

兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证证券资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

送出日期：2026 年 8 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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约定，于 2026 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 月 30 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	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
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	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	2
7.1 期末基金资产组合情况	2
7.2 债券回购融资情况	3
7.3 基金投资组合平均剩余期限	3
7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明	4
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	4
7.6 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	4

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离	4
7.8 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
7.9 投资组合报告附注	5
§8 基金份额持有人信息	5
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	5
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	6
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	6
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	6
§9 开放式基金份额变动	6
§10 重大事件揭示	6
10.1 基金份额持有人大会决议	6
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	7
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	7
10.4 基金投资策略的改变	7
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	7
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	7
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	8
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	9
10.9 其他重大事件	9
§11 影响投资者决策的其他重要信息	12
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	12
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	13
§12 备查文件目录	13
12.1 备查文件目录	13
12.2 存放地点	13
12.3 查阅方式	13

§ 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	7,668,421,951.80 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	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。 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。 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。
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	翁建国	王静茹
	联系电话	95562-3	010-50938589
	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		021-68581323	-
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		王焕舟	于文强

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ixztcgl.com
基金中期报告置备地点	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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	27,253,997.51
本期利润	27,253,997.51
本期净值收益率	0.3614%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末基金资产净值	7,668,421,951.80
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
累计净值收益率	3.3182%

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。

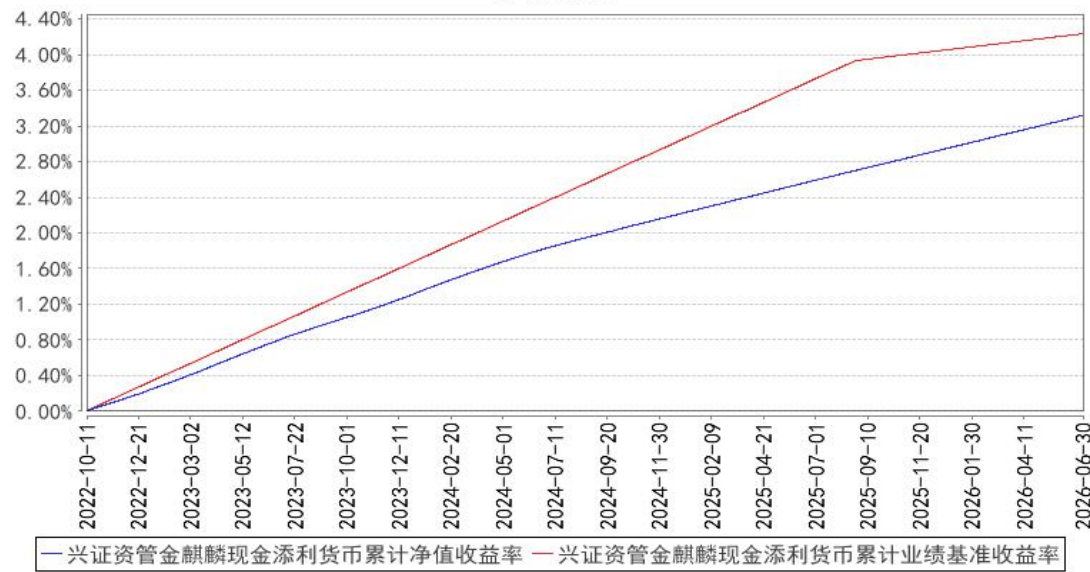
3.2 基金净值表现

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	0.1819%	0.0005%	0.0885%	0.0000%	0.0934%	0.0005%
过去六个月	0.3614%	0.0005%	0.1760%	0.0000%	0.1854%	0.0005%
过去一年	0.7281%	0.0006%	0.5076%	0.0010%	0.2205%	-0.0004%
过去三年	2.5216%	0.0006%	3.2489%	0.0013%	-0.7273%	-0.0007%
自基金合同 生效起至今	3.3182%	0.0006%	4.2351%	0.0012%	-0.9169%	-0.0006%

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 2026 年 06 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证证券资产管理有限公司经中国证监会证监许可[2014]145 号文批复，于 2014 年 6 月 9 日正式成立。目前，公司注册资本为 8 亿元人民币。兴证证券资产管理有限公司是兴业证券股份有限公司（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（原公募业务部）基金经理	2025 年 8 月 25 日	-	14 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 日担任兴证资管金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。

