

宝盈货币市场证券投资基金 2019 年半年度报告摘要

2019 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：2019 年 8 月 27 日

§ 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 2019 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。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

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	4,857,550,110.23 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	883,101,665.62 份	3,974,448,444.61 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	杨凯
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	yangk@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	010-67595096
传真	0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

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

§ 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(2019年1月1日 - 2019年6月30日)	报告期(2019年1月1日 - 2019年6月30日)
本期已实现收益	12,522,235.23	130,991,956.78
本期利润	12,522,235.23	130,991,956.78
本期净值收益率	1.2447%	1.3654%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年6月30日)	
期末基金资产净值	883,101,665.62	3,974,448,444.61
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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

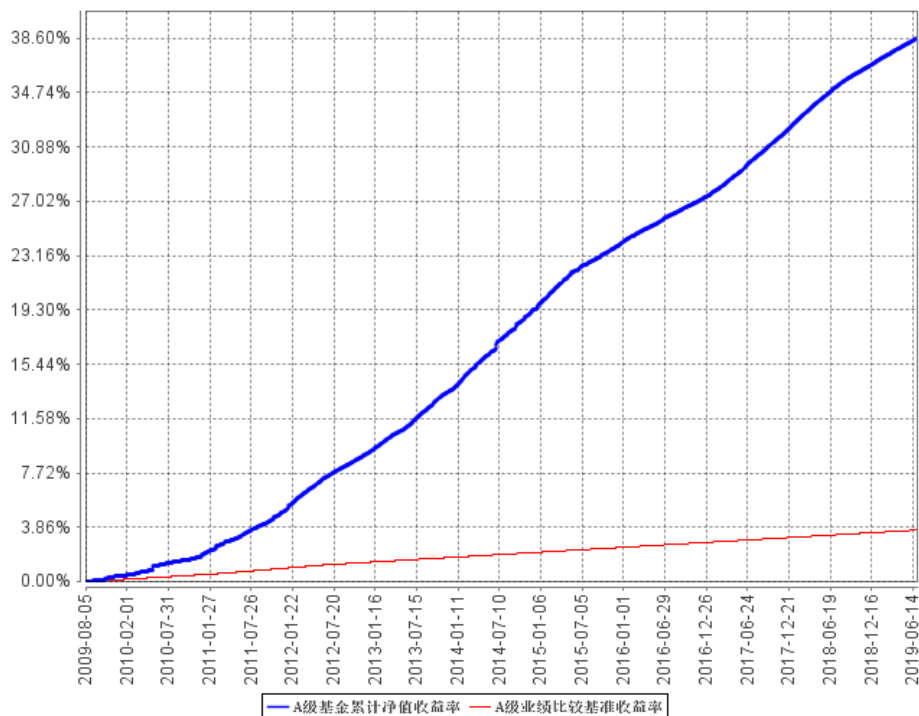
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2054%	0.0021%	0.0288%	0.0000%	0.1766%	0.0021%
过去三个月	0.6024%	0.0017%	0.0873%	0.0000%	0.5151%	0.0017%
过去六个月	1.2447%	0.0019%	0.1736%	0.0000%	1.0711%	0.0019%
过去一年	2.6972%	0.0020%	0.3500%	0.0000%	2.3472%	0.0020%
过去三年	10.1315%	0.0033%	1.0500%	0.0000%	9.0815%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	38.5964%	0.0100%	3.6713%	0.0001%	34.9251%	0.0099%

