

东兴安盈宝货币市场基金

2019 年半年度报告摘要

2019 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

送出日期:2019 年 08 月 27 日

§ 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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2019 年 8 月 22 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。

本报告中财务资料未经审计。

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。

本报告期自 2019 年 1 月 1 日起至 2019 年 6 月 30 日止

§ 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06月03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	4,063,647,696.49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	74,463,021.89份	3,989,184,674.60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 姓名	陈智勇	田东辉

露负责人	联系电话	010-57307309	010-68858113
	电子邮箱	chenzy_jj@dxzq.net.cn	tiandonghui@psbc.com
客户服务电话		95309	95580
传真		010-57307388	010-68858120

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.fund.dxzq.net
基金半年度报告备置地点	北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6层

§ 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(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
本期已实现收益	597,797.52	110,424,171.05
本期利润	597,797.52	110,424,171.05
本期净值收益率	1.2096%	1.3298%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末基金资产净值	74,463,021.89	3,989,184,674.60
期末基金份额净值	1.0000	1.0000

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。

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

东兴安盈宝A

阶段	份额净值收 益率①	份额净值收 益率标准差	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标	①-③	②-④
----	--------------	----------------	----------------	----------------	-----	-----

		②		准差④		
过去一个月	0.1906%	0.0034%	0.0292%	0.0000%	0.1614%	0.0034%
过去三个月	0.5676%	0.0020%	0.0885%	0.0000%	0.4791%	0.0020%
过去六个月	1.2096%	0.0016%	0.1760%	0.0000%	1.0336%	0.0016%
过去一年	2.6914%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	2.3365%	0.0016%
过去三年	10.4456%	0.0023%	1.0646%	0.0000%	9.3810%	0.0023%
自基金合同生效起至今	10.6331%	0.0023%	1.0918%	0.0000%	9.5413%	0.0023%

东兴安盈宝B

阶段	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
过去一个月	0.2099%	0.0034%	0.0292%	0.0000%	0.1807%	0.0034%
过去三个月	0.6274%	0.0020%	0.0885%	0.0000%	0.5389%	0.0020%
过去六个月	1.3298%	0.0016%	0.1760%	0.0000%	1.1538%	0.0016%
过去一年	2.9376%	0.0016%	0.3549%	0.0000%	2.5827%	0.0016%
过去三年	11.2414%	0.0023%	1.0646%	0.0000%	10.1768%	0.0023%
自基金合同生效起至今	11.4500%	0.0023%	1.0918%	0.0000%	10.3582%	0.0023%

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-2019年06月30日)



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06月03日-2019年06月30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。

2、建仓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股份有限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2019年6月30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、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金、东兴核心成长混合型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金共10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(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
孙继青先生	本基金基金经理	2016-06-03	-	11年	北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，11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、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
张琳娜女士	本基金基金经理	2018-06-22	-	11年	金融学硕士毕业，11年证券基金行业从业经历。2007年4月至2012年2月任益民基金集中交易部交易员、副总经理，2012年3月至2018年1月任英大基金交易管理部副总经理，固定收益部总经理、基金经理，2018年1月12日加入东兴证券。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、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理。

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 公平交易制度的执行情况

基金管理人根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，制定了《东兴证券股份有限公司基金业务公平交易管理办法（修订）》。

基金管理人建立了投资决策的内部控制体系和客观的研究方法，各投资组合经理在

授权范围内自主决策，各投资组合共享研究平台，在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

基金管理人实行集中交易制度，建立公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于交易所公开竞价交易，基金管理人执行交易系统内的公平交易程序；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等非集中竞价交易，在参与申购之前，各基金经理应在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量。在获配额度确定后，部门应按照价格优先的原则对交易结果进行分配；如果申购价格相同，则根据该价位各投资组合的申购数量进行比例分配。债券一级市场申购分配不足最小单位的，可由基金经理协商分配，协商不一致则由投资总监决定；对于银行间市场交易，应按照场外交易流程执行，由各基金经理给出询价区间，交易室根据询价区间在银行间市场上应该按照价格优先、时间优先的原则进行询价并完成交易，并留存询价交易记录备查。

基金管理人定期对不同投资组合不同时间段的内向交易价差、反向交易情况、异常交易情况进行统计分析，投资组合经理对相关交易情况进行合理性解释并留存记录。

本报告期内，基金管理人严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动中公平对待不同投资组合，未直接或通过第三方的交易安排在不同投资组合之间进行利益输送。本基金运作符合法律法规和公平交易管理制度规定。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2019年上半年资金面起伏波动。隔夜资金价格从年初的2.2798%降至6月末的1.5480%，期间最高至2.9725%，最低至1.0312%，7天资金价格从年初的2.5935%升至6月末的2.6603%，期间最高至3.6250%，最低至2.2204%。一月降准1个百分点，五月对中小银行实行差别化存款准备金率，六月对中小银行增加再贴现2000亿元和常备借贷便利1000亿元，TMLF保持季度投放的节奏，整体流动性合理充裕。

