# 兴全添利宝货币市场基金
# 2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

# §1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 07 月 01 日起至 09 月 30 日止。

# §2 基金产品概况

| | |
|---|---|
| 基金简称 | 兴全添利宝货币 |
| 基金主代码 | 000575 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 2 月 27 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 202,039,658,255.62 份 |
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 根据宏观形势、利率走势等因素，确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标，并在这些指标要求的基础上构建投资组合；进行主动投资，有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金 |
| 基金管理人 | 兴证全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日） |
|---|---|

| | |
|---|---|
| 1.本期已实现收益 | 489,441,889.46 |
| 2.本期利润 | 489,441,889.46 |
| 3.期末基金资产净值 | 202,039,658,255.62 |

注：1、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。

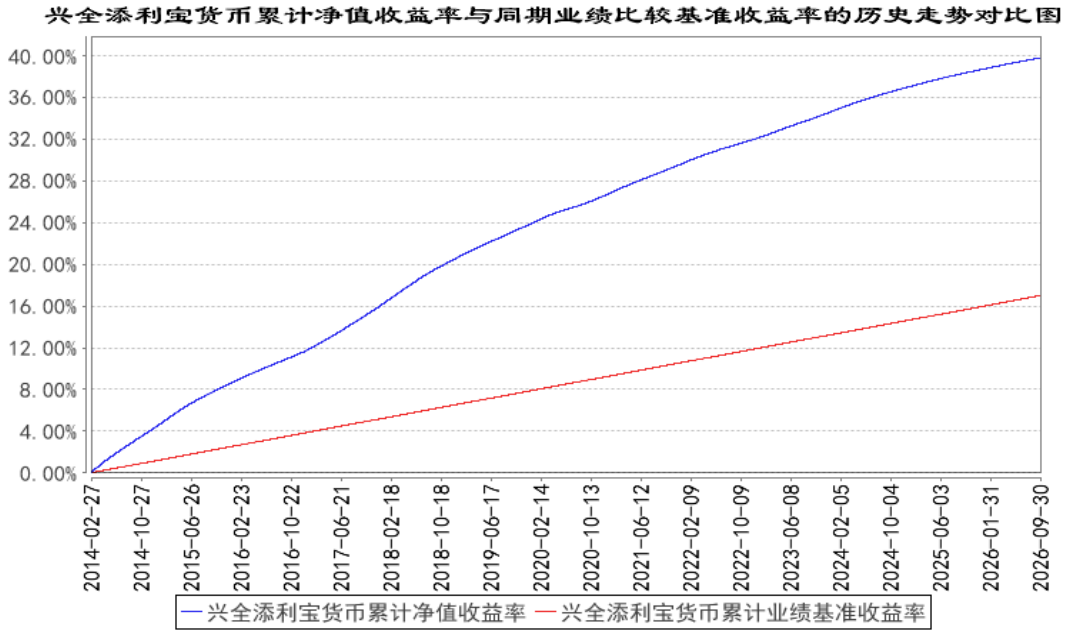
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购赎回费、红利再投资费、基金转换费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

## 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 | 净值收益率① | 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 | 0.2352% | 0.0002% | 0.3403% | 0.0000% | -0.1051% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.4954% | 0.0002% | 0.6768% | 0.0000% | -0.1814% | 0.0002% |
| 过去一年 | 1.0462% | 0.0002% | 1.3500% | 0.0000% | -0.3038% | 0.0002% |
| 过去三年 | 4.3061% | 0.0010% | 4.0537% | 0.0000% | 0.2524% | 0.0010% |
| 过去五年 | 8.4359% | 0.0012% | 6.7537% | 0.0000% | 1.6822% | 0.0012% |
| 过去七年 | 13.5760% | 0.0014% | 9.4574% | 0.0000% | 4.1186% | 0.0014% |
| 过去十年 | 26.0568% | 0.0026% | 13.5074% | 0.0000% | 12.5494% | 0.0026% |
| 自基金合同生效起至今 | 39.8270% | 0.0033% | 17.0100% | 0.0000% | 22.8170% | 0.0033% |

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较




注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2014 年 02 月 27 日起共计六个月。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 翟秀华 | 固定收益部副总监、基础设施投资部副总监，兴全添利宝货币市场基金、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金、兴全恒利一年定期开放债券型发 | 2016 年 3 月 17 日 | - | 16 年 | 硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴证全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理、兴全祥泰定开债券发起式基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理。 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 起式证券投资基金、兴全兴裕混合型证券投资基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全恒泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴全磐盈债券型证券投资基金基金经理 | | | | |
| 邓娟 | 兴全添利宝货币市场基金基金经理、兴全恒利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴全恒嘉 30 天持有期债券型证券投资基金基金经理、兴全恒荣债券型证券投资基金基金经理 | 2019 年 6 月 26 日 | - | 11 年 | 硕士。历任兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员、交易员，兴全添利宝货币市场基金基金经理助理、兴全天添益货币市场基金基金经理助理和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理助理、兴全货币市场基金基金经理、兴证全球恒远债券型证券投资基金基金经理基金经理。 |

注：1、职务指截止报告期末的职务（报告期末仍在任的）或离任前的职务（报告期内离任的）。

2、任职日期指基金合同生效之日（基金成立时即担任基金经理）或公司作出聘任决定之日（基金成立后担任基金经理）；离任日期指公司作出解聘决定之日。

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

## 4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券投资基金法》及其各项实施细则、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责、取信于市场、取信于社会的原则管理和运用基金资产，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金投资管理符合有关法规和基金合同的规定，无违法违规、未履行基金合同承诺或损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 公平交易专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司相关制度等规定，从投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等环节严格把关，确保各投资组合之间得到公平对待，保护投资者的合法权益。公司风险管理部对公司管理的不同投资组合的整体收益率差异进行统计，从不同的角度分析差异的来源、考察是否存在非公平的因素。

