

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产  
管理计划  
2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证证券资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2024 年 8 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、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。

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 8 月 28 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。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划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集合计划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

<b>§1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>§4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
<b>§5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§7 投资组合报告</b>	<b>37</b>
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 债券回购融资情况	38
7.3 基金投资组合平均剩余期限	38
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	39
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	39
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	39

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 .....	40
7.8 期末按实际利率计算的账面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 .....	40
7.9 投资组合报告附注 .....	40
<b>§8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>41</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	41
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	41
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 .....	41
<b>§9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>42</b>
<b>§10 重大事件揭示 .....</b>	<b>42</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	42
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 .....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	42
10.4 基金投资策略的改变 .....	42
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	42
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 .....	42
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	43
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	43
10.9 其他重大事件 .....	43
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>44</b>
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 .....	44
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	44
<b>§12 备查文件目录 .....</b>	<b>45</b>
12.1 备查文件目录 .....	45
12.2 存放地点 .....	45
12.3 查阅方式 .....	45

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划
基金简称	兴证资管金麒麟现金添利货币
基金主代码	970192
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 10 月 11 日
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司
基金托管人	中国证券登记结算有限责任公司
报告期末基金份额总额	2,495,667,455.08 份
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。

注：1、管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划进行了规范，并在收到中国证监会准予兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 10 月 11 日生效。“兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划”（以下称本集合计划）。

2、投资者依据原《兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划份额，自 2022 年 10 月 11 日起全部自动转换为兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划份额。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在不影响客户正常证券交易的前提下，将客户资金账户中的闲置保证金转换为产品份额，通过投资于银行存款组合及其他具有良好流动性的短期金融工具，在保证资金安全性和充分流动性的情况下，力求为投资者获取合理收益。
投资策略	第一，在资产投资策略上，主要包括资产配置策略、利率预期策略、利率品种投资策略、信用品种投资策略、银行定期存款投资策略、杠杆投资策略。本集合计划将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对集合计划资产组合进行积极管理。第二，在流动性管理策略上，本集合计划将紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响集合计划流动性管理的因素，建立组合流动性监控管理指标，实现对集合计划资产流动性的实时管理。本集合计划将通过对市场结构、市场冲击情况、主要资产流动性变化跟踪分析等多种方式对流动性进行定量定性分析，在进行组合优化

	时增加流动性约束条件，在兼顾集合计划收益的前提下合理地控制资产的流动性风险，综合平衡集合计划资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高集合计划资产整体的流动性。
业绩比较基准	同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本集合计划作为货币型集合资产管理计划，其长期平均风险和预期收益率低于股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划、债券型集合资产管理计划。

## 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	兴证证券资产管理有限公司	中国证券登记结算有限责任公司
信息披露 负责人	姓名	付志坚
	联系电话	021-38565866
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn
客户服务电话	95562-3	4008-058-058
传真	021-38565863	-
注册地址	福建省平潭县金井镇天山北路3号金井湾商务营运中心6栋15层110室	北京市西城区太平桥大街17号
办公地址	上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦9层	北京市西城区锦什坊街26号
邮政编码	200135	100033
法定代表人	孙国雄	于文强

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ixzcg1.com">http://www.ixzcg1.com</a>
基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 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1月1日-2024年6月30日)
本期已实现收益	12,656,579.00
本期利润	12,656,579.00
本期净值收益率	0.5164%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末基金资产净值	2,495,667,455.08
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
累计净值收益率	1.8312%

注：本期已实现收益指集合计划本期利息收入、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，由于货币市场集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