5月包商银行被接管，中小银行存单流动性枯竭，资金收紧明显，流动性分层问题严重，市场机构从交易对手和质押品两个方面严控风险，而后央行大额进行投放，六月末资金极度宽松，资金利率下行明显。

操作方面，本基金根据规模变动，在资金面不明朗的情况下保守操作，在资产收益

处于低位的情况下，组合剩余期限缩短，同时以产品流动性和安全性为最基本原则，收益较为稳定。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2019年1月1日起至2019年6月30日，本基金A类份额净值收益率为1.2096%，业绩比较基准收益率为0.1760%，高于绩比较基准收益率为1.0336%；本基金B类份额净值收益率为1.3298%，业绩比较基准收益率为0.1760%，高于绩比较基准收益率为1.1538%；

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，全球步入降息潮，贸易战长期化，而国内货币政策保持稳健，以内部环境为主的态度并未改变。CPI至高点回落，PPI转负，社融同比基数降低，房地产融资收紧，委托贷款、信托贷款下半年新增继续为负，地产投资增速的回落及土地财政的吃紧都将拖累经济，但财政政策的积极效果不容小觑，上半年地方债及专项债放量发行，消费成为拉动经济增长的有力指标，经济仍旧存在一定韧性。

操作上，本基金保持组合流动性、提高组合安全性，在2019年下半年流动性合理充裕的环境下，剩余期限保持高位，持续为持有人带来稳定收益。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内2019年1月1日至2019年6月30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111,021,968.57元；本基金本报告期无应分配而尚未分配利润的情况。

4.8 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（以下称“本托管人”）在东兴安盈宝货币市场基金（以下称“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。

本报告期内，本基金共进行利润分配11,102.20万元。

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 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 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：2019年06月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资 产：		
银行存款	90,923,930.86	131,134,136.54
结算备付金	50,000,000.00	-
存出保证金	-	0.19
交易性金融资产	2,675,122,728.98	5,032,766,471.73
其中：股票投资	-	-
基金投资	-	-

债券投资	2,644,950,317.89	5,002,589,884.13
资产支持证券投资	30,172,411.09	30,176,587.60
贵金属投资	-	-
衍生金融资产	-	-
买入返售金融资产	1,238,770,378.16	2,457,571,065.95
应收证券清算款	-	-
应收利息	17,207,725.90	23,992,508.67
应收股利	-	-
应收申购款	1,900.00	104,700.00
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	4,072,026,663.90	7,645,568,883.08
负债和所有者权益	本期末	上年度末
	2019年06月30日	2018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	-	365,299,052.05
应付证券清算款	-	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	1,180,316.96	2,392,796.97
应付托管费	314,751.21	638,079.24
应付销售服务费	48,425.61	92,003.50
应付交易费用	100,677.61	113,783.97
应交税费	68,589.25	91,898.89
应付利息	-	377,910.55
应付利润	6,602,494.59	16,356,170.45
递延所得税负债	-	-
其他负债	63,712.18	129,000.00
负债合计	8,378,967.41	385,490,695.62

所有者权益：		
实收基金	4,063,647,696.49	7,260,078,187.46
未分配利润	-	-
所有者权益合计	4,063,647,696.49	7,260,078,187.46
负债和所有者权益总计	4,072,026,663.90	7,645,568,883.08

注：报告截止日2019年6月30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4,063,647,696.49份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额74,463,021.89份，B类基金份额总额3,989,184,674.60份。

6.2 利润表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
一、收入	133,235,676.10	217,520,802.66
1. 利息收入	132,958,663.23	214,769,918.03
其中：存款利息收入	2,720,273.41	23,670,305.72
债券利息收入	93,354,992.71	135,327,982.75
资产支持证券利息收入	813,635.50	-
买入返售金融资产收入	36,069,761.61	55,771,629.56
其他利息收入	-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）	277,012.87	2,750,884.63
其中：股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	277,012.87	2,750,884.63
资产支持证券投资收益	-	-
贵金属投资收益	-	-
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	22,213,707.53	29,892,047.86
1. 管理人报酬	12,461,592.81	13,923,611.66
2. 托管费	3,323,091.41	3,712,963.20
3. 销售服务费	473,477.61	564,542.09
4. 交易费用	-	92.50
5. 利息支出	5,875,908.10	11,610,127.27
其中: 卖出回购金融资产支出	5,875,908.10	11,610,127.27
6. 税金及附加	26,325.42	2,405.58
7. 其他费用	53,312.18	78,305.56
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)	111,021,968.57	187,628,754.80
减: 所得税费用	-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)	111,021,968.57	187,628,754.80