宝盈货币 B

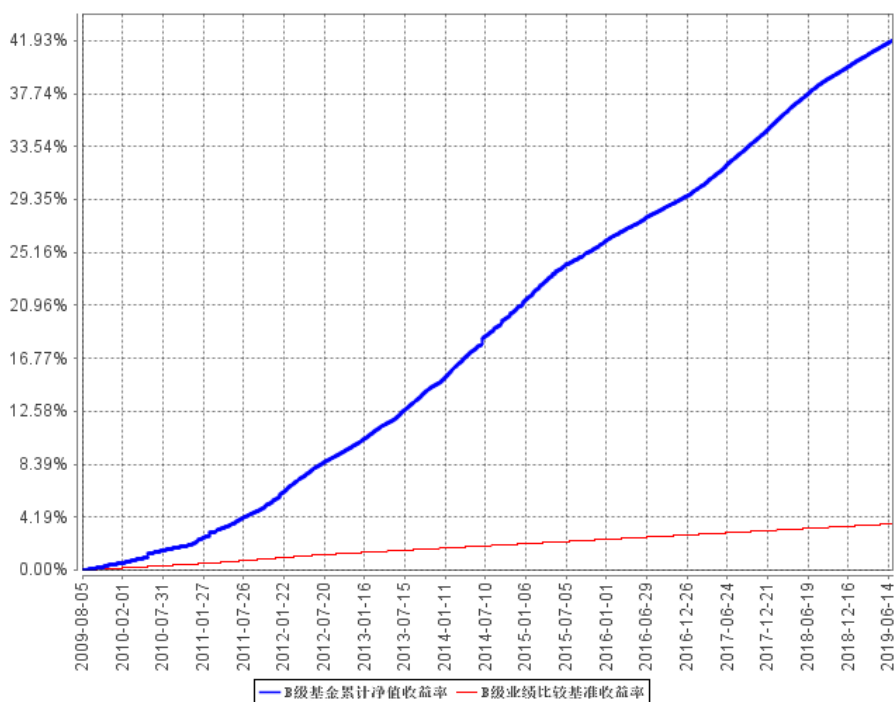
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.2252%	0.0021%	0.0288%	0.0000%	0.1964%	0.0021%
过去三个月	0.6630%	0.0017%	0.0873%	0.0000%	0.5757%	0.0017%
过去六个月	1.3654%	0.0019%	0.1736%	0.0000%	1.1918%	0.0019%
过去一年	2.9443%	0.0020%	0.3500%	0.0000%	2.5943%	0.0020%
过去三年	10.9283%	0.0033%	1.0500%	0.0000%	9.8783%	0.0033%
自基金合同 生效起至今	41.9333%	0.0100%	3.6713%	0.0001%	38.2620%	0.0099%

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、宝盈品牌消费股票二十八只基金，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基金经理	2018 年 4 月 21 日	-	6 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	本基金基金经理	2019 年 3 月 30 日	-	6 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。
高宇	本基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞混合型证券投资基金、宝盈祥泰混合型证券投资基金、宝盈盈泰纯债债券型证券投资基金、宝盈安泰短债债券型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金基金经理；固定收益部副总经理	2017 年 9 月 30 日	2019 年 3 月 30 日	11 年	高宇先生，厦门大学投资学硕士。2008 年 6 月至 2009 年 8 月任职于第一创业证券资产管理部，担任研究员；2009 年 8 月至 2010 年 10 月任职于国信证券经济研究所，担任固定收益分析师；2010 年 10 月至 2016 年 6 月任职于博时基金，先后担任固定收益总部研究员、基金经理助理、基金经理等职位；2016 年 7 月至 2017 年 8 月任职于天风证券，担任机构业务总部总经理助理。2017 年 8 月加入宝盈基金管理有限公司固定收益部。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，“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期；

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 2019 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，国际经济金融形势错综复杂，外部不确定不稳定因素增多，国内宏观经济保持了总体平稳、稳中有进的发展态势。通胀方面，主要工业品价格显著上行，农产品价格维持区间震荡，居民消费价格保持温和上涨。

