

# 宝盈货币市场证券投资基金 2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人：宝盈基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2018 年 3 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 2018 年 3 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务会计报告出具了标准无保留意见的审计报告，基金管理人在本报告中对相关事项亦有详细说明，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 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	15
<b>§ 5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 审计报告</b>	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
<b>§ 7 年度财务报表</b>	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	19
7.4 报表附注	21
<b>§ 8 投资组合报告</b>	42
8.1 期末基金资产组合情况	42
8.2 债券回购融资情况	43
8.3 基金投资组合平均剩余期限	43
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	44
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	44
8.6 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	44
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	44

8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	45
8.9 投资组合报告附注 .....	45
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>45</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	45
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	46
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	46
9.4 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 .....	46
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>47</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>47</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	47
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	47
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
11.4 基金投资策略的改变 .....	48
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	48
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	48
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	49
11.9 其他重大事件 .....	49
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>51</b>
12.1 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
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	51
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>51</b>
13.1 备查文件目录 .....	51
13.2 存放地点 .....	51
13.3 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	30,655,198,646.07 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	3,132,759,760.24 份	27,522,438,885.83 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	<p>本基金的业绩比较基准为：活期存款利率(税后)。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	宝盈基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张瑾
	联系电话	0755-83276688
	电子邮箱	zhangj@byfunds.com
客户服务电话	400-8888-300	010-67595096
传真	0755-83515599	010-66275853
注册地址	深圳市深南路 6008 号特区报业大厦 1501	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	广东省深圳市福田区福华一路 115 号投行大厦 10 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼

邮政编码	518034	100033
法定代表人	李文众	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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www. byfunds. com
基金年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间 数据和指标	2017 年		2016 年		2015 年	
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B	宝盈货币 A	宝盈货币 B
本期已实现收益	100,627,928.75	477,155,680.13	93,363,887.32	652,507,368.55	151,185,549.40	700,035,566.19
本期利润	100,627,928.75	477,155,680.13	93,363,887.32	652,507,368.55	151,185,549.40	700,035,566.19
本期净值收益率	3.9027%	4.1524%	2.5975%	2.8442%	3.7074%	3.9568%
3.1.2 期末 数据和指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
期末基金资产净值	3,132,759,760.24	27,522,438,885.83	3,121,511,397.92	14,287,189,319.34	3,559,341,762.13	24,737,727,017.32
期末基金份额 额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计 期末指标	2017 年末		2016 年末		2015 年末	
累计净值收 益率	32.3543%	35.0539%	27.3830%	29.6695%	24.1579%	26.0835%

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**

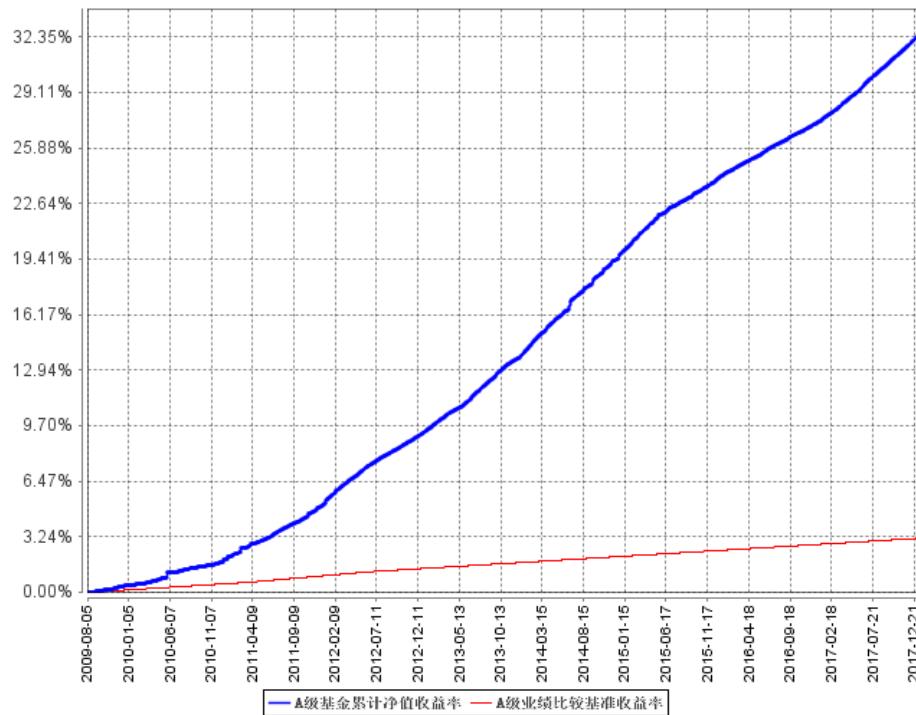
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0229%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.9347%	0.0016%
过去六个月	2.0212%	0.0016%	0.1764%	0.0000%	1.8448%	0.0016%
过去一年	3.9027%	0.0034%	0.3500%	0.0000%	3.5527%	0.0034%
过去三年	10.5537%	0.0063%	1.0510%	0.0000%	9.5027%	0.0063%
过去五年	21.0976%	0.0084%	1.7510%	0.0000%	19.3466%	0.0084%
自基金合同生效起至今	32.3543%	0.0108%	3.1478%	0.0001%	29.2065%	0.0107%

