

# 东兴安盈宝货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 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:2024 年 08 月 30 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。本中期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2024年8月23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。

本报告期自2024年1月1日起至2024年6月30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 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 债券回购融资情况	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限	47
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	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	48
7.6 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	48
7.7 “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	49
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	49
7.9 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51

§10 重大事件揭示 .....	52
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	52
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	53
10.9 其他重大事件 .....	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
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 .....	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
§12 备查文件目录 .....	54
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	55

## §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	13,418,329,743.63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	4,062,273,427.48份	9,356,056,316.15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	姓名	李宛霖	张立学

露负责人	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	010-68858120
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		牛南洁	刘建军

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.dxamc.cn">http://www.dxamc.cn</a>
基金中期报告备置地点	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
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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	东兴安盈宝A	东兴安盈宝B
本期已实现收益	36,514,657.63	113,556,183.14
本期利润	36,514,657.63	113,556,183.14
本期净值收益率	0.8638%	0.9841%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末	

	(2024年06月30日)	
期末基金资产净值	4,062,273,427.48	9,356,056,316.15
期末基金份额净值	1.0000	1.0000
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2024年06月30日)	
累计净值收益率	22.0049%	24.3870%

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。

### 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

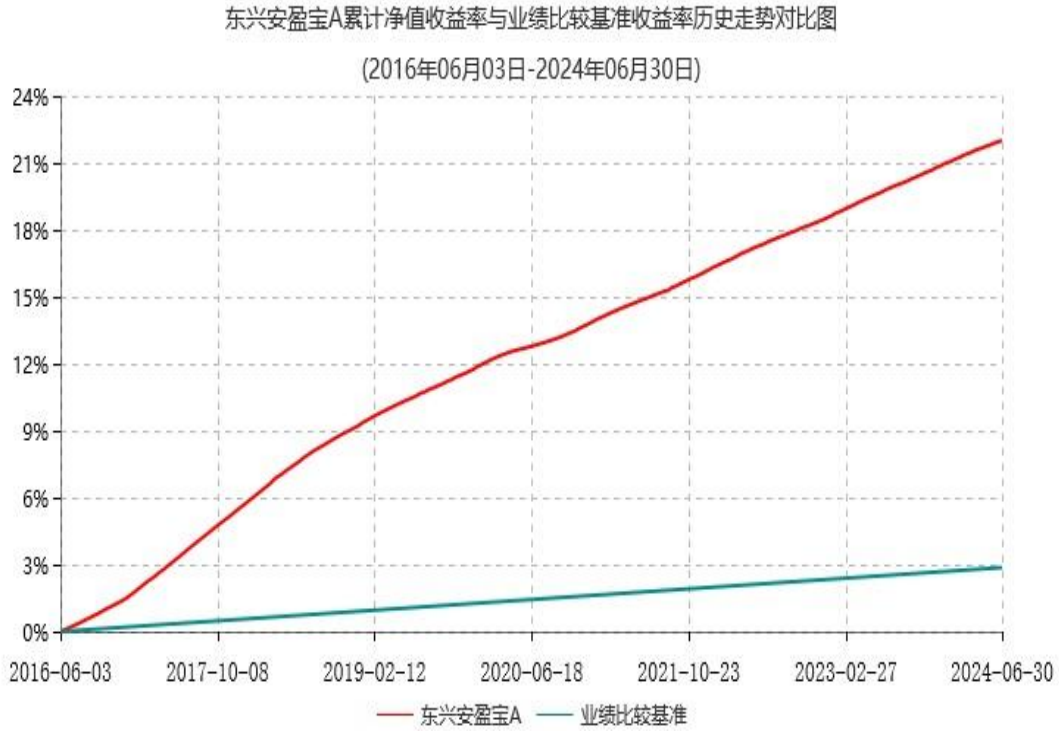
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1205%	0.0016%	0.0292%	0.0000%	0.0913%	0.0016%
过去三个月	0.4010%	0.0025%	0.0885%	0.0000%	0.3125%	0.0025%
过去六个月	0.8638%	0.0022%	0.1769%	0.0000%	0.6869%	0.0022%
过去一年	1.8451%	0.0021%	0.3558%	0.0000%	1.4893%	0.0021%
过去三年	6.0531%	0.0022%	1.0656%	0.0000%	4.9875%	0.0022%
自基金合同生效起至今	22.0049%	0.0028%	2.8681%	0.0000%	19.1368%	0.0028%