报告期内，人民银行坚持稳健的货币政策要松紧适度，综合运用多种货币政策工具，保持流动性合理充裕，货币市场资金利率中枢维持低位。报告期内，春节前，人民银行先后调整普惠金融定向降准小微企业贷款考核标准、下调金融机构存款准备金率置换部分中期借贷便利，以对冲春节前由于现金投放造成的流动性波动，资金面维持宽松；春节后，人民银行继续“削峰填谷”式对冲操作，保持银行体系流动性合理充裕，跨季压力逐步释放；4月，人民银行缩量续作中期借贷便利，资金面波动扩大，货币市场利率显著上行；5月和6月，人民银行从2019年5月15日开始对中小银行实行较低存款准备金率，公开市场重启28D逆回购、超量续作中期借贷便利并增加再贴现和常备借贷便利额度，流动性总量充裕但结构分层在6月份较为显著。报告期内，商业银行同业融资压力继续缓解，但5月下旬后中小银行压力较大，协议存款和同业存单利率波动较大，先区间震荡后上再下，经历了6月下旬的迅速下行后来到历史低位区间。债券市场方面，短期品种1年期国开债先区间震荡后上再下，整体上行约7bp，季末上行至2.73%左右；长期品种10年期国开债先上后下，整体变化不大，季末回落至3.61%附近。

报告期内，人民银行保持流动性合理充裕，两次定向调低存款准备金率，资金面维持宽松格局，资金利率中枢维持低位。我们整体维持了较高评级和较低久期的投资组合，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1.2447%，本报告期宝盈货币B的基金份额净值收益率为1.3654%，同期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

展望下半年，我们的基本判断仍是经济增速逐步放缓。具体来看，海外经济不确定性加大预

计进一步拖累出口和制造业投资，地产投资在新开工走弱和竣工交付走强影响下大概率迎来拐点，基建投资受资本金来源改善等带动有望对冲制造业和地产投资的下滑但整体幅度有限，消费则趋于稳定。CPI 和 PPI 预计在 3 季度回落，短期对货币政策的约束有限。国内经济走弱、通胀压力有限，稳健的货币政策有望继续体现逆周期调节的要求。

趋势上，我们继续看好长端利率的下行机会，但短端利率约束了利率进一步的下行空间，潜在的逆周期调节政策也会造成冲击，仍需要更好地把握节奏。信用债绝对收益率仍处于历史相对低位区间，关注中等级债券的期限利差压缩机会。货币市场有望继续维持宽松格局，择机配置高评级高收益的同业存款、同业存单和信用债，适度提升杠杆水平。

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、运营的分管领导及研究部、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、监察稽核部负责人共同组成，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 12,522,235.23 元，B 类 130,991,956.78 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：2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
资 产：		
银行存款	406,116,477.12	4,207,165,655.22
结算备付金	-	-
存出保证金	-	-
交易性金融资产	3,131,450,242.18	8,840,977,963.07
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,131,450,242.18	8,840,977,963.07
资产支持证券投资	-	-
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,516,097,114.14	1,705,832,758.75
应收证券清算款	-	-
应收利息	21,282,913.80	53,335,111.44
应收股利	-	-
应收申购款	3,682,416.54	10,869.43
递延所得税资产	-	-
其他资产	694,766.67	694,766.67
资产总计	5,079,323,930.45	14,808,017,124.58

负债和所有者权益	本期末 2019 年 6 月 30 日	上年度末 2018 年 12 月 31 日
负 债：		
短期借款	-	-
交易性金融负债	-	-
衍生金融负债	-	-
卖出回购金融资产款	214,999,772.50	1,252,897,360.65
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	3,232,774.71	111,496.43
应付管理人报酬	1,421,600.52	5,017,342.97
应付托管费	430,788.04	1,520,406.95
应付销售服务费	226,757.89	355,964.97
应付交易费用	117,856.72	284,623.18
应交税费	34,784.47	47,887.79
应付利息	33,802.84	638,617.68
应付利润	1,023,186.67	5,349,342.81
递延所得税负债	-	-
其他负债	252,495.86	379,179.43
负债合计	221,773,820.22	1,266,602,222.86
所有者权益：		
实收基金	4,857,550,110.23	13,541,414,901.72
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,857,550,110.23	13,541,414,901.72
负债和所有者权益总计	5,079,323,930.45	14,808,017,124.58

