

东兴安盈宝货币市场基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:东兴基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 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2026年3月27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。

毕马威华振会计师事务所（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2025年1月1日起至2025年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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况	13
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	18
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	19
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 净资产变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 债券回购融资情况	57
8.3 基金投资组合平均剩余期限	58
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	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	59
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细	59
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	59
8.8 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	60
8.9 投资组合报告附注	60
§9 基金份额持有人信息	61

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	61
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
9.4 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	62
§10 开放式基金份额变动	62
§11 重大事件揭示	63
11.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
11.4 基金投资策略的改变	63
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	63
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	63
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
11.8 偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	64
11.9 其他重大事件	64
§12 影响投资者决策的其他重要信息	67
12.1 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	67
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	67
§13 备查文件目录	67
13.1 备查文件目录	67
13.2 存放地点	68
13.3 查阅方式	68

§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	东兴基金管理有限公司		
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	15,244,452,042.81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	东兴安盈宝C
下属分级基金的交易代码	002759	002760	024503
报告期末下属分级基金的份额总额	5,082,851,762.81份	9,814,815,480.35份	346,784,799.65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	东兴基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	李宛霖	张立学
	联系电话	400-670-1800	010-68858113
	电子邮箱	xxpl@dxamc.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		400-670-1800	95580
传真		010-83770122	010-86353609
注册地址		北京市丰台区东管头1号院1号楼1-190室	北京市西城区金融大街3号
办公地址		北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		100033	100808
法定代表人		王洪亮	郑国雨

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.dxamc.cn
基金年度报告备置地点	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
注册登记机构	东兴基金管理有限公司	北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15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	2025年			2024年			2023年		
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B	东兴安盈宝C	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B	东兴安盈宝C	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B	东兴安盈宝C
本期已实	64,123,743.09	115,963,244.76	394,224.64	69,411,943.98	185,449,485.64	-	81,879,695.30	276,177,714.05	-

现收益									
本期利润	64,123,743.09	115,963,244.76	394,224.64	69,411,943.98	185,449,485.64	-	81,879,695.30	276,177,714.05	-
本期净值收益率	1.2571%	1.5006%	0.8167%	1.5978%	1.8418%	-	2.0292%	2.2745%	-
3.1.2 期末数据和指标	2025年末			2024年末			2023年末		
期末基金资产净值	5,082,851.762.81	9,814,815.480.35	346,784.799.65	4,392,834,921.27	12,661,456,709.20	-	2,979,526.783.40	10,537,632.652.40	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	1.0000	-	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2025年末			2024年末			2023年末		
累计净值收益率	24.4376%	27.3259%	0.8167%	22.8928%	25.4435%	-	20.9600%	23.1748%	-

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。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2020年3月12日前每日分配收益，按月结转份额；自2020年3月12日起每日分配收益，每日结转份额；

4、本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额，截至报告期末不满一年。

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	0.2923%	0.0008%	0.0894%	-	0.2029%	0.0008%
过去六个月	0.5842%	0.0008%	0.1789%	-	0.4053%	0.0008%
过去一年	1.2571%	0.0017%	0.3549%	-	0.9022%	0.0017%
过去三年	4.9625%	0.0020%	1.0656%	-	3.8969%	0.0020%
过去五年	9.2224%	0.0022%	1.7753%	-	7.4471%	0.0022%

自基金合同生效起至今	24.4376%	0.0029%	3.4018%	-	21.0358%	0.0029%
------------	----------	---------	---------	---	----------	---------

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
过去三个月	0.3531%	0.0008%	0.0894%	-	0.2637%	0.0008%
过去六个月	0.7062%	0.0008%	0.1789%	-	0.5273%	0.0008%
过去一年	1.5006%	0.0017%	0.3549%	-	1.1457%	0.0017%
过去三年	5.7212%	0.0020%	1.0656%	-	4.6556%	0.0020%
过去五年	10.5407%	0.0022%	1.7753%	-	8.7654%	0.0022%
自基金合同生效起至今	27.3259%	0.0029%	3.4018%	-	23.9241%	0.0029%

东兴安盈宝C

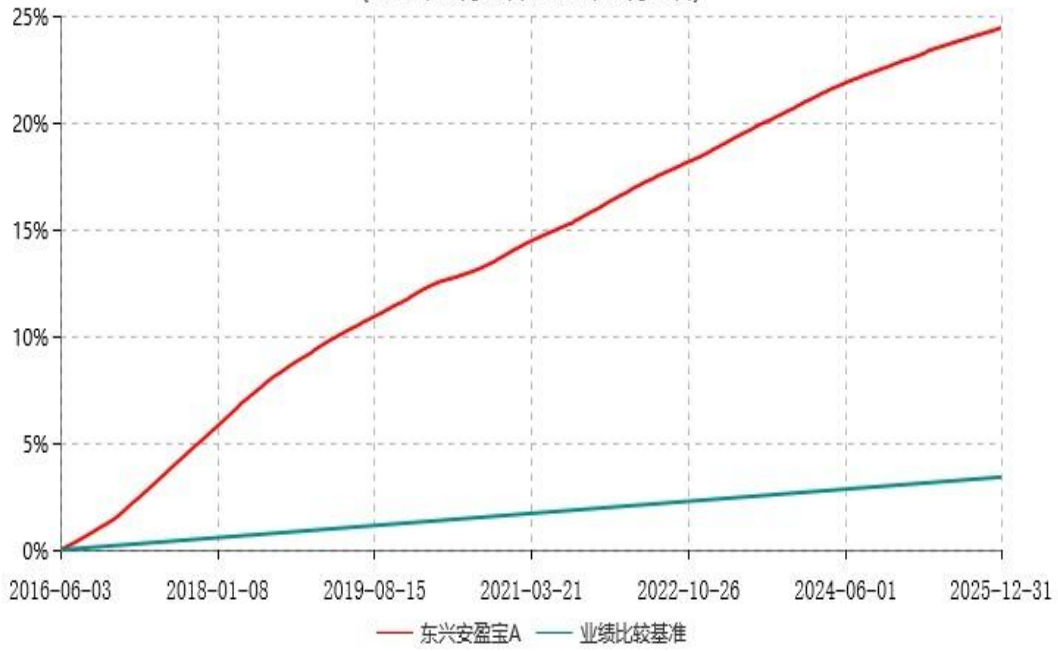
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3532%	0.0008%	0.0894%	-	0.2638%	0.0008%
过去六个月	0.7062%	0.0008%	0.1789%	-	0.5273%	0.0008%
自基金合同生效起至今	0.8167%	0.0008%	0.2061%	-	0.6106%	0.0008%

