东兴安盈宝货币市场基金招募说明书(更新)摘要(2020 年第 2 号)

基金管理人:东兴证券股份有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
二零二零年三月十二日

重要提示

东兴安盈宝货币市场基金(以下简称“本基金”)于 2016 年 4 月 11 日已在中国证监会注册(证监许可[2016]720 号文)。本基金基金合同于 2016 年 6 月 3 日正式生效。

基金管理人保证本招募说明书的内容真实、准确、完整。本招募说明书经中国证监会注册,但中国证监会对本基金募集的注册,并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证,也不表明投资于本基金没有风险。投资者认购(或申购)本基金时应认真阅读本招募说明书。

证券投资基金(以下简称“基金”)是一种长期投资工具,其主要功能是分散投资,降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具,投资人购买基金,既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益,也可能承担基金投资所带来的损失。

基金投资人应当充分了解基金定期定额投资和零存整取等储蓄方式的区别。定期定额投资是引导投资人进行长期投资、平均投资成本的一种简单易行的投资方式,但并不能规避基金投资所固有的风险,不能保证投资人获得收益,也不是替代储蓄的等效理财方式。

基金在投资运作过程中可能面临各种风险,既包括市场风险,也包括基金自身的管理风险、技术风险和合规风险等。巨额赎回风险是开放式基金所特有的一种风险,即当单个开放日基金的净赎回申请超过上一日基金总份额的百分之十时,投资人将可能无法及时赎回持有的全部基金份额。

本基金为货币市场基金,属证券投资基金中的较低风险收益品种,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金管理人不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》、基金产品资料概要等基金法律文件,了解基金的风险收益特征,根据自身的投资目的、投资期限、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应,并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金销售业务资格的其他机构购买基金。

基金产品资料概要编制、披露与更新要求,自《信息披露办法》实施之日起一年后开始执行。

基金管理人承诺依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金资产,但不保证本基金一定盈利,也不保证最低收益。本基金的过往业绩及其净值高低并不预示其未来业绩表现, 基金管理人管理的其他基金的业绩也不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资人注意基金投资的“买者自负”原则,在做出投资决策后,基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险,由投资人自行负担。

一、基金合同生效日期

2016 年 6 月 3 日

二、基金管理人

(一)基金管理人概况

名称:东兴证券股份有限公司
成立日期:2008 年 5 月 28 日
注册地址:北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)12、15 层
办公地址:北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)6、10、12、15、16 层
法定代表人:魏庆华
组织形式:股份有限公司
联系人:陈智勇
联系电话:010-57307309
传真:010-57307388
注册资本:275796.0657 万元人民币
股权结构:(截止 2019 年 5 月末)

序号	股东名称	持股数量(股)	持股比例(%)
1	中国东方资产管理股份有限公司	1,454,600,484	52.74
2	山东高速股份有限公司	119,989,367	4.35
3	上海工业投资(集团)有限公司	48,100,000	1.74
4	福建新联合投资有限责任公司	42,530,568	1.54
5	中国证券金融股份有限公司	31,218,813	1.13

(二)主要人员情况

1、董事会成员

魏庆华先生,1964 年 10 月出生,博士研究生学历,高级经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾就职于福建清流县外贸局;曾任清流县人民银行股长、副行长;三明市人民银行办公室副主任(主持工作);闽发证券三明支公司总经理、闽发证券副总裁、总裁,东兴证券副总经理、总经理、财务负责人,东兴期货董事长,东兴资本董事长,东兴投资董事长。现任东兴证券董事长。

张涛先生,1972 年 8 月出生,博士研究生学历,正高级经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任华泰证券总裁办公室总裁秘书、投资银行一部业务经理、福州办事处副主任、上海总部投资银行业务部副总经理(主持)、深圳总部副总经理(主持)兼深圳彩田路营业部总经理、董事会秘书兼总裁助理、董事会办公室主任、副总裁,华泰期货有限公司董事长,钟山有限公司董事、副总裁,钟山金融控股有限公司董事长。现任东兴证券董事、总经理、财务负责人,东兴投资董事长。

