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

报告送出日期:二〇一一年八月二十七日 1.重要提示及目录

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

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2011年8月26日复核了本报告中的 财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、 误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。 基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。 本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2011 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止

2.基金简介

基金简称	宝盈货		
基金主代码		213009	
交易代码		213009	
基金运作方式		契约型开放式	
基金合同生效日	2009年8月5		
基金管理人	宝盈基金管理有限公		
基金托管人	中国建设银行股份有限公		
报告期末基金份额总额	111,411,655.24		
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	53,238,981.58 份	58,172,673.66 份	

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。
12 页日 你	在体持队内医与同院如注的塞恤上,但不信定的自身权量。
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危重和选择。投资策略考虑 各类资产的风险性、液动性反败或性特征。相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	本基金的或辦比較基准为:活期存款利率(稅后)。 本基金位产用金管理的工具、果用活明存款稅后利率作为本基金的业 銷比較基准,更能休配未基金良好的流动性与安全性。 如果今后有生它代表性更獨的或賴比較基准推出,或有更科学客观的权 思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,对业绩比较基准的变更需要基金管理人 和基金社管人协商一致,在履行适当程序后实施,并在更新的招票说明书中列示。
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 名称		基金管理人	基金托管人 中国建设银行股份有限公司	
		宝盈基金管理有限公司		
	姓名	孙胜华	尹东	
信息披露负责人	联系电话	0755-83276688	010-67595003	
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	yindong.zh@ccb.cn	
客户服务电话	多电话 400-8888-300		010-67595096	
传真		0755-83515599	010-66275853	
2.4信息披露方式				
登载基金半年度报告正	文的管理人互联网网加	www.byfunds.co	m	

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2011年1月1日至2011年6月30日)			
	宝盈货币 A	宝盈货币B		
本期已实现收益	1,126,530.01	1,798,551.87		
本期利润	1,126,530.01	1,798,551.87		
本期净值收益率	1.4604%	1.5821%		
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2011年6月30日)			
3.1.2 別不知語刊目的	宝盈货币 A	宝盈货币 B		
期末基金资产净值	53,238,981.58	58,172,673.66		
期末基金份額净值	1.0000	1.0000		

注:1、本基金收益分配是按日结转份额

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用

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

1. 宝盈货币 A:

阶段	份额净值收益 率①	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	0.2920%	0.0084%	0.0411%	0.0000%	0.2509%	0.00849
过去三个月	0.6046%	0.0054%	0.1233%	0.0001%	0.4813%	0.00539
过去六个月	1.4604%	0.0175%	0.2176%	0.0002%	1.2428%	0.01739
过去一年	2.1970%	0.0135%	0.3991%	0.0002%	1.7979%	0.01339
自基金合同生 效起至今	3.4243%	0.0155%	0.7246%	0.0001%	2.6997%	0.01549
2. 宝盈货币	В:					
阶段	份額净值收益 率①	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	0.3119%	0.0084%	0.0411%	0.0000%	0.2708%	0.00849
过去三个月	0.6652%	0.0054%	0.1233%	0.0001%	0.5419%	0.00534

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 宝盈货币市场证券投资基金 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

2009年8月5日至2011年6月30日) 1、宝盈货币 A DATE DOVE STOCK SEPTE STOCK STOKE A CKS STOCK SPOKE STOKE A TASK.

