

# 兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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：2026 年 3 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 其他指标	8
3.4 过去三年基金的利润分配情况	8
<b>§4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>§5 托管人报告</b>	<b>14</b>
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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
<b>§6 审计报告</b>	<b>14</b>
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
<b>§7 年度财务报表</b>	<b>16</b>
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21

<b>§8 投资组合报告</b> .....	<b>3</b>
8.1 期末基金资产组合情况 .....	3
8.2 债券回购融资情况 .....	3
8.3 基金投资组合平均剩余期限 .....	3
8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明 .....	4
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	4
8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 .....	4
8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离 .....	5
8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细 .....	5
8.9 投资组合报告附注 .....	5
<b>§9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>6</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	6
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 .....	6
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	6
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	7
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	7
<b>§10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>7</b>
<b>§11 重大事件揭示</b> .....	<b>7</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	7
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	7
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	8
11.4 基金投资策略的改变 .....	8
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	8
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	8
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	8
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	9
11.9 其他重大事件 .....	9
<b>§12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>17</b>
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	17
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	17
<b>§13 备查文件目录</b> .....	<b>18</b>
13.1 备查文件目录 .....	18
13.2 存放地点 .....	18
13.3 查阅方式 .....	18

## § 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市场基金
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	6,821,517,878.62 份
基金合同存续期	不定期

注：2022 年 10 月 11 日，“兴证资管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货币型集合资产管理计划”。2025 年 8 月 25 日，“兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划”变更为“兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金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基金份额，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	<p>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。本基金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，对基金资产组合进行积极管理。</p> <p>第二，在流动性管理策略上，本基金将紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响基金流动性管理的因素，建立组合流动性监控管理指标，实现对基金资产流动性的实时管理。</p> <p>本基金将通过对市场结构、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，在兼顾基金收益的前提下合理地控制资产的流动性风险，综合平衡基金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基金资产整体的流动性。</p>
业绩比较基准	活期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金作为货币市场基金，其长期平均风险和预期收益率低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

注：“兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划”于 2025 年 8 月 25 日变更注册为“兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金”，兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金业绩比较基准调整为

“活期存款利率（税后）”。

## 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	宋琳	陈晨
	联系电话	95562-3	010-50938723
	电子邮箱	zcg1@xyzq.com.cn	zctg@chinaclear.com.cn
客户服务电话		95562-3	4008-058-058
传真		021-68581323	-
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		刘宇	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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ixzzcgl.com">http://www.ixzzcgl.com</a>
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场2座办公楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年
本期已实现收益	46,357,369.20	27,568,845.78	22,108,801.79
本期利润	46,357,369.20	27,568,845.78	22,108,801.79
本期净值收益率	0.7366%	0.9054%	1.0922%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末

期末基金资产净值	6,821,517,878.62	4,929,124,356.67	1,871,525,389.08
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
累计净值收益率	2.9568%	2.2202%	1.3148%

注：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。

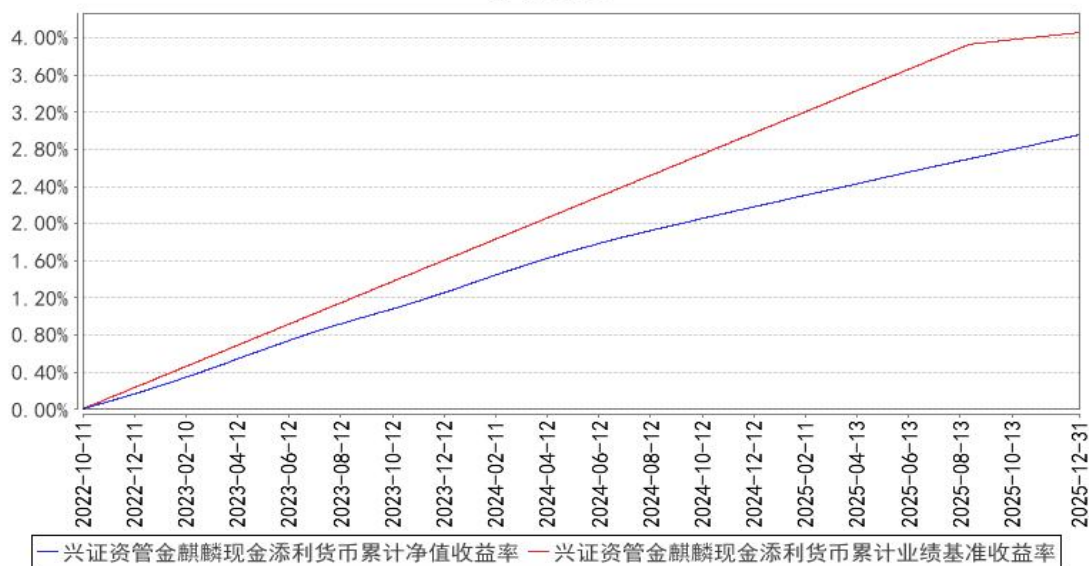
## 3.2 基金净值表现

### 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
过去三个月	0.1826%	0.0005%	0.0894%	0.0000%	0.0932%	0.0005%
过去六个月	0.3668%	0.0006%	0.3317%	0.0013%	0.0351%	-0.0007%
过去一年	0.7366%	0.0006%	1.0104%	0.0013%	-0.2738%	-0.0007%
过去三年	2.7342%	0.0006%	3.7517%	0.0009%	-1.0175%	-0.0003%
自基金合同生效起至今	2.9568%	0.0006%	4.0592%	0.0009%	-1.1024%	-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

