东兴安盈宝货币市场基金

2017年第2季度报告

2017年06月30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

报告送出日期：2017年07月19日

§1 重要提示

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2017年7月18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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年4月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金产品概况

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06月03日
报告期末基金份额总额	9,343,983,191.10份
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。	
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	
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	69,879,361.30份	9,274,103,829.80份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年04月01日-2017年06月30日）	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
1.本期已实现收益	732,525.71	133,591,392.25
2.本期利润	732,525.71	133,591,392.25
3.期末基金资产净值	69,879,361.30	9,274,103,829.80

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	1.0264%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.9379%	0.0013%

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	净值收益	业绩比较	业绩比较基	①-③	②-④

	率①	率标准差②	基准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	1.0863%	0.0013%	0.0885%	0.0000%	0.9978%	0.0013%

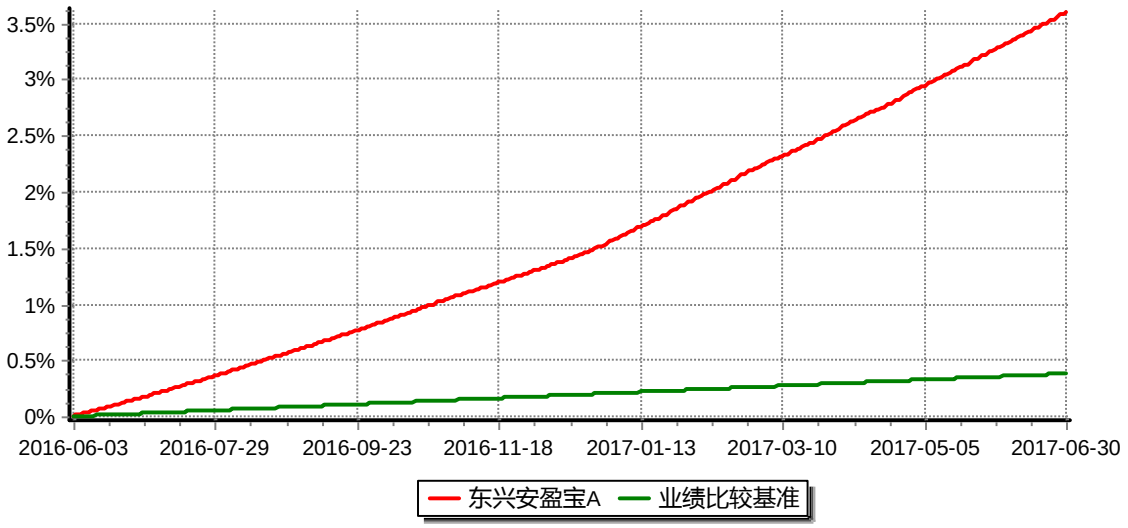
注：本基金每日分配收益，按月结转份额。

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-2017年06月30日）



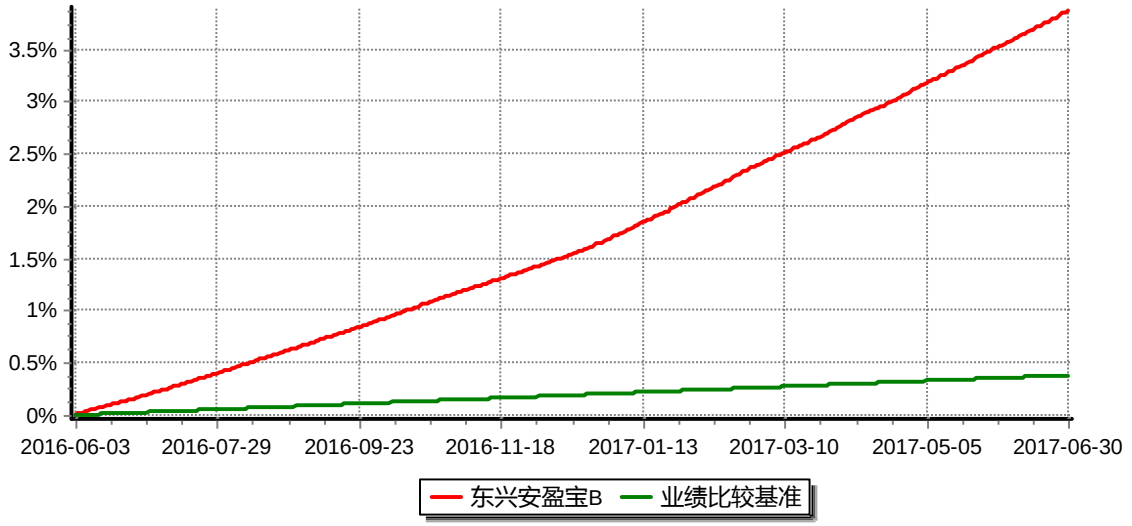
注：1、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，建仓期为6个月，截至本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

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-2017年06月30日）



注：1、本基金基金合同生效日为2016年6月3日，建仓期为6个月，截至本报告期末距建仓期结束不满一年；

2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）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06月03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、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理。
孙继青先生	本基金基金经	2016年06月03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

	理				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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