注：本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额，截至报告期末不满一年。

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

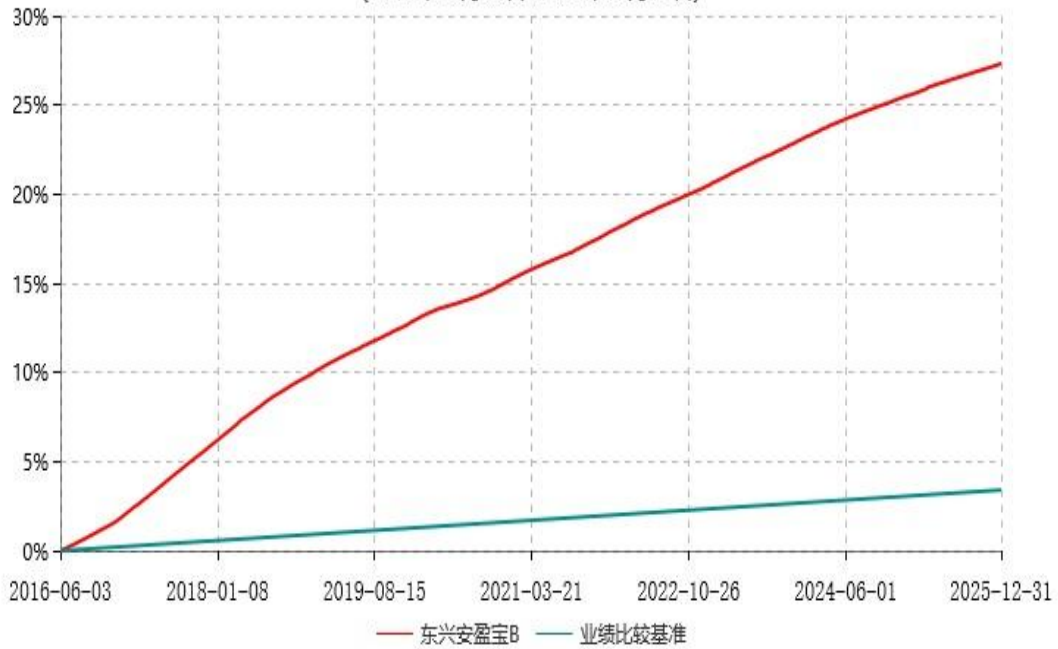
东兴安盈宝A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年06月03日-2025年12月31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-2025年12月31日)



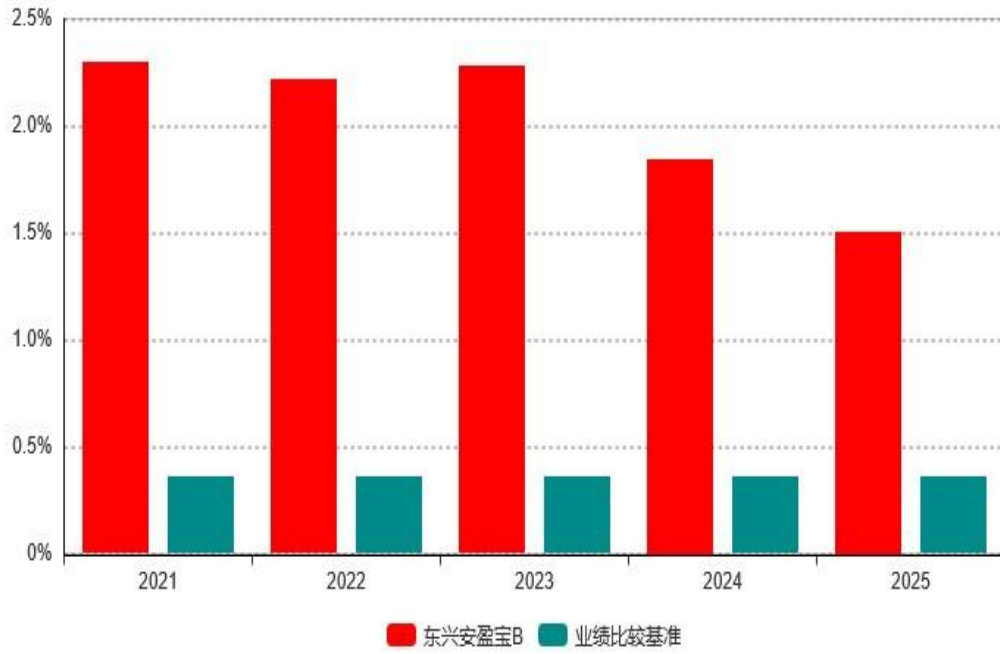
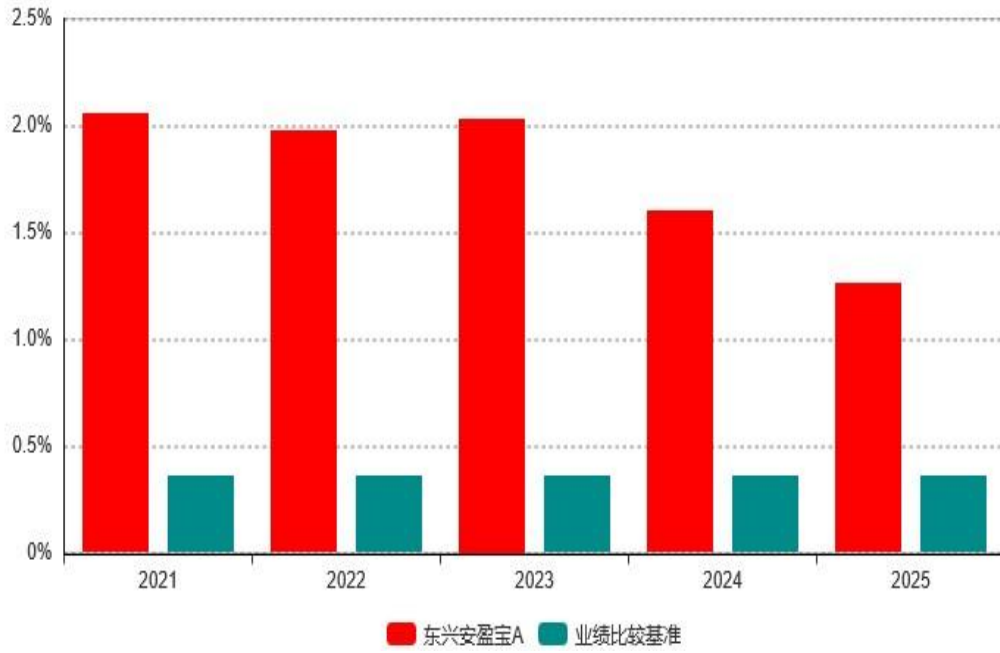
东兴安盈宝C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

