

宝盈货币市场证券投资基金 2022 年中期报告

2022 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：2022 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 30 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 2022 年 1 月 1 日起至 6 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
3.3 其他指标	8
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 债券回购融资情况	41
7.3 基金投资组合平均剩余期限	42
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	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
7.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	43
7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	43

7.8 期末按实际利率计算的账面价值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	44
7.9 投资组合报告附注	44
§ 8 基金份额持有人信息	46
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	46
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	46
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§ 9 开放式基金份额变动	47
§ 10 重大事件揭示	47
10.1 基金份额持有人大会决议	47
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	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	48
10.4 基金投资策略的改变	48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	48
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	48
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	48
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	49
10.9 其他重大事件	49
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	51
§ 12 备查文件目录	51
12.1 备查文件目录	51
12.2 存放地点	51
12.3 查阅方式	51

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	宝盈货币市场证券投资基金	
基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2009 年 8 月 5 日	
基金管理人	宝盈基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	29,317,539,998.48 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	23,097,754,695.49 份	6,219,785,302.99 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。
投资策略	本基金运用利率预测、相对价值评估、收益率利差策略、套利交易策略等积极的投资策略相结合，对各类可投资资产进行合理的配置和选择。投资策略考虑各类资产的风险性、流动性及收益性特征，把风险控制在预算之内，在不增加风险的基础上保持高流动性，最终追求稳定的收益。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。 本基金定位于现金管理的工具，采用活期存款税后利率作为本基金的业绩比较基准，更能体现本基金良好的流动性与安全性。 如果今后有其它代表性更强的业绩比较基准推出，或有更科学客观的权重比例适用于本基金时，本基金管理人可依据维护基金份额持有人合法权益的原则，对业绩比较基准进行相应调整。业绩比较基准的变更需经基金管理人和基金托管人协商一致，在履行适当程序后实施，并在更新的招募说明书中列示。
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	张磊
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangl@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	021-60637111
传真	0755-83515599	021-60635778
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华一路 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	严震	田国立
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年01月01日-2022年06月30日)	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
本期已实现收益	185,286,192.83	39,249,100.60
本期利润	185,286,192.83	39,249,100.60
本期净值收益率	0.9496%	1.0696%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)	
期末基金资产净值	23,097,754,695.49	6,219,785,302.99
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(2022年6月30日)	
累计净值收益率	47.4754%	52.1141%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。

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	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①—③	②—④
----	------	------	-------	--------	-----	-----

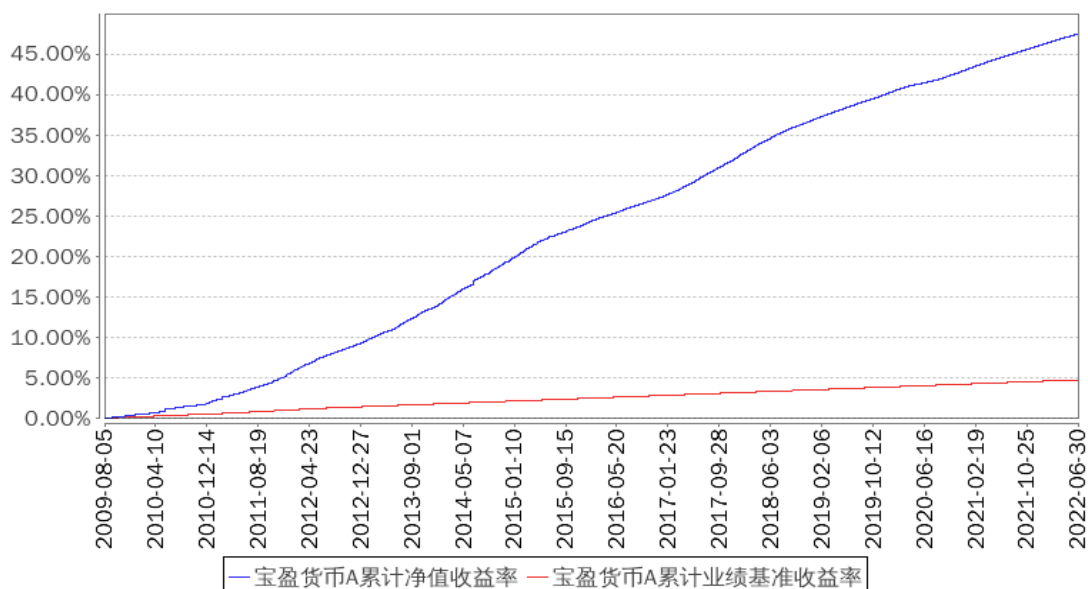
	收益率①	收益率标准 差②	准收益率③	收益率标准 差④		
过去一个月	0.1489%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.1201%	0.0010%
过去三个月	0.4545%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.3672%	0.0007%
过去六个月	0.9496%	0.0007%	0.1736%	0.0000%	0.7760%	0.0007%
过去一年	1.9807%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	1.6307%	0.0007%
过去三年	6.4064%	0.0016%	1.0510%	0.0000%	5.3554%	0.0016%
自基金合同生效 起至今	47.4754%	0.0089%	4.7223%	0.0001%	42.7531%	0.0088%