6.3 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: 2019年01月01日至2019年06月30日

单位: 人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06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)	7,260,078,187.46	-	7,260,078,187.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	-	111,021,968.57	111,021,968.57
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)	-3,196,430,490.97	-	-3,196,430,490.97
其中: 1. 基金申购款	17,157,809,578.31	-	17,157,809,578.31

2. 基金赎回款	-20,354,240,069.28	-	-20,354,240,069.28
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)	-	-111,021,968.57	-111,021,968.57
五、期末所有者权益(基金净值)	4,063,647,696.49	-	4,063,647,696.49
项 目	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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)	6,485,886,686.18	-	6,485,886,686.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	187,628,754.80	187,628,754.80
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)	-948,023,720.59	-	-948,023,720.59
其中：1. 基金申购款	32,900,971,161.80	-	32,900,971,161.80
2. 基金赎回款	-33,848,994,882.39	-	-33,848,994,882.39
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)	-	-187,628,754.80	-187,628,754.80
五、期末所有者权益(基金净值)	5,537,862,965.59	-	5,537,862,965.59

报表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：

魏庆华

张涛

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

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 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42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3号—半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。

6.4.3 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2019年6月30日的财务状况以及2019年1月1日至2019年6月30日的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策与上年度会计报表相一致。

6.4.4.1 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2019年1月1日至2019年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。本基金现有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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

（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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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。

6.4.4.9 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，B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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

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

本基金在本报告期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

本基金在本报告期无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 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》、财税【2016】140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税【2017】2号《财政部、国家税务总局关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税【2017】56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》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。自2018年1月1日起，在基金运营过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

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。

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
中国东方资产管理股份有限公司	基金管理人的控股股东
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
东兴资本投资管理有限公司	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
大业信托有限责任公司	与基金管理人同一控股股东的关联方

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖 成交总额的比例
东兴证券股 份有限公司	20,677,600.00	100.00%	-	-

6.4.8.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期债券回购 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
东兴证券股 份有限公司	2,417,176,000.00	100.00%	7,354,162,020.00	100.00%

6.4.8.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方的佣金费用，期末无应支付关联方的佣金。

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 2019年01月01日至201 9年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至201 8年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	12,461,592.81	13,923,611.66
其中：支付销售机构的客户维护费	235,497.63	205,027.28

注：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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018 年06月30日
----	-----------------------------------	--

当期发生的基金应支付的托管费	3,323,091.41	3,712,963.20
----------------	--------------	--------------

注：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。

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 2019年01月01日至2019年06月30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	41,463.45	397,991.81	439,455.26
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,930.38	0.00	3,930.38
大连银行股份有限公司	9,835.80	2,325.81	12,161.61
合计	55,229.63	400,317.62	455,547.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30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	51,954.56	448,406.91	500,361.47
中国邮政储蓄银行股份有限公司	10,179.93	0.00	10,179.93
大连银行股份有限公司	36,631.07	1,549.15	38,180.22
合计	98,765.56	449,956.06	548,721.62

注：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。

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 2019年01月01日至2019年06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
大连银行股份有限公司	-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06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
大连银行股份有限公司	-	-	-	-	50,016,000.00	5,481.21

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

东兴安盈宝B

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月3 0日
	基金合同生效日(2016年06)	640,000,000.00

月03日)持有的基金份额		
报告期初持有的基金份额	564,505,866.10	787,269,330.07
报告期间申购/买入总份额	1,156,789,228.40	416,394,008.40
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	1,220,785,275.18	700,000,000.00
报告期末持有的基金份额	500,509,819.32	503,663,338.47
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.55%	9.20%

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。

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

份额单位:份

东兴安盈宝A

关联方名称	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
大业信托有限责任公司	240,895.42	0.32%	237,908.94	0.41%

东兴安盈宝B

关联方名称	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
东兴资本投资管理有限公司	36,151,717.75	0.91%	35,660,828.92	0.5%
大连银行股份有限公司	-	-	200,000,000.00	2.78%
中国东方资产管理股份有限公司	1,373,413,252.26	34.43%	2,050,273,003.37	28.47%

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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	923,930.86	14,249.18	423,083.82	14,072.66

