

兴全添利宝货币市场基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：兴证全球基金管理有限公司

基金托管人：兴业银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 03 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2023 年 01 月 01 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..... | 5 |
| 2.4 信息披露方式..... | 5 |
| 2.5 其他相关资料..... | 6 |
| § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标..... | 6 |
| 3.2 基金净值表现..... | 7 |
| 3.3 其他指标..... | 8 |
| 3.4 过去三年基金的利润分配情况..... | 9 |
| § 4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况..... | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明..... | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明..... | 11 |
| 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..... | 12 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望..... | 12 |
| 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况..... | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 13 |
| 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明..... | 13 |
| 4.10 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..... | 14 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明..... | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.. | 14 |
| 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见..... | 14 |
| § 6 审计报告 | 14 |
| 6.1 审计报告基本信息..... | 14 |
| 6.2 审计报告的基本内容..... | 14 |
| § 7 年度财务报表 | 16 |
| 7.1 资产负债表..... | 16 |
| 7.2 利润表..... | 18 |
| 7.3 净资产变动表..... | 19 |
| 7.4 报表附注..... | 21 |
| § 8 投资组合报告 | 50 |
| 8.1 期末基金资产组合情况..... | 50 |

| | |
|---|-----------|
| 8.2 债券回购融资情况..... | 50 |
| 8.3 基金投资组合平均剩余期限..... | 51 |
| 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..... | 51 |
| 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合..... | 51 |
| 8.6 期末按实际利率计算账面价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细..... | 52 |
| 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..... | 52 |
| 8.8 期末按实际利率计算的账面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..... | 53 |
| 8.9 投资组合报告附注..... | 53 |
| § 9 基金份额持有人信息..... | 54 |
| 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 54 |
| 9.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况..... | 54 |
| 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 54 |
| 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况..... | 54 |
| 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..... | 54 |
| § 10 开放式基金份额变动..... | 54 |
| § 11 重大事件揭示..... | 55 |
| 11.1 基金份额持有人大会决议..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 55 |
| 11.4 基金投资策略的改变..... | 55 |
| 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 55 |
| 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..... | 55 |
| 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 55 |
| 11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况..... | 56 |
| 11.9 其他重大事件..... | 56 |
| § 12 影响投资者决策的其他重要信息..... | 56 |
| 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..... | 56 |
| 12.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 57 |
| § 13 备查文件目录..... | 57 |
| 13.1 备查文件目录..... | 57 |
| 13.2 存放地点..... | 57 |
| 13.3 查阅方式..... | 57 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|----------------------|
| 基金名称 | 兴全添利宝货币市场基金 |
| 基金简称 | 兴全添利宝货币 |
| 基金主代码 | 000575 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2014 年 2 月 27 日 |
| 基金管理人 | 兴证全球基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 兴业银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 184,248,110,941.66 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|---|
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 根据宏观形势、利率走势等因素，确定各个阶段的投资组合平均久期、剩余期限等指标，并在这些指标要求的基础上构建投资组合；进行主动投资，有效提高资产组合收益。本基金综合运用类属配置、目标久期控制、收益曲线、个券选择、套利等多种投资策略进行投资。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率（税后） |
| 风险收益特征 | 本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金 |

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 | | 兴证全球基金管理有限公司 | 兴业银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 杨卫东 | 龚小武 |
| | 联系电话 | 021-20398888 | 021-52629999-212056 |
| | 电子邮箱 | yangwd@xqfunds.com | gongxiaowu@cib.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006780099, 021-38824536 | 95561 |
| 传真 | | 021-20398988 | 021-62159217 |
| 注册地址 | | 上海市黄浦区金陵东路 368 号 | 福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦 |
| 办公地址 | | 上海市浦东新区芳甸路 1155 号 嘉里城办公楼 28-29 楼 | 上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼 |
| 邮政编码 | | 201204 | 200120 |
| 法定代表人 | | 杨华辉 | 吕家进 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券日报 |
| 登载基金年度报告正文的管理人互联网网 | http://www.xqfunds.com |

| | |
|------------|---------------|
| 址 | |
| 基金年度报告备置地点 | 基金管理人、基金托管人住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|--------------------|---------------------------------|
| 会计师事务所 | 德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙） | 上海市延安东路 222 号 30 楼 |
| 注册登记机构 | 兴证全球基金管理有限公司 | 上海市浦东新区芳甸路 1155 号嘉里城办公楼 28-29 楼 |

§ 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 | 2021 年 |
|---------------|--------------------|--------------------|--------------------|
| 本期已实现收益 | 3,526,877,574.51 | 3,066,530,388.18 | 2,939,019,499.61 |
| 本期利润 | 3,526,877,574.51 | 3,066,530,388.18 | 2,939,019,499.61 |
| 本期净值收益率 | 1.9708% | 1.8790% | 2.3443% |
| 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 | 184,248,110,941.66 | 181,625,249,804.47 | 156,310,291,144.77 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 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 | 34.7331% | 32.1291% | 29.6922% |

注：1、上述财务指标采用的计算公式，详见中国证券监督管理委员会发布的《证券投资基金信息披露编报规则第 1 号〈主要财务指标的计算及披露〉》、《证券投资基金会计核算业务指引》等相关法规。

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

4、本基金收益分配按日结转份额。

3.2 基金净值表现

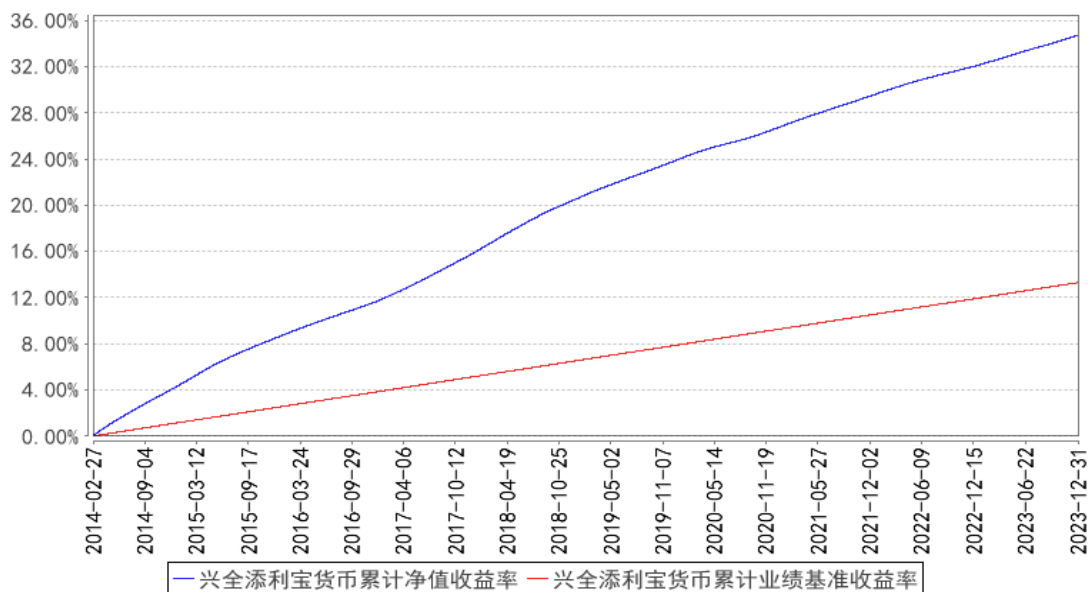
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 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 | 0.5063% | 0.0005% | 0.3403% | 0.0000% | 0.1660% | 0.0005% |
| 过去六个月 | 0.9831% | 0.0005% | 0.6805% | 0.0000% | 0.3026% | 0.0005% |
| 过去一年 | 1.9708% | 0.0005% | 1.3500% | 0.0000% | 0.6208% | 0.0005% |
| 过去三年 | 6.3223% | 0.0009% | 4.0500% | 0.0000% | 2.2723% | 0.0009% |
| 过去五年 | 11.7222% | 0.0012% | 6.7537% | 0.0000% | 4.9685% | 0.0012% |
| 自基金合同生效起至今 | 34.7331% | 0.0030% | 13.2966% | 0.0000% | 21.4365% | 0.0030% |

