

# 宝盈货币市场证券投资基金 2015 年半年度报告

2015 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：2015 年 8 月 27 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2015 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2015 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.....	7
<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.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	10
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.....	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> .....	<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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、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.....	13
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
<b>§ 7 投资组合报告</b> .....	<b>32</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	32
7.2 债券回购融资情况.....	32
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	33
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	33
7.5 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.....	34
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	34
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	34
7.8 投资组合报告附注.....	34
<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>35</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	35
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	36
8.3 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> .....	<b>36</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>36</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	36
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.....	36
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.....	38
<b>§ 11 备查文件目录</b> .....	<b>39</b>
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	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	17,977,589,344.18 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	4,158,351,803.46 份	13,819,237,540.72 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	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。 本基金定位于现金管理的工具，采用活期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准，更能体现本基金良好的流动性与安全性。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

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路 115 号投行大厦 10 层	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	李文众	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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	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
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( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日 )	报告期( 2015 年 1 月 1 日 - 2015 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	96,752,510.42	255,983,431.67
本期利润	96,752,510.42	255,983,431.67
本期净值收益率	2.2413%	2.3630%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末( 2015 年 6 月 30 日 )	
期末基金资产净值	4,158,351,803.46	13,819,237,540.72
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( 2015 年 6 月 30 日 )	
累计净值收益率	22.4026%	24.1505%

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

宝盈货币 A

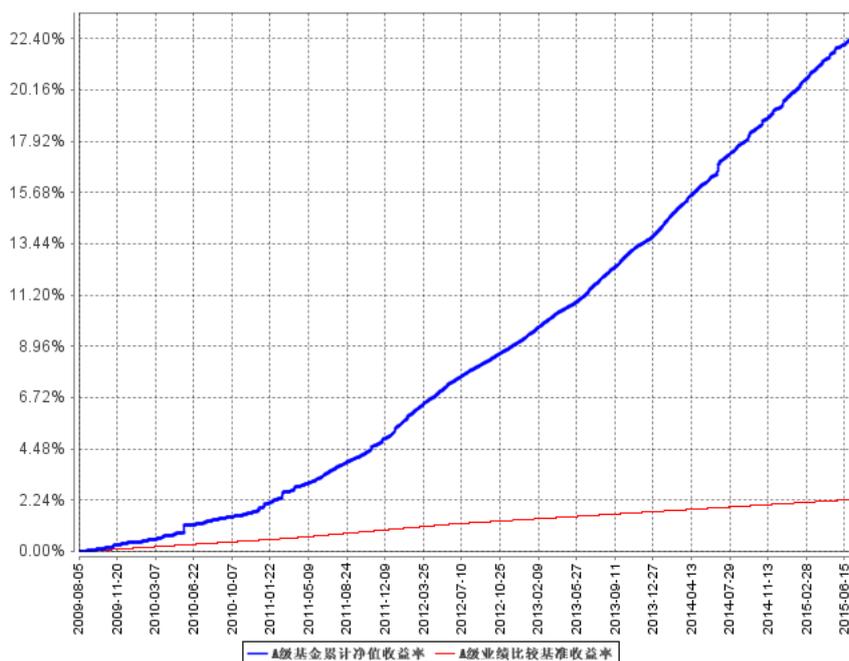
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3282%	0.0112%	0.0288%	0.0000%	0.2994%	0.0112%
过去三个月	1.0282%	0.0135%	0.0873%	0.0000%	0.9409%	0.0135%
过去六个月	2.2413%	0.0108%	0.1736%	0.0000%	2.0677%	0.0108%
过去一年	4.6360%	0.0126%	0.3500%	0.0000%	4.2860%	0.0126%
过去三年	13.7961%	0.0098%	1.0507%	0.0000%	12.7454%	0.0098%
自基金合同生效起至今	22.4026%	0.0125%	2.2704%	0.0002%	20.1322%	0.0123%