注：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，利息收入为活期存款利息收入。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本报告期及上年度可比期间，本基金未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

6.4.8.7.1 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联事项的说明。

6.4.9 期末（2019年06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/增发证券而于期末流通受限的证券。

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的股票。

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

本基金本报告期末未持有在银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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在交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告报出日，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。

§ 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	2,675,122,728.98	65.70
	其中：债券	2,644,950,317.89	64.95
	资产支持证券	30,172,411.09	0.74
2	买入返售金融资产	1,238,770,378.16	30.42
	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	140,923,930.86	3.46
4	其他各项资产	17,209,625.90	0.42
5	合计	4,072,026,663.90	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	6.52	
	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	-	-
	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

序号	发生日期	债券融资余额占基金资产净值比例 (%)	原因	调整期
1	2019-05-29	26.97	发生巨额赎回	2个交易日
2	2019-05-30	26.64	发生巨额赎回	1个交易日

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	27
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	27

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。

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	68.13	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	27.25	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	1.23	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.50	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	2.68	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	99.79	-

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过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。

7.5 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	19,983,011.99	0.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	250,317,817.05	6.16
	其中：政策性金融债	250,317,817.05	6.16
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	580,239,094.55	14.28
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,794,410,394.30	44.16
8	其他	-	-
9	合计	2,644,950,317.89	65.09
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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	占基金资产净值比例 (%)
1	111806178	18交通银行CD178	3,500,000	349,496,428.73	8.60
2	111904027	19中国银行CD027	3,000,000	299,082,911.09	7.36
3	111909154	19浦发银行CD154	3,000,000	298,616,098.62	7.35
4	011900352	19浙能源SCP002	2,000,000	200,001,238.89	4.92
5	120312	12进出12	1,500,000	150,293,790.87	3.70
6	111820219	18广发银行CD219	1,500,000	149,387,971.02	3.68
7	180209	18国开09	1,000,000	100,024,026.18	2.46
8	071900031	19华泰证券CP001	1,000,000	100,008,965.56	2.46
9	111807190	18招商银行CD190	1,000,000	99,869,145.74	2.46
10	111817167	18光大银行CD167	1,000,000	99,814,841.33	2.46

7.7 “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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0904%
报告期内偏离度的最低值	-0.0056%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0323%

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。

报告期内正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。

7.8 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	156397	同煤联04	200,000	20,036,000.00	0.49
2	139524	链融10A1	100,000	10,021,000.00	0.25
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-
6	-	-	-	-	-
7	-	-	-	-	-
8	-	-	-	-	-
9	-	-	-	-	-
10	-	-	-	-	-

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金采用摊余成本法计价。

7.9.2

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。

7.9.3 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	17,207,725.90
4	应收申购款	1,900.00
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	17,209,625.90

§ 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

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			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	3,723	20,000.81	12,184,616.26	16.36%	62,278,405.63	83.64%
东兴安盈宝B	29	137,558,092.23	3,978,659,601.18	99.74%	10,525,073.42	0.26%
合计	3,752	0.00	3,990,844,217.44	98.21%	72,803,479.05	1.79%

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额(份)	占总份额比例
1	其他机构	1,373,413,252.26	33.80%
2	券商类机构	500,509,819.32	12.32%
3	银行类机构	301,964,308.25	7.43%

4	保险类机构	279,599,608.50	6.88%
5	基金类类机构	271,306,473.75	6.68%
6	券商类机构	213,221,628.65	5.25%
7	基金类类机构	200,000,000.00	4.92%
8	基金类类机构	170,000,000.00	4.18%
9	其他机构	100,000,000.00	2.46%
10	保险类机构	100,000,000.00	2.46%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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基金	东兴安盈宝A	4,421.98	0.01%
	东兴安盈宝B	-	-
	合计	4,421.98	0.00%

8.4 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	0~10
	东兴安盈宝B	0
	合计	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
基金合同生效日(2016年06月03 日)基金份额总额	31,358,162.32	3,990,007,000.00
本报告期期初基金份额总额	58,305,459.94	7,201,772,727.52

本报告期基金总申购份额	171, 174, 040. 06	16, 986, 635, 538. 25
减：本报告期基金总赎回份额	155, 016, 478. 11	20, 199, 223, 591. 17
本报告期期末基金份额总额	74, 463, 021. 89	3, 989, 184, 674. 60