宝盈货币 B

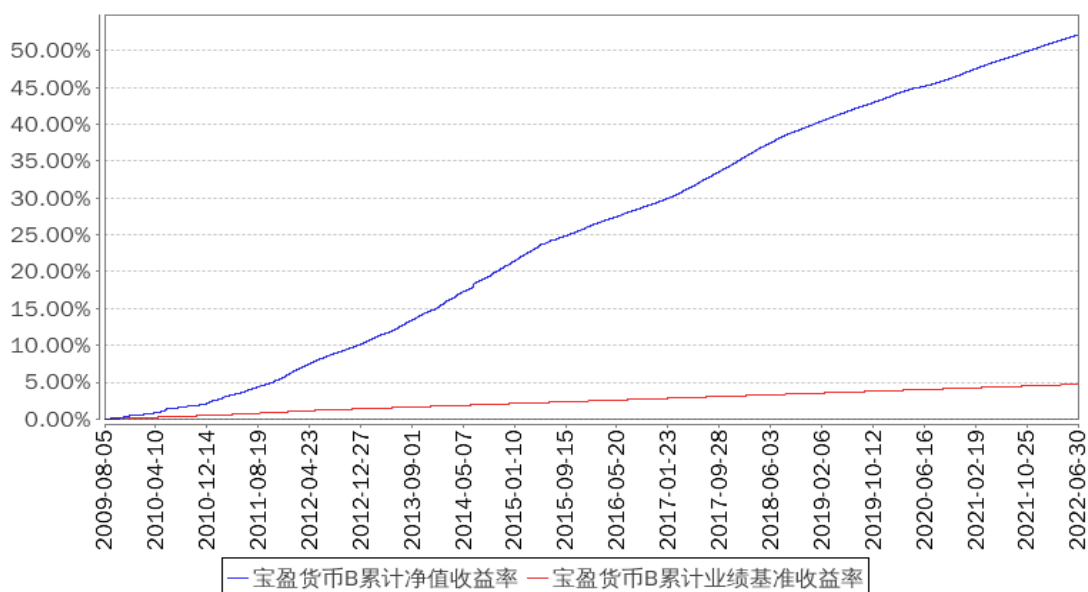
阶段	份额净值 收益率①	份额净值 收益率标准 差②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标准 差④	①—③	②—④
过去一个月	0.1685%	0.0010%	0.0288%	0.0000%	0.1397%	0.0010%
过去三个月	0.5146%	0.0007%	0.0873%	0.0000%	0.4273%	0.0007%
过去六个月	1.0696%	0.0007%	0.1736%	0.0000%	0.8960%	0.0007%
过去一年	2.2256%	0.0007%	0.3500%	0.0000%	1.8756%	0.0007%
过去三年	7.1730%	0.0016%	1.0510%	0.0000%	6.1220%	0.0016%
自基金合同生效 起至今	52.1141%	0.0089%	4.7223%	0.0001%	47.3918%	0.0088%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

宝盈货币A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



宝盈货币B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



3.3 其他指标

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人：宝盈基金管理有限公司是 2001 年按照证监会“新的治理结构、新的内控体系”标准设立的首批基金管理公司之一，2001 年 5 月 18 日成立，注册资本为人民币 1 亿元，注册地

在深圳。公司目前管理宝盈鸿利收益混合、宝盈泛沿海混合、宝盈策略增长混合、宝盈增强收益债券、宝盈资源优选混合、宝盈核心优势混合、宝盈货币、宝盈中证 100 指数增强、宝盈新价值混合、宝盈祥瑞混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰混合、宝盈优势产业混合、宝盈新锐混合、宝盈医疗健康沪港深股票、宝盈国家安全沪港深股票、宝盈互联网沪港深混合、宝盈消费主题混合（由原基金鸿阳转型而来）、宝盈盈泰纯债债券、宝盈人工智能股票、宝盈安泰短债债券、宝盈祥颐定期开放混合、宝盈聚享定期开放债券、宝盈品牌消费股票、宝盈盈润纯债债券、宝盈融源可转债债券、宝盈聚丰两年定开债券、宝盈研究精选混合、宝盈祥利稳健配置混合、宝盈祥泽混合、宝盈鸿盛债券、宝盈龙头优选股票、宝盈祥明一年定开混合、宝盈盈旭纯债债券、宝盈现代服务业混合、宝盈创新驱动股票、宝盈聚福 39 个月定开债、宝盈发展新动能股票、宝盈祥裕增强回报混合、宝盈盈沛纯债债券、宝盈基础产业混合、宝盈智慧生活混合、宝盈祥乐一年持有期混合、宝盈祥庆 9 个月持有混合、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数、宝盈优质成长混合、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数、宝盈成长精选混合、宝盈品质甄选混合、宝盈祥和 9 个月定开混合、宝盈安盛中短债债券、宝盈祥琪混合、宝盈新能源产业混合发起式五十七只基金，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		
杨献忠	本基金、宝盈聚享纯债定期开放债券型发起式证券投资基金、宝盈盈润纯债债券型证券投资基金、宝盈盈沛纯债债券型证券投资基金、宝盈聚福 39 个月定期开放债券型证券投资基金、宝盈聚丰两年定期开放债券型证券投资基金、宝盈安盛	2018 年 4 月 21 日	-	8 年	杨献忠先生，中国人民大学金融学硕士。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，宝盈盈辉纯债债券型证券投资基金基金经理。中国国籍，