谭世豪先生,1964 年 1 月出生,硕士研究生,高级经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中国银行国际业务部科员、主任科员、副处长、处长;中国东方股权及投行部经理、助理总经理,资产经营部助理总经理、副总经理;深圳外贸集团董事长,监事长;邦信资产管理有限公司副总经理兼深圳分公司副总经理; 中国东方人力资源部副总经理;东兴证券副董事长。现任东兴证券董事、副总经理,东兴香港董事会主席。

江月明先生,1971 年 8 月出生,硕士研究生学历,持有中国律师执业资格证书,中国国籍,无境外永久居留权。2001 年 7 月至 2016 年 8 月历任中国东方经营处置审查办公室职员、高级主任,总裁办公室经理、高级经理、助理总经理,风险管理部助理总经理、副总经理,董事会办公室(引战上市办公室)副总经理(主持工作);现任中国东方董事会办公室(上市办公室)总经理,兼任东富(天津)股权投资基金管理有限公司董事、东方邦信创业投资有限公司董事。2017 年 3 月至今任东兴证券董事。

曾涛先生,1972 年 12 月出生。大学本科学历。曾就职于中国银行股份有限公司海南省分行,中国东方资产管理股份有限公司海口办事处。曾任中国东方资产管理股份有限公司(以下简称一中国东方Ⅱ)人力资源部高级经理、总经理助理、副总经理,机构管理部副总经理主持工作,中华联合保险集团股份有限公司副总经理、合规负责人、纪委书记。2017 年 6 月至今任中国东方办公室总经理,兼任大连银行股份有限公司董事。2019 年 3 月起任东兴证券董事。

董裕平先生,1969 年 10 月出生,博士研究生学历,研究员(中国社科院)、博士生导师、博士后合作导师,哈佛大学经济系访问学者。曾任国家开发银行政策研究室科级行员、经济师,稽核评价局稽核一处副处长、综合处副处长、正处级行员、高级经济师;中国社会科学院金融研究所副研究员、研究员、公司金融研究室主任、法与金融研究室主任、所纪委委员、所长助理,兼任中国社会科学院投融资研究中心主任;中国东方战略发展规划部副总经理。2018 年 11 月至今任中国东方战略发展规划部(研究院)副总经理(主持工作),2018 年 12 月至今兼任东方邦信融通控股股份有限公司董事。2019 年 3 月起任东兴证券董事。

屠波旋先生,1973 年 8 月出生,大学本科,经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾就职于中国银行上海市分行、东方资产上海办事处,上海大盛资产有限公司;曾任上海国盛(集团)有限公司资产管理中心副主任、上海国盛集团资产有限公司经营部总经理、总裁助理、副总裁;现任上海国盛(集团)有限公司资本运营部副总经理(主持工作),上海正浩资产管理有限公司董事长, 上海经济年鉴社总经理。2007 年 8 月至今任东兴证券董事。

王云泉先生,1969 年 3 月出生,硕士研究生,高级经济师、会计师,中国国籍,无境外永久居留权。曾就职于山东省交通厅人事处、山东省交通开发投资公司办公室、山东基建股份有限公司。历任山东高速股份有限公司总经理助理、副总经理、董事会秘书、总法律顾问、董事。2013 年 9 月至今,兼任山东高速投资发展有限公司董事长;2017 年 12 月至今,兼任山东高速(深圳)投资有限公司董事长(法定代表人)。现任山东高速投资控股有限公司总经理,2018 年 6 月至今任东兴证券董事。

郑振龙先生,1966 年 3 月出生,博士研究生,厦门大学管理学院教授,中国国籍,无境外永久居留权。曾任厦门大学研究生院副院长、经济学院副院长、金融系副主任(主持工作)。现任厦门大学闽江学者特聘教授、国务院学位委员会学科评议组成员,享受国务院政府特殊津贴,兼任华福证券独立董事、华安证券独立董事,厦门国际银行股份有限公司独立董事、福建华通银行独立董事。2017 年 3 月至今任东兴证券独立董事。

