	-	-
本期利润	3,640,779.68	-	3,640,779.68
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	-3,640,779.68	-	-3,640,779.68
本期末	-	-	-

**7.4.7.11 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
活期存款利息收入	192,772.83	290,064.07
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	41,980.10	-
结算备付金利息收入	-	778.13
其他	6,441.04	29,847.67
合计	241,193.97	320,689.87

**7.4.7.12 股票投资收益**

不适用。

**7.4.7.13 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
卖出债券（债券到期兑付）成交总额	803,875,853.49	636,585,668.96
减：卖出债券（债券到期兑付）成本总额	797,209,882.20	630,364,768.23
减：应收利息总额	5,691,245.27	5,545,809.09
债券投资收益	974,726.02	675,091.64

**7.4.7.14 衍生工具收益**

不适用。

**7.4.7.15 股利收益**

不适用。

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

本报告期及上年度报告可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.17 其他收入**

本报告期及上年度报告可比期间无其他收入。

**7.4.7.18 交易费用**

本报告期及上年度报告可比期间无交易费用。

**7.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2011年1月1日至2011年12月31日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00

银行费用	19,938.82	9,389.87
债券托管账户维护费用	18,000.00	18,000.00
合计	187,938.82	177,389.87

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

本基金无需要披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 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。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	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(以下简称“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
成都工业投资集团有限公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	648,989.16	514,089.70
其中：支付销售机构的客户维护费	79,028.33	30,193.92

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。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2011年1月1日至2011年12月31日	2010年1月1日至2010年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	196,663.47	158,209.11

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.1\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.3 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 2011年1月1日至2011年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	83,882.51	3,523.06	87,405.57
宝盈基金管理有限公司	15,216.75	4,414.43	19,631.18
合计	99,099.26	7,937.49	107,036.75
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币A	宝盈货币B	合计
中国建设银行	51,751.27	1,562.71	53,313.98
宝盈基金管理有限公司	5,075.86	7,307.82	12,383.68
合计	56,827.13	8,870.53	65,697.66

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：

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 A 类基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}。$$

$$\text{日销售服务费} = \text{前一日 B 类基金资产净值} \times 0.01\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2011年1月1日至2011年12月31日					
	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	-	49,776,850.22	-	-	-	-
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日					
	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	-	19,966,037.36	-	-	19,700,000.00	2,051.51

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末及上年度报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

##### 7.4.10.5 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 2011年1月1日至2011年12月31日		上年度可比期间 2010年1月1日至2010年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	77,997,725.62	218,164.05	6,317,023.22	290,064.07

注：1、本基金本期末存放于基金托管人中国建设银行的活期存款余额为 2,997,725.62 元，按银行同业利率计息。

2、本基金本期末存放于基金托管人中国建设银行的协议存款余额为 75,000,000.00 元，按约定利率计息。

##### 7.4.10.6 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。

##### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 1、宝盈货币 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
1,927,498.52	-	17,916.16	1,945,414.68	-

##### 2、宝盈货币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
3,606,693.83	-	34,085.85	3,640,779.68	-

#### 7.4.12 期末（2011 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 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。

##### 7.4.12.2 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。

#### **7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

##### **7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

##### **7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2011 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。

#### **7.4.13 金融工具风险及管理**

##### **7.4.13.1 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。

##### **7.4.13.2 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同责任，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。



本公司在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行股份有限公司，因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有托管资格的上海银行股份有限公司，与该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，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。

#### 7.4.13.2.1 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 2011年12月31日	上年末 2010年12月31日
A-1	40,012,555.53	109,801,091.23
A-1 以下	-	-
未评级	-	249,388,308.01
合计	40,012,555.53	359,189,399.24

注：未评级债券为央行票据。

#### 7.4.13.2.2 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 2011年12月31日	上年末 2010年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	50,388,520.70	29,951,418.54
合计	50,388,520.70	29,951,418.54

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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。

针对投资品种变现的流动性风险,本基金的基金管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资于定期存款的比例不得超过基金资产净值的 30%,投资于一家公司发行的短期企业债券及短期融资券的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%。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 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。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,正回购上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值以及基金资产净值的 20%。

本基金所持有的全部金融负债的合约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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

本基金的基金管理人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。

本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种,因此存在相应的利率风险。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位:人民币元

本期末 2011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	127,997,725.62	-	-	-	-	127,997,725.62
交易性金融资产	90,401,076.23	-	-	-	-	90,401,076.23

