

## 东兴安盈宝货币市场基金招募说明书（更新）摘要

基金管理人：东兴证券股份有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

二零一七年一月

### 重要提示

东兴安盈宝货币市场基金（以下简称“本基金”）于2016年4月11日已在中国证监会注册（证监许可[2016]720号文）。本基金基金合同于2016年6月3日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册，但中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

证券投资基金（以下简称“基金”）是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资人购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式，但并不能规避基金投资所固有的风险，不能保证投资人获得收益，也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险，既包括市场风险，也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险，即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一日基金总份额的百分之十时，投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金为货币市场基金，属证券投资基金中的较低风险收益品种，但投

投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现，基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资人自行承担。

本招募说明书已经本基金托管人复核，基金管理人股权结构及有关财务数据和净值表现截止日为2016年9月30日（财务数据未经审计），本招募说明书其他所载内容截止日为2016年12月3日。

本摘要根据本基金合同和本基金《招募说明书》编写，并经中国证监会核准。基金合同是约定基金当事人之间权利、义务的法律文件。基金投资人自依基金合同取得基金份额，即成为基金份额持有人和本基金合同的当事人，其持有基金份额的行为本身即表明其对基金合同的承认和接受，并按照《中华人民共和国证券投资基金法》（以下简称《基金法》）、《公开募集证券投资基金运作管理办法》（以下简称《运作办法》）、基金合同及其他有关规定享有权利、承担义务。基金投资人欲了解基金份额持有人的权利和义务，应详细查阅本基金合同。

## 一、基金合同生效日期

2016年6月3日

## 二、基金管理人

### （一）基金管理人概况

名称：东兴证券股份有限公司

成立日期：2008年5月28日

注册地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

组织形式：股份有限公司

联系人：张韵

联系电话：010-66551816

传真：010-66551452

注册资本：27.585.04 亿元人民币

股权结构：

序号 股东名称 持股数量（股） 持股比例（%）

1 中国东方资产管理公司 1,454,600,484 58.09%

2 上海国盛集团资产有限公司 96,973,366 3.87%

3 泰禾集团股份有限公司 54,000,000 2.16%

4 北京永信国际投资（集团）有限公司 50,335,000 2.01%

5 福建天宝矿业集团股份有限公司 50,000,000 2.00%

## （二）主要人员情况

### 1、董事会成员

魏庆华先生，1964 年 10 月出生，博士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局；曾任清流县人民银行股长、副行长，三明市人民银行办公室副主任（主持工作），闽发证券三明支公司总经理，闽发证券副总裁、总裁，东兴证券副总经理，东兴证券董事；2015 年 3 月至今

任东兴证券董事长，兼总经理、财务负责人，东兴期货董事长，东兴投资董事。

谭世豪先生，1964 年 1 月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国银行国际业务部科员、主任科员、副处长、处长，东方资产股权及投行部经理、助理总经理、资产经营部副总经理，邦信资产管理有限公司副总经理，东方资产人力资源部副总经理。

2012年10月至今任东兴证券副董事长，现兼任东兴投资董事长，东兴资本董事长，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事长。

印建民先生，1966年1月出生，大学本科学历。曾任职于中国银行股份有限公司、中国东方资产管理公司广州办事处、云南经营部、深圳办事处。2010

年9月至2011年5月任中国东方资产管理公司云南经营部副总经理；2011年5月至2013年6月任中国东方资产管理公司深圳办事处副总经理；2013年6月至今任中国东方资产管理公司投融资审核及处置审查部总经理。2016年1月至今任东兴证券董事。

秦斌先生，1968年4月出生，博士研究生学历。秦斌先生曾任职于中国银行股份有限公司、中国东方资产管理公司股权及投行业务部、市场开发部、总裁

办公室、研发中心。2010年5月至2011年11月任中国东方资产管理公司研发中心副总经理；2011年11月至2013年1月任中国东方资产管理公司研发中心总经理；2013年1月至今任中国东方资产管理公司战略发展规划部总经理。2016年1月至今任东兴证券董事。

丁源女士，1956年11月出生，大学本科，中国国籍，无境外永久居留权。曾任经济日报出版社期刊编辑室副主任，国务院研究室副处长、处长，中国银行国际金融研究所副总经理，东方资产总裁办公室副总经理、发展规划部总经理、北京办事处副总经理。2010年8月至今任东兴证券董事。

