

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

2023 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：2024 年 3 月 29 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。

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 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。

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。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
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	7
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	8
3.3 其他指标	10
3.4 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	53
8.1 期末基金资产组合情况	53
8.2 债券回购融资情况	53
8.3 基金投资组合平均剩余期限	53
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	54
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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序的前十名债券投资明细	55

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	56
8.8 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序的所有资产支持证券投资明 细	56
8.9 投资组合报告附注	56
§9 基金份额持有人信息	58
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	58
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	58
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的情况	58
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	59
§10 开放式基金份额变动	60
§11 重大事件揭示	61
11.1 基金份额持有人大会决议	61
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	61
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	61
11.4 基金投资策略的改变	61
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	61
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	61
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	61
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	62
11.9 其他重大事件	62
§12 影响投资者决策的其他重要信息	65
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	65
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	65
§13 备查文件目录	66
13.1 备查文件目录	66
13.2 存放地点	66
13.3 查阅方式	66

§ 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	1,871,525,389.08 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

	<p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
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	陈晨
	联系电话	021-38565866	010-50938723
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	zctg@chinaclear.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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.ixzzcgl.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼
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	2023 年	2022 年 10 月 11 日 (基金合同生效 日)-2022 年 12 月 31 日	2021 年
本期已实现收益	22,108,801.79	2,305,401.37	-
本期利润	22,108,801.79	2,305,401.37	-
本期净值收益率	1.0922%	0.2226%	-
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
期末基金资产净值	1,871,525,389.08	879,520,253.66	-
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	-
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	2022 年末	2021 年末
累计净值收益率	1.3148%	0.2226%	-

注：1、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。

2、本集合计划合同于 2022 年 10 月 11 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

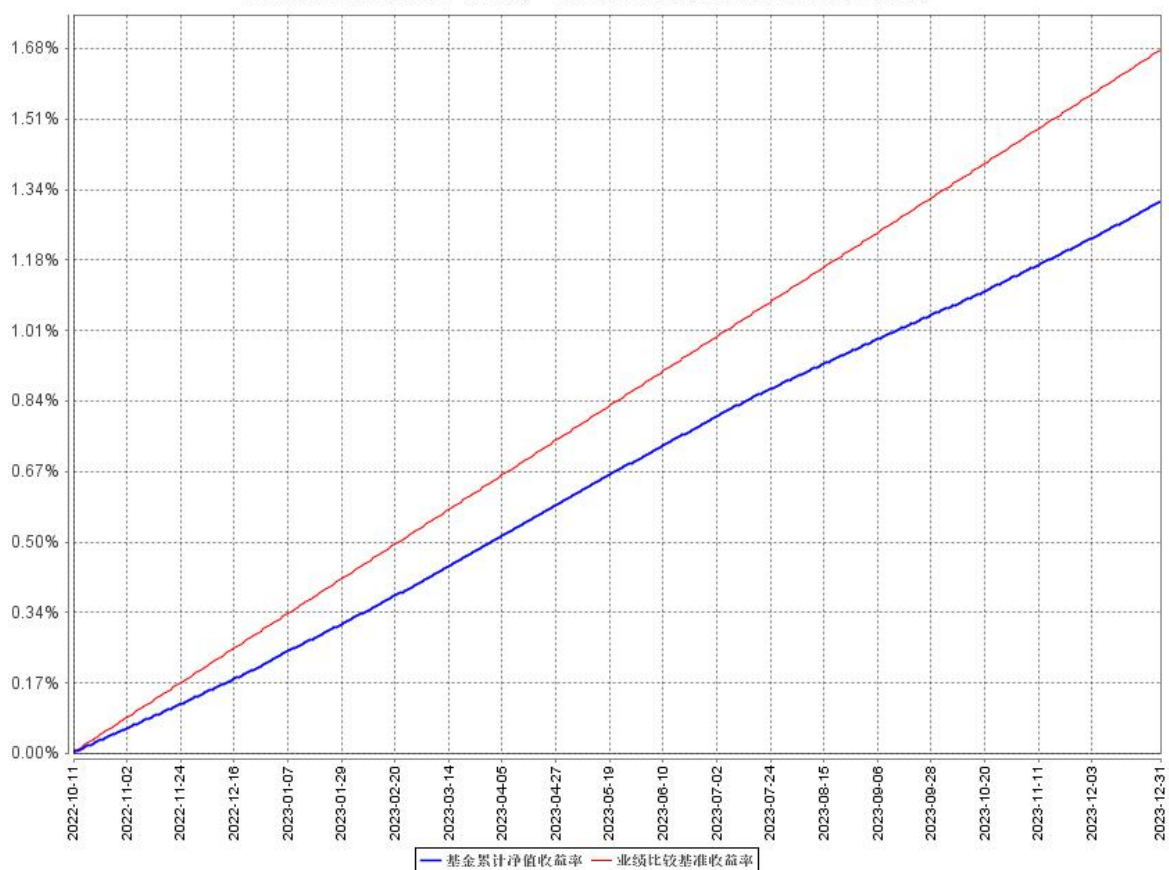
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	0.2640%	0.0003%	0.3450%	0.0000%	-0.0810%	0.0003%
过去六个月	0.5183%	0.0003%	0.6900%	0.0000%	-0.1717%	0.0003%
过去一年	1.0922%	0.0003%	1.3687%	0.0000%	-0.2765%	0.0003%