注：本基金业绩比较基准为同期七天通知存款利率（税后），业绩比较基准的选取上主要基于如下考虑：本业绩比较基准是投资者最熟知、最容易获得的低风险收益率。同时本基金将采用兴证全球基金绩效评价系统对投资组合的投资绩效进行评价。

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

兴全添利宝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

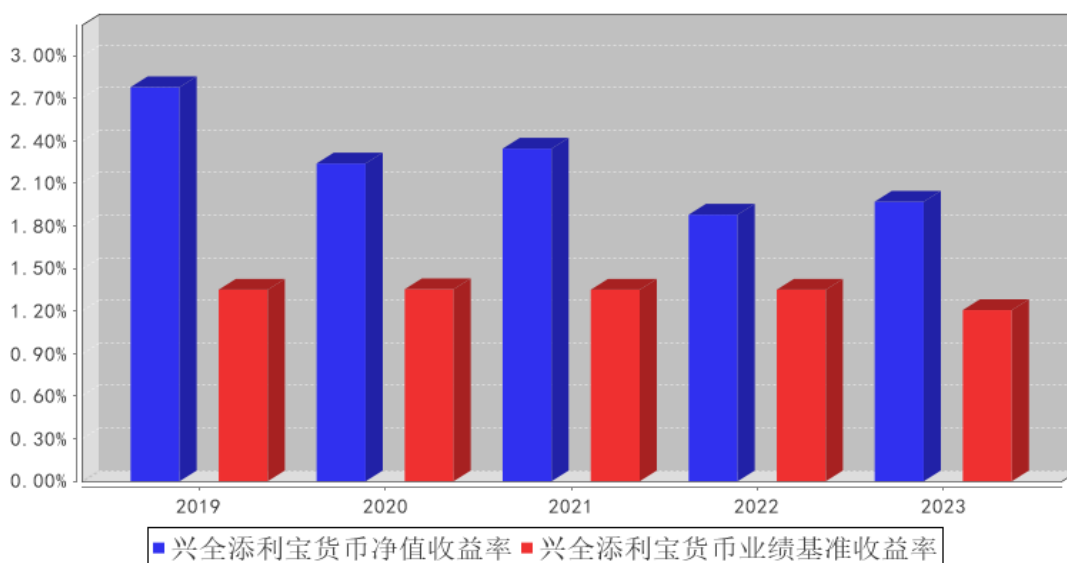


注：1、净值表现所取数据截至到 2023 年 12 月 31 日。

2、按照《兴全添利宝货币市场基金基金合同》的规定，本基金建仓期为 2014 年 2 月 27 日至 2014 年 5 月 26 日。建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合本基金合同规定的比例限制及本基金投资组合的比例范围。

3.2.3 过去五年基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴全添利宝货币基金每年净值收益率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 其他指标

注：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 年 | 3,526,877,574. 51 | - | - | 3,526,877,574. 51 | - |
| 2022 年 | 3,066,530,388. 18 | - | - | 3,066,530,388. 18 | - |
| 2021 年 | 2,939,019,499. 61 | - | - | 2,939,019,499. 61 | - |
| 合计 | 9,532,427,462. 30 | - | - | 9,532,427,462. 30 | - |

§ 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

兴证全球基金管理有限公司（成立时名为“兴业基金管理有限公司”，以下简称“公司”）经证监基字[2003]100号文批准于2003年9月30日成立。2008年1月，中国证监会批复（证监许可[2008]6号），同意全球人寿保险国际公司（AEGON International B.V）受让公司股权并成为公司股东。2008年4月9日，公司完成股权转让、变更注册资本等相关手续后，公司注册资本由9800万元变更为人民币1.2亿元，其中兴业证券股份有限公司的出资占注册资本的51%，全球人寿保险国际公司的出资占注册资本的49%。2008年7月，经中国证监会批准（证监许可[2008]888号），公司于2008年8月25日完成变更公司名称、注册资本等相关手续后，公司名称变更为“兴业全球基金管理有限公司”，注册资本增加为1.5亿元人民币，其中两股东出资比例不变。2016年12月28日，因公司发展需要，公司名称变更为“兴全基金管理有限公司”。2020年3月18日，公司名称变更为“兴证全球基金管理有限公司”。

截至2023年12月31日，公司旗下已管理兴全可转债混合型证券投资基金等共65只基金，包括股票型、混合型、债券型、货币型、指数型、FOF等类型。

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 | | |
| 翟秀 华 | 固定收益 部副 总 监，兴全 添利宝货 | 2016年3 月17日 | - | 13年 | 硕士，历任毕马威华振会计师事务所审计，泰信基金管理有限公司交易总监助理，兴证全球基金管理有限公司研究员兼基金经理助理、兴全稳泰债券型证券投资 |

| | | | | | |
|----|---|------------|---|-----|---|
| | 币市场基金、兴全稳益定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全祥泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全汇享一年持有期混合型证券投资基金、兴证全球恒利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、兴证全球兴裕混合型证券投资基金基金经理 | | | | 基金、兴全兴泰定期开放债券型发起式证券投资基金、兴全天添益货币市场基金基金经理、固定收益部总监助理。 |
| 邓娟 | 兴全添利宝货币市场基金、兴证全球恒利一年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理、兴证全球恒远债券型证券投资基金基金经理 | 2019年6月26日 | - | 8年 | 硕士。历任兴证全球基金管理有限公司固定收益部研究员、交易员，兴全添利宝货币市场基金基金经理助理、兴全天添益货币市场基金基金经理助理和兴全磐稳增利债券型证券投资基金基金经理助理、兴全货币市场基金基金经理。 |
| 刘沅 | 兴证全球 | 2023年1 | - | 11年 | 硕士，CFA，历任兴证全球基金管理有限 |

| | | | | | |
|---|---|-------|--|--|--------------------------------|
| 沉 | 恒利一年 定开债券 发起式基 金、兴全 添利宝货 币基金基 金经理助 理 | 月 3 日 | | | 公司渠道部渠道经理、交易部债券交易 员、资金交易主管。 |
|---|---|-------|--|--|--------------------------------|

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

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

3、证券从业的涵义遵从行业的相关规定，包括资管相关行业从业经历。

4.1.3 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

注：本报告期末，本基金基金经理不存在兼任私募资产管理计划的投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募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遵规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人制定了《兴证全球基金管理有限公司公平交易管理办法》，并将不时进行修订。本基金管理人主要从研究的公平、决策的公平、交易的公平、公平交易的监控评估、公平交易的报告和信息披露等方面对公平交易行为进行规范，从而达到保证本基金管理人管理的不同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

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

是否存在不公平的因素。

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

4.3.2.1 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

本报告期末，本基金基金经理未兼任私募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，不存在本投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 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

2023 年，资金面整体偏宽松，但也出现一些波动，货币资产收益亦呈现较大波动。1 季度，受地产和疫情放松影响，经济恢复斜率较高，资金面收敛，债券收益明显上行。2-3 季度，经济增速放缓，资金面宽松，风险偏好下降，货币资产收益大幅下行。3 季末至 12 月，中美利率倒挂，人民币贬值压力较大，制约国内政策宽松空间，特殊再融资债和国债发行对流动性形成一定挤压，资金面收敛，债券收益上行。年底，资金面转松，债券收益下行。