TOTAL TOTAL

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项 资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

2、宝盈货币 B

注:按基金合同规定,本基金自基金合同生效之日起的6个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项 资产配置比例符合基金合同中的相关约定。

4.管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人:宝盈基金管理有限公司是2001年按照证监会新的治理结构、新的内控体系"标准设立的 首批基金管理公司之一,2001年5月18日成立,注册资本为人民币1亿元,注册地在深圳。公司目前管理基 金鸿阳、宝盈鸿利收益、宝盈泛沿海、宝盈策略增长、宝盈增强收益、宝盈资源优选、宝盈核心优势、宝盈货 币、宝盈中证 100 九只基金,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 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 五	医亚红理 以虚3	医红理小组 灰基	玉 纪理助理的	[H]2]-	
姓名	姓名 职务	任本基金的基金经理期限		证券从业	说明
X土-仁1	RX 95	任职日期	离任日期	年限	DE 971
陈若劲	本基金基金经收券 理、宝盈增强证金 价券基金量 投资基金国定 经理兼监 经理总监	2009-08-06	-	8年	陈若劲,女。1971年生,香港中文大学金融 MBA。曾在第一创业证券有限责任公司图 定收益部从事价券投资,研究及交易等工 作。2008年4月加入宝盈基金管理有限公 司任债券组合研究局。现同时兼任宝盈赠 徵收益债券型证券投资基金经理、固定收 益都总监。中国国籍,证券投资基金从业 人员资格。

4.2管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

投资组合的业绩与管理人旗下其它组合的投资业绩不具有可比性。

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。经检查,公平交易制度执行情况良好。本报告期内,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,无损害组合持有人利益的行为。

4.3.2 本投资组合与其他投资风格相似的投资组合之间的业绩比较 本投资组合与管理人旗下的其他投资组合的投资风格存在较大的差异。由于投资风格的差异,本基金

宝盈货币市场证券投资基金

2011 半年度 报告摘要

2011年6月30日

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。

44管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

报告期内,通货膨胀持续走高,宏观调控日趋收紧,央行六次上调存款准备金率两次加息。 随着基准 利率的上调和大量流动性的回收,市场资金面逐渐趋紧,回购利率大幅攀升并持续在高位运行,上升幅度和

与回顺利率上行相对应,各期限央票品种一二级收益率也大幅上升,而且一二级市场收益率形成倒挂。 3个月期央票收益率由期初的3.1%左右攀升到期末的3.5%附近,1年期央票收益率由期初的3.4%附近攀

升到期末的3.8%附近,两者均已接近2007、2008年的高点水平 报告期内,我们的投资组合以短期限 shibor 浮息债和短融券为主,并逐渐减少组合中短期央票的比例,

加大组合中逆回购的比例,以规避央票收益率上行的风险。 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

货币 A: 截至本报告期末,本基金的份额争值为1.0000元。本报告期内本基金的份额净值收益率为1.4604%,业 绩比较基准收益率为 0.2176%

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1.5821%,业

绩比较基准收益率为 0.2176%。

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 2011 年下半年,我们判断资金面紧张程度将有所下降,回购利率也会有所回落,但是中长期看资

金收益率中枢仍处于上行周期,在此过程中,仍有可能因资金紧张带动回购利率脉冲式上升。 下半年不排除有一至两次加息,因此,短期央票收益率下行的空间也相对有限。

基于以上的判断,我们在下半年将寻找央票的阶段性投资机会,继续关注 shibor 浮息债和短融券,并保 留适当的现金和超短期央票等资产以保证组合足够的流动性。

4.6管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 本基金管理人按照新会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定,对基金持有的投资 品种进行估值。会计师事务所就我司所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报 告。基金托管人负责对基金管理公司采用的估值政策和程序进行核查,并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人设立估值工作小组,估值工作小组由本基金管理人的总经理任小组长,由投资部、研究部、金融工程部、基金事务部、监察稽核部指定人员组成。相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作 经历。估值工作小组负责制定、修订和完善基金估值政策和程序,定期对估值政策和程序进行评价,在发生 了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法,以保证其持续适用。投资部、研究部 负责定期对经济环境是否发生重大变化、证券发行机构是否发生影响证券价格的重大事件以及估值政策和 程序进行评价;金融工程部负责对估值模型及方法进行筛选,选择最具适用性的估值模型及参数,并负责估 值模型的选择及测算;基金事务部负责进行日常估值,并与托管行的估值结果核对一致;监察稽核部负责审 核估值政策和程序的一致性,监督估值委员会工作流程中的风险控制,并负责估值调整事项的信息披露工

