

# 中信建投添鑫宝货币市场基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29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，投资者投资于货币市场基金并不等于将资金作为存款存放在银行或者存款类金融机构，基金管理人也不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。

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2024年1月1日起至6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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
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	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 债券回购融资情况	46
7.3 基金投资组合平均剩余期限	46
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	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 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	48
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	48
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	48
7.9 投资组合报告附注	49
§8 基金份额持有人信息	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	50
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	51
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	51
§9 开放式基金份额变动	51

§10 重大事件揭示 .....	52
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 .....	54
10.9 其他重大事件 .....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
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 .....	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
§12 备查文件目录 .....	57
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	58

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投添鑫宝货币市场基金		
基金简称	中信建投添鑫宝		
基金主代码	002260		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年12月16日		
基金管理人	中信建投基金管理有限公司		
基金托管人	中信银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	8,292,710,249.37份		
基金合同存续期	不定期		
下属各类别基金的基金简称	中信建投添鑫宝A	中信建投添鑫宝C	中信建投添鑫宝D
下属各类别基金的交易代码	002260	018202	020449
报告期末下属各类别基金的份额总额	8,236,772,172.53份	25,282,076.26份	30,656,000.58份

注：根据基金管理人于2024年1月24日披露的《中信建投基金管理有限公司关于中信建投添鑫宝货币市场基金增加D类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》，自2024年1月24日起，本基金增加D类基金份额（基金代码：020449）。

### 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前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将通过分析宏观经济形势、财政与货币政策、市场及其结构变化和短期的资金供需等因素，形成对市场短期利率走势的判断。在以上分析的基础上，本基金将根据不同类别资产的收益率水平（不同剩余期限到期收益率、利息支付方式以及再投资便利性），结合各类资产的流动性特征（成交活跃度、发行规模）和风险特征（信用等级、波动性），决定各类资产的配置比例和期限匹配情况。

业绩比较基准	七天通知存款税后利率
风险收益特征	本基金为货币市场基金，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低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。

### 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		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-59100298	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	方合英

### 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层

## §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 (2024年01月01日-2024年06月30日)		
	中信建投添鑫宝 A	中信建投添 鑫宝C	中信建投添 鑫宝D
本期已实现收益	67,504,527.62	277,430.40	4,809,809.53
本期利润	67,504,527.62	277,430.40	4,809,809.53
本期净值收益率	0.7844%	0.8183%	0.7737%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)		
	期末基金资产净值	8,236,772,172.53	25,282,076.26
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)		
	累计净值收益率	21.7956%	2.1166%

注：1、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。

2、本基金的利润分配于2023年3月24日由按月结转基金份额转为按日结转基金份额。

3、持有人认购或交易本基金时，不需缴纳任何费用。

### 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

中信建投添鑫宝A

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
过去一个月	0.1185%	0.0001%	0.1125%	0.0000%	0.0060%	0.0001%
过去三个月	0.3673%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	0.0260%	0.0002%
过去六个月	0.7844%	0.0004%	0.6825%	0.0000%	0.1019%	0.0004%

过去一年	1.6314%	0.0004%	1.3725%	0.0000%	0.2589%	0.0004%
过去三年	5.2661%	0.0011%	4.1100%	0.0000%	1.1561%	0.0011%
自基金合同生效起至今	21.7956%	0.0025%	11.7000%	0.0000%	10.0956%	0.0025%

中信建投添鑫宝C

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
过去一个月	0.1227%	0.0001%	0.1125%	0.0000%	0.0102%	0.0001%
过去三个月	0.3796%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	0.0383%	0.0002%
过去六个月	0.8183%	0.0004%	0.6825%	0.0000%	0.1358%	0.0004%
过去一年	1.6919%	0.0004%	1.3725%	0.0000%	0.3194%	0.0004%
自基金合同生效起至今	2.1166%	0.0007%	1.7025%	0.0000%	0.4141%	0.0007%