4.2 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基金和投资组合，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。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。公司对投资交易行为进行监测，未发现违反公平交易制度的情况。

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。本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

基本面方面，经济整体仍处在区间震荡、分化磨底的状态，1-3 月 PMI 分别为 49.3、49.0、50.4，由荣枯线之下回升至荣枯线之上。前两个月经季节性调整后其实际综合表现平稳，景气度不弱。3 月较 2 月有较大回升，剔除 2 月春节等基数因素扰动后，3 月 PMI 也表现不弱。具体看外需为核心驱动力，新出口订单明显上行，制造业产需修复，需求分项首次超过生产。4-6 月 PMI 分别为 50.3、50、50.3，整体运行在荣枯线之上但略有波动。4 月 PMI 较上季度有所回落，但经高基数及季节性调整后其表现尚可，具体来看，外需为核心驱动力，新出口订单继续上行；内需相对较弱，虽节假日出行、两新政策以及基建发力有所支撑，然整体新订单指数有所回落。5 月 PMI 略有收敛，出口订单有所回落，内需整体不强。6 月 PMI 较 5 月回升，高于市场预期以及可比季节性，制造业景气度边际修复。具体来看，地缘局势缓和，外需新订单指数修复快于生产指数，库存去化、供需错配略有收窄。内需方面，土木工程建筑业和消费品制造业新订单指数均有所回

升，油价回落对下游的挤出效应有一定的弱化。输入性通胀和中下游利润压力边际缓解。金融数据方面，1 月金融数据开门红平稳，但总量略低于预期，结构上延续此前政策主导的特征。2 月金融数据继续呈现“总量不弱但结构分化”的特征。年初“宽信用”的效果更多体现在企业端和政府端，向居民端的传导效率有待提升。4 月金融数据明显弱于季节性水平、5 月金融数据回归季节性水平，整体上体现私人部门融资需求偏弱，居民部门边际上有进一步去杠杆的趋势，整体内生动能并未实质性改善。受高基数及财政投放节奏的影响，二季度基本面数据有所回落，短期经济环比动能有所收敛，目前内需的修复前景仍需进一步信号。下半年经济走向取决于财政实物工作量提速、出口韧性能否延续以及内需的修复情况。市场方面，上半年资金总体均衡，机构跨春节、跨月末、季末平稳顺利，具体来看，一季度资金利率区间波动，二季度先下后上。6 月 17 日，央行于陆家嘴论坛预告“适时增加隔夜逆回购操作品种”，并于 6 月 25 日公告，6 月 29 日、6 月 30 日增设该品种，实际操作金额分别为 3000 亿元、6000 亿元。意在熨平关键时点资金面波动。现券方面，债券超长端呈现震荡格局，30 年国债活跃券累计上行约 0.6bp，债券长端呈现震荡下行态势，10 年国债活跃券累计下行 11bps。同业存单方面，1 年期 AAA 级商业银行同业存单估值先下后上，于 6 月初到达最低点，后调整，至 6 月末重回下行态势，上半年累计下行 15bp 左右。组合操作方面，在满足账户日常流动性需求以及外规限额要求的前提下，灵活调整组合持仓，并配合一定的波段操作。

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 0.3614%，业绩比较基准收益率为 0.1760%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济结构性 K 型分化仍在延续，7 月 PMI 和通胀数据皆低于预期，通胀与 PMI 相互印证，量价信号同步偏弱。7 月政治局会议提及“加大逆周期调节力度”，强调“高度重视经济运行中的困难挑战”，强调增量政策“务实管用”，意在稳增长政策力度偏向温和托举，并非强刺激；货币政策方面，会议明确“综合运用并适时调整货币政策工具，优化实施财政金融协同促内需政策”，结合 7 月基本面数据情况，增量货币工具落地的可能性在提升。同时，会议财政端强调“加快财政支出和债券资金使用进度”，指向存量政策加速落地而非大规模增量刺激工具。后续仍需关注财政实物工作量提速、出口韧性能否延续以及内需的修复情况。投资策略方面，本产品将继续按照产品投资范围、投资目标采取相对保守策略，根据市场情况以及负债端情况变化，严格控制组合剩余期限、把握合适的配置节奏。同时配合市场波动，适度进行波段交易。投资上，择机灵活配置剩余期限 397 天以内的最高等级信用债、存单、存款、回购等标的，平衡产品流动