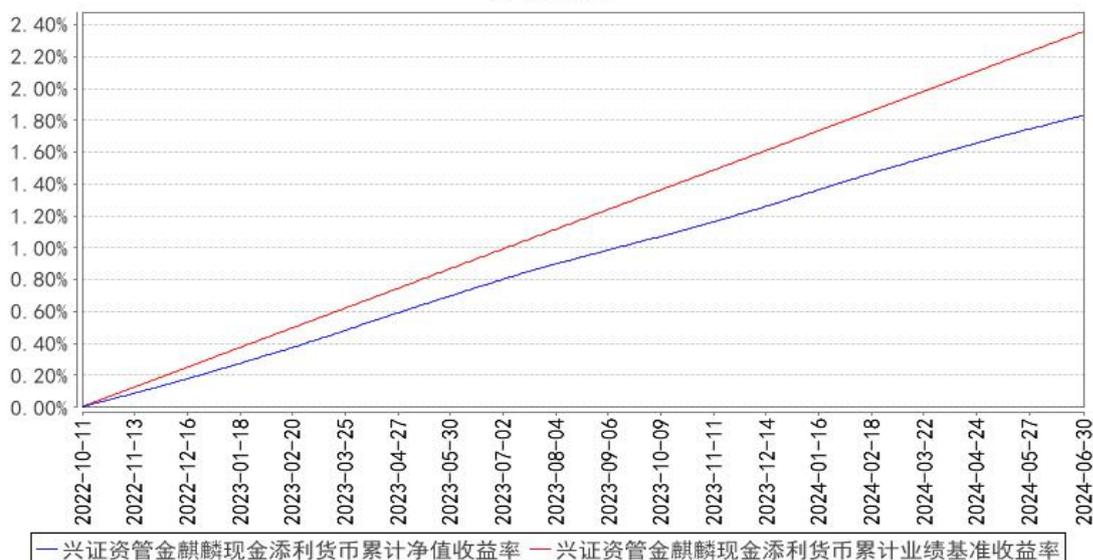
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.0753%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	-0.0372%	0.0002%
过去三个月	0.2400%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	-0.1013%	0.0002%
过去六个月	0.5164%	0.0003%	0.6825%	0.0000%	-0.1661%	0.0003%
过去一年	1.0347%	0.0003%	1.3725%	0.0000%	-0.3378%	0.0003%
自基金合同生效起至今	1.8312%	0.0003%	2.3587%	0.0000%	-0.5275%	0.0003%

### 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

兴证资管金麒麟现金添利货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2024 年 06 月 30 日。

## § 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

兴证证券资产管理有限公司经中国证监会证监许可[2014]145号文批复，于2014年6月9日正式成立。目前，公司注册资本为8亿元人民币。兴证证券资产管理有限公司是兴业证券股份有限公司（SH 601377）的全资子公司，前身为兴业证券股份有限公司资产管理部，2000年即获准开展资产管理业务，2014年正式成为兴业证券股份有限公司旗下子公司。目前公司经营范围为证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。

十多年来，基于母公司作为现代大型证券金融集团业务链条齐全的禀赋，依托自主培养的、稳健扎实的投资研究底蕴，兴证资管已经发展成为一家极具投资能力禀赋的综合型资产管理机构。固收、权益、创新投资、组合投资、同业投资等多元业务齐头并进，可为机构客户与个人客户提供一站式投融资解决方案。

截止2024年6月30日，兴证证券资产管理有限公司共有10只按照公募基金要求规范运作的大集合资产管理计划，分别为兴证资管金麒麟领先优势一年持有混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟

兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划、兴证资管麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划、兴证资管麒麟现金添利货币型集合资产管理计划、兴证资管麒麟兴享增利六个月持有期债券型集合资产管理计划。

#### 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		
游臻	兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理	2022 年 10 月 11 日	-	12 年	新加坡管理大学硕士。2012 年 9 月进入金融行业，任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014 年 12 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易运营部交易员、固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、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。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截止本报告期末，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划和其他组合的投资经理。

#### 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，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 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

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，严格遵守相应的制度和流

程，各组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，各组合享有平等的交易权利。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。交易执行环节对各类交易严格流程控制、并持续技术改进，确保了公平交易原则的实现。公司对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合不存在参与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的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