上述参与估值流程的本基金管理人、本基金托管人和本基金聘请的会计师事务所各方不存在任何重大 利益冲突。基金经理不参与决定本基金估值的程序。本基金未接受任何已签约的与估值相关的任何定价服

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。

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

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

本报告期,本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定,对本基金的基金资产净 值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核,对本基金的投资运作方面进行了监督,未发现基金管理人 有损害基金份额持有人利益的行为

报告期内,本基金实施利润分配的金额为 2,925,081.88 元。 5.3托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6.半年度财务会计报告 床经审计

会计主体:宝盈货币市场证券投资基金

资产	本期末 2011年6月30日	上年度末 2010年12月31日
j ^{bc} :	2011 071 30	2010 1 12 // 31 //
行存款	644,988.27	6,317,023.22
算备付金	_	
出保证金	_	
易性金融资产	60,394,101.40	389,140,817.78
中:股票投资	_	-
金投资	_	-
券投资	60,394,101.40	389,140,817.78
产支持证券投资	_	
生金融资产	_	-
人返售金融资产	35,640,217.82	-
收证券清算款	_	-
收利息	382,854.09	1,651,190.82
收股利	_	
收申购款	14,518,200.00	155,726,053.85
延所得税资产	_	-
他资产	_	-
产总计	111,580,361.58	552,835,085.67
负债和所有者权益	本期末 2011年 6 月 30 日	上年度末 2010年 12 月 31 日
债:		
期借款	-	-
易性金融负债	-	
生金融负债	-	-
出回购金融资产款	-	
付证券清算款	-	149,530,928.73
付赎回款	-	5,102.29
付管理人报酬	40,347.24	61,569.52
付托管费	12,226.45	18,657.41
付销售服务费	12,333.23	7,963.86
付交易费用	10,303.80	5,806.97
交税费	-	
付利息	-	
付利润	9,654.27	14,552.40
延所得税负债	-	
他负债	83,841.35	54,564.24
债合计	168,706.34	149,699,145.42
有者权益:		
收基金	111,411,655.24	403,135,940.25
分配利润	-	_
有者权益合计	111,411,655.24	403,135,940.25
债和所有者权益总计	111,580,361.58	552,835,085.67

份额总额 53,238,981.58 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 58, 172,673.66 份。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

		单位:人民币
项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30 日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30 日
一、收入	3,673,416.19	1,473,189.33
1.利息收入	3,089,881.61	1,095,039.24
其中:存款利息收入	145,290.82	199,222.05
债券利息收人	2,403,943.56	768,123.90
资产支持证券利息收人	_	-
买人返售金融资产收人	540,647.23	127,693.29
其他利息收人	-	-
2.投资收益(损失以"="填列)	583,534.58	378,150.09
其中:股票投资收益	_	-
基金投资收益	_	-
债券投资收益	583,534.58	378,150.09
资产支持证券投资收益	_	-
衍生工具收益	_	-
股利收益	_	-
3.公允价值变动收益(损失以"_"号填列)	-	-
4.汇兑收益(损失以"="号填列)	_	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	_	-
减:二、费用	748,334.31	504,719.85
1.管理人报酬	392,278.73	272,246.76
2.托管费	118,872.40	84,923.38
3.销售服务费	130,437.37	59,124.11
4.交易费用	-	-
5.利息支出	11,229.37	491.11
其中:卖出回购金融资产支出	11,229.37	491.11
6.其他费用	95,516.44	87,934.49
三、利润总额(亏损总额以"="号填列)	2,925,081.88	968,469.48
减:所得税费用	-	_
四、净利润(净亏损以"="号填列)	2,925,081.88	968,469,48