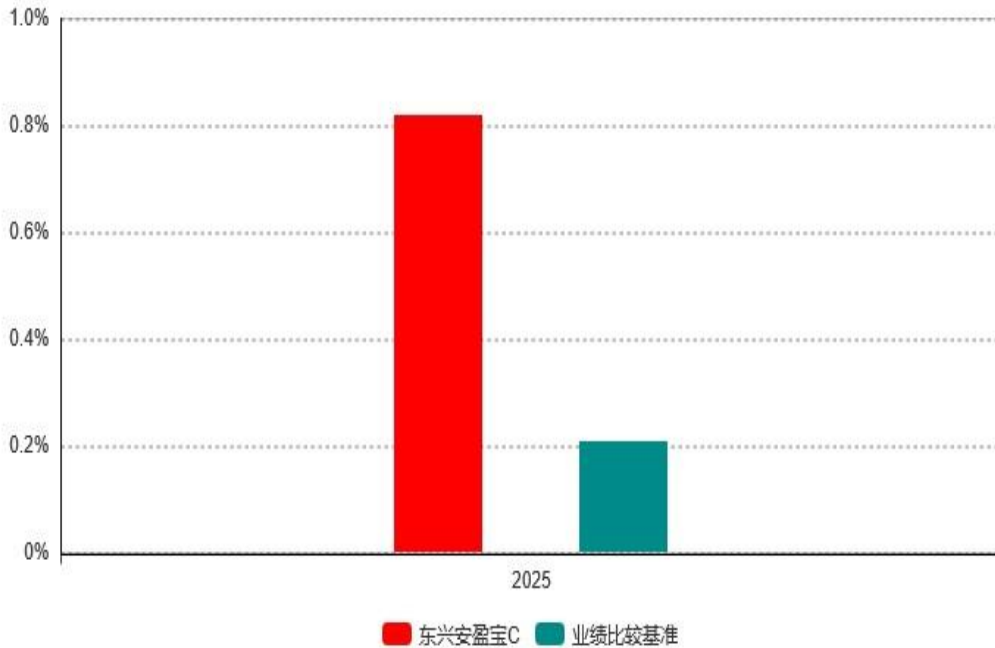
(2025年06月03日-2025年12月31日)



- 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；
- 2、建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定；
- 3、本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额，截至报告期末不满一年。

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
2025年	64,123,743.09	-	-	64,123,743.09	-
2024年	69,411,943.98	-	-	69,411,943.98	-
2023年	81,879,695.30	-	-	81,879,695.30	-
合计	215,415,382.37	-	-	215,415,382.37	-

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
2025年	115,963,244.76	-	-	115,963,244.76	-
2024年	185,449,485.64	-	-	185,449,485.64	-
2023年	276,177,714.05	-	-	276,177,714.05	-

合计	577,590,444.45	-	-	577,590,444.45	-
----	----------------	---	---	----------------	---

东兴安盈宝C

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
2025年	394,224.64	-	-	394,224.64	-
合计	394,224.64	-	-	394,224.64	-

注：本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额。

§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

东兴基金管理有限公司（以下简称“东兴基金”）成立于2020年3月，注册地北京，注册资本2亿元。东兴证券股份有限公司（以下简称“东兴证券”）持有东兴基金100%股份，其控股股东为中国东方资产管理股份有限公司（以下简称“中国东方”）。东兴基金系中国东方下属唯一公募基金业务经营主体，是中国东方金融服务平台的重要组成部分。

东兴基金前身为东兴证券基金业务部，先后在主动权益、固定收益、现金管理和指数类产品方面进行了大量布局，积累了丰富的投资运作经验：

特色指数类产品--在行业指数、量化增强方面进行深入研究设计，致力于打造特色精品指数类基金阵列；

主动管理类产品--以追求绝对收益为目标，贯彻自上而下和自下而上相结合的投研思路，坚持价值投资；

固定收益类产品--坚持守住价值、发现价值的原则，在严格把控信用风险的前提下，充分挖掘市场机会。

东兴基金拥有一支行业经验丰富、具备高度凝聚力、战斗力和专业性的优秀团队。公司承载中国东方的红色基因，践行诚信、创新、激情、专注、协作的企业文化，坚持以投资者利益为上的原则，致力为客户持续创造价值。

截至2025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、东兴安盈宝货币市场基金、东兴兴利债券型证券投资基金、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、东兴未来价值灵活配置混合型证券投资基金、东兴兴瑞一年定期开放债券型证券投资基金、东兴兴财短债债券型证券投资基金、东兴鑫远三年定期开放债券型证券投资基金、东兴中证消费50指数证券投资基金、东兴兴晟混合型证券投资基金、东兴宸瑞量化混合型证券投资基金、东兴鑫享6个月滚动持有债券型发起式证券投资基金、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资

资基金、东兴兴源债券型证券投资基金、东兴宸祥量化混合型证券投资基金、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金、东兴数字经济混合型发起式证券投资基金、东兴鑫颐3个月滚动持有纯债债券型证券投资基金、东兴成长优选混合型发起式证券投资基金、东兴医药生物量化选股混合型证券投资基金、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金、东兴宸泰量化选股混合型发起式证券投资基金、东兴红利优选混合型证券投资基金、东兴中证A500指数增强型证券投资基金、东兴产业升级混合型发起式证券投资基金、东兴中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金、东兴低碳经济混合型发起式证券投资基金共29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		
司马义买买提先生	本基金基金经理	2021-04-27	2025-04-07	16年	毕业于上海交通大学计算数学专业，硕士研究生学历。2008年7月至2014年1月，在中信证券股份有限公司工作；2015年1月至2017年2月，任职粤开证券（原联讯证券）股份有限公司固定收益业务总部下属资本市场部委员（北京业务部行政负责人）；2017年3月至2019年1月，任职九州证券股份有限公司固定收益资产管理部总经理；2019年1月至2021年2月，任职江信基金管理有限公司金融市场总部总经理；2021年3月至2021年4月，在东兴证券股份有限公司基金业务部工作；2021年4月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部基金经理；2021年5月至2023年12月，任职东兴基金管理有限公司固定收益部负责人、基金经理；2023年12月至今，任职东兴基金管理有限公司固定收益部总经理、基金经理。现任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、东兴连裕6个月滚动持有债券型证券投资基金基金经理、东兴连众一年持有期混合型证券投资基金基金经理、东兴鑫颐3个月滚动持有纯债债券型证券投资基金基金经理。
王卉妍女士	本基金基金经理	2025-04-07	-	11年	毕业于厦门大学国际法学专业，硕士研究生学历。2013年7月至2013年10月，任职平安银行股份有限公司；2013年12月至2014年7月，任职扬州市现代金融投资集团有限责任公司；2014年9月至2017年5月，任职中诚信国际信用评级有限责任公司结构融资部分析师/项目经理；2017年6月至2024年4月，历任国寿安保基金管理有限公司研究部研究员、投资管理二部研究员、投资经理助理；2024年4月至2025年1月，任职国通信托有限责任公司资产管理部投资经理；2025年2月至2025年3月，任职东兴基金管理有限公司混合资产投资部；2025年3月至今，任职东兴基金管理有限公司混合资产投资部基金经理。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金基金经理、东兴中债1-3年政策性金融债指数证券投资基金基金经理。
孙继青先生	本基金基金经理	2025-04-07	-	18年	毕业于北京科技大学钢铁冶金专业，硕士研究生学历。2007年10月至2012年3月，任职东兴证券股份有限公司研究所钢铁行业研究员；2012年3月至2013年6

