

东兴安盈宝货币市场基金2016年年度报告

2016年12月31日

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

送出日期：2017年3月27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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月21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。

瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）为基金财务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2016年6月3日（基金合同生效日）起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	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合规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	18
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	20
§8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 债券回购融资情况	44
8.3 基金投资组合平均剩余期限	45
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	46
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
8.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	47
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细	48
8.9 投资组合报告附注	48
§9 基金份额持有人信息	48
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	49
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	49
§10 开放式基金份额变动	49
§11 重大事件揭示	50

11.1	基金份额持有人大会决议.....	50
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.....	50
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	50
11.4	基金投资策略的改变.....	50
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
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.....	51
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	51
11.8	偏离度绝对值超过 0.5%的情况.....	52
11.9	其他重大事件.....	52
§12	备查文件目录.....	53
12.1	备查文件目录.....	53
12.2	存放地点.....	53
12.3	查阅方式.....	53

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	东兴安盈宝货币市场基金	
基金简称	东兴安盈宝	
基金主代码	002759	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016年6月3日	
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	
报告期末基金份额总额	6,692,579,749.87份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
下属分级基金的交易代码	002759	002760
报告期末下属分级基金的份 额总额	17,289,124.13份	6,675,290,625.74份

### 2.2 基金产品说明

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。
投资策略	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。
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
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。

## 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		东兴证券股份有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张韵	田东辉
	联系电话	010-66551816	010-68858113
	电子邮箱	zhangyun@dxzq.net.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		95309	95580
传真		010-66551452	010-68858120
注册地址		北京市西城区金融大街5号（新盛大厦）12、15层	北京市西城区金融大街3号
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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100007	100808
法定代表人		魏庆华	李国华

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.fund.dxzq.net
基金年度报告备置地点	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）	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层
注册登记机构	东兴证券股份有限公司	北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12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	2016年6月3日至2016年12月31日	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
本期已实现收益	2,107,553.86	77,872,962.16
本期利润	2,107,553.86	77,872,962.16
本期净值收益率	1.5459%	1.6869%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	
期末基金资产净值	17,289,124.13	6,675,290,625.74
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2016年末	
累计净值收益率	1.5459%	1.6869%

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场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。

3、本基金每日分配收益，按月结转份额。

4、本基金基金合同于2016年6月3日生效，本报告实际报告期为2016年6月3日至2016年12月31日。

## 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

阶段 (东兴安盈宝A)	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	0.7206%	0.0013%	0.0894%	0.0000%	0.6312%	0.0013%
过去六个月	1.3738%	0.0010%	0.1789%	0.0000%	1.1949%	0.0010%
自基金合同生效日起至 今（2016年06月03日 -2016年12月31日）	1.5459%	0.0011%	0.2061%	0.0000%	1.3398%	0.0011%

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

(东兴安盈宝B)	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	0.7810%	0.0013%	0.0894%	0.0000%	0.6916%	0.0013%
过去六个月	1.4966%	0.0010%	0.1789%	0.0000%	1.3177%	0.0010%
自基金合同生效日起至 今(2016年06月03日 -2016年12月31日)	1.6869%	0.0011%	0.2061%	0.0000%	1.4808%	0.0011%

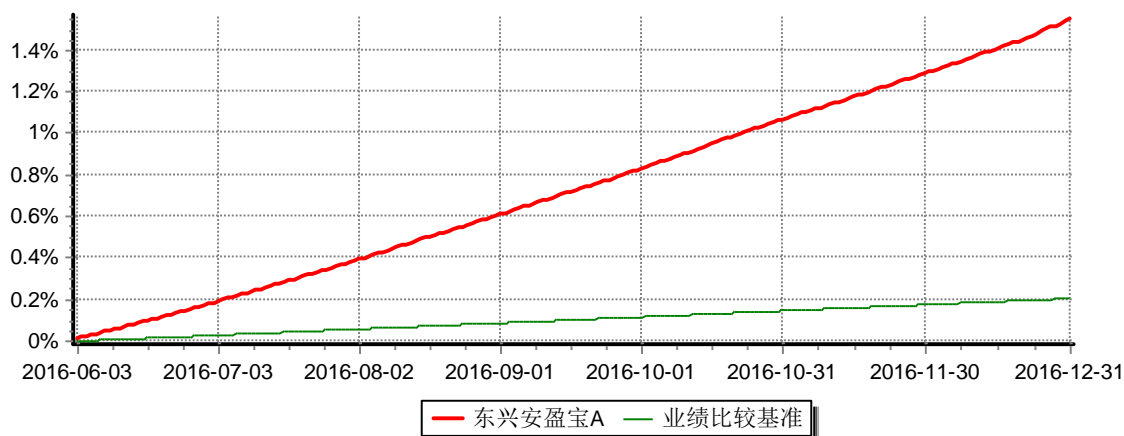
注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长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

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6月3日-2016年12月31日)



注：1、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内，截至本报告期末已完成建仓但距建仓结束不满一年。

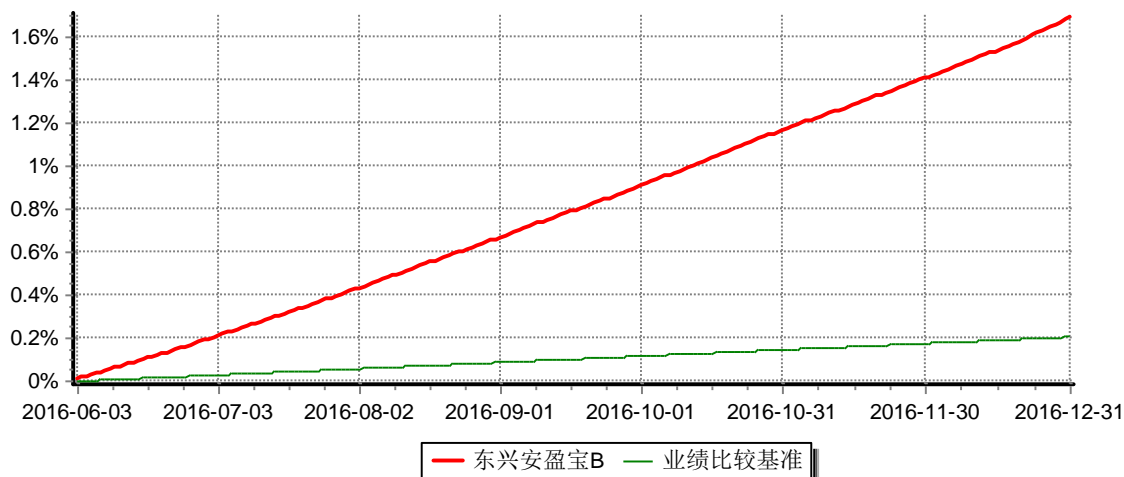
2、建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