注：报告期间基金总申购份额包含红利再投资份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动：

2019年1月29日，董事秦斌先生、黎蜀宁女士因工作安排原因，向董事会递交书面辞职报告，申请辞去第四届董事会董事职务，其辞职自辞职报告送达董事会时生效；公司第四届董事会第十七次会议同意提名曾涛先生、董裕平先生为公司第四届董事会非独立董事，详见《东兴证券股份有限公司关于董事辞职及补选董事的公告》（公告编号：2019-005）。

2019年1月29日，监事会主席许向阳先生因工作安排原因，向董事会递交书面辞职报告，申请待公司依照法定程序产生新任监事会主席履职时，辞去公司第四届监事会监事、监事会主席；公司第四届监事会第十次会议同意提名秦斌先生为公司第四届监事会非职工监事，详见《东兴证券股份有限公司关于监事会主席辞职及补选监事的公告》（公告编号：2019-006）。

鉴于公司第四届董事会第十四次会议聘任张涛先生为公司总经理和财务负责人，张涛先生于2019年2月15日取得证券公司高管任职资格正式履职，魏庆华先生不再担任公司总经理和财务负责人，详见《东兴证券股份有限公司关于高级管理人员任职的公告》（公告编号：2019-009）。

2019年2月21日，公司2019年第一次临时股东大会选举曾涛先生、董裕平先生为公司第四届董事会非独立董事；选举秦斌为公司第四届监事会非职工监事，北京证监局于2019年3月28日核准其任职资格，上述三位均正式履职。详见《东兴证券股份有限公司2019年第一次临时股东大会会议决议公告》（公告编号：2019-010）和《东兴证券股份有限公司关于董事任职的公告》（公告编号：2019-017）。

2019年2月21日，公司第四届监事会第十一次会议选举秦斌先生为监事会主席，北京证监局于2019年3月28日核准其证券公司董事长类任职资格，秦斌先生正式履职。详见《东兴证券股份有限公司关于选举监事会主席的公告》（公告编号：2019-012）和《东兴证券股份有限公司关于监事主席任职的公告》（公告编号：2019-018）。

2019年6月6日，公司第四届董事会第十九次会议审议通过《关于聘任公司首席信息官的议案》，同意聘任公司副总经理刘亮先生为公司首席信息官，任期自本次董事会通过之日起至本届董事会任期届满。详见《东兴证券关于聘任公司首席信息官的公告》（公告编号：2019-038）。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内涉及基金管理人的诉讼：详见本公司于2019年2月22日在上海证券交易所网站（www.sse.com.cn）刊登的《东兴证券股份有限公司关于累计涉及诉讼事项的公告》以及公司2019年半年度报告“重要事项”章节中关于诉讼的相关内容。

本报告期内，无涉及基金财产和基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内未更换会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

1、2019年1月17日，本基金管理人因成都二环路南二段证券营业部存在未按规定履行客户身份识别义务、未按规定划分客户风险等级、未按规定报送可疑交易报告相关问题，中国人民银行成都分行营业管理部向该营业部出具《行政处罚决定书》（成银营罚字[2019]2号）。收到上述处罚函件后，成都二环路南二段营业部及时落实并完成整改，向成都分行营业部报送了整改报告。

2、2019年7月11日，北京证监局向本基金管理人出具《行政监管措施决定书》（[2019]74号），指出公司私募子公司东兴资本投资管理有限公司在证券公司组织架构规范整改工作中整改逾期比例较高，要求公司3个月内改正，完善内部控制流程，加强对子公司的合规管理，增加内部合规检查次数。公司已要求东兴资本子公司高度重视整改工作，按照期限完成整改，并将加强合规督导，增加合规检查次数，定期报送检查报告。

3、报告期内，本基金管理人董事、监事、高级管理人员不存在被有权机关调查、被司法机关或纪检部门采取强制措施、被移送司法机关或追究刑事责任、被中国证监会立案调查或行政处罚、被采取市场禁入、被认定为不适当人选、被其他行政管理部门处罚以及被证券交易所公开谴责的情形。

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东兴证券股份有限公司	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价在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，只能使用本基金管理人自有的交易单元。

4、本基金本报告期内未新增交易单元。

10.7.2 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		权证交易		基金交易	
	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	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	20,677,600.00	100.00%	2,417,176,000.00	100.00%	-	-	-	-

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内不存在偏离度绝对值超过0.5%的情况。

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	2019年1月1日至2019年1月16日, 2019年1月18日至2019年1月22日, 2019年1月29日, 2019年3月27日至2019年4月2日, 2019年5月29日至2019年6月30日	2,050,273,003.37	23,140,248.89	700,000,000.00	1,373,413,252.26	33.80%
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。							

11.2 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。

东兴证券股份有限公司
二〇一九年八月二十七日