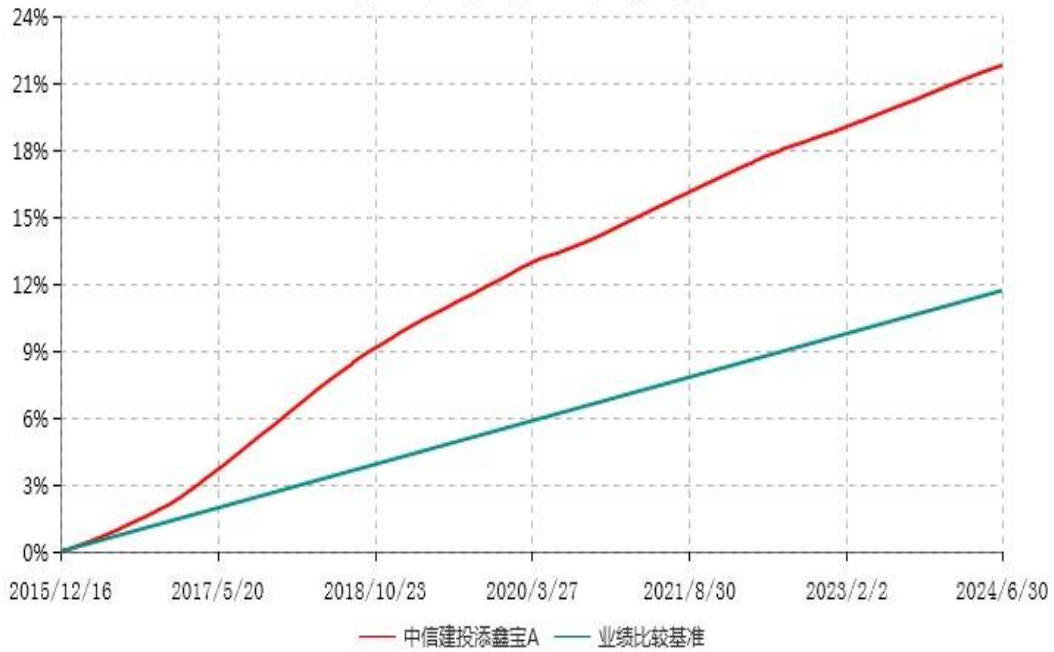
中信建投添鑫宝D

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
过去一个月	0.1376%	0.0002%	0.1125%	0.0000%	0.0251%	0.0002%
过去三个月	0.4265%	0.0002%	0.3413%	0.0000%	0.0852%	0.0002%
自基金合同生效起至今	0.7737%	0.0003%	0.5925%	0.0000%	0.1812%	0.0003%

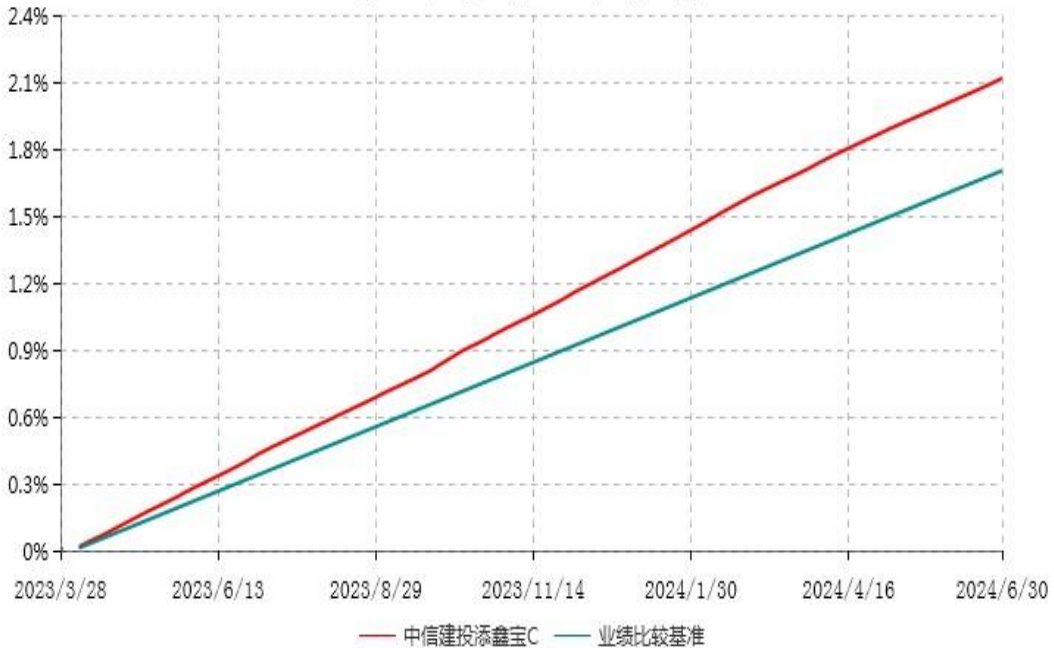
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中信建投添鑫宝A累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2015年12月16日-2024年06月30日)