**宝盈货币 B**

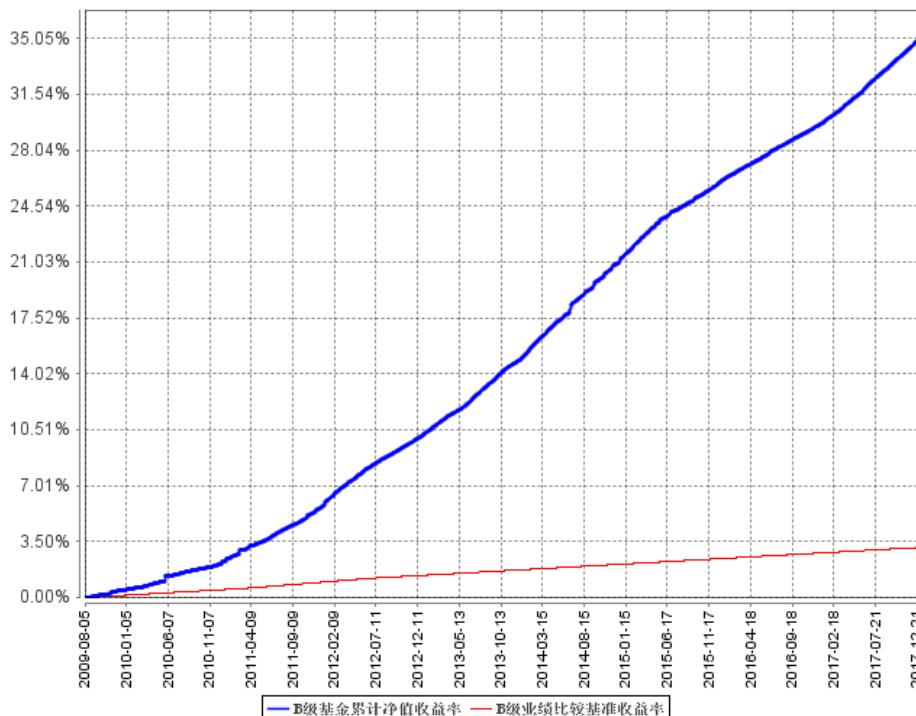
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	1.0839%	0.0016%	0.0882%	0.0000%	0.9957%	0.0016%
过去六个月	2.1450%	0.0016%	0.1764%	0.0000%	1.9686%	0.0016%
过去一年	4.1524%	0.0034%	0.3500%	0.0000%	3.8024%	0.0034%
过去三年	11.3530%	0.0063%	1.0510%	0.0000%	10.3020%	0.0063%
过去五年	22.5595%	0.0084%	1.7510%	0.0000%	20.8085%	0.0084%
自基金合同生效起至今	35.0539%	0.0108%	3.1478%	0.0001%	31.9061%	0.0107%

