

信诚薪金宝货币市场基金
2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：2020 年 08 月 28 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2020 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	6
§ 4	管理人报告	7
4.1	基金管理人及基金经理情况	7
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	8
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	9
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
§ 5	托管人报告	10
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	10
5.3	托管人对中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	10
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1	资产负债表	11
6.2	利润表	12
6.3	所有者权益（基金净值）变动表	13
6.4	报表附注	14
§ 7	投资组合报告	28
7.1	期末基金资产组合情况	28
7.2	债券回购融资情况	28
7.3	基金投资组合平均剩余期限	29
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	29
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	29
7.6	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	30
7.7	影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	30
7.8	期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细	31
7.9	投资组合报告附注	31
§ 8	基金份额持有人信息	32
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	32
8.2	期末货币市场基金前十名份额持有人情况	32

8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	32
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情况	32
8.5	发起式基金发起资金持有份额情况	32
§ 9	开放式基金份额变动	32
§ 10	重大事件揭示	33
10.1	基金份额持有人大会决议	33
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	33
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	33
10.4	基金投资策略的改变	33
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	33
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	33
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	33
10.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况	34
10.9	其他重大事件	34
§ 11	影响投资者决策的其他重要信息	35
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	35
11.2	影响投资者决策的其他重要信息	35
§ 12	备查文件目录	35
12.1	备查文件目录	35
12.2	存放地点	35
12.3	查阅方式	35

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	信诚薪金宝货币市场基金
基金简称	信诚薪金宝货币
基金主代码	000599
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014 年 05 月 14 日
基金管理人	中信保诚基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	14,184,675,904.35 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益率。
投资策略	本基金将综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征,在保证基金资产的安全性和流动性的基础上力争为投资人创造稳定的收益。同时,通过对国内外宏观经济走势、货币政策和财政政策的研究,结合对市场利率变动的预期,进行积极的投资组合管理。
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,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信保诚基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	周浩	李修滨
	联系电话	021-68649788	4006800000
	电子邮箱	hao.zhou@citicprufunds.com.cn	lixubin@citicbank.com
客户服务电话		400-666-0066	95558
传真		021-50120888	010-85230024
注册地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层	北京市东城区朝阳门北大街9号
办公地址		中国(上海)自由贸易试验区世纪大道8号上海国金中心汇丰银行大楼9层	北京市东城区朝阳门北大街9号
邮政编码		200120	100010
法定代表人		张翔燕	李庆萍

注:本基金管理人法定名称于2017年12月18日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。
本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称

变更的公告。

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信保诚基金管理有限公司	中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日）
本期已实现收益	187,479,120.82
本期利润	187,479,120.82
本期净值收益率	1.0797%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
期末基金资产净值	14,184,675,904.35
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020 年 06 月 30 日）
累计净值收益率	22.3288%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于本基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

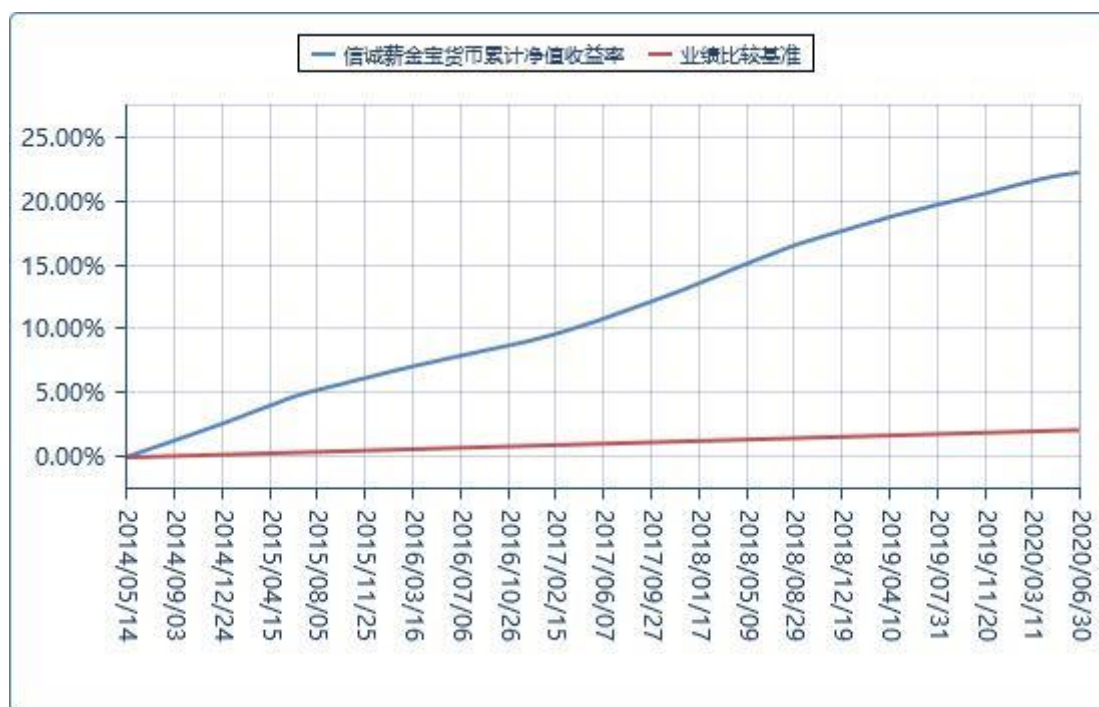
3、本基金的收益分配是按日结转份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1287%	0.0016%	0.0288%	0.0000%	0.0999%	0.0016%
过去三个月	0.4442%	0.0015%	0.0873%	0.0000%	0.3569%	0.0015%
过去六个月	1.0797%	0.0017%	0.1745%	0.0000%	0.9052%	0.0017%
过去一年	2.3640%	0.0016%	0.3510%	0.0000%	2.0130%	0.0016%
过去三年	10.0906%	0.0026%	1.0510%	0.0000%	9.0396%	0.0026%
自基金合同生效起至今	22.3288%	0.0026%	2.1479%	0.0000%	20.1809%	0.0026%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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