张伟先生,1977 年 4 月出生,博士研究生,具有 FRM(金融风险管理师)资格,中国国籍,无境外永久居留权。2001 年 8 月至 2012 年 2 月,历任中国人民银行研究生部教研部研究实习员、副主任兼助理研究员; 中国人民银行研究生部行政部副主任兼副研究员。2012 年 3 月至今任清华大学五道口金融学院校友办主任兼副研究员。主要从事宏观经济、货币政策、汇率体制、股票投资、外汇投资、金融稳定机制、金融危机预警机制等方面研究。2017 年 3 月起任东兴证券独立董事。

宫肃康先生,1965 年 3 月出生,硕士研究生学历,注册会计师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中央财政金融学院税务系教师、北京市新技术产业开发试验区财政审计所专管员、宁波创源文化发展股份有限公司独立董事。现任北京天平会计师事务所有限责任公司执行董事总经理、北京天平健税务师事务所执行董事总经理。2017 年 12 月至今任东兴证券独立董事。

孙广亮先生,1963 年 7 月出生,硕士研究生学历,律师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中国法律事务中心律师、众鑫律师事务所律师,现任北京市华堂律师事务所合伙人律师、主任, 大商股份有限公司独立董事、大恒新纪元科技股份有限公司独立董事。2017 年 12 月至今任东兴证券独立董事。

2、监事会成员

綦斌先生,1968 年 4 月出生,博士研究生学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任江苏广播电视大学团总支副书记;中国银行总行海外行管理部科员、主任科员;中国东方股权部业务三部助理经理、股权及投行业务部副总经理、市场开发部业务发展部副总经理、总裁办公室综合信息处副经理(主持工作)、总裁办公室助理总经理、党委办公室和总裁办公室副主任、副总经理、党委办公室和研发中心副主任、副总经理(主持工作)、研发中心总经理、战略发展规划部总经理。2016 年 1 月至 2019 年 1 月任东兴证券董事。现任东兴证券监事、监事会主席。

叶淑玉女士,1957 年 5 月出生,物理学学士、中欧 EMBA、高级工程师、会计师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任福州无线电七厂质检科副科长兼厂团总支书记;福州电子工业局团委委员;福州智达电脑品管部副经理;福建新世纪电脑集团有限公司副总裁;实达电脑集团人力资源处处长、监事;实达电脑与美国 Compaq 合资公司副总经理;上海外高桥房地产有限公司副总经理。现任福建东煌投资集团股份有限公司董事、董事长助理兼董事会秘书,福建天宝矿业集团股份有限公司董事、副总裁兼董事会秘书。2017 年 3 月至今任东兴证券监事。

罗小平先生,1960 年 5 月出生,硕士研究生,高级经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任华夏证券股份有限公司投行部副总经理、并购部和证券营业部总经理、中华企业咨询有限公司执行总裁;中国诚通控股集团有限公司战略发展中心总监。现任中国诚通控股集团有限公司专职派出董事、中国物流有限公司董事、中国诚通香港有限公司董事。2011 年 11 月至今任东兴证券监事。

郝洁女士,1971 年 4 月出生,硕士研究生,中国国籍,无境外永久居留权。曾任信达资产管理公司财务部会计,宏源证券财务部总经理助理、副总经理,现任东兴证券财务部总经理,兼任东兴投资董事、东兴期货董事。2017 年 3 月至今任东兴证券职工监事,东兴证券(香港)金融控股有限公司董事。

杜彬先生,1973 年 2 月出生,本科学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中国人民银行条法司综合处科员;中国民族国际信托投资公司国际业务部副经理、资产管理部总经理,民族证券法律及合规政策部经理、合规部副总经理、总经理、合规部兼风险管理部总经理,合规风控部总经理;现任东兴证券合规法律部总经理、东兴投资董事、东兴期货监事、东兴资本监事、上海东策盛资产管理有限公司监事。2014 年 8 月至今任东兴证券职工监事。