注：报告期截止日 2019 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 883,101,665.62 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 3,974,448,444.61 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 4,857,550,110.23 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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 年 6 月 30 日
一、收入	177,781,599.65	788,604,646.27
1. 利息收入	167,549,902.83	771,303,738.44
其中：存款利息收入	34,439,583.55	252,520,379.69
债券利息收入	97,428,414.76	351,319,919.65
资产支持证券利息收入	-	-

买入返售金融资产收入	35,681,904.52	167,463,439.10
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	10,231,696.82	17,300,907.83
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	10,231,696.82	17,300,907.83
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
衍生工具收益	-	-
股利收益	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	-	-
减：二、费用	34,267,407.64	105,007,599.36
1. 管理人报酬	17,455,732.96	54,339,953.84
2. 托管费	5,289,616.05	16,466,652.66
3. 销售服务费	1,738,194.54	3,773,287.16
4. 交易费用	-	1,323.00
5. 利息支出	9,557,971.41	30,170,138.19
其中：卖出回购金融资产支出	9,557,971.41	30,170,138.19
6. 税金及附加	35,028.95	47,808.08
7. 其他费用	190,863.73	208,436.43
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	143,514,192.01	683,597,046.91
减：所得税费用	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	143,514,192.01	683,597,046.91

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：2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	-8,683,864,791.49	-	-8,683,864,791.49

数 (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
项目	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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)	30,655,198,646.07	-	30,655,198,646.07
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	683,597,046.91	683,597,046.91
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)	-16,034,391,389.35	-	-16,034,391,389.35
其中: 1. 基金申购款	106,711,425,030.28	-	106,711,425,030.28
2. 基金赎回款	-122,745,816,419.63	-	-122,745,816,419.63
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)	-	-683,597,046.91	-683,597,046.91
五、期末所有者权益(基金净值)	14,620,807,256.72	-	14,620,807,256.72

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 _____

基金管理人负责人

_____ 彭玖雯 _____

主管会计工作负责人

_____ 何瑜 _____

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 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。

6.4.2.2 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。

6.4.2.3 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。

6.4.3 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。

6.4.4 关联方关系

6.4.4.1 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。

6.4.4.2 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。

6.4.5 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.5.1 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。

6.4.5.2 关联方报酬

6.4.5.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	17,455,732.96	54,339,953.84
其中：支付销售机构的客户维护费	1,405,543.05	2,977,118.38

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 × 0.33% / 当年天数。

6.4.5.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年1月1日至2019年6月 30日	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30 日
当期发生的基金应支付	5,289,616.05	16,466,652.66

的托管费		
------	--	--

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。

6.4.5.2.3 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 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
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	418,084.66	15,595.48	433,680.14
宝盈基金	248,912.68	1,384,550.34	1,633,463.02
合计	666,997.34	1,400,145.82	2,067,143.16

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。

6.4.5.3 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 2019 年 1 月 1 日至 2019 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	-	750,004,712.94	-	-	1,350,000,000.00	74,555.00
	上年度可比期间 2018 年 1 月 1 日至 2018 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	1,419,526,828.15	3,397,375,623.10	-	-	9,029,600,000.00	1,185,571.44

6.4.5.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.5.4.1 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 2019年1月1日至2019年6月30日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期初持有的基金份额	-	206,805,393.91
期间申购/买入总份额	-	90,967,225.44
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	98,900,000.00
期末持有的基金份额	-	198,872,619.35
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	5.00%
项目	上年度可比期间 2018年1月1日至2018年6月30日	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
期初持有的基金份额	-	76,724,948.54
期间申购/买入总份额	-	346,021,624.56
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	175,600,000.00
期末持有的基金份额	-	247,146,573.10
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.84%