宝盈货币 B

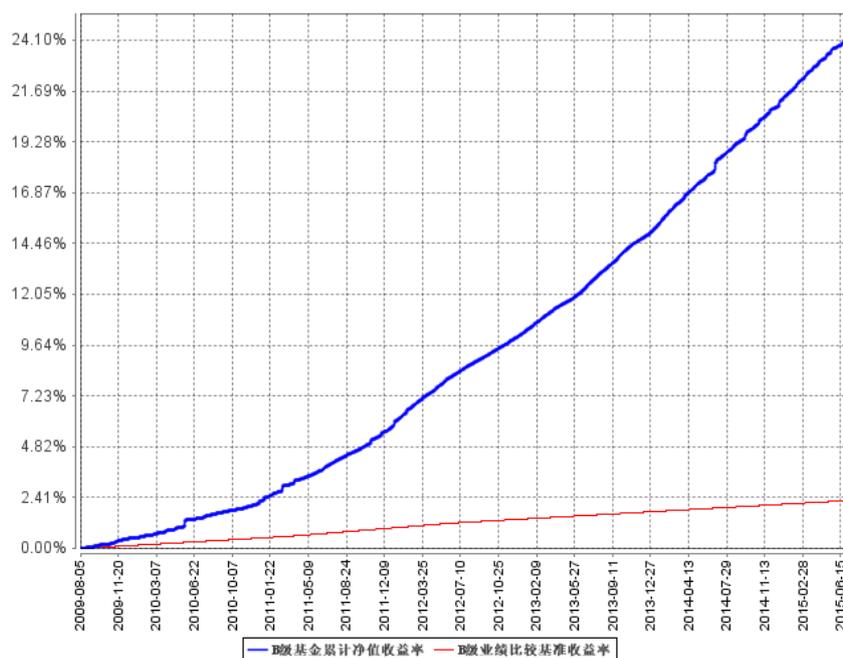
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.3482%	0.0112%	0.0288%	0.0000%	0.3194%	0.0112%
过去三个月	1.0888%	0.0136%	0.0873%	0.0000%	1.0015%	0.0136%
过去六个月	2.3630%	0.0109%	0.1736%	0.0000%	2.1894%	0.0109%
过去一年	4.8874%	0.0126%	0.3500%	0.0000%	4.5374%	0.0126%
过去三年	14.6177%	0.0098%	1.0507%	0.0000%	13.5670%	0.0098%
自基金合同生效起至今	24.1505%	0.0125%	2.2704%	0.0002%	21.8801%	0.0123%

#### 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



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。

## § 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、宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海增长股票、宝盈策略增长股票、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选股票、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、宝盈祥瑞养老混合、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、宝盈祥泰养老混合十七只基金，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		
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、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理、固定收益部总监	2009 年 8 月 5 日	-	12 年	陈若劲女士，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。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
于启明	本基金基金经理、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金基金经理	2012 年 7 月 6 日	2015 年 6 月 13 日	8 年	于启明先生，经济学学士。2007 年 7 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投研秘书（集中交易员）及债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、陈若劲为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写；

2、于启明非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

3、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 2015 年 6 月 30 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，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，宏观经济下行态势依然明显，为托底经济增长，央行持续加大货币政策宽松力度，多次下调存贷款利率、存款准备金率，并通过逆回购、MLF 等操作持续向市场注入流动性；财政政策方面，包括降低购房首付、减免购房税费、加快基础设施项目审批进度等积极措施也接连推出。

报告期内，随着货币政策宽松力度持续加大，市场资金面异常充裕，隔夜和 7 天回购利率均大幅下行，多年来首次跌破 1%和 2%的水平，即使 6 月末传统的机构考核时期，也未对资金面带来过多扰动；协议存款方面，除春节、月末、季末等个别时点外，商业银行对存款需求普遍较低，特别是进入二季度，个别短期限存款品种甚至暂停报价；债券市场方面，随着资金利率的大幅回落，各短券品种收益率整体均大幅下行，报告期内，代表性品种 1 年期 AAA 短融券收益率下行幅度超过 120bp。

报告期内，由于银行协议存款报价较低，我们逐步增加了债券类资产的配置比例，并在个别资金面紧张时期，择机增加协议存款配置。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

货币 A:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 2.2413%，业绩比较基准收益率为 0.1736%。

货币 B:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 2.3630%，业绩比较基准收益率为 0.1736%。

#### 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 2015 年下半年，我们认为宏观经济仍将低位运行，为巩固经济增长，货币政策仍有进一步放松的空间。货币市场方面，在政策呵护下，市场资金面整体将继续维持宽松，同时 IPO 的暂停和权益市场步入调整，也有助于货币市场的平稳运行；债券市场受益于理财资金、打新资金的回流，配置需求增加，收益率仍将有进一步下行的空间。