	中短债债券型证券投资基金基金经理				证券投资基金从业人员资格。
吕姝仪	本基金、宝盈祥利稳健配置混合型证券投资基金、宝盈祥泽混合型证券投资基金、宝盈祥裕增强回报混合型证券投资基金、宝盈祥颐定期开放混合型证券投资基金、宝盈中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、宝盈祥乐一年持有期混合型证券投资基金、宝盈祥庆 9 个月持有期混合型证券投资基金、宝盈中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、宝盈祥琪混合型证券投资基金基金经理	2019 年 3 月 30 日	-	9 年	吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。2012 年 7 月至 2013 年 9 月在中山证券有限责任公司任投资经理助理，2013 年 10 月至 2015 年 9 月在民生加银基金管理有限公司任债券交易员，2015 年 9 月至 2017 年 12 月在东兴证券股份有限公司基金业务部任基金经理。2017 年 12 月加入宝盈基金管理有限公司，历任投资经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。

注：1、本基金基金经理均非首任基金经理，其“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2022 年 6 月 30 日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

报告期内本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

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，国际环境复杂多变，多数国家通胀迅速上行，海外经济复苏放缓；国内疫情反弹得到有效控制后，经济总体企稳回升。通胀方面，主要工业品和农业品价格均显著上行后快速回落，居民消费价格同比涨幅持续扩大但仍低于通胀目标。

报告期内，人民银行认真贯彻党中央、国务院部署，加大稳健的货币政策实施力度，发挥货币政策工具的总量和结构双重功能，主动应对，努力服务实体经济，稳住经济大盘。报告期内，为保持流动性合理充裕，人民银行延续每日连续开展公开市场操作和每月中固定时间开展中期借贷便利（MLF）操作的惯例。1 季度，人民银行下调中期借贷便利和公开市场逆回购中标利率，资金面维持宽松、季末先紧后松，货币市场利率先下后上再下、季末冲高回落。2 季度，人民银行下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点（不含已执行 5% 存款准备金率的金融机构），资金面超预期宽松、季末小幅收紧，货币市场利率先下后上再下。报告期内，商业银行同业融资压力不高，协议存款和同业存单利率震荡下行后小幅回升。债券市场方面，短期品种 1 年期国开债先下后上再下、整体显著下行，上半年最高 2.35%，半年末下行至 2.02% 左右、较去年末下行约 30bp；长期品种 10 年期国开债区间震荡、整体变化不大，上半年最高 3.12%，半年末收至 3.05% 左右、与去年末基本持平。

报告期内，资金面维持宽松，货币市场利率震荡下行。我们灵活调整了组合久期和杠杆水平，在 1 季度末和 6 月上旬积极配置了收益率较高的同业存款、同业存单和信用债。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期宝盈货币 A 的基金份额净值收益率为 0.9496%，本报告期宝盈货币 B 的基金份额净值

收益率为 1.0696%，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，判断国内经济进入弱复苏阶段。具体来看，随着疫情的逐步缓解，前期出台的宽信用政策有望逐步见效，海外高通胀推动货币政策收紧、外部需求下行拖累出口，制造业投资动能趋弱，“房住不炒”背景下地产投资也难有大的起色，基建投资可能是唯一亮点，消费场景、能力和意愿均受到疫情约束和冲击。值得关注的是，下半年 CPI 有可能在猪周期上行带动下破 3。宽信用“政策”仍处于向基本面“数据”的转化中，短期货币政策维持宽松是比较确认的，但在海外货币政策收紧和国内政策利率中枢双重约束下很难进一步宽松。

目前，债券市场交易核心重回宽信用验证，宽信用虽无法证伪但很难一帆风顺，短端利率有回归政策利率的风险，后续利率债有望走出震荡偏弱行情；信用债绝对收益率和信用利差均处于历史相对低位区间，可适度关注品种下沉和强担保的弱主体；货币市场宽松格局短期有望维持，市场利率逐步向政策利率靠拢，持续跟踪货币政策以及资金面的变化，择机配置性价比高的资产。

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、督察长及研究部、投资部门（权益投资部、固定收益部等）、风险管理部、基金运营部、监察稽核部总经理共同组成，以上人员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。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、流通受限股票等估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金基金合同的约定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月支付。每日进行收益计算并分配时，每月累计收益支付方式只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，投资者可通过赎回基金份额获得现金收益。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净

值低于五千万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本基金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，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,053,919,442.19	10,005,475,381.91
结算备付金		-	-
存出保证金		20,695.62	2,278.76
交易性金融资产	6.4.7.2	14,284,211,743.39	11,818,484,528.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		14,284,211,743.39	11,818,484,528.75
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	7,168,885,263.91	2,219,610,929.40
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		4,228,627.78	4,124,388.21
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	694,766.67	81,939,213.88
资产总计		30,511,960,539.56	24,129,636,720.91
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021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		1,178,578,956.16	709,999,245.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,165,033.86	12,562,484.47
应付管理人报酬		6,661,992.46	10,730,977.73
应付托管费		2,018,785.64	1,690,500.54
应付销售服务费		4,289,214.90	3,657,421.35
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,975.63	1,840.38
应付利润		1,303,666.14	1,436,272.58
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	379,916.29	535,010.50
负债合计		1,194,420,541.08	740,613,752.55
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,317,539,998.48	23,389,022,968.36
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		29,317,539,998.48	23,389,022,968.36
负债和净资产总计		30,511,960,539.56	24,129,636,720.91

注：1、报告截止日 2022 年 06 月 30 日，宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金份额净值人民币 1.0000 元，A 类基金份额 23,097,754,695.49 份；B 类基金份额净值人民币 1.0000 元，B 类基金份额 6,219,785,302.99 份；宝盈货币市场证券投资基金基金份额总额合计为 29,317,539,998.48 份。