### 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

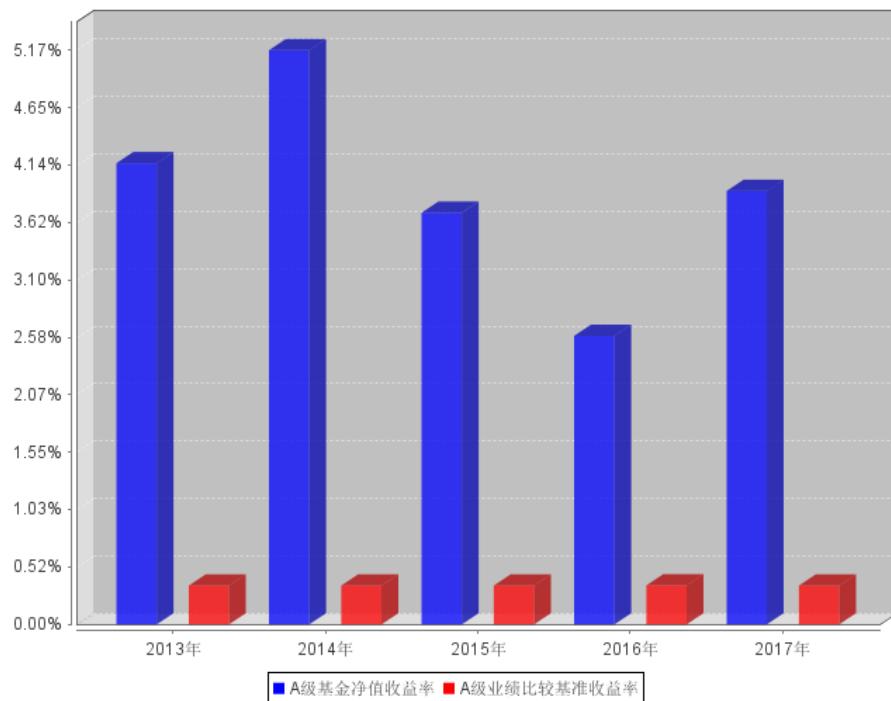


B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图

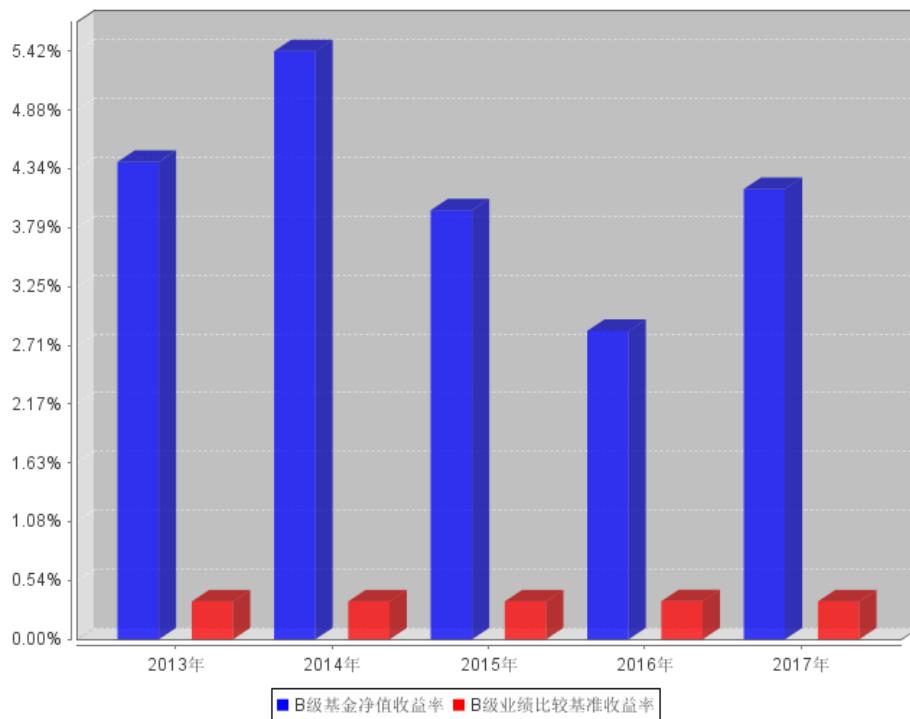


### 3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



B级过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

宝盈货币 A					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	99,802,430.49	-	825,498.26	100,627,928.75	

2016	93,060,008.46	-	303,878.86	93,363,887.32	
2015	151,270,055.12	-	-84,505.72	151,185,549.40	
合计	344,132,494.07	-	1,044,871.40	345,177,365.47	

单位：人民币元

宝盈货币 B					
年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2017	467,327,964.31	-	9,827,715.82	477,155,680.13	
2016	651,625,672.16	-	881,696.39	652,507,368.55	
2015	698,880,166.09	-	1,155,400.10	700,035,566.19	
合计	1,817,833,802.56	-	11,864,812.31	1,829,698,614.87	

## § 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、宝盈祥瑞养老混合、宝盈科技 30 混合、宝盈睿丰创新混合、宝盈先进制造混合、宝盈新兴产业混合、宝盈转型动力混合、宝盈祥泰养老混合、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）二十二只基金，公司恪守价值投资的投资理念，并逐渐形成了稳健、规范的投资风格。公司拥有一支经验丰富的投资管理团队，在研究方面，公司汇聚着一批从事宏观经济、行业、上市公司、债券和金融工程研究的专业人才，为公司的投资决策提供科学的研究支持；在投资方面，公司的基金经理具有丰富的证券市场投资经验，以自己的专业知识致力于获得良好业绩，努力为投资者创造丰厚的回报。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金、宝盈 增强收益债 券型证券投 资基金、宝盈 祥瑞养老混 合型证券投	2009 年 8 月 5 日	2017 年 11 月 11 日	14 年	陈若劲女士，香港 中文大学金融 MBA。 曾在第一创业证券 有限责任公司固定 收益部从事债券投 资、研究及交易等

	资基金、宝盈祥泰养老混合型证券投资基金基金经理；固定收益一部总经理				工作，2008年4月加入宝盈基金管理有限公司任债券组合研究员。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
高宇	本基金、宝盈增强收益债券型证券投资基金、宝盈祥瑞养老混合型证券投资基金、宝盈祥泰养老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	-	9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，现担任宝盈基金固定收益部副总经理。中国国籍，证券投资基金从业人员资格。
邱骏	本基金基金经理	2015年7月8日	2017年8月3日	7年	2010年7月加入宝盈基金管理有限公司，在固定收益部任职固定收益研究员，负责利率债、信用债、可转债等各类固定收益证券研究。

注：1、陈若劲为首任基金经理，其“任职日期”按基金合同生效日填写，“离任日期”指根据公司决定的解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定，证券从业年限的计算截至 2017 年 12 月 31 日。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在投资管理活动中公平对待不同投资组合，无损害基金持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

我公司根据《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。

公司对不同投资组合，尤其是同一位投资组合经理管理的不同投资组合同日同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析，形成《公平交易分析报告》，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，公司要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，但是完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

公司对其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，对于异常交易发生前后不同投资组合买卖该异常交易证券的情况进行分析，并要求相关投资组合经理应对异常交易情况进行合理性解释。

##### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，全球经济同步复苏背景下外需回暖、消费需求保持强劲、投资增长稳中略缓，供给侧结构性改革推进下企业效益继续改善，宏观经济稳中向好、好于预期。国际大宗商品价格总体上涨，国内主要工业品价格震荡上行，食品价格有所下降而非食品价格上涨较快，消费价格整体温和上涨。

报告期内，央行继续实施稳健中性的货币政策，维护银行体系流动性合理稳定，公开市场操作利率“随行就市”小幅上行，货币市场资金利率中枢稳步抬升。报告期内，商业银行对同业存款和同业存单需求迫切且呈现明显的季节性特征，尤其是半年末和年末同业融资滚动压力较大，利率显著抬升并在 12 月份突破 6 月份的年内高点。报告期内，上半年，在政策利率调整、严监管政策超预期和经济基本面数据波动等多重因素共同作用下，债券市场收益率震荡上行，10 年国开债收益率运行在 3.7%-4.38%，1 年 AAA 信用债收益率运行在 3.59%-4.66%；进入三季度后，经济基本面和资金面相对平稳，债券市场收益率宽幅区间震荡，10 年国开债收益率运行在 4.17%-4.36%，1 年 AAA 信用债收益率运行在 4.37%-4.66%；四季度，海外债券利率连续上行，国内经济基本面数据小幅超预期且资金利率有所上行，债券市场收益率快速上行，绝对收益水平创下近年新高，10 年国开债收益率运行在 4.22%-4.94%，1 年 AAA 信用债收益率运行在 4.50%-5.25%。

报告期内，资金利率中枢稳步抬升、区间波动较大，监管政策力度逐步加强，我们整体维持了较低久期和较高评级的投资组合，并在部分市场资金面紧张时期适当配置收益率较高的同业存款和同业存单。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