### 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

基本面方面，上半年经济依旧处在波浪式发展、曲折式前进的态势中。一季度，1-3 月 PMI 分别为 49.2、49.1、50.8，从荣枯线下超预期上升至荣枯线之上。1-2 月经济数据保持超预期的回升态势。1 月社融新增规模偏高，企业融资需求改善为主要支撑，2 月社融新增规模及 2 月人民币信贷新增规模均较 1 月大幅回落，且处于季节性偏弱水平。2 月新增社融结构性较为突出，主要增量来自政府债券的发行，实体企业的直接融资增量或未能延续 1 月的态势。居民加杠杆意愿或仍较为一般，实体融资需求或尚未开启自发性循环。二季度，4-6 月 PMI 分别为 50.4、49.5、49.5，经济整体仍处于波浪式运行中，较一季度有所回落。4-5 月经济数据呈现供给修复，需求待改善之特征。4 月金融数据出现异动，社融规模出现单月负增长，此现象或受资金防空转的影响，符合 2024 年第一季度货币政策执行报告专栏中提及“盘活被低效占用的金融资源，减少资金空转沉淀，大力发展直接融资，这可能会使得信贷总量增速放缓”的描述。5 月金融数据回归相对常态，总体上，实体经济融资需求弱的格局仍然存在。目前经济运行情况整体仍处于波动与反复中，内生动能和微观主体活力仍有待改善，后续关注宏观需求改善情况、地产政策落地效果等。市场方面，上半年，资金情况整体均衡宽松，月末、春节前以及季度末、半年末，机构跨月跨季平稳顺利。1 月 24 日，央行行长潘功胜在国新办新闻发布会上表示从 2 月 5 日起，存款准备金率下调 0.5 个百分点，将向市场提供长期流动性约 1 万亿元。2 月 20 日，5 年期 LPR 从 4.2% 下调至 3.95%。4 月份以来，央行多次提醒长债风险。现券方面，一季度长端利率债震荡下行，10 年国债震荡下行，累计下行 21bp。1 年期 AAA 存单累计下行 21bp 至 2.23%。二季度，超长端、长端利率债震荡下行，收益率于 4 月下旬达上半年低点后大幅调整，随后震荡下行。二季度，30 年国

债活跃券累计下行 5.65bp，10 年国债活跃券累计下行 4.45bp。1 年期 AAA 存单累计下行 13bp。组合操作方面，上半年配合产品规模的变化，及时调整账户资产配置，并在指标允许范围内及时增减组合平均剩余期限，同时配合波段交易，在保证账户日常流动性需求的前提下，力争提升组合收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划本报告期集合计划份额净值收益率为 0.5164%，业绩比较基准收益率为 0.6825%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济基本面或将继续处于波浪式运行态势，经济恢复基础仍处于巩固阶段。往后看，资金方面，目前政策利率下调、MLF 加场操作、存款利率下调，在当前经济修复的反复阶段，货币政策暂无大幅收紧基础，短期内货币或维持中性偏宽松状态，后续关注地产修复、宏观需求、汇率等方面变化情况。投资策略方面，目前债市难言趋势性拐点何时出现，利率中枢或在波动中继续下探。本产品将继续按照产品投资范围、投资目标采取相对保守策略，根据市场情况以及负债端情况变化，严格控制组合剩余期限、把握合适的配置节奏。同时配合市场波动，适度进行波段交易。投资上，灵活配置剩余期限 397 天以内的最高等级信用债、存单、存款、回购等标的，平衡产品流动性和收益率，并可能适当关注高等级高流动性品种交易机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由公司总裁、公司副总裁、公司合规总监、公司总裁助理、各投资部门负责人、各研究部门负责人、合规风控部负责人、交易运营部负责人等人员组成。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且投资经理不参与其管理集合计划的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划合同，本集合计划收益支付方式为现金分红，且每季集中支付。本集合计划本报告期内向本集合计划份额持有人分配利润 12,656,579.00 元，其中以直接通过应付赎回款转出金额 507,403.32 元，计入应付利润科目 12,149,175.68 元，符合相关法规及本集合计划合同的规定。

#### 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

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人或者计划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，本托管人在对本集合计划的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、集合计划合同和托管协议的有关规定，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

#### 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有关规定，对本集合计划的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划费用开支等方面进行了监督和复核，未发现本集合计划管理人存在损害集合计划份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核了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、投资组合报告等内容，认为其内容真实、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：兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 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	142,635,133.81	333,192,178.65
结算备付金		650,292.50	6,106,657.62
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	1,841,400,390.89	1,666,595,452.75
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,841,400,390.89	1,666,595,452.75
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	520,114,160.46	20,014,394.69
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		2,504,799,977.66	2,025,908,683.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6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		-	145,975,900.23
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,036,001.51	1,749,924.80
应付托管费		113,111.24	97,218.01
应付销售服务费		565,555.97	486,090.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,981.12	31,903.59
应付利润		6,279,812.74	5,800,880.44
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	132,060.00	241,377.33
负债合计		9,132,522.58	154,383,294.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	2,495,667,455.08	1,871,525,389.08
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		2,495,667,455.08	1,871,525,389.08
负债和净资产总计		2,504,799,977.66	2,025,908,683.71