2、以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应收利息”

与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示于 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年 12 月 31 日资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		311,240,136.11	242,379,872.38
1. 利息收入		149,429,997.77	232,542,573.11
其中：存款利息收入	6.4.7.13	124,910,644.53	51,006,191.71
债券利息收入		-	152,098,054.27
资产支持证券利息收入		-	668,465.66
买入返售金融资产收入		24,519,353.24	28,769,861.47
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		161,810,138.34	9,837,299.27
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	161,810,138.34	9,837,299.27
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		86,704,842.68	61,850,731.05

1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	38,176,275.50	26,443,192.14
2. 托管费	6.4.10.2.2	11,568,568.41	8,013,088.45
3. 销售服务费		24,531,222.42	16,804,737.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		12,220,703.81	10,384,333.42
其中：卖出回购金融资产支出		12,220,703.81	10,384,333.42
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		18,245.44	22,481.09
8. 其他费用	6.4.7.23	189,827.10	182,898.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		224,535,293.43	180,529,141.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		224,535,293.43	180,529,141.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		224,535,293.43	180,529,141.33

注：以上比较财务信息已根据最新的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	23,389,022,968.36	-	-	23,389,022,968.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	23,389,022,968.36	-	-	23,389,022,968.36
三、本期增减变	5,928,517,030.12	-	-	5,928,517,030.12

动额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	224,535,293.43	224,535,293.43
(二)、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)	5,928,517,030.12	-	-	5,928,517,030.12
其中:1.基金申购款	108,808,574,647.74	-	-	108,808,574,647.74
2.基金赎回款	-102,880,057,617.62	-	-	-102,880,057,617.62
(三)、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)	-	-	-224,535,293.43	-224,535,293.43
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	29,317,539,998.48	-	-	29,317,539,998.48
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	10,419,789,979.48	-	-	10,419,789,979.48
加:会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	10,419,789,979.48	-	-	10,419,789,979.48
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	12,316,954,038.09	-	-	12,316,954,038.09
(一)、综合收益总额	-	-	180,529,141.33	180,529,141.33
(二)、本期基金份额交易产生的	12,316,954,038.09	-	-	12,316,954,038.09

基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)				
其中: 1. 基金申购款	119,165,427,316.14	-	-	119,165,427,316.14
2. 基金赎回款	-106,848,473,278.05	-	-	-106,848,473,278.05
(三)、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)	-	-	-180,529,141.33	-180,529,141.33
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	22,736,744,017.57	-	-	22,736,744,017.57

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

杨凯

张献锦

何瑜

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

宝盈货币市场证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2009]第 532 号《关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的批复》核准,由宝盈基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集 1,455,089,424.24 元,业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报(验)字(09)第 0014 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》于 2009 年 8 月 5 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,455,160,265.48 份基金份额,其中认购资金利息折合 70,841.24 份基金份额。本基金的基金管理人为宝盈基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》和《宝盈货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,并

据此将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金按照 0.25% 年费率计提销售服务费；B 类基金按照 0.01% 年费率计提销售服务费的。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算每万份基金净收益和七日年化收益率。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 50 万份时，本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《货币市场基金管理暂行规定》和《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为现金，通知存款，短期融资券，一年以内(含一年)的银行定期存款、大额存单，剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、资产支持证券，期限在一年以内(含一年)的债券回购，期限在一年以内(含一年)的中央银行票据以及中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年中期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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 6 月 30 日的经营成果和净资产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

除以下会计政策变更外，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金

成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并

未显著增加, 认定为处于第一阶段的金融工具, 按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具, 按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具, 按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项, 无论是否存在重大融资成分, 本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的, 予以终止确认: (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止; (2) 该金融资产已转移, 且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方; 或者 (3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额, 计入当期损益。

原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用的原金融工具准则)

本基金于 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则, 但选择不重述比较信息。因此, 比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时, 按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息, 单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息, 按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价; 同时于每一计价日计算影子价格, 以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法, 以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的, 予以终止确认: (1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止; (2) 该金融资产已转移, 且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方; 或者 (3) 该金融资产已转移, 虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬, 但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时, 其账面价值与收到的对价的差额, 计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时, 终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

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

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》及《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金 2022 年中期财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、买入返售金融资产、应收利息、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 10,005,475,381.91 元、2,278.76 元、2,219,610,929.40 元、81,244,447.21 元、4,124,388.21 元和 694,766.67 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、存出保证金、买入返售金融资产、其他资产-应收利息、应收申购款和其他资产-其他应收款，金额分别为 10,052,925,434.61 元、2,279.86 元、2,221,672,857.06 元、0.00 元、4,124,388.21 元和 694,766.67 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,818,484,528.75 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 11,850,216,994.50 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付利润、应付交易费用、应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 709,999,245.00 元、12,562,484.47 元、10,730,977.73 元、1,690,500.54 元、3,657,421.35 元、1,436,272.58 元、209,005.99 元、44,928.48 元和 2,076.03 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为卖出回购金融资产款、应付赎回款、应付管理人报酬、