#### 东兴安盈宝B

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6月3日-2016年12月31日)

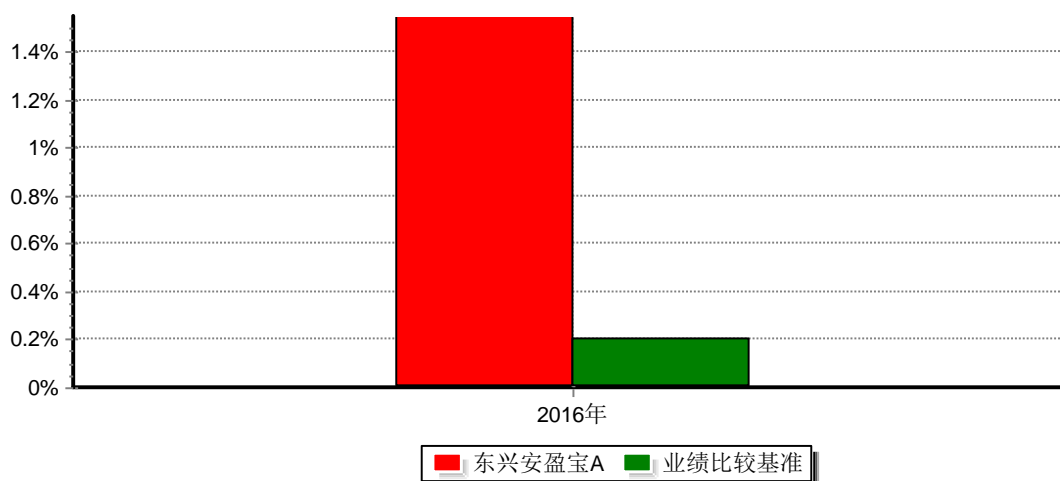




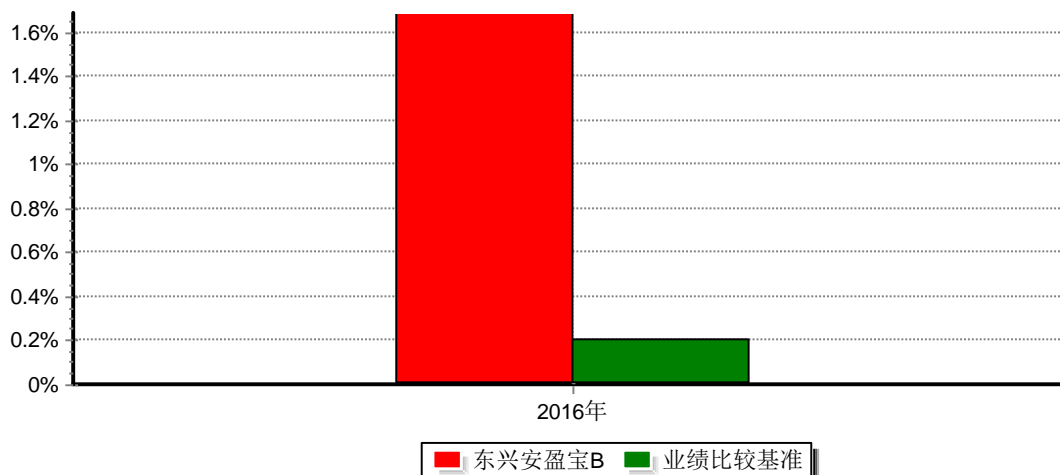
注：1、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，根据相关法律法规和基金合同，本基金建仓期为基金合同生效之日起6个月内，截至本报告期末已完成建仓但距建仓结束不满一年。

2、建仓结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来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



注：本基金基金合同于2016年6月3日生效，自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。



注：本基金基金合同于2016年6月3日生效，自合同生效以来未满五年。合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

东兴安盈宝A

单位：人民币元

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
2016年	826,661.11	1,034,149.62	246,743.13	2,107,553.86	

东兴安盈宝B

单位：人民币元

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
2016年	56,541,108.20	8,191,332.39	13,140,521.57	77,872,962.16	

注：本基金“每日分配收益，按月结转份额”。本基金收益以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每月第一个工作日例行对上月实现的收益进行收益结转。

## § 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

东兴证券股份有限公司（股票简称“东兴证券”，股票代码“601198”，以下简称“本

公司”)是2008年经财政部和中国证监会批准,由中国东方资产管理公司作为主要发起人发起设立的全国性综合类证券公司,2015年2月26日在上海证券交易所上市,是国内首家资产管理公司系上市证券公司。

本公司注册资本27.58亿元,总部设在北京。公司业务涵盖证券经纪、证券投资咨询、与证券交易和证券投资活动有关的财务顾问、证券承销与保荐、证券投资基金销售业务、证券自营和证券资产管理业务、融资融券业务、代销金融产品业务、公开募集证券投资基金管理业务,形成覆盖场内与场外、线下和线上、国内和海外的综合金融服务体系。

本公司经中国证券监督管理委员会核准(证监许可【2015】67号)于2015年1月8日获得公开募集证券投资基金管理业务资格。截至2016年12月31日,本公司管理东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金、东兴安盈宝货币市场基金和东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金共5只开放式基金。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕姝仪女士	本基金基金经理	2016年6月3日	—	3年	中国人民大学经济学硕士,3年证券从业经历。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员的职位。2015年9月加入东兴证券股份有限公司基金业务部,现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理。
孙继青先生	本基金基金经理	2016年6月3日	—	9年	北京科技大学工学硕士,3年钢铁行业经验,9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业务部。现任东兴改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴蓝海财富灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴安盈宝货币市场基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证券监督管理委员会和《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。本基金无违法、违规行为。本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