自基金合同 生效起至今	1.3148%	0.0003%	1.6762%	0.0000%	-0.3614%	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

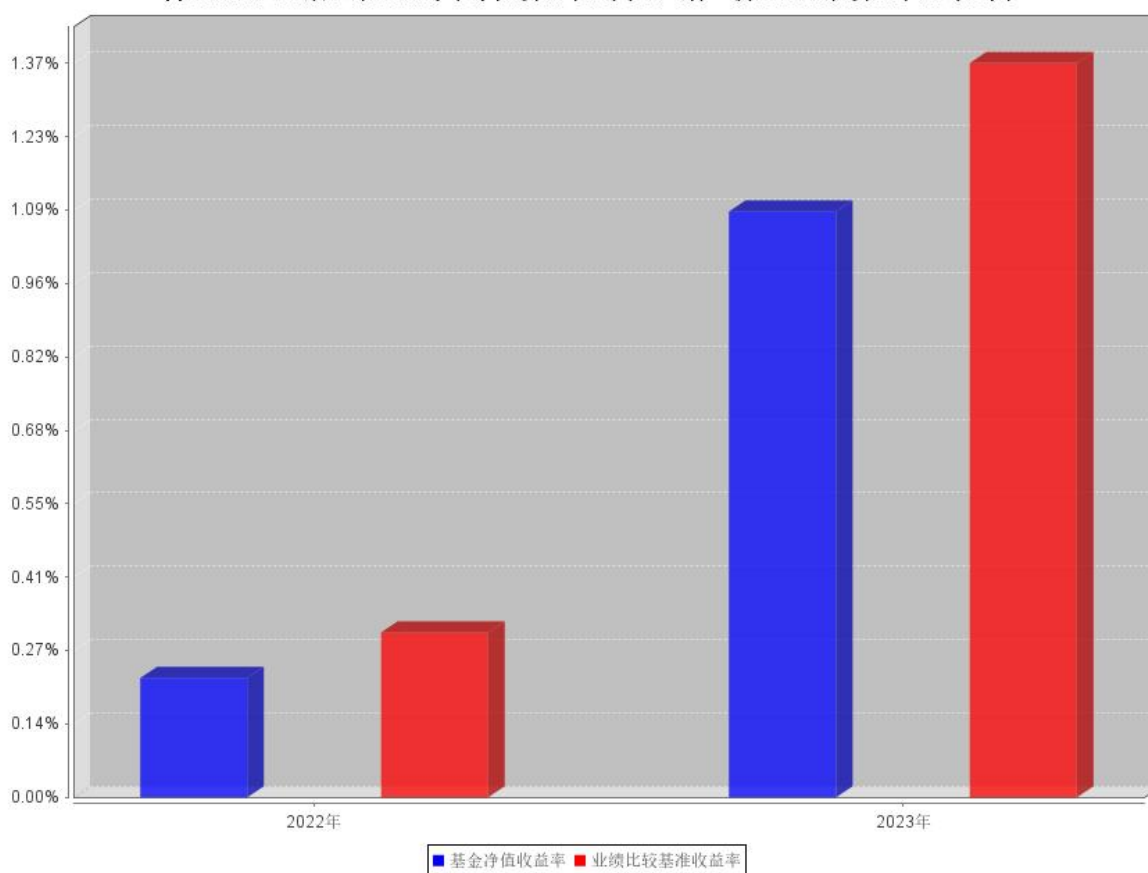
基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2023 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