回顾5月中旬到6月上旬期间，同业存单收益率快速上行，但10年国债收益率反而震荡下行。5月相对于4月，银行整体流动性压力边际上是缓和的，同业存单利率的上行反应的是大行对中小行的收割，这种利益的转移主要发生在银行体系内部。6月份央行投放大量OMO保障市场流动性，造成6月中下旬资金面异常宽松。在流动性较好的影响下，短端利率尤其是存单收益率出现较大幅度的下行，收益率倒挂现象有所修复，市场出现了短期波段操作的机会。

报告期内，本基金采取了较为保守的配置策略，以应对半年度末的银行资金回表需求。在资产的类别配置上增配了存款和债券回购，存单配置以高等级为主。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2017年4月1日起至2017年6月30日，本基金A类份额净值收益率为1.0264%，业绩比较基准收益率为0.0885%，高于业绩比较基准0.9379%；本基金B类份额净值收益率为1.0863%，业绩比较基准收益率为0.0885%，高于业绩比较基准0.9978%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，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。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

由于6月投放的大量公开市场操作在7月到期，投资者对7月初资金面产生担忧。从历史上看，7月央行更多的采取了净投放的操作，而且目前央行对于降杠杆的成果比较满意，一定程度上缓解了下半年监管政策从紧的预期，因此7月预计央行会进行少量资金回笼，但不会造成流动性的过度紧张。3季度的债券市场，资金面缓和、监管压力趋缓，更多是关注欧洲央行紧缩和基本面的边际变化，把握交易性机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	3,765,995,638.82	36.71
	其中：债券	3,765,995,638.82	36.71
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	3,170,959,046.16	30.91
	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	3,250,845,437.41	31.69
4	其他资产	70,149,177.76	0.68
5	合计	10,257,949,300.15	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	6.40	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	869,858,994.89	9.31
	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基金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

在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 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	86
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	99

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	44

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。

5.3.2 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	36.62	9.31
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	30.74	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	17.15	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
4	90天(含)—120天	5.89	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	120天(含)—397天（含）	18.64	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
合计		109.03	9.31

5.4 报告期内投资组合平均剩余期限超过240天情况说明

在本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余存续期超过240天的情况。

5.5 报告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	149,483,562.54	1.60
2	央行票据	—	—

3	金融债券	489,678,332.04	5.24
	其中：政策性金融债	489,678,332.04	5.24
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	249,951,425.01	2.67
6	中期票据	—	—
7	同业存单	2,876,882,319.23	30.79
8	其他	—	—
9	合计	3,765,995,638.82	40.30
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

5.6 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

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	111710209	17兴业银行CD209	5,000,000	498,793,081.22	5.34
2	111710197	17兴业银行CD197	4,300,000	429,175,958.38	4.59
3	111711207	17平安银行CD207	3,000,000	298,009,649.02	3.19
4	111709203	17浦发银行CD203	3,000,000	297,873,059.70	3.19
5	111709229	17浦发银行CD229	3,000,000	296,993,051.21	3.18
6	111711209	17平安银行CD209	2,000,000	198,633,425.42	2.13
7	111720089	17广发银行CD089	2,000,000	198,607,730.95	2.13
8	111708162	17中信银行CD162	2,000,000	198,582,039.80	2.13
9	111796161	17珠海华润银行CD043	2,000,000	192,637,483.93	2.06
10	130216	13国开16	1,900,000	189,522,166.49	2.03

5.7 “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	0.0353%
报告期内偏离度的最低值	-0.0168%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0143%

5.7 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。

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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明。

本基金采用摊余成本法计价。

5.9.2

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。

5.9.3 其他资产构成

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	70,096,317.76
4	应收申购款	52,860.00
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	70,149,177.76

§6 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
报告期期初基金份额总额	42,812,401.00	12,139,058,409.39

报告期基金总申购份额	220,422,326.15	16,560,682,846.17
减：报告期基金总赎回份额	193,355,365.85	19,425,637,425.76
报告期期末基金份额总额	69,879,361.30	9,274,103,829.80

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2017年04月05日	2,951,783.51	—	—
2	红利再投	2017年05月02日	3,195,421.24	—	—
3	红利再投	2017年06月01日	3,572,416.70	—	—
合计			9,719,621.45	—	

注：根据《东兴安盈宝货币市场基金招募说明书》的规定，本基金不收取申购费和赎回费，红利再投也不收取费用。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017年4月1日至2017年4月11日	4,924,126,665.77	723,000,397.92	4,400,000,000.00	1,247,127,063.69	13.35%
机构	2	2017年4月13日至2017年4月19日	—	3,200,475,939.34	3,200,475,939.34	—	—
机构	3	2017年5月3日至2017年5月7日，2017年5月12日至2017年5月15日，2017年5月18日至2017年6月18日	1,500,000,000.00	1,474,825,875.88	1,960,000,000.00	1,014,825,875.88	10.86%
产品特有风险							
本基金投资于货币市场工具，可能面临较高货币市场利率波动的系统性风险以及流动性风险。货币市场利率的波动会影响基金的再投资收益，并影响到基金资产公允价值的变动。同时为应对赎回进行资产变现时，可能会由于货币市场工具流动性不足而面临流动性风险。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金本报告期内无影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、东兴安盈宝货币市场基金基金合同

2、东兴安盈宝货币市场基金托管协议

3、东兴安盈宝货币市场基金2017年第2季度报告原文

9.2 存放地点

北京市东城区东直门南大街3号国华投资大厦12层

9.3 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制件或复印件。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

二〇一七年七月十九日