3、总经理及其他高级管理人员

魏庆华、张涛先生和谭世豪先生,简历请参见上述关于董事的介绍

许学礼先生,1963 年 12 月出生,博士研究生学历,高级经济师,中国国籍,无境外永久居留权。曾任财政部财政科学研究所助理研究员;中国南山开发公司上市小组成员;深圳证券交易所高级研究员;广州尊荣集团副总经理;深圳汉君雄投资公司副总经理;亚洲控股有限公司总裁助理;大通证券股份有限公司副总经理;东兴证券首席风险官,东兴资本董事。现任东兴证券副总经理、合规总监、首席风险官,东兴香港董事。

银国宏先生,1974 年 3 月出生,博士研究生学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中国教育科技信托投资公司证券营业部研究咨询部经理;中信建投证券研究所所长助理;东兴证券研究所总经理,公司助理总经理兼研究所总经理、机构业务部总经理、资产管理业务总部总经理、基金业务部总经理。现任东兴证券副总经理、衍生品部总经理,东兴期货董事长,上海伴兴实业发展有限公司董事长。

张军先生,1975 年 5 月出生,硕士研究生学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任北京市园林局香山公园科员;中诚信托投资有限责任公司信托经理;证监会发行监管部审核一处科员、副调研员、副处长;东兴证券首席风险官。现任东兴证券副总经理,东兴香港董事。

刘亮先生,1974 年 10 月出生,本科学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾就职于福建省政府办公厅证券办、中国证监会福建特派员办事处。曾任福建省证券监督管理委员会科员,中国证监会福建监管局科员、副主任科员、主任科员、党办副主任、稽查处副处长、纪委委员、党办副主任(主持)、党办主任;东兴证券助理总经理、总经理办公室总经理、场外市场业务总部总经理、新疆分公司总经理、深圳分公司总经理、东兴证券董事会秘书,董事会办公室总经理。现任东兴证券副总经理,福建分公司总经理。

陈海先生,1970 年 12 月出生,本科学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任闽发证券深圳营业部会计主管、福州五一中路营业部分析师、信息研究中心股评部经理、福州北环东路营业部助理总经理;东兴证券福州北环东路营业部助理总经理、副总经理、营销总监,福州五一中路营业部江厝服务部负责人、福州江厝营业部总经理、福建分公司副总经理,公司助理总经理兼任资产管理业务总部业务一部总经理、公司助理总经理兼任资产管理业务总部总经理。现任东兴证券副总经理,东兴香港董事,东兴证券(香港)有限公司董事会主席。

张锋先生,1973 年 12 月出生,硕士研究生学历,中国国籍,无境外永久居留权。曾任中国银行总行营业部出口处职员;中国东方股权部、实业部、评估部助理经理、副经理;东兴证券北京北四环中路证券营业部总经理、企业融资部总经理、财富管理部总经理。现任东兴证券董事会秘书,公司助理总经理,机构客户部总经理。

4、合规总监

许学礼先生,简历请参见上述关于总经理及其他高级管理人员的介绍。

5、本基金基金经理

张琳娜女士,金融学硕士毕业,11 年证券基金行业从业经历。2007 年 4 月至 2012 年 2 月任益民基金集中交易部交易员、副总经理,2012 年 3 月至 2018 年 1 月任英大基金交易管理部副总经理,固定收益部总经理、基金经理,2018 年 1 月 12 日加入东兴证券。现任东兴安盈宝货币市场基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理、东兴兴福一年定期开放债券型证券投资基金、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基金经理。