本基金在做好账户的流动性风险管理前提下，努力为持有人创造了较好的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，兴全添利宝货币的基金份额净值增长率为 1.9708%，同期业绩比较基准收益率为 1.3500%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024 年，国内经济处于新旧动能切换的过程中。国内宏观政策偏积极，但在地产下行、地方化债的背景和高质量发展框架内，经济刺激的力度预计偏温和，经济复苏的弹性不大。海外方面，美国通胀压力缓解，美联储货币政策转鸽，人民币贬值压力预计减小，国内货币政策外部掣肘减轻，政策空间或能进一步打开。综合来看，高质量发展和经济的温和复苏仍对债券有利，但阶段性可能受到债券供给、风险偏好变化等因素影响，波动加大。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本基金管理人通过以下工作的开展，有力地保证了本基金整体运作的合法合规，从而最大程度地保护了基金份额持有人和其他相关当事人的合法权益：

1、实时风险监控：通过风控系统对本基金的运作进行实时监控，每日撰写监控日志，在此基础上每周撰写信息周报，对本基金遵守风控指标的情况进行汇总、分析和提示。

2、加强事后人工分析，并定期撰写风险管理报告。除系统控制外，公司风险管理部还对一些

无法嵌入系统的风控指标进行了事后人工计算分析和复核，并同样反映在监控日志和信息周报中。此外，在每个季度结束之后，公司风险管理部会对基金的流动性进行压力测试并出具书面报告，对旗下每只基金进行全面的风险评价并形成风险分析报告，并提交公司领导和基金经理审阅。

3、进一步加强对公平交易的监控。根据监管部门的要求以及公司公平交易相关工作的不断深入开展，公司进一步明确了公平交易执行和分析中的具体标准，将公平交易问题分为交易的公平和投资策略的公平，主要包括：（1）明确交易部的分单规则及其识别异常下单行为的职责，保证交易的公平；（2）通过 T 检验、模拟利益输送金额、具体可疑交易分析等方法，对以往的下单及交易记录进行分析，保证投资策略的公平。

4、季度监察稽核和专项稽核：根据中国证监会《关于基金管理公司报送监察稽核报告的通知》以及《证券投资基金管理有限公司监察稽核报告内容与格式指引（试行）》等规定，认真做好公司各季度监察稽核工作。对照中国证监会的季度监察稽核项目表，对本基金的守法合规情况进行逐条检视。此外，在公司审计部对投研部门展开的专项稽核中，也会对本基金的业务进行全面检查。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照最新的估值准则、证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金投资品种进行估值。具体估值流程为：1、估值委员会制定旗下基金的估值政策和流程，选取适当的估值方法、定期对估值政策和程序进行评价。采用的基金估值方法、政策和程序应经估值委员会审议，并报管理层批准后方可实施。2、估值方法确立后，由 IT 人员或 IT 人员协助估值系统开发商及时对系统中的参数或模型作相应的调整或对系统进行升级，以适应新的估值方法的需要。3、基金会计具体负责执行估值委员会确定的估值策略，并通过与托管行核对等方法确保估值准确无误；4、投资人员（包括基金经理）积极关注市场环境变化及证券发行机构有关影响证券价格的重大事件等可能对给估值造成影响的因素，并就可能带来的影响提出建议和意见；5、合规管理人员参与估值方案的制定，确保估值方案符合相关法律法规及基金合同的约定；负责基金估值业务的定期和临时信息披露。6、审计部对估值流程、估值结果等进行检查，确保估值委员会决议的有效执行。

上述参与估值流程人员均具备估值业务所需的专业胜任能力。上述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《基金法》、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》及其他相关法律法规的规定，本基金自基金合同生效日起每日将基金份额实现的基金净收益分配给份额持有人，并按日结转到份额持有人的基金账户。本报告期内，本基金向基金份额持有人分配利润 3,526,877,574.51 元，符合本

基金基金合同的相关规定。

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

本基金本报告期内未发生需披露的基金份额持有人数不满两百人或基金资产净值低于五千元的情形。

§ 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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、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，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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 | 德师报(审)字(24)第 P00151 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 | 兴全添利宝货币市场基金全体持有人 |
| 审计意见 | 我们审计了兴全添利宝货币市场基金的财务报表，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。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务 |

| | |
|-----------------|--|
| | 操作的有关规定编制，公允反映了兴全添利宝货币市场基金 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。 |
| 形成审计意见的基础 | 我们按照中国注册会计师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，我们独立于兴全添利宝货币市场基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。 |
| 强调事项 | - |
| 其他事项 | - |
| 其他信息 | <p>兴证全球基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括兴全添利宝货币市场基金年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</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>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制财务报表，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，基金管理人管理层负责评估兴全添利宝货币市场基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算兴全添利宝货币市场基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督兴全添利宝货币市场基金的财务报告过程。</p> |
| 注册会计师对财务报表审计的责任 | <p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> |

| | |
|-----------|--|
| | <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对兴全添利宝货币市场基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴全添利宝货币市场基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p> |
| 会计师事务所的名称 | 德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙) |
| 注册会计师的姓名 | 吴凌志 冯适 |
| 会计师事务所的地址 | 上海市黄浦区延安东路 222 号外滩中心 30 楼 |
| 审计报告日期 | 2024 年 3 月 27 日 |

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

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 | 79,131,177,095.05 | 54,778,129,193.45 |
| 结算备付金 | | 290,879,776.91 | 260,253,838.60 |
| 存出保证金 | | 95,472.94 | 52,713.63 |
| 交易性金融资产 | 7.4.7.2 | 73,024,455,173.74 | 84,334,213,454.41 |
| 其中：股票投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 73,024,455,173.74 | 84,334,213,454.41 |
| 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 | 51,039,336,085.95 | 59,752,368,779.61 |
| 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 | | 992,327,734.55 | 686,990,200.01 |
| 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 | | 204,478,271,339.14 | 199,812,008,179.71 |
| 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 | | 16,391,149,891.41 | 14,685,463,935.49 |
| 应付清算款 | | 3,747,114,824.00 | 3,412,525,421.68 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 42,104,715.41 | 41,032,554.96 |
| 应付托管费 | | 7,797,169.50 | 7,598,621.26 |
| 应付销售服务费 | | 38,985,847.59 | 37,993,106.44 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,160,764.81 | 276,369.09 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 7.4.7.9 | 1,847,184.76 | 1,868,366.32 |
| 负债合计 | | 20,230,160,397.48 | 18,186,758,375.24 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 7.4.7.10 | 184,248,110,941.66 | 181,625,249,804.47 |
| 其他综合收益 | 7.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 7.4.7.12 | - | - |
| 净资产合计 | | 184,248,110,941.66 | 181,625,249,804.47 |
| 负债和净资产总计 | | 204,478,271,339.14 | 199,812,008,179.71 |