宁静女士，1976年1月出生，硕士研究生，高级会计师、中国注册会计师、中国注册税务师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任东方资产资金财会部高级职员、主任、副经理、经理，东方资产上海办事处资金财会部经理、高级经理，上海东兴投资控股发展有限公司财务负责人，东方资产资金财会部高级经理、助理总经理、副总经理；现任中华联合保

险控股股份有限公司副总经理。2010年8月至今任东兴证券董事。

屠旋旋先生，1973年8月出生，大学本科，经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于东方资产上海办事处，上海大盛资产有限公司；曾任上海国盛（集团）有限公司资产管理中心副主任、上海国盛资产经营部总经理、总裁助理；现任上海国盛副总裁，上海盛翰投资有限公司执行董事，上海正浩资产管理有限公司董事长，上海外环隧道建设发展有限公司董事，上海复兴隧道建设发展有限公司董事，湖南外商国际活动中心有限公司董事长，上海金煤化工新技术有限公司董事，安徽易能生物能源有限公司监事，湖南外商白金公寓酒店有限公司董事长，上海实久公司总经理，上海盛融国际游船公司执行董事（法定代表人），上海棱光实业有限公司党委书记、执行董事（法定代表人）。2007年8月至今任东兴证券董事。

钟伟先生，1969年2月出生，博士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。北京师范大学经济与工商管理学院教授、博士生导师。主要从事证券市场和国际金融领域的研究，兼任富滇银行股份有限公司独立董事。2010年8月至今任东兴证券独立董事。

李健女士，1953年9月出生，博士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。中央财经大学教授、博士生导师，兼任教育部金融学专业教学指导委员会副主任，中国金融学会理事，中国国际金融学会理事，中国人寿资产股份有限公司独立董事，北京银行股份有限公司独立董事，五矿证券有限公司独立董事，交通银行股份有限公司独立董事，国务院特殊津贴和首届百位国家教学名师奖获得者，首批国家级教学团队带头人。2010年8月至今任东兴证券独立董事。

朱武祥先生，1965年5月出生，博士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。清华大学经济管理学院教授、博士生导师。主要从事公司金融研究，包括：商业模式、公司金融工程、资本运作与价值管理等，兼任北京建设（控股）有限公司独立董事，华夏幸福基业股份有限公司独立董事，中兴通讯股份有限公司独立董事，海洋石油工程股份有限公司独立董事，紫光股份有限公司监事

会主席，光大证券股份有限公司监事。2011年11月至今任东兴证券独立董事。

韩建旻先生，1969年12月出生，硕士研究生，高级会计师、中国注册会计师、中国注册资产评估师、中国注册税务师，中国国籍，无境外永久居留权。现任大华会计师事务所管理委员会委员、执行合伙人，兼任中国民生银行股份有限公司独立董事，天津渤海商品交易所股份有限公司独立董事，财政部管理会计咨询专家委员会委员，北京注册会计师协会惩戒委员会委员，北京粮食集团有限责任公司外部董事。2011年11月至今任东兴证券独立董事。

## 2、监事会成员

许向阳先生，1965年7月出生，大学本科，律师，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国政法大学讲师，国家经济体制改革委员会政策法规司副处长、处长，中国银行法律部处长，东方资产总裁办公室、资产处置审查办公室副总经理，哈尔滨办事处、法律事务部、机构管理部总经理。2011年7月至今任东兴证券监事会主席。

吴桥辉先生，1973年10月出生，大学本科，会计师、中国注册会计师、中国注册税务师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建省华侨信托投资公司；曾任中国证监会福建监管局上市公司监管处副处长，北京中兴鸿基科技有限公司副总经理；现任福建企联超越投资有限公司董事、福建省莆田市涵江区含元

股权投资管中心（有限合伙企业）执行事务合伙人、福建创鑫科技发展有限公司董

事、福建中科光汇激光科技有限公司董事。2011年11月至今任东兴证券监事。

罗小平先生，1960年5月出生，硕士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于天津远洋运输公司；曾任华夏证券股份有限公司并购部、营业部总经理，中华企业咨询有限公司执行总裁，诚通控股战略发展中心总监；现任中国诚通控股集团有限公司专职派出董事，中国物流有限公司派出董事，中国诚通香港有限公司派出董事。2011年

11 月至今任东兴证券监事。

刘天先生，1972 年 9 月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于华夏证券股份有限公司西安营业部，长征火箭技术股份有限公司；曾任新时代证券有限责任公司人力资源部总经理，东兴证券人力资源部副总经理；现任东兴证券人力资源部总经理。2011 年 11 月至今任东兴证券职工监事，东兴投资监事。