					<p>月，任职东兴证券股份有限公司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，任职东兴证券股份有限公司资产管理部投资经理；2014年9月至2021年5月，任职东兴证券股份有限公司基金业务部基金经理；2021年5月至2023年12月，任职东兴基金管理有限公司研究部负责人、基金经理；2023年12月至2024年6月，任职东兴基金管理有限公司研究部总经理、基金经理；2024年6月至2025年4月，任职东兴基金管理有限公司研究部总经理；2025年4月至今，任职东兴基金管理有限公司研究部总经理、基金经理。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。</p>
冯晨先生	本基金基金经理	2025-06-28	-	8年	<p>毕业于华中科技大学，北京理工大学硕士学位。曾任职于国家电网下属公司、渤海证券股份有限公司、渤海汇金证券资产管理有限公司、上银基金管理有限公司、富邦华一银行有限公司；2021年12月至2024年12月，任职川财证券有限责任公司固定收益部投资经理；2024年12月至2025年6月，任职东兴基金管理有限公司混合资产投资部；2025年6月至今，任职东兴基金管理有限公司混合资产投资部基金经理。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、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、东兴兴盈三个月定期开放债券型证券投资基金基金经理、东兴兴诚利率债债券型证券投资基金基金经理。</p>

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

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，协商不一致则由分管投资的公司领导决定；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。

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 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《证券投资基金管理人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。

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。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025年，宏观基本面呈现“前高后低”态势，全年经济增长目标顺利达成；出口在复杂贸易环境下展现出超预期韧性，投资与消费保持相对稳定，通胀水平亦逐步企稳。政策面上，货币政策维持适度宽松基调，全年累计实施一次降准与一次降息，银行间资金面整体由紧向松过渡。在此市场环境下，组合操作积极而审慎，逐步加大了同业存单的配置力度，并在利率相对高点适时增配了长期资产，同时依据各类资产间的比价关系，灵活调整同业存单、信用债及逆回购等主要品种的配置比例，整体执行了稳健而灵活的操作策略。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2025年1月1日起至2025年12月31日，本基金A类份额净值收益率为1.2571%，业绩比较基准收益率为0.3549%，高于业绩比较基准0.9022%；本基金B类份额净值收益率为1.5006%，业绩比较基准收益率为0.3549%，高于业绩比较基准1.1457%；2025年6月3日（本基金增设C类份额日）起至2025年12月31日，本基金C类份额净值收益率为0.8167%，业绩比较基准收益率为0.2061%，高于业绩比较基准0.6106%。

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2026年，宏观经济预计在政策支撑下持续复苏，企业盈利与居民收入体感有望逐步修复，物价水平保持温和回升。外部环境更趋严峻，“以我为主”的政策态势将更加明确。财政政策预计延续积极取向，债券供给放量，有力支撑“十五五”开局之年的

经济增长动能。货币政策预计更多依赖结构性工具维持流动性合理充裕，总量政策则以对冲为主要目标。具体到货币市场，预计同业存单利率将延续宽幅震荡格局，收益率上行阶段将凸显出更高的配置价值。组合将始终保持较高的流动性水平和操作灵活度，在同业存单、信用债、存款及回购等资产类别中择机择优进行布局，积极把握市场波动中的结构性机会。

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和职业道德培训，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2025年1月1日至2025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180,481,212.49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

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 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18,048.12万元。

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	毕马威华振审字第 2604670 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
审计意见	<p>我们审计了后附的东兴安盈宝货币市场基金(以下简称"该基金")财务报表,包括2025年12月31日的资产负债表,2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称"企业会计准则")及财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称"审计准则")的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号--财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人东兴基金管理有限公司(以下简称"该基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>

<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，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。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中</p>

	<p>的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	白龙、李鹏
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场东2座办公楼8层
审计报告日期	2026-03-30

§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：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	885,773.99	145,135,437.96
结算备付金		-	-
存出保证金		-	7,388.44
交易性金融资产	7.4.7.2	13,186,887,067.93	11,803,010,444.71
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		13,186,887,067.93	11,803,010,444.71
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	7.4.7.4	1,971,558,976.52	4,680,458,652.23
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		322,528,908.73	851,952,060.75
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		15,481,860,727.17	17,480,563,984.09
负债和净资产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负债：			
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		233,012,327.52	420,038,124.09
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,144,185.38	3,571,248.32
应付托管费		595,607.05	952,332.88
应付销售服务费		1,248,564.71	1,115,625.71
应付投资顾问费		-	-
应交税费		131,456.04	257,630.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	276,543.66	337,392.31
负债合计		237,408,684.36	426,272,353.62
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	15,244,452,042.81	17,054,291,630.47
未分配利润	7.4.7.8	-	-
净资产合计		15,244,452,042.81	17,054,291,630.47
负债和净资产总计		15,481,860,727.17	17,480,563,984.09

注：报告截止日2025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，C类基金份额净值1.0000元；基金份额总额15,244,452,042.81份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额5,082,851,762.81份，B类基金份额总额9,814,815,480.35份，C类基金份额总额346,784,799.65份。

7.2 利润表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至2 025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2 024年12月31日
一、营业总收入		237,067,511.26	325,225,593.50
1.利息收入		42,253,529.94	97,151,844.82
其中：存款利息收入	7.4.7.9	528,737.74	2,233,646.37
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		41,724,792.20	94,918,198.45
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填 列）		194,813,981.32	228,073,748.68
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	194,813,981.32	228,073,748.68
资产支持证券投资 收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-	-
减：二、营业总支出		56,586,298.77	70,364,163.88
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	29,712,661.68	43,559,545.33
2.托管费	7.4.10.2.2	8,080,905.89	11,615,878.85
3.销售服务费	7.4.10.2.3	13,687,601.37	12,013,236.43
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		4,788,026.08	2,610,180.28
其中：卖出回购金融资产支出		4,788,026.08	2,610,180.28
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		144,903.75	392,672.99
8.其他费用	7.4.7.19	172,200.00	172,650.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		180,481,212.49	254,861,429.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		180,481,212.49	254,861,429.62
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		180,481,212.49	254,861,429.62