性和收益率，并适当参与高等级高流动性品种交易机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值管理委员会，并制定了相关制度及流程。估值管理委员会对公司依法管理的基金的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定基金估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值管理委员会由公司总裁、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、战略与产品部负责人、综合管理部负责人、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投资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。

4.7 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 27,253,997.51 元，其中以直接通过应付赎回款转出金额 1,607,489.22 元，计入应付利润科目 25,646,508.29 元，符合相关法规及本基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,106,256,953.14	322,340,590.96
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,681,256,784.41	6,167,351,407.05
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,681,256,784.41	6,167,351,407.05
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	900,083,124.87	350,105,608.55
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		7,687,596,862.42	6,839,797,606.56
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		3,157,355.85	3,689,204.48
应付托管费		335,042.81	316,242.54
应付销售服务费		1,675,213.89	1,581,212.96
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,610.54	8,341.37
应付利润		13,830,948.62	12,411,947.24
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	172,738.91	272,779.35
负债合计		19,174,910.62	18,279,727.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	7,668,421,951.80	6,821,517,878.62
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-	-
净资产合计		7,668,421,951.80	6,821,517,878.62
负债和净资产总计		7,687,596,862.42	6,839,797,606.56

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，兴证资管金麒麟现金添利货币份额净值 1.0000 元，份额总额 7,668,421,951.80 份。

6.2 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		61,639,172.78	50,092,782.00
1. 利息收入		12,846,645.51	6,074,194.16
其中：存款利息收入	6.4.7.13	9,753,413.82	1,283,565.25
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		3,093,231.69	4,790,628.91
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		48,792,527.27	44,018,587.84
其中：股票投资收益		-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.14	48,792,527.27	44,018,587.84
资产支持证券投 资收益	6.4.7.15	-	-
贵金属投资收益		-	-

衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	-	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-	-
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-	-
减：二、营业总支出		34,385,175.27	29,850,433.56
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	20,397,420.99	21,439,870.34
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	1,863,558.28	1,356,294.72
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,317,791.31	6,781,473.19
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		2,665,863.07	130,855.65
其中：卖出回购金融资产支出		2,665,863.07	130,855.65
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		2,679.56	4,184.80
8. 其他费用	6.4.7.21	137,862.06	137,754.86
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		27,253,997.51	20,242,348.44
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		27,253,997.51	20,242,348.44
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		27,253,997.51	20,242,348.44

6.3 净资产变动表

会计主体：兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收	未分配利润	净资产合计

		益		
一、上期期末净资产	6,821,517,878.62	-	-	6,821,517,878.62
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	6,821,517,878.62	-	-	6,821,517,878.62
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	846,904,073.18	-	-	846,904,073.18
(一)、综合收益总额	-	-	27,253,997.51	27,253,997.51
(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)	846,904,073.18	-	-	846,904,073.18
其中：1. 基金申购款	123,325,309,540.68	-	-	123,325,309,540.68
2. 基金赎回款	-122,478,405,467.50	-	-	-122,478,405,467.50
(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)	-	-	-27,253,997.51	-27,253,997.51
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	7,668,421,951.80	-	-	7,668,421,951.80
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	755,371,434.84	-	-	755,371,434.84
(一)、综合收益总额	-	-	20,242,348.44	20,242,348.44
(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)	755,371,434.84	-	-	755,371,434.84
其中：1. 基金申购款	71,155,357,948.22	-	-	71,155,357,948.22
2. 基金赎回款	-70,399,986,513.38	-	-	-70,399,986,513.38

（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）	-	-	-20,242,348.44	-20,242,348.44
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	5,684,495,791.51	-	-	5,684,495,791.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

王焕舟
基金管理人负责人

杨华
主管会计工作负责人

吴勇滨
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金（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）。

6.4.2 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。

6.4.3 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 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 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) 基金管理人运营基金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股票、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。基金管理人运营基金提供的贷款服务，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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	440,532,142.12
等于：本金	440,182,555.74
加：应计利息	349,586.38
减：坏账准备	-

定期存款	665,724,811.02
等于：本金	663,000,000.00
加：应计利息	2,724,811.02
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	665,724,811.02
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,106,256,953.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		按实际利率计算的账面价值	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	5,681,256,784.41	5,682,810,260.27	1,553,475.86	0.0203
	合计	5,681,256,784.41	5,682,810,260.27	1,553,475.86	0.0203
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,681,256,784.41	5,682,810,260.27	1,553,475.86	0.0203