杜彬先生，1973 年 2 月出生，大学本科，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于中国人民银行；曾任中国民族国际信托投资公司国际业务部副经理、资产管理部总经理，中国民族证券有限责任公司法律及合规政策部经理、合规部副总经理、总经理、合规部兼风险管理部总经理、合规风控部总经理；现任东兴证券合规法律部总经理。2014 年 8 月至今任东兴证券职工监事。

### 3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华先生，简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生，1963 年 12 月出生，博士研究生，高级经济师，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于财政部财政科学研究所；曾任中国南山开发公司上市小组成员，深圳证券交易所高级研究员，广州尊荣集团副总经理，深圳汉君雄投资公司副总经理，亚洲控股有限公司总裁助理，大通证券股份有限公司副总经理，东兴证券副总经理。2008 年 12 月至今任东兴证券合规总监，2015 年 9 月 22 日至今任公司副总经理，东兴资本董事，东兴投资董事，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

银国宏先生，1974 年 3 月出生，博士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理，中信建投证券有限责任公司研究所所长助理，东兴证券研究所总经理，东兴证券助理总经理，兼研究所、机构业务部总经理。2011 年 3 月至今任东兴证券副总经理，现兼任机构业务部总经理，基金业务部总经理，东兴期货董事，东兴投资董事。

孙小庆先生，1964 年 9 月出生，大学本科，工程师，中国国籍，无境外

永久居留权。曾就职于中国银行安徽省分行；曾任东方资产合肥办事处高级主任、副经理、助理总经理，闽发证券清算组副组长，东兴证券助理总经理。2012年4月至今任东兴证券副总经理，现兼任融资融券部总经理。

张军先生，1975年5月出生，硕士研究生，中国国籍，无境外永久居留权。曾任中诚信托投资有限责任公司信托经理，中国证券监督管理委员会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长。2015年9月22日至今任公司首席风险官，东兴证券（香港）金融控股有限公司董事。

刘亮先生，1974年10月出生，大学本科，中国国籍，无境外永久居留权。曾就职于福建省政府办公厅证券办、中国证监会福建特派员办事处、中国证监会福建监管局，曾任中国证监会福建监管局主任科员、副处长、处长，东兴证券助理总经理，兼任董事会办公室总经理、总经理办公室总经理。2013年9月至今任东兴证券董事会秘书，现兼任董事会办公室总经理、总经理办公室总经理、场外市场部总经理。

#### 4、合规总监

许学礼先生，简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

#### 5、本基金基金经理

吕姝仪女士，中国人民大学经济学硕士。东兴安盈宝货币基金基金经理。曾就职于中山证券有限责任公司资产管理部固收投资助理、民生加银基金管理有限公司固收交易主管的职位。2015年9月加入东兴证券基金业务部。

孙继青先生，北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，7年证券行业经验。2007年10月加入东兴证券，2007年10月至2012年3月任东兴证券研究所钢铁行业研究员；2012年3月至2013年6月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员、宏观策略研究员；2013年6月至2014年9月任东兴证券资产管理部投资经理。2014年9月加入东兴证券基金部。

#### 6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生，简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍

郑闵钢先生，现任研究所首席研究员。

郭晓杰女士，现任风险管理部风险管理专员。

孙继青先生，现任基金业务部基金经理。

李森女士，现任基金业务部市场总监。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

### 三、基金托管人

#### （一）基金托管人概况

名称：中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称：中国邮政储蓄银行)

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号A座

法定代表人：李国华

成立时间：2007年3月6日

组织形式：股份有限公司

注册资本：686.04亿元人民币

存续期间：持续经营

批准设立机关及批准设立文号：中国银监会银监复〔2006〕484号

基金托管资格批文及文号：证监许可〔2009〕673号

联系人：王璞

联系电话：010—68858126

经营范围：吸收公众存款；发放短期、中期、长期贷款；办理国内外结算；办理票据承兑和贴现；发行金融债券；代理发行、代理兑付、承销政府债券；买卖政府债券、金融债券；从事同业拆借；买卖、代理买卖外汇；从事银行卡业务；提供信用证服务及担保；代理收付款项及代理保险业务；提供保险箱服务；经中国银行业监督管理委员会等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准，中国邮政储蓄银行有限责任公司（成立于2007年3月6日）于2012年1月21日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、