宝盈货币 A:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 3.9027%，业绩比较基准收益率为 0.3500%。

宝盈货币 B:

截至本报告期末，本基金的份额净值为 1.0000 元。本报告期内本基金的份额净值收益率为 4.1524%，业绩比较基准收益率为 0.3500%。

#### 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 2018 年，我们认为全球经济复苏延续背景下外需推动、国内供给侧结构性改革持续推进，宏观经济总体预计运行平稳。受去产能、环保督查、大宗商品价格回暖、基数因素等叠加影响，通胀水平可能存在小幅上升压力，超预期风险不大。

货币市场方面，出于维护稳增长、去杠杆、防风险之间平衡的需要，我们预计货币政策保持稳健中性，央行综合运用价、量工具和宏观审慎政策加强预调微调，维护流动性合理稳定，资金面维持紧平衡。

债券市场方面，在宏观经济总体运行平稳和资金面持续紧平衡情况下，高评级、短端品种收益率已处于历史相对较高水平，具有较好的配置价值。

2018 年，我们将密切跟踪基本面数据环比变化、货币政策动向以及资金面变化，择机适当参与高收益高评级的同业存款、同业存单和信用债的配置机会。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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，由其按约定提有关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期内未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，发现个别监督指标不符合基金合同约定并及时通知了基金管理人。

报告期内，本基金实施利润分配的金额为 A 类 100,627,928.75 元，B 类 477,155,680.13 元。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

### § 6 审计报告

#### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第 20834 号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	宝盈货币市场证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了宝盈货币市场证券投资基金(以下简称“宝盈货币市场基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意見</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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，公允反映了宝盈货币市场基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于宝盈货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>宝盈货币市场基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估宝盈货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算宝盈货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督宝盈货币市场基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p>

	<p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对宝盈货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致宝盈货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	薛竞 罗佳
会计师事务所的地址	中国 · 上海市
审计报告日期	2018 年 3 月 30 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

报告截止日： 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,306,871,724.73	4,609,436,972.98
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	16,730,168,734.23	8,646,147,448.03
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		16,730,168,734.23	8,646,147,448.03
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	5,106,869,840.28	4,069,515,904.26
应收证券清算款		-	-

应收利息	7. 4. 7. 5	96, 170, 842. 34	92, 343, 066. 73
应收股利		-	-
应收申购款		38, 471, 236. 99	349, 459. 58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7. 4. 7. 6	737, 173. 35	737, 173. 35
资产总计		31, 279, 289, 551. 92	17, 418, 530, 024. 93
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2016 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7. 4. 7. 3	-	-
卖出回购金融资产款		600, 999, 029. 50	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		369, 673. 54	727, 809. 87
应付管理人报酬		5, 682, 976. 58	3, 454, 126. 13
应付托管费		1, 722, 114. 13	1, 046, 704. 87
应付销售服务费		644, 387. 37	831, 760. 01
应付交易费用	7. 4. 7. 7	301, 987. 83	308, 405. 67
应交税费		-	-
应付利息		300, 128. 97	-
应付利润		13, 790, 430. 28	3, 137, 216. 20
递延所得税负债		-	-
其他负债	7. 4. 7. 8	280, 177. 65	323, 284. 92
负债合计		624, 090, 905. 85	9, 829, 307. 67
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7. 4. 7. 9	30, 655, 198, 646. 07	17, 408, 700, 717. 26
未分配利润	7. 4. 7. 10	-	-
所有者权益合计		30, 655, 198, 646. 07	17, 408, 700, 717. 26
负债和所有者权益总计		31, 279, 289, 551. 92	17, 418, 530, 024. 93

注： 报告期截止日 2017 年 12 月 31 日， 宝盈货币市场证券投资基金 A 类基金份额净值 1. 0000 元， 基金份额总额 3, 132, 759, 760. 24 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 27, 522, 438, 885. 83 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 30, 655, 198, 646. 07 份。

## 7.2 利润表

会计主体： 宝盈货币市场证券投资基金

本报告期： 2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位： 人民币元

项目	附注号	本期 2017 年 1 月 1 日至 2017	上年度可比期间 2016 年 1 月 1 日至
----	-----	----------------------------	----------------------------

		年 12 月 31 日	2016 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		689,776,631.27	945,888,232.58
1. 利息收入		681,576,786.54	768,181,280.40
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 11	172,269,091.29	308,306,647.90
债券利息收入		488,827,034.34	446,147,190.49
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		20,480,660.91	13,727,442.01
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		8,166,544.73	177,706,754.38
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7. 4. 7. 13	8,166,544.73	177,706,754.38
资产支持证券投资收益	7. 4. 7. 13.1	-	-
贵金属投资收益	7. 4. 7. 14	-	-
衍生工具收益	7. 4. 7. 15	-	-
股利收益	7. 4. 7. 16	-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7. 4. 7. 17	-	-
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	7. 4. 7. 18	33,300.00	197.80
<b>减：二、费用</b>		111,993,022.39	200,016,976.71
1. 管理人报酬		46,666,405.84	89,237,116.67
2. 托管费		14,141,335.22	27,041,550.40
3. 销售服务费		7,742,906.04	11,464,614.95
4. 交易费用	7. 4. 7. 19	7,653.82	-
5. 利息支出		43,024,045.42	71,895,813.94
其中：卖出回购金融资产支出		43,024,045.42	71,895,813.94
6. 其他费用	7. 4. 7. 20	410,676.05	377,880.75
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		577,783,608.88	745,871,255.87
<b>减：所得税费用</b>		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		577,783,608.88	745,871,255.87