##### 东兴安盈宝B

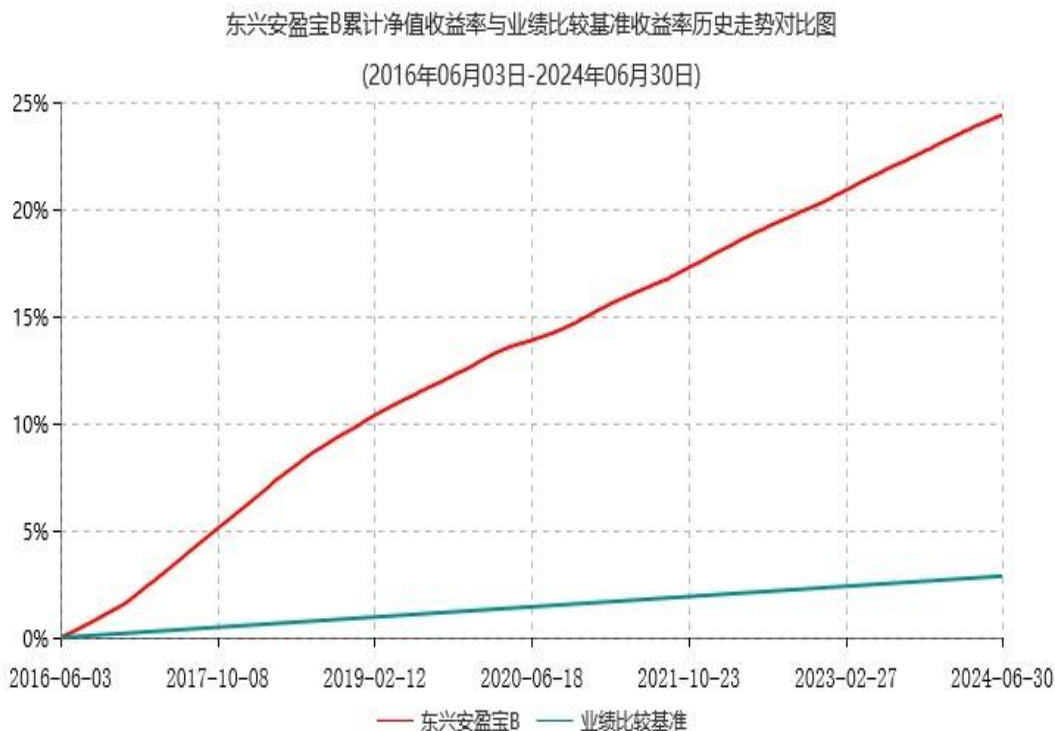
阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.1403%	0.0016%	0.0292%	0.0000%	0.1111%	0.0016%
过去三个月	0.4609%	0.0025%	0.0885%	0.0000%	0.3724%	0.0025%
过去六个月	0.9841%	0.0022%	0.1769%	0.0000%	0.8072%	0.0022%
过去一年	2.0903%	0.0021%	0.3558%	0.0000%	1.7345%	0.0021%

过去三年	6.8196%	0.0022%	1.0656%	0.0000%	5.7540%	0.0022%
自基金合同生效起至今	24.3870%	0.0028%	2.8681%	0.0000%	21.5189%	0.0028%

### 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







- 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”），实际控制人为中国财政部。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。公司大部分员工来自于基金、券商、投资、信评等各类金融机构，90%以上员工具有硕士及以上学历。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2024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共19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	-	14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。
--	--	--	--	----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

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遵规守信情况的说明

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，未直接或通过与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

上半年，我们适量增配了部分债券资产提升了组合资产的静态收益并保持较高的流动性水平。

下半年，在利差持续收窄的行情下，我们将继续提高组合流动性水平，保持高灵活性以应对市场变化。

东兴基金作为本基金管理人，在兼顾流动性充裕、信用风险可控的前提下，努力提升基金综合收益率。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

2024年1月1日起至2024年6月30日，本基金A类份额净值收益率为0.8638%，业绩比较基准收益率为0.1769%，高于业绩比较基准收益率0.6869%；本基金B类份额净值收益率为0.9841%，业绩比较基准收益率为0.1769%，高于业绩比较基准收益率0.8072%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024上半年，在基本面和政策面改善情况一定程度被证实以及资产荒的大背景下，利率走势受到债券供给进度偏慢和防风险政策下资金平稳宽松以及美联储预期不断修正的影响，整体呈现出震荡下行态势。