中信建投添鑫宝C累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2023年03月28日-2024年06月30日)



中信建投添鑫宝D累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2024年01月25日-2024年06月30日)



- 注：1、以上第1张图为中信建投添鑫宝A基金份额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，绘图日期为2015年12月16日（基金合同生效日）至2024年6月30日；
- 2、以上第2张图为中信建投添鑫宝C基金份额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，绘图日期为2023年3月28日（首笔份额登记日）至2024年6月30日；
- 3、以上第3张图为中信建投添鑫宝D基金份额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，绘图日期为2024年1月25日（首笔份额登记日）至2024年6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

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本4.5亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共57个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加

强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

#### 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		
潘泓宇	本基金的基金经理	2022-03-04	-	7年	中国籍，1992年11月生，马里兰大学会计学硕士。2016年9月加入中信建投基金管理有限公司，曾任运营管理部基金会计、交易部交易员、投资部-固收投资部基金经理助理，现任本公司固定收益部基金经理，担任中信建投凤凰货币市场基金、中信建投添鑫宝货币市场基金、中信建投稳泰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信建投景明一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信建投中证同业存单AAA指数7天持有期证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度

指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

#### 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

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理人公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金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5%的情况。

#### 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

报告期内，我国主要经济指标保持稳定，中长期经济预期持续走强，人民币汇率保持稳定，经济结构不断优化。具体来看，失业率比上年同期下降0.2个百分点，CPI和核心CPI同比温和上涨，在地产政策连续出台后，地产销售数据在6月单月同比和环比值均出现明显回升，新质生产力相关投资和绿色低碳相关投资也实现了较快增长。银行间流动性保持合理充裕，债券收益率震荡下行。

报告期内，本基金在严控信用风险和流动性风险的前提下，择时调整久期和杠杆，为基金份额持有人谋取长期稳定回报。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投添鑫宝A基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.7844%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末中信建投添鑫宝C基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.8183%，同期业绩比较基准收益率为0.6825%；截至报告期末中信建投添鑫宝D基金份额净值为1.0000元，本报告期内，该类基金份额净值收益率为0.7737%，同期业绩比较基准收益率为0.5925%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我国经济潜力大，政策空间足，中长期向好的趋势在不断巩固加强，货币政策和财政政策有望持续发力，人民币汇率有望保持窄幅双边波动，债券市场在经历了上半年收益率下行后性价比有所下降，预期后续债券收益率会窄幅波动。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部门的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配方式为红利再投资，于2023年3月24日由按月结转基金份额转为按日结转基金份额。本报告期基金应分配利润为72,591,767.55元，已全部分配，符合法律法规和基金合同的相关规定。

#### 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

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满200人或者基金资产净值低于5000万元的情形。

## §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

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《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，对中信建投添鑫宝货币市场基金2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投添鑫宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §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：中信建投添鑫宝货币市场基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	691,447,207.12	83,464,679.50
结算备付金		-	11,093,893.33
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	5,284,492,758.61	6,153,221,468.99
其中：股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		5,284,492,758.61	6,153,221,468.99

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	2,393,862,643.35	488,113,205.53
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		29,391,753.20	265,830.06
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		8,399,194,362.28	6,736,159,077.41
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		100,027,397.26	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,668,463.50	2,308,559.84
应付托管费		404,312.68	349,781.75
应付销售服务费		1,834,121.83	1,747,384.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		156,522.11	156,522.11
应付利润		1,056,535.65	966,094.06
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	336,759.88	406,974.45
负债合计		106,484,112.91	5,935,317.00
<b>净资产：</b>			

实收基金	6.4.7.6	8,292,710,249.37	6,730,223,760.41
未分配利润	6.4.7.7	-	-
净资产合计		8,292,710,249.37	6,730,223,760.41
负债和净资产总计		8,399,194,362.28	6,736,159,077.41

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额净值1.0000元，基金份额总额8,292,710,249.37份，其中中信建投添鑫宝货币市场基金A类基金份额8,236,772,172.53份，中信建投添鑫宝货币市场基金C类基金份额25,282,076.26份，中信建投添鑫宝货币市场基金D类基金份额30,656,000.58份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投添鑫宝货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
一、营业总收入		101,765,333.56	127,253,207.07
1.利息收入		37,750,737.47	47,551,171.70
其中：存款利息收入	6.4.7.8	8,639,731.22	13,969,307.71
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		29,111,006.25	33,581,863.99
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		64,014,596.09	79,702,035.37
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	64,014,596.09	79,702,035.37
资产支持证券投资 收益		-	-



贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	-
股利收益	6.4.7.12	-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.13	-	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		29,173,566.01	35,826,683.29
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	15,201,383.30	18,114,889.09
2.托管费	6.4.10.2.2	2,303,239.84	2,744,680.26
3.销售服务费	6.4.10.2.3	10,844,570.15	13,722,415.13
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		654,640.56	1,066,783.34
其中：卖出回购金融资产支出		654,640.56	1,066,783.34
6.信用减值损失	6.4.7.15	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.16	169,732.16	177,915.47
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		72,591,767.55	91,426,523.78
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		72,591,767.55	91,426,523.78
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		72,591,767.55	91,426,523.78

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投添鑫宝货币市场基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,730,223,760.41	-	6,730,223,760.41
二、本期期初净资产	6,730,223,760.41	-	6,730,223,760.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,562,486,488.96	-	1,562,486,488.96
（一）、综合收益总额	-	72,591,767.55	72,591,767.55
（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）	1,562,486,488.96	-	1,562,486,488.96
其中：1.基金申购款	85,652,320,874.27	-	85,652,320,874.27
2.基金赎回款	-84,089,834,385.31	-	-84,089,834,385.31
（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）	-	-72,591,767.55	-72,591,767.55
四、本期期末净资产	8,292,710,249.37	-	8,292,710,249.37
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	9,008,693,335.38	-	9,008,693,335.38

产			
二、本期期初净资产	9,008,693,335.38	-	9,008,693,335.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	290,667,265.20	-	290,667,265.20
（一）、综合收益总额	-	91,426,523.78	91,426,523.78
（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）	290,667,265.20	-	290,667,265.20
其中：1.基金申购款	104,672,300,854.33	-	104,672,300,854.33
2.基金赎回款	-104,381,633,589.13	-	-104,381,633,589.13
（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）	-	-91,426,523.78	-91,426,523.78
四、本期期末净资产	9,299,360,600.58	-	9,299,360,600.58

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：

黄凌

张欣宇

谭保民

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信建投添鑫宝货币市场基金(以下简称“本基金”)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〔2015〕第2802号《关于准予中信建投添鑫宝货币市场

基金注册的批复》核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2015)验字第60952150\_A13号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》于2015年12月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为200,231,326.13份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投基金管理有限公司关于中信建投添鑫宝货币市场基金增加C类基金份额、修改收益支付方式并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自2023年3月24日起增加C类基金份额类别。增加基金份额类别后，本基金分设A类、C类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别公布每万份基金净收益和7日年化收益率。

根据《中信建投基金管理有限公司关于中信建投添鑫宝货币市场基金增加C类基金份额、修改收益支付方式并修改基金合同和托管协议的公告》，本基金自2024年1月24日起增加D类基金份额类别。增加基金份额类别后，本基金分设A类、C类、D类三类基金份额，三类基金份额单独设置基金代码，分别公布每万份基金净收益和7日年化收益率。本基金A类基金份额的销售服务费率为0.25%，C类基金份额的销售服务费率为0.20%，D类基金份额的销售服务费率为0.01%。本基金A类基金份额、C类基金份额、D类基金份额不参与升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于固定收益类金融工具，包括：现金，期限在一年以内(含一年)的银行存款、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、资产支持证券、非金融企业债务融资工具，以及法律法规或中国证监会、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：七天通知存款税后利率。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年1月1日至2024年6月30日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2024年1月1日至2024年6月30日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

##### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类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。

##### 债务工具

本基金持有的金融资产主要为债务工具，是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### ①以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### ②以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

## (2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时，以公允价值计量。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券投资起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在债券投资或资产支持证券投资的账面价值中。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率每日计提应计利息，同时在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价；同时于每一计价日计算影子价格，以避免债券投资和资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项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。

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损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然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的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免投资组合的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用投资组合的公允价值计算影子价格。当影子价格确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的偏离度绝对值达到或超过0.25%时，基金管理人应根据相关法律法规采取相应措施，使基金资产净值更能公允地反映基金投资组合价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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。

#### 6.4.4.8 收入/（损失）的确认和计量

债券投资和资产支持证券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.9 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约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每日以红利再投资方式集中支付累计收益。

#### 6.4.4.11 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。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) 本基金的基金管理人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) 本基金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。



本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.12 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和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔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〔2008〕1号《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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，暂不征收企业所得税。