7.3 净资产变动表

会计主体：东兴安盈宝货币市场基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025年12月31日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	17,054,291,630.47	-	17,054,291,630.47
二、本期期初净资产	17,054,291,630.47	-	17,054,291,630.47
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,809,839,587.66	-	-1,809,839,587.66
(一)、综合收益总额	-	180,481,212.49	180,481,212.49
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-1,809,839,587.66	-	-1,809,839,587.66
其中: 1.基金申购款	169,353,482,457.35	-	169,353,482,457.35
2.基金赎回款	-171,163,322,045.01	-	-171,163,322,045.01
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-180,481,212.49	-180,481,212.49
四、本期期末净资产	15,244,452,042.81	-	15,244,452,042.81
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	13,517,159,435.80	-	13,517,159,435.80
二、本期期初净资产	13,517,159,435.80	-	13,517,159,435.80
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	3,537,132,194.67	-	3,537,132,194.67
(一)、综合收益总额	-	254,861,429.62	254,861,429.62
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,537,132,194.67	-	3,537,132,194.67
其中: 1.基金申购款	154,416,565,390.35	-	154,416,565,390.35
2.基金赎回款	-150,879,433,195.68	-	-150,879,433,195.68
(三)、本期向基金份	-	-254,861,429.62	-254,861,429.62

额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	17,054,291,630.47	-	17,054,291,630.47

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：

王洪亮

黄言

王广辉

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基金管理有限公司（本基金原基金管理人为东兴证券股份有限公司，自2021年5月24日起变更为东兴基金管理有限公司），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

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注7.4.2中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2025年12月31日的财务状况、2025年度的经营成果和净资产变动情况。

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2025年1月1日至2025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

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产,分类为以摊余成本计量的金融资产:

-本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标;

-该金融资产的合同条款规定,在特定日期产生的现金流量,仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外,本基金将其余所有的金融资产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。

2、金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

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

1、金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

2、金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

3、金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

4、金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

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。

计算影子价格时遵循如下原则：

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

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

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认利息收入。

债券投资利息收入按债券投资的账面价值与实际利率计算的金额确认，在债券实际持有期内逐日计提。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按实际利率法逐日计算利息收入。

债券投资收益和资产支持证券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

7.4.4.9 费用的确认和计量

管理人报酬、托管费和销售服务费(若有)在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

1、“每日分配、按日支付”。本基金收益根据每日基金收益公告，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，每日支付收益。基金

份额持有人当日收益的精度为0.01元，小数点后第3位采用去尾的方式，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止。

2、本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日净收益大于零时，为基金份额持有人记正收益；若当日净收益小于零时，为基金份额持有人记负收益；若当日净收益等于零时，基金份额持有人不记收益。

3、本基金每日收益计算并分配时，以人民币元方式簿记，每日收益只采用红利再投资（即红利转基金份额）方式，基金份额持有人可通过赎回基金份额获得现金收益；若基金份额持有人在每日收益支付时，其当日净收益为正值，则为基金份额持有人增加相应的基金份额，其当日净收益为负值，则将缩减基金份额持有人基金份额。若基金份额持有人赎回基金份额时，其对应收益将立即结清，若收益为负值，则从基金份额持有人赎回基金款中扣除。

4、每份基金份额享有同等分配权。

5、当日申购的基金份额自下一个工作日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起不享有基金的分配权益。

6、在不影响基金份额持有人利益的前提下，基金管理人可酌情调整本基金收益分配方式，此项调整并不需要基金份额持有人大会决议通过。

7、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

7.4.4.11 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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

本基金在本报告期无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

1、资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

2、对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

3、对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

4、对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	885,773.99	145,135,437.96
等于：本金	885,561.95	145,123,642.21
加：应计利息	212.04	11,795.75
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	885,773.99	145,135,437.96

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日				
	按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	13,186,887,067.93	13,191,196,472.59	4,309,404.66	0.0283
	合计	13,186,887,067.93	13,191,196,472.59	4,309,404.66	0.0283
资产支持证券	-	-	-	-	

合计	13,186,887,067.93	13,191,196,472.59	4,309,404.66	0.0283	
项目	上年度末 2024年12月31日				
	按实际利率计算的 账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度(%)	
债券	交易所市场	-	-	-	
	银行间市场	11,803,010,444.71	11,815,513,722.80	12,503,278.09	0.0733
	合计	11,803,010,444.71	11,815,513,722.80	12,503,278.09	0.0733
资产支持证券	-	-	-	-	
合计	11,803,010,444.71	11,815,513,722.80	12,503,278.09	0.0733	

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

本报告期末及上年度末，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 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	1,971,558,976.52	-
合计	1,971,558,976.52	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	4,680,458,652.23	-
合计	4,680,458,652.23	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本报告期末及上年度末，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 其他资产

本报告期末及上年度末，本基金未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	132,543.66	193,392.31
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	132,543.66	193,392.31
应付利息	-	-
预提费用	144,000.00	144,000.00
合计	276,543.66	337,392.31

注：预提费用为按日计提的审计费、信息披露费和账户维护费。

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 东兴安盈宝A

金额单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝A)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,392,834,921.27	4,392,834,921.27
本期申购	124,262,572,169.18	124,262,572,169.18
本期赎回（以“-”号填列）	-123,572,555,327.64	-123,572,555,327.64
本期末	5,082,851,762.81	5,082,851,762.81

7.4.7.7.2 东兴安盈宝B

金额单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝B)	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	12,661,456,709.20	12,661,456,709.20
本期申购	44,641,147,156.13	44,641,147,156.13
本期赎回（以“-”号填列）	-47,487,788,384.98	-47,487,788,384.98
本期末	9,814,815,480.35	9,814,815,480.35

7.4.7.7.3 东兴安盈宝C

金额单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝C)	本期 2025年06月03日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	449,763,132.04	449,763,132.04
本期赎回（以“-”号填列）	-102,978,332.39	-102,978,332.39
本期末	346,784,799.65	346,784,799.65

注：本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额，截至报告期末不满一年。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 东兴安盈宝A

单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	64,123,743.09	-	64,123,743.09
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	-64,123,743.09	-	-64,123,743.09
本期末	-	-	-

7.4.7.8.2 东兴安盈宝B

单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	115,963,244.76	-	115,963,244.76
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	-115,963,244.76	-	-115,963,244.76
本期末	-	-	-

7.4.7.8.3 东兴安盈宝C

单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	394,224.64	-	394,224.64
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	-394,224.64	-	-394,224.64
本期末	-	-	-

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年 12月31日
活期存款利息收入	148,326.83	2,232,619.68
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	-	1,007.77
其他	380,410.91	18.92
合计	528,737.74	2,233,646.37

注：其他为应收申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.10 股票投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股票投资收益。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
债券投资收益——利息收入	185,332,389.23	211,847,749.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,481,592.09	16,225,998.99
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	194,813,981.32	228,073,748.68

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	48,858,412,927.93	43,103,995,249.45
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	48,740,288,012.16	42,818,173,196.38
减：应计利息总额	108,643,323.68	269,596,054.08
减：交易费用	-	-
买卖债券差价收入	9,481,592.09	16,225,998.99