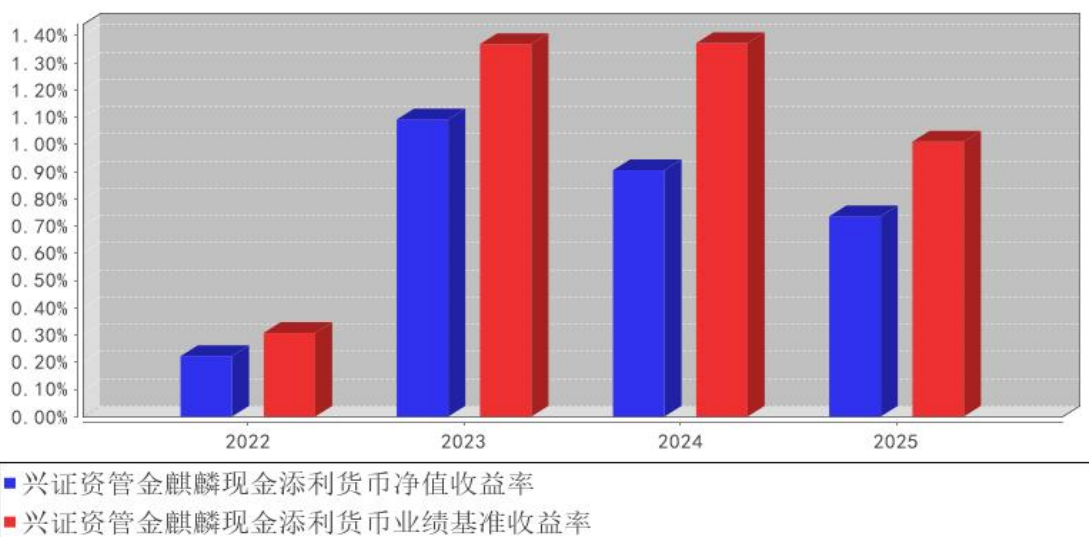
兴证资管金麒麟现金添利货币累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2025 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证资管金麒麟现金添利货币基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2025 年	-	3,803,010.38	42,554,358.82	46,357,369.20	-
2024 年	-	3,174,158.07	24,394,687.71	27,568,845.78	-
2023 年	-	51,869.36	22,056,932.43	22,108,801.79	-
合计	-	7,029,037.81	89,005,978.96	96,035,016.77	-

## § 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（SH601377）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。公司已形成公、私募两大业务板块，固收、权益、FOF和多资产业务齐头并进、均衡发展。

兴证证券资产管理有限公司现有12只公开募集证券投资基金，分别为兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟消费升级混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟均衡优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟兴享优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟兴睿优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券型证券投资基金、兴证资管金麒麟3个月持有期混合型基金中基金(FOF)、兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金、兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金、兴证资管国企红利优选混合型发起式证券投资基金、兴证资管恒睿致胜混合型发起式证券投资基金。

#### 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		
游臻	兴证证券资产管理有限公司公募投资部（原公	2025年8月25日	-	13年	新加坡管理大学硕士。2012年9月进入金融行业，曾任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014年10月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易部交易员，固定收益部投资经理，公募投资部

	募业务部)基金经理				投资经理, 公募业务部投资经理、基金经理。现任公募投资部(原公募业务部)基金经理。
--	-----------	--	--	--	---

注：1、游臻自 2022 年 10 月 11 日至 2025 年 8 月 24 日担任兴证资管麒麟现金添利货币型集合资产管理计划的投资经理；

2、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

3、非首任基金经理，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；

4、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，本基金基金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。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同约定的行为，未有损害基金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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》。本基金管理人通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督，从而达到保证管理人旗下不同的投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有公募产品和组合，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，共享交易资源。报告期内，本基金管理人严格执行了《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。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.3.3 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