下半年，我们将密切跟踪权益市场和通胀预期的变化，在保持组合良好流动性基础上，择优参与债券投资，并积极把握资金利率相对高点配置协议存款的机会。

#### 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，由投资部、研究部、固定收益部、专户投资部、量化投资部、基金运营部、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、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、固定收益部、专户投资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；量化投资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；基金运营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。

#### 4.7 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 96,752,510.42 元，B 类 255,983,431.67 元。

### 5.3 托管人对本半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 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：2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,533,825,573.12	2,414,177,304.36
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	18,561,175,026.06	6,831,875,801.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		18,561,175,026.06	6,831,875,801.75
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	300,001,010.00	673,893,250.84
应收证券清算款		163,484,749.51	-
应收利息	6.4.7.5	209,869,129.52	133,570,480.50

应收股利		-	-
应收申购款		557,680,721.27	12,794,757.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	632,855.99	574,522.99
资产总计		21,326,669,065.47	10,066,886,117.89
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014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		3,314,195,842.90	1,214,697,097.95
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		18,657,626.16	7,288,384.56
应付管理人报酬		7,740,543.44	2,616,423.27
应付托管费		2,345,619.26	792,855.54
应付销售服务费		1,038,493.32	620,095.73
应付交易费用	6.4.7.7	1,087,543.29	543,233.52
应交税费		-	-
应付利息		234,682.76	381,012.85
应付利润		3,471,379.88	880,746.57
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	307,990.28	233,365.45
负债合计		3,349,079,721.29	1,228,053,215.44
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	17,977,589,344.18	8,838,832,902.45
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计		17,977,589,344.18	8,838,832,902.45
负债和所有者权益总计		21,326,669,065.47	10,066,886,117.89

注：报告期截止日 2015 年 6 月 30 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 4,158,351,803.46 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 13,819,237,540.72 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 17,977,589,344.18 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2015年1月1日至2015 年6月30日	2014年1月1日至2014 年6月30日

<b>一、收入</b>		421,163,970.08	380,717,528.19
1. 利息收入		283,303,154.80	287,028,627.48
其中：存款利息收入	6.4.7.11	118,251,075.57	125,330,015.05
债券利息收入		157,490,215.87	144,780,260.53
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,561,863.36	16,918,351.90
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		137,860,815.28	93,688,900.71
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	137,860,815.28	93,688,900.71
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>		68,428,027.99	45,363,875.31
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	28,026,052.08	21,281,625.61
2. 托管费	6.4.10.2.2	8,492,743.04	6,448,977.50
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	6,290,754.84	1,778,940.84
4. 交易费用	6.4.7.19	-	-
5. 利息支出		25,435,720.86	15,688,796.07
其中：卖出回购金融资产支出		25,435,720.86	15,688,796.07
6. 其他费用	6.4.7.20	182,757.17	165,535.29
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		352,735,942.09	335,353,652.88
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		352,735,942.09	335,353,652.88

### 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：2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 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)	8,838,832,902.45	-	8,838,832,902.45
二、本期经营活动产生的 基金净值变动数(本 期利润)	-	352,735,942.09	352,735,942.09
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)	9,138,756,441.73	-	9,138,756,441.73
其中: 1. 基金申购款	119,943,790,434.13	-	119,943,790,434.13
2. 基金赎回款	-110,805,033,992.40	-	-110,805,033,992.40
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)	-	-352,735,942.09	-352,735,942.09
五、期末所有者权益 (基金净值)	17,977,589,344.18	-	17,977,589,344.18
	<b>上年度可比期间</b>		
	<b>2014年1月1日至2014年6月30日</b>		
项目	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)	6,578,213,070.73	-	6,578,213,070.73
二、本期经营活动产生 的基金净值变动数(本 期利润)	-	335,353,652.88	335,353,652.88
三、本期基金份额交易 产生的基金净值变动 数 (净值减少以“-”号 填列)	3,109,598,956.94	-	3,109,598,956.94
其中: 1. 基金申购款	46,135,578,010.32	-	46,135,578,010.32
2. 基金赎回款	-43,025,979,053.38	-	-43,025,979,053.38
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)	-	-335,353,652.88	-335,353,652.88
五、期末所有者权益 (基金净值)	9,687,812,027.67	-	9,687,812,027.67

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：

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

## 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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2015 年上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 2015 年 6 月 30 日的财务状况以及 2015 年上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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

#### 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[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[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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(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，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。