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无资产支持证券收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本报告期及上年度可比期间，本基金无公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他收入。

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年

	12月31日	12月31日
审计费用	15,000.00	15,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他	1,200.00	1,650.00
合计	172,200.00	172,650.00

注：其他主要为银行间账户查询费。

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

本基金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。

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	基金管理人的实际控制人
东兴证券股份有限公司	基金管理人的控股股东、基金销售机构
东兴基金管理有限公司	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	与基金管理人同一控股股东的关联方
东兴证券投资有限公司	与基金管理人同一控股股东的关联方
大连银行股份有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方、基金销售机构
大业信托有限责任公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方
东方金诚国际信用评估有限公司	与基金管理人同一实际控制人的关联方

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本报告期及上年度可比期间，本基金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

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12 月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
东兴证券股份有限公司	-	-	260,443,145.07	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

本报告期及上年度可比期间，本基金未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本报告期及上年度可比期间，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 2025年01月01日至20 25年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	29,712,661.68	43,559,545.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,320,163.32	10,256,686.17
应支付基金管理人的净管理费	21,392,498.36	33,302,859.16

注：本基金的管理费2025年6月3日前按前一日基金资产净值的0.30%年费率计提，自2025年6月3日（含）起按前一日基金资产净值的0.18%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

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

R为管理费年费率

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025 年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,080,905.89	11,615,878.85

注：本基金的托管费2025年6月3日前按前一日基金资产净值的0.08%的年费率计提，自2025年6月3日（含）起按前一日基金资产净值的0.05%年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times R \div \text{当年天数}$$

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

R为托管费年费率

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。

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 2025年01月01日至2025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	东兴安盈宝C	合计
东兴基金管理有限公司	6,833.34	407,290.00	1,220.96	415,344.30
东兴证券股份有限公司	12,499,521.75	388.41	0.00	12,499,910.16
中国邮政储蓄银行股份有限公司	48,868.26	64,629.67	1,416.52	114,914.45
大连银行股份有限公司	6,112.95	0.00	0.00	6,112.95
合计	12,561,336.30	472,308.08	2,637.48	13,036,281.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2024年01月01日至2024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	东兴安盈宝C	合计
东兴基金管理有限公司	12,789.23	546,687.77	0.00	559,477.00
东兴证券股份有限公司	10,530,699.15	7,037.50	0.00	10,537,736.65
中国邮政储蓄银行股份有限公司	53,474.81	76,857.66	0.00	130,332.47
大连银行股份有限公司	7,142.66	0.00	0.00	7,142.66
合计	10,604,105.85	630,582.93	0.00	11,234,688.78

注：本基金A类基金份额的年销售服务费率为0.25%，B类基金份额的年销售服务费率为0.01%，本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额，C类基金份额的年销售服务费率为0.01%。三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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间，未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间，未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 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 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	62,630,126.19	66,519,077.39
报告期间申购/买入总份额	25,683,596.84	95,111,048.80
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	58,000,000.00	99,000,000.00
报告期末持有的基金份额	30,313,723.03	62,630,126.19
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.31%	0.49%

东兴安盈宝C

份额单位：份

项目	本期 2025年01月01日至 2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至 2024年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	20,162,576.35	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	20,162,576.35	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.81%	-

- 注：1、申购含红利再投增加的份额；
2、本基金自2025年6月3日起增设C类基金份额。

7.4.10.5.2 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

东兴安盈宝B

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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
东兴证券股份有限公司	300,000,000.00	3.06%	400,086,215.60	3.16%
大业信托有限责任公司	21,027.50	-	20,716.59	-
东兴证券投资有限公司	105,527,428.93	1.08%	103,967,323.76	0.82%
东兴资本投资管理有限公司	143,488,612.70	1.46%	47,100,712.63	0.37%
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,343,551,450.56	23.88%	3,002,649,818.80	23.71%

7.4.10.6 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 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31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	885,773.99	148,326.83	145,135,437.96	2,232,619.68

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联交易事项的说明。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金

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
64,123,743.09	-	-	64,123,743.09	-

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
115,963,244.76	-	-	115,963,244.76	-

东兴安盈宝C

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
394,224.64	-	-	394,224.64	-

注：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，每日结转。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。

7.4.12 期末（2025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2025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233,012,327.52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
230214	23国开14	2026-01-05	100.26	1,400,000	140,363,075.69
250401	25农发01	2026-01-05	101.13	1,064,000	107,605,478.98
合计				2,464,000	247,968,554.67

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末未持有参与转融通证券出借业务的证券。

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。本基金设立了由风险控制与审计委员会、投资决策委员会、风险管理部门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；本基金持有一家公司发行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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,769,468,330.64	3,405,704,199.84
合计	1,769,468,330.64	3,405,704,199.84

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,658,828,805.34	7,437,508,535.56
合计	10,658,828,805.34	7,437,508,535.56

注：同业存单评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.4 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-

未评级	758,589,931.95	959,797,709.31
合计	758,589,931.95	959,797,709.31

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级债券为国债、政策性金融债、央票及无第三方机构评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末和上年度末未持有资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末和上年度末未持有按长期信用评级的同业存单。

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在基金开放期内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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人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，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持证券除附注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，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。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投资的公允价值。

于2025年12月31日，除卖出回购金融资产款余额233,012,327.52元将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

单位：人民币元

本期末 2025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	合计
资产	-	-	-	-	-	
货币资金	885,773.99	-	-	-	-	885,773.99
交易性金融资产	2,824,756,959.89	4,782,441,296.51	5,579,688,811.53	-	-	13,186,887,067.93
买入返售金融资产	1,971,558,976.52	-	-	-	-	1,971,558,976.52
应收申购款	322,528,908.73	-	-	-	-	322,528,908.73
资产总计	5,119,730,619.13	4,782,441,296.51	5,579,688,811.53	-	-	15,481,860,727.17
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	233,012,327.52	-	-	-	-	233,012,327.52
应付管理人报酬	2,144,185.38	-	-	-	-	2,144,185.38
应付托管费	595,607.05	-	-	-	-	595,607.05
应付销售服务费	1,248,564.71	-	-	-	-	1,248,564.71
应交税费	131,456.04	-	-	-	-	131,456.04
其他负债	276,543.66	-	-	-	-	276,543.66
负债总计	237,408,684.36	-	-	-	-	237,408,684.36
流动性净额	4,882,321,934.77	4,782,441,296.51	5,579,688,811.53	-	-	15,244,452,042.81
上年度末 2024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	合计
资产	-	-	-	-	-	
货币资金	145,135,437.96	-	-	-	-	145,135,437.96
存出保证金	7,388.44	-	-	-	-	7,388.44
交易性金融资产	1,090,156,912.57	6,384,614,626.55	4,328,238,905.59	-	-	11,803,010,444.71
买入返售金融资产	4,680,458,652.23	-	-	-	-	4,680,458,652.23
应收申购款	851,952,060.75	-	-	-	-	851,952,060.75
资产总计	6,767,710,451.95	6,384,614,626.55	4,328,238,905.59	-	-	17,480,563,984.09
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	420,038,124.09	-	-	-	-	420,038,124.09
应付管理人报酬	3,571,248.32	-	-	-	-	3,571,248.32
应付托管费	952,332.88	-	-	-	-	952,332.88
应付销售服务费	1,115,625.71	-	-	-	-	1,115,625.71
应交税费	257,630.31	-	-	-	-	257,630.31

