

东兴安盈宝货币市场基金

2020年第3季度报告

2020年09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:2020年10月28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2020年10月22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2020年7月1日起至2020年9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	2,706,610,143.05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	1, 011, 369, 034. 15份	1, 695, 241, 108. 90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(2020年07月01日 - 2020年09月30日)	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
1. 本期已实现收益	4, 153, 603. 50	12, 399, 196. 99
2. 本期利润	4, 153, 603. 50	12, 399, 196. 99
3. 期末基金资产净值	1, 011, 369, 034. 15	1, 695, 241, 108. 90

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 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净值表现

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	0.4023%	0.0014%	0.0894%	-	0.3129%	0.0014%
过去六个月	0.7323%	0.0018%	0.1779%	-	0.5544%	0.0018%
过去一年	1.8522%	0.0022%	0.3558%	-	1.4964%	0.0022%
过去三年	8.2459%	0.0029%	1.0656%	-	7.1803%	0.0029%
自基金合同生效起至今	13.2942%	0.0030%	1.5371%	-	11.7571%	0.0030%

东兴安盈宝B净值表现

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	0.4626%	0.0014%	0.0894%	-	0.3732%	0.0014%
过去六个月	0.8528%	0.0018%	0.1779%	-	0.6749%	0.0018%
过去一年	2.0963%	0.0022%	0.3558%	-	1.7405%	0.0022%
过去三年	9.0258%	0.0029%	1.0656%	-	7.9602%	0.0029%
自基金合同	14.4722%	0.0030%	1.5371%	-	12.9351%	0.0030%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

注：本基金每日分配收益并结转份额。

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

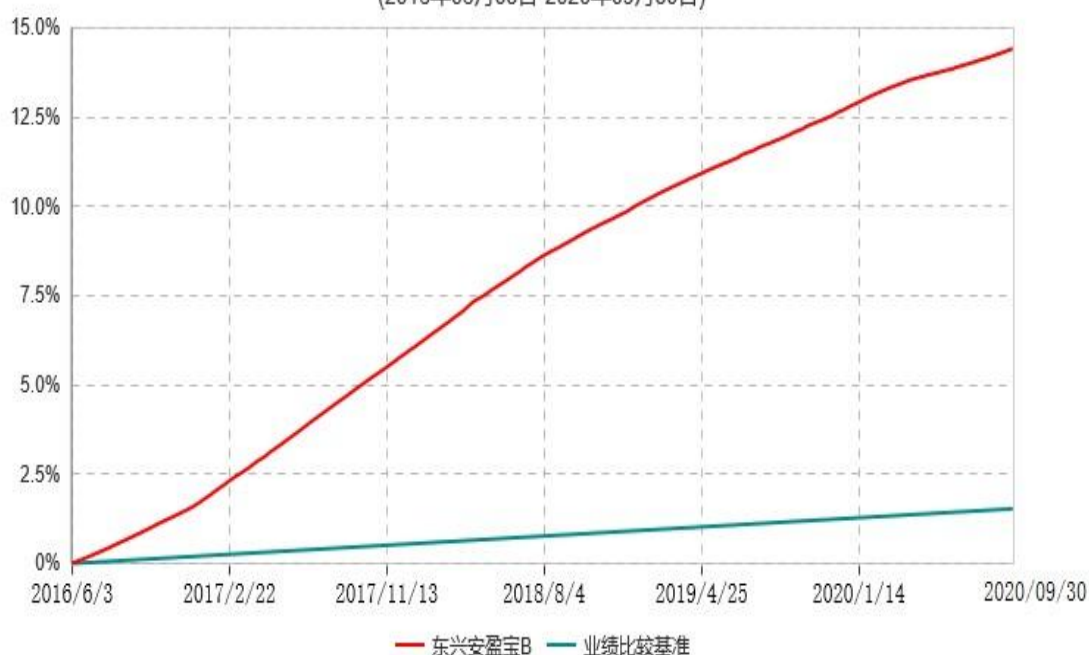
东兴安盈宝A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年06月03日-2020年09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-2020年09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		
孙继青先生	本基金基金经理	2016-06-03	-	12年	北京科技大学工学硕士，3年钢铁行业经验，12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月加入东兴证券投资基金业务部。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、东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴众智优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴量化多策略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	-	12年	金融学硕士毕业，12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、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴财短债债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫远三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 报告期内本基金运作合规守信情况说明

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

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2020年三季度在国内疫情得到有效控制的环境下，宏观经济继续恢复，房地产投资、基建投资和出口较强，通胀下行，PPI逐月走强，社融和信贷显著放量。从债券收益率走势来看，七月初股市大幅上涨，债券收益率大幅上行后缓慢抬升，收益率创年内新高，回购利率在货币政策回归正常后趋于平稳，存单收益较二季度上行明显，一年期存单利率接近甚至高于MLF利率，MLF加量续作，政策利率未做调整。