#### 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 2015年6月30日
活期存款	33,825,573.12
定期存款	-
其中：存款期限 1-3 个月	-
其他存款	1,500,000,000.00
合计：	1,533,825,573.12

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 2015年6月30日				
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	18,561,175,026.06	18,580,352,000.00	19,176,973.94	0.1067%
	合计	18,561,175,026.06	18,580,352,000.00	19,176,973.94	0.1067%

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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债余额。

##### 6.4.7.4 买入返售金融资产

###### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

买入返售证券_银行间	300,001,010.00	-
合计	300,001,010.00	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无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 2015年6月30日
应收活期存款利息	7,814.27
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	1,111,805.54
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	208,586,978.17
应收买入返售证券利息	162,531.54
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	-
合计	209,869,129.52

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
其他应收款	630,233.00
待摊费用	-
其他	2,622.99
合计	632,855.99

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015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	1,087,543.29
合计	1,087,543.29

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	127,758.55
其他	33,300.00
预提审计费	79,343.16
预提信息披露费	49,588.57
预提债券账户维护费	18,000.00
合计	307,990.28

#### 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 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,245,468,617.83	3,245,468,617.83
本期申购	37,384,101,989.48	37,384,101,989.48
本期赎回(以“-”号填列)	-36,471,218,803.85	-36,471,218,803.85
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	4,158,351,803.46	4,158,351,803.46

金额单位：人民币元

宝盈货币 B		
项目	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,593,364,284.62	5,593,364,284.62
本期申购	82,559,688,444.65	82,559,688,444.65
本期赎回(以“-”号填列)	-74,333,815,188.55	-74,333,815,188.55
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	13,819,237,540.72	13,819,237,540.72

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

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	96,752,510.42	-	96,752,510.42

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	-96,752,510.42	-	-96,752,510.42
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	255,983,431.67	-	255,983,431.67
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	-255,983,431.67	-	-255,983,431.67
本期末	-	-	-

## 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年6月30日
活期存款利息收入	82,306.45
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	118,168,766.64
结算备付金利息收入	2.48
其他	-
合计	118,251,075.57

## 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 2015年1月1日至2015年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	48,009,189,874.09
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,101,355,934.92
减：应收利息总额	769,973,123.89
买卖债券差价收入	137,860,815.28

**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期内无资产支持证券收益。

**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**

本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.18 其他收入**

本基金本报告期内无其他收入。

**6.4.7.19 交易费用**

本基金本报告期内无交易费用。

**6.4.7.20 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 日
审计费用	79,343.16
信息披露费	49,588.57
上清所数字证书服务费	200.00
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
银行费用	35,625.44
合计	182,757.17

**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**

本基金无需要披露的或有事项。

**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	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

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	28,026,052.08	21,281,625.61
其中：支付销售机构的客户维护费	3,902,078.59	884,997.31

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
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	8,492,743.04	6,448,977.50

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 2015 年 1 月 1 日至 2015 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	1,544,003.56	54,493.76
宝盈基金管理有限公司	548,954.78	533,649.67	1,082,604.45
合计	2,092,958.34	588,143.43	2,681,101.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 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	411,474.95	37,626.94
宝盈基金管理有限公司	112,926.72	529,715.20	642,641.92
合计	524,401.67	567,342.14	1,091,743.81

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

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

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

## 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

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015 年 1 月 1 日至 2015 年 6 月 30 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	1,160,402,643.94	426,047,643.23	-	-	17,046,060,000.00	2,625,068.55
银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014 年 1 月 1 日至 2014 年 6 月 30 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	523,529,988.50	316,107,777.26	-	-	9,087,200,000.00	1,480,087.70

## 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 2015年1月1日至2015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	-	-
期初持有的基金份额	-	44,114,604.97
期间申购/买入总份额	-	907,780.11
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	10,000,000.00
期末持有的基金份额	-	35,022,385.08
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.19%
项目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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	-	-
期初持有的基金份额	-	31,884,936.27
期间申购/买入总份额	-	30,874,385.54
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	10,000,000.00
期末持有的基金份额	-	52,759,321.81
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.54%

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第一创业证券有限责任公司办理，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

本基金本报告期内及上年度可比期间无基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

## 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	上年度可比期间
	2015年1月1日至2015年6月30日	2014年1月1日至2014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	33,825,573.12	82,306.45	3,162,565.21	197,876.67

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 33,825,573.12 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 0.00 元。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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——货币市场基金

