

# 东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金

## 2022年第3季度报告

2022年09月30日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:招商银行股份有限公司

报告送出日期:2022年10月26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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年10月20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2022年7月1日起至2022年9月30日止。

## § 2 基金产品概况

|            |                                                                                                                                                                                                                                                                         |
|------------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称       | 东兴兴盈三个月定开债                                                                                                                                                                                                                                                              |
| 基金主代码      | 013164                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金运作方式     | 契约型开放式                                                                                                                                                                                                                                                                  |
| 基金合同生效日    | 2021年12月30日                                                                                                                                                                                                                                                             |
| 报告期末基金份额总额 | 200,762,350.49份                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 投资目标       | 在注重风险和流动性管理的前提下，力争获取超越业绩比较基准的投资收益。                                                                                                                                                                                                                                      |
| 投资策略       | <p>（一）封闭期投资策略</p> <ol style="list-style-type: none"> <li>1、类属配置策略</li> <li>2、期限配置策略</li> <li>3、期限结构策略</li> <li>4、信用债券投资策略</li> <li>5、可转换债券投资策略</li> <li>6、可交换债券投资策略</li> <li>7、证券公司短期公司债券投资策略</li> <li>8、资产支持证券等品种投资策略</li> <li>9、国债期货投资策略</li> </ol> <p>（二）开放期投资策略</p> |
| 业绩比较基准     | 中债综合全价(总值)指数收益率                                                                                                                                                                                                                                                         |
| 风险收益特征     | 本基金为债券型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场                                                                                                                                                                                                                                              |

|                 |                   |             |
|-----------------|-------------------|-------------|
|                 | 基金，低于混合型基金和股票型基金。 |             |
| 基金管理人           | 东兴基金管理有限公司        |             |
| 基金托管人           | 招商银行股份有限公司        |             |
| 下属分级基金的基金简称     | 东兴兴盈三个月定开债A       | 东兴兴盈三个月定开债C |
| 下属分级基金的交易代码     | 013164            | 013165      |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 200,761,359.43份   | 991.06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(2022年07月01日 - 2022年09月30日) |             |
|-----------------|--------------------------------|-------------|
|                 | 东兴兴盈三个月定开债A                    | 东兴兴盈三个月定开债C |
| 1. 本期已实现收益      | -655,494.73                    | -0.32       |
| 2. 本期利润         | 2,259,258.42                   | 10.57       |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0085                         | 0.0083      |
| 4. 期末基金资产净值     | 203,171,329.56                 | 1,002.60    |
| 5. 期末基金份额净值     | 1.0120                         | 1.0116      |

注：1、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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

东兴兴盈三个月定开债A净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差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      | 0.96%  | 0.08%     | 0.73%      | 0.05%         | 0.23% | 0.03% |
| 过去六个月      | 1.36%  | 0.07%     | 1.03%      | 0.04%         | 0.33% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.50%  | 0.06%     | 1.22%      | 0.05%         | 0.28% | 0.01% |

东兴兴盈三个月定开债C净值表现

| 阶段         | 净值增长率① | 净值增长率标准差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      | 0.95%  | 0.07%     | 0.73%      | 0.05%         | 0.22% | 0.02% |
| 过去六个月      | 1.34%  | 0.07%     | 1.03%      | 0.04%         | 0.31% | 0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.46%  | 0.06%     | 1.22%      | 0.05%         | 0.24% | 0.01% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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



东兴兴盈三个月定开债C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金基金合同生效日为 2021 年 12 月 30 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，截止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 |        |                                                                                                                                                                                       |
| 司马义买买提先生 | 本基金基金经理 | 2021-12-30  | -    | 9年     | 2011年10月至2014年3月任职于中信证券股份有限公司；2015年4月至2017年2月任职于粤开证券(原联讯证券)股份有限公司；2017年3月至2019年1月任职于九州证券股份有限公司固定收益资产管理部，曾担任部门总经理职务，主要从事固定收益投资、交易等工作；2019年1月至2021年2月，任职于江信基金管理有限公司金融市场总部，担任部门总经理，主要从事固 |