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 184,248,110,941.66 份。

7.2 利润表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|--------------------------------|------------|---|--|
| 一、营业总收入 | | 4,803,645,872.20 | 4,190,192,850.03 |
| 1. 利息收入 | | 2,894,214,760.99 | 2,624,618,829.83 |
| 其中：存款利息收入 | 7.4.7.13 | 1,504,927,442.00 | 1,373,862,773.17 |
| 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 | | 1,389,287,318.99 | 1,250,756,056.66 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2. 投资收益（损失以 “-”填列） | | 1,909,323,276.71 | 1,565,513,997.76 |
| 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 | 1,909,323,276.71 | 1,565,513,997.76 |
| 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 | 107,834.50 | 60,022.44 |
| 减：二、营业总支出 | | 1,276,768,297.69 | 1,123,662,461.85 |
| 1. 管理人报酬 | 7.4.10.2.1 | 487,939,173.08 | 444,760,868.52 |

| | | | |
|----------------------------|------------|-------------------------|-------------------------|
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2. 托管费 | 7.4.10.2.2 | 90,359,106.13 | 82,363,123.71 |
| 3. 销售服务费 | 7.4.10.2.3 | 451,795,530.68 | 411,815,618.93 |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | 245,937,935.11 | 183,984,390.35 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 245,937,935.11 | 183,984,390.35 |
| 6. 信用减值损失 | 7.4.7.22 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 305,090.20 | 337,515.08 |
| 8. 其他费用 | 7.4.7.23 | 431,462.49 | 400,945.26 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | 3,526,877,574.51 | 3,066,530,388.18 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | 3,526,877,574.51 | 3,066,530,388.18 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 3,526,877,574.51 | 3,066,530,388.18 |

7.3 净资产变动表

会计主体：兴全添利宝货币市场基金

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 | 181,625,249,804.47 | - | - | 181,625,249,804.47 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 181,625,249,804.47 | - | - | 181,625,249,804.47 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 2,622,861,137.19 | - | - | 2,622,861,137.19 |
| (一)、综合收益 | - | - | 3,526,877,574.51 | 3,526,877,574.51 |

| | | | | |
|--|----------------------------------|--------|------------------|-----------------------|
| 总额 | | | 51 | 1 |
| (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) | 2,622,861,137.19 | - | - | 2,622,861,137.19 |
| 其中: 1. 基金申购款 | 1,277,415,640,560.31 | - | - | 1,277,415,640,560.31 |
| 2. 基金赎回款 | -1,274,792,779,423.12 | - | - | -1,274,792,779,423.12 |
| (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) | - | - | 3,526,877,574.51 | 3,526,877,574.51 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 184,248,110,941.66 | - | - | 184,248,110,941.66 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年1月1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 | 156,310,291,144.77 | - | - | 156,310,291,144.77 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 156,310,291,144.77 | - | - | 156,310,291,144.77 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 25,314,958,659.70 | - | - | 25,314,958,659.70 |

| | | | | |
|--|-----------------------|---|------------------|-----------------------|
| (一)、综合收益总额 | - | - | 3,066,530,388.18 | 3,066,530,388.18 |
| (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) | 25,314,958,659.70 | - | - | 25,314,958,659.70 |
| 其中：1. 基金申购款 | 1,303,956,829,099.70 | - | - | 1,303,956,829,099.70 |
| 2. 基金赎回款 | -1,278,641,870,440.00 | - | - | -1,278,641,870,440.00 |
| (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) | - | - | 3,066,530,388.18 | 3,066,530,388.18 |
| (四)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 181,625,249,804.47 | - | - | 181,625,249,804.47 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

| | | |
|------------|------------|------------|
| <u>杨华辉</u> | <u>庄园芳</u> | <u>詹鸿飞</u> |
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

兴全添利宝货币市场基金(以下简称“本基金”),系经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]217号《关于准予兴全添利宝货币市场基金注册的批复》的核准,由基金管理人兴证全球基金管理有限公司于2014年2月26日向社会公开募集,基金合同于2014年2月27日正式生效,首次设立募集规模为1,306,102,190.00份基金份额。本基金为契约型开放

式，存续期限不定。本基金的基金管理人和注册登记机构为兴证全球基金管理有限公司，基金托管人为兴业银行股份有限公司。

本基金的投资范围为以下金融工具：现金、期限在 1 年以内(含 1 年)的银行存款(包括活期存款、定期存款、通知存款等)、债券回购、中央银行票据、同业存单、剩余期限在 397 天以内(含 397 天)的债券、短期融资券、中期票据、资产支持证券、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。如法律法规或监管机构以后允许货币市场基金投资其他金融工具，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的业绩比较基准为同期七天通知存款利率(税后)。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定(统称“企业会计准则”)、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 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。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金以人民币为记账本位币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

根据本基金的业务特点和风险管理要求，本基金将所持有的金融资产在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和以摊余成本计量的金融资产，暂无金融资产划分为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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，且本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标，则本基金将该金融资产分类为以摊余成本计量的金融资产。此类金融资产主要包括货币资金、各类应收款项、买入返售金融资产等。

不符合分类为以摊余成本计量的金融资产以及公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产条件的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产计入“衍生金融资产”外，其他以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产计入“交易性金融资产”。

(2) 金融负债的分类

本基金将持有的金融负债在初始确认时划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本基金暂无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。

其他金融负债包括各类应付款项、卖出回购金融资产款等。

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

本基金成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。对于以常规方式购买或出售金融资产的，在交易日确认将收到的资产和为此将承担的负债，或者在交易日终止确认已出售的资产。金融资产和金融负债在初始确认时以公允价值计量。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券或资产支持证券已到付息期但尚未领取的利息，单独确认为应收项目。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产按照公允价值进行后续计量，公允价值变动形成的利得或损失以及与该金融资产相关的股利和利息收入计入当期损益。以摊余成本计量的金融资产和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量，发生减值或终止确认产生的利得或损失，计入当期损益。

本基金对分类为以摊余成本计量的金融资产以预期信用损失为基础确认损失准备。除购买或

源生的已发生信用减值的金融资产外，本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后的变动情况。若该金融工具的信用风险自初始确认后已显著增加，本基金按照相当于该金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备；若该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加，本基金按照相当于该金融工具未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备。信用损失准备的增加或转回金额，作为减值损失或利得计入当期损益。

本基金在前一会计期间已经按照相当于金融工具整个存续期内预期信用损失的金额计量了损失准备，但在当期资产负债表日，该金融工具已不再属于自初始确认后信用风险显著增加的情形，本基金在当期资产负债表日按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量该金融工具的损失准备，由此形成的损失准备的转回金额作为减值利得计入当期损益。

本基金利用可获得的合理且有依据的前瞻性信息，通过比较金融工具在资产负债表日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止、该金融资产已转移且其所有权上几乎所有的风险和报酬已转移或虽然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，但是未保留对该金融资产的控制，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。若本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有风险和报酬，且保留了对该金融资产控制的，则按照其继续涉入被转移金融资产的程度继续确认该被转移金融资产，并相应确认相关负债。金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，才能终止确认该金融负债或其一部分。金融负债全部或部分终止确认的，将终止确认部分的账面价值与支付的对价(包括转出的非现金资产或承担的新金融负债)之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债基于公允价值的输入值的可观察程度以及该等输入值对公允价值计量整体的重要性，将其公允价值划分为三个层次。第一层次输入值是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；第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

本基金采用影子定价和偏离度控制确定金融资产的公允价值。在本基金存续期间，基金管理人定期计算本基金投资组合摊余成本与其他可参考公允价值指标之间的偏离程度，并定期测试其他可参考公允价值指标确定方法的有效性。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，按其他公允价值指标对组合的账面价值进行调整。

如有确凿证据表明按上述方法不能客观反映交易性金融工具的公允价值，基金管理人将根据具体情况与基金托管人商定后采用估值技术确定最能反映公允价值的价格。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。每份基金份额面值为人民币 1.00 元。申购、赎回、转换及分红再投资等引起的实收基金的变动分别于上述各交易确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

(1) 利息收入

存款利息收入按存款的本金与适用利率逐日计提。

买入返售金融资产收入按买入返售金融资产的摊余成本在返售期内以实际利率法逐日计提。

(2) 投资收益

债券投资收益包括债券利息收入以及买卖债券价差收入。基金持有的附息债券、贴现券按摊

余成本和实际利率计算确定利息收入。买卖债券价差收入为卖出债券交易日的成交总额扣除应结转的债券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