应付托管费、应付销售服务费、应付利润、其他负债-应付交易费用、其他负债-应付利息和其他负债-其他应付款，金额分别为 710,044,173.48 元、12,562,484.47 元、10,730,977.73 元、1,690,500.54 元、3,657,421.35 元、1,436,272.58 元、209,005.99 元、0.00 元和 2,076.03 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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》、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 2022 年 6 月 30 日
活期存款	2,977,916.85
等于：本金	2,977,473.99
加：应计利息	442.86
减：坏账准备	-
定期存款	9,050,941,525.34
等于：本金	9,000,000,000.00
加：应计利息	50,941,525.34
减：坏账准备	-
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	9,050,941,525.34
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	9,053,919,442.19

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日				
	按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	14,284,211,743.39	14,293,330,293.16	9,118,549.77	0.0311
	合计	14,284,211,743.39	14,293,330,293.16	9,118,549.77	0.0311

资产支持证券	-	-	-	-
合计	14,284,211,743.39	14,293,330,293.16	9,118,549.77	0.0311

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

无。

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 2022年6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	7,168,885,263.91	-
合计	7,168,885,263.91	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应收利息	-
其他应收款	694,766.67
待摊费用	-
合计	694,766.67

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年6月30日
应付赎回费	48.51
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	236,976.65
其中：交易所市场	-
银行间市场	236,976.65
应付利息	-
预提费用	142,891.13
合计	379,916.29

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

宝盈货币 A

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,370,988,223.76	17,370,988,223.76
本期申购	101,844,543,104.60	101,844,543,104.60

本期赎回（以“-”号填列）	-96,117,776,632.87	-96,117,776,632.87
本期末	23,097,754,695.49	23,097,754,695.49

宝盈货币 B

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,018,034,744.60	6,018,034,744.60
本期申购	6,964,031,543.14	6,964,031,543.14
本期赎回（以“-”号填列）	-6,762,280,984.75	-6,762,280,984.75
本期末	6,219,785,302.99	6,219,785,302.99

6.4.7.11 其他综合收益

无。

6.4.7.12 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
本期期初	-	-	-
本期利润	185,286,192.83	-	185,286,192.83
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	-185,286,192.83	-	-185,286,192.83
本期末	-	-	-

宝盈货币 B

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	39,249,100.60	-	39,249,100.60
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	-39,249,100.60	-	-39,249,100.60
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	20,328.65
定期存款利息收入	124,889,581.12	
其他存款利息收入	-	

结算备付金利息收入	606.81
其他	127.95
合计	124,910,644.53

6.4.7.14 股票投资收益

不适用。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	148,655,288.89
债券投资收益——买卖债券（及债券到期兑付）差价收入	13,154,849.45
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	161,810,138.34

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	22,237,993,981.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	22,163,385,999.73
减：应计利息总额	61,452,857.51
减：交易费用	275.00
买卖债券差价收入	13,154,849.45

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

无。

6.4.7.18 衍生工具收益

不适用。

6.4.7.19 股利收益

不适用。

6.4.7.20 公允价值变动收益

无。

6.4.7.21 其他收入

无。

6.4.7.22 信用减值损失

无。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
中债登账户维护费	9,000.00
上清所账户维护费	9,000.00
汇款费	37,335.97
其他	600.00
合计	189,827.10

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本基金本报告期不存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（“宝盈基金”）	基金管理人、基金注册登记机构、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、基金销售机构
中国对外经济贸易信托有限公司（“中国外贸信托”）	基金管理人的股东
中铁信托有限责任公司（“中铁信托”）	基金管理人的股东
中铁宝盈资产管理有限公司（“中铁宝盈”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	38,176,275.50	26,443,192.14
其中：支付销售机构的客户维护费	16,083,745.17	10,969,704.89

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	11,568,568.41	8,013,088.45

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 × 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 2022 年 1 月 1 日至 2022 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
宝盈基金	120,926.95	167,635.90	288,562.85
中国建设银行	75,920.01	349.34	76,269.35
合计	196,846.96	167,985.24	364,832.20
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	96,667.08	1,110.60	97,777.68
宝盈基金	210,925.26	106,341.28	317,266.54
合计	307,592.34	107,451.88	415,044.22

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

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	-	200,722,586.30	-	-	-	-

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
	宝盈货币 A	宝盈货币 B
报告期初持有的基金份额	-	115,487,032.21
报告期间申购/买入总份额	-	109,445,212.21
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	84,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	140,932,244.42
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	2.27%
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

	宝盈货币 A	宝盈货币 B
报告期初持有的基金份额	-	170,859,129.80
报告期内申购/买入总份额	-	208,686,319.92
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	158,500,000.00
报告期末持有的基金份额	-	221,045,449.72
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	5.59%

注：1、期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。

2、基金管理人宝盈基金管理有限公司在本半年度申购本基金的交易委托宝盈基金管理有限公司直销柜台办理，适用费率为 0%。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

宝盈货币 B

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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 (%)
中铁宝盈	93,512,856.20	1.50	91,690,381.87	1.52

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 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	2,977,916.85	20,328.65	5,963,426.57	17,134.08

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.11 利润分配情况

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

185,329,079.54	-	-42,886.71	185,286,192.83	-
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
39,338,820.33	-	-89,719.73	39,249,100.60	-