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，兴证资管金麒麟现金添利货币份额净值 1.0000 元，份额总额 2,495,667,455.08 份。

## 6.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		27,928,225.56	18,893,192.02
1. 利息收入		3,840,060.36	3,605,605.19
其中：存款利息收入	6.4.7.13	2,870,457.08	2,479,819.05
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		969,603.28	1,125,786.14
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		24,088,165.20	15,287,586.83
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	24,088,165.20	15,287,586.83
资产支持证券投 资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	-	-
以摊余成本计量 的金融资产终止确认产 生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		15,271,646.56	9,439,453.92
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	11,035,791.67	7,280,653.87
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	613,099.48	404,480.77
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	3,065,497.59	1,526,188.95
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		418,244.65	88,523.05
其中：卖出回购金融资产 支出		418,244.65	88,523.05

6. 信用减值损失	6. 4. 7. 22	-	-
7. 税金及附加		2,063.18	6,641.56
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	136,949.99	132,965.72
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		12,656,579.00	9,453,738.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,656,579.00	9,453,738.10
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,656,579.00	9,453,738.10

### 6.3 净资产变动表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,871,525,389.08	-	-	1,871,525,389.08
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	1,871,525,389.08	-	-	1,871,525,389.08
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	624,142,066.00	-	-	624,142,066.00
(一)、综合收益总额	-	-	12,656,579.00	12,656,579.00
(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)	624,142,066.00	-	-	624,142,066.00
其中：1. 基金申购款	30,621,279,402.63	-	-	30,621,279,402.63

2. 基金赎回款	-29,997,137.33 6.63	-	-	-29,997,137.336 .63
(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)	-	-	-12,656,579.00	-12,656,579.00
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,495,667,455.08	-	-	2,495,667,455.08
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	879,520,253.66	-	-	879,520,253.66
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	879,520,253.66	-	-	879,520,253.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,166,412,254.51	-	-	1,166,412,254.51
(一)、综合收益总额	-	-	9,453,738.10	9,453,738.10
(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)	1,166,412,254.51	-	-	1,166,412,254.51
其中：1. 基金申购款	24,806,543,151.66	-	-	24,806,543,151.66
2. 基金赎回款	-23,640,130,897.15	-	-	-23,640,130,897.15

(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）	-	-	-9,453,738.10	-9,453,738.10
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	2,045,932,508.17	-	-	2,045,932,508.17

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：

<u>孙国雄</u>	<u>徐翔</u>	<u>吴勇滨</u>
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

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划，兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划由兴业证券金麒麟现金添利集合资产管理计划变更而来。

2013 年 5 月 31 日，中国证券业协会作出《关于兴业证券股份有限公司发起设立兴业证券金麒麟现金添利集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函[2013]522 号）。兴业证券金麒麟现金添利集合资产管理计划自 2013 年 3 月 25 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 15 日结束募集并于 2013 年 5 月 16 日成立。2015 年 8 月 7 日兴业证券金麒麟现金添利集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划。

根据《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》、《现金管理产品运作管理指引》等相关法律法规及中国证监会《关于准予兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更的回函》（机构部函[2022]647 号），管理人于 2022 年 9 月 2 日发布《关于兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更公告暨投资者征询意见函》，并于 2022 年 10 月 10 日完成合同变更事项征询工作。自 2022 年 10 月 11 日起，《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》生效，“兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划”。

本集合计划为契约性开放式，本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。本集合计划的管理人为兴证证券资产管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本集合计划的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具：现金；期限在 1 年以内（含 1 年）的银行存款、中央银行票据、同业存单；期限在 1 个月以内的债券回购；剩余期限在 397 天以内（含 397 天）的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券；中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。

本集合计划的业绩比较基准为：同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本集合资产管理计划财务报表以持续经营为基础编制。

本集合资产管理计划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<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合资产管理计划财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 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的要求，真实、完整地反映了本集合资产管理计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 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

本集合报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

如 6.4.1 集合资产管理计划基本情况所述，本集合资产管理计划已遵照公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作。本集合资产管理计划目前比照证券投资基金的相关税务法规进行税务处理。如果日后涉及本集合资产管理计划的有关税收法规颁布，本集合资产管理计划的税务处理可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。本集合资产管理计划适用的主要税项列示如下：

(a) 根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》（财税[2016]36 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[2016]140 号）、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》（财税[2017]2 号）及《关于资管产品增值税有关问题的通知》（财税[2017]56 号），资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品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。