其他负债	337,392.31	-	-	-	-	337,392.31
负债总计	426,272,353.62	-	-	-	-	426,272,353.62
流动性净额	6,341,438,098.33	6,384,614,626.55	4,328,238,905.59	-	-	17,054,291,630.47

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。

7.4.13.3.2 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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

2025年12月31日							
资产							
货币资金	885,561.95	-	-	-	-	212.04	885,773.99
交易性金融资产	2,818,401,936.88	4,773,962,072.96	5,571,590,085.50	-	-	22,932,972.59	13,186,887,067.93
买入返售金融资产	1,970,910,516.36	-	-	-	-	648,460.16	1,971,558,976.52
应收申购款	-	-	-	-	-	322,528,908.73	322,528,908.73
资产总计	4,790,198,015.19	4,773,962,072.96	5,571,590,085.50	-	-	346,110,553.52	15,481,860,727.17
负债							
卖出回购金融资产款	232,999,450.50	-	-	-	-	12,877.02	233,012,327.52
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,144,185.38	2,144,185.38
应付托管费	-	-	-	-	-	595,607.05	595,607.05
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,248,564.71	1,248,564.71
应交税费	-	-	-	-	-	131,456.04	131,456.04
其他负债	-	-	-	-	-	276,543.66	276,543.66
负债总计	232,999,450.50	-	-	-	-	4,409,233.86	237,408,684.36
利率敏感度缺口	4,557,198,564.69	4,773,962,072.96	5,571,590,085.50	-	-	341,701,319.66	15,244,452,042.81
上年度末 2024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							
货币资金	145,123,642.21	-	-	-	-	11,795.75	145,135,437.96
存出保证金	7,384.81	-	-	-	-	3.63	7,388.44
交易性金融资产	1,089,199,498.87	6,370,286,331.57	4,309,553,191.47	-	-	33,971,422.80	11,803,010,444.71
买入返售金融资产	4,678,086,537.11	-	-	-	-	2,372,115.12	4,680,458,652.23
应收申购款	-	-	-	-	-	851,952,060.75	851,952,060.75
资产总计	5,912,417,063.00	6,370,286,331.57	4,309,553,191.47	-	-	888,307,398.05	17,480,563,984.09
负债							
卖出回购金融资产款	419,999,150.00	-	-	-	-	38,974.09	420,038,124.09
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,571,248.32	3,571,248.32
应付托管费	-	-	-	-	-	952,332.88	952,332.88
应付销售服务	-	-	-	-	-	1,115,625.71	1,115,625.71

费							
应交税费	-	-	-	-	-	257,630.31	257,630.31
其他负债	-	-	-	-	-	337,392.31	337,392.31
负债总计	419,999,150.00	-	-	-	-	6,273,203.62	426,272,353.62
利率敏感度缺口	5,492,417,913.00	6,370,286,331.57	4,309,553,191.47	-	-	882,034,194.43	17,054,291,630.47

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

本报告期末，在“影子定价”机制有效的前提下，若其他市场变量保持不变，市场利率上升或下降25个基点，对本基金基金资产净值无重大影响。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)	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	13,186,887,067.93	86.50	11,803,010,444.71	69.21
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	13,186,887,067.93	86.50	11,803,010,444.71	69.21
----	-------------------	-------	-------------------	-------

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2025年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资(2024年12月31日：同)，因此其他价格风险对于本基金资产净值无重大影响(2024年12月31日：同)。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	13,186,887,067.93	11,803,010,444.71
第三层次	-	-
合计	13,186,887,067.93	11,803,010,444.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内不存在持有的金融工具公允价值所属层次间发生重大变动的情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期内不存在持有非持续以公允价值计量的金融工具的情况。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括货币资金、应收申购款、买入返售金融资产款、卖出回购金融资产款和其他应付款项，其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	13,186,887,067.93	85.18
	其中：债券	13,186,887,067.93	85.18
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,971,558,976.52	12.73
	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	885,773.99	0.01
4	其他各项资产	322,528,908.73	2.08
5	合计	15,481,860,727.17	100.00

8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	2.24	
	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	233,012,327.52	1.53
	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	76
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	96
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	45

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。

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	32.27	1.56
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	12.82	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	0.98	-
3	60天(含)—90天	19.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	13.09	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	23.51	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	101.56	1.56

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。

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	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	1,029,701,887.26	6.75
	其中：政策性金融债	1,029,701,887.26	6.75
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	1,406,229,481.94	9.22
6	中期票据	92,126,893.39	0.60
7	同业存单	10,658,828,805.34	69.92
8	其他	-	-
9	合计	13,186,887,067.93	86.50
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	149,733,826.42	0.98

8.6 期末按实际利率计算账面价值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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112521360	25渤海银行CD360	2,300,000	229,858,092.13	1.51
2	112583326	25广东南海农商行CD082	2,000,000	199,893,804.63	1.31
3	112583399	25富邦华一银行CD066	2,000,000	199,873,717.22	1.31
4	112586884	25青岛银行CD085	2,000,000	199,837,487.80	1.31
5	112580328	25徽商银行CD143	2,000,000	199,749,771.47	1.31
6	112585001	25湖南银行CD116	2,000,000	199,632,829.25	1.31
7	112585008	25温州银行CD180	2,000,000	199,630,541.62	1.31
8	112503280	25农业银行CD280	2,000,000	199,502,254.89	1.31
9	112585845	25温州银行CD190	2,000,000	199,495,655.05	1.31
10	112503079	25农业银行CD079	2,000,000	199,408,125.45	1.31

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值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	0.0840%
报告期内偏离度的最低值	0.0024%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0305%

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。

8.8 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

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，本期未出现被监管部门立案调查的情形；渤海银行股份有限公司、广东南海农村商业银行股份有限公司、青岛银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司、湖南银行股份有限公司、温州银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	322,528,908.73

5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	322,528,908.73

§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	61,815	82,226.83	122,892,977.40	2.42%	4,959,958,785.41	97.58%
东兴安盈宝B	103	95,289,470.68	9,801,715,337.40	99.87%	13,100,142.95	0.13%
东兴安盈宝C	39,497	8,780.03	20,163,342.21	5.81%	326,621,457.44	94.19%
合计	101,415	150,317.53	9,944,771,657.01	65.24%	5,299,680,385.80	34.76%