经济基本面方面，2025 年全年经济处于波浪式运行中，呈现先回升后回落的态势，2025 年一季度以来，经济数据保持超预期回升态势，经济景气度在政策的拉动下回升至荣枯线之上并逐步修复。二季度重回荣枯线之下，并随着关税政策的落地和缓和先降后缓升。4 月 PMI 重回荣枯线之下，受关税政策落地影响回落超过季节性；关税政策缓和后，5、6 月 PMI 逐步缓慢修复，整体生产端与需求端仍存在一定分化，生产端维持一定韧性，但需求端预期略转弱，基本面内生动能仍有待加强。三季度，虽然在荣枯线之下，但受反内卷提振，PMI 逐步回升。四季度，由荣枯线之下逐步回升至荣枯线之上。整体外需较为有韧性，出口订单边际逐步修复、经济新动能拉动继续体现。四个季度 GDP 分别为 5.4%、5.2%、4.8%、4.5%。资金面方面，全年资金面总体均衡，虽然关键时点略有波动，但整体机构跨季跨年平稳顺利；全年央行一次调降存款准备金率，0.5 个百分点，释放约 1 万亿；一次调降公开市场 7 天逆回购操作利率，10bp 至 1.40%；一次调降 1 年期 LPR10bp 至 3.0%，一次调降 5 年期 LPR10bp 至 3.50%等。市场方面，十年国债全年区间震荡。组合配置方面，在满足流动性储备及应付北交所新股申购可能导致的大额赎回的前提下，于一季度拉长组合平均剩余期限，三季度末降低组合平均剩余期限，并配合相应的波段交易，通过不同时期策略的调整，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市场基金本报告期基金份额净值收益率为 0.7366%，业绩比较基准收益率为 1.0104%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，目前 1 月份 PMI 有所回落且仍处于荣枯线之下，需求端压力仍有一定的体现，制造业供需皆有所下行，供需缺口扩大；出口新订单指数下滑，但港口吞吐等高频数据暂时维持韧性。由于今年春节时点偏晚且假期较长，一季度数据或相应受到影响。后续关注政策性金融工具加码、前期资金对实物工作量的传导等落地情况，以及外需韧性是否继续维持。同时，地缘政治、商品价格波动以及股市是否有新的科技叙事同样值得关注。流动性方面，在当前基本面弱修复，经济内生动能待强化的情况下，货币并无收紧的基础。且央行行长日前在接受采访时明确表示，在总量政策方面，将灵活高效运用降准降息等多种货币政策工具，保持流动性充裕，并指出“今年降准降息还有一定的空间”。预计货币政策将继续维持稳健偏宽松的基调，在必要时加大逆周期调节力度，为经济回升向好营造适宜的货币金融环境。投资策略方面，银行同业存单等短端资产目前保持区间小幅震荡，绝对收益方面或有一定的配置价值。组合配置方面，将根据市场情况及产品负债端情况，在保证流动性储备充足的前提下，合理安排组合平均剩余期限，把握配置节奏，并适度进行波段交易，力争增厚组合收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内本管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入持续加强治理建设、制度建设、合规管理和监察稽核工作，主要包括：

1、完善治理架构：完善由股东、董事会、监事会、公司经营管理层、各专业委员会和各部门组成的治理架构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和制衡机制。

为贯彻落实《公司法》（2023 年 12 月修订）《关于新〈公司法〉配套制度规则实施相关过渡期安排》及国有金融企业监事会改革要求，进一步完善公司法人治理规范，公司本年度推进监事会改革，不再设置监事会，在董事会下设审计委员会行使《公司法》所规定的监事会职权等内容。至此，公司建立了由股东、董事会、董事会审计委员会、公司经营管理层、各专门委员会和各部门组成的治理架构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和制衡机制。

2、加强制度建设：公司已经建立并持续完善覆盖合规与风险管理、反洗钱、投资研究、交易运营、销售适当性、财务管理、人员管理、估值与资金交收管理、信息技术管理等经营管理和内部控制领域的制度体系，持续强化制度执行监督检查和突发应急制度体系建设。

3、开展监察稽核：根据外部监管要求等完成各项定期稽核和专项稽核，开展各项审计和审查，检查内容覆盖公司多个业务部门和业务环节，对整改情况进行跟踪，促进公司业务合规运作、稳

健经营。

4、员工行为管理：依据《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》《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等规定，持续完善信息系统和内部流程机制，定期开展投资行为监督管理。

5、合规培训：高度重视法律法规和监管政策培训，积极开展合规风控培训工作。针对《公开募集证券投资基金管理人参与上市公司治理管理规则》《证券公司分类评价规定》等多项新规开展专题解读及应对建议措施分享。积极开展廉洁从业管理、操作风险管理、反洗钱管理等各类主题培训。同时，及时结合行业违法违规案例发布多期专项解读、多期《合规管理在身边》专题案例分享、多期合规月报。

本报告期内，本基金整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了基金持有人利益。本管理人将继续以风险控制为核心，一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，切实保障基金安全、合规运作。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金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、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基金经理不参与其管理基金的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同，本基金收益支付方式为现金分红，且每季集中支付。本基金本报告期内向本基金份额持有人分配利润 46,357,369.20 元，其中以直接通过应付赎回款转出金额 3,803,010.38 元，计入应付利润科目 42,554,358.82 元，符合相关法规及本基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百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，本托管人在对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，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

### 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，对本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了监督和复核，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。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2602353 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金全体基金份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立

	<p>性准则第 1 号--财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	<p>该基金管理人兴证证券资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但</p>

	<p>目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	蔡晓晓 邬明东
会计师事务所的地址	上海市南京西路 1266 号恒隆广场 2 号楼 25 楼
审计报告日期	2026 年 03 月 25 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	322,340,590.96	186,347,327.28
结算备付金		-	3,225,405.29
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	6,167,351,407.05	4,176,006,580.56
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		6,167,351,407.05	4,176,006,580.56
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	350,105,608.55	520,044,822.43

债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	58,017,320.55
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		6,839,797,606.56	4,943,641,456.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年12月31日</b>	<b>上年度末 2024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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,689,204.48	3,998,785.45
应付托管费		316,242.54	222,154.74
应付销售服务费		1,581,212.96	1,110,773.73
应付投资顾问费		-	-
应交税费		8,341.37	48,709.15
应付利润		12,411,947.24	8,868,952.27
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	272,779.35	267,724.10
负债合计		18,279,727.94	14,517,099.44
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	6,821,517,878.62	4,929,124,356.67
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		6,821,517,878.62	4,929,124,356.67
负债和净资产总计		6,839,797,606.56	4,943,641,456.11

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 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 6,821,517,878.62 份。