(b) 本集合资产管理计划进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》（财政部税务总局公告 2023 年第 39 号），自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易所适用的印花税实施减半征收。根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券（股票）交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方征收印花税，对受让方不再征税。

(c) 对集合资产管理计划在运营过程中缴纳的增值税，分别按照集合资产管理计划管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税税率、教育费附加和地方教育附加。

#### 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 6 月 30 日
活期存款	142,635,133.81
等于：本金	142,431,435.33
加：应计利息	203,698.48
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	142,635,133.81

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年6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	1,841,400,390.89	1,842,686,617.49	1,286,226.60	0.0515
	合计	1,841,400,390.89	1,842,686,617.49	1,286,226.60	0.0515
	资产支持证券	-	-	-	-
	合计	1,841,400,390.89	1,842,686,617.49	1,286,226.60	0.0515

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

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

##### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

##### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

#### 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6月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	220,051,365.94	-
银行间市场	300,062,794.52	-
合计	520,114,160.46	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

##### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本集合计划本报告期末未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

#### 6.4.7.5 债权投资

##### 6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

##### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

#### 6.4.7.6 其他债权投资

##### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

##### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

#### 6.4.7.7 其他权益工具投资

##### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

##### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

#### 6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6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	23,306.10
其中：交易所市场	5,278.00
银行间市场	18,028.10
应付利息	-
预提费用	108,753.90
合计	132,060.00

#### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	1,871,525,389.08	1,871,525,389.08
本期申购	30,621,279,402.63	30,621,279,402.63
本期赎回（以“-”号填列）	-29,997,137,336.63	-29,997,137,336.63
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	2,495,667,455.08	2,495,667,455.08

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期末无其他综合收益。

#### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	12,656,579.00	-	12,656,579.00
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	-12,656,579.00	-	-12,656,579.00
本期末	-	-	-

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	2,816,122.76
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	54,334.32
其他	-
合计	2,870,457.08

注：其他包括保证金利息收入。

**6.4.7.14 股票投资收益**

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

**6.4.7.15 债券投资收益****6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	23,956,256.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	131,908.74
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	24,088,165.20

**6.4.7.15.2 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1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,925,262,819.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,915,542,017.58
减：应计利息总额	9,588,893.10
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	131,908.74

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.16 资产支持证券投资收益****6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

**6.4.7.17 贵金属投资收益****6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.18 衍生工具收益****6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.19 股利收益**

本集合计划本报告期内无股利收益。

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

本集合计划本报告期内无公允价值变动收益。

**6.4.7.21 其他收入**

本集合计划本报告期内无其他收入。

**6.4.7.22 信用减值损失**

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

**6.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	39,781.56
信息披露费	59,672.34

证券出借违约金	-
银行费用	18,896.09
银行间账户维护费	18,600.00
合计	136,949.99

#### 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

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

本集合资产管理计划于 2024 年 7 月 2 日实施 2024 年第 3 次收益支付，收益累计期间为自 2024 年 4 月 2 日至 2024 年 7 月 1 日止期间，向收益累计期间登记在册并且未在收益分配截止日前解约赎回的全部分额持有人进行现金分红。

#### 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

本报告期内未发生与本集合计划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。

##### 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
兴证证券资产管理有限公司（“兴证资管”）	集合计划管理人
中国证券登记结算有限责任公司（“中国结算”）	集合计划托管人
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	集合计划管理人的股东、集合计划销售机构
兴证期货有限公司（“兴证期货”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证全球基金管理有限公司（“兴证基金”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证投资管理有限公司（“兴证投资”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
福州兴证物业管理有限公司	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证（香港）金融控股有限公司（“兴证香港”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证创新资本管理有限公司（“兴证资本”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证国际金融集团有限公司（“兴证国际”）	受集合计划管理人的股东控制的公司

注：以下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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

## 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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30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 (%)
兴业证券	-	-	70,344,550.00	100.00

## 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
兴业证券	4,788,107,000.00	100.00	9,549,900,000.00	100.00

## 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

## 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	16,462.58	100.00	5,278.00	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
兴业证券	23,018.95	100.00	8,683.80	100.00

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为

本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	11,035,791.67	7,280,653.87
其中：应支付销售机构的客户维护费	5,158,708.01	3,517,863.22
应支付基金管理人的净管理费	5,877,083.66	3,762,790.65

