

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产  
管理计划  
2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 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

报告送出日期：2023 年 10 月 25 日

## § 1 重要提示

集合计划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。

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 2023 年 10 月 23 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。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	兴证资管金麒麟现金添利货币
交易代码	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
报告期末基金份额总额	1,810,350,977.16 份
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。
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

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。

### § 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(2023年7月1日—2023年9月30日)
1. 本期已实现收益	6,480,667.20

2. 本期利润	6,480,667.20
3. 期末基金资产净值	1,810,350,977.16

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。

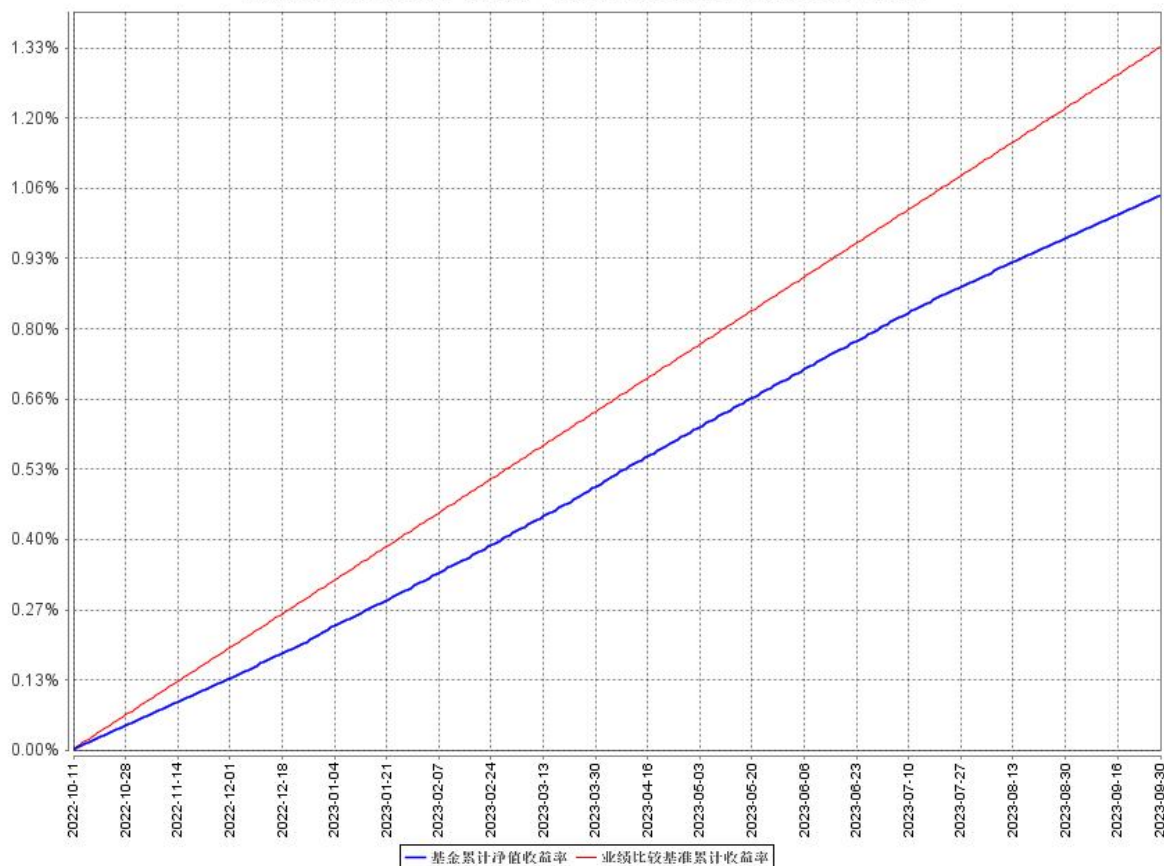
## 3.2 基金净值表现

### 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	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	0.2543%	0.0003%	0.3450%	0.0000%	-0.0907%	0.0003%
过去六个月	0.5487%	0.0003%	0.6863%	0.0000%	-0.1376%	0.0003%
自基金合同生效起至今	1.0508%	0.0003%	1.3312%	0.0000%	-0.2804%	0.0003%

### 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

基金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：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 9 月 30 日。
- 2、本集合计划合同于 2022 年 10 月 11 日生效，至报告期末未满一年。
- 3、截止本报告期末，本集合计划建仓已完成，建仓期结束时各项资产配置比例符合集合计划合同约定。

## § 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		
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	-	11	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。