## 7.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		109,619,838.18	66,589,573.16
1. 利息收入		16,068,235.32	11,228,831.76
其中：存款利息收入	7.4.7.13	4,800,120.68	8,034,465.05
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		11,268,114.64	3,194,366.71
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		93,551,602.86	55,360,741.40
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	93,551,602.86	55,360,741.40
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	-	-
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）	7.4.7.20	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		63,262,468.98	39,020,727.38
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	43,513,662.42	28,373,664.70
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,147,182.91	1,581,267.03
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	15,735,913.70	7,906,335.44
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		575,109.81	873,675.35
其中：卖出回购金融资产支出		575,109.81	873,675.35
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		7,346.51	8,367.31

8. 其他费用	7. 4. 7. 23	283, 253. 63	277, 417. 55
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46, 357, 369. 20	27, 568, 845. 78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46, 357, 369. 20	27, 568, 845. 78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46, 357, 369. 20	27, 568, 845. 78

### 7.3 净资产变动表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	4, 929, 124, 356. 67	-	-	4, 929, 124, 356. 67
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	4, 929, 124, 356. 67	-	-	4, 929, 124, 356. 67
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1, 892, 393, 521. 95	-	-	1, 892, 393, 521. 95
（一）、综合收益总额	-	-	46, 357, 369. 20	46, 357, 369. 20
（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, 892, 393, 521. 95	-	-	1, 892, 393, 521. 95
其中：1. 基金申购款	183, 454, 437, 581. 32	-	-	183, 454, 437, 581. 32
2. 基金赎回款	-181, 562, 044, 0	-	-	-181, 562, 044, 05

	59.37			9.37
(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)	-	-	-46,357,369.20	-46,357,369.20
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	6,821,517,878.62	-	-	6,821,517,878.62
项目	上年度可比期间			
	2024年1月1日至2024年12月31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)	3,057,598,967.59	-	-	3,057,598,967.59
(一)、综合收益总额	-	-	27,568,845.78	27,568,845.78
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	3,057,598,967.59	-	-	3,057,598,967.59
其中：1. 基金申购款	87,803,889,338.69	-	-	87,803,889,338.69
2. 基金赎回款	-84,746,290,371.10	-	-	-84,746,290,371.10

（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）	-	-	-27,568,845.78	-27,568,845.78
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	4,929,124,356.67	-	-	4,929,124,356.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>刘宇</u>	<u>杨华</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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金（以下简称“本基金”）由兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册而来，兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划由兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划变更而来，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。2022 年 10 月 11 日，兴证资管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货币型集合资产管理计划。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》等法律法规的规定，本基金经中国证监会《关于准予兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册的批复》（证监许可〔2025〕1366 号文）注册。《兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金基金合同》于 2025 年 8 月 25 日起生效，原《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》同日起失效。

本基金为契约性开放式，存续期限为不定期。本基金的基金管理人为兴证证券资产管理有限公司，登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为中国证券登记结算有限责任公司。

本基金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。

本基金的业绩比较基准为：活期存款利率（税后）。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

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

-本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；

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

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

#### (b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

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

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

(b) 金融工具的后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

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

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

-该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

-所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

-因转移金融资产而收到的对价。

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

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

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

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

#### 预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

#### 核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人

没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，基金管理人应当在 5 个交易日内将负偏离度绝对值调整到 0.25%以内。当正偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当暂停接受申购并在 5 个交易日内将正偏离度绝对值调整到 0.5%以内。当负偏离度绝对值达到 0.5%时，基金管理人应当使用风险准备金或者固有资金弥补潜在资产损失，将负偏离度绝对值控制在 0.5%以内。当负偏离度绝对值连续两个交易日超过 0.5%时，基金管理人应当采用公允价值估值方法对持有投资组合的账面价值进行调整，或者采取暂停接受所有赎回申请并终止基金合同进行财产清算等措施。

计算影子价格时遵循如下原则：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

-本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；

-本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

#### 7.4.4.9 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

#### 7.4.4.10 基金的收益分配政策

- 1、本基金每份基金份额享有同等分配权；
- 2、本基金收益支付方式为现金分红；
- 3、“每日计算、按季支付”：本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，且每季集中支付；
- 4、本基金根据每日暂估收益情况，将当日暂估收益计入投资人账户，若当日暂估净收益大于零时，为投资人记正收益；若当日暂估净收益小于零时，为投资人记负收益；若当日暂估净收益等于零时，当日投资人不记收益；法律法规或监管机构另有规定的从其规定；
- 5、本基金收益每季度集中支付一次，每季度收益支付方式采用现金分红方式。投资人赎回基金份额时，不支付其累计未付收益，将在季度分红日以现金分红方式与投资者结清。若当季累计未付收益为正，则为投资者支付相应的现金收益；若当季累计未付收益为零，则不支付现金收益；

若当季累计未付收益为负，为投资者缩减其相应份额。遇投资者剩余基金份额不足以扣减的情形，基金管理人将启动内部应急机制保障基金平稳运行；

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、投资者解约情形下，基金管理人将按照同期中国人民银行公布的活期存款基准利率支付收益，该投资者实际投资收益与支付收益的差额部分计入基金资产；

8、法律法规或监管机构另有规定的从其规定。

#### 7.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

#### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

### 7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46

号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	10,745,034.16	106,048,229.88
等于：本金	10,743,032.56	105,760,531.69
加：应计利息	2,001.60	287,698.19
减：坏账准备	-	-
定期存款	311,595,556.80	80,299,097.40
等于：本金	310,000,000.00	80,000,000.00
加：应计利息	1,595,556.80	299,097.40