注：本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.90%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.90\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

当以0.90%的管理费计算的七日年化暂估收益率小于或等于2倍活期存款利率，集合计划管理人将调整管理费为0.30%，以降低每万份产品暂估净收益为负并引发销售机构交收透支的风险，直至该类风险消除，集合计划管理人方可恢复计提0.90%的管理费。管理人应在费率调整后依照《信息披露办法》的有关规定在规定媒介上公告。

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人复核后于次月前5个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	613,099.48	404,480.77

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日或不可抗力致使无法按时支付等，支付日期顺延至最近可支付日支付。

#### 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费 兴证资管金麒麟现金添利货币
兴业证券	3,065,497.59
合计	3,065,497.59
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费 兴证资管金麒麟现金添利货币
兴业证券	1,526,188.95
合计	1,526,188.95

注：本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.25%。

计算公式为： $H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

#### 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

本集合计划本报告期及上年度可比期间未与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 10 月 11 日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	0.00	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：本报告期内及上年度可比期间本集合计划管理人均无运用自有资金投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.4.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024年6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（%）
兴业证券股份有限公司	19,094,000.00	0.7651	13,026,000.00	0.6960

#### 6.4.10.5 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1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国结算	2,692,349.10	180,001.88	2,845,113.15	245,595.01

注：本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人中国证券登记结算有限责任公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

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
-	507,403.32	12,149,175.68	12,656,579.00	-

#### 6.4.12 期末（2024年6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

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 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 06 月 30 日止,本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 06 月 30 日止,本集合计划从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元,无抵押债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为货币型集合资产管理计划,是集合资产管理计划中的低风险品种。本集合计划的预期风险和预期收益均低于股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划、债券型集合资产管理计划。本集合计划的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具,包括:1、现金;2、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款、中央银行票据、同业存单;3、期限在 1 个月以内的债券回购;4、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的国债、政策性金融债、企业债、公司债、短期融资券、中期票据、超短期融资券;5、中国证监会、中国人民银行认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。如法律法规或监管机构允许货币证券投资基金投资其他货币市场工具的,在不改变集合计划投资目标、投资策略及风险收益特征的前提下,在履行适当程序后,本集合计划可参与其他货币市场工具的投资。本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定范围之内。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人实施全面风险管理,由公司董事会、经营管理层以及全体员工共同参与,对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险等各类风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析产品投资运作管理各环节的各类风险,并设定适当的风险限额及内部控制流程,通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立由董事会、监事会、经营管理层、风险管理部门、各部门组成的全面风险管理组织架构,即董事会、监事会——公司经营管理层及其风险管理委员会——风险管理部门——各部门。

本集合计划管理人确立风险管理三道防线,即各部门实施有效自我控制为第一道防线,风险管理部门风险管理工作人员在事前和事中实施专业的风险管理为第二道防线,合规风控部内控稽核人

员实施事后监督、评价为第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。本集合计划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%，本集合计划与由本集合计划管理人管理的其他集合计划共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本集合计划在交易所进行的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，因此违约风险发生的可能性很小；集合计划在进行银行间同业市场交易前均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

本集合计划于本报告期末和上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

##### 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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,657,366,334.54	1,512,297,691.74
合计	1,657,366,334.54	1,512,297,691.74

注：持有发行期限在一年以内（含）的同业存单按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他同业存单以其债项评级作为长期信用评级进行列示。

##### 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 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	184,034,056.35	154,297,761.01
合计	184,034,056.35	154,297,761.01

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

2. 持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示；

3. 未评级部分为政策性金融债。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指集合计划管理人未能以合理价格及时变现集合计划资产以支付投资者赎回款项的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于计划份额持有人可随时要求赎回其持有的计划份额，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。

本集合计划管理人密切关注各类资产及投资标的的交易活跃程度与价格的连续性情况，评估各类资产及投资标的占集合计划资产的比例并进行动态调整，以满足本集合计划运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划投资于具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易。本集合计划管理人建立了科学的资产负债管理和头寸管理机制，并通过限制投资集中度来管理投资品种变现的流动性风险：本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；本集合计划管理人管理的全部大集合资产管理计划（大集合资产管理计划系指投资人数不受 200 人限制的资产管理计划，下同）持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家公司上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家公司上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划资产管理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，有效保障集合计划持有人利益。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指集合计划的财务状况和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。