(3)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。

(4)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。

#### 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 2024年06月30日
活期存款	7,275,445.08
等于：本金	7,272,334.94
加：应计利息	3,110.14
减：坏账准备	-
定期存款	684,171,762.04
等于：本金	680,000,000.00
加：应计利息	4,171,762.04
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	300,597,916.55
存款期限3个月以上	383,573,845.49
其他存款	-
等于：本金	-

加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	691,447,207.12

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06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	5,284,492,758.61	5,288,900,118.51	4,407,359.90	0.0531
	合计	5,284,492,758.61	5,288,900,118.51	4,407,359.90	0.0531
资产支持证券		-	-	-	-
合计		5,284,492,758.61	5,288,900,118.51	4,407,359.90	0.0531

注：1、偏离金额=影子定价-摊余成本；

2、偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 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 2024年06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	2,393,862,643.35	-
合计	2,393,862,643.35	-

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	218,361.50
其中：交易所市场	-
银行间市场	218,361.50
应付利息	-
预提费用	118,398.38
合计	336,759.88

### 6.4.7.6 实收基金

#### 6.4.7.6.1 中信建投添鑫宝A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,696,045,742.39	6,696,045,742.39
本期申购	82,884,778,296.58	82,884,778,296.58
本期赎回（以“-”号填列）	-81,344,051,866.44	-81,344,051,866.44
本期末	8,236,772,172.53	8,236,772,172.53

#### 6.4.7.6.2 中信建投添鑫宝C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	34,178,018.02	34,178,018.02
本期申购	147,308,182.19	147,308,182.19
本期赎回（以“-”号填列）	-156,204,123.95	-156,204,123.95
本期末	25,282,076.26	25,282,076.26

### 6.4.7.6.3 中信建投添鑫宝D

金额单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝D)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	2,620,234,395.50	2,620,234,395.50
本期赎回（以“-”号填列）	-2,589,578,394.92	-2,589,578,394.92
本期末	30,656,000.58	30,656,000.58

注：1、申购含红利再投。

2、根据基金管理人于2024年1月24日披露的《中信建投基金管理有限公司关于中信建投添鑫宝货币市场基金增加D类基金份额并修改基金合同和托管协议的公告》《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》，自2024年1月24日起，本基金增加D类基金份额。

### 6.4.7.7 未分配利润

#### 6.4.7.7.1 中信建投添鑫宝A

单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	67,504,527.62	-	67,504,527.62
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	-67,504,527.62	-	-67,504,527.62

本期末	-	-	-
-----	---	---	---

**6.4.7.7.2 中信建投添鑫宝C**

单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	277,430.40	-	277,430.40
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	-277,430.40	-	-277,430.40
本期末	-	-	-

**6.4.7.7.3 中信建投添鑫宝D**

单位：人民币元

项目 (中信建投添鑫宝D)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	4,809,809.53	-	4,809,809.53
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	-4,809,809.53	-	-4,809,809.53
本期末	-	-	-

**6.4.7.8 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	183,769.25
定期存款利息收入	8,344,642.57
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	111,319.40
其他	-
合计	8,639,731.22

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

无。

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	63,769,054.85
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	245,541.24
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	64,014,596.09

##### 6.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	12,003,179,592.61
减：卖出债券（债	11,974,996,851.48

转股及债券到期兑 付) 成本总额	
减: 应计利息总额	27,936,400.00
减: 交易费用	799.89
买卖债券差价收入	245,541.24

**6.4.7.11 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.12 股利收益**

无。

**6.4.7.13 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.14 其他收入**

无。

**6.4.7.15 信用减值损失**

无。

**6.4.7.16 其他费用**

单位: 人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	41,733.78
账户维护费	18,600.00
合计	169,732.16

**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，本基金并无须作披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 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

无。

#### 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
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

无。

##### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

##### 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券回 购成交	成交金额	占当期 债券回 购成交

		总额的 比例		总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	5,897,329,000.00	100.00%	197,692,161,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

无。

#### 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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,201,383.30	18,114,889.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,556,014.00	4,292,072.58
应支付基金管理人的净管理费	11,645,369.30	13,822,816.51

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×0.33%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,303,239.84	2,744,680.26

