

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产
管理计划
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：兴证证券资产管理有限公司

基金托管人：中国证券登记结算有限责任公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§1 重要提示

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

集合计划托管人中国证券登记结算有限责任公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

集合计划管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，但不保证集合计划一定盈利。

集合计划的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本集合计划的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 兴证资管金麒麟现金添利货币 |
| 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 |
| 报告期末基金份额总额 | 3,062,459,187.42 份 |
| 投资目标 | 本集合计划在不影响客户正常证券交易的前提下，将客户资金账户中的闲置保证金转换为产品份额，通过投资于银行存款组合及其他具有良好流动性的短期金融工具，在保证资金安全性和充分流动性的情况下，力求为投资者获取合理收益。 |
| 投资策略 | 第一，在资产投资策略上，主要包括资产配置策略、利率预期策略、利率品种投资策略、信用品种投资策略、银行定期存款投资策略、杠杆投资策略。本集合计划将在深入研究国内外的宏观经济走势、货币政策变化趋势、市场资金供求状况的基础上，分析和判断利率走势与收益率曲线变化趋势，并综合考虑各类投资品种的收益性、流动性和风险特征，对集合计划资产组合进行积极管理。第二，在流动性管理策略上，本集合计划将紧密关注申购/赎回现金流变化情况、季节性资金流动等影响集合计划流动性管理的因素，建立组合流动性监控管理指标，实现对集合计划资产流动性的实时管理。本集合计划将通过对市场结构、市场冲击情况、主要资产流动性变化跟踪分析等多种方式对流动性进行定量定性分析，在进行组合优化时增加流动性约束条件，在兼顾集合计划收益的前提下合理地控制资产的流动性风险，综合平衡集合计划资产在流动性资产和收益性资产之间的配置比例，通 |

| | |
|--------|--|
| | 过现金留存、持有高流动性券种、正向回购、降低组合久期等方式提高集合计划资产整体的流动性。 |
| 业绩比较基准 | 同期中国人民银行公布的七天通知存款利率（税后）。 |
| 风险收益特征 | 本集合计划作为货币型集合资产管理计划，其长期平均风险和预期收益率低于股票型集合资产管理计划、混合型集合资产管理计划、债券型集合资产管理计划。 |
| 基金管理人 | 兴证证券资产管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中国证券登记结算有限责任公司 |

注：1、管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划进行了规范，并在收到中国证监会准予兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 10 月 11 日生效。“兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划”（以下称本集合计划）。

2、投资者依据原《兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划份额，自 2022 年 10 月 11 日起全部自动转换为兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划份额。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日） |
|-------------|-------------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 5,439,295.64 |
| 2. 本期利润 | 5,439,295.64 |
| 3. 期末基金资产净值 | 3,062,459,187.42 |

注：本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益，由于货币市场集合计划采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3.2 基金净值表现

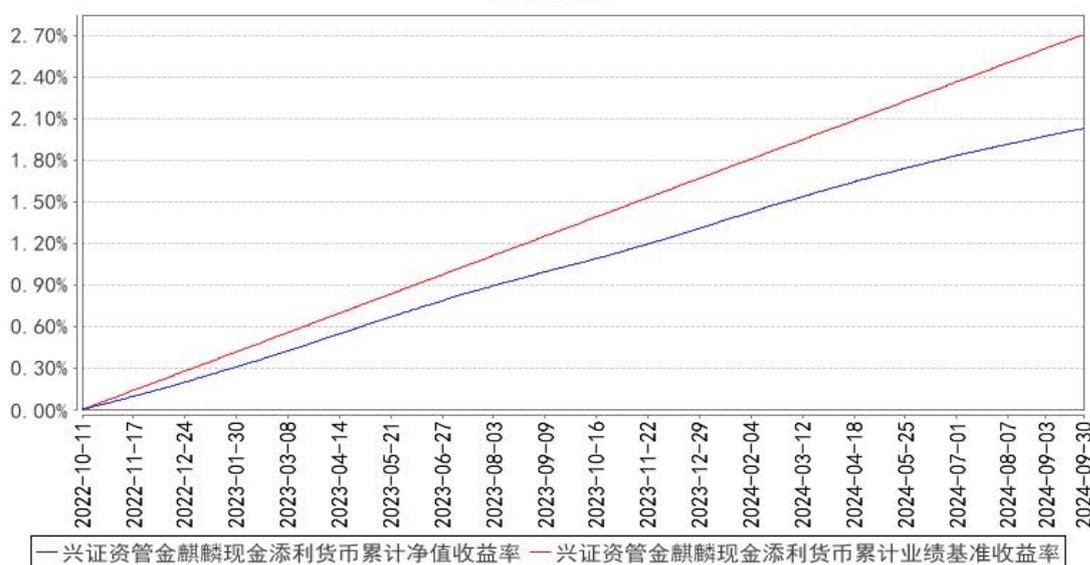
3.2.1 基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 净值收益率① | 净值收益率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基准 收益率标准差 | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|---------------|----------------|------------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|----------------|---------|---------|---------|---------|----------|---------|
| | | | | ④ | | |
| 过去三个月 | 0.1976% | 0.0001% | 0.3450% | 0.0000% | -0.1474% | 0.0001% |
| 过去六个月 | 0.4376% | 0.0003% | 0.6863% | 0.0000% | -0.2487% | 0.0003% |
| 过去一年 | 0.9780% | 0.0004% | 1.3725% | 0.0000% | -0.3945% | 0.0004% |
| 自基金合同 生效起至今 | 2.0288% | 0.0004% | 2.7037% | 0.0000% | -0.6749% | 0.0004% |