操作上，本基金保持组合流动性、提高组合安全性，剩余期限维持至高位，持续为持有人带来稳定收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

2020年7月1日起至2020年9月30日，本基金A类份额净值收益率为0.4023%，业绩比较基准收益率为0.0894%，高于业绩比较基准0.3129%；本基金B类份额净值收益率为0.4626%，业绩比较基准收益率为0.0894%，高于业绩比较基准0.3732%。

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。

§ 5 投资组合报告

5.1 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	1,934,369,781.52	68.15
	其中：债券	1,755,085,967.93	61.84
	资产支持证券	179,283,813.59	6.32
2	买入返售金融资产	458,117,010.67	16.14
	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	437,003,863.30	15.40
4	其他资产	8,783,553.61	0.31
5	合计	2,838,274,209.10	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	2.98
	其中：买断式回购融资	-	0.00
2	报告期末债券回购融资余额	129,999,735.00	4.80
	其中：买断式回购融资	-	0.00

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

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。

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	67
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	69
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

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	24.53	4.80
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
2	30天(含)—60天	26.66	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
3	60天(含)—90天	36.41	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	0.00	-
4	90天(含)—120天	5.55	0.00

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	—
5	120天(含)—397天(含)	11.39	0.00
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.00	—
合计		104.54	4.80

5.4 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

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	99,711,171.14	3.68
2	央行票据	—	—
3	金融债券	99,928,375.00	3.69
	其中：政策性金融债	99,928,375.00	3.69
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	609,923,807.68	22.53
6	中期票据	—	—
7	同业存单	945,522,614.11	34.93
8	其他	—	—
9	合计	1,755,085,967.93	64.84
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

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	112009121	20浦发银行CD121	2,000,000	199,193,344.79	7.36
2	207703	20贴现国开03	1,000,000	99,928,375.00	3.69
3	112003086	20农业银行CD086	1,000,000	99,698,669.64	3.68
4	111915553	19民生银行CD553	1,000,000	99,691,443.93	3.68
5	112009130	20浦发银行CD130	1,000,000	99,641,166.82	3.68
6	112003017	20农业银行CD017	1,000,000	99,565,833.09	3.68
7	112019318	20恒丰银行CD318	1,000,000	99,439,515.19	3.67

8	012000302	20阳煤SCP003	700,000	70,089,045.80	2.59
9	012000348	20象屿SCP002	500,000	50,038,808.61	1.85
10	012000998	20大同煤矿SCP008	500,000	50,027,815.74	1.85

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	-0.0431%
报告期内偏离度的最低值	-0.1221%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0747%

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。

5.8 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资产支持证券投资明细

序号	证券代码	证券名称	数量(份)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	165894	珠华发04	500,000	50,106,487.02	1.85
2	138590	链融23A2	240,000	24,000,000.00	0.89
3	168208	兴港2A	210,000	21,000,000.00	0.78
4	138589	链融23A1	190,000	19,000,000.00	0.70
5	165343	锦安2A2	300,000	18,792,287.41	0.69
6	168133	建一2期	140,000	14,000,000.00	0.52
7	165342	锦安2A1	200,000	12,528,107.29	0.46
8	138591	蛇口06优	110,000	11,000,000.00	0.41
9	165413	阳煤03优	80,000	8,028,615.47	0.30
10	138307	万科12优	100,000	828,316.40	0.03

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中国证监会及其派出机构、证券交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

5.9.3 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	8,783,153.61
4	应收申购款	400.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	8,783,553.61

§ 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	649,121,605.25	3,275,907,846.21
报告期期间基金总申购份额	8,570,986,056.97	2,531,919,196.99
报告期期间基金总赎回份额	8,208,738,628.07	4,112,585,934.30
报告期期末基金份额总额	1,011,369,034.15	1,695,241,108.90

§ 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	红利发放	2020-07-01	16,729.95	-	-
2	红利发放	2020-07-02	14,752.74	-	-
3	红利发放	2020-07-03	12,194.83	-	-
4	红利发放	2020-07-06	36,208.92	-	-
5	红利发放	2020-07-07	12,857.32	-	-
6	红利发放	2020-07-08	10,323.15	-	-
7	红利发放	2020-07-09	19,717.47	-	-
8	赎回	2020-07-10	-300,122,784.38	-300,133,997.26	-
合计			-300,000,000.00	-300,133,997.26	

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	2020 年 7 月 1 日-2020 年 9 月 14 日	906,531,224.68	3,780,173.34	400,000,000.00	510,311,398.02	18.85%
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2020年第3季度报告原文

9.2 存放地点

北京市西城区平安里西大街28号中海国际中心6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

2020年10月28日