资产支持证券投资收益包括资产支持证券利息收入以及买卖资产支持证券价差收入。基金持有的资产支持证券按摊余成本和实际利率计算确定利息收入。资产支持证券投资收益为卖出资产支持证券交易日的成交总额扣除应结转的资产支持证券投资成本、应收利息(若有)与相关交易费用后的差额确认。

(3) 信用减值损失

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认信用损失准备。本基金所计提的信用减值损失计入当期损益。

(4) 其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

7.4.4.9 费用的确认和计量

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

(1) 基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 的年费率逐日计提；

(2) 基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率逐日计提；

(3) 基金销售服务费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率逐日计提；

卖出回购金融资产支出，按卖出回购金融资产的摊余成本及实际利率(当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率)在回购期内逐日计提。

其他费用系根据有关法规及相应协议规定，按实际支出金额，列入当期基金费用。如果影响基金份额净值小数点后第四位的，则采用待摊或预提的方法。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

- (1) 本基金的每份基金份额享有同等分配权；
- (2) 本基金收益分配方式为红利再投资，免收再投资的费用；
- (3) “每日分配、按日支付”。本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金已实现收益为基准，为投资人每日计算当日收益并分配，且每日进行支付。投资人当日收益分配的计算保留到小数点后 2 位，小数点后第 3 位按去尾原则处理，因去尾形成的余额进行再次分配，直到分完为止；
- (4) 本基金根据每日收益情况，将当日收益全部分配，若当日已实现收益大于零时，为投资人记正收益；若当日已实现收益小于零时，为投资人记负收益；若当日已实现收益等于零时，当日投资人不记收益；
- (5) 本基金每日进行收益计算并分配时，每日收益支付方式只采用红利再投资(即红利转基金份额)方式，投资人可通过赎回基金份额获得现金收益；若投资人在当日收益支付时，若当日净收益大于零时，则增加投资人基金份额；若当日净收益等于零时，则保持投资人基金份额不变；基金管理人将采取必要措施尽量避免基金净收益小于零，若当日净收益小于零时，缩减投资人基金份额；
- (6) 当日申购的基金份额应当自下一个交易日起享有基金的分配权益；当日赎回的基金份额自下一个交易日起不享有基金的分配权益；
- (7) 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

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；

(3)能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于中国证券投资基金业协会《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》（中基协字[2022]566号）所规定的固定收益品种，本基金按照相关规定，对以公允价值计量的固定收益品种选取第三方估值基准服务机构提供估值全价进行估值；对以摊余成本计量的固定收益品种用自建或由第三方估值基准服务机构提供的预期信用损失模型参数或减值计量结果。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《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《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《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《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》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 证券投资基金(封闭式证券投资基金, 开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖债券免征增值税; 2018 年 1 月 1 日起, 公开募集证券投资基金运营过程中发生的资管产品运营业务, 以基金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。

(2) 对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, 暂不缴纳企业所得税。

(3) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 | 9,608,563,624.23 | 4,049,867,803.53 |
| 等于: 本金 | 9,552,328,604.16 | 4,046,980,070.02 |
| 加: 应计利息 | 56,235,020.07 | 2,887,733.51 |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 定期存款 | 69,522,613,470.82 | 50,728,261,389.92 |
| 等于: 本金 | 69,150,000,000.00 | 50,480,000,000.00 |
| 加: 应计利息 | 372,613,470.82 | 248,261,389.92 |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 其中: 存款期限 1 个月以内 | 300,057,500.01 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | 3,002,400,277.74 | 6,961,451,180.61 |
| 存款期限 3 个月以上 | 66,220,155,693.07 | 43,766,810,209.31 |
| 其他存款 | - | - |
| 等于: 本金 | - | - |
| 加: 应计利息 | - | - |
| 减: 坏账准备 | - | - |
| 合计 | 79,131,177,095.05 | 54,778,129,193.45 |

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 | | | |
|-----------|-------------------------|----------------|-------------|---------|
| | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 交易所市 | 975,179,293.19 | 974,846,550.13 | -332,743.06 | - |

| | | | | | |
|----|--------|--------------------------|-------------------|---------------|-------------|
| | 场 | | | | 0.0002 |
| | 银行间市场 | 72,049,275,880.55 | 72,114,826,613.07 | 65,550,732.52 | 0.0356 |
| | 合计 | 73,024,455,173.74 | 73,089,673,163.20 | 65,217,989.46 | 0.0354 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 73,024,455,173.74 | 73,089,673,163.20 | 65,217,989.46 | 0.0354 |
| | 项目 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | | | |
| | | 按实际利率计算的账面价值 | 影子定价 | 偏离金额 | 偏离度 (%) |
| 债券 | 交易所市场 | 1,660,230,125.65 | 1,656,887,007.42 | -3,343,118.23 | - 0.0018 |
| | 银行间市场 | 82,673,983,328.76 | 82,682,758,427.96 | 8,775,099.20 | 0.0048 |
| | 合计 | 84,334,213,454.41 | 84,339,645,435.38 | 5,431,980.97 | 0.0030 |
| | 资产支持证券 | - | - | - | - |
| | 合计 | 84,334,213,454.41 | 84,339,645,435.38 | 5,431,980.97 | 0.0030 |

注：按实际利率计算的账面价值包含成本和应计利息；其中，偏离金额=影子定价-按实际利率计算的账面价值，偏离度=偏离金额/通过按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末无期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末无黄金衍生品。

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 | 12,697,907,718.43 | - |
| 银行间市场 | 38,341,428,367.52 | - |
| 合计 | 51,039,336,085.95 | - |
| 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 | 9,576,585,858.44 | - |
| 银行间市场 | 50,175,782,921.17 | - |
| 合计 | 59,752,368,779.61 | - |

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均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

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内无其他债权投资减值准备。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他权益工具投资。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产。

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 | 1,609,784.76 | 1,634,566.32 |

| | | |
|----------|--------------|--------------|
| 其中：交易所市场 | - | - |
| 银行间市场 | 1,609,784.76 | 1,634,566.32 |
| 应付利息 | - | - |
| 预提费用 | 219,000.00 | 219,000.00 |
| 应付汇划费 | 18,400.00 | 14,800.00 |
| 合计 | 1,847,184.76 | 1,868,366.32 |

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 | 181,625,249,804.47 | 181,625,249,804.47 |
| 本期申购 | 1,277,415,640,560.31 | 1,277,415,640,560.31 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,274,792,779,423.12 | -1,274,792,779,423.12 |
| 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 | 184,248,110,941.66 | 184,248,110,941.66 |

注：申购含红利再投资、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金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 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 3,526,877,574.51 | - | 3,526,877,574.51 |
| 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 | -3,526,877,574.51 | - | -3,526,877,574.51 |
| 本期末 | - | - | - |

7.4.7.13 存款利息收入

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1月1日至2022年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|----------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 157,054,975.97 | 106,028,945.64 |
| 定期存款利息收入 | 1,341,996,100.92 | 1,262,528,699.65 |
| 其他存款利息收入 | - | - |
| 结算备付金利息收入 | 5,874,224.62 | 5,304,075.28 |
| 其他 | 2,140.49 | 1,052.60 |
| 合计 | 1,504,927,442.00 | 1,373,862,773.17 |

7.4.7.14 股票投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股票投资收益买卖股票差价收入。

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1月1日至2022年12月31日 |
|------------------------------|-----------------------------|----------------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 1,864,025,734.43 | 1,514,070,510.98 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 45,297,542.28 | 51,443,486.78 |
| 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 | 1,909,323,276.71 | 1,565,513,997.76 |