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对比图



注：1、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。

2、本集合计划合同于 2022 年 10 月 11 日生效，至本报告期末未满五年。

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
2023	-	51,869.36	22,056,932.43	22,108,801.79	
2022	-	52,835.73	2,252,565.64	2,305,401.37	
合计	-	104,705.09	24,309,498.07	24,414,203.16	

注：本集合计划合同于 2022 年 10 月 11 日生效，至本报告期末未满三年。

§ 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。

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2023年12月31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、兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟3个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划、兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划、兴证资管金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	-	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。

4.1.3 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。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本集合计划投资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 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据《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》。本集合计划管理人通过科学、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，共享交易资源。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。

4.3.2.1 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，本集合计划投资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，2023 全年呈现先高后低，2023 年一季度以来，在经历防疫政策优化后，线下生产、消费活动逐步恢复，经济景气度逐步回升。二季度，经济在经历疫后补偿性需求释放冲高后，回归疫后常态，消费、出口等短期需求变量纷纷回归疫后常态水平，内生动能不足问题开始凸显，经济增长动能趋弱。三季度，经济逐步修复，PMI 逐步回到荣枯线上。四季度，经济修复动能转弱，PMI 回到荣枯线下且持续回落，经济修复动能偏弱。四个季度 GDP 分别为 4.5%、6.3%、4.9%、5.2%。资金面方面，一季度资金面松紧适度，但在跨春节、跨月、跨季等关键时点，资金利率波动较大；二季度资金面维持中性偏松态势，流动性分层趋明显，非银机构间资金利率在跨半年末时点有所波动；三季度资金整体维持中性，供需较为均衡。四季度资金先紧后松，至年末资金面持续改善，跨年平稳。全年央行两次调降存款准备金率共 0.5bp，释放约 1 万亿；两次调降 MLF 利率，两次调降 OMO 利率。市场方面，十年国债全年震荡下行，期限结构趋于平坦。组合配置方面，在满足流动性储备的前提下，于三、四月份积极拉长组合平均剩余期限，并配合相应

的波段交易，通过不同时期策略的调整，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增长率为 1.0922%，业绩比较基准收益率为 1.3687%。

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 2024 年，一季度预计在开门红发力之下，经济修复斜率或再度提升。后续关注房地产新增投资与销售情况，或为 2-3 季度的经济修复斜率和持续性的关键影响因素。流动性方面，在“防空转”监管要求之下，持续宽松的概率不大，预计市场利率围绕政策利率波动是常态，同时关注流动性分层及关键时点波动。投资策略方面，年初降准以来，短端资产下行幅度较大，后续若降息落地，短端资产收益率或进一步下行。组合配置方面，或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，等待配置时点的到来，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。

2、加强制度建设：完善委员会治理，印发《信息技术治理委员会议事规则》，制定《数据治理管理办法》等多项信息技术相关制度，修订《洗钱和恐怖融资风险自评估实施细则》等反洗钱制度，完善投资、研究、风控等各类制度。

3、开展监察稽核：根据外部监管会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，建立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，针对《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》及其配套规则、《证券期货经营机构私募资产管理计划备案办法》《证券公司内部审计指引》《债券质押式协议回购风险控制》等多项新规开展多种形式的合规培训宣导。

本报告期内，本集合计划整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了集合计划持有人利益。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集合计划资产，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，切实保障集合计划安全、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。

4.8 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 22,108,801.79 元，其中以直接通过应付赎回款转出金额 51,869.36 元，计入应付利润科目 22,056,932.43 元，符合相关法规及本集合计划合同的规定。

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 2401843 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型集合资产管理计划全体集合资产管理计划份额持有人：
审计意见	<p>我们审计了后附的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“该集合资产管理计划”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>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，公允反映了该集合资产管理计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
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，我们独立于该集合资产管理计划，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。
强调事项	-
其他事项	-
其他信息	该集合资产管理计划管理人兴证证券资产管理有限公司（以下简称“该集合资产管理计划管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该集合资产管理计划 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不

	<p>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。</p> <p>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>该集合资产管理计划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，该集合资产管理计划管理人管理层负责评估该集合资产管理计划的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该集合资产管理计划预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该集合资产管理计划管理人治理层负责监督该集合资产管理计划的财务报告过程。</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，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p>