|      |         |            |   |    |                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                      |
|------|---------|------------|---|----|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
|      |         |            |   |    | 定收益研究相关工作。2021年3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、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、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理、东兴兴源债券型证券投资基金基金经理、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金基金经理。                                                                                                              |
| 任祺先生 | 本基金基金经理 | 2022-02-08 | - | 8年 | 硕士研究生,2013年6月至2015年5月,任职于方正证券股份有限公司北京证券资产管理分公司,先后任研究员、投资主办,主要负责固定收益投资、研究等工作;2015年6月至2016年6月,任职于九州证券股份有限公司,任资产管理委员会固收及量化投资部投资经理,主要从事固定收益投资、研究等工作;2016年9月至2021年8月,任职于江海证券有限公司,任资产管理固定收益投资部投资经理,主要负责固定收益投资及管理工作。2021年8月加入东兴基金管理有限公司。现任东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金基金经理、东兴兴盈三个月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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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《东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同》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《东兴基金管理有限公司公平交易管理办法》。

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，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，交易部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同向交易价差、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。

我们对本报告期内公司管理的不同投资组合在相同时间窗口下（日内、3日内和5日内）同向交易的价差进行了t分布假设检验，通过对检验结果进行分析，未发现旗下投资组合之间存在可能导致不公平交易和利益输送的异常情况。

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

站在2022年三季度这个时间点，我们看本轮牛市从2020年四季度开始已经延续了两个年度，我们系统回顾下今年以来情况。

总体看来，东兴兴盈在2022年的业绩呈现逐季度强化和改善的态势。兴盈于2021年12月30日成立并进入建仓期，2022年1月中旬央行降息后利率快速下行，对建仓节奏造成较大影响。对此1月下旬至3月中下旬主要参考长短端品种估值、曲线结构和期限利差使用长端国开和逆回购进行防守逐步建仓并等待市场机会进攻，期间2月份开始宽信用预期转强、地产政策放松叠加1月社融总量大超预期，利率回调幅度较大，这期间久期逐步增加至中性偏低久期水平。1-2月社融数据和经济数据在回升之后，3月份数据出现显著下滑，以及深圳出现疫情，组合层面3月下旬久期增加至中性偏多水平，并补充中长期国开个券以获取波段收益。这个阶段整体防守效果较好。

二季度市场利率受到沪京疫情冲击、降息预期落空和降准缩量、稳增长政策发力和复工复产多重因素影响形成“W”走势。4月上旬资金利率显著低于政策利率和疫情发酵带动利率下行，但是降息落空和降准低于预期回调上行；4月底政治局会议强调疫情防控坚持动态清零和预期政策对于经济活动的扰动，包括地产复苏、消费恢复和供应链通畅遇阻，5月份出现一定幅度下行创下季度内低点。国内主要城市的疫情延续至5月底陆续缓解，上海复工复产和稳增长政策发力的预期带动利率回升，整个6月份利率上行承压明显。

6月末开始反复思考预期差在哪里，当时主要关注资金利率和政策利率中枢变动情况、观察政策效果和经济恢复状态，包括信贷和就业等的改善，以及地产政策连续的放松之后关注销售和投资的改善和持续情况；计划根据资金利率波动情况和经济修复的斜率灵活调整组合。很快7月上旬看到资金利率再度快速回落到低位，高频数据显示经济从疫后恢复重新进入疲弱的状态，地产迟迟没有大的改观，结合经济回升力度和持续时间显著弱于2020年的预判，组合方面果断增加久期至中高水平，结构上主要构成为中长端债券尤其十年长债以保持进攻态势。这个阶段整体看进攻效果较好，7月和8月份在基本面验证低于预期之外还有系列事件催化，如地产交楼、超预期降息和政治局会议定调不搞强刺激等，市场分歧快速趋于一致，在流动性宽松的背景下利率保持非常流畅和快速的下行，兴盈在这一阶段获取非常不错的波段收益。

整体来看，今年以来出现的利率下行主要是由四方面因素推动，a、降息带动中长端估值中枢下行；b、资金利率下行维持低位带动杠杆息差交易和短端估值下行；c、阶段性政策效力低于预期；d、疫情对于经济活动的影响。这几方面因素使利率在七八月份都相对定价充分，9月份上旬利率下行动能减弱，市场止盈情绪偏强，这一阶段我们也相应做了一部分止盈操作。