买入返售金融资产	40,000,180.00	-	-	-	-	40,000,180.00
应收利息	-	-	-	-	1,238,116.28	1,238,116.28
应收申购款	-	-	-	-	321,181.84	321,181.84
资产总计	258,398,981.85	-	-	-	1,559,298.12	259,958,279.97
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	42,751.72	42,751.72
应付管理人报酬	-	-	-	-	62,681.64	62,681.64
应付托管费	-	-	-	-	18,994.45	18,994.45
应付销售服务费	-	-	-	-	23,001.17	23,001.17
应付交易费用	-	-	-	-	12,023.43	12,023.43
应付利润	-	-	-	-	66,554.41	66,554.41
其他负债	-	-	-	-	54,774.13	54,774.13
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	-	280,780.95	280,780.95
利率敏感度缺口	258,398,981.85	-	-	-	1,278,517.17	259,677,499.02
上年度末 2010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	6,317,023.22	-	-	-	-	6,317,023.22
交易性金融资产	369,282,672.07	19,858,145.71	-	-	-	389,140,817.78
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	1,651,190.82	1,651,190.82
应收申购款	-	-	-	-	155,726,053.85	155,726,053.85
资产总计	375,599,695.29	19,858,145.71	-	-	157,377,244.67	552,835,085.67
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	5,102.29	5,102.29
应付管理人报酬	-	-	-	-	61,569.52	61,569.52
应付托管费	-	-	-	-	18,657.41	18,657.41
应付销售服务费	-	-	-	-	7,963.86	7,963.86
应付交易费用	-	-	-	-	5,806.97	5,806.97
应付利润	-	-	-	-	14,552.40	14,552.40
其他负债	-	-	-	-	54,564.24	54,564.24

应付证券清算款	-	-	-	-	149,530,928.73	149,530,928.73
负债总计	-	-	-	-	149,699,145.42	149,699,145.42
利率敏感度缺口	375,599,695.29	19,858,145.71	-	-	7,678,099.25	403,135,940.25

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。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2011年12月31日	上年度末 2010年12月31日
	市场利率下降25个基点	87,207.76	160,000.00
	市场利率上升25个基点	-86,909.74	-160,000.00

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (b) 以公允价值计量的金融工具

##### (i) 金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上（未经调整）的报价。

第二层级：直接（比如取自价格）或间接（比如根据价格推算的）可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值（不可观察输入值）。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2011 年 12 月 31 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第二层级的余额为 90,401,076.23 元，无属于第一或第三层级的余额（2010 年 12 月 31 日：第一层级 389,140,817.78 元，无属于第一或第三层级的余额）。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iv) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	90,401,076.23	34.78
	其中：债券	90,401,076.23	34.78
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	40,000,180.00	15.39
	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	127,997,725.62	49.24
4	其他各项资产	1,559,298.12	0.60
	合计	259,958,279.97	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.20
	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

金额单位：人民币元

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2011-01-05	33.79	巨额赎回	1 个交易日

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	130
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	11

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

序号	发生日期	平均剩余期限 (天数)	原因	调整期
1	2011-07-13	128	大额赎回	2011-07-20
2	2011-07-14	128	大额赎回	2011-07-20
3	2011-07-15	130	大额赎回	2011-07-20
4	2011-07-18	124	大额赎回	2011-07-20
5	2011-07-19	127	大额赎回	2011-07-20

注：根据基金合同规定，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。

因证券市场波动、上市公司合并、基金规模变动、股权分置改革中支付对价等基金管理人之外的因素致使基金投资比例不符合合同规定投资比例的，基金管理人应当在 10 个交易日内进行调整。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	26.19	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	-	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	30.96	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—180 天	30.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	11.55	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	99.51	-

#### 8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值 比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	50,388,520.70	19.40
	其中：政策性金融债	50,388,520.70	19.40
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,012,555.53	15.41
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	90,401,076.23	34.81
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.5 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	070211	07 国开 11	500,000	50,388,520.70	19.40
2	1181113	11 浙国贸 CP01	100,000	10,016,692.96	3.86
3	1181192	11 苏垦 CP01	100,000	10,001,823.15	3.85
4	1181194	11 新野 CP01	100,000	10,000,154.71	3.85

5	1181213	11 广新 CP01	100,000	9,993,884.71	3.85
---	---------	------------	---------	--------------	------