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%。

6.4.5.4.2 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 2019年6月30日	上年度末 2018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	203,737,882.13	4.19%	-	-
中铁宝盈资 产管理有限 公司	79,275,586.33	1.63%	-	-

6.4.5.5 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 2019年1月1日至2019年6月30日		上年度可比期间 2018年1月1日至2018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	6,116,477.12	56,438.91	10,191,446.91	71,075.26

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。

6.4.5.6 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。

6.4.5.7 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。

6.4.6 期末（2019年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.6.1 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。

6.4.6.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.6.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.6.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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 214,999,772.50 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
120235	12国开35	2019年7月1日	100.17	2,250,000	225,382,500.00
合计				2,250,000	225,382,500.00

6.4.6.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2019 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。

6.4.7 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	3,131,450,242.18	61.65
	其中: 债券	3,131,450,242.18	61.65
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,516,097,114.14	29.85
	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	406,116,477.12	8.00
4	其他各项资产	25,660,097.01	0.51
5	合计	5,079,323,930.45	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	7.51	
	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	214,999,772.50	4.43
	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	42
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	83

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	41
-------------------	----

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	48.01	4.43
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	36.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.76	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	7.58	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	5.52	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.04	4.43

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	338,368,213.75	6.97
2	央行票据	-	-
3	金融债券	300,499,090.15	6.19
	其中：政策性金融债	300,499,090.15	6.19
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	949,975,888.30	19.56
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,542,607,049.98	31.76
8	其他	-	-
9	合计	3,131,450,242.18	64.47
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	111817176	18 光大银行 CD176	4,000,000	398,767,606.79	8.21
2	120235	12 国开 35	3,000,000	300,499,090.15	6.19
3	199915	19 贴现国债 15	2,200,000	218,437,741.07	4.50
4	011900289	19 华电股 SCP001	2,000,000	200,002,886.28	4.12
5	111807156	18 招商银行 CD156	2,000,000	199,383,803.42	4.10
6	011901000	19 苏交通 SCP005	1,500,000	150,014,122.76	3.09
7	071900037	19 光大证券 CP003BC	1,500,000	149,992,347.72	3.09
8	180026	18 付息国债 26	1,200,000	119,930,472.68	2.47
9	011900282	19 华电 SCP002	1,000,000	99,998,167.91	2.06
10	111811198	18 平安银行 CD198	1,000,000	99,765,260.45	2.05

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	0.0919%
报告期内偏离度的最低值	0.0214%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0592%

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序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 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 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 18 平安银行 CD198 发行主体平安银行股份有限公司外未受到公开谴责、处罚。本基金投资 18 平安银行 CD198 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

18 平安银行 CD198(代码: 111811198)为宝盈货币市场证券投资基金的前十大持仓证券。2018 年 8 月 1 日，中国人民银行网站发布了关于平安银行股份有限公司的处罚信息。经查，2017 年 1 月 1 日至 2017 年 6 月 30 日，平安银行未按照规定履行客户身份识别义务，根据《中华人民共和

国反洗钱法》第三十二条第（一）项规定，处以 50 万元罚款；未按照规定保存客户身份资料和交易记录，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（二）项规定，处以 40 万元罚款；未按照规定报送大额交易报告或者可疑交易报告，根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（三）项规定，处以 50 万元罚款；对平安银行合计处以 140 万元罚款，并根据《中华人民共和国反洗钱法》第三十二条第（一）项、第（二）项和第（三）项规定，对相关责任人共处以 14 万元罚款。

2019 年 3 月 18 日，中国证监会大连监管局对平安银行股份有限公司大连分行采取责令改正行政监督管理措施。经查，平安银行大连分行存在以下问题：一、未向基金投资者公开基金产品风险评价方法，违反《证券投资基金销售管理办法》第六十一条的规定。二、花园广场支行基金销售人员在投资者进行风险承受能力调查与评价工作中，存在未经投资者允许，擅自代投资者填写风险承受能力调查问卷的情况。上述行为违反《证券投资基金销售管理办法》第五十九条的规定。

