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:二〇一二年八月二十五日

宝盈货币市场证券投资基金

2012 半年度 报告摘要

2012年6月30日

1 重要提示

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2012年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2012年1月1日起至6月30日止。

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	宝盈货币	
基金主代码	213009	
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	2,349,713,068.56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	596,962,937.38份	1,752,750,131.18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	孙胜华	尹东
	联系电话	0755-83276688	010-67595003
	电子邮箱	sunsh@byfunds.com	yindong.zh@ccb.com
客户服务电话		400-8888-300	010-67595096
传真		0755-83515599	010-66275853

2.4 信息披露方式

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.byfunds.com
基金半年度报告备置地点	基金管理人、基金托管人处

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2012年1月1日至2012年6月30日)	
	宝盈货币A	宝盈货币B
本期已实现收益	7,952,542.73	12,816,056.57
本期利润	7,952,542.73	12,816,056.57
本期净值收益率	2.2829%	2.4040%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2012年6月30日)	
	宝盈货币A	宝盈货币B
期末基金资产净值	596,962,937.38	1,752,750,131.18
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

注:1、本基金收益分配是按日结转份额。

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

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

4、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

3.2 基金净值表现

3.2.1基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.2671%	0.0013%	0.0348%	0.0001%	0.2323%	0.0012%
过去三个月	0.9797%	0.0059%	0.1184%	0.0001%	0.8613%	0.0058%
过去六个月	2.2829%	0.0112%	0.2430%	0.0001%	2.0399%	0.0111%
过去一年	4.0017%	0.0111%	0.4951%	0.0001%	3.5066%	0.0110%
自基金合同生效起至今	7.5631%	0.0144%	1.2197%	0.0002%	6.3434%	0.0142%

2. 宝盈货币B:

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	0.2870%	0.0013%	0.0348%	0.0001%	0.2522%	0.0012%
过去三个月	1.0394%	0.0059%	0.1184%	0.0001%	0.9210%	0.0058%
过去六个月	2.4040%	0.0112%	0.2430%	0.0001%	2.1610%	0.0111%
过去一年	4.2510%	0.0111%	0.4951%	0.0001%	3.7559%	0.0110%
自基金合同生效起至今	8.3170%	0.0144%	1.2197%	0.0002%	7.0973%	0.0142%

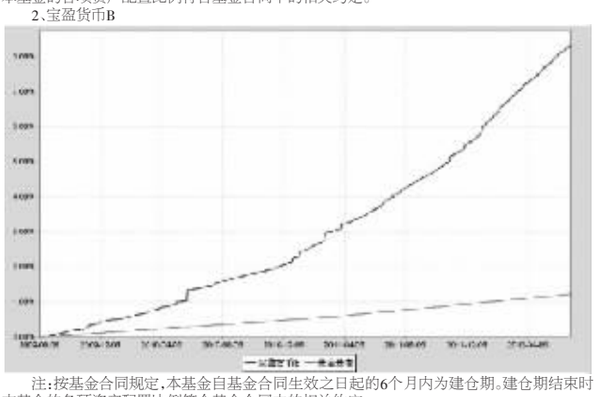
3.2.2自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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2012年6月30日)

1、宝盈货币A

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)及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈若劲	本基金基金经理、宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理兼固定收益部总监	2009-08-06	-	9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固定收益部从事债券投资、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员,现同时兼任宝盈增强收益债券型证券投资基金基金经理、固定收益部总监。中国国籍,证券投资基金从业人员资格。

注:1、本基金基金经理为首任基金经理,其“任职日期”按基金合同生效日填写;

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定,证券从业年限的计算截至2012年6月30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 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说明

4.4.1报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,经济增长和通货膨胀同步快速下行,货币政策转向宽松,央行多次下调存贷款基准利率和存款准备金率。虽然时有波折,但是报告期内,市场资金面整体随货币政策转向而逐渐好转,回购利率除春节、季末等几个时点出现脉冲式上升外,均维持较低水平。