上半年月度经济数据表现较为平淡。虽然通胀、出口等数据呈现出向好趋势，但一定程度上受益于低基数及海外因素的支撑，其他指标例如金融数据持续偏弱，靠政府债券支撑的社融数据参考意义降低，货币和存贷款相关数据也显示居民和企业部门对未来投资回报预期仍需提振。另外，二季度市场侧重点或在于监管风险，上半年利率市场曾出现几波显著回调，但随后因资产荒背景下配置需求强烈、宏观及高频数据维持弱势、供给压力预期减弱叠加外部货币政策预期不断修正以及地缘政治风险等因素导致利率再度逐步震荡下行。

展望后续债市，潜在的风险或在于三季度债券供给、央行二级市场操作行为以及增量政策。债券供给方面，由于上半年发行节奏偏慢，三季度债券发行节奏提速可能性较大，资金面或面临一定压力；央行二级市场操作方面，目前长期利率点位较低，市场对后续央行卖券操作存在担忧，不过从市场资产供需来分析实际影响效果仍待观察，另一方面，结合宏观政策一致性取向货币政策延续前期基调，由于卖券会导致流动性回笼，央行或会谨慎操作预防流动性过度收紧。当前仍处于资产荒以及潜在经济增速下行、总需求偏弱等长期因素的大背景下，基本面对债市仍形成一定的支撑。近期会议定调内需不足，外部环境变化但要坚决完成稳增长。上半年完成5%的目标，下半年仍面临一定压力，三季度增量政策落地可能性较大需关注其政策有效性。

#### 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2024年1月1日至2024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150,070,840.77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

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15,007.08万元。

#### 5.3 托管人对本中期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：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	2,454,419.56	8,496,078.10
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	10,122,220,541.26	8,933,232,664.43
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		10,122,220,541.26	8,933,232,664.43
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	3,226,015,435.06	4,841,478,392.32
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		634,023,334.37	548,087,994.81
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		13,984,713,730.25	14,331,295,129.66
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		560,103,561.64	800,129,087.67
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	7,223,991.34
应付管理人报酬		3,714,020.33	4,036,167.79
应付托管费		990,405.43	1,076,311.39

应付销售服务费		977,840.09	902,907.25
应付投资顾问费		-	-
应交税费		309,651.89	375,268.79
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	288,507.24	391,959.63
负债合计		566,383,986.62	814,135,693.86
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	13,418,329,743.63	13,517,159,435.80
未分配利润	6.4.7.8	-	-
净资产合计		13,418,329,743.63	13,517,159,435.80
负债和净资产总计		13,984,713,730.25	14,331,295,129.66

注：报告截止日2024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13,418,329,743.63份，下属分级基金的份额总额分别为：A类基金份额总额4,062,273,427.48份，B类基金份额总额9,356,056,316.15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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		187,173,014.27	211,698,324.55
1.利息收入		56,310,270.49	63,211,437.08
其中：存款利息收入	6.4.7.9	229,713.28	115,429.52
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		56,080,557.21	63,096,007.56
其他利息收入		-	-



2.投资收益（损失以“-”填列）		130,862,743.78	148,486,887.47
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	130,862,743.78	148,486,887.47
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		37,102,173.50	38,240,557.37
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	23,856,909.24	22,984,144.42
2.托管费	6.4.10.2.2	6,361,842.49	6,129,105.17
3.销售服务费	6.4.10.2.3	5,874,944.90	5,642,940.90
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		702,384.61	3,083,317.20
其中：卖出回购金融资产 支出		702,384.61	3,083,317.20
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		218,372.30	313,347.70
8.其他费用	6.4.7.19	87,719.96	87,701.98
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		150,070,840.77	173,457,767.18
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		150,070,840.77	173,457,767.18
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		150,070,840.77	173,457,767.18

### 6.3 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：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30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）	-98,829,692.17	-	-98,829,692.17
（一）、综合收益总额	-	150,070,840.77	150,070,840.77
（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）	-98,829,692.17	-	-98,829,692.17
其中：1.基金申购款	74,787,343,568.50	-	74,787,343,568.50
2.基金赎回款	-74,886,173,260.67	-	-74,886,173,260.67
（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）	-	-150,070,840.77	-150,070,840.77
四、本期期末净资产	13,418,329,743.63	-	13,418,329,743.63
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计