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	311,595,556.80	80,299,097.40
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	322,340,590.96	186,347,327.28

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	6,167,351,407.05	6,168,292,139.74	940,732.69	0.0138
	合计	6,167,351,407.05	6,168,292,139.74	940,732.69	0.0138
资产支持证券		-	-	-	-
合计		6,167,351,407.05	6,168,292,139.74	940,732.69	0.0138
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	4,176,006,580.56	4,180,679,753.42	4,673,172.86	0.0948
	合计	4,176,006,580.56	4,180,679,753.42	4,673,172.86	0.0948
资产支持证券		-	-	-	-
合计		4,176,006,580.56	4,180,679,753.42	4,673,172.86	0.0948

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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

##### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

**7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

**7.4.7.4 买入返售金融资产****7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-	-
银行间市场	350,105,608.55	-
合计	350,105,608.55	-
项目	上年度末 2024年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	49,993,062.06	-
银行间市场	470,051,760.37	-
合计	520,044,822.43	-

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末及上年度末未通过买断式逆回购交易取得债券。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

本基金本报告期末及上年度末未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

**7.4.7.5 债权投资****7.4.7.5.1 债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

**7.4.7.6 其他债权投资****7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

**7.4.7.7 其他权益工具投资****7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具投资。

#### 7.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	53,479.35	58,424.10
其中：交易所市场	-	17,444.68
银行间市场	53,479.35	40,979.42
应付利息	-	-
预提费用	219,300.00	209,300.00
合计	272,779.35	267,724.10

#### 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,929,124,356.67	4,929,124,356.67
本期申购	183,454,437,581.32	183,454,437,581.32
本期赎回（以“-”号填列）	-181,562,044,059.37	-181,562,044,059.37
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	6,821,517,878.62	6,821,517,878.62

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期及上年度可比期间无其他综合收益。

#### 7.4.7.12 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	46,357,369.20	-	46,357,369.20
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	-46,357,369.20	-	-46,357,369.20
本期末	-	-	-

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
活期存款利息收入	2,001,751.08	7,629,209.72
定期存款利息收入	2,795,698.30	299,097.40
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	2,671.30	106,157.93
其他	-	-
合计	4,800,120.68	8,034,465.05

注：其他包括保证金利息收入。

#### 7.4.7.14 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	92,477,884.67	54,821,436.26
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,073,718.19	539,305.14
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	93,551,602.86	55,360,741.40

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,875,261,561.82	5,566,630,784.31
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,852,939,186.24	5,550,795,922.14
减：应计利息总额	21,248,627.39	15,295,557.03
减：交易费用	30.00	-
买卖债券差价收入	1,073,718.19	539,305.14

#### 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

#### 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

##### 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

##### 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

#### 7.4.7.17 贵金属投资收益

##### 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

##### 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

贵金属暂不属于本基金的投资范围，故此项不适用。

**7.4.7.18 衍生工具收益****7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间未进行衍生工具买卖交易。

**7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间未进行衍生工具买卖交易。

**7.4.7.19 股利收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无股利收益。

**7.4.7.20 公允价值变动收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无公允价值变动收益。

**7.4.7.21 其他收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无其他收入。

**7.4.7.22 信用减值损失**

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

**7.4.7.23 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	90,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	36,053.63	40,217.55
银行间账户维护费	37,200.00	37,200.00
合计	283,253.63	277,417.55

**7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明****7.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

**7.4.8.2 资产负债表日后事项**

本基金于2026年1月6日实施2026年第1次收益支付，收益累计期间为自2025年10月10

日至 2026 年 1 月 5 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份额持有人进行现金分红。

#### 7.4.9 关联方关系

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”）	基金管理人
中国证券登记结算有限责任公司（“中国结算”）	基金托管人
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	基金管理人的股东、基金销售机构
兴证期货有限公司（“兴证期货”）	基金管理人的股东的子公司
兴证全球基金管理有限公司（“兴证基金”）	基金管理人的股东的子公司
兴证投资管理有限公司（“兴证投资”）	基金管理人的股东的子公司
福州兴证物业管理有限公司	基金管理人的股东的子公司
兴证（香港）金融控股有限公司（“兴证香港”）	基金管理人的股东的子公司
兴证创新资本管理有限公司（“兴证资本”）	基金管理人的股东的子公司
兴证国际金融集团有限公司（“兴证国际”）	同受基金管理人控股股东控制

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

本基金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。

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	998,000,000.00	100.00	12,977,184,000.00	100.00

#### 7.4.10.1.4 权证交易

本基金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。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31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	1,693.00	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	46,742.63	100.00	17,444.68	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基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	43,513,662.42
其中：应支付销售机构的客户维护 费	21,040,409.11	13,407,861.78
应支付基金管理人的净管理费	22,473,253.31	14,965,802.92

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的【0.70】%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 【0.70】\% \div \text{当年天数}$$

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

当以 0.70% 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，基金管理人将调整管理费为 0.30%，以降低每万份基金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，基金管理人方可恢复计提 0.70% 的管理费。基金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。

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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,147,182.91	1,581,267.03

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的【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。

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 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	15,735,913.70
合计	15,735,913.70
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	7,906,335.44
合计	7,906,335.44