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

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 2024 年 09 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-------------------------|------------------|------|--------|--|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 游臻 | 兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理 | 2022 年 10 月 11 日 | - | 12 年 | 新加坡管理大学硕士。2012 年 9 月进入金融行业，任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014 年 12 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易运营部交易员、固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。 |

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作合规守信情况说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

基本面方面，7-9 月 PMI 分别为 49.4、49.1、49.8，经济整体仍处于波浪式运行中，较二季度继续回落。7-8 月经济数据延续前期走势，呈现供给修复强于需求之特征，需求仍待强化。7 月金融数据弱于季节性，一方面说明需求偏弱的问题仍然存在，一方面也是信贷继续挤水分的体现。符合 2024 年第一季度货币政策执行报告专栏中提及“盘活被低效占用的金融资源，减少资金空转沉淀，大力发展直接融资，这可能会使得信贷总量增速放缓”的描述。8 月金融数据反应经济趋势仍未逆转。总体上，实体经济融资需求弱的格局仍然存在。目前经济运行情况整体仍处于波动与反复中，内生动能和微观主体活力仍有待改善，后续关注实体融资需求、整体市场需求是否改善，以及地产政策落地效果，并关注是否有超预期财政政策出台等。市场方面，三季度资金

情况整体均衡，价格偏高，月末、季末，机构跨月跨季平稳顺利。现券方面，三季度以来，超长端、长端利率债走势波折，整体先下后上。7月初，人民银行公告将面向部分公开市场业务一级交易商开展国债借入操作、新增临时正回购或逆回购操作工具等；7月中，金融监管部门调研地方法人银行债券投资情况；7月末，人民银行推迟 MLF 续作并下调 MLF 操作利率 20bp 至 2.30%，弥合与同业存单等市场利率之间的差异。超长端、长端利率债大幅下行。8月至9月，超长端、长端利率债先上后下，直至9月末，人民银行宣布将下调存款准备金率 0.5 个百分点、下调 7 天逆回购操作利率 0.2 个百分点，将下调存量房贷利率等，30 年国债活跃券、10 年国债活跃券分别触及近期低点后大幅反弹。

全季度 30 年国债活跃券累计下行 14bp 左右，10 年国债活跃券累计下行 9bp 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，力争提升组合收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划本报告期集合计划份额净值收益率为 0.1976%，业绩比较基准收益率为 0.3450%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本集合计划未出现连续二十个工作日计划份额持有人数量不满两百人或者计划资产净值低于五千万元的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-----------------------|------------------|--------------|
| 1 | 固定收益投资 | 2,181,515,251.97 | 71.04 |
| | 其中：债券 | 2,181,515,251.97 | 71.04 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 640,036,460.71 | 20.84 |
| | 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 | 249,239,266.09 | 8.12 |
| 4 | 其他资产 | 16,876.72 | 0.00 |
| 5 | 合计 | 3,070,807,855.49 | 100.00 |