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
96,279,275.84	-	473,234.58	96,752,510.42	-

##### 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
253,866,032.94	-	2,117,398.73	255,983,431.67	-

#### 6.4.12 期末（2015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

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 2015 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 3,314,195,842.9 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
130215	13 国开 15	2015 年 7 月 1 日	99.96	3,600,000	359,856,000.00
130234	13 国开 34	2015 年 7 月 1 日	97.76	3,500,000	342,160,000.00
011524003	15 中冶 SCP003	2015 年 7 月 1 日	100.16	3,000,000	300,480,000.00

100230	10 国开 30	2015 年 7 月 1 日	100.40	2,500,000	251,000,000.00
110402	11 农发 02	2015 年 7 月 1 日	100.08	2,500,000	250,200,000.00
100236	10 国开 36	2015 年 7 月 1 日	100.52	2,300,000	231,196,000.00
011590003	15 苏交通 SCP003	2015 年 7 月 1 日	100.77	2,000,000	201,540,000.00
011599331	15 五矿 SCP007	2015 年 7 月 1 日	100.11	2,000,000	200,220,000.00
011599389	15 陕交建 SCP001	2015 年 7 月 1 日	99.96	2,000,000	199,920,000.00
071522003	15 齐鲁证券 CP003	2015 年 7 月 1 日	99.94	2,000,000	199,880,000.00
130235	13 国开 35	2015 年 7 月 1 日	95.57	2,000,000	191,140,000.00
130211	13 国开 11	2015 年 7 月 1 日	100.14	1,000,000	100,140,000.00
1382107	13 华侨城 MTN1	2015 年 7 月 1 日	100.75	900,000	90,675,000.00
041561012	15 光明 CP001	2015 年 7 月 1 日	101.14	800,000	80,912,000.00
130233	13 国开 33	2015 年 7 月 1 日	99.97	800,000	79,976,000.00
011599070	15 联合水泥 SCP002	2015 年 7 月 1 日	100.70	600,000	60,420,000.00
130250	13 国开 50	2015 年 7 月 1 日	100.54	500,000	50,270,000.00
140443	14 农发 43	2015 年 7 月 1 日	100.27	500,000	50,135,000.00
130212	13 国开 12	2015 年 7 月 1 日	98.63	500,000	49,315,000.00
120233	12 国开 33	2015 年 7 月 1 日	98.84	400,000	39,536,000.00
110217	11 国开 17	2015 年 7 月 1 日	97.54	400,000	39,016,000.00
1082166	10 葛洲坝 MTN1	2015 年 7 月 1 日	100.79	200,000	20,158,000.00
合计				34,000,000	3,388,145,000.00

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2015 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行中国建设银行；其他存款存放在具有基金托管资格的平安银行股份有限公司、中国民生银行股份有限公司、广发银行股份有限公司以及中信银行股份有限公司，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。

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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
A-1	3,956,320,937.00	2,711,446,723.75
A-1 以下	-	-
未评级	10,561,951,695.00	1,782,251,887.02
合计	14,518,272,632.00	4,493,698,610.77

注：未评级债券为政策性金融债及超短期融资券。

##### 6.4.13.2.2 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 2015 年 6 月 30 日	上年度末 2014 年 12 月 31 日
AAA	2,024,281,416.00	1,149,771,868.12
AAA 以下	-	-
未评级	2,018,620,978.16	1,188,405,322.86

合计	4,042,902,394.16	2,338,177,190.98
----	------------------	------------------

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 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。

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%。

于 2015 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额中有 3314195842.90 元将在 1 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。