另一方面，全年来看推动利率上行的主要逻辑一般为稳增长政策加码、疫情防控对经济的影响、经济恢复预期差等因素之间的反复切换，主要的震荡和调整很大程度上受稳增长政策发力、地产以及财政增量政策工具预期的影响。具体到近期的调整，自8月中旬降息后稳增长政策信号即再度有所增强，8月下旬国常会均释放明确的稳增长信号，进入9月后更大幅度的地产量价政策放松、多项结构性增量政策密集出台，叠加联储加息预期强劲，加息压力传导到人民币汇率市场，带动了对于货币政策宽松节奏、幅度的负面预期，部分机构在中下旬出现明显减仓降低杠杆，整体的上行调整幅度比较剧烈。

展望四季度，经济基本面延续偏弱的状态，观察到融资需求的现状没有明显恢复，而且从央行三季度银行家调查和储户调查也可以看到这种需求增加的预期暂时还未明显改观，对于居民和企业来说预期扭转需要更大力度的政策和时间。从疫情防控的角度看政策在可展望的时间内具备持续性，结合当下弱修复的态势，经济恢复的时间可能会更长。

主要的经济部门方面，地产在9月下旬连续政策加力下需要观察实际的政策效果，短期较好的结果是销售触底；消费无论是近期的高频数据还是储户调查，还是处于偏弱状态；出口由于外需的变化开始步入走弱的态势，进入四季度末，大家更会关注欧洲美国需求衰退的影响；核心的稳增长抓手为在结构性货币政策支撑下的基建和制造业，需要后续连续性的增量政策发力。金融数据方面在结构性政策发力下，预计四季度维持底部甚至出现一定增长的态势。

从估值和交易性价比看，9月以来的调整打出了相对空间，十年国债靠近估值中枢 2.75%，在本轮经济下行十年国债基本没有突破MLF估值中枢，结合当前的情况看预计收益率在2.75%以上空间有限，同时如果融资需求恢复不如预期，利率下行还具备空间。因此如果没有根本性的因素导致本轮经济下行的预期扭转，估值中枢附近介入应该具备盈利空间。

操作层面在实体融资需求没有根本性改变的四季度，本轮下行的预期还没有根本性扭转，利率债具备操作空间，本基金将保持中高久期灵活交易努力获取票息和波段收益。风险各方面关注包括资金利率和政策利率的波动回归，超预期的增量政策，以及其他重大政策变化策等。

#### 4.5 报告期内基金的业绩表现

2022年7月1日起至2022年9月30日，本基金A类份额净值增长率为0.96%，业绩比较基准收益率为0.73%，高于业绩比较基准0.23%；本基金C类份额净值增长率为0.95%，业绩比较基准收益率为0.73%，高于业绩比较基准0.22%。

#### 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

第9页，共14页

## 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<br>(%) |
|----|-----------------------|----------------|------------------|
| 1  | 权益投资                  | —              | —                |
|    | 其中：股票                 | —              | —                |
| 2  | 基金投资                  | —              | —                |
| 3  | 固定收益投资                | 276,228,466.38 | 99.60            |
|    | 其中：债券                 | 276,228,466.38 | 99.60            |
|    | 资产支持证券                | —              | —                |
| 4  | 贵金属投资                 | —              | —                |
| 5  | 金融衍生品投资               | —              | —                |
| 6  | 买入返售金融资产              | —              | —                |
|    | 其中：买断式回购的买入<br>返售金融资产 | —              | —                |
| 7  | 银行存款和结算备付金合<br>计      | 1,113,505.87   | 0.40             |
| 8  | 其他资产                  | 5,018.84       | 0.00             |
| 9  | 合计                    | 277,346,991.09 | 100.00           |

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

## 5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种      | 公允价值(元)        | 占基金资产净<br>值比例(%) |
|----|-----------|----------------|------------------|
| 1  | 国家债券      | 19,931,255.43  | 9.81             |
| 2  | 央行票据      | —              | —                |
| 3  | 金融债券      | 256,297,210.95 | 126.15           |
|    | 其中：政策性金融债 | 256,297,210.95 | 126.15           |
| 4  | 企业债券      | —              | —                |
| 5  | 企业短期融资券   | —              | —                |

|    |           |                |        |
|----|-----------|----------------|--------|
| 6  | 中期票据      | —              | —      |
| 7  | 可转债（可交换债） | —              | —      |
| 8  | 同业存单      | —              | —      |
| 9  | 其他        | —              | —      |
| 10 | 合计        | 276,228,466.38 | 135.96 |