会计主体: 宝盈货币市场证券投资基金

本报告期:2011年1月1日至2011年6月30日

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 403,135,940.2 2,925,081.88 2,925,081.8 -291,724,285.0 -291,724,285.0 1:1.基金申购前 1,959,491,460 1,959,491,460.4 -2,925,081.8 -2,925,081.8 111,411,655.2

2010年	上年度可比期间 1月1日至2010年6月30	В
实收基金	未分配利润	所有者权益合计
1,420,281,746.17	-	1,420,281,746.17
-	968,469.48	968,469.48
-1,249,532,147.94	-	-1,249,532,147.94
915,109,611.93	-	915,109,611.93
-2,164,641,759.87	-	-2,164,641,759.87
-	-968,469.48	-968,469.48
170,749,598.23	-	170,749,598.23
	实收基金 1,420,281,746.17 - -1,249,532,147.94 915,109,611.93 -2,164,641,759.87	2010年1月1日至2010年6月30 実収基金 未分配利詞 1,420,281,746.17 - 968,469.48 - 1,249.532,147.94 - 915,109.611.93 2,164.641,759.87 - 968,469.48 - 968,469.48 - 968,469.48

报告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:

基金管理公司负责人:汪钦,主管会计工作负责人:汪钦,会计机构负责人:何瑜

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 (金)字 09)第0014号验资报告予以验证。经向中国证监会备案, 儘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《生盈货币市场证券投资基金基金合同》和《生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 锭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(脱后)。

642 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会 十准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定《以下合称 企业会计准 则")、中国证监会公告 5010 b 号《证券投资基金信息披露 XBRL模板第3号《年度报告和半年度报告》》。 中国证券业协会于2007年5月15日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《宝盈货币市场证券投资 基金基金合同》和中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2011 年上半年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2011 年 6 月 30 日的财务状况以及 2011 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与上年度会计报表相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明 本基金本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计估计变更。 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

本基金本报告期所采用的税项与最近一期年度报告相一致。 6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 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。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方 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") 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。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易 6.4.8.1 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。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金官埋货		
		单位:人民币:
项目	本期 2011年1月1日至2011年6月30日	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	392,278.73	272,246.76
其中:支付销售机构的客户维护费	54,570.90	21,862.58
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

6.4.8.2.2 基金托管费

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日 118,872.40

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

日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.33% / 当年天数

	2011/5	本期 1月1日至2011年6月30日	1	
获得销售服务费的各关联方名称		生的基金应支付的销售服务署		
	宝盈货币 A	宝盈货币 B	合计	
中国建设银行	58,700.23	2,650.35	61,350.58	
宝盈基金管理有限公司	9,992.03	1,608.82	11,600.85	
合计	68,692.26	4,259.17	72,951.43	
	上年度可比期间 2010年1月1日至2010年6月30日			
获得销售服务费的各关联方名称	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	34,137.37	1,377.49	35,514.86	
宝盈基金管理有限公司	2,254.67	4,021.71	6,276.3	
合计	36,392.04	5,399.20	41,791.24	

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 B 类基金资产净值 X 0.01 % / 当年天数。

6.4.8.3 与关联	方进行银行	间同业市场的债券(含回购)交易	1		
						单位:人民币
		2011年1月1日	本期 至 2011 年 6 月	∃ 30 ⊟		
银行间市场交易的	债	券交易金额	基金逆回购		基金正[可购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国建设银行	-	49,776,850.22	-	-	-	-
		上年月 2010年1月1日	度可比期间 至 2010 年 6 月	∃ 30 ⊟		
银行间市场交易的	债	券交易金额	基金i	20购	基金正[可购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国建设银行	-	19,966,037.36	_	-	9,900,000.00	491.11

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况 本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金

6.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况 本基金本报告期末及上年度报告期末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。 6.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

本期 2011年1月1日至2011年6月30日 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

6.4.8.6 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。 6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.9 期末 2011 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券 6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券 本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票 6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购 截至本报告期末2011年6月30日止,本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的余额。