§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人中信保诚基金管理有限公司经中国证监会批准,于2005年9月30日正式成立,注册资本2亿元,注册地为上海。公司股东为中信信托有限责任公司、英国保诚集团股份有限公司和中新苏州工业园区创业投资有限公司,各股东出资比例分别为49%、49%、2%。因业务发展需要,经国家工商行政管理总局核准,本基金管理人法定名称于2017年12月18日起由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”。本基金管理人已于2017年12月20日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

截至2020年6月30日,本基金管理人管理的运作中基金为71只,分别为:信诚四季红混合型证券投资基金、中信保诚精萃成长混合型证券投资基金、中信保诚盛世蓝筹混合型证券投资基金、信诚三得益债券型证券投资基金、信诚优胜精选混合型证券投资基金、信诚中小盘混合型证券投资基金、信诚深度价值混合型证券投资基金(LOF)、信诚增强收益债券型证券投资基金(LOF)、信诚金砖四国积极配置证券投资基金(LOF)、信诚中证500指数分级证券投资基金、信诚货币市场证券投资基金、信诚新机遇混合型证券投资基金(LOF)、信诚全球商品主题证券投资基金(LOF)、信诚沪深300指数分级证券投资基金、信诚双盈债券型证券投资基金(LOF)、信诚周期轮动混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚至远灵活配置混合型证券投资基金、信诚优质纯债债券型证券投资基金、信诚新兴产业混合型证券投资基金、信诚中证800医药指数分级证券投资基金、信诚中证800有色指数分级证券投资基金、信诚年年有余定期开放债券型证券投资基金、信诚中证800金融指数分级证券投资基金、信诚幸福消费混合型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚中证TMT产业主题指数分级证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、信诚中证信息安全指数分级证券投资基金、信诚中证智能家居指数分级证券投资基金、信诚中证建筑工程指数型证券投资基金(LOF)、信诚鼎利灵活配置混合型证券投资基金(LOF)、中信保诚稳利债券型证券投资基金、信诚惠盈债券型证券投资基金、信诚稳健债券型证券投资基金、信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚惠泽18个月定期开放债券型证券投资基金、信诚稳瑞债券型证券投资基金、中信保诚稳益债券型证券投资基金、信诚至裕灵活配置混合型证券投资基金、信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚景

瑞债券型证券投资基金、信诚新悦回报灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳丰债券型证券投资基金、信诚永益一年定期开放混合型证券投资基金、信诚稳悦债券型证券投资基金、信诚稳泰债券型证券投资基金、信诚稳鑫债券型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚理财 28 日盈债券型证券投资基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金、信诚多策略灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚新泽回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚嘉鑫 3 个月定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚稳鸿债券型证券投资基金、中信保诚至兴灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚稳达债券型证券投资基金、中信保诚新蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚景泰债券型证券投资基金、中信保诚景丰债券型证券投资基金、中信保诚创新成长灵活配置混合型证券投资基金、中信保诚嘉裕五年定期开放债券型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金、中信保诚嘉丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、中信保诚中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
席行懿	本基金基金经理, 兼任信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金的基金经理。	2016 年 03 月 18 日	-	10	工商管理硕士。曾任职于德勤华永会计师事务所, 担任高级审计师。2009 年 11 月加入中信保诚基金管理有限公司, 历任基金会计经理、交易员、固定收益研究员。现任信诚货币市场证券投资基金、中信保诚景华债券型证券投资基金、信诚薪金宝货币市场基金、信诚智惠金货币市场基金、中信保诚至泰中短债债券型证券投资基金的基金经理。

注: 1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内, 本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚薪金宝货币市场基金基金合同》、《信诚薪金宝货币市场基金招募说明书》的约定, 本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度, 加强内部管理, 规范基金运作。本报告期内, 基金运作合法合规, 没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》, 以及公司拟定的《信诚基金公平交易管理制度》, 公司采取了一系列的行动实际落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职, 投资研究前端不断完善研究方法和投资决策流程, 确保各投资组合享有公平的投资决策机会, 建立公平交易的制度环境; 交易环节加强交易执行的内部控制, 利用恒生

交易系统公平交易相关程序,及其它的流程控制,确保不同基金在一、二级市场同一证券交易时的公平;公司同时不断完善和改进公平交易分析系统,在事后加以了严格的行为监控,分析评估以及报告与信息披露。当期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现有违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内,未发现本基金与其它投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。报告期内,未出现参与交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易(完全复制的指数基金除外)。