注：本基金的销售服务费按前一日基金资产净值的【0.25】%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 【0.25】\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金销售服务费

E 为前一日的基金资产净值

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金合同生效日(2022年10月11日)持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	100,004,054.11	0.00
报告期间申购/买入总份额	-	100,004,054.11
报告期间因拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	100,004,054.11	-
报告期末持有的基金份额	0.00	100,004,054.11
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	2.0288%

注:本报告期内,本基金管理人投资本基金的适用费率符合本基金招募说明书和相关公告的规定。

##### 7.4.10.4.2 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		上年度末	
	2025年12月31日		2024年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
兴业证券股份有限公司	55,908,000.00	0.8196	39,395,000.00	0.7992

##### 7.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国结算	7,425,505.56	17,024.81	13,413,424.55	636,555.70

注:本基金的银行存款由本基金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。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联方交易事项。

#### 7.4.11 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
-	3,803,010.38	42,554,358.82	46,357,369.20	-

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场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。

###### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事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。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本基金为货币型证券投资基金，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均低于股票型证券投资基金、混合型证券投资基金、债券型证券投资基金。本基金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，在不改变基金投资目标、投资策略及风险收益特征的前提下，在履行适当程序后，本基金可参与其他货币市场工具的投资。本基金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。本基金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。

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人实施全面风险管理，由公司董事会、经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、及时报告、妥善应对及全程管理。本基金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。

本基金管理人建立组织架构健全、职责边界清晰的风险管理组织架构，明确董事会及其下设风险控制委员会、董事会下设审计委员会、经理层及其下设风险管理委员会、首席风险官，以及各部门、风险管理部门在全面风险管理中的职责分工，建立各部门、风险管理部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

本基金管理人确立风险管理三道防线，即各部门及全体员工实施有效自我控制为第一道防线，风险管理人员在事前和事中实施专业的风险管理为第二道防线，内控稽核人员实施事后监督、评价为第三道防线。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金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，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金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。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金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；基金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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	50,215,178.08
A-1 以下	-	-
未评级	666,374,940.12	281,929,913.69
合计	666,374,940.12	332,145,091.77

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的

其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。债券投资以全价列示。

2、未评级部分为企业短期融资债券、超短期融资债券、政策性金融债等。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,449,453,270.92	3,526,613,066.20
合计	5,449,453,270.92	3,526,613,066.20

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。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	51,523,196.01	317,248,422.59
合计	51,523,196.01	317,248,422.59

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。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金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。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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基金资产的比例并进行动态调整，以满足本基金运作过程中的流动性要求，应对流动性风险。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人在基金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》等法规的要求对本基金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基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短期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。

本基金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。本基金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：本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家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%；本基金管理人管理的全部投资组合持有一家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，本基金的管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金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。

本基金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。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	30,956,588.72	191,024,848.81	100,359,153.43	-	-	-	322,340,590.96
交易性金融资产	1,049,289,920.86	1,707,901,906.86	3,410,159,579.33	-	-	-	6,167,351,407.05
买入返售金融资产	350,105,608.55	-	-	-	-	-	350,105,608.55
资产总计	1,430,352,118.13	1,898,926,755.67	3,510,518,732.76	-	-	-	6,839,797,606.56
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,689,204.48	3,689,204.48
应付托管费	-	-	-	-	-	316,242.54	316,242.54
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,581,212.96	1,581,212.96
应付利润	-	-	-	-	-	12,411,947.24	12,411,947.24
应交税费	-	-	-	-	-	8,341.37	8,341.37
其他负债	-	-	-	-	-	272,779.35	272,779.35
负债总计	-	-	-	-	-	18,279,727.94	18,279,727.94
利率敏感度缺口	1,430,352,118.13	1,898,926,755.67	3,510,518,732.76	-	-	-18,279,727.94	6,821,517,878.62
上年度末 2024年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	106,048,229.88	80,299,097.40	-	-	-	-	186,347,327.28
结算备付金	3,225,405.29	-	-	-	-	-	3,225,405.29
交易性金融资产	410,207,404.22	1,150,065,178.48	2,615,733,997.86	-	-	-	4,176,006,580.56
买入返售金融资产	520,044,822.43	-	-	-	-	-	520,044,822.43
应收清算款	-	-	-	-	-	58,017,320.55	58,017,320.55

资产总计	1,039,525,861.82	1,230,364,275.88	2,615,733,997.86	-	-	58,017,320.55	4,943,641,456.11
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,998,785.45	3,998,785.45
应付托管费	-	-	-	-	-	222,154.74	222,154.74
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,110,773.73	1,110,773.73
应付利润	-	-	-	-	-	8,868,952.27	8,868,952.27
应交税费	-	-	-	-	-	48,709.15	48,709.15
其他负债	-	-	-	-	-	267,724.10	267,724.10
负债总计	-	-	-	-	-	14,517,099.44	14,517,099.44
利率敏感度缺口	1,039,525,861.82	1,230,364,275.88	2,615,733,997.86	-	-	43,500,221.11	4,929,124,356.67

注：表中所示为本基金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。

#### 7.4.13.4.1.2 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（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	市场利率+1%	-20,410,319.73	-14,918,634.19
	市场利率-1%	20,618,260.03	15,060,099.24

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基金净值产生的影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 7.4.13.4.3 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。本基金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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