6.4.12 期末(2022 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

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

不适用。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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 1,178,578,956.16 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
180204	18 国开 04	2022 年 7 月 1 日	103.12	1,000,000	103,121,968.25
190214	19 国开 14	2022 年 7 月 1 日	102.32	1,200,000	122,779,872.03
200312	20 进出 12	2022 年 7 月 1 日	102.70	1,211,000	124,371,592.34
210010	21 付息国债 10	2022 年 7 月 1 日	101.89	400,000	40,756,326.54
210211	21 国开 11	2022 年 7 月 1 日	101.91	1,000,000	101,907,402.37
210312	21 进出 12	2022 年 7 月 1 日	101.58	1,000,000	101,578,538.02
210407	21 农发 07	2022 年 7 月 1 日	101.84	500,000	50,919,087.82
210411	21 农发 11	2022 年 7 月 1 日	101.52	1,000,000	101,521,656.67
220201	22 国开 01	2022 年 7 月 1 日	100.99	2,500,000	252,476,148.40
220301	22 进出 01	2022 年 7 月 1 日	100.47	2,128,000	213,802,346.33
220401	22 农发 01	2022 年 7 月 1 日	100.48	500,000	50,237,872.07
合计				12,439,000	1,263,472,810.84

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 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卖出回购证券款, 无抵押债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金, 主要投资于各类货币市场工具, 属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种, 其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金在日常经

营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益”的风险收益目标。

本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人中国建设银行；定期存款存放在中国银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、华夏银行股份有限公司、上海银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于主体信用评级低于 AAA 的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过 2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的 10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计

及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,826,474,378.00	860,290,552.24
合计	1,826,474,378.00	860,290,552.24

注：未评级部分为国债、政策性金融债，短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,272,937,449.05	10,176,604,810.08
合计	12,272,937,449.05	10,176,604,810.08

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 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
AAA	184,799,916.34	50,420,165.06
AAA 以下	-	-
未评级	-	731,169,001.37
合计	184,799,916.34	781,589,166.43

注：未评级部分为国债、政策性金融债，中期票据。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

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。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，除发生巨额赎回、连续 3 个交易日累计赎回 20%以上或者连续 5 个交易日累计赎回 30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

6.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

无。

6.4.13.3.2 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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过监控基金平均剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)，并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过 240 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过 90 天，平均剩余存续期不得超过 180 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 20%；当本基金前 10 名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的 50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 60 天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过 120 天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于 30%。于 2021 年 6 月 30 日，本基金

前 10 名份额持有人的持有份额合计占基金总份额的比例为 10.58%，本基金投资组合的平均剩余期限为 86 天，平均剩余存续期为 86 天。本基金持有的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及 5 个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例为 14.35%。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的 10%。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%。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	6,551,654,858.96	2,502,264,583.23	-	-	9,053,919,442.19
存出保证金	20,695.62	-	-	-	20,695.62

交易性金融资产	12,197,731,318.26	2,086,480,425.13	-	-	14,284,211,743.39
买入返售金融资产	7,168,885,263.91	-	-	-	7,168,885,263.91
应收申购款	-	-	-	4,228,627.78	4,228,627.78
其他资产	-	-	-	694,766.67	694,766.67
资产总计	25,918,292,136.75	4,588,745,008.36	-	4,923,394.45	30,511,960,539.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,165,033.86	1,165,033.86
应付管理人报酬	-	-	-	6,661,992.46	6,661,992.46
应付托管费	-	-	-	2,018,785.64	2,018,785.64
卖出回购金融资产款	1,178,578,956.16	-	-	-	1,178,578,956.16
应付销售服务费	-	-	-	4,289,214.90	4,289,214.90
应付利润	-	-	-	1,303,666.14	1,303,666.14
应交税费	-	-	-	22,975.63	22,975.63
其他负债	-	-	-	379,916.29	379,916.29
负债总计	1,178,578,956.16	-	-	15,841,584.92	1,194,420,541.08
利率敏感度缺口	24,739,713,180.59	4,588,745,008.36	-	-10,918,190.47	29,317,539,998.48
上年度末 2021 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月 -1 年	1-5 年	不计息	合计
资产					
银行存款	9,105,475,381.91	900,000,000.00	-	-	10,005,475,381.91
存出保证金	2,278.76	-	-	-	2,278.76
交易性金融资产	10,408,552,168.94	1,409,932,359.81	-	-	11,818,484,528.75
买入返售金融资产	2,219,610,929.40	-	-	-	2,219,610,929.40
应收申购款	-	-	-	4,124,388.21	4,124,388.21
其他资产	-	-	-	81,939,213.88	81,939,213.88
资产总计	21,733,640,759.01	2,309,932,359.81	-	86,063,602.09	24,129,636,720.91
负债					
卖出回购金融资产款	709,999,245.00	-	-	-	709,999,245.00
应付赎回款	-	-	-	12,562,484.47	12,562,484.47
应付管理人报酬	-	-	-	10,730,977.73	10,730,977.73
应付托管费	-	-	-	1,690,500.54	1,690,500.54
应付销售服务费	-	-	-	3,657,421.35	3,657,421.35
应交税费	-	-	-	1,840.38	1,840.38
应付利润	-	-	-	1,436,272.58	1,436,272.58
其他负债	-	-	-	535,010.50	535,010.50
负债总计	709,999,245.00	-	-	30,614,507.55	740,613,752.55
利率敏感度缺口	21,023,641,514.01	2,309,932,359.81	-	55,449,094.54	23,389,022,968.36

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	
	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 (2022 年 6 月 30 日)	上年度末 (2021 年 12 月 31 日)
分析	1. 市场利率下降 25 个基点	11,096,537.64	7,994,379.27
	2. 市场利率上升 25 个基点	-11,058,124.31	-7,968,513.48

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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