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.05%/当年天数。

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 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中信建投添鑫宝 A	中信建投添鑫宝 C	中信建投添鑫宝 D	合计
中信建投证券股份有限公司	10,288,045.71	0.00	0.00	10,288,045.71
中信建投基金管理有限公司	270,947.13	0.01	14,237.59	285,184.73
中信银行股份有限公司	320.43	33,620.36	13,254.02	47,194.81
合计	10,559,313.27	33,620.37	27,491.61	10,620,425.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	中信建投添鑫宝 A	中信建投添鑫宝 C	中信建投添鑫宝 D	合计
中信建投证券股份有限公司	11,988,654.84	0.00	0.00	11,988,654.84
中信建投基金管理有限公司	611,722.25	0.00	0.00	611,722.25
中信银行股份有限公司	189,151.76	3,925.52	0.00	193,077.28
合计	12,789,528.85	3,925.52	0.00	12,793,454.3

				7
--	--	--	--	---

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日A类基金份额、C类基金份额和D类基金份额的基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。A类基金份额和、C类基金份额和D类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.2%和0.01%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日A/C/D类基金资产净值×约定年费率/当年天数。

#### 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

无。

#### 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

中信建投添鑫宝D

份额单位：份

项目	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
基金合同生效日（2015年12月16日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	503,794.23	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	503,794.23	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.6434%	-

注：期间申购/买入总份额含红利再投资份额。

##### 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

无。

##### 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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	7,275,445.08	183,769.25	827,229,494.84	9,739,381.16

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按同业利率或约定利率计息。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.10.7 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金**

中信建投添鑫宝A

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
67,182,430.79	234,439.93	87,656.90	67,504,527.62	-

中信建投添鑫宝C

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
279,157.82	-	-1,727.42	277,430.40	-

中信建投添鑫宝D

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
4,674,395.50	130,901.92	4,512.11	4,809,809.53	-

### 6.4.12 期末（2024年06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

无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 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2024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100,027,397.26元，是以如下债券作为抵押：

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
220202	22国开02	2024-07-01	101.28	80,000	8,102,563.20
230306	23进出06	2024-07-01	101.63	1,000,000	101,626,469.91
合计				1,080,000	109,729,033.11

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，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。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人和其他商业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险；在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，不投资于短期信用评级在A-1级以下或长期信用评级在AA+级以下的债券，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。本基金投资于主体信用评级低于AAA的机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过10%，其中单一机构发行的金融工具占基金资产净值的比例合计不得超过2%。且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末的净资产的10%。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

##### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

##### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	4,740,830,329.77	5,558,539,782.16
合计	4,740,830,329.77	5,558,539,782.16

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金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，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金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，有效保障基金持有人利益。此外，本基金还可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，除发生巨额赎回、连续3个交易日累计赎回20%以上或者连续5个交易日累计赎回30%以上的情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的20%。

于2024年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金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》、《货币市场基金监督管理办法》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，通过监控基金平均



剩余期限、平均剩余存续期限、高流动资产占比、持仓集中度、投资交易的不活跃品种（企业债或短期融资券），并结合份额持有人集中度变化予以实现。

一般情况下，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过120天，平均剩余存续期限在每个交易日均不得超过240天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的20%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日不得超过90天，平均剩余存续期不得超过180天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于20%；当本基金前10名份额持有人的持有份额合计超过基金总份额的50%时，本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过60天，平均剩余存续期在每个交易日均不得超过120天；投资组合中现金、国债、中央银行票据、政策性金融债券以及5个交易日内到期的其他金融工具占基金资产净值的比例合计不得低于30%。

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的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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他货币市场基金投资同一商业银行的银行存款及其发行的同业存单与债券不得超过该商业银行最近一个季度末净资产的10%。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的10%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### **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**

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

本基金主要投资于银行间同业市场及交易所市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	691,447,207.12	-	-	-	-	691,447,207.12
交易性金融资产	3,172,444,164.15	2,112,048,594.46	-	-	-	5,284,492,758.61
买入返售金融资产	2,393,862,643.35	-	-	-	-	2,393,862,643.35
应收申购款	-	-	-	-	29,391,753.20	29,391,753.20
资产总计	6,257,754,014.62	2,112,048,594.46	-	-	29,391,753.20	8,399,194,362.28
负债						
卖出回购金融资产款	100,027,397.26	-	-	-	-	100,027,397.26
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,668,463.50	2,668,463.50
应付托管费	-	-	-	-	404,312.68	404,312.68
应付销售服务费	-	-	-	-	1,834,121.83	1,834,121.83
应交税费	-	-	-	-	156,522.11	156,522.11
应付利润	-	-	-	-	1,056,535.65	1,056,535.65
其他负	-	-	-	-	336,759.88	336,759.88