一、上期期末净资产	11,499,690,856.54	-	11,499,690,856.54
二、本期期初净资产	11,499,690,856.54	-	11,499,690,856.54
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,267,967,466.71	-	1,267,967,466.71
(一)、综合收益总额	-	173,457,767.18	173,457,767.18
(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)	1,267,967,466.71	-	1,267,967,466.71
其中: 1.基金申购款	57,830,687,743.22	-	57,830,687,743.22
2.基金赎回款	-56,562,720,276.51	-	-56,562,720,276.51
(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)	-	-173,457,767.18	-173,457,767.18
四、本期期末净资产	12,767,658,323.25	-	12,767,658,323.25

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:

牛南洁

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

## 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。

#### 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”）、中国证券投资基金业协会制定的《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》、《公开募集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-年度报告和中期报告》、《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2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024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、会计估计与上年度会计报告相一致。

##### 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2024年1月1日至2024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、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。在通常情况下，本基金所持有的金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产。

基金持有的股票投资、债券投资、基金投资、资产支持证券投资等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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

基金持有的以摊余成本计量的、按照返售协议约定先买入再按固定价格返售的票据、证券等金融资产所融出的资金分类为买入返售金融资产。

基金采用买入并持有至到期策略的金融资产，即到期日固定、回收金额固定或可确定，且有明确意图和能力持有至到期的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产，在债权投资中核算。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### 2、金融负债的分类

金融负债分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以及以摊余成本计量的金融负债两类。基金持有的未划分为以摊余成本计量的金融负债通常以公允价值计量且其变动计入当期损益，列示为交易性金融负债。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。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金管理人在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，应符合《企业会计准则》、监管部门有关规定。

1、对存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的投资品种，在估值日有报价的，除会计准则规定的例外情况外，应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，应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，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

2、对不存在活跃市场的投资品种，应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，应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。

3、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，使潜在估值调整对前一估值日的基金资产净值的影响在0.25%以上的，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 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）利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

分类为以摊余成本计量的金融资产利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产利息收入。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认债券利息收入；买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提，若合同利率与实际利率差异较小，则采用合同利率计算确定利息收入。

##### （2）投资收益

股票投资收益为卖出股票交易日的成交总额扣除应结转的股票投资成本和对应投资品种产生的交易费用的差额确认。

债券、资产支持证券、同业存单等固定收益类金融资产的投资收益分为：

① 持有期间的利息收入：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利息收入在持有期内，按金融资产的票面价值和票面利率计算的利息扣除适用情况下由金融资产发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额，逐日确认金融资产投资收益。其中：贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限推算内含票面利率后，逐日确认投资收益；

② 交易日按卖出金融资产交易日的成交总额扣除应结转的投资成本与应计利息(若有)和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认投资收益。

衍生工具投资收益为交易日的成交总额扣除应结转的衍生工具投资成本和对应投资品种产生的交易费用后的差额确认。

股利收入于除息日按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

##### （3）公允价值变动损益

公允价值变动损益系本基金持有的采用公允价值模式计量的交易性金融资产、交易性金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失，并于相关金融资产或金融负债卖出或到期时转出计入投资收益。

#### (4) 其他收入

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时确认。

### 6.4.4.9 费用的确认和计量

(1) 根据基金合同，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；

(2) 根据基金合同，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；

(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. 本基金在2020年3月12日前政策为：“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；自2020年3月12日起变更为：“每日分配、按日支付”。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；



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.本基金在2020年3月12日前政策为：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；自2020年3月12日起变更为：本基金每日进行收益计算并分配时，每日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；若投资人在每日累计收益支付时，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 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。

#### **6.4.4.12 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**

本基金在本报告期间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**

本基金在本报告期间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【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【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【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、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税【2023】39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，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；自2023年8月28日起证券交易印花税实施减半征收。

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 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	2,454,419.56
等于：本金	2,454,008.69
加：应计利息	410.87
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	2,454,419.56

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	10,122,220,541.26	10,139,242,666.81	17,022,125.55	0.1269
	合计	10,122,220,541.26	10,139,242,666.81	17,022,125.55	0.1269
资产支持证券		-	-	-	-
合计		10,122,220,541.26	10,139,242,666.81	17,022,125.55	0.1269