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：宝盈货币市场证券投资基金

本报告期：2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	17,408,700,717.26	-	17,408,700,717.26
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	577,783,608.88	577,783,608.88
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	13,246,497,928.81	-	13,246,497,928.81
其中：1. 基金申购款	115,374,144,995.43	-	115,374,144,995.43
2. 基金赎回款	-102,127,647,066.62	-	-102,127,647,066.62
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)	-	-577,783,608.88	-577,783,608.88
五、期末所有者权益(基金净值)	30,655,198,646.07	-	30,655,198,646.07
项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	28,297,068,779.45	-	28,297,068,779.45
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	745,871,255.87	745,871,255.87
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)	-10,888,368,062.19	-	-10,888,368,062.19
其中：1. 基金申购款	156,399,068,526.66	-	156,399,068,526.66
2. 基金赎回款	-167,287,436,588.85	-	-167,287,436,588.85
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)	-	-745,871,255.87	-745,871,255.87
五、期末所有者权益(基金净值)	17,408,700,717.26	-	17,408,700,717.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张啸川

丁宁

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

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

根据《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》和《宝盈货币市场证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,并据此将基金份额分为不同的类别。其中 A 类基金按照 0.25% 年费率计提销售服务费;B 类基金按照 0.01% 年费率计提销售服务费的。本基金 A 类、B 类两种收费模式并存,由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 B 类基金份额分别计算每万份基金净收益和七日年化收益率。投资人可自由选择申购某一类别的基金份额,但各类别基金份额之间不能相互转换。若 A 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额达到或超过 500 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 A 类基金份额升级为 B 类基金份额。若 B 类基金份额持有人在单个基金账户保留的基金份额低于 50 万份时,本基金的注册登记机构自动将其在该基金账户持有的 B 类基金份额降级为 A 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》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)。

本财务报表由本基金的基金管理人宝盈基金管理有限公司于审计报告日批准报出。

### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《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<年度报告和半年度报告>》、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》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

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

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和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。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息，按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资的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。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合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，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过 0.25% 时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支

持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

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

债券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有申请当日的分红权益，而赎回的基金份额享有申请当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方

式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。本基金的 A、B 类基金份额所对应的可分配收益可能有所不同。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金管理税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	6,871,724.73	9,436,972.98
定期存款	-	-
其中：存款期限1-3个月	-	-
其他存款	9,300,000,000.00	4,600,000,000.00
合计：	9,306,871,724.73	4,609,436,972.98

注：其他存款均为有存款期限，但根据协议可提前支取且没有利息损失的银行存款。

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2017年12月31日			
	摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
债 交交易所市场	-	-	-	-

券 券	银行间市场	16,730,168,734.23	16,725,184,000.00	-4,984,734.23	-0.0163%
	合计	16,730,168,734.23	16,725,184,000.00	-4,984,734.23	-0.0163%
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度
		-	-	-	-
债券 券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	8,646,147,448.03	8,640,955,000.00	-5,192,448.03	-0.0298%
	合计	8,646,147,448.03	8,640,955,000.00	-5,192,448.03	-0.0298%

注：1、偏离金额=影子定价—摊余成本。

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

不适用。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	5,106,869,840.28	-
合计	5,106,869,840.28	-
项目		上年度末 2016 年 12 月 31 日
		账面余额
		其中：买断式逆回购
买入返售证券_银行间	4,069,515,904.26	-
合计	4,069,515,904.26	-

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017 年 12 月 31 日	上年度末 2016 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	4,778.30	3,293.61

应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	30,446,444.97	3,211,944.40
应收结算备付金利息	-	-
应收债券利息	55,765,515.07	86,370,999.66
应收买入返售证券利息	9,954,104.00	2,756,829.06
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
其他	-	-
合计	96,170,842.34	92,343,066.73

#### 7.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
其他应收款	571,900.00	571,900.00
待摊费用	165,273.35	165,273.35
合计	737,173.35	737,173.35

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	-	-
银行间市场应付交易费用	301,987.83	308,405.67
合计	301,987.83	308,405.67

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2017年12月31日	2016年12月31日
应付赎回费	1,177.65	984.92
预提费用	279,000.00	289,000.00
其他	-	33,300.00
合计	280,177.65	323,284.92

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
宝盈货币 A		

上年度末	3,121,511,397.92	3,121,511,397.92
本期申购	14,639,757,305.96	14,639,757,305.96
本期赎回(以“-”号填列)	-14,628,508,943.64	-14,628,508,943.64
本期末	3,132,759,760.24	3,132,759,760.24

金额单位：人民币元

项目	宝盈货币 B	
	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	14,287,189,319.34	14,287,189,319.34
本期申购	100,734,387,689.47	100,734,387,689.47
本期赎回(以“-”号填列)	-87,499,138,122.98	-87,499,138,122.98
本期末	27,522,438,885.83	27,522,438,885.83

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

宝盈货币 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	100,627,928.75	-	100,627,928.75
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	-100,627,928.75	-	-100,627,928.75
本期末	-	-	-

单位：人民币元

宝盈货币 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	477,155,680.13	-	477,155,680.13
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	-477,155,680.13	-	-477,155,680.13
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
活期存款利息收入	94,642.95	248,522.77
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	172,174,448.34	308,058,125.13
结算备付金利息收入	-	-
其他	-	-
合计	172,269,091.29	308,306,647.90

注：本期活期存款利息收入中包含 13,492.50 元银行间账户滞留资金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

不适用。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	95,755,853,358.28	126,235,612,019.46
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	95,383,797,360.34	124,571,122,785.45
减：应收利息总额	363,889,453.21	1,486,782,479.63
买卖债券差价收入	8,166,544.73	177,706,754.38

#### 7.4.7.13.1 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.14 贵金属投资收益

不适用。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.16 股利收益

不适用。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

无。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他	33,300.00	197.80
合计	33,300.00	197.80