业务和人员，依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务，以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位，发挥邮政网络优势，强化内部控制，合规稳健经营，为广大城乡居民及企业提供优质金融服务，实现股东价值最大化，支持国民经济发展和社会进步。

## （二）主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部，下设资产托管处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 20 人，全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格，80%员工具有三年以上基金从业经历，具备丰富的托管服务经验。

## （三）基金托管业务经营情况

2009 年 7 月 23 日，中国邮政储蓄银行经中国证券监督管理委员会和中国银行业监督管理委员会联合批准，获得证券投资基金托管资格，是我国第 16 家托管银行。2012 年 7 月 19 日，中国邮政储蓄银行经中国保险业监督管理委员会批准，获得保险资金托管资格。中国邮政储蓄银行坚持以客户为中心、以服务为基础的经营理念，依托专业的托管团队、灵活的托管业务系统、规范的托管管理制度、健全的内控体系、运作高效的业务处理模式，为广大基金份额持有人和众多资产管理机构提供安全、高效、专业、全面的托管服务，并获得了合作伙伴一致好评。

截至 2016 年 9 月 30 日，中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 51 只，包括中欧行业成长混合型证券投资基金(LOF)（原中欧中小盘股票型证券投资基金(LOF)）(166006)、长信纯债壹号债券型证券投资基金（原长信中短债证券投资基金）(519985)、东方保本混合型开放式证券投资基金（400013）、万家添利债券型证券投资基金(LOF)（161908）、长信利鑫分级债券型证券投资基金（163003）、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)（164208）、鹏华丰泽债券型证券投资基金(LOF)

（160618）、东方增长中小盘混合型开放式证券投资基金（400015）、

长安宏观策略股票型证券投资基金（740001）、金鹰持久增利债券型证券投资基金（LOF）（162105）、中欧信用增利债券型证券投资基金（LOF）（166012）、农银汇理消费主题股票型证券投资基金（660012）、浦银安盛中证锐联基本面 400 指数证券投资基金（519117）、天弘现金管家货币市场基金（420006）、汇丰晋信恒生 A 股行业龙头指数证券投资基金（540012）、华安安心收益债券型证券投资基金（040036）、东方强化收益债券型证券投资基金（400016）、中欧纯债分级债券型证券投资基金（166016）、东方安心收益保本混合型证券投资基金（400020）、银河岁岁回报定期开放债券型证券投资基金（519662）、中欧纯债添利分级债券型证券投资基金（166021）、银河灵活配置混合型证券投资基金（519656）、天弘通利混合型证券投资基金（000573）、中加纯债一年定期开放债券型证券投资基金（000552）、南方通利债券型证券投资基金（000563）、中邮货币市场基金（000576）、易方达财富快线货币市场基金（000647）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金（000774）、中邮核心科技创新灵活配置混合证券投资基金（000966）、中信建投凤凰货币市场基金（001006）、景顺长城稳健回报灵活配置混合型证券投资基金（001194）、南方利淘灵活配置混合型证券投资基金（001183）、易方达新收益灵活配置混合型证券投资基金（001216）、易方达改革红利混合型证券投资基金（001076）、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金（001250）、易方达新利灵活配置混合型证券投资基金（001249）、易方达新鑫灵活配置混合型证券投资基金（001285）、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金（001210）、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金（001447）、易方达新益灵活配置混合型证券投资基金（001314）、方正富邦优选灵活配置混合型证券投资基金（001431）、易方达瑞景灵活配置混合型证券投资基金（001433）、南方利安灵活配置混合型证券投资基金（001570）、广发安富回报灵活配置混合型证券投资基金（002107）、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金（002388）、博时泰和债券型证券投资基金（002608）、融通增益债券型证券投资基金（002342）、东兴安盈宝货

币市场基金（002759）、万家颐和保本混合型证券投资基金（519198）、创金合信鑫价值灵活配置混合型证券投资基金（003191）、创金合信鑫动力灵活配置混合型证券投资基金（003230）。至今，中国邮政储蓄银行已形成涵盖证券投资基金、基金公司特定客户资产管理计划、信托计划、银行理财产品（本外币）、私募基金、证券公司资产管理计划、保险资金、保险资产管理计划等多种资产类型的托管产品体系，托管规模达 37164.24 亿元。

#### （四）基金托管人的内部控制制度

##### 1、内部控制目标

作为基金托管人，中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定，守法经营、规范运作、严格监察，确保业务的稳健运行，保证基金财产的安全完整，确保有关信息的真实、准确、完整、及时，保护基金份额持有人的合法权益。