报告期内,各类别债券收益率分别出现不同程度下降,信用品种下行幅度更大。各期限AAA评级短融券收益率下行幅度均超过150BP,而AA评级则下行超过200BP。

报告期内,我们的投资组合以银行定期存款、浮息债和短融券为主,择机适当放大杠杆以提高组合整体收益率。

4.4.2报告期内基金的业绩表现

货币A:

截至本报告期末,本基金的份额净值为1.0000元。本报告期内本基金的份额净值收益率为2.2829%,业绩比较基准收益率为0.2430%。

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2.4040%,业绩比较基准收益率为0.2430%。

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2012年下半年,在经济增速探底企稳迹象尚未明朗,同时通胀继续大幅回落情况下,预计央行将延续宽松的货币政策,存贷款利率和存款准备金率仍有继续下调的空间。预计下半年市场资金面整体仍将维持相对宽松局面。

随着宽松货币政策和积极财政政策效果的积累,下半年经济有望见底企稳。在此背景下,各期限债券收益率继续大幅下行的可能性较低,而低评级信用债还有可能遭遇评级下调冲击,信用利差有扩大的风险,因此,在宽松的资金情况下,我们将继续加大对中高等级信用产品的配置比例。此外,由于银行时点考核等因素的影响,不排除下半年资金面仍有阶段性资金紧张的机会,将成为配置债券和银行存款较好的时间窗口。

基于以上判断,我们在下半年将继续配置信用资质良好、收益率较高的短融券和浮息债,同时在市场资金面紧张时期适当配置银行定期存款。

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作。

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务。

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 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,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20,768,599.30元。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:宝盈货币市场证券投资基金

报告截止日:2012年6月30日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
资 产:			
银行存款		1,903,265,334.87	127,997,725.62
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产		704,576,966.56	90,401,076.23
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		704,576,966.56	90,401,076.23
资产支持证券投资		-	-
衍生金融资产		-	-
买入返售金融资产		-	40,000,180.00
应收证券清算款		-	-
应收利息		20,255,090.92	1,238,116.28
应收股利		-	-
应收申购款		31,335,362.77	321,181.84
递延所得税资产		-	-
其他资产		2,367.12	-
资产总计		2,659,435,122.24	259,958,279.97
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012年6月30日	上年度末 2011年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		307,999,218.00	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		3,497.67	42,751.72
应付管理人报酬		693,182.20	62,681.64
应付托管费		210,055.20	18,994.45
应付销售服务费		178,538.14	23,001.17
应付交易费用		31,929.90	12,023.43
应交税费		-	-
应付利息		79,650.19	-
应付利润		442,340.87	66,554.41
递延所得税负债		-	-
其他负债		83,641.51	54,774.13
负债合计		309,722,053.68	280,780.95
所有者权益:			
实收基金		2,349,713,068.56	259,677,499.02
未分配利润		-	-
所有者权益合计		2,349,713,068.56	259,677,499.02
负债和所有者权益总计		2,659,435,122.24	259,958,279.97

注:本报告截止日2012年6月30日,宝盈货币市场证券投资基金A类基金份额净值1.0000元,基金份额总额596,962,937.38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1,752,750,131.18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2,349,713,068.56份。

6.2 利润表

会计主体:宝盈货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
一、收入		24,207,649.49	3,673,416.19
1.利息收入		21,864,808.21	3,089,881.61
其中:存款利息收入		15,863,146.25	145,290.82
债券利息收入		4,908,333.98	2,403,943.56
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,093,327.98	540,647.23
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以“-”填列)		2,342,841.28	583,534.58
其中:股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益		2,342,841.28	583,534.58
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		3,439,050.19	748,334.31
1.管理人报酬		1,648,489.95	392,278.73
2.托管费		499,542.47	118,872.40
3.销售服务费		511,570.83	130,437.37
4.交易费用		-	-
5.利息支出		668,190.68	11,229.37
其中:卖出回购金融资产支出		668,190.68	11,229.37
6.其他费用		111,256.26	95,516.44
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		20,768,599.30	2,925,081.88
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		20,768,599.30	2,925,081.88