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
交易所市场交易费用	-	-
银行间市场交易费用	7,653.82	-
合计	7,653.82	-

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
审计费用	170,000.00	160,000.00
信息披露费	100,000.00	100,000.00
银行间账户维护费	36,000.00	36,000.00
银行费用	102,976.05	80,480.75
其他	1,700.00	1,400.00
合计	410,676.05	377,880.75

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司（以下简称“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（以下简称“中国建设银行”）	基金托管人、基金代销机构
中铁信托有限责任公司	基金管理人的股东
中国对外经济贸易信托有限公司（以下简称“对外经贸信托”）	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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度报告期内未通过关联方交易单元进行交易。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	46,666,405.84	89,237,116.67
其中：支付销售机构的客户维护费	5,740,094.94	8,383,850.36

注：支付基金管理人宝盈基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数。

###### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付	14,141,335.22	27,041,550.40

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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	885,962.23	32,574.50	918,536.73
宝盈基金公司	711,769.94	987,600.21	1,699,370.15
合计	1,597,732.17	1,020,174.71	2,617,906.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计
中国建设银行	1,124,981.02	56,678.39	1,181,659.41
宝盈基金公司	1,019,659.87	2,148,534.23	3,168,194.10
合计	2,144,640.89	2,205,212.62	4,349,853.51

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。

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位：人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期					
	2017 年 1 月 1 日至 2017 年 12 月 31 日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国建设银行	1,613,651,567.44	2,661,399,715.87	-	-	7,863,150,000.00	2,023,848.75
上年度可比期间						
2016 年 1 月 1 日至 2016 年 12 月 31 日						
银行间市场交	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	

易的 各关联方名称	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	7,056,760,865.42	4,933,572,360.43	-	-	23,279,950,000.00	2,444,716.45

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	
	宝盈货币A	宝盈货币B
期初持有的基金份额	-	73,855,095.30
期间申购/买入总份额	-	2,869,853.24
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	-	76,724,948.54
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.28%

项目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	宝盈货币A	宝盈货币B
期初持有的基金份额	-	15,322,691.72
期间申购/买入总份额	-	71,532,403.58
期间因拆分变动份额	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	13,000,000.00
期末持有的基金份额	-	73,855,095.30
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	-	0.52%

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%。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

宝盈货币B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016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
中铁宝盈资产管理有限公司	-	-	5,000,000.00	0.03%
对外经贸信托	25,000,000.00	0.09%	-	-

#### 7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方 名称	本期		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年12月31日		2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行	6,871,724.73	94,642.95	9,436,972.98	248,522.77

注：1、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。

2、本期当期利息收入中包含 13,492.50 元银行间账户滞留资金利息收入。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在承销期内未参与关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金无其他关联交易事项的说明。

#### 7.4.11 利润分配情况

金额单位：人民币元

##### 宝盈货币A

已按再投资形式转实收基 金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合 计	备注
99,802,430.49	-	825,498.26	100,627,928.75	-

##### 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
467,327,964.31	-	9,827,715.82	477,155,680.13	-

注：本基金在本年度累计分配收益为 577,783,608.88 元，其中以红利再投资方式结转入实收基金 567,130,394.80 元，计入应付收益科目 10,653,214.08 元。

#### 7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

不适用。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 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 600,999,029.50 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
111787040	17 南京银行 CD161	2018 年 1 月 3 日	99.68	3,400,000	338,912,000.00
170204	17 国开 04	2018 年 1 月 2 日	99.82	3,000,000	299,460,000.00
合计				6,400,000	638,372,000.00

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2017 年 12 月 31 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为货币市场基金，主要投资于各类货币市场工具，属于证券投资基金中的高流动性、低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现“在保持低风险与高流动性的基础上，追求稳定的当期收益。”的风险收益目标。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去

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

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行中国建设银行；定期存款存放在具有基金托管资格的，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
A-1	9,787,853,507.73	530,551,736.15
A-1以下	-	-
未评级	6,922,207,112.75	7,329,548,445.67
合计	16,710,060,620.48	7,860,100,181.82

注：未评级债券为政策性金融债、同业存单、短期融资券以及超短期融资券。

##### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
AAA	20,108,113.75	-
AAA以下	-	-
未评级	-	786,047,266.21
合计	20,108,113.75	786,047,266.21

注：未评级债券为政策性金融债。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金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%。

于 2017 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额中有 600,999,029.50 元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

#### 7.4.13.3.1 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、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 2017 年 12 月 31 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 32.65%，本基金投资组合的平均剩余期限为 52 天，平均剩余存续期为 52 天。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

###### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	9,306,871,724.73	-	-	-	-	9,306,871,724.73