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1月1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 | 236,023,237,739.82 | 189,840,006,637.68 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 235,360,477,117.90 | 188,958,529,088.84 |
| 减：应计利息总额 | 617,461,906.62 | 830,033,912.36 |
| 减：交易费用 | 1,173.02 | 149.70 |
| 买卖债券差价收入 | 45,297,542.28 | 51,443,486.78 |

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益赎回差价收入。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无贵金属投资收益申购差价收入。

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益其他投资收益。

7.4.7.19 股利收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无股利收益。

7.4.7.20 公允价值变动收益

注：本基金本报告期间及上年度可比期间均无公允价值变动收益。

7.4.7.21 其他收入

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1月1日至2022 年12月31日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - | - |
| 其他 | 107,834.50 | 60,022.44 |
| 合计 | 107,834.50 | 60,022.44 |

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年12 月31日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日 |
|---------|---------------------------------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 90,000.00 | 90,000.00 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 120,000.00 |
| 证券出借违约金 | - | - |
| 账户服务费 | 36,630.00 | 35,720.00 |
| 银行汇划费 | 184,832.49 | 155,225.26 |
| 合计 | 431,462.49 | 400,945.26 |

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

截至资产负债表日，本基金无需要在财务报表附注中说明的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------------------------|-----------|
| 全球人寿保险国际公司 (AEGON International B.V) | 基金管理人的股东 |
| 兴证全球资本管理(上海)有限公司(“兴 | 基金管理人的子公司 |

| | |
|------------------------|---------------------|
| 证全球资本”) | |
| 兴证全球基金管理有限公司(“兴证全球基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 兴业证券股份有限公司(“兴业证券”) | 基金管理人的股东 |
| 兴业银行股份有限公司(“兴业银行”) | 基金托管人、基金销售机构 |

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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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1月1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 | 3,030,198,655.92 | 100.00 | 2,793,368,173.08 | 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1月1日至2022年12月31日 | |
|-------|-----------------------------|-------------------|----------------------------------|-------------------|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例(%) |
| 兴业证券 | 902,630,567,000.00 | 100.00 | 777,182,612,000.00 | 100.00 |

7.4.10.1.4 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间均无应支付关联方的佣金。

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 2023年1月1日至2023年 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022 |
|----|-----------------------|---------------------------|
| | | |

| | 12 月 31 日 | 年 12 月 31 日 |
|------------------|----------------|----------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 487,939,173.08 | 444,760,868.52 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 240,984,177.39 | 220,632,526.12 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 246,954,995.69 | 224,128,342.40 |

注：基金管理费按前一日基金资产净值的 0.27% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算方法如下：每日应支付的基金管理费=前一日基金资产净值×0.27%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|----------------|---|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 90,359,106.13 | 82,363,123.71 |

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

计算方法如下：每日应支付的基金托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期 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 |
| | 兴全添利宝货币 |
| 兴业银行 | 21,633,008.57 |
| 兴证全球基金 | 5,525,581.69 |
| 合计 | 27,158,590.26 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 |
| | 兴全添利宝货币 |
| 兴业银行 | 22,395,256.75 |
| 兴证全球基金 | 3,218,989.39 |
| 合计 | 25,614,246.14 |

注：支付给销售机构的基金销售服务费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算方法如下：每日应支付的基金销售服务费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

单位：人民币元

| 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 |
|--|
|--|

| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
|---|------------------|------------------|-------|------|-------------------|--------------|
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | 1,234,198,254.43 | 50,436,213.93 | - | - | 4,178,020,000.00 | 324,792.54 |
| 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 | | | | | | |
| 银行间市场交易的各关联方名称 | 债券交易金额 | | 基金逆回购 | | 基金正回购 | |
| | 基金买入 | 基金卖出 | 交易金额 | 利息收入 | 交易金额 | 利息支出 |
| 兴业银行 | 396,081,927.68 | 1,321,519,289.04 | - | - | 42,282,830,000.00 | 3,001,313.34 |

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日 | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------------------------|--|---|
| 基金合同生效日（2014 年 2 月 27 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 447,527,333.86 | 206,811,742.71 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 1,413,245,785.95 | 300,840,339.81 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 570,231,283.02 | 60,124,748.66 |
| 报告期末持有的基金份额 | 1,290,541,836.79 | 447,527,333.86 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 0.7004% | 0.2464% |

注：1. 期间申购/买入总份额含红利再投资、转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

2. 关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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 2023 年 12 月 31 日 | | 上年度末 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 (%) |
| 兴业银行 | 61,592,489.77 | 0.0334 | 67,190,755.64 | 0.0370 |
| 兴证全球资本 | 57,062,198.41 | 0.0310 | 58,866,858.47 | 0.0324 |

注：关联方投资本基金的费率按照基金合同和招募说明书规定的确定，符合公允性要求。

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 2023年1月1日至2023年12月31日 | | 上年度可比期间 2022年1月1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 |
| 兴业银行 | 19,644,748,487.55 | 252,146,783.48 | 5,556,280,303.80 | 169,049,502.12 |

注：本基金的银行存款由基金托管人兴业银行股份有限公司保管，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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

截至本报告期末，管理人持有的关联方兴业银行发行的同业存单面额 0.00 元，估值总额 0.00 元。截至上年度末，管理人持有的关联方兴业银行发行的同业存单面额 1,650,000,000.00 元，估值总额 1,635,626,609.88 元。

注：管理人持有的关联方发行的同业存单估值总额按照摊余成本法计算。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

| 已按再投资形式转 实收基金 | 直接通过应付 赎回款转出金额 | 应付利润 本年变动 | 本期利润分配合计 | 备注 |
|------------------|-------------------|--------------|------------------|----|
| 3,526,877,574.51 | - | - | 3,526,877,574.51 | - |

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

注：本基金本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

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 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为人民币 15,752,841,719.21 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 |
|-----------|-------------------|-------------------|------------|-----------|---------------|
| 112302061 | 23 工商银 行 CD061 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.47 | 1,000,000 | 98,469,187.78 |
| 112302062 | 23 工商银 | 2024 年 1 月 | 99.09 | 1,000,000 | 99,093,568.05 |

| | | | | | |
|-----------|---------------|----------------|--------|------------|------------------|
| | 行 CD062 | 2 日 | | | |
| 112303068 | 23 农业银行 CD068 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.25 | 1,510,000 | 149,873,869.13 |
| 112303184 | 23 农业银行 CD184 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.36 | 2,000,000 | 196,714,403.27 |
| 112304033 | 23 中国银行 CD033 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.22 | 2,000,000 | 198,431,736.24 |
| 112305076 | 23 建设银行 CD076 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.29 | 7,800,000 | 774,439,520.32 |
| 112305204 | 23 建设银行 CD204 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.35 | 2,000,000 | 196,700,515.90 |
| 112306242 | 23 交通银行 CD242 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.29 | 3,000,000 | 297,871,824.91 |
| 112306246 | 23 交通银行 CD246 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.28 | 1,237,000 | 122,803,598.68 |
| 112308215 | 23 中信银行 CD215 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.27 | 500,000 | 49,135,226.73 |
| 112311052 | 23 平安银行 CD052 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.29 | 1,000,000 | 99,291,237.54 |
| 112311055 | 23 平安银行 CD055 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.26 | 3,000,000 | 297,766,701.31 |
| 112311122 | 23 平安银行 CD122 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.35 | 1,000,000 | 98,350,328.78 |
| 112312112 | 23 北京银行 CD112 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.65 | 9,000,000 | 887,806,501.72 |
| 112312147 | 23 北京银行 CD147 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.19 | 8,601,000 | 853,147,127.82 |
| 112317099 | 23 光大银行 CD099 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.34 | 3,165,000 | 314,416,619.53 |
| 112317194 | 23 光大银行 CD194 | 2024 年 1 月 2 日 | 98.34 | 1,560,000 | 153,410,808.41 |
| 112322089 | 23 邮储银行 CD089 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.29 | 770,000 | 76,453,768.39 |
| 112383148 | 23 成都银行 CD150 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.31 | 5,807,000 | 576,682,566.81 |
| 112396837 | 23 宁波银行 CD063 | 2024 年 1 月 2 日 | 99.27 | 10,835,000 | 1,075,612,789.53 |
| 140215 | 14 国开 15 | 2024 年 1 月 2 日 | 103.85 | 499,000 | 51,818,664.97 |
| 210207 | 21 国开 07 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.86 | 3,111,000 | 316,879,798.61 |
| 210213 | 21 国开 13 | 2024 年 1 月 2 日 | 100.28 | 50,800,000 | 5,094,129,745.52 |
| 210406 | 21 农发 06 | 2024 年 1 月 | 101.36 | 5,300,000 | 537,222,586.80 |