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 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 2024年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	3,226,015,435.06	-
合计	3,226,015,435.06	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有通过买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	210,387.28
其中：交易所市场	-
银行间市场	210,387.28
应付利息	-
预提费用	78,119.96
合计	288,507.24

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。

#### 6.4.7.7 实收基金

##### 6.4.7.7.1 东兴安盈宝A

金额单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,979,526,783.40	2,979,526,783.40
本期申购	35,632,231,318.91	35,632,231,318.91
本期赎回（以“-”号填列）	-34,549,484,674.83	-34,549,484,674.83
本期末	4,062,273,427.48	4,062,273,427.48

##### 6.4.7.7.2 东兴安盈宝B

金额单位：人民币元

项目 (东兴安盈宝B)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,537,632,652.40	10,537,632,652.40
本期申购	39,155,112,249.59	39,155,112,249.59
本期赎回（以“-”号填列）	-40,336,688,585.84	-40,336,688,585.84
本期末	9,356,056,316.15	9,356,056,316.15

**6.4.7.8 未分配利润****6.4.7.8.1 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	36,514,657.63	-	36,514,657.63
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	-36,514,657.63	-	-36,514,657.63
本期末	-	-	-

**6.4.7.8.2 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	113,556,183.14	-	113,556,183.14
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	-113,556,183.14	-	-113,556,183.14
本期末	-	-	-

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	229,713.28
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	-
其他	-
合计	229,713.28

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本报告期间无股票投资收益。

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	124,704,692.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,158,051.21
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	130,862,743.78

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	24,279,571,473.61
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,115,176,904.29
减：应计利息总额	158,236,518.11
减：交易费用	-

买卖债券差价收入	6,158,051.21
----------	--------------

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

本基金本报告期无股利收益。

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

本基金本报告期无公允价值变动收益。

**6.4.7.17 其他收入**

本基金本报告期无其他收入。

**6.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	9,447.62
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
账户维护费	18,000.00
其他	600.00
合计	87,719.96

注：其他为银行间账户查询费。



## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

本基金本报告期末不存在需要说明的或有事项。

### 6.4.8.2 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。

## 6.4.9 关联方关系

### 6.4.9.1 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。

### 6.4.9.2 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

### 6.4.10 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。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 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。

##### 6.4.10.1.2 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。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	-	-	109,602,715.07	100.00%

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.1.5 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。

**6.4.10.2 关联方报酬****6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	23,856,909.24	22,984,144.42
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,180,002.33	4,437,311.81
应支付基金管理人的净管理费	18,676,906.91	18,546,832.61

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。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	6,361,842.49	6,129,105.17

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。

## 6.4.10.2.3 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 2024年01月01日至2024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	5,022,975.16	2,722.89	5,025,698.05
东兴基金管理有限公司	6,678.79	326,344.62	333,023.41
中国邮政储蓄银行股份有限公司	28,220.52	13,940.92	42,161.44
大连银行股份有限公司	4,018.15	0.00	4,018.15
合计	5,061,892.62	343,008.43	5,404,901.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	4,798,309.13	16,958.60	4,815,267.73
东兴基金管理有限公司	7,353.83	390,233.20	397,587.03
中国邮政储蓄银行股份有限公司	45,560.95	43.26	45,604.21

大连银行股份有限公司	3,507.13	0.00	3,507.13
合计	4,854,731.04	407,235.06	5,261,966.10

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%。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。

#### 6.4.10.3 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。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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。

##### 6.4.10.4.2 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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 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 2024年01月01日至2024	上年度可比期间 2023年01月01日至2023

	年06月30日	年06月30日
报告期初持有的基金份额	66,519,077.39	0.00
报告期内申购/买入总份额	20,633,172.18	45,069,013.02
报告期内因拆分变动份额	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	14,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	73,152,249.57	45,069,013.02
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.78%	0.50%

注：申购含红利再投增加的份额。

#### 6.4.10.5.2 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 2024年06月30日		上年度末 2023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
中国东方资产管理股份有限公司	205,153,703.42	2.19%	402,116,369.88	3.82%
东兴证券股份有限公司	400,000,000.00	4.28%	300,050,944.11	2.85%
大业信托有限责任公司	50,014,982.94	0.53%	204,452,314.77	1.94%
东兴证券投资有限公司	103,759,764.77	1.11%	202,216,720.13	1.92%
东兴资本投资管理有限公司	76,455,630.78	0.82%	75,700,729.35	0.72%
东方金诚国际信用评估有限公司	-	-	55,016,995.97	0.52%
中国邮政储蓄银行股份有限公司	2,282,680,903.32	24.40%	1,462,615,968.05	13.88%