孙继青先生,北京科技大学工学硕士,3 年钢铁行业经验,11 年证券行业经验。2007 年 10 月加入东兴证券,2007 年 10 月至 2012 年 3 月任东兴证券研究所钢铁行业研究员;2012 年 3 月至 2013 年 6 月任东兴证券资产管理部投资品行业研究员、宏观策略研究员;2013 年 6 月至 2014 年 9 月任东兴证券资产管理部投资经理。2014 年 9 月加入东兴证券基金业务部。现任东兴证券改革精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴监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、东兴量化多策略灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴量化优享灵活配置混合型证券投资基金基金经理、东兴兴利债券型证券投资基金基金经理、东兴品牌精选灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

6、基金业务投资决策委员会成员

银国宏先生,简历请参见上述关于经营管理层人员的介绍

王青女士,现任基金业务部总经理。

孙继青先生,现任基金业务部基金经理。

张琳娜女士,现任基金业务部基金经理。

7、上述人员之间均不存在近亲属关系。

三、基金托管人

(一)基金托管人情况

1、基本情况

名称:中国邮政储蓄银行股份有限公司(简称:中国邮政储蓄银行)
住所: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 3 号 A 座
法定代表人:张金良
成立时间:2007 年 3 月 6 日
组织形式:股份有限公司
注册资本:810.31 亿元人民币
存续期间:持续经营
批准设立机关及批准设立文号:中国银监会银监复〔2006〕484 号
基金托管资格批文及文号:证监许可〔2009〕673 号
联系人:马强
联系电话:010—68857221
经营范围:吸收公众存款;发放短期、中期、长期贷款;办理国内外结算;办理票据承兑和贴现;发行金融债券;代理发行、代理兑付、承销政府债券;买卖政府债券、金融债券;从事同业拆借;买卖、代理买卖外汇;从事银行卡业务;提供信用证服务及担保;代理收付款项及代理保险业务;提供保险箱服务;经中国银行业监督管理机构等监管部门批准的其他业务。

经国务院同意并经中国银行业监督管理委员会批准,中国邮政储蓄银行有限责任公司(成立于 2007 年 3 月 6 日)于 2012 年 1 月 21 日依法整体变更为中国邮政储蓄银行股份有限公司。中国邮政储蓄银行股份有限公司依法承继原中国邮政储蓄银行有限责任公司全部资产、负债、机构、业务和人员,依法承担和履行原中国邮政储蓄银行有限责任公司在有关具有法律效力的合同或协议中的权利、义务,以及相应的债权债务关系和法律责任。中国邮政储蓄银行股份有限公司坚持服务“三农”、服务中小企业、服务城乡居民的大型零售商业银行定位,发挥邮政网络优势,强化内部控制,合规稳健经营,为广大城乡居民及企业提供优质金融服务,实现股东价值最大化,支持国民经济发展和社会进步。

2、主要人员情况

中国邮政储蓄银行股份有限公司总行设托管业务部,下设资产托管处、产品管理处、风险管理处、运营管理处等处室。现有员工 27 人,全部员工拥有大学本科以上学历及基金从业资格,90%员工具有三年以上基金从业经历,具备丰富的托管服务经验。

3、基金托管业务经营情况

截至 2019 年 9 月 30 日,中国邮政储蓄银行托管的证券投资基金共 97 只。(二)基金托管人的内部风险控制制度说明

1、内部控制目标

作为基金托管人,中国邮政储蓄银行严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

2、内部控制组织结构

中国邮政储蓄银行设有风险与内控管理委员会, 负责全行风险管理与内部控制工作,对托管业务风险控制工作进行检查指导。托管业务部专门设置内部风险控制处室,配备专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,具有独立行使监督稽核的工作职权和能力。

3、内部控制制度及措施

托管业务部具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理严格实行复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人员负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

(三)基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

1、监督方法

依照《基金法》及其配套法规和基金合同的约定,监督所托管基金的投资运作。严格按照现行法律法规以及基金合同规定,对基金管理人运作基金的投资比例、投资范围、投资组合等情况进行监督,对违法违规行为及时予以风险提示,要求其限期纠正,同时报告中国证监会。在日常为基金投资运作所提供的基金清算和核算服务环节中,对基金管理人发送的投资指令、基金管理人对各基金费用的提取与开支情况进行检查监督。