### 5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）   | 公允价值(元)       | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|--------|---------|---------------|--------------|
| 1  | 210203 | 21国开03 | 600,000 | 62,740,027.40 | 30.88        |
| 2  | 200202 | 20国开02 | 400,000 | 40,344,712.33 | 19.86        |
| 3  | 200203 | 20国开03 | 300,000 | 31,318,865.75 | 15.41        |
| 4  | 220203 | 22国开03 | 300,000 | 30,498,000.00 | 15.01        |
| 5  | 220206 | 22国开06 | 300,000 | 30,188,038.36 | 14.86        |

### 5.6 报告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。

### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 5.11 投资组合报告附注

#### 5.11.1

本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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、处罚的情形。

#### 5.11.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称      | 金额(元)    |
|----|---------|----------|
| 1  | 存出保证金   | 5,018.84 |
| 2  | 应收证券清算款 | —        |
| 3  | 应收股利    | —        |
| 4  | 应收利息    | —        |
| 5  | 应收申购款   | —        |
| 6  | 其他应收款   | —        |
| 7  | 其他      | —        |
| 8  | 合计      | 5,018.84 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

## § 6 开放式基金份额变动

单位：份

|                           | 东兴兴盈三个月定开债A    | 东兴兴盈三个月定开债C |
|---------------------------|----------------|-------------|
| 报告期期初基金份额总额               | 718,660,232.71 | 3,297.33    |
| 报告期期间基金总申购份额              | —              | —           |
| 减：报告期期间基金总赎回份额            | 517,898,873.28 | 2,306.27    |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | —              | —           |
| 报告期期末基金份额总额               | 200,761,359.43 | 991.06      |

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

|                  | 东兴兴盈三个月定开债A   | 东兴兴盈三个月定开债C |
|------------------|---------------|-------------|
| 报告期期初管理人持有的本基金份额 | 20,000,777.77 | —           |
| 报告期期间买入/申购总份额    | —             | —           |

|                          |               |   |
|--------------------------|---------------|---|
| 报告期期间卖出/赎回总份额            | 19,000,777.77 | — |
| 报告期期末管理人持有的本基金份额         | 1,000,000.00  | — |
| 报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%） | 0.50          | — |

## 7.2 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  | 赎回   | 2022-07-14 | -19,000,777.77 | -19,084,381.19 | —    |
| 合计 |      |            | -19,000,777.77 | -19,084,381.19 |      |

注：基金管理人运用固有资金投资本基金适用的申购、赎回费率均按照招募说明书约定收取。

## § 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              | 2022年7月1日至2022年7月11日   | 199,281,586.29 | 0.00 | 199,281,586.29 | 0.00           | 0.00%  |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 2              | 2022年7月1日至2022年9月30日   | 199,222,034.07 | 0.00 | 99,600,000.00  | 99,622,034.07  | 49.62% |
|                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                               | 3              | 2022年7月12日至2022年9月30日  | 100,126,656.90 | 0.00 | 0.00           | 100,126,656.90 | 49.87% |
| 产品特有风险                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                                        |                |                        |                |      |                |                |        |
| <p>1、本基金为债券型基金，基金除承担由于市场利率波动造成的利率风险外还要承担如企业债、公司债等信用品种的发债主体信用恶化造成的信用风险。</p> <p>2、本基金以定期开放方式运作，在封闭期内，本基金不接受基金份额的申购和赎回，也不上市交易。因此，在封闭期内，基金份额持有人将面临因不能赎回或卖出基金份额而出现的流动性约束。本基金开放期可能出现巨额赎回，导致基金资产变现困难，进而出现延缓支付赎回款项的风险。</p> <p>3、本基金可投资于在全国银行间债券市场或证券交易所交易的资产支持证券，基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券投资，但由于资产支持证券具有一定的信用风险、利率风险、流动性风险、提前偿还风险等风险，可能导致包括基金净值波动在内的各项风险。</p> <p>4、本基金的投资范围包括国债期货，国债期货的交易采用保证金交易方式，基金资产可能由于无法及时筹措资金满足建立或者维持国债期货头寸所要求的保证金而面临保证金风险。同时，该潜在损失可能成倍放大，具有杠杆性风险。另外，国债期货在对冲市场风险的使用过程中，基金资产可能因为国债期货合约与合约标的的价格波动不一致而面临基差风险。</p> |                |                        |                |      |                |                |        |

### 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、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金合同
- 2、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金托管协议
- 3、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金2022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.dxamc.cn](http://www.dxamc.cn)）查阅。

东兴基金管理有限公司

2022年10月26日