#### 6.4.10.6 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	2,454,419.56	229,713.28	927,888.31	114,538.07

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。

#### 6.4.10.7 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。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间，本基金无其他关联事项的说明。

#### 6.4.11 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
36,514,657.63	-	-	36,514,657.63	-

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
113,556,183.14	-	-	113,556,183.14	-

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。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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。

##### 6.4.12.2 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。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024年6月30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560,103,561.64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
230306	23进出06	2024-07-01	101.56	2,000,000	203,113,460.40
230411	23农发11	2024-07-01	101.83	2,000,000	203,663,684.22
2404103	24农发贴现03	2024-07-01	99.91	1,171,000	116,988,964.70
2404107	24农发贴现07	2024-07-01	99.75	745,000	74,310,035.20
合计				5,916,000	598,076,144.52

#### 6.4.12.3.2 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。

#### 6.4.12.4 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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 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。

#### 6.4.13.2 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。

#### 6.4.13.2.1 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	5,533,606,249.24	2,671,303,985.12
合计	5,533,606,249.24	2,671,303,985.12

注：以上按短期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.2 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。

#### 6.4.13.2.3 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,840,750,446.90	5,074,490,390.55
合计	3,840,750,446.90	5,074,490,390.55

#### 6.4.13.2.4 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-



未评级	10,042,457.12	331,509,132.32
合计	10,042,457.12	331,509,132.32

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 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。

#### 6.4.13.2.6 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。

#### 6.4.13.3 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6.4.12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。

于2024年6月30日，除卖出回购金融资产款余额560,103,561.64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。

#### 6.4.13.3.1 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 2024年06月30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	2,454,419.56	-	-	-	-	2,454,419.56
交易性金融资产	3,097,289,953.72	2,640,152,730.44	4,384,777,857.10	-	-	10,122,220,541.26
买入返售金融资产	3,226,015,435.06	-	-	-	-	3,226,015,435.06
应收申购款	634,023,334.37	-	-	-	-	634,023,334.37
资产总计	6,959,783,142.71	2,640,152,730.44	4,384,777,857.10	-	-	13,984,713,730.25
负债	-	-	-	-	-	

卖出回购金融资产款	560,103,561.64	-	-	-	-	560,103,561.64
应付管理人报酬	3,714,020.33	-	-	-	-	3,714,020.33
应付托管费	990,405.43	-	-	-	-	990,405.43
应付销售服务费	977,840.09	-	-	-	-	977,840.09
应交税费	309,651.89	-	-	-	-	309,651.89
其他负债	288,507.24	-	-	-	-	288,507.24
负债总计	566,383,986.62	-	-	-	-	566,383,986.62
流动性净额	6,393,399,156.09	2,640,152,730.44	4,384,777,857.10	-	-	13,418,329,743.63
上年度末 2023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	8,496,078.10	-	-	-	-	8,496,078.10
交易性金融资产	471,897,453.28	2,930,163,926.92	5,531,171,284.23	-	-	8,933,232,664.43
买入返售金融资产	4,841,478,392.32	-	-	-	-	4,841,478,392.32
应收申购款	548,087,994.81	-	-	-	-	548,087,994.81
资产总计	5,869,959,918.51	2,930,163,926.92	5,531,171,284.23	-	-	14,331,295,129.66
负债	-	-	-	-	-	
卖出回购金融资产款	800,129,087.67	-	-	-	-	800,129,087.67
应付管理人报酬	4,036,167.79	-	-	-	-	4,036,167.79
应付托管费	1,076,311.39	-	-	-	-	1,076,311.39
应付销售服务费	902,907.25	-	-	-	-	902,907.25
应交税费	375,268.79	-	-	-	-	375,268.79
应付赎回款	7,223,991.34	-	-	-	-	7,223,991.34
其他负债	391,959.63	-	-	-	-	391,959.63
负债总计	814,135,693.86	-	-	-	-	814,135,693.86
流动性净额	5,055,824,224.65	2,930,163,926.92	5,531,171,284.23	-	-	13,517,159,435.80