2、监督流程

(1)每工作日按时通过基金监督子系统,对各基金投资运作比例控制指标进行例行监控,发现投资比例超标等异常情况,向基金管理人发出书面通知,与基金管理人进行情况核实,督促其纠正,并及时报告中国证监会。

(2)收到基金管理人的划款指令后,对涉及各基金的投资范围、投资对象及交易对手等内容进行合法合规性监督。

(3)通过技术或非技术手段发现基金涉嫌违规交易,电话或书面要求管理人进行解释或举证,要求限期纠正,并及时报告中国证监会。

四、相关服务机构

(一)基金份额发售机构

1、直销机构

(1)东兴证券股份有限公司直销中心
a、东兴证券股份有限公司直销柜台
办公地址:北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 6 层
联系人:陈智勇
直销中心电话:010—57307309
传真:010—57307388
公司网站:http://www.dxzq.net
b、东兴证券股份有限公司网上直销系统
交易系统网址:https://tradefund.dxzq.net/etrading/
(2)东兴证券股份有限公司分支机构
住所:北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 6 层
办公地址:北京西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 6 层
法人代表:魏庆华
联系人:田丰舞
电话:010—57307307
传真:010—57307388
2、代销机构

(1)大连银行股份有限公司
注册地址:辽宁省大连市中山区中山路 88 号
客服电话: 400—664—0099
公司网站: http://www.bankofdl.com
(2)上海基煜基金销售有限公司
注册地址:上海市崇明县长兴镇潘园公路 1800 号 2 号楼 6153 室(上海泰和经济发展区)
客服电话:400—820—5369
公司网站:www.jiyufund.com.cn
(3)上海天天基金销售有限公司
注册地址:上海市徐汇区龙田路 190 号 2 号楼 2 层
法定代表人:其实
联系人:丁姗姗
电话: 010—65980408—8009
传真: 010—65980408—8000
公司网址: www.1234657.com.cn
(4)中国邮政储蓄银行股份有限公司
住所: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 3 号 A 座
法定代表人:张金良
联系人:文彦娜
联系电话: 010—68858101
传真: 010—68858057
公司网站: http://www.psbc.com
(5)联讯证券股份有限公司
注册地址:广东省惠州市惠城区江北东江三路惠州广播电视新闻中心三、四楼
法定代表人:徐刚
联系人:彭莲
电话: (0752)2119700
公司网站: http://www.lxzq.com.cn
(6)大泰金石投资管理有限公司
公司网站:www.dtfunds.com
客服热线:400—9282—299
(7)上海好买基金销售有限公司
注册地址:上海市虹口区欧阳路 196 号 26 号楼 2 楼 41 号
法定代表人:杨文斌
联系人:戴稽汉
电话: 021—20613647
传真: 021— 68596916
公司网站: www.ehowbuy.com
(8)北京恒天明泽基金销售有限公司
注册地址:北京经济技术开发区宏达北路 10 号五层 5122 室
办公地址:北京市朝阳区亮马桥路 39 号第一上海中心 C 座 6 层
法定代表人:梁越
联系人:张晔
电话: 010—58845312
公司网站: www.chtfund.com
(9)北京钱景财富投资管理有限公司
注册地址:北京市海淀区丹棱街 6 号 1 幢 9 层 1008—1012
法定代表人:赵荣春
联系人:崔丁元
电话: 010—57418813
传真: 010—57569671
公司网站: www.qianjing.com
(10)上海长量基金销售投资顾问有限公司
注册地址:上海市浦东新区高翔路 526 号 2 幢 220 室
办公地址:上海市浦东大道 555 号裕景国际 B 座 16 楼
法定代表人:张跃伟
联系人:苗明
电话: 021—20691923
传真: 021—20691861
公司网站: http://www.erichfund.com/
(11)北京展恒基金销售股份有限公司
注册地址:北京市顺义区后沙峪镇安富街 6 号
地址:北京市朝阳区安苑路 15—1 号邮电新闻大厦二层
法定代表人:闫振杰
联系人:马林
电话: 010—59601366—7024