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

2020 年上半年债券市场巨幅震荡。2020 年一季度债券市场收益率整体大幅下行,其中短端利率下行幅度大于长端,收益率曲线呈现牛陡;二季度债券市场先扬后抑,宽幅震荡,短端收益率涨幅较长端更为剧烈,收益率曲线由牛陡变为熊平。具体来看,一季度主导债券市场波动的主要因素是新冠疫情,在疫情发展的不同阶段,债券市场的基本面预期出现了两次较大的变化。春节前,疫情尚未爆发,市场预期将出现小的主动补库周期,对债市有所压制;春节后,疫情在国内大规模爆发,国内货币政策启动危机模式进行快速应对,市场预期此次疫情不会改变中国经济基本面;3 月以后,疫情在全球蔓延,虽然疫情在国内得到了较好的控制,但全球陷入“闭关锁国”状态,外需遭受严重打击,基本面预期迅速恶化。反应在债券市场,长端利率债经历了快速下行到调整再到快速下行几个阶段,10 年期国债活跃券收益率创下了 2016 年以来的新低。信用债市场,前期受资金面宽松,机构欠配等多因素影响,收益率快速下行。3 月以后,受美元流动性冲击叠加国内企业现金流快速恶化的影响,信用利差和期限利差均有所走阔。

进入二季度,国内疫情得到较好控制之后,国内复工复产加速推进,5、6 月微观经济活动持续回暖,海外疫情爆发导致对医疗器械和纺织服装制品的需求井喷,支持了我国出口订单,国内经济复苏叠加出口弱企稳支撑了二季度基本面的快速修复;资金面上,2-4 月份货币政策基调是危机模式,货币环境始终保持较为宽松的状态,4 月 3 日央行超预期下调 IOER 使得货币市场的宽松情绪达到了极致,3M Shibor 降至 1.39%的历史次低位,仅次于 08 年金融危机的低位。随后,受汇率波动影响及防风险考虑,央行开始在公开市场边际收紧资金以抑制资金在金融市场空转。5 月开始,基本面复苏叠加货币政策边际收紧,债券市场经历罕见大跌,短端 3M Shibor 快速上行至 2.12%,较前期上行 75BP,调整幅度和速度都历史罕见,长端 10 年期国债收益率也从前期的 2.5%上行至接近 3.0%的位置,信用利差也有一定程度的走阔,债券收益率曲线由牛陡迅速切换至熊平。

组合管理上,2 月底前,本基金拉长了组合期限,主要配置 1 年内信用债和 ABS。3 月以后,投资收益率下降较快,组合剩余期限维持在 80 天左右的中性水平,同时提高杠杆率增厚组合收益。二季度组合整体保持中性策略配置,组合剩余期限维持在 90 天附近,杠杆率维持在 5%-10%之间。资产配置上,由于二季度整体存单性价比较低,组合更多的配置了回购资产和前期配置的信用债资产,维持一定杠杆提高组合收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,本基金份额净值收益率为 1.0797%,同期业绩比较基准收益率为 0.1745%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2020 年三季度,从基本面上看,经济复苏较为确定,当前供给端恢复仍然好于需求端,因此复苏节奏仍需观察,制造业投资仍是最大的拖累,叠加暑期大学生就业高峰,就业压力仍然较大;货币政策上,央行此次提前收紧货币抑制资金在金融市场空转,金融风险得到了较快释放,短端利率重回疫情前水平,配置价值重新显现。整体来看,经济复苏仍需巩固,CPI 和 PPI 的持续低位运行给货币政策提供了操作空间,短期内货币政策进一步收紧概率较小,短端的确定性较强。操作上,组合应提高资产流动性,将资产更多的配置在短期回购和 3 个月内的存单和高等级信用债上,将剩余期限维持在 90 天以内,适当保持杠杆率增厚收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

1. 基金估值程序

为了向基金投资人提供更好的证券投资管理服务,本基金管理人对估值和定价过程进行了严格控制。本基金管理人通过估值决策委员会来更有效的完善估值服务。估值决策委员会包括下列成员:分管基金运营业务的领导(委员会主席)、风险管理部负责人、权益投资负责人、固定收益投

资负责人、研究部负责人、交易部负责人、运营部负责人、基金会计主管（委员会秘书）。本基金管理人在充分衡量市场风险、信用风险、流动性风险、货币风险、衍生工具和结构性产品等影响估值和定价因素的基础上,综合运营部、稽核部、投资部、风控部和其它相关部门的意见,确定本基金管理人采用的估值政策。

估值政策和程序的确立和修订须经本基金管理人总经理批准后方可实行。基金在采用新投资策略或投资新品种时,应评价现有估值政策和程序的适用性,并在不适用的情况下,及时召开估值决策委员会。

在每个估值日,本基金管理人的运营部使用估值政策确定的估值方法,确定证券投资基金的份额净值。

基金管理人采用专用的估值业务系统进行基金核算及账务处理,对基金资产进行估值后,将基金份额净值结果发送基金托管人,基金托管人按照托管协议中“基金资产净值计算和会计核算”确定的规则复核,复核无误后,由基金管理人对外公布。