#### 6.4.13.3.2 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6.4.12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。

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30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							
银行存款	2,454,008.69	-	-	-	-	410.87	2,454,419.56
交易性金融资产	3,083,292,122.15	2,625,026,824.95	4,366,048,527.35	-	-	47,853,066.81	10,122,220,541.26
买入返售金融资产	3,224,987,016.47	-	-	-	-	1,028,418.59	3,226,015,435.06
应收申购款	-	-	-	-	-	634,023,334.37	634,023,334.37
资产总计	6,310,733,147.31	2,625,026,824.95	4,366,048,527.35	-	-	682,905,230.64	13,984,713,730.25
负债							
卖出回购金融资产款	559,999,320.00	-	-	-	-	104,241.64	560,103,561.64
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,714,020.33	3,714,020.33
应付托管费	-	-	-	-	-	990,405.43	990,405.43
应付销售服务费	-	-	-	-	-	977,840.09	977,840.09
应交税费	-	-	-	-	-	309,651.89	309,651.89
其他负债	-	-	-	-	-	288,507.24	288,507.24
负债总计	559,999,320.00	-	-	-	-	6,384,666.62	566,383,986.62
利率敏感度缺口	5,750,733,827.31	2,625,026,824.95	4,366,048,527.35	-	-	676,520,564.02	13,418,329,743.63

上年度末 2023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	8,492,087.31	-	-	-	-	3,990.79	8,496,078.10
交易性金融资产	469,722,305.73	2,919,949,841.68	5,505,438,399.00	-	-	38,122,118.02	8,933,232,664.43
买入返售金融资产	4,837,891,796.82	-	-	-	-	3,586,595.50	4,841,478,392.32
应收申购款	-	-	-	-	-	548,087,994.81	548,087,994.81
资产总计	5,316,106,189.86	2,919,949,841.68	5,505,438,399.00	-	-	589,800,699.12	14,331,295,129.66
负债							
卖出回购金融资产款	799,999,200.00	-	-	-	-	129,887.67	800,129,087.67
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	4,036,167.79	4,036,167.79
应付托管费	-	-	-	-	-	1,076,311.39	1,076,311.39
应付销售服务费	-	-	-	-	-	902,907.25	902,907.25
应交税费	-	-	-	-	-	375,268.79	375,268.79
应付赎回款	-	-	-	-	-	7,223,991.34	7,223,991.34
其他负债	-	-	-	-	-	391,959.63	391,959.63
负债总计	799,999,200.00	-	-	-	-	14,136,493.86	814,135,693.86
利率敏感度缺口	4,516,106,989.86	2,919,949,841.68	5,505,438,399.00	-	-	575,664,205.26	13,517,159,435.80

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。

#### 6.4.13.4.1.2 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。

#### 6.4.13.4.2 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。

#### 6.4.13.4.3 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。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023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	10,122,220,541.26	75.44	8,933,232,664.43	66.09
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	10,122,220,541.26	75.44	8,933,232,664.43	66.09

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2024年6月30日，本基金未持有交易性权益类投资(2023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(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	10,122,220,541.26	8,933,232,664.43
第三层次	-	-
合计	10,122,220,541.26	8,933,232,664.43

**6.4.14.2 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。

**6.4.14.3 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。

**6.4.14.4 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。

**6.4.15 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。

**§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	10,122,220,541.26	72.38
	其中：债券	10,122,220,541.26	72.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	3,226,015,435.06	23.07
	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	2,454,419.56	0.02
4	其他各项资产	634,023,334.37	4.53
5	合计	13,984,713,730.25	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	0.61
	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	560,103,561.64	4.17
	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。

## 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	88
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	101
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

### 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	48.12	4.22
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	14.59	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	8.84	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	0.76	-

	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	31.92	-
	其中：剩余存续期超过397天的 浮动利率债	-	-
	合计	104.22	4.22

#### 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

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	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	737,821,388.00	5.50
	其中：政策性金融债	737,821,388.00	5.50
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	5,533,606,249.24	41.24
6	中期票据	10,042,457.12	0.07
7	同业存单	3,840,750,446.90	28.62
8	其他	-	-
9	合计	10,122,220,541.26	75.44
10	剩余存续期超过397天的 浮动利率债券	-	-