注：1、偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值；

2、偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购

交易所市场	-	-
银行间市场	900,083,124.87	-
合计	900,083,124.87	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期末未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	74,178.76
其中：交易所市场	-

银行间市场	74,178.76
应付利息	-
预提费用	98,560.15
合计	172,738.91

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,821,517,878.62	6,821,517,878.62
本期申购	123,325,309,540.68	123,325,309,540.68
本期赎回（以“-”号填列）	-122,478,405,467.50	-122,478,405,467.50
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	7,668,421,951.80	7,668,421,951.80

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	27,253,997.51	-	27,253,997.51
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	-27,253,997.51	-	-27,253,997.51
本期末	-	-	-

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

活期存款利息收入	6,213,076.28
定期存款利息收入	3,540,337.54
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	—
其他	—
合计	9,753,413.82

注：其他包括保证金利息收入。

6.4.7.14 债券投资收益

6.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	48,639,872.91
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	152,654.36
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	48,792,527.27

6.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	6,589,769,149.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,579,984,468.07
减：应计利息总额	9,632,027.39
减：交易费用	—
买卖债券差价收入	152,654.36

6.4.7.15 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

本基金本报告期内无股利收益。

6.4.7.18 公允价值变动收益

本基金本报告期内无公允价值变动收益。

6.4.7.19 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	30,001.91
银行间账户维护费	18,600.00
合计	137,862.06

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金于 2026 年 7 月 2 日实施 2026 年第 3 次收益支付，收益累计期间为自 2026 年 4 月 2 日至 2026 年 7 月 1 日止期间，向收益累计期间登记在册并且未在收益分配截止日前解约赎回的全部份额持有人进行现金分红。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本基金存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证证券资产管理有限公司（“兴证资管”）	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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本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。

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例（%）
兴业证券	-	-	996,000,000.00	100.00

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期			
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间			
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
兴业证券	1,692.00	100.00	2.00	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基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	20,397,420.99	21,439,870.34

其中：应支付销售机构的客户维护费	10,045,379.49	10,299,011.96
应支付基金管理人的净管理费	10,352,041.50	11,140,858.38

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,863,558.28	1,356,294.72

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	兴证资管金麒麟现金添利货币

兴业证券	9,317,791.31
合计	9,317,791.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
	兴证资管金麒麟现金添利货币
兴业证券	6,781,473.19
合计	6,781,473.19

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金合同生效日（2022 年 10 月 11 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	100,004,054.11
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	100,004,054.11
报告期末持有的基金份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	0.0000%	0.0000%

注：本报告期内，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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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	44,177,000.00	0.5761	55,908,000.00	0.8196

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国结算	6,406,685.24	7,130.00	6,136,510.66	9,176.76

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本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。

6.4.10.7 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。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转 实收基金	直接通过应付 赎回款转出金额	应付利润 本年变动	本期利润分配合计	备注
-	1,607,489.22	25,646,508.29	27,253,997.51	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本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。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 06 月 30 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。

6.4.13 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。

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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公司发行的证券，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。

6.4.13.2.1 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	131,494,312.33	666,374,940.12
合计	131,494,312.33	666,374,940.12

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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	5,060,882,879.70	5,449,453,270.92
合计	5,060,882,879.70	5,449,453,270.92

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

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	488,879,592.38	51,523,196.01
合计	488,879,592.38	51,523,196.01

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级；

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

3. 未评级部分为政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	440,532,142.12	311,898,305.87	353,826,505.15	-	-	-	1,106,256,953.14
交易性金融资产	820,193,824.84	1,249,732,161.78	3,611,330,797.79	-	-	-	5,681,256,784.41
买入返售金融资产	900,083,124.87	-	-	-	-	-	900,083,124.87
资产总计	2,160,809,091.83	1,561,630,467.65	3,965,157,302.94	-	-	-	7,687,596,862.42
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	3,157,355.85	3,157,355.85
应付托管费	-	-	-	-	-	335,042.81	335,042.81
应付销售服务费	-	-	-	-	-	1,675,213.89	1,675,213.89
应付利润	-	-	-	-	-	13,830,948.62	13,830,948.62
应交税费	-	-	-	-	-	3,610.54	3,610.54
其他负债	-	-	-	-	-	172,738.91	172,738.91
负债总计	-	-	-	-	-	19,174,910.62	19,174,910.62
利率敏感度缺口	2,160,809,091.83	1,561,630,467.65	3,965,157,302.94	-	-	-19,174,910.62	7,668,421,951.80
上年度末 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