2. 基金管理人估值业务的职责分工

本基金管理人的估值业务采用双人双岗,所有业务操作需经复核方可生效。

3. 基金管理人估值人员的专业胜任能力和相关工作经历

本基金管理人的估值人员均具备估值业务所需的专业胜任能力,具有基金从业人员资格。

4. 基金经理参与或决定估值的程度

本基金管理人的后台与投资业务隔离,基金经理不直接参与或决定估值。

基金经理持续保持对基金估值所采用估值价格的关注,在认为基金估值所采用的估值价格不足够公允时,可申请召开估值决策委员会临时会议,通过会议讨论决定是否调整基金管理人所采用的估值政策。

5. 参与估值流程各方之间存在的任何重大利益冲突

参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

6. 已签约的与估值相关的任何定价服务的性质与程度

本基金未与任何第三方签订定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内根据每日基金收益情况,以每万份基金已实现收益为基础,为投资人每日计算当日收益并分配,且每日进行支付。该处理符合相关法律法规及《基金合同》约定。

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

本报告期内,本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元(基金份额持有人数量不满二百人)的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

5.3 托管人对中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：信诚薪金宝货币市场基金

报告截止日：2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	1,719,468.44	4,471,233,548.67
结算备付金	-	-	-
存出保证金	-	115.39	8,042.17
交易性金融资产	6.4.7.2	11,046,284,745.03	13,928,393,148.22
其中：股票投资	-	-	-
债券投资	-	10,276,490,145.80	13,636,895,121.09
资产支持证券投资	-	769,794,599.23	291,498,027.13
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,804,755,299.15	1,475,146,412.72
应收证券清算款	-	-	-
应收利息	6.4.7.5	77,215,571.89	81,053,731.19
应收股利	-	-	-
应收申购款	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计	-	14,929,975,199.90	19,955,834,882.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债：			
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	-	736,249,311.87	1,318,697,930.45
应付证券清算款	-	-	-
应付赎回款	-	-	-
应付管理人报酬	-	4,003,064.10	5,235,992.68
应付托管费	-	1,213,049.72	1,586,664.47
应付销售服务费	-	3,032,624.36	3,966,661.12
应付交易费用	6.4.7.7	126,792.84	95,906.12
应交税费	-	389,980.12	360,713.02
应付利息	-	45,064.84	110,543.00
应付利润	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-
其他负债	6.4.7.8	239,407.70	400,200.00

负债合计	-	745,299,295.55	1,330,454,610.86
所有者权益：	-	-	-
实收基金	6.4.7.9	14,184,675,904.35	18,625,380,272.11
未分配利润	6.4.7.10	-	-
所有者权益合计	-	14,184,675,904.35	18,625,380,272.11
负债和所有者权益总计	-	14,929,975,199.90	19,955,834,882.97

注：截止本报告期末，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 14,184,675,904.35 份。

6.2 利润表

会计主体：信诚薪金宝货币市场基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
一、收入	-	253,373,896.47	550,634,867.73
1. 利息收入	-	252,468,593.96	545,009,606.74
其中：存款利息收入	6.4.7.11	49,398,969.26	61,014,535.48
债券利息收入	-	173,916,142.89	460,019,550.20
资产支持证券利息收入	-	8,727,735.70	4,334,524.48
买入返售金融资产收入	-	20,425,746.11	19,640,996.58
证券出借利息收入	-	-	-
其他利息收入	-	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	-	905,302.51	5,625,260.99
其中：股票投资收益	-	-	-
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	6.4.7.12	858,797.90	5,633,448.07
资产支持证券投资	6.4.7.12.5	46,504.61	-8,187.08
贵金属投资收益	-	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	-	-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
减：二、费用	-	65,894,775.65	118,985,439.58
1. 管理人报酬	-	28,297,399.46	49,874,911.92
2. 托管费	-	8,574,969.50	15,113,609.66
3. 销售服务费	-	21,437,423.90	37,784,024.30
4. 交易费用	6.4.7.17	-150.00	-
5. 利息支出	-	7,170,816.95	15,625,789.77
其中：卖出回购金融资产支出	-	7,170,816.95	15,625,789.77
6. 税金及附加	-	233,838.14	354,878.44

7. 其他费用	6. 4. 7. 18	180, 477. 70	232, 225. 49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	-	187, 479, 120. 82	431, 649, 428. 15
减：所得税费用	-	-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	-	187, 479, 120. 82	431, 649, 428. 15

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：信诚薪金宝货币市场基金

本报告期：2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 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）	18, 625, 380, 272. 11	0. 00	18, 625, 380, 272. 11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	187, 479, 120. 82	187, 479, 120. 82
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）	-4, 440, 704, 367. 76	0. 00	-4, 440, 704, 367. 76
其中：1. 基金申购款	23, 280, 535, 602. 88	0. 00	23, 280, 535, 602. 88
2. 基金赎回款	- 27, 721, 239, 970. 64	0. 00	- 27, 721, 239, 970. 64
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）	0. 00	- 187, 479, 120. 82	- -187, 479, 120. 82
五、期末所有者权益（基金净值）	14, 184, 675, 904. 35	0. 00	14, 184, 675, 904. 35
项目	上年度可比期间 2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 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）	35, 388, 401, 504. 09	0. 00	35, 388, 401, 504. 09
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	431, 649, 428. 15	431, 649, 428. 15
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, 994, 453, 956. 09	0. 00	-9, 994, 453, 956. 09
其中：1. 基金申购款	48, 846, 563, 909. 38	0. 00	48, 846, 563, 909. 38
2. 基金赎回款	- 58, 841, 017, 865. 47	0. 00	- 58, 841, 017, 865. 47
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）	0. 00	- 431, 649, 428. 15	- -431, 649, 428. 15
五、期末所有者权益（基金净值）	25, 393, 947, 548. 00	0. 00	25, 393, 947, 548. 00