##### 2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会，负责全行风险管理与内部控制工作，对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室，配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作，具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

##### 3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系，建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程，可以保证托管业务的规范操作和顺利进行；业务人员具备从业资格；业务管理严格实行复核、审核、检查制度，授权工作实行集中控制，业务印章按规程保管、存放、使用，账户资料严格保管，制约机制严格有效；业务操作区专门设置，封闭管理，实施音像监控；业务信息由专职信息披露人员负责，防止泄密；业务实现自动化操作，防止人为事故的发生，技术系统完整、独立。

#### （五）基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

##### 1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定，监督所托管基金的投

资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定，对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督，对违法违规行为及时予以风险提示，要求其限期纠正，同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中，对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

## 2、监督流程

(1) 每工作日按时通过基金监督子系统，对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控，发现投资比例超标等异常情况，向基金管理人发出书面通知，与基金管理人进行情况核实，督促其纠正，并及时报告中国证监会。

(2) 收到基金管理人的划款指令后，对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3) 通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易，电话或书面要求管理人进行解释或举证，要求限期纠正，并及时报告中国证监会。

## 四、相关服务机构

### (一) 基金份额发售机构

#### 1、直销机构

(1) 东兴证券股份有限公司直销中心

a、东兴证券股份有限公司直销柜台

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

联系人：张韵吴霜

直销中心电话：010-6655-18161532

传真：010-66551452

公司网站：<http://www.dxzq.net>

b、东兴证券股份有限公司网上直销系统

交易系统网址：<https://tradefund.dxzq.net/etrading/>

(2) 东兴证券股份有限公司各分支机构

住所：北京西城区金融大街5号新盛大厦B座6层

办公地址：北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 6 层

法人代表：魏庆华

联系人：田丰舞

电话：010-66551707

传真：010-66551452

基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构代理销售基金，并及时公告。

## 2、代销机构

东兴证券股份有限公司各营业部以及基金管理人委托的代销机构，代销机构具体信息见基金份额发售公告。

### (1) 北京汇成基金销售有限公司

公司网站：[www.fundzone.cn](http://www.fundzone.cn)

客服热线：400-619-9059

### (2) 乾道金融信息服务（北京）有限公司

公司网站：[www.qiandaojr.com](http://www.qiandaojr.com)

客服热线：400-0888-080

### (3) 大泰金石投资管理有限公司

公司网站：[www.dtfunds.com](http://www.dtfunds.com)

客服热线：400-9282-299

### (4) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 3 号

办公地址：北京市西城区金融大街 3 号 A 座

法定代表人：李国华

联系人：文彦娜

联系电话：010-68858101

传真：010-68858057

公司网站：<http://www.psbc.com>

### (5) 联讯证券股份有限公司

注册地址：广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、

四楼

法定代表人：徐刚

联系人：彭莲

电话： (0752)2119700

公司网站： <http://www.lxzq.com.cn>

(6) 上海天天基金销售有限公司

注册地址：上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层

法定代表人：其实

联系人：丁姗姗

电话： 010-65980408-8009

传真： 010-65980408-8000

公司网址： [www.1234657.com.cn](http://www.1234657.com.cn)

(7) 上海好买基金销售有限公司

注册地址：上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号

法定代表人：杨文斌

联系人：戴稽汉

电话： 021-20613647

传真： 021- 68596916

公司网站： [www.ehowbuy.com](http://www.ehowbuy.com)

(8) 北京恒天明泽基金销售有限公司

注册地址：北京市经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室

办公地址：北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层

法定代表人：梁越

联系人：张晔

电话： 010-58845312

公司网站： [www.chtfund.com](http://www.chtfund.com)

(9) 北京钱景财富投资管理有限公司

注册地址：北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008-1012

法定代表人：赵荣春

联系人：崔丁元

电话： 010-57418813

传真： 010-57569671

公司网站： [www.qianjing.com](http://www.qianjing.com)

(10) 上海长量基金销售投资顾问有限公司

注册地址：上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室

办公地址：上海市浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼

法定代表人：张跃伟

联系人：苗明

电话： 021-20691923

传真： 021-20691861

公司网站： <http://www.erichfund.com/>

(11) 北京展恒基金销售股份有限公司

注册地址：北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号

地址：北京市朝阳区安苑路 15-1 号邮电新闻大厦二层

法定代表人：闫振杰

联系人：马林

电话： 010-59601366-7024

公司网站： [www.myfund.com](http://www.myfund.com)