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	1. 其他影响债券公允价值的变量保持不变		
	2. 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 （2026年6月30日）	上年度末 （2025年12月31日）
	市场利率+1%	-21,722,831.90	-20,410,319.73
	市场利率-1%	21,949,740.13	20,618,260.03

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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本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。

6.4.13.4.3.1 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。

6.4.13.4.3.2 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。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下： 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价； 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值； 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	-	-
第二层次	5,681,256,784.41	6,167,351,407.05
第三层次	-	-
合计	5,681,256,784.41	6,167,351,407.05

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	5,681,256,784.41	73.90
	其中：债券	5,681,256,784.41	73.90
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	900,083,124.87	11.71
	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	1,106,256,953.14	14.39
4	其他各项资产	-	-
5	合计	7,687,596,862.42	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	5.27	
	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%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	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	98

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。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30 天以内	28.16	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
2	30 天（含）—60 天	5.85	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
3	60 天（含）—90 天	7.29	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
4	90 天（含）—120 天	13.05	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—
5	120 天（含）—397 天（含）	45.75	—
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	—	—

合计	100.10	-
----	--------	---

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本基金投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	488,879,592.38	6.38
	其中：政策性金融债	488,879,592.38	6.38
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	131,494,312.33	1.71
6	中期票据	-	-
7	同业存单	5,060,882,879.70	66.00
8	其他	-	-
9	合计	5,681,256,784.41	74.09
10	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

7.6 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

金额单位：人民币元

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	240202	24 国开 02	3,500,000	355,592,197.17	4.64
2	112502224	25 工商银行 CD224	2,000,000	199,857,297.55	2.61
3	112517170	25 光大银行 CD170	2,000,000	199,512,047.51	2.60
4	112505382	25 建设银行 CD382	2,000,000	199,260,235.63	2.60
5	112502283	25 工商银行 CD283	2,000,000	198,561,801.55	2.59
6	112503337	25 农业银行 CD337	1,500,000	149,418,669.30	1.95
7	210208	21 国开 08	1,300,000	133,287,395.21	1.74
8	112504040	25 中国银行 CD040	1,000,000	99,941,627.24	1.30
9	112690441	26 徽商银行 CD011	1,000,000	99,936,988.02	1.30
10	112522033	25 邮储银行 CD033	1,000,000	99,898,132.97	1.30

7.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数	0

报告期内偏离度的最高值	0.0596%
报告期内偏离度的最低值	0.0051%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0280%

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。

7.8 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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 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。

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

本基金投资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、中国银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、徽商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。

7.9.3 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 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比 例 (%)	持有份额	占总份额比 例 (%)

50,255	152,590.23	507,323,646.07	6.62	7,161,098,305.73	93.38
--------	------------	----------------	------	------------------	-------

8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况

序号	持有人类别	持有份额（份）	占总份额比例（%）
1	机构	255,535,950.12	3.33
2	个人	169,052,511.06	2.20
3	个人	64,863,104.08	0.85
4	个人	50,000,000.00	0.65
5	机构	44,177,000.00	0.58
6	个人	42,252,343.40	0.55
7	个人	41,413,261.69	0.54
8	个人	34,651,346.58	0.45
9	机构	30,092,040.86	0.39
10	机构	29,301,128.67	0.38

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	70,450.63	0.0009

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 10 月 11 日）基金份额总额	951,269,642.00
本报告期期初基金份额总额	6,821,517,878.62
本报告期基金总申购份额	123,325,309,540.68
减：本报告期基金总赎回份额	122,478,405,467.50
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,668,421,951.80

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

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人的重大人事变动如下：

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。

2026 年 4 月 9 日起，王焕舟同志担任本公司董事长职务，刘宇先生不再担任公司董事长职务。2026 年 4 月 10 日起，王焕舟先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，刘宇先生不再代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务。

2026 年 4 月 10 日起，陈怡女士担任公司副总裁。

2026 年 4 月 28 日起，公司法定代表人变更为王焕舟先生。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本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。