债						
负债总计	100,027,397.26	-	-	-	6,456,715.65	106,484,112.91
利率敏感度缺口	6,157,726,617.36	2,112,048,594.46	-	-	22,935,037.55	8,292,710,249.37
上年度末 2023年12月31日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
货币资金	3,420,812.81	80,043,866.69	-	-	-	83,464,679.50
结算备付金	11,093,893.33	-	-	-	-	11,093,893.33
交易性金融资产	5,710,960,961.44	442,260,507.55	-	-	-	6,153,221,468.99
买入返售金融资产	488,113,205.53	-	-	-	-	488,113,205.53
应收申购款	-	-	-	-	265,830.06	265,830.06
资产总计	6,213,588,873.11	522,304,374.24	-	-	265,830.06	6,736,159,077.41
负债						
应付管理人报酬	-	-	-	-	2,308,559.84	2,308,559.84
应付托管费	-	-	-	-	349,781.75	349,781.75
应付销售服务费	-	-	-	-	1,747,384.79	1,747,384.79
应交税费	-	-	-	-	156,522.11	156,522.11
应付利润	-	-	-	-	966,094.06	966,094.06
其他负债	-	-	-	-	406,974.45	406,974.45
负债总计	-	-	-	-	5,935,317.00	5,935,317.00

利率敏感度缺口	6,213,588,873.11	522,304,374.24	-	-	-5,669,486.94	6,730,223,760.41
---------	------------------	----------------	---	---	---------------	------------------

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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

于2024年6月30日，若市场利率变动25个基点且其他市场变量保持不变，本基金净资产将不会产生重大变动（2023年12月31日：同）。

#### 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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，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。

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	-	-
第二层次	5,284,492,758.61	6,153,221,468.99

第三层次	-	-
合计	5,284,492,758.61	6,153,221,468.99

#### 6.4.14.2 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。

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

#### 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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

#### 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	5,284,492,758.61	62.92
	其中：债券	5,284,492,758.61	62.92
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	2,393,862,643.35	28.50
	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	691,447,207.12	8.23
4	其他各项资产	29,391,753.20	0.35
5	合计	8,399,194,362.28	100.00

## 7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	0.78	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	100,027,397.26	1.21
	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基金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

本报告期内本基金债券正回购的资金余额未超过基金资产净值的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	107
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	40

### 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剩余期限超过120天的情形。

### 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	39.14	1.21
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	9.63	-

	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天（含）—90天	6.01	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	-	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天（含）	46.14	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	100.92	1.21

#### 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

本报告期内本基金未发生投资组合平均剩余存续期超过240天的情形。

#### 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	543,662,428.84	6.56
	其中：政策性金融债	543,662,428.84	6.56
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	同业存单	4,740,830,329.77	57.17
8	其他	-	-
9	合计	5,284,492,758.61	63.72
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

7.6 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)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	112491169	24广州农村商业银行CD008	5,000,000	499,265,844.17	6.02
2	112492680	24东莞银行CD018	4,000,000	394,030,156.02	4.75
3	112409103	24浦发银行CD103	3,000,000	295,243,727.41	3.56
4	112402024	24工商银行CD024	2,400,000	238,437,175.70	2.88
5	112493513	24湖南银行CD018	2,000,000	199,268,402.03	2.40
6	112492836	24珠海华润银行CD025	2,000,000	198,182,981.42	2.39
7	112492785	24贵阳银行CD023	2,000,000	198,175,244.86	2.39
8	112403045	24农业银行CD045	2,000,000	198,067,230.32	2.39
9	112481477	24重庆农村商行CD105	2,000,000	197,048,843.09	2.38
10	112481638	24四川银行CD101	2,000,000	197,037,913.26	2.38

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	0.0640%
报告期内偏离度的最低值	-0.0033%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0289%

注：上表中“偏离情况”根据报告期内各交易日数据计算。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本基金本报告期内未发生负偏离度的绝对值达到或超过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

本基金本报告期内未发生正偏离度的绝对值达到或超过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



无余额。

## 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，即计价对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内按实际利率法摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算并分配收益的方式，使基金份额净值始终保持在1.0000元。

**7.9.2 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，东莞银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局东莞监管分局的处罚，湖南银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国人民银行湖南省分行的处罚，珠海华润银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局珠海监管分局的处罚，贵阳银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局贵州监管分局的处罚，中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局、国家外汇管理局北京市分局的处罚，重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆市江北区市场监管局的处罚，四川银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局四川监管局的处罚。**

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收利息	-
4	应收申购款	29,391,753.20
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	29,391,753.20