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：

唐世春

陈逸辛

刘卓

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

信诚薪金宝货币市场基金(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[2014]281号《关于核准信诚薪金宝货币市场基金募集的批复》核准,由中信保诚基金管理有限公司(原名为“信诚基金管理有限公司”)依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《信诚薪金宝货币市场基金基金合同》和《信诚薪金宝货币市场基金招募说明书》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人民币 374,957,052.03 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第 218 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《信诚薪金宝货币市场基金基金合同》于正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 374,965,569.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 8,516.97 份基金份额。本基金的基金管理人为中信保诚基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据中信保诚基金管理有限公司于 2017 年 12 月 20 日发布的《中信保诚基金管理有限公司关于公司名称变更的函》,经中华人民共和国国家工商行政管理总局核准,公司名称由“信诚基金管理有限公司”变更为“中信保诚基金管理有限公司”,并由上海市工商行政管理局于 2017 年 12 月 18 日核发新的营业执照。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《信诚薪金宝货币市场基金基金合同》和最新公布的《信诚薪金宝货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括现金,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,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,剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券、中期票据,以及中国证监会及/或中国人民银行认可的其他具有良好流动性的金融工具。本基金业绩比较基准:活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础。本财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计(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)

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计除 6.4.5 所列变更外,与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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。

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》、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附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
活期存款	1,719,468.44
定期存款	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
合计	1,719,468.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2020年06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	1,134,683.06	1,134,246.30	-436.76	-
	银行间市场	10,275,355,462.74	10,276,184,400.00	828,937.26	0.0058
	合计	10,276,490,145.80	10,277,318,646.30	828,500.50	0.0058
资产支持证券		769,794,599.23	770,646,600.00	852,000.77	0.0060
合计		11,046,284,745.03	11,047,965,246.30	1,680,501.27	0.0118

注：偏离金额=影子定价-摊余成本，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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	672,008,000.00	-
银行间市场	3,132,747,299.15	-
合计	3,804,755,299.15	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	5,821.13
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	66,381,398.51
应收资产支持证券利息	8,705,663.11
应收买入返售证券利息	1,805,927.55
应收申购款利息	316,761.49
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	0.10
合计	77,215,571.89

注：其他包括应收结算保证金利息、应收中金所清算备付金利息。

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06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	126,792.84
合计	126,792.84

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付审计费	169,535.36
应付信息披露费	59,672.34
应付账户维护费	9,000.00

应付其他费用	1,200.00
合计	239,407.70

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,625,380,272.11	18,625,380,272.11
本期申购	23,280,535,602.88	23,280,535,602.88
本期赎回（以“-”号填列）	-27,721,239,970.64	-27,721,239,970.64
本期末	14,184,675,904.35	14,184,675,904.35

注：申购含红利再投（如有）、转换入份额（如有），赎回含转换出份额（如有）。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	187,479,120.82	-	187,479,120.82
本期基金份额交易产生的变动数	-	-	0.00
其中：基金申购款	-	-	0.00
基金赎回款	-	-	0.00
本期已分配利润	-187,479,120.82	-	-187,479,120.82
本期末	-	-	-

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	49,072,750.01
结算备付金利息收入	6.51
其他	316,767.43
合计	49,398,969.26

注：1、其他存款利息收入为有存款期限、但根据协议可提前支取且没有利息损失的协议存款的利息收入。

2、其他包括直销申购款利息收入、结算保证金利息收入、中金所清算备付金利息收入。

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
	债券投资收益--买卖债券(、债转股及债券到期兑付)差价收入

债券投资收益--赎回差价收入	-
债券投资收益--申购差价收入	-
合计	858,797.90

6.4.7.12.2 债券投资收益--买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	25,308,575,938.14
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	25,180,773,846.42
减：应收利息总额	126,943,293.82
买卖债券差价收入	858,797.90

6.4.7.12.3 债券投资收益--赎回差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.12.4 债券投资收益--申购差价收入

本基金本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.12.5 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出资产支持证券成交总额	355,561,634.28
减：卖出资产支持证券成本总额	352,308,395.39
减：应收利息总额	3,206,734.28
资产支持证券投资收益	46,504.61

6.4.7.13 衍生工具收益**6.4.7.13.1 衍生工具收益--买卖权证差价收入**

本基金本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

6.4.7.13.2 衍生工具收益--其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具收益-其他投资收益。

6.4.7.14 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.15 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.16 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.17 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	-
银行间市场交易费用	-150.00
合计	-150.00

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
审计费用	84,535.36
信息披露费	59,672.34
银行费用	17,670.00
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	180,477.70

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需要说明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

本报告期存在控制关系或其他重大利害的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信保诚基金管理有限公司（“中信保诚基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司（“中信银行”）	基金托管人、基金销售机构
中信信诚资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 基金交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的基金交易。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	28,297,399.46	49,874,911.92
其中：支付销售机构的客户维护费	17,938,257.24	33,154,432.94