	<p>(3)评价该集合资产管理计划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)对该集合资产管理计划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，就可能导致对该集合资产管理计划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集合资产管理计划不能持续经营。</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>我们与该集合资产管理计划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	黄小熠 李晨宇
会计师事务所的地址	上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼
审计报告日期	2024 年 3 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型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	333,192,178.65	124,723,100.99
结算备付金		6,106,657.62	10,004,950.00
存出保证金		-	8,276.09
交易性金融资产	7.4.7.2	1,666,595,452.75	688,044,311.06
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		1,666,595,452.75	688,044,311.06
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	20,014,394.69	59,983,319.72
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		-	33,720.56
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		2,025,908,683.71	882,797,678.42
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		145,975,900.23	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,749,924.80	783,637.79
应付托管费		97,218.01	43,535.43
应付销售服务费		486,090.23	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31,903.59	17,320.73
应付利润		5,800,880.44	2,332,170.81
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	241,377.33	100,760.00
负债合计		154,383,294.63	3,277,424.76
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	1,871,525,389.08	879,520,253.66
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-	-
净资产合计		1,871,525,389.08	879,520,253.66
负债和净资产总计		2,025,908,683.71	882,797,678.42

注：报告截止日 2023 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 1,871,525,389.08 份。

7.2 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：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 10 月 11 日(基 金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		46,718,953.27	4,555,788.09
1.利息收入		9,143,814.31	1,260,002.78
其中：存款利息收入	7.4.7.13	5,767,345.47	885,509.01
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		3,376,468.84	374,493.77
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		37,575,138.96	3,295,785.31
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	37,575,138.96	3,295,785.31
资产支持证券投资收益	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	-	-
减：二、营业总支出		24,610,151.48	2,250,386.72
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	18,365,060.25	2,098,436.41
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,020,281.20	116,579.76
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	4,605,190.80	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		330,902.02	-
其中：卖出回购金融资产支出		330,902.02	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		12,794.95	1,391.71
8. 其他费用	7.4.7.23	275,922.26	33,978.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		22,108,801.79	2,305,401.37
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		22,108,801.79	2,305,401.37
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		22,108,801.79	2,305,401.37

注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 10 月 11 日，2022 年度实际报告期间为 2022 年 10 月 11 日至 2022 年 12 月 31 日。

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型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	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)	992,005,135.42	-	-	992,005,135.42
(一)、综合收益总额	-	-	22,108,801.79	22,108,801.79
(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)	992,005,135.42	-	-	992,005,135.42
其中：1.基金申购款	56,148,350,179.43	-	-	56,148,350,179.43
2.基金赎回款	-55,156,345,044.01	-	-	-55,156,345,044.01
(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)	-	-	-22,108,801.79	-22,108,801.79
(四)、其他综合收益 结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	1,871,525,389.08	-	-	1,871,525,389.08
项目	上年度可比期间 2022 年 10 月 11 日(基金合同生效日)至 2022 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	951,269,642.00	-	-	951,269,642.00
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-71,749,388.34	-	-	-71,749,388.34
(一)、综合收益总额	-	-	2,305,401.37	2,305,401.37
(二)、本期基金份额	-71,749,388.34	-	-	-71,749,388.34

交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	4,704,829,566.65	-	-	4,704,829,566.65
2.基金赎回款	-4,776,578,954.99	-	-	-4,776,578,954.99
（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）	-	-	-2,305,401.37	-2,305,401.37
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	879,520,253.66	-	-	879,520,253.66

注：本集合计划合同变更生效日为 2022 年 10 月 11 日，2022 年度实际报告期间为 2022 年 10 月 11 日至 2022 年 12 月 31 日。

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：

_____ 孙国雄	_____ 徐翔	_____ 吴勇滨
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）。

7.4.2 会计报表的编制基础

本集合资产管理计划以持续经营为基础编制财务报表。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〈年度报告和中期报告〉》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。

7.4.3 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 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的要求，真实、完整地反映了本集合资产管理计划 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 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

本集合计划财务报表所载财务信息根据下列依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所制定的重要会计政策和会计估计编制。

7.4.4.1 会计年度

本集合资产管理计划的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本集合资产管理计划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。本集合资产管理计划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

本集合资产管理计划的金融工具包括债券投资、买入返售金融资产。

本集合资产管理计划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。

除非本集合资产管理计划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。

本集合资产管理计划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：

- 本集合资产管理计划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。

管理金融资产的业务模式，是指本集合资产管理计划如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本集合资产管理计划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。本集合资产管理计划以客观事实为依据、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。