| | | | | | |
|--------|----------|-------------------|--------|-------------|-------------------|
| | | 2 日 | | | |
| 210409 | 21 农发 09 | 2024 年 1 月 2 日 | 100.11 | 30,900,000 | 3,093,532,266.51 |
| 230406 | 23 农发 06 | 2024 年 1 月 2 日 | 101.34 | 7,300,000 | 739,749,196.82 |
| 合计 | | | | 164,695,000 | 16,449,804,160.08 |

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 12 月 31 日止,基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 638,308,172.20 元,于 2024 年 1 月 2 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券,按证券交易所规定的比例折算为标准券后,不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险,主要包括:信用风险、流动性风险、市场风险。本基金管理人制定了政策和程序以识别及分析相关风险,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。

本基金管理人建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、风险管理部和审计部及合规管理部、相关职能部门和业务部门构成的四级风险管理架构体系。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任,或者基金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。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,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%,且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的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位:人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2023 年 12 月 31 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|-------------------------|--------------------------|
| A-1 | - | 727,642,866.04 |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 1,154,289,891.48 | 6,079,521,522.40 |

| | | |
|----|------------------|------------------|
| 合计 | 1,154,289,891.48 | 6,807,164,388.44 |
|----|------------------|------------------|

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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同业存单投资。

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 | 4,120,724,887.32 | 5,608,252,260.84 |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 30,257,289.84 |
| 合计 | 4,120,724,887.32 | 5,638,509,550.68 |

注：此处列示的信用证券不包括国债、央行票据、政策性金融债券等非信用债券投资。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末及上年度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

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 | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 57,336,534,932.18 | 65,900,965,923.34 |
| 合计 | 57,336,534,932.18 | 65,900,965,923.34 |

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

本基金所持大部分证券为剩余期限较短、信誉良好的国债、企业债及央行票据等，主要在银行间同业市场交易。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金、提前支取定期存款等方式应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金为开放式基金，投资者可在合同规定交易日进行基金申购与赎回业务，本基金管理人针对基金特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本基金管理人每日预测基金的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照基金类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款及强制赎回费条款，同时控制每日确认的净赎回申请不超过本基金投资组合 7 个工作日可变现资产的可变现价值，减少赎回业务对本基金的流动性冲击，从而控制流动性风险。此外，本基金通过预留一定的现金头寸，并且可在需要时通过卖出回购金融资产方式借入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。截止本报告期末，本基金前十名份额持有人持有基金份额比例未超过基金总份额 20%，本基金投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金主要投资于银行间市场交易的固定收益品种，以摊余成本计价，并通过“影子定价”机制使按摊余成本确认的基金资产净值能近似反映基金资产的公允价值，因此本基金的运作仍然存在相应的利率风险。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感度缺口进行监控。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本 期 末 202 3年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1 - 5 年 上 | 5 年 以 上 | 不计息 | 合计 |
|--|-------------------|------------------|-------------------|-----------------------|------------------|-----|-------------------|
| 资 产 | | | | | | | |
| 货 币 | 13,916,076,957.38 | 5,343,733,166.83 | 59,871,366,970.84 | - | - | - | 79,131,177,095.05 |

| | | | | | | |
|----------|-------------------|-------------------|--------------------|---|-----------------|--------------------|
| 资金 | | | | | | |
| 结算备付金 | 290,879,776.91 | - | - | - | - | 290,879,776.91 |
| 存出保证金 | 95,472.94 | - | - | - | - | 95,472.94 |
| 交易性金融资产 | 6,780,791,746.19 | 12,950,946,137.09 | 53,292,717,290.46 | - | - | 73,024,455,173.74 |
| 买入返售金融资产 | 50,003,459,155.74 | 435,123,785.96 | 600,753,144.25 | - | - | 51,039,336,085.95 |
| 应收清算款 | - | - | - | - | -992,327,734.55 | 992,327,734.55 |
| 资产总计 | 70,991,303,109.16 | 18,729,803,089.88 | 113,764,837,405.55 | - | -992,327,734.55 | 204,478,271,339.14 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 42,104,715.41 | 42,104,715.41 |

| | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|--------------------|---|-------------------|--------------------|
| 应付托管费 | - | - | - | - | 7,797,169.50 | 7,797,169.50 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | 3,747,114,824.00 | 3,747,114,824.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 16,391,149,891.41 | - | - | - | - | 16,391,149,891.41 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 38,985,847.59 | 38,985,847.59 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 1,160,764.81 | 1,160,764.81 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 1,847,184.76 | 1,847,184.76 |
| 负债总计 | 16,391,149,891.41 | - | - | - | 3,839,010,506.07 | 20,230,160,397.48 |
| 利率敏感度缺口 | 54,600,153,217.75 | 18,729,803,089.88 | 113,764,837,405.55 | - | -2,846,682,771.52 | 184,248,110,941.66 |

| 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 | | | | | | |
| 货币资金 | 15,519,356,830.15 | 6,358,280,291.80 | 32,900,492,071.50 | - | - | 54,778,129,193.45 |
| 结算备付金 | 260,253,838.60 | - | - | - | - | 260,253,838.60 |
| 存出保证金 | 52,713.63 | - | - | - | - | 52,713.63 |
| 交易性金融资产 | 4,736,774,540.03 | 26,903,941,177.39 | 52,693,497,736.99 | - | - | 84,334,213,454.41 |
| 买入返售金融资产 | 55,266,563,355.52 | 3,168,329,184.12 | 1,317,476,239.97 | - | - | 59,752,368,779.61 |
| 应收清算 | - | - | - | - | 686,990,200.01 | 686,990,200.01 |

| | | | | | | |
|-----------|-------------------|-------------------|-------------------|---|------------------|--------------------|
| 款 | | | | | | |
| 资产总计 | 75,783,001,277.93 | 36,430,550,653.31 | 86,911,466,048.46 | - | -686,990,200.01 | 199,812,008,179.71 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 41,032,554.96 | 41,032,554.96 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 7,598,621.26 | 7,598,621.26 |
| 应付清算款 | - | - | - | - | 3,412,525,421.68 | 3,412,525,421.68 |
| 卖出回购金融资产款 | 14,685,463,935.49 | - | - | - | - | 14,685,463,935.49 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 37,993,106.44 | 37,993,106.44 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 276,369.09 | 276,369.09 |
| 其他 | - | - | - | - | 1,868,366.32 | 1,868,366.32 |

| | | | | | | |
|---------------------------------|-----------------------|-----------------------|-----------------------|--|-----------------------|------------------------|
| 他 负 债 | | | | | | |
| 负 债 总 计 | 14,685,463,935. 49 | | | | 3,501,294,439. 75 | 18,186,758,375. 24 |
| 利 率 敏 感 度 缺 口 | 61,097,537,342. 44 | 36,430,550,653. 31 | 86,911,466,048. 46 | | -2,814,304,239. 74 | 181,625,249,804. 47 |