注：支付基金管理人中信保诚基金管理有限公司的基金管理费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。计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	8,574,969.50	15,113,609.66

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信保诚基金	3,307,157.74
中信银行	17,430,658.32
合计	20,737,816.06
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
中信保诚基金	4,629,591.36
中信银行	33,154,432.94
合计	37,784,024.30

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 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：

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

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

本基金在本报告期内与上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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	上年度可比期间
	2020 年 01 月 01 日至 2020 年 06 月 30 日	2019 年 01 月 01 日至 2019 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2014 年 05 月 14 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	21,532,944.64	50,883,951.12
报告期间申购/买入总份额	152,605,355.64	60,919.36
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	138,000,000.00	50,376,411.24

报告期末持有的基金份额	36,138,300.28	568,459.24
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.25%	0.00%

注：本基金的基金管理人运用固有资金投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例	持有的 基金份额	持有的基金份 额 占基金总份 额 的比例
中信信诚资产管理有限 公司	101,096,361.57	0.71%	100,015,003.58	0.54%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金费率按本基金基金合同公布的费率执行。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30 日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行	1,719,468.44	9,445.31	1,197,183,216.85	4,191,342.54

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

6.4.10.7.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配 合计	备注
187,479,120.82	-	-	187,479,120.82	-

6.4.12 期末 2020 年 06 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/增发流通受限证券。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 736,249,311.87 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
150220	15 国开 20	2020 年 07 月 01 日	100.38	1,500,000	150,570,000.00
170209	17 国开 09	2020 年 07 月 01 日	100.46	4,920,000	494,263,200.00
190211	19 国开 11	2020 年 07 月 01 日	100.19	730,000	73,138,700.00
209923	20 贴现国 债 23	2020 年 07 月 01 日	99.75	600,000	59,850,000.00
合计				7,750,000	777,821,900.00

6.4.12.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

本基金属于货币市场基金,预期风险与预期收益低于债券型基金、混合型基金及股票型基金,属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种。本基金投资的金融工具主要包括具有良好流动性的货币市场工具等。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。

本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设。在董事会下设立风控与审计委员会,负责制定风险管理的宏观政策,设定最高风险承受度以及审议批准防范风险和内部控制的政策等;在管理层层面设立风险管理委员会,实施董事会风控与审计委员会制定的各项风险管理和内部控制政策;公司设立独立的监察稽核部和风险管理部,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。监察稽核部和风险管理部日常向督察长汇报工作。

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析各类风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统对风险进行持续监控。

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,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银行,本基金在选择定期存款存放的银行前通过审慎评估其信用风险并通过额度控制的方法以控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。另外,本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程,审慎进行债券投资,通过信用评级和分散化投资以分散信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	1,270,293,790.50	1,730,735,872.89
A-1 以下	-	-
未评级	3,616,075,851.45	2,529,000,020.70
合计	4,886,369,641.95	4,259,735,893.59

注:以上评级取自第三方评级机构的债项评级,未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
AAA	463,346,187.37	195,304,800.00
未评级	223,549,946.60	-
合计	686,896,133.97	195,304,800.00

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	4,745,080,893.47	8,704,298,912.63
合计	4,745,080,893.47	8,704,298,912.63

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，同业存单无债项评级。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	-	120,860,725.49
AAA 以下	-	-
未评级	645,039,610.38	551,999,589.38
合计	645,039,610.38	672,860,314.87

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级，未评级债券为国债、政策性金融债等无信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2020 年 06 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
AAA	82,898,465.26	96,193,227.13
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	82,898,465.26	96,193,227.13

注：以上评级取自第三方评级机构的债项评级。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本报告期末及上年度末均未持有长期同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险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，另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。

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。针对资产变现流动性风险，本基金管理人严格控制流通受限资产的投资限额，并及时追踪持仓证券的流动性情况，综合持有人赎回变动情况对流动性风险进行管理。

本基金本报告期末，除所持有的卖出回购金融资产款将在一年以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所持有的其他金融负债无固定到期日或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，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《货币市场基金监督管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、流动性受限资产占比，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50% 时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。本报告期末，本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例小于 20%（不含基金管理人固有资金投资的基金份额），本基金投资组合的平均剩余期限未超过 120 天，平均剩余存续期未超过 240 天，本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不低于 10%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不得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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 10%。本报告期末，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的 10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期末，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量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。

本基金持有有一定比例的交易所及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 2020年06 月30日	1个月内	1-3个月	3个月-1年	1-5 年	5年以 上	不计息	合计
资产							
银行存款	1,719,468.44	-	-	-	-	-	1,719,468.44
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	115.39	-	-	-	-	-	115.39
交易性金融 资产	1,211,599,366 .76	5,108,730,974 .25	4,725,954,404 .02	-	-	-	11,046,284,74 5.03
衍生金融资 产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金 融资产	3,804,755,299 .15	-	-	-	-	-	3,804,755,299 .15
应收证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	77,215,571 .89	77,215,571.89
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税 资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	5,018,074,249 .74	5,108,730,974 .25	4,725,954,404 .02	-	-	77,215,571 .89	14,929,975,19 9.90
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	736,249,311.8 7	-	-	-	-	-	736,249,311.8 7
应付证券清 算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人 报酬	-	-	-	-	-	4,003,064. 10	4,003,064.10
应付托管费	-	-	-	-	-	1,213,049. 72	1,213,049.72
应付销售服	-	-	-	-	-	3,032,624.	3,032,624.36