本报告期内公司旗下基金严格遵守公司的公平交易制度，未发现违反公平交易原则的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，不存在本投资组合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 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，国内经济运行在偏弱区间，外需强于内需，国内融资需求仍待改善。货币政策维持宽松，财政刺激以托底为主。在此期间，资金面充裕，短端资金价格平稳，货币类资产收益低位运行震荡，波动不大。

本基金在运作期内，力争在保持高流动性和安全性的基础上，较灵活使用久期和杠杆，为投资人提供较好的收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期，兴全添利宝货币的基金份额净值增长率为 0.2352%，同期业绩比较基准收益率为 0.3403%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

## §5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 固定收益投资 | 38,417,753,445.26 | 18.18 |
| | 其中：债券 | 38,417,753,445.26 | 18.18 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 39,885,056,823.76 | 18.87 |
| | 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 | 133,041,372,127.09 | 62.95 |
| 4 | 其他资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 211,344,182,396.11 | 100.00 |

### 5.2 报告期债券回购融资情况

| 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 | 2.92 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | 9,210,337,788.38 | 4.56 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每日融资余额占资产净值比例的简单平均值，故金额处不予填列。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

注：在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

### 5.3 基金投资组合平均剩余期限

### 5.3.1 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 | 113 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 99 |

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内未发生投资组合平均期限超过 120 天的情况。

### 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 30 天以内 | 24.60 | 4.56 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 8.77 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 21.52 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 8.65 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 40.78 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 104.32 | 4.56 |

### 5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

注：本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

### 5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 4,379,119,994.75 | 2.17 |
| | 其中：政策性金融债 | 1,880,257,341.02 | 0.93 |
| 4 | 企业债券 | 10,033,198.90 | 0.00 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,828,840,046.97 | 0.91 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 32,199,760,204.64 | 15.94 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 38,417,753,445.26 | 19.01 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

### 5.6 报告期末按公允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

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 112680012 | 26 长沙银行 CD148 | 15,000,000 | 1,496,613,897.08 | 0.74 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 2 | 112605224 | 26 建设银行 CD224 | 15,000,000 | 1,492,962,974.02 | 0.74 |
| 3 | 112605227 | 26 建设银行 CD227 | 15,000,000 | 1,492,903,209.34 | 0.74 |
| 4 | 112603100 | 26 农业银行 CD100 | 15,000,000 | 1,491,767,597.62 | 0.74 |
| 5 | 112605240 | 26 建设银行 CD240 | 12,000,000 | 1,193,989,438.55 | 0.59 |
| 6 | 112617083 | 26 光大银行 CD083 | 11,000,000 | 1,084,001,230.59 | 0.54 |
| 7 | 112603104 | 26 农业银行 CD104 | 10,000,000 | 998,167,071.89 | 0.49 |
| 8 | 112698411 | 26 中原银行 CD124 | 9,000,000 | 896,000,323.83 | 0.44 |
| 9 | 220203 | 22 国开 03 | 7,200,000 | 735,044,963.86 | 0.36 |
| 10 | 112603108 | 26 农业银行 CD108 | 6,000,000 | 598,869,322.43 | 0.30 |

## 5.7 “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 | 0.0044% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0013% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0010% |

### 报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

注：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

注：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。

## 5.8 报告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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本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，长沙银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中原银行股份有限公司具有在报

告编制日前一年内受到监管部门处罚的情况；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

前十名证券的发行主体中，未见其他发行主体有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。

### 5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | - |

### 5.9.4 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。

## §6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---|---|
| 报告期期初基金份额总额 | 213,041,273,319.73 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 319,545,211,577.88 |
| 报告期期间基金总赎回份额 | 330,546,826,641.99 |
| 报告期期末基金份额总额 | 202,039,658,255.62 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

| 序号 | 交易方式 | 交易日期 | 交易份额(份) | 交易金额(元) | 适用费率(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 红利再投 | 2026-07-31 | 61,490.89 | 0.00 | - |
| 2 | 红利再投 | 2026-08-31 | 58,099.19 | 0.00 | - |
| 3 | 赎回 | 2026-09-30 | -67,467.93 | -67,467.93 | 0.0000 |
| 4 | 红利再投 | 2026-09-30 | 55,431.31 | 0.00 | - |
| 5 | 红利再投 | 2026-09-30 | 212.64 | - | - |
| 合计 | | | 107,766.10 | -67,467.93 | |

注：1、“交易日期”为交易确认日或红利再投资确认日。

2、因本基金收益分配按日结转份额，上表中“红利再投资”数据为当月汇总数据。

# §8 影响投资者决策的其他重要信息

## 8.1 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：1、“申购金额”包含份额申购、转换转入、分红再投资等导致投资者持有份额增加的情形。

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

# §9 备查文件目录

## 9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金募集注册的文件；

2、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》；

3、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》；

4、关于申请募集基金之法律意见；

5、基金管理人业务资格批件和营业执照；

6、基金托管人业务资格批件和营业执照；

7、中国证监会要求的其他文件。

## 9.2 存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

## 9.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（http://www.xqfunds.com）查阅，或在营业时间内至基

金管理人、基金托管人住所免费查阅。

基金管理人客户服务中心电话：400-678-0099，021-38824536

**兴证全球基金管理有限公司**

**2026 年 10 月 27 日**