不受除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动影响的资产（包括债券、资产支持证券等）不填报其他价格风险敞口。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

本基金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。

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属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。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	6,167,351,407.05	4,176,006,580.56
第三层次	-	-
合计	6,167,351,407.05	4,176,006,580.56

##### 7.4.14.2.2 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，本基金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。

##### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

###### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动(上年度可比期间：无)。

###### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

于 2025 年 12 月 31 日，本基金无使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况(2024 年 12 月 31 日：无)。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	固定收益投资	6,167,351,407.05	90.17
	其中：债券	6,167,351,407.05	90.17
	资产支持证 券	-	-
2	买入返售金融资产	350,105,608.55	5.12
	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	322,340,590.96	4.71
4	其他各项资产	-	-
5	合计	6,839,797,606.56	100.00

### 8.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
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 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

在本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 8.3 基金投资组合平均剩余期限

#### 8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	116
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	120
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	93

#### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本基金未发生投资组合平均期限超过 120 天的情况。

#### 8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产	各期限负债占基金资产
----	--------	------------	------------

		净值的比例 (%)	净值的比例 (%)
1	30 天以内	18.03	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
2	30 天（含）—60 天	15.37	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
3	60 天（含）—90 天	13.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
4	90 天（含）—120 天	17.54	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
5	120 天（含）—397 天（含）	35.59	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的 浮动利率债	-	-
	合计	100.13	-

#### 8.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	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	435,917,538.05	6.39
	其中：政策性 金融债	435,917,538.05	6.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融 资券	281,980,598.08	4.13
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,449,453,270.92	79.89
8	其他	-	-
9	合计	6,167,351,407.05	90.41
10	剩余存续期 超过 397 天的 浮动利率债 券	-	-

#### 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资 明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	按实际利率计算的 账面价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	250206	25 国开 06	3,800,000	384,394,342.04	5.64
2	112502012	25 工商银行 CD012	2,000,000	199,862,866.06	2.93
3	112517091	25 光大银行 CD091	2,000,000	199,618,216.49	2.93
4	112509089	25 浦发银行 CD089	2,000,000	199,252,738.31	2.92
5	112522026	25 邮储银行 CD026	2,000,000	199,039,407.13	2.92
6	112504020	25 中国银行 CD020	2,000,000	198,672,754.30	2.91
7	112504017	25 中国银行 CD017	1,500,000	149,229,667.81	2.19
8	012581278	25 上海医药 SCP002	1,000,000	100,857,178.89	1.48
9	112502010	25 工商银行 CD010	1,000,000	99,941,507.49	1.47
10	112512006	25 北京银行 CD006	1,000,000	99,938,935.77	1.47

### 8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.0956%
报告期内偏离度的最低值	-0.0775%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0256%

#### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

报告期内本基金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

报告期内本基金未发生正偏离度的绝对值达到 0.5% 的情况。

### 8.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

### 8.9 投资组合报告附注

#### 8.9.1 基金计价方法说明

本基金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。

### 8.9.2 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本基金投资的前十名证券的发行主体中，国家开发银行、中国工商银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国邮政储蓄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。

除上述主体外，本基金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。

### 8.9.3 期末其他各项资产构成

本基金本报告期末未持有其他资产。

### 8.9.4 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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 (%)
41,553	164,164.27	426,921,220.54	6.26	6,394,596,658.08	93.74

### 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
1	个人	169,141,034.17	2.48
2	个人	141,257,623.20	2.07
3	机构	75,521,108.07	1.11
4	个人	64,584,795.14	0.95
5	个人	63,789,498.51	0.94
6	机构	62,684,837.44	0.92
7	机构	55,908,000.00	0.82
8	个人	45,289,399.18	0.66
9	机构	36,244,157.32	0.53
10	个人	34,712,085.89	0.51

### 9.3 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	1,390.54	0.0000

**9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况**

项目	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

**9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况**

本报告期内，本基金基金经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

**§ 10 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	4,929,124,356.67
本报告期基金总申购份额	183,454,437,581.32
减：本报告期基金总赎回份额	181,562,044,059.37
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,821,517,878.62

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。

**§ 11 重大事件揭示****11.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

**11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动如下：

2025年3月3日起，宋琳女士担任本公司合规总监、首席风险官，孙国雄先生不再代为履行公司合规总监、首席风险官职务；

2025年3月28日起，杨华先生担任本公司总裁，孙国雄先生不再代为履行总裁职务；

2025年3月28日起，郑方镛先生担任本公司副总裁；

2025年5月20日起，刘宇先生担任本公司董事长，孙国雄先生不再担任本公司董事长职务；

2025年9月24日，刘宇先生担任本公司法定代表人。

本报告期内，本托管人的专门基金托管部门负责人由方堃先生变更为朱立元先生。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金管理人未改聘会计师事务所。本基金聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金提供审计服务。本报告年度的审计费用为 90,000.00 元。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的高级管理人员、本基金的基金经理等相关从业人员未受到监管部门稽查或处罚。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本托管人无受调查或处罚等情况。

#### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
兴业证券	2	-	-	1,693.00	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；具备本基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本基金进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本基金提供研究服务支持；佣金费率合理；本基金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：本基金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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

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	-	-	998,000,000.00	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；具备本基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本基金进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本基金提供研究服务支持；佣金费率合理；本基金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：本基金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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

### 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

### 11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2025-1-3
2	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-1-9
3	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-1-10
4	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-1-16
5	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-1-17