本集合计划主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年6 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							
货币资金	142,635,133.81	-	-	-	-	-	142,635,133.81
结算备付金	650,292.50	-	-	-	-	-	650,292.50
交易性金融资产	300,103,336.06	428,347,925.78	1,112,949,129.05	-	-	-	-1,841,400,390.89
买入返售金融资产	520,114,160.46	-	-	-	-	-	520,114,160.46
资产总计	963,502,922.83	428,347,925.78	1,112,949,129.05	-	-	-	-2,504,799,977.66
负债							

应付管理人报酬	-	-	-	-	-	2,036,001.51	2,036,001.51
应付托管费	-	-	-	-	-	113,111.24	113,111.24
应付销售服务费	-	-	-	-	-	565,555.97	565,555.97
应付利润	-	-	-	-	-	6,279,812.74	6,279,812.74
应交税费	-	-	-	-	-	5,981.12	5,981.12
其他负债	-	-	-	-	-	132,060.00	132,060.00
负债总计	-	-	-	-	-	9,132,522.58	9,132,522.58
利率敏感度缺口	963,502,922.83	428,347,925.78	1,112,949,129.05	-	-	-9,132,522.58	2,495,667,455.08
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	333,192,178.65	-	-	-	-	-	333,192,178.65
结算备付金	6,106,657.62	-	-	-	-	-	6,106,657.62
交易性金融资产	352,016,354.12	857,154,643.12	457,424,455.51	-	-	-	-1,666,595,452.75
买入返售金融资产	20,014,394.69	-	-	-	-	-	20,014,394.69
资产	711,329,585.08	857,154,643.12	457,424,455.51	-	-	-	-2,025,908,683.71

总计							
负债							
卖出回购金融资产款	145,975,900.23	-	-	-	-	-	145,975,900.23
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,749,924.80	1,749,924.80
应付托管费	-	-	-	-	-	97,218.01	97,218.01
应付销售服务费	-	-	-	-	-	486,090.23	486,090.23
应交税费	-	-	-	-	-	31,903.59	31,903.59
应付利润	-	-	-	-	-	5,800,880.44	5,800,880.44
其他负债	-	-	-	-	-	241,377.33	241,377.33
负债总计	145,975,900.23	-	-	-	-	8,407,394.40	154,383,294.63
利率敏感度缺口	565,353,684.85	857,154,643.12	457,424,455.51	-	-	-8,407,394.40	1,871,525,389.08

注：表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并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

假设	1. 其他影响债券公允价值的变量保持不变		
	2. 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	市场利率+1%	-6,708,437.88	-3,567,841.76

	市场利率-1%	6,774,880.87	3,593,137.48
--	---------	--------------	--------------

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对本集合计划净值产生的影响。

#### 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。本集合计划本报告期末未持有不以记账本位币计价的资产，因此不存在相应的外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本集合计划主要投资于银行存款、同业存单等固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 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6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	1,841,400,390.89	73.78	1,666,595,452.75	89.05
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	1,841,400,390.89	73.78	1,666,595,452.75	89.05

注：本集合计划主要投资于银行存款、同业存单等固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本集合计划主要投资于银行存款、同业存单等固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

#### 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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的

输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：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6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	1,841,400,390.89	1,666,595,452.75
第三层次	-	-
合计	1,841,400,390.89	1,666,595,452.75

##### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 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工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

#### 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集合计划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	1,841,400,390.89	73.51
	其中：债券	1,841,400,390.89	73.51
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	520,114,160.46	20.76
	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	143,285,426.31	5.72
4	其他各项资产	-	-
5	合计	2,504,799,977.66	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
1	报告期内债券回购融资余额	1.90	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值的比例 (%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中：买断式回购融资	-	-

注：报告期内债券回购融资余额占本集合计划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

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

## 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	117
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	59

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划未发生投资组合平均期限超过 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	32.57	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	11.99	-

	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	11.17	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	3.98	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	40.51	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	100.23	-

#### 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

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未发生超过 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	按实际利率计算的账面价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	184,034,056.35	7.37
	其中：政策性 金融债	184,034,056.35	7.37
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,657,366,334.54	66.41
8	其他	-	-
9	合计	1,841,400,390.89	73.78
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)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	210218	21 国开 18	1,000,000	102,126,899.06	4.09
2	112304032	23 中国银行 CD032	1,000,000	99,820,696.19	4.00