交易性金融资产	16,341,024,736.73	389,143,997.50	-	-	-	16,730,168,734.23
买入返售金融资产	5,106,869,840.28	-	-	-	-	5,106,869,840.28
应收利息	-	-	-	-	96,170,842.34	96,170,842.34
应收申购款	-	-	-	-	38,471,236.99	38,471,236.99
其他资产	-	-	-	-	737,173.35	737,173.35
资产总计	30,754,766,301.74	389,143,997.50	-	-	135,379,252.68	31,279,289,551.92
负债						
卖出回购金融资产款	600,999,029.50	-	-	-	-	600,999,029.50
应付赎回款	-	-	-	-	369,673.54	369,673.54
应付管理人报酬	-	-	-	-	5,682,976.58	5,682,976.58
应付托管费	-	-	-	-	1,722,114.13	1,722,114.13
应付销售服务费	-	-	-	-	644,387.37	644,387.37
应付交易费用	-	-	-	-	301,987.83	301,987.83
应付利息	-	-	-	-	300,128.97	300,128.97
应付利润	-	-	-	-	13,790,430.28	13,790,430.28
其他负债	-	-	-	-	280,177.65	280,177.65
负债总计	600,999,029.50	-	-	-	23,091,876.35	624,090,905.85
利率敏感度缺口	30,153,767,272.24	389,143,997.50	-	-	112,287,376.33	30,655,198,646.07
上年度末 2016 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	4,609,436,972.98	-	-	-	-	4,609,436,972.98
交易性金融资产	8,547,654,673.57	98,492,774.46	-	-	-	8,646,147,448.03
买入返售金融资产	4,069,515,904.26	-	-	-	-	4,069,515,904.26
应收利息	-	-	-	-	92,343,066.73	92,343,066.73
应收申购款	-	-	-	-	349,459.58	349,459.58
其他资产	-	-	-	-	737,173.35	737,173.35
资产总计	17,226,607,550.81	98,492,774.46	-	-	93,429,699.66	17,418,530,024.93
负债						
应付赎回款	-	-	-	-	727,809.87	727,809.87
应付管理人报酬	-	-	-	-	3,454,126.13	3,454,126.13
应付托管费	-	-	-	-	1,046,704.87	1,046,704.87
应付销售服务费	-	-	-	-	831,760.01	831,760.01
应付交易费用	-	-	-	-	308,405.67	308,405.67
应付利润	-	-	-	-	3,137,216.20	3,137,216.20
其他负债	-	-	-	-	323,284.92	323,284.92
负债总计	-	-	-	-	9,829,307.67	9,829,307.67
利率敏感度缺口	17,226,607,550.81	98,492,774.46	-	-	83,600,391.99	17,408,700,717.26

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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(2017年12月31日)	上年度末(2016年12月31日)
	市场利率下降25个基点	6,798,298.04	4,231,327.46
	市场利率上升25个基点	-6,777,889.03	-4,209,853.80

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的债券，因此无重大其他价格风险。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 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。

###### (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2017年12月31日，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16,730,168,734.23元，无属于第一层次和第三层次的余额(2016年12月31日：第二层次8,646,147,448.03元，无属于第一层次和第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三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 2017 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016 年 12 月 31 日：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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于 2016 年 12 月 21 日颁布的财税[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》的规定，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。

根据财政部、国家税务总局于 2017 年 6 月 30 日颁布的财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。

此外，财政部、国家税务总局于 2017 年 12 月 25 日颁布的财税[2017]90 号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自 2018 年 1 月 1 日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至 2017 年 12 月 31 日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	16,730,168,734.23	53.49
	其中：债券	16,730,168,734.23	53.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	5,106,869,840.28	16.33
	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, 306, 871, 724. 73	29. 75
4	其他各项资产	135, 379, 252. 68	0. 43
5	合计	31, 279, 289, 551. 92	100. 00

## 8.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10. 60	
	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	600, 999, 029. 50	1. 96
	其中: 买断式回购融资	-	-

注: 报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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。

## 8.3 基金投资组合平均剩余期限

### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	52
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	85
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

### 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。

### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30 天以内	42. 86	1. 96
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	13. 14	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	40. 35	-
	其中: 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-

4	90 天(含)—120 天	1. 66	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	3. 57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		101. 59	1. 96

#### 8.4 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。

#### 8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1, 767, 690, 981. 17	5. 77
	其中：政策性金融债	1, 767, 690, 981. 17	5. 77
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	710, 274, 225. 59	2. 32
6	中期票据	20, 108, 113. 75	0. 07
7	同业存单	14, 232, 095, 413. 72	46. 43
8	其他	-	-
9	合计	16, 730, 168, 734. 23	54. 58
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

#### 8.6 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	170204	17 国开 04	10, 800, 000	1, 078, 048, 620. 05	3. 52
2	111772036	17 成都农商银行 CD107	8, 000, 000	790, 453, 516. 35	2. 58
3	170408	17 农发 08	5, 100, 000	509, 748, 943. 32	1. 66
4	111720252	17 广发银行 CD252	5, 000, 000	497, 415, 728. 57	1. 62
5	111709483	17 浦发银行 CD483	5, 000, 000	495, 662, 306. 43	1. 62
6	111787040	17 南京银行 CD161	4, 500, 000	448, 546, 961. 87	1. 46
7	111790724	17 重庆银行 CD017	4, 000, 000	398, 717, 061. 86	1. 30
8	111710635	17 兴业银行 CD635	4, 000, 000	396, 531, 566. 90	1. 29
9	111709506	17 浦发银行 CD506	4, 000, 000	395, 742, 416. 02	1. 29
10	111713076	17 沪商银行 CD076	3, 800, 000	379, 126, 301. 57	1. 24

#### 8.7 “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	0.1193%
报告期内偏离度的最低值	-0.0338%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0494%

#### 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。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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未受到公开谴责、处罚。

#### 8.9.3 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	96,170,842.34
4	应收申购款	38,471,236.99
5	其他应收款	737,173.35
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	135,379,252.68

#### 8.9.4 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		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	333,488	9,393.92	106,253,356.84	3.39%	3,026,506,403.40	96.61%
宝盈货币 B	449	61,297,191.28	24,789,629,647.80	90.07%	2,732,809,238.03	9.93%
合计	333,937	91,799.35	24,895,883,004.64	81.21%	5,759,315,641.43	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。

### 9.2 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	2,330,000,000.00	7.61%
2	券商类机构	1,500,094,310.34	4.90%
3	其他机构	1,403,280,716.29	4.59%
4	券商类机构	1,013,165,037.96	3.31%
5	券商类机构	800,000,000.00	2.61%
6	其他机构	680,000,000.00	2.22%
7	券商类机构	600,057,864.87	1.96%
8	银行类机构	530,042,961.24	1.73%
9	保险类机构	503,733,120.07	1.65%
10	银行类机构	501,600,082.47	1.64%