### 8.6 “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	57
报告期内偏离度的最高值	0.5256%
报告期内偏离度的最低值	-0.3684%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1741%

### 8.7 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。

### 8.8 投资组合报告附注

#### 8.8.1 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，在其剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

8.8.2 本报告期内 10 国开 36 存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

序号	发生日期	该类浮动债占基金资产净值的比例 (%)	原因	调整期
1	2011-07-13	21.31	大额赎回	2011-07-19
2	2011-07-14	21.75	大额赎回	2011-07-19
3	2011-07-15	21.61	大额赎回	2011-07-19
4	2011-07-16	21.61	大额赎回	2011-07-19
5	2011-07-17	21.61	大额赎回	2011-07-19
6	2011-07-18	21.70	大额赎回	2011-07-19
7	2011-09-20	22.04	大额赎回	2011-09-21

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

#### 8.8.4 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	1,238,116.28
4	应收申购款	321,181.84
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	1,559,298.12

#### 8.8.5 其他需说明的重要事项标题

由于四舍五入的原因，分项与合计项之间可能存在尾差。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
宝盈货币 A	1,309	65,484.95	1,670,841.72	1.95%	84,048,956.78	98.05%
宝盈货币 B	14	12,425,550.04	161,421,914.24	92.79%	12,535,786.28	7.21%
合计	1,323	196,279.29	163,092,755.96	62.81%	96,584,743.06	37.19%

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

2、户均持有的基金份额合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	宝盈货币 A	4,127.21	0.0048%
	宝盈货币 B	0.00	0%
	合计	4,127.21	0.0016%

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）。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	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	99,653,274.69	303,482,665.56
本报告期基金总申购份额	1,266,213,657.41	1,720,130,180.62
减:本报告期基金总赎回份额	1,280,147,133.60	1,849,655,145.66
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	85,719,798.50	173,957,700.52

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内本基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人 2011 年 2 月 9 日发布公告, 经中国建设银行研究决定, 聘任杨新丰为中国建设银行投资托管服务部副总经理(主持工作), 其任职资格已经中国证监会审核批准(证监许可〔2011〕115 号)。解聘罗中涛中国建设银行投资托管服务部总经理职务。本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知, 解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职务。本基金托管人 2011 年 10 月 24 日发布任免通知聘任张军红为中国建设银行投资托管服务部副总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所审计费 50,000 元，目前事务所已连续 3 年为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

## 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

项目	发生日期	偏离度	法定披露	法定披露日
----	------	-----	------	-------

			报刊	期
报告期内偏离度绝对值在0.5%（含）以上	2011-02-24	0.5256%	证券时报	2011-02-26

### 11.9 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	宝盈基金管理有限公司关于宝盈货币市场证券投资基金 2011 年春节假期前暂停申购、转换转入及定期定额投资业务的公告	证券时报	2011-01-28
2	宝盈基金管理有限公司关于宝盈货币市场证券投资基金偏离度绝对值达到/超过 0.5%的公告	证券时报	2011-02-26
3	宝盈基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为基金代销机构的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2011-04-20
4	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中信证券股份有限公司为代销机构的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2011-04-29
5	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金增加中国农业银行股份有限公司为代销机构并办理定期定额投资、转换等业务的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2011-06-23
6	宝盈基金管理有限公司关于开通汇付天天盈账户网上直销业务的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2011-07-22
7	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报	2011-09-29
8	宝盈基金管理有限公司关于新增中信万通证券有限责任公司办理基金定期定额投资业务的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2011-12-07
9	宝盈货币市场证券投资基金 暂停申购、转换转入、定期定额投资公告	证券时报	2011-12-26

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2011 年 10 月 28 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长辞任的公告，根据国家金融工作的需要，郭树清先生已向中国建设银行股份有限公司（“本行”）董事会（“董事会”）提出辞呈，请求辞去本行董事长、执行董事等职务。根据《中华人民共和国公司法》等相关法律法规和本行章程的规定，郭树清先生的辞任自辞呈送达本行董事会之日起生效。

2、2012 年 1 月 16 日，托管人中国建设银行股份有限公司发布关于董事长任职的公告，自 2012 年 1 月 16 日起，王洪章先生就任本行董事长、执行董事。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 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基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市深南大道 6008 号特区报业大厦 15 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

### 13.3 查阅方式

上述备查文件文本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

二〇一二年三月二十八日