## 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

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和有关法律法规的规定，针对股票、债券的一级市场申购和二级市场交易等投资管理活动，以及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，建立了股票、债券等证券池管理制度和细则，投资管理制度和细则，公平交易制度等公平交易相关的公司制度或流程指引。通过加强投资决策、交易执行的内部控制，完善对投资交易行为的日常监控和事后分析评估，以及履行相关的报告和信息披露义务，切实防范投资管理业务中的不公平交易和利益输送行为，保护投资者合法权益。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意

见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

#### 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

2016年债券市场经历了非理性繁荣到恐慌性下跌的过程，11月份特朗普当选后美元指数和美债收益率攀升，12月份季末和春节提前效应叠加，央行通过拉长供给资金期限、抬升资本中枢，年底资金面整体紧张。2016年12月份高评级短期债券收益率、高评级同业存单收益率均大幅上行。

报告期内，本基金采取了较为灵活的配置策略，在11月份降低了组合久期，增强了组合流动性，实现了超基准的收益。在资产的类别配置上绝大部分为存单、债券回购，少量配置高评级信用债、存款。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2016年6月3日（基金合同生效日）起至2016年12月31日，本基金A类份额净值收益率为1.5459%，业绩比较基准收益率为0.2061%，高于业绩比较基准1.3398%；本基金B类份额净值收益率为1.6869%，业绩比较基准收益率为0.2061%，高于业绩比较基准1.4808%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2017年一季度基本面和政策面对债券市场无明显利好，但年初配置力量较强，预计弱势震荡行情为主。在防控金融风险、去杠杆的背景下，须警惕流动性脉冲式收紧风险和债券市场回调风险。在基本面向下拐点出现之前，货币政策仍将边际收紧，初步判断债券市场在基本面出现拐点之后将具备一定的交易性机会。2017年较为复杂和困难的内外环境下，基金仍将不断努力，为投资人带来合理回报。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守相关法律法规，坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

本报告期内，本基金管理人进一步完善了公司的内控体系；对公司投研交易、市场销售、后台运营等业务开展了定期或专项稽核，检查业务开展的合规性和制度执行的有效性；采取事前防范、事中控制和事后监督等三阶段工作，加强对日常投资运作的管理和监控，督促投研交易业务的合规开展；针对新出台的法律法规和监管要求，积极组织

了多项法律法规、职业道德培训以及合规考试，不断提高从业人员的合规素质和职业道德修养；全面参与新产品设计、新业务拓展工作；严格审查基金宣传推介材料，及时检查基金销售业务的合法合规情况；完成各项信息披露工作，保证所披露信息的真实性、准确性和完整性；监督客户投诉处理，重视媒体监督和投资者关系管理。

本基金管理人承诺将坚持诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，顺应“放松管制、加强监管”的监管形势，积极健全内部管理制度，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，切实保护基金资产的安全与利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人应严格按照新准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。其中，本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作决策和执行的专门机构，且具有风控、合规、会计方面的专业经验。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日，根据相关法律法规和本基金基金合同要求及实际运作情况，本基金应分配且已分配利润79,980,516.02元；本基金本报告期无应分配而尚未分配利润的情况。

#### 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

报告期内，本基金不存在连续二十个工作日出现基金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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在东兴安盈宝货币市场基金（以下简称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和

托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金A类份额实施利润分配的金额为2,107,553.86元，本基金B类份额实施利润分配的金额为77,872,962.16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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §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	瑞华审字【2017】01460012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	东兴安盈宝货币市场基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的东兴证券股份有限公司作为管理人按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制的东兴安盈宝货币市场基金（以下简称基金）的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表，2016年度的利润表和持有人权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报基金财务报表是基金管理人东兴证券股份有限公司的责任。这种责任包括：（1）按照后附的财务报表附注二所述的编制基础编制财务报表，并使其实现公允反映；（2）设计、执行和维护必要的内部控制，以使基金财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对基金财

	<p>务报表发表审计意见。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。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对基金财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及执行审计程序，以获取有关基金财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的基金财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与基金财务报表编制和公允列报相关的内部控制，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。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价基金财务报表的总体列报。</p> <p>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>
审计意见段	我们认为，上述财务报表在所有重大方面按照附注二所述编制基础编制，公允反映了东兴安盈宝货币市场基金于2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和持有人权益（基金净值）变动情况。
注册会计师的姓名	王需如，刘涛
会计师事务所的名称	瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	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层
审计报告日期	2017年3月22日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

报告截止日：2016年12月31日



单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日
<b>资产：</b>		
银行存款	7.4.7.1	500,909,018.10
结算备付金		—
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	2,824,978,291.30
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		2,824,978,291.30
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	4,083,000,000.00
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	31,613,894.72
应收股利		—
应收申购款		4,612,432.00
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		7,445,113,636.12
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 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		737,166,294.25
应付证券清算款		—
应付赎回款		—

应付管理人报酬		1,355,566.91
应付托管费		361,484.57
应付销售服务费		47,938.09
应付交易费用	7.4.7.7	72,518.59
应交税费		—
应付利息		132,819.14
应付利润		13,387,264.70
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	10,000.00
负债合计		752,533,886.25
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	6,692,579,749.87
未分配利润	7.4.7.10	—
所有者权益合计		6,692,579,749.87
负债和所有者权益总计		7,445,113,636.12

注：1、报告截止日2016年12月31日，A类基金份额净值1.0000元，B类基金份额净值1.0000元；基金份额总额6,692,579,749.87份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额17,289,124.13份，B类基金份额总额6,675,290,625.74份。

2、本基金基金合同于2016年6月3日生效，无可比期间数据，本报告实际报告期为2016年6月3日至2016年12月31日，下同。

## 7.2 利润表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

本报告期：2016年6月3日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2016年6月3日至2016年12月31日
一、收入		95,193,106.89
1. 利息收入		95,812,167.78
其中：存款利息收入	7.4.7.11	26,893,624.03
债券利息收入		34,370,964.81
资产支持证券利息收入		—