#### 6.4.13.4 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。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2015年6月30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	1,533,825,573.12	-	-	-	-	1,533,825,573.12
交易性金融资产	14,838,376,540.57	3,722,798,485.49	-	-	-	18,561,175,026.06
买入返售金融资产	300,001,010.00	-	-	-	-	300,001,010.00
应收证券清算款	-	-	-	-	163,484,749.51	163,484,749.51
应收利息	-	-	-	-	209,869,129.52	209,869,129.52
应收申购款	-	-	-	-	557,680,721.27	557,680,721.27
其他资产	-	-	-	-	632,855.99	632,855.99
资产总计	16,672,203,123.69	3,722,798,485.49	-	-	931,667,456.29	21,326,669,065.47
负债						
卖出回购金融资产款	3,314,195,842.90	-	-	-	-	3,314,195,842.90
应付赎回款	-	-	-	-	18,657,626.16	18,657,626.16
应付管理人报酬	-	-	-	-	7,740,543.44	7,740,543.44
应付托管费	-	-	-	-	2,345,619.26	2,345,619.26
应付销售服务费	-	-	-	-	1,038,493.32	1,038,493.32
应付交易费用	-	-	-	-	1,087,543.29	1,087,543.29
应付利息	-	-	-	-	234,682.76	234,682.76
应付利润	-	-	-	-	3,471,379.88	3,471,379.88
其他负债	-	-	-	-	307,990.28	307,990.28
负债总计	3,314,195,842.90	-	-	-	34,883,878.39	3,349,079,721.29
利率敏感度缺口	13,358,007,280.79	3,722,798,485.49	-	-	-896,783,577.90	17,977,589,344.18
上年度末 2014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	2,414,177,304.36	-	-	-	-	2,414,177,304.36
交易性金融资产	5,783,665,362.33	1,048,210,439.42	-	-	-	6,831,875,801.75
买入返售金融资产	673,891,000.00	-	-	-	-	673,891,000.00
应收利息	-	-	-	-	133,570,480.50	133,570,480.50
应收申购款	-	-	-	-	12,794,757.45	12,794,757.45
其他资产	-	-	-	-	576,773.83	576,773.83

资产总计	8,871,733,666.69	1,048,210,439.42	-	-	-146,942,011.78	10,066,886,117.89
负债						
卖出回购金融资产款	1,214,697,097.95	-	-	-	-	1,214,697,097.95
应付赎回款	-	-	-	-	7,288,384.56	7,288,384.56
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,616,423.27	2,616,423.27
应付托管费	-	-	-	-	792,855.54	792,855.54
应付销售服务费	-	-	-	-	620,095.73	620,095.73
应付交易费用	-	-	-	-	543,233.52	543,233.52
应付利息	-	-	-	-	381,012.85	381,012.85
应付利润	-	-	-	-	880,746.57	880,746.57
其他负债	-	-	-	-	233,365.45	233,365.45
负债总计	1,214,697,097.95	-	-	-	13,356,117.49	1,228,053,215.44
利率敏感度缺口	7,657,036,568.74	1,048,210,439.42	-	-	-133,585,894.29	8,838,832,902.45

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（2015年6月30日）	上年度末（2014年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	20,865,148.20	11,257,401.63
	市场利率上升 25 个基点	-20,746,463.87	-11,182,655.55

#### 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

本基金无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	18,561,175,026.06	87.03
	其中:债券	18,561,175,026.06	87.03
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	300,001,010.00	1.41
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,533,825,573.12	7.19
4	其他各项资产	931,667,456.29	4.37
5	合计	21,326,669,065.47	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	12.51	
	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	3,314,195,842.90	18.44
	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

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2015 年 5 月 5 日	23.94	大额赎回	2 个工作日
2	2015 年 5 月 6 日	20.34	大额赎回	2 个工作日
3	2015 年 6 月 24 日	34.80	大额赎回	4 个工作日
4	2015 年 6 月 25 日	31.49	大额赎回	4 个工作日
5	2015 年 6 月 26 日	25.47	大额赎回	4 个工作日
6	2015 年 6 月 29 日	24.07	大额赎回	4 个工作日

### 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 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 180 天的情况。根据本基金《基金合同》中关于投资组合限制的约定：“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”；且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	15.22	18.44
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	4.44	-
2	30 天(含)—60 天	36.46	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.34	-
3	60 天(含)—90 天	12.43	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	0.50	-
4	90 天(含)—180 天	29.53	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天(含)—397 天(含)	20.71	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	114.36	18.44

#### 7.4 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	2,068,762,356.59	11.51
	其中：政策性金融债	2,068,762,356.59	11.51
4	企业债券	899,594,102.96	5.00

5	企业短期融资券	14,468,131,253.39	80.48
6	中期票据	1,124,687,313.12	6.26
7	其他	-	-
8	合计	18,561,175,026.06	103.25
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	949,507,667.44	5.28