本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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

本集合资产管理计划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。

本集合资产管理计划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集合资产管理计划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) 后续计量

- 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，本集合资产管理计划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，且本集合资产管理计划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，虽然本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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

本集合资产管理计划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

本集合资产管理计划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，是指本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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。

本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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

如果本集合资产管理计划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集合资产管理计划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集合资产管理计划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

本集合资产管理计划采用影子定价和偏离度控制确定金融资产公允价值。

当影子定价确定的集合资产管理计划资产净值与摊余成本法计算的集合资产管理计划资产净值的负偏离度绝对值达到 0.25%时，集合资产管理计划管理人应当在 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，集合资产管理计划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，集合资产管理计划管理人应当使用风险准备金或者自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，集合资产管理计划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资产管理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，本集合资产管理计划不

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：

- 本集合资产管理计划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；
- 本集合资产管理计划计划以净额结算，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集合资产管理计划份额所募集的总金额。每份集合资产管理计划面值为 1.00 元。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合资产管理计划申购确认日及集合资产管理计划赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括集合资产管理计划转换所引起的转入集合资产管理计划的实收基金增加和转出集合资产管理计划的实收基金减少。

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。

买入返售金融资产款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。

债券投资收益和衍生工具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

本集合资产管理计划的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按集合资产管理计划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

本集合计划收益分配应遵循下列原则：

- 1、本集合计划每份集合计划份额享有同等分配权；
- 2、本集合计划收益支付方式为现金分红；

3、“每日计算、按季支付”：本集合计划根据每日集合计划收益情况，以每万份产品暂估净收益为基准，为投资人每日计算当日暂估收益，且每季集中支付；

4、本集合计划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、本集合计划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。投资人赎回集合计划份额时，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。遇投资者剩余集合计划份额不足以扣减的情形，管理人将启动内部应急机制保障集合计划平稳运行；

6、当日申购的集合计划份额自下一个工作日起，享有集合计划的收益分配权益；当日赎回的集合计划份额自下一个工作日起，不享有集合计划的收益分配权益；

7、投资者解约情形下，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集合计划资产；

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

本集合资产管理计划以内部组织结构、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。

本集合资产管理计划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，本集合资产管理计划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。本集合资产管理计划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》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。

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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

如 7.4.1 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。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	333,192,178.65	124,723,100.99
等于：本金	332,922,114.12	124,637,470.06
加：应计利息	270,064.53	85,630.93
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：	333,192,178.65	124,723,100.99

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算账 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	1,666,595,452.75	1,667,006,255.35	410,802.60	0.0220%
	合计	1,666,595,452.75	1,667,006,255.35	410,802.60	0.0220%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		1,666,595,452.75	1,667,006,255.35	410,802.60	0.0220%
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		按实际利率计算账 面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债 券	交易所市场	10,167,066.49	10,146,389.04	-20,677.45	-0.0024%
	银行间市场	677,877,244.57	677,698,728.77	-178,515.80	-0.0203%
	合计	688,044,311.06	687,845,117.81	-199,193.25	-0.0226%
资产支持证券		-	-	-	0.0000%
合计		688,044,311.06	687,845,117.81	-199,193.25	-0.0226%

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/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

本集合计划本报告期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

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期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 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	20,014,394.69	-
银行间市场	-	-
合计	20,014,394.69	-
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	59,983,319.72	-
银行间市场	-	-
合计	59,983,319.72	-

7.4.7.4.2 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。

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。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 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。

7.4.7.6 其他债权投资**7.4.7.6.1 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。

7.4.7.6.2 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。

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**

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 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	32,077.33	11,460.00
其中：交易所市场	20,216.85	9,660.00
银行间市场	11,860.48	1,800.00
-	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	-
预提审计费用	80,000.00	80,000.00
预提账户维护费	9,300.00	9,300.00
合计	241,377.33	100,760.00

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	879,520,253.66	879,520,253.66
本期申购	56,148,350,179.43	56,148,350,179.43
本期赎回(以“-”号填列)	-55,156,345,044.01	-55,156,345,044.01
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	1,871,525,389.08	1,871,525,389.08

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

本集合计划本报告期末无其他综合收益。

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 (若有)	-	-	-
前期差错更正 (若有)	-	-	-
其他(若有)	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	22,108,801.79	-	22,108,801.79
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	-22,108,801.79	-	-22,108,801.79
本期末	-	-	-