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| | | | |
|----|---------------------------------|---------------------------------|-----------------------|
| 假设 | 其他影响债券公允价值的变量保持不变，仅利率发生变动； | | |
| | 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) |
| | 市场利率上升1% | -280,079,862.48 | -265,554,632.37 |
| | 市场利率下降1% | 282,615,424.48 | 267,690,693.95 |

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基金净值产生的影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

本基金其他价格风险主要系市场价格风险，市场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。本基金主要投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，且以摊余成本进行后续计量，因此无重大市场价格风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

无。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

注：无。

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的层次，由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决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：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 | 73,024,455,173.74 | 84,334,213,454.41 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 73,024,455,173.74 | 84,334,213,454.41 |

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况**7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况**

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

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，本基金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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§ 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 | 73,024,455,173.74 | 35.71 |
| | 其中：债券 | 73,024,455,173.74 | 35.71 |
| | 资产支持证 券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 51,039,336,085.95 | 24.96 |
| | 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 | 79,422,056,871.96 | 38.84 |
| 4 | 其他各项资产 | 992,423,207.49 | 0.49 |
| 5 | 合计 | 204,478,271,339.14 | 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 | | 7.12 |
| | 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 | 16,391,149,891.41 | 8.90 |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

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

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的 20%的说明

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

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 | 114 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 118 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 71 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

注：本报告期内未发生投资组合平均期限超过 120 天的情况。

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 | 38.95 | 10.93 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 2.05 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 8.14 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 15.87 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 45.66 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 110.66 | 10.93 |

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

注：本报告期内投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-------|-------------------|---------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 13,354,212,567.38 | 7.25 |
| | 其中：政策 | 10,412,905,462.76 | 5.65 |

| | | | |
|----|--------------------|-------------------|-------|
| | 性金融债 | | |
| 4 | 企业债券 | 975,179,293.19 | 0.53 |
| 5 | 企业短期融资券 | 1,154,289,891.48 | 0.63 |
| 6 | 中期票据 | 204,238,489.51 | 0.11 |
| 7 | 同业存单 | 57,336,534,932.18 | 31.12 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 73,024,455,173.74 | 39.63 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量 (张) | 按实际利率计算的 账面价值(元) | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|-----------|---------------------|-------------|---------------------|------------------|
| 1 | 210213 | 21 国开 13 | 50,800,000 | 5,094,129,745.52 | 2.76 |
| 2 | 210409 | 21 农发 09 | 30,900,000 | 3,093,532,266.51 | 1.68 |
| 3 | 112302065 | 23 工商银行 CD065 | 13,000,000 | 1,287,776,052.50 | 0.70 |
| 4 | 112374059 | 23 成都银行 CD241 | 13,000,000 | 1,283,038,762.03 | 0.70 |
| 5 | 112372851 | 23 厦门国际 银行 CD138 | 12,000,000 | 1,185,165,868.32 | 0.64 |
| 6 | 112313214 | 23 浙商银行 CD214 | 12,000,000 | 1,185,141,119.40 | 0.64 |
| 7 | 112396837 | 23 宁波银行 CD063 | 11,500,000 | 1,141,628,710.62 | 0.62 |
| 8 | 112312147 | 23 北京银行 CD147 | 11,000,000 | 1,091,107,825.37 | 0.59 |
| 9 | 112389382 | 23 厦门国际 银行 CD100 | 11,000,000 | 1,090,751,729.06 | 0.59 |
| 10 | 112381889 | 23 徽商银行 CD100 | 11,000,000 | 1,085,859,627.64 | 0.59 |

8.7 “影子定价”与按实际利率计算账面价值确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|----------------------------------|----------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25 (含) -0.5% 间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0668% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0324% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0250% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25% 情况说明

注：报告期内本基金未发生负偏离度的绝对值达到 0.25% 的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5% 情况说明

注：本报告期内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名的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.9 投资组合报告附注

8.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法（除特殊情况外），即估值对象以买入成本列示，按照实际利率每日计提应收利息。

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，厦门国际银行股份有限公司、宁波银行股份有限公司、北京银行股份有限公司、徽商银行股份有限公司具有在报告编制日前一年内受到监管部门处罚的情形；本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

本基金投资的前十名证券发行主体中，未见其他发行主体有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情形。

8.9.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|----------------|
| 1 | 存出保证金 | 95,472.94 |
| 2 | 应收清算款 | 992,327,734.55 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 992,423,207.49 |

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 (%) |
| 17,961,265 | 10,258.08 | 4,190,767,357.28 | 2.27 | 180,057,343,584.38 | 97.73 |

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 | 银行类机构 | 1,387,964,896.25 | 0.75 |
| 2 | 基金类机构 | 1,126,778,016.43 | 0.61 |
| 3 | 银行类机构 | 777,571,787.74 | 0.42 |
| 4 | 银行类机构 | 229,740,357.69 | 0.12 |
| 5 | 基金类机构 | 163,540,755.33 | 0.09 |
| 6 | 银行类机构 | 160,293,136.00 | 0.09 |
| 7 | 个人 | 77,461,318.04 | 0.04 |
| 8 | 银行类机构 | 60,069,606.59 | 0.03 |
| 9 | 银行类机构 | 58,369,069.60 | 0.03 |
| 10 | 基金类机构 | 57,062,198.41 | 0.03 |

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 | 46,314,000.49 | 0.0251 |

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间 (万份) |
|------------------------------------|--------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0~10 |

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

注：本报告期末，本基金基金经理未兼任私募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 (2014 年 2 月 27 日) 基金份额总额 | 1,306,352,581.78 |
|-------------------------------------|------------------|

| | |
|---------------|----------------------|
| 本报告期期初基金份额总额 | 181,625,249,804.47 |
| 本报告期基金总申购份额 | 1,277,415,640,560.31 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 1,274,792,779,423.12 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 184,248,110,941.66 |

注：总申购份额含红利再投资、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

(1) 报告期内基金管理人无重大人事变动。

(2) 本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动如下：

自 2023 年 4 月 11 日起，陈启女士担任基金托管人资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作，叶文煌先生不再担任基金托管人资产托管部总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2014 年起连续 10 年聘请德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务。本年度应支付给所聘任的会计师事务所 90,000.00 元人民币。

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

注：本报告期内管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：报告期内本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到监管部门的稽查或处罚。

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 | - | - | - | - | - |

注：根据中国证监会的有关规定，我司在综合考量证券经营机构的财务状况、经营状况、研究能力、客户服务质量的基础上，选择基金专用交易席位。

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 | 3,030,198,655.92 | 100.00 | 902,630,567,000.00 | 100.00 | - | - |

11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况

无。

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 | 关于调整网上直销部分基金转换/赎回回购优惠费率的公告 | 证券日报、指定互联网网站 | 2023-06-06 |
| 2 | 关于使用自有资金自购旗下权益类公募基金五千万的公告 | 证券日报、指定互联网网站 | 2023-08-21 |

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

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

2、“赎回份额”包含份额赎回、转换转出等导致投资者持有份额减少的情形。

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、中国证监会准予兴全添利宝货币市场基金募集注册的文件；
- 2、《兴全添利宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《兴全添利宝货币市场基金托管协议》；
- 4、关于申请募集兴全添利宝货币市场基金之法律意见；
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人的办公场所。

13.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站（<http://www.xqfunds.com>）查阅，或在营业时间内至基金管理人、基金托管人办公场所免费查阅。

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

兴证全球基金管理有限公司

2024年3月29日