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:宝盈货币市场证券投资基金

本报告期:2012年1月1日至2012年6月30日

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	259,677,499.02	-	259,677,499.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	20,768,599.30	20,768,599.30
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)	2,090,035,569.54	-	2,090,035,569.54
其中:1.基金申购款	8,971,767,550.89	-	8,971,767,550.89
2.基金赎回款	-6,881,731,981.35	-	-6,881,731,981.35
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)	-	-20,768,599.30	-20,768,599.30
五、期末所有者权益(基金净值)	2,349,713,068.56	-	2,349,713,068.56
项目	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	403,135,940.25	-	403,135,940.25
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	2,925,081.88	2,925,081.88
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)	-291,724,285.01	-	-291,724,285.01
其中:1.基金申购款	1,959,491,460.45	-	1,959,491,460.45
2.基金赎回款	-2,251,215,745.46	-	-2,251,215,745.46
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)	-	-2,925,081.88	-2,925,081.88
五、期末所有者权益(基金净值)	111,411,655.24	-	111,411,655.24

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:胡坤,会计机构负责人:何瑜

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日颁布的《企业会计准则-基本准则》和38项具体会计准则、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[2010]5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2012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2012年6月30日的财务状况以及2012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。

6.4.6 税项

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

关联方名称	与本基金的关系
宝盈基金管理有限公司	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

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 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,648,489.95	392,278.73
其中:支付销售机构的客户维护费	242,653.35	54,570.90

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。

6.4.8.2.2基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日	上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	499,542.47	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。

6.4.8.2.3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 2012年1月1日至2012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	211,194.11	8,646.72	219,840.83
宝盈基金管理有限公司	43,322.32	14,110.42	57,432.74
合计	254,516.43	22,757.14	277,273.57
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	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

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金资产净值0.25%的年费率以及B类基金资产净值0.01%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给宝盈基金管理有限公司,再由宝盈基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为:

日销售服务费=前一日A类基金资产净值 X 0.25 %/当年天数。

日销售服务费=前一日B类基金资产净值 X 0.01 %/当年天数。

6.4.8.3 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 2012年1月1日至2012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	-	10,112,248.20	-	-	1,067,000,000.00	149,243.17
上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	-	49,776,850.22	-	-	-	-

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

份额单位:份

项目	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011年6月30日	
	宝盈货币A	宝盈货币B	宝盈货币A	宝盈货币B
期初持有的基金份额	-	-	-	-
期间申购/买入总份额	-	30,032,858.32	-	-
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	-	30,032,858.32	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.28%	-	-

注:本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书规定的费率结构。

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

单位:人民币元

关联方名称	本期 2012年1月1日至2012年6月30日		上年度可比期间 2011年1月1日至2011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	106,265,334.87	849,928.94	644,988.27	145,037.10

注:1、本基金本期末存放于基金托管人中国建设银行的活期存款余额为6,265,334.87元,按银行同业利率计息。

2、本基金本期末存放于基金托管人中国建设银行的协议存款余额为100,000,000.00元,按约定利率计息。

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

本基金无其他关联交易事项的说明。

6.4.9 期末(2012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。

6.4.9.2期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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2012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307,999,218.00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
110402	11农发02	2012-07-02	100.06	1,000,000	100,060,000.00
090205	09国开05	2012-07-03	101.23	500,000	50,615,000.00
100209	10国开09	2012-07-03	100.94	600,000	60,564,000.00
100236	10国开36	2012-07-03	101.09	600,000	60,654,000.00
110402	11农发02	2012-07-03	100.06	400,000	40,024,000.00
合计		-	-	3,100,000	311,917,000.00

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2012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

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	704,576,966.56	26.49
	其中:债券	704,576,966.56	26.49
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	1,903,265,334.87	71.57
4	其他各项资产	51,592,820.81	1.94
5	合计	2,659,435,122.24	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	3.07	
	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	307,999,218.00	13.11
	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????????	79
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	119
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	48

报告期内投资组合平均剩余期限超过180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180天的情况。根据本基金《基金合同》中关于投资组合限制的约定:“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”;且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	31.30	13.11
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	8.56	-
2	30天(含)-60天	23.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.70	-
3	60天(含)-90天	20.93	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	4.74	-
4	90天(含)-180天	24.68	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债