买入返售金融资产收入		34,547,578.94
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-619,061.06
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	-619,061.06
资产支持证券投资收益		—
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	0.17
<b>减：二、费用</b>		15,212,590.87
1. 管理人报酬		8,150,374.59
2. 托管费		2,173,433.21
3. 销售服务费		291,259.57
4. 交易费用	7.4.7.19	—
5. 利息支出		4,519,623.50
其中：卖出回购金融资产支出		4,519,623.50
6. 其他费用	7.4.7.20	77,900.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		79,980,516.02
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		79,980,516.02

注：本基金基金合同于2016年6月3日生效，无可比期间数据。

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

本报告期：2016年6月3日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3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）	4,021,365,162.32	—	4,021,365,162.32
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		79,980,516.02	79,980,516.02
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）	2,671,214,587.55	—	2,671,214,587.55
其中：1. 基金申购款	18,655,318,612.95	—	18,655,318,612.95
2. 基金赎回款	-15,984,104,025.40	—	-15,984,104,025.40
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）	—	-79,980,516.02	-79,980,516.02
五、期末所有者权益（基金净值）	6,692,579,749.87	—	6,692,579,749.87

注：本基金基金合同于2016年6月3日生效，无可比期间数据。

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：

魏庆华

魏庆华

王青

-----  
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

东兴安盈宝货币市场基金（以下简称“本基金”）根据2016年4月11日中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）《关于准予东兴安盈宝货币市场基金注册的批复》（证监许可[2016]720号）的批复，自2016年5月23日至2016年5月31日公开募集设立。本基金为货币市场基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集4,021,357,278.27元人民币，业经瑞华会计师事务所（特殊普通合伙）“瑞华验字[2016]01460014号”验资报告验证。经向中国证监会备案，《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》于2016年6月3日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,021,365,162.32份，其中认购资金利息折合7,884.05份。本基金基金管理人为东兴证券股份有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》的有关规定，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。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的会计报表按照财政部2006年2月15日颁布的《企业会计准则——基本准则》（财政部令第33号发布、财政部令第76号修订）、于2006年2月15日及其后颁布和修订的41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”）、中国证券业协会制定的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会颁布的《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》、《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号—年度报告的内容与格式》、《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》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号—会计报表附注的编制及披露》及中国证监会颁布的其他相关规定编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金编制的财务报表符合企业会计准则及其他有关规定要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历每年1月1日至12月31日。本期财务报表的实际编制期间为

2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日。

#### 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。

##### 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。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，于交易日按取得时的公允价值作为初始确认金额。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券以及不作为有效套期工具的衍生工具等，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或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。

债券投资采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，即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，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

同业存单采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，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，以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。

本基金的金融负债在初始确认时以公允价值计量，并以摊余成本进行后续计量。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，终止确认该金融负债或其一部分。

本基金主要金融工具的成本计价方法具体如下：

### 1、债券投资

买入银行间同业市场交易的债券，于交易日确认为债券投资。

债券投资按实际支付的全部价款入账，其中所包含应收利息单独核算，对于付息债券，不构成债券投资成本，对于贴息债券，应作为债券投资成本。

卖出银行间同业市场交易的债券，于交易日确认债券投资收益；出售债券的成本按移动加权平均法结转。

### 2、回购协议

基金持有的回购协议（封闭式回购），以实际成本列示，按实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提利息。

### 3、同业存单

买入同业存单时，按实际支付的全部价款入账，其中所包含应收利息作为同业存单投资成本。

卖出同业存单时，于交易日确认同业存单投资收益；出售同业存单的成本按移动加权平均法结转。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金估值采用“摊余成本法”，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价和折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。

本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值；本基金金融工具的估值方法具体如下：

##### （1）银行存款

本基金持有的银行存款以本金列示，按银行实际协议利率逐日计提利息。

##### （2）债券投资

本基金持有的附息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

##### （3）回购协议

①本基金持有的回购协议（封闭式回购），以成本列示，按实际利率在实际持有期间内逐日计提利息。

②本基金持有的买断式回购以协议成本列示，所产生的利息在实际持有期间内逐日计提；回购期满时，若双方都能履约，则按协议进行交割。若融资业务到期无法履约，则继续持有现金资产；若融券业务到期无法履约，则继续持有债券资产，实际持有的相关资产按其性质进行估值。

##### （4）资产支持证券

本基金持有的资产支持证券视同债券，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）

确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

#### (5) 同业存单

本基金持有的同业存单购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。

#### (6) 其他

①为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当影子定价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负偏离度绝对值达到0.25%时，基金管理人应当在5个交易日内将负偏离度绝对值调整到0.25%以内。当正偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在5个交易日内将正偏离度绝对值调整到0.5%以内。当负偏离度绝对值达到0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。发生上述情形的，基金管理人应与基金托管人协商，基金管理人应编制并披露临时报告。

②如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

③相关法律法规以及监管部门有强制规定的，从其规定。如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额。每份基金份额面值为人民币1.00元。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、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。

#### 7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入：按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息收入损失，列入利息收



入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会基金部通知（2006）22号文《关于货币市场证券投资基金提前支取定期存款有关问题的通知》的规定，因提前支取导致的利息损失由基金管理公司承担；

（2）债券利息收入：按实际持有期内逐日计提。付息债券、贴现券购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；企业债券利息收入按扣除代扣代缴的个人所得税之后的差额计量；

（3）同业存单利息收入：在实际持有期内逐日计提，购买时采用实际支付价款（包含交易费用）确定初始成本，每日按摊余成本和实际利率计算确定利息收入；

（4）买入返售金融资产收入：按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

（5）债券投资收益：于卖出债券成交日确认，并按卖出债券成交金额与其成本、应收利息及相关费用的差额入账；

（6）同业存单投资收益：于同业存单成交日确认，并按卖出同业存单成交金额与其账面价值及相关费用的差额入账；

（7）其他收入：在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

（1）基金管理费按前一日基金资产净值的0.30%的年费率逐日计提并确认；

（2）基金托管费按前一日基金资产净值的0.08%的年费率逐日计提并确认；

（3）本基金A类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率0.25%逐日计提并确认，A类基金份额的销售服务费按前一日基金资产净值的年费率0.01%逐日计提并确认；