(12) 北京新浪仓石基金销售有限公司

注册地址：北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室

法定代表人：张琪

联系人：付文红

电话： 010-62676405

公司网站： [www.xincai.com](http://www.xincai.com)

(二) 登记机构

名称：东兴证券股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街 5 号（新盛大厦）B 座 12、15 层

法定代表人：魏庆华

办公地址：北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

联系人：王广辉

电话：010-66551599

传真：010-66551452

### （三）律师事务所

名称：北京市天元律师事务所

住所：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

办公地址：北京市西城区丰盛胡同28号太平洋保险大厦10层

负责人：朱小辉

电话：010-57763888

传真：010-57763777

经办律师：吴冠雄、李晗

### （四）会计师事务所

名称：瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）

注册地址：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

办公地址：北京市海淀区西四环中路16号院2号楼4层

北京市东城区永定门西滨河路8号院7号楼中海地产广场西塔5-11层

执行事务合伙人：杨剑涛、顾仁荣

联系电话：010-88095588

传真：010-88901190

经办注册会计师：王需如、刘涛

## 五、基金名称和基金类型

（一）本基金名称：东兴安盈宝货币市场基金

（二）本基金类型：货币市场基金

运作方式：契约型开放式

## 六、基金的投资目标和投资方向

（一）投资目标

在严格控制风险、保持较高流动性的基础上，力争超越业绩比较基准的投资收益、实现基金资产的稳定增值。

## （二）投资范围

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，包括：

- 1、 现金；
- 2、 1 年以内（含 1 年）的银行存款；
- 3、 期限在 1 年以内（含 1 年）的债券回购；
- 4、 期限在 1 年以内（含 1 年）的中央银行票据（以下简称“央行票据”）；
- 5、 期限在 1 年以内（含 1 年）的同业存单；
- 6、 剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的债券、非金融企业债务融资工具、资产支持证券、中期票据；
- 7、 中国证监会、中国人民银行认可的其它具有良好流动性的货币市场工具。

对于法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资的其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

## 七、基金的投资策略

### 1、决策依据

- （1）国家有关法律法规、监管规定和基金合同的有关规定；
- （2）宏观经济运行情况，货币政策执行情况，短期资金市场的资金供给与需求情况等；
- （3）投研团队提供的宏观经济分析报告、策略分析报告、固定收益债券分析报告、定量分析报告等。

### 2、投资决策程序

- （1）研究人员为投资运作提供投资建议；
- （2）投资决策委员会确定资产配置方案；
- （3）基金经理负责拟定投资方案；
- （4）投资决策委员会对基金经理提交的方案进行论证分析，并形成决策纪要；
- （5）基金经理根据决策纪要制定投资组合及操作方案，并下达投资指令至交易室；

(6) 交易室按有关交易规则执行，并将有关信息反馈基金经理；

(7) 基金经理定期检视投资组合的绩效，并对组合做必要调整。

### 3、投资组合管理策略

本基金采用稳健的投资组合策略，通过对宏观经济指标、货币政策的研究，确定组合平均剩余到期期限；通过对各期限各品种的流动性、收益性及信用水平的分析来确定组合资产配置；通过对市场资金供给情况的分析，对组合平均剩余期限及投资品种比例进行适当调整。在保证本金安全与资产流动性的基础上，追求稳定的当期收益。

#### (1) 久期调整策略

根据宏观经济形式、央行货币政策、短期资金市场流动性状况等因素，来确定并动态调整投资组合的久期。当市场利率看涨时，适度缩短投资组合平均剩余期限，即减持剩余期限较长投资品种、增持剩余期限较短品种，降低组合整体净值损失风险；当市场利率看跌时，则相对延长投资组合平均剩余期限，增持较长剩余期限的投资品种，获取超额收益。

#### (2) 类属配置策略

综合考虑各品种之间的流动性、收益性以及信用风险情况，来确定组合的资产配置比例。前提条件是保证基金资产的高流动性、低风险和稳定收益。

#### (3) 现金流管理策略

根据当期和远期市场资金面充裕程度的分析，匹配各期限的回购与债券品种的到期日，实现现金流的有效管理。

#### (4) 套利策略

短期资金市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场，其中投资群体、交易方式等市场要素不同，使得两个市场的资金面和市场短期利率在一定期间内可能存在定价偏离。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上，寻找最佳介入时机，进行跨市场操作，获得安全的超额收益。由于投资群体的差异，对期限相近的品种，因为其流动性、税收等因素造成内在价值出现明显偏离时，本基金可以在保证流动性的基础上，进行品种间的套利操作，增加超额收益。