公司网站: www.myfund.com
(12)北京新浪仓石基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区北四环西路 58 号 906 室
法定代表人:张琪
联系人:付文红
电话: 010—62676405
公司网站:www.xincai.com
(13)上海利得基金销售有限公司
注册地址:上海市宝山区蕴川路 5475 号 1033 室
客服电话:400—921—7755
公司网站:www.leadbank.com.cn
(14)上海万得基金销售有限公司
注册地址:中国(上海)自由贸易试验区福山路 33 号 11 楼 B 座
客服电话:400—821—0203
公司网站:www.520fund.com.cn
(15)北京肯特瑞基金销售有限公司
注册地址:北京市海淀区海淀东三街 2 号 4 层 401—15
客服电话:95118
公司网站:fund.jd.com
(16)乾道金融信息服务(北京)有限公司
公司网站:www.qiandaojr.com
客服热线:400—0888—080
(17)北京汇成基金销售有限公司
公司网站:www.fundzone.cn
客服热线:400—619—9059
(18) 蚂蚁(杭州)基金销售有限公司
公司网站:https://www.antfortune.com/
客服热线:95188
(19)南京苏宁基金销售有限公司
公司网站:https://www.snjijin.com/
客服热线:95177
(20)方德保险代理有限公司
公司网站: www.jhjhome.net
客服热线: 400—8557—333
(21) 深圳众禄基金销售股份有限公司
公司网站:http://www.jjmmw.com/
客服热线:4006—788—887
(22) 北京植信基金销售有限公司
公司网站:https://www.zhixin—iv.com/
客服热线:4006—802—123
(23) 济安财富(北京)基金销售有限公司
公司网站:http://www.jianfortune.com/
客服热线:400—673—7010
(24)上海联泰基金销售有限公司
公司网站:http://www.66liantai.com/
客服热线:400—166—6788
(25)珠海盈米基金销售有限公司
公司网站:https://www.yingmi.cn/
(26)嘉实财富管理有限公司
公司网站:https://www.harvestwm.cn/
客服热线:400—021—8850
(27)北京加和基金销售有限公司
公司网站:www.bzfunds.com
电话:010—50866175
(28)上海陆金所基金销售有限公司
公司网站:http://www.lufunds.com/
客服热线:400—8219—031
(29)大连网金基金销售有限公司
公司网站:http://www.yibaijin.com/
客服热线:4000—899—100
(30)北京蛋卷基金销售有限公司
公司网站:https://danjuanapp.com/
客服热线:4000—618—518
(31)天津万家财富基金销售有限公司
公司网站:http://www.wanjiawealth.com/
客服热线:010—59013895
(32)恒泰证券股份有限公司
公司网站:https://www.cnht.com.cn/
客服热线:4001—966—188
(二)登记机构

名称:东兴证券股份有限公司
住所:北京市西城区金融大街 5 号(新盛大厦)B 座 12、15 层
法定代表人:魏庆华
办公地址:北京市西城区平安里西大街 28 号中海国际中心 6 层
联系人:王广辉
电话:010—57307359
传真:010—57307366
(三)律师事务所

名称:北京市天元律师事务所
住所:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层
办公地址:北京市西城区丰盛胡同 28 号太平洋保险大厦 10 层
负责人:朱小辉
电话:010—57763888
传真:010—57763777
经办律师:吴冠雄、李晗
(四)会计师事务所

名称:德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)
注册地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层 10 室
办公地址:北京市东城区东长安街 1 号东方广场东方经贸城西二办公楼 8 层 10 室
执行事务合伙人:崔劲
联系电话:010—85207108
传真:010—85181218
经办注册会计师:李燕、王亚坤