（4）卖出回购证券支出，按卖出回购金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率）在回购期内逐日计提；

（5）其他费用

其他费用包括基金运作过程中发生的除上述费用支出以外的其他各项费用，如《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用、会计师费、审计费、公证费、律师费、仲裁费和诉讼费、基金份额持有人大会费用、基金的证券交易费用、基金的银行汇划费用、证券账户开户费用、银行账户维护费等。发生的其他费用，如不影响估值日份额净值小数点后第四位，发生时可直接计入基金损益，如果影响基金份额净值小数点后第四位的，采用待摊或预提的方法计入基金损益。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

1. 本基金同一类别内的每份基金份额享有同等分配权；
2. 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；

3. “每日分配、按月支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，每月集中支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后2位，小数点后第3位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；

4. 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；

5. 本基金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，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在每月累计收益支付时，其累计收益为正值，则为投资人增加相应的基金份额，其累计收益为零，则保持投资人基金份额不变，其累计收益为负值，则缩减投资人基金份额。若投资人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清；若收益为负值，则从投资人赎回基金款中扣除；

6. 当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益；

7. 法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

在不违反法律法规、基金合同的约定且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可在中国证监会允许的条件下调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.11 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他需要披露的重要会计政策和会计估计。

#### 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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税【2002】128号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税【2004】78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税【2005】103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税【2007】84号《关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知》、财税【2008】1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年4月23日发布的《上海、深

圳证券交易所关于做好交易相关系统印花税率参数调整的通知》、2008年9月18日发布的《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税【2012】85号《关于实施公司股息红利差别化个人所得税政策的通知》、财税【2015】101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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】70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，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。管理人运用基金买卖股票、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股票、债券的转让收入免征增值税，对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，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

3. 对基金取得的股票股息、红利收入，自2015年9月8日起，基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过1年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

4. 对基金取得的债券利息收入，由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税，暂不缴纳企业所得税。

5. 对于基金从事A股买卖，自2008年09月19日起，由出让方按0.1%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，受让方不再缴纳印花税。

6. 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价，暂免于缴纳印花税、企业所得税和个人所得税。

#### 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 2016年12月31日
活期存款	909,018.10
定期存款	500,000,000.00
其中：存款期限1-3个月	—

存款期限3个月-1年	500,000,000.00
其他存款	—
合计	500,909,018.10

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2016年12月31日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	—	—	—	—
	银行间市场	2,824,978,291.30	2,819,648,000.00	-5,330,291.30	-0.0796
	合计	2,824,978,291.30	2,819,648,000.00	-5,330,291.30	-0.0796

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

本报告期末本基金未持有衍生金融资产/负债。

#### 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2016年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	4,083,000,000.00	—
银行间市场	—	—
合计	4,083,000,000.00	—

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末本基金未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应收活期存款利息	257.13
应收定期存款利息	7,025,000.37
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	8,831.71
应收债券利息	16,747,599.42
应收买入返售证券利息	7,832,206.09
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	—
合计	31,613,894.72

#### 7.4.7.6 其他资产

本报告期末本基金未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 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	72,518.59
合计	72,518.59

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	10,000.00

合计	10,000.00
----	-----------

注：预提费用为按日计提的审计费。

#### 7.4.7.9 实收基金

##### 7.4.7.9.1 东兴安盈宝A

金额单位：人民币元

项目	2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	31,358,162.32	31,358,162.32
本期申购	30,607,997.36	30,607,997.36
本期赎回（以“-”号填列）	-44,677,035.55	-44,677,035.55
本期末	17,289,124.13	17,289,124.13

##### 7.4.7.9.2 东兴安盈宝B

金额单位：人民币元

项目	2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,990,007,000.00	3,990,007,000.00
本期申购	18,624,710,615.59	18,624,710,615.59
本期赎回（以“-”号填列）	-15,939,426,989.85	-15,939,426,989.85
本期末	6,675,290,625.74	6,675,290,625.74

注：本基金基金合同于2016年6月3日生效，基金合同生效日的基金份额总额为4,021,365,162.32份，其中：A类份额认购资金本金折算基金份额为：31,357,278.27份，利息折算基金份额为：884.05份；B类份额认购资金本金折算基金份额为：3,990,000,000.00份，利息折算基金份额为：7,000.00份。

#### 7.4.7.10 未分配利润

##### 7.4.7.10.1 东兴安盈宝A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—

本期利润	2,107,553.86	—	2,107,553.86
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	-2,107,553.86	—	-2,107,553.86
本期末	—	—	—

## 7.4.7.10.2 东兴安盈宝B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	77,872,962.16	—	77,872,962.16
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	-77,872,962.16	—	-77,872,962.16
本期末	—	—	—

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年6月3日至2016年12月31日
活期存款利息收入	88,571.13
定期存款利息收入	26,766,472.59
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	38,580.31
其他	—
合计	26,893,624.03

## 7.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期间无股票投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3日至2016年12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	-619,061.06
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	-619,061.06

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3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	3,981,144,785.31
减：卖出债券(、债转股及债券到期 兑付)成本总额	3,960,000,000.00
减：应收利息总额	21,763,846.37
买卖债券差价收入	-619,061.06

##### 7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本报告期2016年6月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日本基金无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14 贵金属投资收益

本报告期2016年6月3日(基金合同生效日)至2016年12月31日本基金无贵金属投资



收益。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金无股利收益。

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金无公允价值变动收益。

#### 7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3日至2016年12月31日
基金赎回费收入	—
其他收入	0.17
合计	0.17

#### 7.4.7.19 交易费用

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金无交易费用。

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年6月3日至2016年12月31日
审计费用	10,000.00
信息披露费	58,000.00
汇划手续费	200.00