截至本报告期末2011年6月30日止,本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的余额。 6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项 本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7.投资组合报告 7.1 期末基金资产组合情况

54.13

金额单位:人民币元

3	银行存款和结算备付金合计	644,988.27	0.58
4	其他各项资产	14,901,054.09	13.35
5	合计	111,580,361.58	100.00

金额单位:人民币元 项目

注:报告期内债券回购融资金额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资金额占资产净值比例的8 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

金额单位:人民币元 调整期

2011-1-5 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

报告期内投资组合平均剩余期限超过 180 天情况说

本基金本报告期内无投资组合平均剩余期限超过180天的情况 7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例 :剩余存续期超过 397 天的符 利率债 :剩余存续期超过397天的浮 利率债

:剩余存续期超过 397 天的 利率债

			金额单位:人民币
序号	债券品种	推余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	20,278,763.83	18.20
	其中:政策性金融债	20,278,763.83	18.20
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,115,337.57	36.01
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	60,394,101.40	54.21
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.5 期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

					金额甲位:人民市
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	070211	07国开 11	200,000	20,278,763.83	18.20
2	1081437	10常纺 CP01	100,000	10,076,220.92	9.04
3	1181003	11魏桥 CP01	100,000	10,022,409.77	9.00
4	1181180	11海龙 CP01	100,000	10,016,307.00	8.99
5	1181194	11新野 CP01	100,000	10,000,399.88	8.98
7.6 影子定价"与 摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离					

7.7 期末按公允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

7.8投资组合报告附注

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。

0.14929

14.901.054.0

7.8.2 本基金本报告期内不存在持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的 摊余成本超过当日基金资产净值的 20%的情况。

7.8.3 本基金持有的 11 海龙 CP01,该债券发行人山东海龙股份有限公司于 2011 年 6 月 1 日收到中国 证券监督管理委员会的调查通知书,本基金在该日前已持有该债券。 基于以下原因本基金暂时继续持有本期债券:发行人作为国有企业,同时又是国内粘胶行业龙头,已发 行多期债券,均按时还本付息,具有良好的信用历史;该期债券票息较高,在收益率波动情况下能提供较好

的票息保护。 本基金将继续密切跟踪公司的基本面情况,并择机对投资组合进行调整

7.8.4 期末其他各项资产构成 单位:人民币元 382,854.0 14,518,200.0

7.8.5 其他需说明的重要事项 由于四舍五人的原因,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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

9,695,445.61 48,126,382.54 82.73% 97,987.38 49,641,251.34

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

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,比例的分母系

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. 开放式基金份额变动 428,312,282 1,026,847,982.9 99,653,274. 303,482,665.5 884,681,642 1,074,809,818.2 1,320,119,810.1

10. 重大事件揭示

10.1 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 报告期内基金管理人无重大人事变动。

本基金托管人 2011年2月9日发布公告,经中国建设银行研究决定,聘任杨新丰为中国建设银行投资 托管服务部副总经理 住持工作),其任职资格已经中国证监会审核批准 (证监许可 2011)115号)。解聘罗

本基金托管人 2011 年 1 月 31 日发布任免通知,解聘李春信中国建设银行投资托管服务部副总经理职 10.3 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。 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

10.5 报告期内改聘会计师事务所情况 本报告期内未发生改聘会计师事务所情况

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 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。

10.7.1 基金租用1	止寿公司父	易甲兀进仃股祟投贸	及佣金文付1	育亿		
					金额单位	:人民币
	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
券商名称		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	_	_	_	_	_

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

6)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 6)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

6)研究实力较强,有固定的研究机构和专门的研究人员,能及时为本基金提供高质量的咨询服务。 2、基金管理人根据以上标准进行评估后确定证券经营机构的选择,与被选择的券商签订证券交易单元 3、本基金与本基金管理公司管理的宝盈增强收益债券型证券投资基金共用交易单元,本报告期未租用

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

宝盈基金管理有限公司 二〇一一年八月二十七日