五、基金名称和基金类型

(一)本基金名称:东兴安盈宝货币市场基金
(二)本基金类型:货币市场基金
运作方式:契约型开放式
本基金存续期:不定期

六、基金的投资目标和投资方向

(一)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。

(二)投资理念

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。

(三)投资范围

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。

七、基金的投资策略

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。

(1)久期调整策略

根据宏观经济形式、央行货币政策、短期资金市场流动性状况等因素,来确定并动态调整投资组合的久期。当市场利率看涨时,适度缩短投资组合平均剩余期限,即减持剩余期限较长投资品种、增持剩余期限较短品种,降低组合整体净值损失风险;当市场利率看跌时,则相对延长投资组合平均剩余期限,增持较长剩余期限的投资品种,获取超额收益。

(2)类属配置策略

综合考虑各品种之间的流动性、收益性以及信用风险情况,来确定组合的资产配置比例。前提条件是保证基金资产的高流动性、低风险和稳定收益。

(3)现金流管理策略

根据当期和远期市场资金面充裕程度的分析,匹配各期限的回购与债券品种的到期日,实现现金流的有效管理。

(4)套利策略

短期资金市场分为银行间市场和交易所市场两个子市场,其中投资群体、交易方式等市场要素不同,使得两个市场的资金面和市场短期利率在一定期间内可能存在定价偏离。本基金在充分论证这种套利机会可行性的基础上,寻找最佳介入时机,进行跨市场操作,获得安全的超额收益。

由于投资群体的差异,对期限相近的品种,因为其流动性、税收等因素造成内在价值出现明显偏离时,本基金可以在保证流动性的基础上,进行品种间的套利操作,增加超额收益。

(5)一级市场参与策略

积极参与国债、金融债、央行票据一级市场投标,增加盈利空间。一级市场发行的国债、金融债、以及央行票据数量大且连续,提供了有效的品种建仓机会。本基金管理人根据二级市场的收益水平和市场资金面的状况,对一级市场进行准确的招标预测,决定本基金的投标价位。在合理价格获得债券,满足组合配置需要。

随着短期资金市场的发展与金融创新的深入,待未来相关法律法规允许本基金可投资的金融工具出现时,本基金将基于审慎的原则,对新投资品种予以评估,在满足本基金投资目标的前提下,本基金可相应调整和更新相关投资策略,并在招募说明书更新中进行公告。

八、基金的业绩比较基准

本基金业绩比较基准:活期存款利率(税后)

本基金为货币市场基金,属于现金管理产品,产品性质上与银行活期存款有着很强的相似性。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取活期存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

如果今后法律法规发生变化,或者有更权威的、更能为市场普遍接受的业绩比较基准推出,或者是市场上出现更加适合用于本基金的业绩比较基准时,本基金经基金管理人和基金托管人协商一致, 可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告,而无需召开基金份额持有人大会。

九、基金的风险收益特征

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。

十、基金的投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定, 于 2019 年 6 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据始于 2019 年 1 月 1 日,截止 2019 年 3 月 31 日。

1.报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	6,137,471,208.50	86.88
	其中:债券	6,097,403,232.34	86.31
	资产支持证券	40,067,976.16	0.57
2	买入返售金融资产	811,502,363.75	11.49
	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	90,524,061.03	1.28
4	其他资产	24,709,698.27	0.35
5	合计	7,064,207,331.55	100.00

2.报告期债券回购融资情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	6.99
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	401,189,198.50	5.86
	其中:买断式回购融资	-	-

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	-	6.55
	其中:买断式回购融资	-	-
2	报告期末债券回购融资余额	449,075,355.46	6.81
	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。

3. 基金投资组合平均剩余期限

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	59
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	62
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	60
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	47

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金不存在投资组合平均剩余期限超过 120 天的情况。

3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30 天以内	39.58	6.81
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	35.50	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	6.03	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	14.21	-
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