6	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 4 季度报告	规定网站	2025-1-22
7	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-1-31
8	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-1
9	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-8
10	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-8
11	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-15
12	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-15
13	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-22
14	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-2-22
15	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-1
16	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-1
17	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2025-3-5
18	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-8
19	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-8
20	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-15
21	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-15
22	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-22
23	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-22
24	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2025-3-29
25	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-29
26	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-3-29
27	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2024 年年度报告	规定网站	2025-3-31

28	兴证证券资产管理公司旗下公募产品通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	规定网站	2025-3-31
29	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	2025-4-2
30	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-5
31	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-5
32	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-12
33	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-12
34	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-18
35	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-19
36	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-19
37	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-19
38	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-4-22
39	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-25
40	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-26
41	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-26
42	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-4-26
43	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-9
44	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-10
45	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-10
46	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-10
47	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-16
48	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-17
49	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-17

50	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-17
51	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2025-5-22
52	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-23
53	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-24
54	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-24
55	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-24
56	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（2025 年第 1 号）	规定网站	2025-5-28
57	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（2025 年第 1 号）	规定网站	2025-5-28
58	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-30
59	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-31
60	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-31
61	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-5-31
62	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-6
63	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-7
64	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-7
65	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-7
66	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-13
67	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-14
68	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-14
69	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-14
70	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-20
71	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-21

72	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-21
73	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-21
74	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-28
75	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-6-28
76	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	2025-7-2
77	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-4
78	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-5
79	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-5
80	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-5
81	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-9
82	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-10
83	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	2025-7-15
84	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-15
85	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-16
86	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-18
87	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-19
88	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2025 年第 2 季度报告	规定网站	2025-7-21
89	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-22
90	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-23
91	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-25
92	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-26
93	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-29

94	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-7-30
95	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分基金开通定投业务的公告	规定网站、规定报刊	2025-7-30
96	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-1
97	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-2
98	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-5
99	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-6
100	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-8
101	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-9
102	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-12
103	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-13
104	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册的提示性公告	规定网站、规定报刊	2025-8-13
105	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-14
106	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-15
107	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-16
108	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-16
109	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-19
110	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册为兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金的公告	规定网站、规定报刊	2025-8-20
111	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金招募说明书	规定网站	2025-8-20
112	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金基金产品资料概要	规定网站	2025-8-20
113	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金托管协议	规定网站	2025-8-20
114	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金基金合同	规定网站	2025-8-20
115	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-20
116	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-21
117	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-22

118	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-23
119	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-23
120	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-26
121	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-8-27
122	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2025 年中期报告	规定网站	2025-8-30
123	关于兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金快速取现的公告	规定网站、规定报刊	2025-9-2
124	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-2
125	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-3
126	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-9
127	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-10
128	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-16
129	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-18
130	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-23
131	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-9-25
132	兴证证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	规定网站、规定报刊	2025-9-26
133	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-1
134	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-1
135	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-6
136	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-7
137	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金收益支付公告	规定网站、规定报刊	2025-10-10
138	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-14
139	关于兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金快速取现的公告	规定网站、规定报刊	2025-10-15

140	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-16
141	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-21
142	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-23
143	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2025 年第 3 季度报告	规定网站	2025-10-28
144	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-28
145	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-10-30
146	兴证证券资产管理有限公司关于旗下大集合产品变更注册为公募基金进展情况的公告	规定网站、规定报刊	2025-10-30
147	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-4
148	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-6
149	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-11
150	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-13
151	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-18
152	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-20
153	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-25
154	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-11-27
155	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-2
156	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-4
157	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-9
158	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-11
159	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-16
160	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-18
161	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-23
162	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率公告	规定网站、规	2025-12-25

	费率公告	定报刊	
163	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金管理费率适用费率公告	规定网站、规定报刊	2025-12-30

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

- 1、2025 年 3 月 3 日起，宋琳女士担任本公司合规总监、首席风险官，孙国雄先生不再代为履行公司合规总监、首席风险官职务。
- 2、2025 年 3 月 28 日起，杨华先生担任本公司总裁，孙国雄先生不再代为履行总裁职务。
- 3、2025 年 3 月 28 日起，郑方镡先生担任本公司副总裁。
- 4、2025 年 5 月 20 日起，刘宇先生担任本公司董事长，孙国雄先生不再担任本公司董事长职务。
- 5、2025 年 8 月 20 日，管理人发布《关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册为兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金的公告》。
- 6、2025 年 9 月 24 日，公司法定代表人变更为刘宇先生。
- 7、2025 年 10 月 31 日，管理人发布《兴证证券资产管理有限公司关于旗下大集合产品变更注册为公募基金进展情况的公告》，公司旗下大集合产品已于 2025 年 10 月 30 日全部完成变更注册。
- 8、2026 年 2 月 27 日起，刘宇先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，宋琳女士不再担任本公司公募基金管理业务合规负责人。2026 年 3 月 3 日起，翁建国先生担任本公司合规总监、首席风险官。宋琳女士不再担任本公司合规总监、首席风险官。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划变更注册的批复文件；
- 2、《兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金基金合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金招募说明书》；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金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。

### 13.2 存放地点

本基金管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼）

### 13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人的网站（<http://www.ixzzcgl.com>）查询，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

兴证证券资产管理有限公司

2026 年 3 月 31 日