#### （5）一级市场参与策略

积极参与国债、金融债、央行票据一级市场投标，增加盈利空间。一级市场发行的国债、金融债、以及央行票据数量大且连续，提供了有效的品种建仓机会。本基金管理人根据二级市场的收益水平和市场资金面的状况，对一级市场进行准确的招标预测，决定本基金的投标价位。在合理价格获得债券，满足组合配置需要。

随着短期资金市场的发展与金融创新的深入，待未来相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时，本基金将基于审慎的原则，对新投资品种予以评估，在满足本基金投资目标的前提下，本基金可相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中进行公告。

#### 八、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准：活期存款利率（税后）

本基金为货币市场基金，属于现金管理产品，产品性质上与银行活期存款有着很强的相似性。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取活期存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化，或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出，或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时，本基金经基金管理人和基金托管人协商一致，可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告，而无需召开基金份额持有人大会。

#### 九、基金的风险收益特征

本基金为货币市场基金，是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于债券型基金、混合型基金、股票型基金。

#### 十、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年10月21日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报

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。

本投资组合报告所载数据始于 2016 年 7 月 1 日，截止 2016 年 9 月 30 日。

### 1. 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额（元） 占基金总资产的比例（%）

1 固定收益投资 2,461,656,502.84 30.14

其中：债券 2,461,656,502.84 30.14

资产支持证券 — —

2 买入返售金融资产 5,038,335,817.50 61.68

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 643,014,491.42 7.87

4 其他资产 25,173,140.40 0.31

5 合计 8,168,179,952.16 100.00

### 2. 报告期债券回购融资情况

3. 序号 项目 占基金资产净值比例（%）

1 报告期内债券回购融资余额 9.67

其中：买断式回购融资 —

序号 项目 金额（元） 占基金资产净值比例（%）

2 报告期末债券回购融资余额 98,999,651.50 1.23

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

本报告期内本基金不存在债券正回购的资金余额超过基金资产净值 20%的情况。

### 3. 基金投资组合平均剩余期限

### 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 57

报告期内投资组合平均剩余期限最高值 118

报告期内投资组合平均剩余期限最低值 57

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

### 3.2 报告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 61.82 1.23

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 2.36 —

2 30 天(含)—60 天 13.01 —

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 — —

3 60 天(含)—90 天 7.80 —

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 — —

4 90 天(含)—120 天 8.05 —

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 — —

5 120 天(含)—397 天(含) 10.36 —

其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 — —

合计 101.04 1.23

### 4. 报告期内投资组合平均剩余期限超过 240 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 240 天的情况。

### 5. 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号 债券品种 摊余成本(元) 占基金资产净值比例  
(%)

1 国家债券 — —

- 2 央行票据 — —
- 3 金融债券 611,276,801.15 7.59
- 其中：政策性金融债 611,276,801.15 7.59
- 4 企业债券 — —
- 5 企业短期融资券 460,576,771.32 5.72
- 6 中期票据 — —
- 7 同业存单 1,389,802,930.37 17.25
- 8 其他 — —
- 9 合计 2,461,656,502.84 30.55
- 10 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 190,210,905.08 2.36

6. 报告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

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本 (元)	占基金资产净值比例 (%)
1	111619094	16 恒丰银行 CD094	2,000,000	200,000,000.00	2.48
2	111611181	16 平安 CD181	2,000,000	199,227,753.45	2.47
3	111608051	16 中信 CD051	2,000,000	199,196,274.67	2.47
4	111608212	16 中信 CD212	2,000,000	198,618,412.15	2.46
5	130216	13 国开 16	1,900,000	190,210,905.08	2.36
6	150302	15 进出 02	1,500,000	150,684,760.42	1.87
7	150222	15 国开 22	1,300,000	130,016,008.89	1.61
8	011699650	16 苏国信 SCP002	1,000,000	100,260,479.30	1.24
9	011698067	16 中船 SCP012	1,000,000	100,097,879.69	1.24
10	160401	16 农发 01	1,000,000	100,064,932.57	1.24

7. “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离  
 项目 偏离情况

报告期内偏离度的绝对值在 0.25(含)-0.5%间的次数 0

报告期内偏离度的最高值 0.0413%

报告期内偏离度的最低值 -0.0136%

报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 0.0234%

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

本基金本报告期内不存在负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

本基金本报告期内不存在正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

8. 报告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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 9 投资组合报告附注