9.2 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	银行类机构	2,343,551,450.56	15.37%
2	银行类机构	1,000,600,058.37	6.56%
3	银行类机构	506,036,234.26	3.32%
4	银行类机构	500,774,299.91	3.28%
5	银行类机构	500,169,087.53	3.28%
6	银行类机构	401,937,941.99	2.64%
7	银行类机构	400,787,743.61	2.63%
8	银行类机构	300,173,257.46	1.97%
9	银行类机构	300,077,550.70	1.97%
10	券商类机构	300,000,000.00	1.97%

9.3 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	11.48	-
	东兴安盈宝B	-	-
	东兴安盈宝C	-	-
	合计	11.48	-

9.4 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
	东兴安盈宝C	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
	东兴安盈宝C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B	东兴安盈宝C
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	4,392,834,921.27	12,661,456,709.20	-
本报告期基金总申购份额	124,262,572,169.18	44,641,147,156.13	449,763,132.04
减：本报告期基金总赎回份额	123,572,555,327.64	47,487,788,384.98	102,978,332.39
本报告期末基金份额总额	5,082,851,762.81	9,814,815,480.35	346,784,799.65

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

本基金本报告期内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

本基金管理人的重大人事变动如下：

黄言先生于2025年1月7日任公司财务负责人；

曲冬松先生于2025年11月27日任公司副总经理。

本基金托管人的专门基金托管部门本报告期无重大人事变动。

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，无涉及基金管理人、基金财产和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

本基金本报告期内未更换会计师事务所。本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用15,000.00元。截至2025年12月31日，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已提供审计服务连续不满二年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人高级管理人员、相关从业人员无受调查或处罚等情况。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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、合规风控能力和交易、研究等服务实力较强的证券公司参与证券交易。其中财务状况良好、经营行为规范指最近一年证券公司分类评级在C类或C类以上；合规风控能力是指证券公司近三年无重大违法违规行、无正在接受立案调查，或受到监管机构严重处罚，责令改正逾期未改，影响正常经营等情形；交易、研究实力较强以公司交易部门、投资部门、研究部及投研分管领导的评价意见为主要判断依据。

券商选择程序：公司根据以上标准对不同证券公司进行考察、选择和确定。在满足证券公司选择标准的前提下，公司应当与提供证券交易服务的证券公司签订委托协议，约定双方的权利义务，明确服务内容、收取交易佣金的价格标准与计算方式。证券公司的选择由研究部发起，由合规法律部对选择标准、选择程序是否符合法规及本制度规定进行初步合规审查后，报督察长进行合规性审查和总经理审批，公司与其建立合作关系并签署委托协议。

3、本基金本报告期内未新增交易单元。

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

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

11.8 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。

11.9 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	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2025-01-08

2	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-01-22
3	东兴安盈宝货币市场基金2024年第4季度报告	指定网站	2025-01-22
4	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-03-28
5	东兴基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况（2024年度）	指定报刊、指定网站	2025-03-28
6	东兴安盈宝货币市场基金2024年年度报告	指定网站	2025-03-28
7	东兴安盈宝货币市场基金基金经理变更公告	指定报刊、指定网站	2025-04-07
8	东兴安盈宝货币市场基金基金产品资料概要更新	指定网站	2025-04-10
9	东兴安盈宝货币市场基金招募说明书（更新）（2025年第1号）	指定网站	2025-04-10
10	东兴安盈宝货币市场基金2025年第1季度报告	指定网站	2025-04-22
11	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-04-22
12	东兴基金管理有限公司关于旗下公募基金产品风险等级更新的公告	指定报刊、指定网站	2025-05-10
13	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-05-21
14	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-05-28
15	关于东兴安盈宝货币市场基金增设C类基金份额、调降费率并修改基金合同、托管协议的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-03
16	东兴安盈宝货币市场基金基金产品资料概要更新	指定网站	2025-06-03
17	东兴安盈宝货币市场基金基金合同	指定网站	2025-06-03
18	东兴安盈宝货币市场基金托管协议	指定网站	2025-06-03
19	东兴安盈宝货币市场基金招募说明书（更新）（2025年第2号）	指定网站	2025-06-03
20	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-04
21	东兴基金管理有限公司关于实际控制人变更获得中国证监会核准的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-07
22	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-11
23	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-18
24	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者	指定报刊、	2025-06-25

	者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定网站	
25	东兴基金管理有限公司关于提请投资者及时更新已过期身份证件及完善身份基本信息的公告	指定报刊、指定网站	2025-06-26
26	东兴安盈宝货币市场基金基金经理变更公告	指定报刊、指定网站	2025-06-28
27	东兴安盈宝货币市场基金招募说明书（更新）（2025年第3号）	指定网站	2025-07-02
28	东兴安盈宝货币市场基金基金产品资料概要更新	指定网站	2025-07-02
29	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-07-02
30	东兴安盈宝货币市场基金B类基金份额调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-07-09
31	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-07-16
32	东兴安盈宝货币市场基金2025年第2季度报告	指定网站	2025-07-21
33	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第二季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-07-21
34	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-07-23
35	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-07-30
36	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-08-06
37	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-08-13
38	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-08-20
39	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-08-21
40	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-08-27
41	东兴安盈宝货币市场基金2025年中期报告	指定网站	2025-08-29
42	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年中期报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-08-29
43	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-08-29
44	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-09-03

45	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的机构投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-09-10
46	东兴安盈宝货币市场基金调整代销机构的非个人投资者大额申购（含定期定额投资及转换转入）业务的公告	指定报刊、指定网站	2025-09-12
47	东兴安盈宝货币市场基金2025年第3季度报告	指定网站	2025-10-28
48	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2025年第三季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-10-28
49	东兴基金管理有限公司关于董事变更情况的公告	指定报刊、指定网站	2025-11-18
50	东兴基金管理有限公司关于旗下公募基金产品风险等级更新的公告	指定报刊、指定网站	2025-11-25
51	东兴基金管理有限公司高级管理人员变更公告	指定报刊、指定网站	2025-11-28
52	东兴基金管理有限公司关于旗下部分基金持有的停牌股票估值调整的提示性公告	指定报刊、指定网站	2025-12-25

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	2025年1月10日至2025年4月6日，2025年4月15日至2025年7月31日，2025年8月6日至2025年8月7日，2025年8月21日至2025年8月21日	3,002,649,818.80	640,901,631.76	1,300,000,000.00	2,343,551,450.56	15.37%
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。							

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 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、中国证监会颁发的经营证券期货业务许可证、营业执照、公司章程

13.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

13.3 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.dxamc.cn）查阅。

东兴基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日