无。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	-	-

第二层次	14,284,211,743.39	11,818,484,528.75
第三层次	-	-
合计	14,284,211,743.39	11,818,484,528.75

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 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	14,284,211,743.39	46.82
	其中：债券	14,284,211,743.39	46.82
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	7,168,885,263.91	23.50
	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	9,053,919,442.19	29.67
4	其他各项资产	4,944,090.07	0.02
5	合计	30,511,960,539.56	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	5.48
	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	1,178,578,956.16	4.02
	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	89
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	78

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	37.88	4.02
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	14.91	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	6.48	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	16.21	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	28.30	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	103.78	4.02

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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	40,756,326.54	0.14
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,656,089,384.33	5.65
	其中：政策性金融债	1,471,289,467.99	5.02
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	314,428,583.47	1.07
6	中期票据	-	-
7	同业存单	12,272,937,449.05	41.86
8	其他	-	-
9	合计	14,284,211,743.39	48.72
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 期末按实际利率计算账面价值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)	按实际利率计算的账面价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	112113200	21 浙商银行 CD200	5,000,000	496,917,691.45	1.69
2	220301	22 进出 01	4,000,000	401,884,109.64	1.37
3	112292250	22 宁波银行 CD040	4,000,000	399,176,298.84	1.36
4	112112160	21 北京银行 CD160	4,000,000	396,818,929.45	1.35
5	112216026	22 上海银行 CD026	3,000,000	299,195,899.84	1.02
6	112216031	22 上海银行 CD031	3,000,000	299,153,137.49	1.02
7	112117180	21 光大银行 CD180	3,000,000	297,941,134.20	1.02
8	112292259	22 南京银行 CD027	3,000,000	297,538,555.38	1.01
9	112203030	22 农业银行 CD030	3,000,000	294,617,471.17	1.00
10	220201	22 国开 01	2,500,000	252,476,148.40	0.86

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0758%
报告期内偏离度的最低值	-0.0072%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0301%

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 期末按实际利率计算的账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用“摊余成本法”计价，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协定利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

7.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体在本报告期内没有被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内除 22 上海银行 CD026、22 上海银行 CD031、22 进出 01、22 宁波银行 CD040、22 国开 01 的发行主体外未受到公开谴责、处罚。

2021 年 7 月 12 日，根据沪银保监罚决字（2021）72 号，2018 年 12 月，上海银行某笔同业投资房地产企业合规审查严重违反审慎经营规则；2019 年 11 月，该行某笔经营性物业贷款授信后管理严重违反审慎经营规则；2019 年 2 月至 4 月，该行部分个人贷款违规用于购房；2020 年 5 月至 7 月，该行对部分个人住房贷款借款人偿债能力审查不审慎；2020 年 7 月，该行在助贷环节对第三方机构收费管理严重违反审慎经营规则；2020 年 6 月至 12 月，该行部分业务以贷收费。因违法《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条第（五）项、《中华人民共和国商业银行法》第七十四条第（三）项、《个人贷款管理暂行办法》第四十二条第（八）项，对上海银行责令改正，并处罚款共计 460 万元。

2021 年 8 月 6 日，根据甬银保监罚决字（2021）57 号，宁波银行存在贷款被挪用于缴纳土地款或土地收储、开发贷款支用审核不严、房地产贷款放款和支用环节审核不严、贷款资金违规流入房市、房地产贷款资金回流借款人、票据业务开展不审慎等六项违规行为。根据《中华人民共和国银行业监督管理法》第四十六条、第四十八条，宁波银保监局对宁波银行罚款人民币 275 万元，并责令该行对相关直接责任人给予纪律处分。

2021 年 7 月 16 日，根据银保监罚决字（2021）31 号，存在个别高管人员未经核准实际履职；监管数据漏报错报；违规向地方政府购买服务提供融资；违规变相发放土地储备贷款；向用地未获国务院批准的项目发放贷款；违规开展租金保理业务变相支持地方政府举债；租金保理业务基础交易不真实；向租赁公司发放用途不合规的流动资金贷款；违规向个别医疗机构新增融资；个别并购贷款金额占比超出监管上限；借并购贷款之名违规发放股权收购贷款；违规向未取得“四证”的固定资产项目发放贷款；违规发放流动资金贷款用于固定资产投资；授信额度核定不审慎；

向无实际用款需求的企业发放贷款导致损失；突破产能过剩行业限额要求授信；项目贷款未按规定设定抵质押担保；贷款风险分类不审慎；信贷资产买断业务贷前调查不尽职；向借款人转嫁评估费用；同业业务交易对手名单制管理落实不到位；贸易背景审查不审慎；对以往监管通报问题整改不到位等问题，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十五条、第四十六条和相关审慎经营规则，对中国进出口银行处以 7345.6 万元罚款。

2022 年 3 月 25 日，根据银保监罚决字(2022)8 号，国家开发银行存在监管标准化数据(EAST)系统数据质量及数据报送违法违规行为，未报送逾期 90 天以上贷款余额 EAST 数据；漏报贸易融资业务 EAST 数据；漏报贷款核销业务 EAST 数据；信贷资产转让业务 EAST 数据存在偏差；未报送债券投资业务 EAST 数据；漏报权益类投资业务 EAST 数据；漏报跟单信用证业务 EAST 数据；漏报保函业务 EAST 数据；EAST 系统理财产品底层持仓余额数据存在偏差；EAST 系统理财产品非标投向行业余额数据存在偏差；漏报分户账 EAST 数据；漏报授信信息 EAST 数据；EAST 系统《表外授信业务》表错报；EAST 系统《对公信贷业务借据》表错报；EAST 系统《关联关系》表漏报；EAST 系统《对公信贷分户账》表漏报；理财产品登记不规范等问题，因违反《中华人民共和国银行业监督管理法》第二十一条、第四十六条和相关审慎经营规则，处以 440 万元罚款。