账户维护费	9,000.00
其他	700.00
合计	77,900.00

注：其他为证券账户开户费和上海清算所查询费。

#### 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

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本基金报告报出日，本基金不存在需要说明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
东兴证券股份有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中国东方资产管理公司	基金管理人的控股股东
东兴期货有限责任公司	基金管理人的全资子公司
东兴证券投资有限公司	基金管理人的全资子公司
东兴资本投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
东兴证券（香港）金融控股有限公司	基金管理人的全资子公司
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一控股股东的关联方、基金销售机构
北京东富宝实投资管理中心（有限合伙）	与基金管理人同一控股股东的关联方

#### 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

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日未通过关联方

交易单元进行股票交易。

#### 7.4.10.1.2 权证交易

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	17,476,081,628.00	100.00%

#### 7.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

#### 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 2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	10,222.07

注：1、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、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，无可比期间数据。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,173,433.21

注：1、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。

2、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，无可比期间数据。

#### 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		
	2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B	合计
东兴证券股份有限公司	4,597.22	270,863.42	275,460.64
中国邮政储蓄银行股份有限公司	13,952.72	—	13,952.72
合计	18,549.94	270,863.42	289,413.36

注：1、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。

2、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，无可比期间数据。

#### 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

本期 2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31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
中国邮政储蓄银行股份 有限公司					737,500,000.00	165,093.70
大连银行股份有限公司					1,127,325,000.00	75,457.91

#### 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 2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
基金合同生效日持有的 基金份额	—	640,000,000.00
期初持有的基金份额	—	—
期间申购/买入总份额	677,954.59	1,303,629,082.15
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	-677,954.59	-1,443,629,082.15
期末持有的基金份额	—	500,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	—	7.47%

注：申购含红利再投和因份额升降级强制调增的份额；赎回含因份额升降级调减的份额。

##### 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

份额单位：份

关联方名称		本期末 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
东兴安盈宝B	中国东方资产管理股份有限公司	3,014,022,401.58	45.15%
东兴安盈宝B	北京东富宝实投资管理中心（有限合伙）	766,948,601.28	11.49%

## 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 2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	909,018.10	88,571.13
大连银行股份有限公司	—	1,718,888.89

注：1、本报告期末余额仅为活期存款，由中国邮政储蓄银行股份有限公司保管的银行存款为活期存款，利息收入仅为活期存款利息收入。

2、由大连银行股份有限公司保管的银行存款为有存款期限，根据协议可提前支取的银行存款。

## 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联事项的说明。

## 7.4.11 利润分配情况

东兴安盈宝A

单位：人民币元

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
826,661.11	1,034,149.62	246,743.13	2,107,553.86	

东兴安盈宝B

单位：人民币元

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
56,541,108.20	8,191,332.39	13,140,521.57	77,872,962.16	

注：本基金“每日分配收益，按月结转份额”。本基金收益以每万份基金份额净收益为基准，每日为基金份额持有人计算当日收益并分配，每月第一个工作日例行对上月实现的收益进行收益结转。

#### 7.4.12 期末（2016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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末流通受限的证券。

##### 7.4.12.2 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。

##### 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2016年12月31日止，本基金从事银行间市场正回购交易形成的卖出回购证券款余额737,166,294.25元，是以如下债券作为质押：

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
111680408	16萧山农商 银行CD056	2017-01-03	98.29	1500000	147,435,000.00
111680444	16德阳银行 CD098	2017-01-03	98.24	644000	63,266,560.00
160414	16农发14	2017-01-03	99.85	900000	89,865,000.00
150408	15农发08	2017-01-03	100.20	400000	40,080,000.00
140407	14农发07	2017-01-03	100.31	500000	50,155,000.00
130216	13国开16	2017-01-03	99.32	1900000	188,708,000.00
150302	15进出02	2017-01-03	100.08	1000000	100,080,000.00
140208	14国开08	2017-01-03	100.60	900000	90,540,000.00

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日，本基金未持有在交易所市场正回购交易中作为抵押的债券。

### 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

本基金投资风险主要包括：信用风险、流动性风险、市场风险和操作风险及其他不可抗拒的风险。其中在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

对于上述风险本基金管理人建立了系统化、流程化和数量化的风险管理体系，确保投资组合在获取较高收益的同时承受尽可能低的风险，从而实现本基金的投资目标。本基金设立了由投资决策委员会、风险控制委员会、风险管理部和合规法律部组成的风险管理组织体系，该体系通过分工合作的制度对风险进行管理控制。本基金通过事前的风险识别，事中的风险测量和处理以及事后的风险评估和调整风险实行全程风险控制。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程发生交收违约，或者基金所投资的债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金均投资于具有良好信用等级的证券；本基金持有一家上市公司的证券市值不超过基金资产净值的百分之十，且本基金与由本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，不超过该证券的百分之十。

除通过上述投资限定控制相应信用风险外，本基金在交易所进行交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，发生违约风险的可能性很低；本基金也可在银行间同业市场进行交易，在交易前均会对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 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 2016年12月31日
A-1	—
A-1以下	—
未评级	229,883,498.14
合计	229,883,498.14

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

##### 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 2016年12月31日
AAA	—
AAA以下	—
未评级	2,035,034,052.94
合计	2,035,034,052.94

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 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。

本基金保持不低于基金资产净值5%的现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以备支付基金份额持有人的赎回款项。本基金所持债券均在证券交易所和银行间同业市场交易，除在本报告7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，本报告期末本基金的其余资产均能及时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。本基金于资产负债表日所持有的金融负债的合同约定剩余到期日均为一年以内且一般不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额一般即为未折现的合约到期现金流量。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