### 7.9.4 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。

## §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

份额级别	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
中信建投添鑫宝A	410,670	20,056.91	626,378,108.23	7.6047%	7,610,394,064.30	92.3953%
中信建投添鑫宝C	5,353	4,722.97	10.91	0.00%	25,282,065.35	100.00%
中信建投添鑫宝D	2	15,328,000.29	30,656,000.58	100.00%	0.00	0.00%
合计	415,993	19,934.74	657,034,119.72	7.9230%	7,635,676,129.65	92.0770%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

### 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	个人	228,509,627.56	2.7555%
2	个人	120,276,103.78	1.4504%
3	其他机构	73,294,143.58	0.8838%
4	个人	61,727,382.26	0.7444%

5	个人	59,584,927.42	0.7185%
6	其他机构	49,392,740.17	0.5956%
7	其他机构	39,683,620.19	0.4785%
8	个人	36,384,769.25	0.4388%
9	个人	34,488,745.42	0.4159%
10	其他机构	34,441,245.16	0.4153%

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	份额级别	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	中信建投添鑫宝A	381,749.87	0.0046%
	中信建投添鑫宝C	510,567.49	2.0195%
	中信建投添鑫宝D	-	-
	合计	892,317.36	0.0108%

**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	份额级别	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	中信建投添鑫宝A	10~50
	中信建投添鑫宝C	50~100
	中信建投添鑫宝D	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基 金	中信建投添鑫宝A	0
	中信建投添鑫宝C	0
	中信建投添鑫宝D	0
	合计	0

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

	中信建投添鑫宝A	中信建投添鑫宝C	中信建投添鑫宝D
基金合同生效日(2)	200,231,326.13	-	-

015年12月16日)基金份额总额			
本报告期期初基金份额总额	6,696,045,742.39	34,178,018.02	-
本报告期基金总申购份额	82,884,778,296.58	147,308,182.19	2,620,234,395.50
减：本报告期基金总赎回份额	81,344,051,866.44	156,204,123.95	2,589,578,394.92
本报告期期末基金份额总额	8,236,772,172.53	25,282,076.26	30,656,000.58

注：总申购份额含红利再投资份额。

## §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，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 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

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人

受到稽查或处罚等措施的时间	2024年05月16日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至本报告期末已向中国证监会北京监管局提交完成整改报告。
其他	-

注：报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资相关部门负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资相关部门每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。权益投资相关部门根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参

考。

(3) 评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+专项研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门组织投研条线相关人员进行打分；专项研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

### 10.7.2 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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券	-	-	5,897,329,000.00	100.00%	-	-	-	-

### 10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期未发生偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### 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	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
2	中信建投添鑫宝货币市场基金2023年第4季度报告	规定网站	2024-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于中信建投添鑫宝货币市场基金增加D类基金份额并	规定网站、规定报刊	2024-01-24

	修改基金合同和托管协议的公告		
4	中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同	规定网站	2024-01-24
5	中信建投添鑫宝货币市场基金托管协议	规定网站	2024-01-24
6	关于中信建投添鑫宝货币市场基金D类份额在直销中心销售的公告	规定网站、规定报刊	2024-01-24
7	关于在中信银行股份有限公司“中信同业+”平台终止办理中信建投添鑫宝货币市场基金A类份额相关销售业务及增加代销中信建投添鑫宝货币市场基金D类份额的公告	规定网站、规定报刊	2024-01-24
8	中信建投添鑫宝货币市场基金招募说明书（更新）	规定网站	2024-01-29
9	中信建投添鑫宝货币市场基金基金产品资料概要更新	规定网站	2024-01-29
10	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购(含大额定期定额投资)、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-02-06
11	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加江苏银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2024-03-01
12	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
13	中信建投添鑫宝货币市场基	规定网站	2024-03-29

	金2023年年度报告		
14	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-04-01
15	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
16	中信建投添鑫宝货币市场基金2024年第1季度报告	规定网站	2024-04-22
17	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-04-26
18	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-05-15
19	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-05-22
20	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-05-29
21	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-06-05
22	中信建投基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售	规定网站、规定报刊	2024-06-07



	业务的公告		
23	中信建投添鑫宝货币市场基金暂停代销渠道大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2024-06-12
24	中信建投添鑫宝货币市场基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
25	中信建投添鑫宝货币市场基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
26	中信建投添鑫宝货币市场基金(D类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28

### §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

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，无影响投资者决策的其他重要信息。

### §12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投添鑫宝货币市场基金基金合同》；
- 3、《中信建投添鑫宝货币市场基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 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。

#### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日