我们认为相关处罚措施对上海银行、宁波银行、中国进出口银行、国家开发银行的正常经营会产生一定影响，但影响可控；对上海银行、宁波银行、中国进出口银行、国家开发银行的债券偿还影响很小。本基金投资 22 上海银行 CD026、22 上海银行 CD031、22 进出 01、22 宁波银行 CD040、22 国开 01 的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	20,695.62
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	4,228,627.78
5	其他应收款	694,766.67
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,944,090.07

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	2,842,744	8,125.16	28,548,244.58	0.12	23,068,588,433.99	99.88
宝盈货币 B	50	124,395,706.06	6,206,055,072.68	99.85	9,210,514.97	0.15
合计	2,842,794	10,312.93	6,234,603,317.26	21.27	23,077,798,948.96	78.73

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	其他机构	700,331,920.57	2.39
2	银行类机构	500,000,000.00	1.71
3	保险类机构	500,000,000.00	1.71
4	保险类机构	500,000,000.00	1.71
5	银行类机构	404,586,625.61	1.38
6	保险类机构	404,360,654.07	1.38
7	银行类机构	402,690,540.00	1.37
8	银行类机构	306,361,149.33	1.05
9	银行类机构	302,982,427.98	1.03
10	其他机构	300,000,000.00	1.02

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	1,231,246.01	0.0053
	宝盈货币 B	4,180,771.96	0.0672
	合计	5,412,017.97	0.0185

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情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	宝盈货币 A	0~10
	宝盈货币 B	>100
	合计	>100
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

项目	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金合同生效日(2009年8月5日) 基金份额总额	428,312,282.49	1,026,847,982.99
本报告期期初基金份额总额	17,370,988,223.76	6,018,034,744.60
本报告期基金总申购份额	101,844,543,104.60	6,964,031,543.14
减：本报告期基金总赎回份额	96,117,776,632.87	6,762,280,984.75
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	23,097,754,695.49	6,219,785,302.99

§ 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六届董事会第五次会议决议，同意马永红不再担任宝盈基金管理有限公司董事长，严震担任宝盈基金管理有限公司董事长；

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。

(2) 根据宝盈基金管理有限公司股东会 2022 年第一次会议决议，同意马永红、陈恪不再担任宝盈基金管理有限公司董事，陈赤、邹纯余担任宝盈基金管理有限公司董事；陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事；

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第六届监事会第四次会议决议，同意陈林不再担任宝盈基金管理有限公司监事会主席，兰敏担任宝盈基金管理有限公司监事会主席。

2、报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

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

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内未发生改聘会计师事务所情况。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况**10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

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

本报告期内未新租交易单元。

(2) 退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例(%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例(%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例(%)
长江证券	150,842,190.96	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

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基金经理结束产假恢复履行职务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-06-30
2	关于宝盈基金管理有限公司开展网上直销渠道费率优惠活动的公告	上海证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-06-24
3	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加和讯信息科技有限公司费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-06-20
4	宝盈基金管理有限公司关于新增博时财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-06-14
5	宝盈基金管理有限公司关于新增洪泰财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-06-07
6	宝盈基金管理有限公司关于新增鼎信汇金为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-05-13
7	宝盈基金管理有限公司关于终止北京唐鼎耀华基金销售有限公司、北京植信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-05-06
8	宝盈货币市场证券投资基金 2022 年第 1 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-04-22
9	宝盈基金管理有限公司旗下 53 只基金 2022 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-04-22
10	宝盈基金管理有限公司旗下公募基	上海证券报, 证券日报, 证券时报,	2022-04-18

	金产品基金转换费用的业务规则说明	中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	
11	宝盈货币市场证券投资基金 2021 年年度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-30
12	宝盈基金管理有限公司旗下 50 只基金 2021 年年度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-03-30
13	宝盈基金管理有限公司关于新增华瑞保险为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-29
14	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	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-25
15	宝盈基金管理有限公司关于终止成都华羿恒信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-25
16	宝盈基金管理有限公司关于新增排排网为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-22
17	宝盈基金管理有限公司关于新增北京中植基金销售有限公司为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-16
18	宝盈基金管理有限公司关于新增泰信财富为旗下基金代销机构及参与相关费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-16
19	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中信建投证券股份有限公司手续费率优惠活动的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-03-10
20	宝盈货币市场证券投资基金 2021 年第 4 季度报告	本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-01-24
21	宝盈基金管理有限公司旗下 52 只基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报	2022-01-24
22	宝盈基金关于暂停杭州科地瑞富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-01-18
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下部分基金可参与北京证券交易所股票投资及相关风险揭示的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-01-07
24	宝盈基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上海证券报, 证券日报, 证券时报, 中国证券报, 本基金管理人网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内无单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的文件。

《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》。

《宝盈货币市场证券投资基金托管协议》。

法律意见书。

基金管理人业务资格批件、营业执照。

基金托管人业务资格批件、营业执照。

中国证监会要求的其他文件。

12.2 存放地点

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

基金托管人办公地址：北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

12.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2022 年 8 月 31 日