务费						36	
应付交易费用	-	-	-	-	-	126,792.84	126,792.84
应交税费	-	-	-	-	-	389,980.12	389,980.12
应付利息	-	-	-	-	-	45,064.84	45,064.84
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	239,407.70	239,407.70
负债总计	736,249,311.87	-	-	-	-	9,049,983.68	745,299,295.55
利率敏感度缺口	4,281,824,937.87	5,108,730,974.25	4,725,954,404.02	-	-	68,165,588.21	14,184,675,904.35
上年度末 2019年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	801,233,548.67	900,000,000.00	2,770,000,000.00	-	-	-	4,471,233,548.67
结算备付金	-	-	-	-	-	-	-
存出保证金	8,042.17	-	-	-	-	-	8,042.17
交易性金融资产	1,745,805,869.83	7,107,599,603.98	5,074,987,674.41	-	-	-	13,928,393,148.22
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	470,054,545.08	1,005,091,867.64	-	-	-	-	1,475,146,412.72
应收证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收利息	-	-	-	-	-	81,053,731.19	81,053,731.19
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,017,102,005.75	9,012,691,471.62	7,844,987,674.41	-	-	81,053,731.19	19,955,834,882.97
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金	1,318,697,930	-	-	-	-	-	1,318,697,930

融资产款	.45						.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	5,235,992.68	5,235,992.68
应付托管费	-	-	-	-	-	1,586,664.47	1,586,664.47
应付销售服务费	-	-	-	-	-	3,966,661.12	3,966,661.12
应付交易费用	-	-	-	-	-	95,906.12	95,906.12
应交税费	-	-	-	-	-	360,713.02	360,713.02
应付利息	-	-	-	-	-	110,543.00	110,543.00
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	400,200.00	400,200.00
负债总计	1,318,697,930.45	-	-	-	-	11,756,680.41	1,330,454,610.86
利率敏感度缺口	1,698,404,075.30	9,012,691,471.62	7,844,987,674.41	-	-	69,297,050.78	18,625,380,272.11

注：上表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年06月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	市场利率下降 25 个基点	8,280,984.22	8,854,335.19
市场利率上升 25 个基点	-8,263,689.08	-8,837,940.40	

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

其他价格风险主要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。本基金的其他价格风险，主要受到证券交易所上市的股票整体涨跌趋势的影响，由所持有的金融工具的公允价值决定。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，通过组合估值、行业配置分析等进行市场价格风险管理。

本基金未持有证券交易所上市股票，因此无重大其他价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于本报告期末及上年度末，本基金未持有对其他价格风险敏感的金融资产与负债。因此其他价格风险的变动对本基金资产的净值无重大影响。

6.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第二层次的余额为 22,114,559,645.03 元，无属于第一或第三层次的余额(上年度末：第二层次 13,928,393,148.22 元，无第一或第三层次)

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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次未发生重大变动。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(上年度末：同)。

(d) 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。

(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。

§ 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	11,046,284,745.03	73.99
	其中：债券	10,276,490,145.80	68.83
	资产支持证券	769,794,599.23	5.16
2	买入返售金融资产	3,804,755,299.15	25.48
	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	1,719,468.44	0.01
4	其他各项资产	77,215,687.28	0.52
5	合计	14,929,975,199.90	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	5.31
	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	736,249,311.87	5.19
	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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

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	85
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	94
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	68

注：本基金合同约定，本基金管理人将动态确定并控制投资组合平均剩余期限在 120 天以内，以规避较长期限债券的利率风险。

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本基金本报告期内未出现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	33.55	5.19
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	8.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	26.34	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	6.62	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	29.72	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		104.71	5.19

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

本基金本报告期内未出现投资组合平均剩余存续期超过 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	69,869,508.07	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,124,374,111.71	7.93
	其中：政策性金融债	1,124,374,111.71	7.93
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	4,337,165,632.55	30.58
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,745,080,893.47	33.45
8	其他	-	-
9	合计	10,276,490,145.80	72.45
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	112021212	20 渤海银行 CD212	5,000,000	496,693,175.01	3.50
2	170209	17 国开 09	4,920,000	494,431,517.28	3.49
3	111977845	19 东亚银行 CD062	4,000,000	397,467,547.84	2.80
4	042000045	20 鞍钢集 CP001	3,000,000	300,003,656.09	2.11
5	112021257	20 渤海银行 CD257	3,000,000	298,578,733.30	2.10
6	207706	20 贴现国开 06	3,000,000	298,461,538.97	2.10
7	112009235	20 浦发银行 CD235	3,000,000	298,419,292.65	2.10
8	112099608	20 宁波银行 CD092	3,000,000	298,080,821.41	2.10
9	012000527	20 冀中能源 SCP004	2,000,000	200,002,578.56	1.41
10	012001113	20 鞍钢集 SCP001	2,000,000	200,000,072.93	1.41

7.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1983%
报告期内偏离度的最低值	-0.0060%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1157%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内未出现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