#### 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。

本基金管理人在利率风险管理方面，定期监控本基金面临的利率风险敞口，并通过调整基金投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2016年12 月31日	1个月以内	1-3 个月	3个月 -1年	1-5 年	5年 以上	不计息	合计
资产							
银行存款	200,909,018.10	—	300,000,000.00	—	—	—	500,909,018.10
交易性金融资产- 债券投资	1,488,693,371.87	338,133,960.97	998,150,958.46	—	—	—	2,824,978,291.30
买入返售 金融资产	2,897,000,000.00	1,186,000,000.00	—	—	—	—	4,083,000,000.00
应收利息	—	—	—	—	—	31,613,894.72	31,613,894.72
应收申购 款	—	—	—	—	—	4,612,432.00	4,612,432.00
资产总计	4,586,602,389.97	1,524,133,960.97	1,298,150,958.46	—	—	36,226,326.72	7,445,113,636.12
负债							
卖出回购 金融资产 款	737,166,294.25	—	—	—	—	—	737,166,294.25
应付管理 人报酬	—	—	—	—	—	1,355,566.91	1,355,566.91
应付托管 费	—	—	—	—	—	361,484.57	361,484.57
应付销售 服务费	—	—	—	—	—	47,938.09	47,938.09
应付交易 费用	—	—	—	—	—	72,518.59	72,518.59
应付利息	—	—	—	—	—	132,819.14	132,819.14
应付利润	—	—	—	—	—	13,387,264.70	13,387,264.70
其他负债	—	—	—	—	—	10,000.00	10,000.00
负债总计	737,166,294.25	—	—	—	—	15,367,592.00	752,533,886.25
利率敏感 度缺口	3,849,436,095.72	1,524,133,960.97	1,298,150,958.46	—	—	20,858,734.72	6,692,579,749.87

注：表中所示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

假设	1. 该利率敏感性分析基于本基金于资产负债表日的利率风险状况； 2. 所有期限的利率均以相同幅度变动25个基点，其他市场变量均不发生变化； 3. 银行存款、结算备付金、存出保证金均以活期存款利率或相对固定的利率计息，假定利率变动仅影响该类资产的未来收益、而对其本身的公允价值无重大影响； 4. 该利率敏感性分析并未考虑管理层为减低利率风险而可能采取的风险管理活动。	
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2016年12月31日
	1、市场利率上升25个基点	-134,052.82
	2、市场利率下降25个基点	134,088.37

## 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

其他价格风险主要为市场价格风险，市场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证券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

## 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	—	—

交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-债券投资	2,819,648,000.00	42.13
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	2,819,648,000.00	42.13

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本年度报告报出日，本基金无需要披露的有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	2,824,978,291.30	37.94
	其中：债券	2,824,978,291.30	37.94
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	4,083,000,000.00	54.84
	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	500,909,018.10	6.73
4	其他各项资产	36,226,326.72	0.49
5	合计	7,445,113,636.12	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	7.86
	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	737,166,294.25	11.01
	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

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日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。

## 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	58
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	30

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金自基金合同生效日（2016年6月3日）至报告截止日（2016年12月31日）不存在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	65.54	11.01
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	2.84	—
2	30天(含)—60天	6.72	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—

3	60天(含)–90天	16.05	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)–120天	3.43	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)–397天(含)	18.95	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		110.69	11.01

#### 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

本基金自基金合同生效日（2016年6月3日）至报告截止日（2016年12月31日）不存在投资组合平均剩余存续期超过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	560,060,740.22	8.37
	其中：政策性金融债	560,060,740.22	8.37
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	229,883,498.14	3.43
6	中期票据	—	—
7	同业存单	2,035,034,052.94	30.41
8	其他	—	—
9	合计	2,824,978,291.30	42.21
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	189,850,194.25	2.84

#### 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	111619094	16恒丰银行CD094	2,000,000	200,000,000.00	2.99
2	111608327	16中信CD327	2,000,000	199,870,782.09	2.99
3	111609395	16浦发CD395	2,000,000	199,869,012.69	2.99
4	111607211	16招行CD211	2,000,000	199,710,631.31	2.98
5	111607123	16招行CD123	2,000,000	199,691,275.53	2.98
6	111611474	16平安CD474	2,000,000	197,927,247.00	2.96
7	130216	13国开16	1,900,000	189,850,194.25	2.84
8	111680408	16萧山农商银行 CD056	1,500,000	148,059,124.31	2.21
9	111680444	16德阳银行CD098	1,500,000	147,994,797.25	2.21
10	111680588	16江苏紫金农村 商业银行CD071	1,500,000	147,974,588.87	2.21

## 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	2
报告期内偏离度的最高值	0.0413
报告期内偏离度的最低值	-0.2725
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0376

## 报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

序号	发生日期	偏离度	原因	调整期
1	2016年12月20日	-0.2725%	债券市场收益率大幅上行，导致债券市场价格下跌，造成负偏离度的绝对值达到或超过0.25%。	2个交易日
2	2016年12月21日	-0.2517%	债券市场收益率大幅上行，导致债券市场价格下跌，造成负偏离度的绝对值达到或超过0.25%。	1个交易日

## 报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本基金自基金合同生效日（2016年6月3日）至报告截止日（2016年12月31日）不存在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。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价。

#### 8.9.2

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。

#### 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	31,613,894.72
4	应收申购款	4,612,432.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	36,226,326.72

## §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	持有人	户均持有的基金	持有人结构
----	-----	---------	-------



级别	户数 (户)	份额	机构投资者		个人投资者	
			持有 份额	占总份额 比例	持有 份额	占总份 额 比例
东兴安盈宝A	1,083	15,964.10	8,790,070.49	50.84%	8,499,053.64	49.16%
东兴安盈宝B	20	333,764,531.29	6,675,290,625.74	100.00%	—	—
合计	1,103	6,067,615.37	6,684,080,696.23	99.87%	8,499,053.64	0.13%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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 有本开放式基金	东兴安盈宝A	87,417.10	0.51%
	东兴安盈宝B	—	—
	合计	87,417.10	0.00%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金 投资和研究部门负责人持有 本开放式基金	东兴安盈宝A	0
	东兴安盈宝B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放 式基金	东兴安盈宝A	0
	东兴安盈宝B	0
	合计	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
基金合同生效日(2016年6月3日)基 金份额总额	31,358,162.32	3,990,007,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基 金总申购份额	30,607,997.36	18,624,710,615.59
减：基金合同生效日起至报告期期末	44,677,035.55	15,939,426,989.85

基金总赎回份额		
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	17,289,124.13	6,675,290,625.74

注：本期申购包含红利再投资份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金未召开基金份额持有人大会。

### 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

本基金管理人（以下简称“本公司”或“公司”）于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举印建民先生担任公司董事的议案。印建民先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本公司于2015年12月8日召开2015年第二次临时会议，审议通过选举秦斌先生担任公司董事的议案。秦斌先生于2016年1月28日取得证券公司董事任职资格，自前述资格取得之日起正式就任公司第三届董事会董事。