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年10月11日(基金合同生效日)至2022年12月31日

活期存款利息收入	5,601,492.81	870,174.14
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	165,705.36	15,304.02
其他	147.30	30.85
合计	5,767,345.47	885,509.01

注：其他包括保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益

本集合计划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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月11日(基金合同生 效日)至2022年12月31日
债券投资收益——利息收 入	37,369,416.19	3,295,785.31
债券投资收益——买卖债 券(、债转股及债券到期兑 付)差价收入	205,722.77	-
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	37,575,138.96	3,295,785.31

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年10月11日(基金合同生 效日)至2022年12月31日
卖出债券(、债转股及债券 到期兑付)成交总额	3,743,083,039.41	221,211,534.24
减:卖出债券(、债转股及 债券到期兑付)成本总额	3,734,414,711.33	220,000,000.00
减:应计利息总额	8,462,605.31	1,211,534.24
减:交易费用	-	-
买卖债券差价收入	205,722.77	-

7.4.7.15.3 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。

7.4.7.15.4 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。

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

本集合计划本报告期内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。

7.4.7.16.3 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。

7.4.7.16.4 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。

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

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，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

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，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**

本集合计划本报告期内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

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

7.4.7.19 股利收益

本集合计划本报告期内无股利收入。

7.4.7.20 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。

7.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

7.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 10 月 11 日(基金合同生效日)至 2022 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	17,972.06
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-

银行间账户维护费	37,200.00	9,187.95
银行费用	38,722.26	6,818.83
合计	275,922.26	33,978.84

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，本集合计划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

本集合资产管理计划于 2024 年 1 月 3 日实施 2024 年第一次收益支付，收益累计期间为自 2023 年 10 月 10 日至 2024 年 1 月 2 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”）	集合计划管理人
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
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
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
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：下述关联方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。

7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年10月11日(基金合同生效日)至 2022年12月31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%	-	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年10月11日(基金合同生效日)至 2022年12月31日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例
兴业证券	24,937,307,000.00	100.00%	4,830,000,000.00	100.00%

7.4.10.1.4 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。

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 2023年1月1日至2023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	65,513.80	100.00%	20,216.85	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年10月11日(基金合同生效日)至2022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	9,660.00	100.00%	9,660.00	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。

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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年10月11日(基金合同生效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	18,365,060.25	2,098,436.41
其中：应支付销售机构的客户维护费	8,685,942.79	984,766.10
应支付基金管理人的净管理费	9,679,117.46	1,113,670.31

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。

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
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 10 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,020,281.20	116,579.76

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。

7.4.10.2.3 销售服务费

金额单位：人民币元

获得销售服务费各关联方名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
兴业证券	4,605,190.80
合计	4,605,190.80
获得销售服务费各关联方名称	上年度可比期间
	2022 年 10 月 11 日 (基金合同生效日) 至 2022 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
合计	-

注：本报告期内本集合计划销售服务费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按季支付。使用计算方法如下：每日应支付的销售服务费=集合计划份额前一日的资产净值×0.25%/当年天数。

2022 年 12 月 11 日（含）至 2023 年 2 月 10 日（含）期间，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%/年降至 0%/年。

2023 年 2 月 11 日（含）至 2023 年 3 月 10 日（含）期间，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%/年降至 0.10%/年。

2023 年 3 月 11 日（含）至 2023 年 4 月 10 日（含）期间，投资者持有本集合计划份额的销售服务费率从 0.25%/年降至 0.20%/年。

从 2023 年 4 月 11 号起费率恢复为 0.25%/年。

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。

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

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固有资金投资本基金的情况。

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	
	2023 年 12 月 31 日		2022 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	13,026,000.00	0.6960%	2,267,000.00	0.2578%

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	
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		2022 年 10 月 11 日(基金合同生效日)至 2022 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	150,885,499.79	440,230.20	2,560,799.75	213,121.93
------	----------------	------------	--------------	------------

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。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内和上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.7 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。

7.4.11 利润分配情况

金额单位：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
-	51,869.36	22,056,932.43	22,108,801.79	-

7.4.12 期末（2023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。

7.4.12.2 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。

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 2023 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 145,975,900.23 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
210202	21 国开 02	2024 年 1 月 2 日	102.93	300,000	30,880,072.79
170201	17 国开 01	2024 年 1 月 2 日	103.80	200,000	20,760,916.97
190208	19 国开 08	2024 年 1 月 2 日	102.39	100,000	10,238,617.25
210406	21 农发 06	2024 年 1 月 2 日	101.64	200,000	20,328,053.21