### 9.3 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	10,576,896.52	0.3376%
	宝盈货币 B	0.00	0.0000%
	合计	10,576,896.52	0.0345%

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）。

### 9.4 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	宝盈货币 A	>100
	宝盈货币 B	0

有本开放式基金	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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	宝盈货币 A	宝盈货币 B
基金合同生效日（2009 年 8 月 5 日）基金份额总额	428,312,282.49	1,026,847,982.99
本报告期期初基金份额总额	3,121,511,397.92	14,287,189,319.34
本报告期基金总申购份额	14,639,757,305.96	100,734,387,689.47
减：本报告期基金总赎回份额	14,628,508,943.64	87,499,138,122.98
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	3,132,759,760.24	27,522,438,885.83

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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四届董事会第六次现场会议决议，同意张新元先生任宝盈基金管理有限公司副总经理。该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第四届董事会第二十六次临时会议决议，同意汪钦辞去总经理职务，在新聘总经理聘任到位之前，暂由公司董事长李文众先生代为履行公司总经理相关职责。本基金管理人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。

(3) 根据宝盈基金管理有限公司第五届董事会第一次现场会议决议，同意张啸川先生任宝盈基金管理有限公司总经理，丁宁先生任宝盈基金管理有限公司副总经理。该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) 宝盈基金管理有限公司原独立董事贺颖奇、屈文洲先生任职届满，不再担任公司独立董事。根据宝盈基金管理有限公司股东会 2017 年第一次现场会议，同意张苏彤、廖振中和王艳

艳担任宝盈基金管理有限公司独立董事，拟任公司总经理张啸川先生担任宝盈基金管理有限公司经营管理层董事，同意刘郁飞担任宝盈基金管理有限公司股东监事、魏玲玲和汪兀担任宝盈基金管理有限公司职工监事。本基金管理人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。

## 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：

2017 年 9 月 1 日，中国建设银行股份有限公司发布公告，聘任纪伟为中国建设银行股份有限公司资产托管业务部总经理。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

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

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内未发生改聘会计师事务所情况。本报告期应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费 170,000 元，目前事务所已连续 9 年为本基金提供审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

在本报告期内，基金管理人、托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

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

注：1、基金管理人选择使用基金专用交易单元的选择标准和程序为：

- (1) 实力雄厚，信誉良好，注册资本不少于 3 亿元人民币。
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。
- (3) 经营行为规范，最近两年未发生重大违规行为而受到中国证监会处罚。
- (4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求。

(5) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本基金进行证券交易的需要，并能为本基金提供全面的信息服务。

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

基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择，与被选择的券商签订证券交易单元租用协议。

## 2、本报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

### (1) 租用交易单元情况

本报告期内未租用交易单元。

### (2) 退租交易单元情况

本报告期内未退租交易单元。

## 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

无。

## 11.8 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。

## 11.9 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新增深圳新华信通资产管理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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年1月4日
2	宝盈基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年1月10日
3	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入公告	证券时报	2017年1月23日
4	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年1月26日
5	宝盈货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要	证券时报	2017年3月21日
6	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2017年3月28日
7	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
8	宝盈基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017年4月14日
9	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转	证券时报	2017年4月25日

	入公告		
10	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2017 年 5 月 24 日
11	宝盈基金管理有限公司关于投资者适当性管理业务变更及开展非居民金融账户涉税信息尽职调查的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 7 月 4 日
12	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 7 月 4 日
13	宝盈货币市场证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2017 年 8 月 3 日
14	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 8 月 12 日
15	宝盈基金管理有限公司关于新增北京蛋卷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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 8 月 25 日
16	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加中泰证券股份有限公司开展的基金费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 8 月 29 日
17	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金参加基煜基金销售有限公司开展的基金费率优惠活动的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 9 月 13 日
18	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 9 月 16 日
19	宝盈货币市场证券投资基金更新招募说明书摘要	证券时报	2017 年 9 月 16 日
20	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2017 年 9 月 26 日
21	宝盈基金管理有限公司关于新增上海挖财金融信息服务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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 9 月 29 日
22	宝盈货币市场证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2017 年 9 月 30 日
23	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 10 月 13 日
24	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 11 月 2 日
25	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 11 月 7 日
26	宝盈货币市场证券投资基金基金经理变更公告	证券时报	2017 年 11 月 11 日
27	宝盈基金管理有限公司关于新增南京苏宁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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 11 月 14 日
28	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金估值变更的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 11 月 16 日
29	宝盈基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报	2017 年 11 月 24 日

30	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金持有的停牌股票采用指数收益法进行估值的提示性公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 11 月 28 日
31	宝盈货币市场证券投资基金限制大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	证券时报	2017 年 12 月 1 日
32	宝盈基金管理有限公司关于新增天津万家财富资产管理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	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 19 日
33	宝盈基金管理有限公司关于旗下基金调整流通受限股票估值方法的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 26 日
34	宝盈货币市场证券投资基金暂停申购、转换转入业务的公告	证券时报	2017 年 12 月 27 日
35	宝盈基金管理有限公司关于公开募集证券投资基金管理缴纳增值税的公告	中国证券报 证券时报 上海证券报 证券日报	2017 年 12 月 30 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 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。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

中国证监会关于核准宝盈货币市场证券投资基金募集的文件。

《宝盈货币市场证券投资基金基金合同》。

《宝盈货币市场证券投资基金基金托管协议》。

宝盈基金管理有限公司批准成立批件、营业执照和公司章程。

本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告。

### 13.2 存放地点

基金管理人办公地址：广东省深圳市福田区福华一路 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

### 13.3 查阅方式

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

宝盈基金管理有限公司

2018 年 3 月 31 日