### 7.5 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	1082129	10 国电集 MTN1	5,000,000	501,664,232.87	2.79
2	011537005	15 中建材 SCP005	5,000,000	499,975,695.76	2.78
3	071503006	15 中信 CP006	5,000,000	499,940,834.42	2.78
4	011537006	15 中建材 SCP006	4,000,000	400,022,326.86	2.23
5	068007	06 首都机场债	3,750,000	376,289,338.04	2.09
6	130215	13 国开 15	3,600,000	360,196,787.62	2.00
7	130234	13 国开 34	3,500,000	353,198,722.67	1.96
8	011499076	14 包钢集 SCP001	3,000,000	300,577,714.38	1.67
9	011575001	15 中信股 SCP001	3,000,000	300,278,218.61	1.67
10	011599192	15 包钢集 SCP003	3,000,000	300,164,523.76	1.67

### 7.6 “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	15
报告期内偏离度的最高值	0.3773%
报告期内偏离度的最低值	-0.0314%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1724%

### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 本报告期内不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。

7.8.3 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，除 15 中信 CP006（证券代码：071503006.IB）发行主体中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）外未受到公开谴责、处罚。

2015 年 1 月 16 日，中国证监会通报 2014 年第四季度证券公司融资类业务现场检查情况，披

露中信证券存在违规为到期融资融券合约展期问题，受过处理仍未改正，且涉及客户数量较多，对其采取暂停新开融资融券客户信用账户 3 个月的行政监管措施。我们认为，中信证券作为国内证券行业龙头，资本实力雄厚，股东背景强大，该行政监管措施主要针对中信证券融资类业务新开客户，且暂停期限仅为 3 个月，对中信证券盈利能力和偿债能力影响非常有限。我们长期看好中信证券跟随中国资本市场发展而进步，相关投资操作符合有关法律法规和本基金投资策略的要求。

#### 7.8.4 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	163,484,749.51
3	应收利息	209,869,129.52
4	应收申购款	557,680,721.27
5	其他应收款	632,855.99
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	931,667,456.29

#### 7.8.5 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	340,404	12,215.93	46,191,612.09	1.11%	4,112,160,191.37	98.89%
宝盈货币 B	233	59,310,032.36	12,955,635,238.61	93.75%	863,602,302.11	6.25%
合计	340,637	52,776.38	13,001,826,850.70	72.32%	4,975,762,493.48	27.68%

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	6,264,835.14	0.1507%
	宝盈货币 B	-	-
	合计	6,264,835.14	0.0348%

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）。

## 8.3 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	10~50
	宝盈货币 B	0
	合计	10~50
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	3,245,468,617.83	5,593,364,284.62
本报告期基金总申购份额	37,384,101,989.48	82,559,688,444.65
减：本报告期基金总赎回份额	36,471,218,803.85	74,333,815,188.55
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期末基金份额总额	4,158,351,803.46	13,819,237,540.72

## § 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

1、报告期内基金管理人重大人事变动情况如下：

2015 年 3 月 21 日，本基金管理人发布关于董事长（法定代表人）变更的公告，李文众先生

任宝盈基金管理有限公司董事长（法定代表人），李文众先生基金行业任职资格核准文号为：证监许可（2015）409 号。李建生女士退休，不再担任董事长（法定代表人）职务。截止至报告期末，基金管理人已完成办理法定代表人工商变更登记等相关手续。

2、报告期内基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

本基金托管人 2015 年 1 月 4 日发布任免通知，聘任张力铮为中国建设银行投资托管业务部副总经理。

### 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要，并能为本基金提供全面的信息服务。

(6) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门的研究人员，能及时为本基金提供高质量的咨询服务。

2、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。

3、本基金与本基金管理公司管理的宝盈增强收益债券型证券投资基金共用交易单元，本报告期末租用和退租证券公司交易单元。

### 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	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 1 月 28 日
2	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入公告	证券时报	2015 年 2 月 9 日
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 2 月 12 日
4	宝盈货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要	证券时报	2015 年 3 月 21 日

5	宝盈基金管理有限公司关于董事长（法定代表人）变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 21 日
6	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 3 月 28 日
7	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2015 年 3 月 31 日
8	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加深圳众禄基金销售有限公司费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2015 年 4 月 24 日
9	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2015 年 4 月 24 日
10	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 5 月 22 日
11	宝盈货币市场证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2015 年 6 月 13 日
12	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2015 年 6 月 16 日
13	宝盈基金管理有限公司关于子公司中铁宝盈资产管理有限公司办公地址变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日
14	宝盈基金管理有限公司关于从业人员在子公司兼职情况的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报	2015 年 6 月 17 日

## § 11 备查文件目录

### 11.1 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。

### 11.2 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

### 11.3 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

2015 年 8 月 27 日