大连证监局表示，依据《证券投资基金销售管理办法》第八十七条的规定，大连证监局决定对平安银行大连分行采取责令改正的行政监督管理措施。平安银行大连分行应对投资者适当性管理方面存在的问题认真整改，并于 2019 年 3 月 31 日前向大连证监局提交书面整改报告。

2019 年 4 月 24 日，中国人民银行温州市中心支行发布行政处罚信息显示，平安银行温州分行有三项行为违法，包括为非法平台提供支付服务等违反有关清算管理规定的行为，利用内部过渡户办理客户备付金互转，为单位商户设置个人账户作为收单账户。行政处罚内容如下，根据《中华人民共和国中国人民银行法》，给予警告，没收违法所得人民币 169.12 万元，并处罚款人民币 537.69 万元；根据《非金融机构支付服务管理办法》，处罚款人民币 3 万元；根据《人民币银行结算账户管理办法》，给予警告，处罚款人民币 3 万元。

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	21,282,913.80
4	应收申购款	3,682,416.54
5	其他应收款	694,766.67
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	25,660,097.01

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	264,420	3,339.77	30,771,524.18	3.48%	852,330,141.44	96.52%
宝盈货币 B	68	58,447,771.24	3,914,156,584.85	98.48%	60,291,859.76	1.52%
合计	264,488	18,365.86	3,944,928,109.03	81.21%	912,622,001.20	18.79%

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	500,958,909.40	10.33
2	银行类机构	500,000,000.00	10.31
3	银行类机构	313,064,737.26	6.46
4	保险类机构	304,360,850.21	6.28
5	银行类机构	300,000,000.00	6.19
6	其他机构	206,101,818.30	4.25
7	保险类机构	204,436,911.90	4.22
8	信托类机构	203,737,882.13	4.20
9	基金类机构	198,872,619.35	4.10
10	其他机构	118,923,884.01	2.45

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	2,759,559.98	0.3125%
	宝盈货币 B	0.00	0.0000%
	合计	2,759,559.98	0.0568%

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	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	0~10
	宝盈货币 B	0
	合计	0~10

§ 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	1,089,267,049.31	12,452,147,852.41
本报告期基金总申购份额	2,023,825,206.18	16,920,315,306.81
减:本报告期基金总赎回份额	2,229,990,589.87	25,398,014,714.61
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	883,101,665.62	3,974,448,444.61

§ 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、报告期内本基金管理人重大人事变动情况如下：

(1) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第四次现场会议决议，同意张啸川同志辞去总经理职务。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第五次现场会议决议，同意聘任杨凯同志担任公司总经理，同时，根据公司章程规定，经营管理层董事由公司总经理担任，经营管理层董事的资格与总经理职务不可分离，任职期间与总经理的任职期间相同，自总经理被任命之日起算，至总经理离职之日自动终止。

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第六次现场会议决议，同意张瑾同志不再担任督察长职务。

以上变更事项已按规定向中国证券监督管理委员会深圳证监局报告以及向中国证券投资基金业协会报备，并发布基金行业高级管理人员变更公告。

(4) 根据宝盈基金管理有限公司股东会 2019 年第一次现场会议决议，同意景开强、陈赤不再担任公司董事，马永红、陈恪担任公司董事；同意张建华、刘郁飞不再担任公司监事，陈林、王法立担任公司监事。

(5) 根据宝盈基金管理有限公司第五届监事会第四次现场会议决议，同意张建华不再担任

公司监事会主席，由陈林担任监事会主席职务。

2、报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动情况如下：

中国建设银行 2019 年 6 月 4 日发布公告，聘任蔡亚蓉为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

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，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

无。

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。

§ 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。

宝盈基金管理有限公司

2019 年 8 月 27 日