190203	19 国开 03	2024 年 1 月 2 日	103.12	100,000	10,311,769.18
140215	14 国开 15	2024 年 1 月 2 日	103.97	100,000	10,397,064.24
210207	21 国开 07	2024 年 1 月 2 日	102.07	300,000	30,621,207.55
170404	17 农发 04	2024 年 1 月 2 日	103.80	200,000	20,760,059.82
合计				1,500,000	154,297,761.01

期末估值总额=期末估值单价（保留小数点后无限位）×数量。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 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。

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	40,546,048.51
合计	-	40,546,048.51

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；

2. 未评级部分为发行期限在一年以内（含）的政策性金融债。

3. 本集合计划合同生效日期为 2022 年 10 月 11 日。

7.4.13.2.2 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	上年度末
--------	-----	------

	2023 年 12 月 31 日	2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	1,512,297,691.74	627,144,148.53
合计	1,512,297,691.74	627,144,148.53

1. 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；。

2. 本集合计划合同生效日期为 2022 年 10 月 11 日。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	10,167,066.49
AAA 以下	-	-
未评级	154,297,761.01	10,187,047.53
合计	154,297,761.01	20,354,114.02

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；

4. 本集合计划合同生效日期为 2022 年 10 月 11 日。

7.4.13.2.5 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

本集合计划于本报告期末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。

本集合计划管理人将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，以满足本集合计划运作过程中的流动

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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							
银行存款	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
资产总计	711,329,585.08	857,154,643.12	457,424,455.51	-	-	-	2,025,908,683.71
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
上年度末 2022 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							
银行存款	124,723,100.99	-	-	-	-	-	124,723,100.99
结算备付金	10,004,950.00	-	-	-	-	-	10,004,950.00
存出保证金	8,276.09	-	-	-	-	-	8,276.09
交易性金融资产	130,255,253.97	318,835,643.68	238,953,413.41	-	-	-	688,044,311.06
买入返售金融资产	59,983,319.72	-	-	-	-	-	59,983,319.72
应收清算款	-	-	-	-	-	33,720.56	33,720.56
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	324,974,900.77	318,835,643.68	238,953,413.41	-	-	33,720.56	882,797,678.42

负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	783,637.79	783,637.79
应付托管费	-	-	-	-	-	43,535.43	43,535.43
应交税费	-	-	-	-	-	17,320.73	17,320.73
应付利润	-	-	-	-	-	2,332,170.81	2,332,170.81
其他负债	-	-	-	-	-	100,760.00	100,760.00
负债总计	-	-	-	-	-	3,277,424.76	3,277,424.76
利率敏感度缺口	324,974,900.77	318,835,643.68	238,953,413.41	-	-	-3,243,704.20	879,520,253.66

注：上表统计了本计划的利率风险敞口，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（2023年12月31日）	上年度末（2022年12月31日）
	市场利率+1%	-3,567,841.76	-1,605,281.69
	市场利率-1%	3,593,137.48	1,615,023.33

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。

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。

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

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	1,666,595,452.75	89.05	688,044,311.06	78.23
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	1,666,595,452.75	89.05	688,044,311.06	78.21

注：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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值按照资本-资产定价模型（CAPM）描述的规律进行变动		
	2. 使用本集合计划业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	3. 在业绩基准变化 5% 时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到本集合计划净值的变化		
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（2023 年 12 月 31 日）	上年度末（2022 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准+5%	-	-
	业绩比较基准-5%	-	-

注：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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	1,666,595,452.75	688,044,311.06
第三层次	-	-
合计	1,666,595,452.75	688,044,311.06

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本报告期持有的金融工具公允价值所属层次间未发生重大变动(上年度可比期间：无)。

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

本集合计划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 2023 年 12 月 31 日，本集合计划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(2022 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

于 2023 年 12 月 31 日，本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具(2022 年 12 月 31 日：无)。

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

于 2023 年 12 月 31 日，本集合计划无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 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	1,666,595,452.75	82.26
	其中:债券	1,666,595,452.75	82.26
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	20,014,394.69	0.99
	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	339,298,836.27	16.75
4	其他各项资产	-	-
5	合计	2,025,908,683.71	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	0.70	
	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	145,975,900.23	7.80
	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。