#### 7.6 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	112315328	23民生银行CD328	3,000,000	299,434,274.30	2.23
2	230411	23农发11	2,000,000	203,663,684.22	1.52
3	230306	23进出06	2,000,000	203,113,460.40	1.51



4	012480391	24电网SCP007	2,000,000	201,599,825.27	1.50
5	012481161	24国家能源SCP005	2,000,000	200,792,654.00	1.50
6	112311120	23平安银行CD120	2,000,000	199,690,963.20	1.49
7	112315321	23民生银行CD321	2,000,000	199,689,645.98	1.49
8	112304027	23中国银行CD027	2,000,000	199,689,645.98	1.49
9	112318199	23华夏银行CD199	2,000,000	199,446,401.49	1.49
10	112310330	23兴业银行CD330	2,000,000	198,115,733.50	1.48

### 7.7 “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	0.1510%
报告期内偏离度的最低值	0.0610%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1043%

#### 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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 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；中国民生银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、华夏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。

### 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	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	634,023,334.37
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	634,023,334.37

## §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	56,878	71,420.82	1,008,137,714.12	24.82%	3,054,135,713.36	75.18%
东兴安盈宝B	122	76,688,986.20	9,356,040,172.67	100.00%	16,143.48	-
合计	57,000	235,409.29	10,364,177,886.79	77.24%	3,054,151,856.84	22.76%

### 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	银行类机构	2,282,680,903.32	17.01%
2	银行类机构	800,038,716.16	5.96%
3	其他机构	798,214,085.75	5.95%
4	银行类机构	600,000,000.00	4.47%

5	银行类机构	500,515,903.71	3.73%
6	券商类机构	404,912,778.21	3.02%
7	券商类机构	400,000,000.00	2.98%
8	银行类机构	301,815,775.11	2.25%
9	银行类机构	300,000,000.00	2.24%
10	银行类机构	207,964,353.46	1.55%

### 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	290,265.19	0.01%
	东兴安盈宝B	0.00	0.00%
	合计	290,265.19	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	10~50
	东兴安盈宝B	0
	合计	10~50
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
	合计	0

## §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	2,979,526,783.40	10,537,632,652.40
本报告期基金总申购份额	35,632,231,318.91	39,155,112,249.59
减：本报告期基金总赎回份额	34,549,484,674.83	40,336,688,585.84
本报告期期末基金份额总额	4,062,273,427.48	9,356,056,316.15

注：本期申购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，基金管理人的重大人事变动：（1）经本公司股东2024年4月决定，鉴于本公司第一届董事会到期换届的具体情况，周利国先生、聂辉华先生、李秀兰女士不再担任本公司独立董事。本公司第二届董事会成员为牛南洁先生、刘亮先生、张锋先生、郝洁女士、刘天先生、刘煜辉先生、安保和先生、岳克胜先生；（2）经本公司股东2024年5月决定，刘煜辉先生不再担任本公司独立董事职务，同意聘任何帆先生为本公司独立董事；委派黄言先生担任本公司董事。

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，无涉及基金管理人、基金财产、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改聘会计师事务所。

### 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

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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、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。

### 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

本基金本报告期内租用证券公司交易单元未进行其他证券投资。

### 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。

### 10.9 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关于持续完善客户身份信息的提示	指定网站	2024-01-15
2	东兴安盈宝货币市场基金2023年第4季度报告	指定网站	2024-01-19
3	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2023年第四季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-01-19
4	东兴安盈宝货币市场基金2023年年度报告	指定网站	2024-03-29

5	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2023年年度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-03-29
6	东兴安盈宝货币市场基金2024年第1季度报告	指定网站	2024-04-19
7	东兴基金管理有限公司旗下全部基金2024年第一季度报告提示性公告	指定报刊、指定网站	2024-04-19
8	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-04-27
9	东兴安盈宝货币市场基金招募说明书（更新）（2024年第1号）	指定网站	2024-05-22
10	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	2024-05-22
11	东兴基金管理有限公司关于董事变更的公告	指定报刊、指定网站	2024-05-24

## §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	2024年3月29日-2024年3月31日, 2024年5月30日-2024年5月30日	1,462,615,968.05	820,064,935.27	-	2,282,680,903.32	17.01%
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。

## §12 备查文件目录

### 12.1 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

### 12.2 存放地点

北京市西城区金融大街5号新盛大厦B座15层

### 12.3 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  
二〇二四年八月三十日