本公司第三届董事会第二十八次会议于2016年11月7日在北京以现场及电话方式举行，董事会同意聘任刘亮先生、陈海先生为公司副总经理。刘亮先生仍兼任公司董事会秘书。刘亮先生、陈海先生均已取得中国证监会核准的高级管理人员任职资格。

本公司于2016年12月6日在公司总部召开职工代表大会，选举杜斌先生、郝洁女士为公司第四届监事会职工代表监事。杜斌先生、郝洁女士将与公司股东大会选举产生的非职工代表监事共同组成公司第四届监事会，任期与第四届监事会任期一致。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金未更换会计师事务所，本报告期应支付给瑞华会计师事务所(特殊普通合伙)审计费用10,000.00元；截至2016年12月31日，该审计机构向本基金提供审计服务不满1年。

### 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

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日基金管理人、基金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	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	2	-	-	-	-	

注：1、此处的佣金指本基金通过券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

#### 2、交易单元的选择标准和程序

券商选择标准：财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司。其中财务状况良好、经营行为规范以最近一年证券公司分类评介在C类或C类以上，且近一年内无重大违法违规事件为主要判断依据。研究实力较强以公司基金业务部投研团队的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：①对符合选择标准的券商的服务进行评价；②拟定租用对象：由投研部门根据以上评价结果拟定备选的券商；③签约：拟定备选的券商后，按公司签约程序与备选券商签约。签约时，要明确签定协议双方的公司名称、委托代理期限、佣金率、双方的权利义务等。

3、由于交易所系统限制，本基金管理人作为上海和深圳证券交易所的会员单位目前尚不能在租赁其他证券公司的交易单元。

4、本基金本报告期内新增租用2个交易单元，分别为东兴证券股份有限公司上海交易所交易单元及深圳交易所交易单元。

#### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		应支付该券商的佣金		备注
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	—	—	17,476,081,628.00	100.00%	—	—	

### 11.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本报告期内2016年6月3日（基金合同生效日）至2016年12月31日本基金不存在正偏离度的绝对值达到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	东兴安盈宝货币市场基金招募说明书	指定报刊、公司网站	2016-05-16
2	东兴安盈宝货币市场基金托管协议	公司网站	2016-05-16
3	东兴安盈宝货币市场基金基金合同合同摘要	指定报刊、公司网站	2016-05-16
4	东兴安盈宝货币市场基金基金合同	公司网站	2016-05-16
5	东兴安盈宝货币市场基金份额发售公告	指定报刊、公司网站	2016-05-16
6	关于增加联讯证券股份有限公司为我公司旗下公开募集证券投资基金销售机构的公告	指定报刊、公司网站	2016-05-19
7	东兴安盈宝货币市场基金基金经理变更公告	指定报刊、公司网站	2016-06-04
8	东兴安盈宝货币市场基金基金合同生效公告	指定报刊、公司网站	2016-06-04
9	东兴安盈宝货币市场基金封闭期收益公告	指定报刊、公司网站	2016-06-06
10	东兴安盈宝货币市场基金封闭期收益公告	指定报刊、公司网站	2016-06-13
11	东兴安盈宝货币市场基金封闭期收益公告	指定报刊、公司网站	2016-06-20
12	东兴安盈宝货币市场基金封闭期收益公告	指定报刊、公司网站	2016-06-25
13	东兴安盈宝货币市场基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务公告	指定报刊、公司网站	2016-06-30
14	东兴安盈宝货币市场基金半年度最后一个市场交易日收益公告	指定报刊、公司网站	2016-07-01
15	东兴安盈宝货币市场基金收益支付公告	指定报刊、公司网站	2016-07-01
16	东兴安盈宝货币市场基金封闭期收益公告	指定报刊、公司网站	2016-07-02
17	东兴证券股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、公司网站	2016-07-20
18	东兴证券股份有限公司关于调整旗下部分基金持有的停牌股票估值方法的提示性公告	指定报刊、公司网站	2016-08-02
19	关于增加北京汇成基金销售有限公司等两家公司为我公司旗下	指定报刊、公司网站	2016-08-26

	公开募集证券投资基金并参与费率优惠活动的公告		
20	关于增加大泰金石投资管理有限公司为我公司旗下公开募集证券投资基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	指定报刊、公司网站	2016-08-29
21	关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为我公司旗下公开募集证券投资基金销售机构并参与费率优惠活动的公告	指定报刊、公司网站	2016-09-08
22	关于东兴安盈宝货币市场基金2016年中秋节假期前暂停大额申购（含定期定额投资）业务的公告	指定报刊、公司网站	2016-09-09
23	东兴安盈宝货币市场基金2016年第3季度报告	指定报刊、公司网站	2016-10-24
24	东兴证券股份有限公司关于参加北京新浪仓石基金销售有限公司等五家公司费率优惠的公告	指定报刊、公司网站	2016-11-15
25	关于增加上海利得基金销售有限公司为东兴证券股份有限公司旗下公开募集证券投资基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、公司网站	2016-12-13
26	关于东兴证券股份有限公司旗下基金参与上海好买基金销售有限公司开展的申购费率优惠活动的公告	指定报刊、公司网站	2016-12-26
27	关于增加大连银行股份有限公司为东兴证券股份有限公司旗下公开募集证券投资基金销售机构并参与其费率优惠活动的公告	指定报刊、公司网站	2016-12-29

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 一、中国证监会核准东兴安盈宝货币市场基金募集的文件
- 二、《东兴安盈宝货币市场基金基金合同》
- 三、《东兴安盈宝货币市场基金托管协议》
- 四、《东兴安盈宝货币市场基金招募说明书》
- 五、中国证监会关于核准东兴证券股份有限公司公开募集证券投资基金管理业务资格的批复、营业执照、公司章程

### 12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

### 12.3 查阅方式

投资者可免费查阅，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复印件或复印件。相关公开披露的法律文件，投资者还可在本基金管理人网站(www.fund.dxzq.net)查阅。

东兴证券股份有限公司

二〇一七年三月二十七日