### 4.2 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 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，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定，遵循各项内部风险控制制度和流程，通过系统和人工相结合的方式在各环节严格控制交易的公平执行。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保各投资组合之间得到公平对待，切实防范利益输送行为，保护投资者合法权益。

#### 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 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面方面，三季度以来，经济逐步修复，7 月至 9 月 PMI 分别为 49.3、49.7、50.2，逐步回到荣枯线上。8 月新增社融 3.12 万亿，处于同期偏高水平，同比多增 6488 亿，存量同比由 8.9% 回升至 9%。货币政策方面，央行公告于 8 月 15 日分别降低公开市场操作 7 天逆回购利率 10bp，中期借贷便利 MLF 利率 15bp，并决定于 9 月 15 日下调金融机构存款准备金率 0.25 个百分点，释放 5000 亿-6000 亿资金。市场方面，三季度资金整体维持中性均衡的态势，流动性合理充裕，整体表现为供需较为均衡，但 8 月下旬、9 月资金价格略高，DR007 季度平均略高于政策利率，季末因逢双节假期长，跨季价格涨幅较大。现券方面，10 年国债波动中先下后上，累计上行 6bp。1 年期国股存单收益率自 2.31% 下行至降息后最低达到 2.21%，后上行，季末上行至 2.52%。组合操作方面，三季度组合资产根据组合规模波动灵活调整平均剩余期限，并在短端资产调整之前逐步调降剩余期限。同时在短端资产震荡时配合波段交易，在符合外规要求及保证账户日常流动性需求的前提下，力争提升组合收益。

### 4.5 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增长率为 0.2543%，业绩比较基准收益率为 0.3450%。

### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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 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	1,773,813,901.02	90.81
	其中：债券	1,773,813,901.02	90.81
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	120,130,140.11	6.15
	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	59,352,663.74	3.04
4	其他资产	8,001.71	0.00
5	合计	1,953,304,706.58	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	0.32	
	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	134,043,763.17	7.40
	其中：买断式回购融资	-	-

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20% 的说明

本报告期内未发生债券正回购资金余额超过集合计划资产净值 20% 的情况。

### 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	98
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	100
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	79

## 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	20.38	7.40
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)-60 天	17.09	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)-90 天	21.99	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)-120 天	12.12	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)-397 天(含)	36.16	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	107.74	7.40

## 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

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	摊余成本(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	153,483,613.47	8.48
	其中：政策性金融债	153,483,613.47	8.48
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	40,085,136.61	2.21
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,580,245,150.94	87.29
8	其他	-	-
9	合计	1,773,813,901.02	97.98
10	剩余存续期超过 397 天的浮动	-	-



	利率债券		
--	------	--	--

### 5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	112217185	22 光大银行 CD185	500,000	49,946,366.11	2.76
2	112205171	22 建设银行 CD171	500,000	49,932,902.50	2.76
3	112289485	22 宁波银行 CD302	500,000	49,916,823.23	2.76
4	112209167	22 浦发银行 CD167	500,000	49,908,920.63	2.76
5	112320040	23 广发银行 CD040	500,000	49,875,304.96	2.76
6	112208177	22 中信银行 CD177	500,000	49,857,000.32	2.75
7	112320047	23 广发银行 CD047	500,000	49,853,034.53	2.75
8	112305033	23 建设银行 CD033	500,000	49,841,707.19	2.75
9	112217216	22 光大银行 CD216	500,000	49,817,342.19	2.75
10	112303022	23 农业银行 CD022	500,000	49,811,380.00	2.75

### 5.7 “影子定价”与“摊余成本法”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	0.0554%
报告期内偏离度的最低值	-0.0676%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0394%

#### 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。

## 5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序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。

## 5.9 投资组合报告附注

### 5.9.1 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。

### 5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本集合计划投资前十名证券的发行主体中，中国建设银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、中国光大银行股份有限公司、上海浦东发展银行股份有限公司、中信银行股份有限公司、广发银行股份有限公司、在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会行政处罚。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。

### 5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	8,001.71
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	其他	-
7	合计	8,001.71

### 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	2,045,932,508.17
报告期期间基金总申购份额	16,059,911,937.07
报告期期间基金总赎回份额	16,295,493,468.08
报告期期末基金份额总额	1,810,350,977.16

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

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本集合计划管理人不存在申购、赎回或交易本集合计划的情况。

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

### 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、 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、 集合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。

## 9.2 存放地点

本集合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）

## 9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站（<http://www.ixzcg1.com>）查询，或在营业时间内至集合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

2023 年 10 月 25 日