### 9.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价。

### 9.2

本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，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

### 9.3 其他资产构成

序号 名称 金额（元）

1 存出保证金 —

2 应收证券清算款 —

3 应收利息 25,121,530.40

4 应收申购款 51,610.00

5 其他应收款 —

6 待摊费用 —

7 其他 一

8 合计 25,173,140.40

## 十一、基金的业绩

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。

### 1. 基金净值表现

1.1 本报告期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、东兴安盈宝 A

阶段 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

过去三个月 0.6486% 0.0005% 0.0894% 0.0000% 0.5592% 0.0005%

注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

#### 2、东兴安盈宝 B

阶段 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

过去三个月 0.7100% 0.0005% 0.0894% 0.0000% 0.6206% 0.0005%

注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

1.2 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

东兴安盈宝 A 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 06 月 03 日-2016 年 09 月 30 日)

注：1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 3 日生效。

2、截至报告期末，本基金成立不满六个月，仍处于建仓期。

东兴安盈宝 B 份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016 年 06 月 03 日-2016 年 09 月 30 日)

注：1、本基金基金合同于 2016 年 6 月 3 日生效。

2、截至报告期末，本基金成立不满六个月，仍处于建仓期。

十二、费用概览

(一) 基金费用的种类

1、与基金运作有关的费用

(1) 基金管理人的管理费；

- (2) 基金托管人的托管费；
- (3) 销售服务费；
- (4) 《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- (5) 《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、审计费、公证费、律师费、仲裁费和诉讼费；
- (6) 基金份额持有人大会费用；
- (7) 基金的证券交易费用；
- (8) 基金的银行汇划费用；
- (9) 证券账户开户费用、银行账户维护费；
- (10) 按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

上述第（4）至（10）项费用，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

## 2、与基金销售有关的费用

- (1) 基金认购费用：本基金不收取认购费用；
- (2) 基金申购费用：本基金不收取申购费用；
- (3) 基金赎回费用：本基金不收取赎回费用。

### (二) 基金费用计提方法、计提标准和支付方式

#### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3. 基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的年销售服务费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额的费率。B 类基金份额的年销售服务费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起享受 B 类基金份额的费率。两类基金份额的销售服务费计提的计算公式相同，具体如下：

本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率计提。

$$H = E \times \text{年销售服务费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日该类基金份额应计提的基金销售服务费

E 为前一日该类基金份额的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按管理人与代销机构的约定时间定期支付。由基金管理人向基金托管人发送基金销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给注册登记机构，由注册登记机构代付给销售机构。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

- 1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

#### （四）基金税收

本基金运作过程中涉及的各项纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

#### 十三、对招募说明书更新部分的说明

本招募说明书依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其他有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动进行了更新，主要内容如下：

（一）在“重要提示”中，新增了“招募说明书有关财务数据的截止日期”及“其他内容的截止日期”及相关文字表述。

（二）在“三、基金管理人”部分，对基金管理人的相关内容进行了更新。

（三）在“四、基金托管人”部分，对基金托管人的相关内容进行了更新。

（四）在“五、相关服务机构”部分，更新了直销柜台联系电话及传真、代销机构和登记机构联系人的信息。

（五）在“六、基金的募集与基金合同生效”部分，新增了基金募集和基金合同生效相关内容。

（六）在“八、基金的投资”部分，新增“基金的投资组合报告”内容，该部分内容均按有关规定编制，并经本基金托管人复核，但未经审计。

（七）在“九、基金的业绩”部分，新增了“基金净值表现”和“本基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图”，该部分内容均按照有关规定编制，并经本基金托管人复核，但相关财务数据未经审计。

（八）在“十九、基金托管协议的内容摘要”部分，对托管人的相关内

容进行了更新。

（九）在“二十一、其他应披露事项”部分，更新了从本基金上次《招募说明书》截止日 2016 年 6 月 3 日至本次《招募说明书（更新）》截止日 2016 年 12 月 3 日之间的信息披露事项。

上述内容仅为本基金更新招募说明书的摘要，详细资料须以本更新招募说明书正文所载的内容为准。欲查询本更新招募说明书详细内容，可登录东兴证券股份有限公司网站 <http://www.dxzq.net>。

东兴证券股份有限公司

2017 年 1 月 17XX 日