5.2 报告期债券回购融资情况

| 序号 | 项目 | 占基金资产净值的比例（%） |
|----|----|---------------|
|----|----|---------------|

| | | | |
|----|--------------|-------|---------------|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | 0.72 | |
| | 其中：买断式回购融资 | - | |
| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金资产净值的比例（%） |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中：买断式回购融资 | - | - |

注：报告期内债券回购融资余额占本集合计划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

在本报告期内本集合计划债券正回购的资金余额未超过资产净值的 20%。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

| 项目 | 天数 |
|-------------------|-----|
| 报告期末投资组合平均剩余期限 | 79 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 116 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 78 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内本集合计划未发生投资组合平均期限超过 120 天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

| 序号 | 平均剩余期限 | 各期限资产占基金资产净值的比例（%） | 各期限负债占基金资产净值的比例（%） |
|----|------------------------|--------------------|--------------------|
| 1 | 30 天以内 | 29.03 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天（含）—60 天 | 16.30 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 16.25 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90 天（含）—120 天 | 15.28 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天（含）—397 天（含） | 23.30 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 100.16 | - |

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过 240 天情况说明

本报告期内本集合计划投资组合平均剩余存续期未发生超过 240 天的情况。

5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|----------------------|------------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 123,168,826.51 | 4.02 |
| | 其中：政策性金融债 | 123,168,826.51 | 4.02 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 50,378,554.81 | 1.65 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 2,007,967,870.65 | 65.57 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 2,181,515,251.97 | 71.23 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量（张） | 摊余成本（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|-----------|---------------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 112306256 | 23 交通银行 CD256 | 1,000,000 | 99,854,060.04 | 3.26 |
| 2 | 112403107 | 24 农业银行 CD107 | 1,000,000 | 99,772,437.55 | 3.26 |
| 3 | 112406212 | 24 交通银行 CD212 | 1,000,000 | 99,567,160.00 | 3.25 |
| 4 | 112303265 | 23 农业银行 CD265 | 1,000,000 | 99,565,626.74 | 3.25 |
| 5 | 112403045 | 24 农业银行 CD045 | 1,000,000 | 99,543,979.51 | 3.25 |
| 6 | 112402017 | 24 工商银行 CD017 | 1,000,000 | 99,413,153.78 | 3.25 |
| 7 | 112420155 | 24 广发银行 CD155 | 1,000,000 | 99,218,822.44 | 3.24 |
| 8 | 112403047 | 24 农业银行 CD047 | 1,000,000 | 99,132,072.28 | 3.24 |
| 9 | 112420169 | 24 广发银行 CD169 | 1,000,000 | 99,128,561.42 | 3.24 |
| 10 | 112404017 | 24 中国银行 CD017 | 1,000,000 | 98,825,323.71 | 3.23 |

5.7 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

| 项目 | 偏离情况 |
|-------------------------------|---------|
| 报告期内偏离度的绝对值在 0.25（含）-0.5%间的次数 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0699% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0145% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0372% |

报告期内负偏离度的绝对值达到 0.25%情况说明

报告期内本集合计划未发生负偏离度的绝对值达到 0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到 0.5%情况说明

报告期内本集合计划未发生正偏离度的绝对值达到 0.5%的情况。

5.8 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

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

5.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期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

本集合计划投资前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国银行股份有限公司、交通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，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.9.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|-----------|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | 16,876.72 |
| 3 | 应收利息 | - |
| 4 | 应收申购款 | - |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 其他 | - |
| 7 | 合计 | 16,876.72 |

5.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------|-------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 2,495,667,455.08 |
| 报告期间基金总申购份额 | 15,655,840,155.61 |
| 报告期间基金总赎回份额 | 15,089,048,423.27 |
| 报告期期末基金份额总额 | 3,062,459,187.42 |

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本集合计划管理人不存在申购、赎回或交易本集合计划的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024 年 9 月，孙国雄先生代为履行公司总经理职务，徐翔先生不再担任公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 8、法律法规及中国证监会要求的其他文件。

9.2 存放地点

本集合计划管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼）

9.3 查阅方式

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

兴证证券资产管理有限公司
2024 年 10 月 25 日