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	65
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	103
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	55

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。

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	36.27	7.80
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天(含)—60 天	27.18	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天(含)—90 天	20.20	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天(含)—120 天	10.60	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	120 天(含)—397 天(含)	13.78	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
	合计	108.03	7.80

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	154,297,761.01	8.24

	其中：政策性金融债	154,297,761.01	8.24
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	1,512,297,691.74	80.81
8	其他	-	-
9	合计	1,666,595,452.75	89.05
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序的前十名债券投资 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	占基金资产净值 比例(%)
1	112320151	23 广发银行 CD151	1,000,000	99,898,334.66	5.34
2	112320159	23 广发银行 CD159	500,000	49,929,732.59	2.67
3	112303064	23 农业银行 CD064	500,000	49,927,133.72	2.67
4	112310309	23 兴业银行 CD309	500,000	49,921,816.18	2.67
5	112305016	23 建设银行 CD016	500,000	49,882,320.13	2.67
6	112305017	23 建设银行 CD017	500,000	49,880,653.83	2.67
7	112310046	23 兴业银行 CD046	500,000	49,875,499.93	2.66
8	112370470	23 上海农商	500,000	49,864,224.56	2.66

		银行 CD100			
9	112305026	23 建设银行 CD026	500,000	49,851,873.87	2.66
10	112305035	23 建设银行 CD035	500,000	49,825,138.93	2.66

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	-
报告期内偏离度的最高值	0.0673%
报告期内偏离度的最低值	-0.0676%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0353%

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。

8.8 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序的所有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。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 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。

8.9.2 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、广发银行股份有限公司、兴业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。

8.9.3 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。

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
12,950	144,519.34	285,396,165.01	15.25%	1,586,129,224.07	84.75%

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	机构	203,277,243.03	10.86%
2	个人	39,939,898.95	2.13%
3	个人	26,898,480.74	1.44%
4	机构	18,248,879.21	0.98%
5	个人	14,086,806.26	0.75%
6	个人	13,495,428.46	0.72%
7	个人	12,869,379.18	0.69%
8	个人	12,296,028.45	0.66%
9	机构	11,513,804.45	0.62%
10	个人	10,514,935.02	0.56%

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	5,809.96	0.0003%

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的情况

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情况

本报告期内，本集合计划投资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	879,520,253.66
本报告期基金总申购份额	56,148,350,179.43
减:本报告期基金总赎回份额	55,156,345,044.01
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	1,871,525,389.08

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。

§ 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，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

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，本集合计划管理人的重大人事变动如下：

截至 2023 年 12 月 27 日，管理人近 12 个月内董事变更超过百分之五十，详见管理人于 2023 年 12 月 29 日发布的《兴证证券资产管理有限公司关于公司董事变更情况的公告》。

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。

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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人未改聘会计师事务所。本集合计划聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划提供审计服务。本报告年度的审计费用为 80,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

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	-	-	65,513.80	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。

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	70,344,550.00	100.00%	24,937,307,000.00	100.00%	-	-

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本集合计划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	2023 年 1 月 4 日
2	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2022 年第四季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
3	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划开展	规定网站、规定报刊	2023 年 2 月 9 日

	销售服务费优惠活动的公告		
4	关于兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划开展销售服务费优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2023 年 3 月 7 日
5	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 月 31 日
6	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	2023 年 4 月 4 日
7	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	2023 年 4 月 11 日
8	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第一季度报告	规定网站	2023 年 4 月 21 日
9	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	2023 年 7 月 4 日
10	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年第二季度报告	规定网站	2023 年 7 月 21 日
11	关于兴证证券资产管理有限公司运用固有资金投资旗下集合资产管理计划的公告	规定网站、规定报刊	2023 年 8 月 22 日
12	兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划 2023 年中期报告	规定网站	2023 年 8 月 31 日
13	兴证资管金麒麟现金添利货币	规定网站	2023 年 9 月 20 日

	型集合资产管理计划招募说明书更新（2023 年第 1 号）		
14	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	2023 年 9 月 20 日
15	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	2023 年 10 月 10 日
16	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划参与北京证券交易所股票投资及相关风险提示的公告	规定网站、规定报刊	2023 年 12 月 19 日
17	兴证证券资产管理有限公司董事变更情况公告	规定网站、规定报刊	2023 年 12 月 29 日

§ 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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 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）。

13.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站（<http://www.ixzcgf.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

2024 年 3 月 29 日