本基金本报告期内未出现正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	摊余成本	占基金资产净值比例（%）
1	138604	创恒 01A	780,000	78,000,000.00	0.55
2	138414	招慧 07A	760,000	76,027,946.60	0.54
3	138514	元熹 5 优 1	680,000	68,000,000.00	0.48
4	138633	海诺 2A1	620,000	62,000,000.00	0.44
5	138486	锦绣 06A	550,000	55,000,000.00	0.39
6	138703	海诺 3A1	510,000	51,000,000.00	0.36
7	165292	聚盈 03A	500,000	50,000,000.00	0.35
8	168012	恒信 23A1	450,000	45,000,000.00	0.32
9	138544	元熹 6 优 1	440,000	44,000,000.00	0.31
10	138008	国链 13A2	400,000	40,229,613.55	0.28

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。

7.9.2 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚说明

宁波银行股份有限公司于 2019 年 12 月 5 日收到宁波银保监局的处罚（甬银保监罚决字[2019]67 号），宁波银行因股权质押管理不合规等事项被宁波银保监局责令对相关直接责任人给予纪律处分，并罚款 40 万元。

中国民生银行股份有限公司于 2019 年 12 月 14 日收到北京银保监局的处罚（京银保监罚决字(2019)56 号），民生银行因违规提供担保及财务资助被北京银保监局责令改正并处 700 万元罚款。民生银行股份有限公司于 2020 年 2 月 10 日收到中国人民银行的处罚（银罚字[2020]1 号），民生银行因违反反洗钱，未依法履行职责被中国人民银行罚款 2360 万元。

对“20 宁波银行 CD092、19 民生银行 CD312”的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究该投资标的的信用资质，我们认为，该处罚事项未对宁波银行和民生银行的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对该投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体均没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	115.39
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	77,215,571.89
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	77,215,687.28

7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中摊余成本占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
969,832	14,625.91	2,613,127,774. 42	18.42%	11,571,548,129. 93	81.58%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例
1	银行类机构	1,120,452,044.12	7.90%
2	银行类机构	511,890,953.60	3.61%
3	其他机构	284,898,037.25	2.01%
4	银行类机构	200,109,211.18	1.41%
5	保险类机构	105,873,502.98	0.75%
6	基金类机构	101,096,361.57	0.71%
7	其他机构	70,218,047.92	0.50%
8	保险类机构	62,382,505.46	0.44%
9	保险类机构	53,091,291.06	0.37%
10	银行类机构	50,222,099.09	0.35%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,534,803.69	0.02%

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情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基 金	>100
本基金基金经理持有本开放式基 金	0~10

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2014 年 05 月 14 日）基金份额总额	374,965,569.00
本报告期期初基金份额总额	18,625,380,272.11
本报告期基金总申购份额	23,280,535,602.88
减：本报告期基金总赎回份额	27,721,239,970.64
本报告期基金拆分变动份额	-
报告期期末基金份额总额	14,184,675,904.35

§ 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

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金进行审计的会计师事务所是普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)。该会计师事务所自本基金基金合同生效日起为本基金提供审计服务至今。

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、基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

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	
长城证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西藏东财	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
长城证券	1,137,078.80	0.88%	1,037,800.00	77.15%	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东财	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	127,544,500.00	99.12%	307,392,000.00	22.85%	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：本基金根据券商的研究实力和服务水平选择专用席位。由研究部牵头对席位候选券商的研究实力和服务质量进行评估，并综合考虑候选券商的综合实力，由研究总监和投资总监审核批准。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过 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	中信保诚基金管理有限公司旗下证券投资基金 2019 年 12 月 31 日基金份额净值和基金份额累计净值公告	《上海证券报》及/或基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2020年01月01日
2	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告 中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年第四季度报告提示性公告	同上	2020年01月17日
3	信诚薪金宝货币市场基金 2019 年第四季度报告	同上	2020年01月17日
4	中信保诚基金管理有限公司关于调整旗下基金业务开放日及开放时间的提示性公告	同上	2020年01月30日
5	中信保诚基金管理有限公司关于推迟披露旗下基金 2019 年年度报告的公告	同上	2020年03月21日
6	中信保诚基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料以免影响日常交易的公告	同上	2020年04月14日

7	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2020 年第一季度报告提示性公告	同上	2020年04月22日
8	信诚薪金宝货币市场基金 2020 年第一季度报告	同上	2020年04月22日
9	中信保诚基金管理有限公司旗下全部基金 2019 年年度报告提示性公告	同上	2020年04月25日
10	信诚薪金宝货币市场基金 2019 年年度报告	同上	2020年04月25日
11	中信保诚基金管理有限公司关于核心系统升级期间暂停薪金煲业务安排的提示性公告	同上	2020年04月29日
12	信诚薪金宝货币市场基金更新招募说明书（2020 年 5 月）	同上	2020年05月28日
13	信诚薪金宝货币市场基金更新招募说明书摘要（2020 年 5 月）	同上	2020年05月28日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、信诚薪金宝货币市场基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚薪金宝货币市场基金基金合同
- 4、信诚薪金宝货币市场基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

12.2 存放地点

中信保诚基金管理有限公司办公地—中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心汇丰银行大楼 9 层。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2020 年 08 月 28 日