10.4 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。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 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调查或处罚。

10.6.2 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调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-

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。

10.7.2 基金租用或者通过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	-	-	-	-	-	-

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。

10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

报告期内每个交易日，本基金偏离度绝对值均未超过 0.5%。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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	2026 年 1 月 1 日
2	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	2026 年 1 月 6 日
3	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	2026 年 1 月 6 日
4	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	2026 年 1 月 8 日
5	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	2026 年 1 月 13 日
6	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	2026 年 1 月 15 日
7	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	2026 年 1 月 20 日
8	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	2026 年 1 月 22 日
9	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
10	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	2026 年 1 月 27 日
11	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	2026 年 1 月 29 日
12	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	2026 年 2 月 3 日
13	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	2026 年 2 月 5 日
14	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	2026 年 2 月 10 日
15	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	2026 年 2 月 10 日
16	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	2026 年 2 月 12 日
17	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	2026 年 2 月 15 日
18	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	2026 年 2 月 17 日
19	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	2026 年 2 月 22 日
20	关于恢复兴证资管金麒麟现金添利货	规定网站、规定报刊	2026 年 2 月 26 日

	币市场基金管理费适用费率公告		
21	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	2026 年 2 月 28 日
22	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	2026 年 3 月 3 日
23	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	2026 年 3 月 5 日
24	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	2026 年 3 月 5 日
25	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	2026 年 3 月 10 日
26	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	2026 年 3 月 13 日
27	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	2026 年 3 月 18 日
28	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	2026 年 3 月 20 日
29	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	2026 年 3 月 25 日
30	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	2026 年 3 月 27 日
31	兴证证券资产管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	规定网站	2026 年 3 月 31 日
32	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
33	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	2026 年 4 月 1 日
34	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	2026 年 4 月 2 日
35	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	2026 年 4 月 4 日
36	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	2026 年 4 月 7 日
37	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	2026 年 4 月 8 日
38	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	2026 年 4 月 9 日
39	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	2026 年 4 月 10 日
40	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	2026 年 4 月 11 日
41	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	2026 年 4 月 11 日

42	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	2026 年 4 月 15 日
43	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	2026 年 4 月 18 日
44	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
45	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	2026 年 4 月 22 日
46	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	2026 年 4 月 25 日
47	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	2026 年 4 月 29 日
48	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	2026 年 4 月 30 日
49	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	2026 年 5 月 1 日
50	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	2026 年 5 月 3 日
51	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	2026 年 5 月 8 日
52	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	2026 年 5 月 12 日
53	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	2026 年 5 月 13 日
54	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	2026 年 5 月 15 日
55	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	2026 年 5 月 19 日
56	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	2026 年 5 月 22 日
57	兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金招募说明书更新（2026 年第 1 号）	规定网站	2026 年 5 月 26 日
58	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更新（2026 年第 1 号）	规定网站	2026 年 5 月 26 日
59	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	2026 年 5 月 26 日
60	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	2026 年 5 月 27 日
61	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	2026 年 5 月 28 日
62	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	2026 年 5 月 30 日
63	关于下调兴证资管金麒麟现金添利货	规定网站、规定报刊	2026 年 6 月 2 日

	币市场基金管理费适用费率公告		
64	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	2026 年 6 月 3 日
65	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	2026 年 6 月 4 日
66	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	2026 年 6 月 6 日
67	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	2026 年 6 月 9 日
68	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	2026 年 6 月 10 日
69	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	2026 年 6 月 11 日
70	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	2026 年 6 月 13 日
71	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	2026 年 6 月 14 日
72	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	2026 年 6 月 14 日
73	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	2026 年 6 月 19 日
74	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	2026 年 6 月 23 日
75	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	2026 年 6 月 27 日
76	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	2026 年 6 月 30 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，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。

2026 年 4 月 9 日起，王焕舟同志担任本公司董事长职务，刘宇先生不再担任公司董事长职务。2026 年 4 月 10 日起，王焕舟先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，刘宇先生不再代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务。

2026 年 4 月 10 日起，陈怡女士担任公司副总裁。

2026 年 4 月 28 日起，公司法定代表人变更为王焕舟先生。

§ 12 备查文件目录

12.1 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。

12.2 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）。

12.3 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 8 月 31 日