3	112420024	24 广发银行 CD024	1,000,000	99,366,912.18	3.98
4	112403045	24 农业银行 CD045	1,000,000	99,022,126.16	3.97
5	112404017	24 中国银行 CD017	1,000,000	98,315,059.92	3.94
6	112304063	23 中国银行 CD063	800,000	79,083,657.80	3.17
7	112304064	23 中国银行 CD064	700,000	69,291,669.46	2.78
8	200203	20 国开 03	600,000	61,373,686.19	2.46
9	112311119	23 平安银行 CD119	500,000	49,934,064.81	2.00
10	112308162	23 中信银行 CD162	500,000	49,931,698.64	2.00

### 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	0.0871%
报告期内偏离度的最低值	0.0011%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0397%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本集合计划未发生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

报告期内本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

### 7.8 期末按实际利率计算的账面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

本集合计划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

本集合计划估值采用摊余成本法（除特殊情况外），即估值对象以买入成本列示，按照实际利率每日计提应收利息。

#### 7.9.2 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

本集合计划投资前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、平安银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门行政处罚。上述主体所发行

证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有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。

### 7.9.3 期末其他各项资产构成

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

### 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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

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 (%)
15,960	156,370.14	355,542,129.17	14.25	2,140,125,325.91	85.75

### 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	机构	200,767,211.87	8.04
2	个人	45,177,475.39	1.81
3	个人	32,991,115.12	1.32
4	机构	30,037,000.00	1.20
5	机构	29,978,432.87	1.20
6	个人	22,706,926.36	0.91
7	个人	13,207,536.20	0.53
8	个人	11,083,895.35	0.44
9	个人	10,564,238.68	0.42
10	个人	10,248,170.12	0.41

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	440,356.86	0.0176

### 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	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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 10 月 11 日） 基金份额总额	951,269,642.00
本报告期期初基金份额总额	1,871,525,389.08
本报告期基金总申购份额	30,621,279,402.63
减：本报告期基金总赎回份额	29,997,137,336.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,495,667,455.08

注：总申购份额含红利再投、转换入份额和强制调增份额，总赎回份额含转换出份额和强制调减份额。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

### 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，本集合计划管理人的重大人事变动如下：

2024 年 6 月 6 日起，杨华先生担任公司副总经理。

本报告期内，本集合计划托管人的专门托管部门未发生重大人事变动。

### 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，本集合计划未发生对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划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，本集合计划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

本报告期内本集合计划管理人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，本集合计划的管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 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，本集合计划托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

## 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 (%)	
兴业证券	2	-	-	16,462.58	100.00	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准：财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；具备本集合计划运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本集合计划进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本集合计划提供研究服务支持；佣金费率合理；本集合计划管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序：本集合计划管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；本集合计划管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本集合计划本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

### 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

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
兴业证券	-	-	4,788,107.00	100.00	-	-

## 10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本集合计划偏离度绝对值均未超过 0.5%。

## 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	兴证资管麒麟现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定网站、规定报刊	2024-1-3
2	兴证证券资产管理有限公司关于投资经理代为履行职责的公告	规定网站、规定报刊	2024-1-8
3	兴证资管麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-1-22

4	兴证证券资产管理有限公司旗下公募资产管理产品风险评价结果的公告	规定网站	2024-1-24
5	兴证证券资产管理有限公司关于公司住所变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-2-2
6	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划单个账户累计持有份额限制的公告	规定网站、规定报刊	2024-2-8
7	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年年度报告	规定网站	2024-3-29
8	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划收益支付公告	规定网站、规定报刊	2024-4-2
9	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-4-22
10	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划快速取现的公告	规定网站、规定报刊	2024-4-26
11	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-6-8
12	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划产品资料概要更新	规定网站	2024-6-17
13	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书更新（2024 年第 1 号）	规定网站	2024-6-17

## § 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	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 2024 年 6 月 6 日起，杨华先生担任公司副总经理。
- 2024 年 6 月 20 日，公司换领《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》，经营范围为证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、 集计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、 集计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、 报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 8、 法律法规及中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

本集计划管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼）。

### 12.3 查阅方式

投资者可登录集计划管理人的网站（<http://www.ixzcg1.com>）查询，或在营业时间内至集计划管理人办公场所免费查阅。

兴证证券资产管理有限公司

2024 年 8 月 31 日