# 中信建投凤凰货币市场基金

# 2026 年中期报告

2026 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:中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

# §1 重要提示及目录

## 1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

## 1.2 目录

**§1 重要提示及目录 ..... 1**
1.1 重要提示 ..... 1
1.2 目录 ..... 2
**§2 基金简介 ..... 4**
2.1 基金基本情况 ..... 4
2.2 基金产品说明 ..... 4
2.3 基金管理人和基金托管人 ..... 4
2.4 信息披露方式 ..... 5
2.5 其他相关资料 ..... 5
**§3 主要财务指标和基金净值表现 ..... 5**
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 5
3.2 基金净值表现 ..... 6
**§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遵规守信情况的说明 ..... 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 ..... 11
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 ..... 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 ..... 12
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遵规守信情况声明 ..... 13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 ..... 13
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 ..... 13
**§6 半年度财务会计报告(未经审计) ..... 13**
6.1 资产负债表 ..... 13
6.2 利润表 ..... 15
6.3 净资产变动表 ..... 16
6.4 报表附注 ..... 17
**§7 投资组合报告 ..... 40**
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 40
7.2 债券回购融资情况 ..... 41
7.3 基金投资组合平均剩余期限 ..... 41
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 ..... 42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 42
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细 ..... 42
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 ..... 43
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 ..... 43
7.9 投资组合报告附注 ..... 43
**§8 基金份额持有人信息 ..... 44**
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 44
8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情况 ..... 45

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 45
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 ..... 45
**§9 开放式基金份额变动 ..... 45**
**§10 重大事件揭示 ..... 46**
10.1 基金份额持有人大会决议 ..... 46
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 ..... 46
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 ..... 46
10.4 基金投资策略的改变 ..... 46
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 46
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 ..... 46
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 ..... 47
10.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况 ..... 47
10.9 其他重大事件 ..... 48
**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 49**
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 ..... 49
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 50
**§12 备查文件目录 ..... 50**
12.1 备查文件目录 ..... 50
12.2 存放地点 ..... 50
12.3 查阅方式 ..... 50

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 基金名称 | 中信建投凤凰货币市场基金 | | | |
| 基金简称 | 中信建投凤凰货币 | | | |
| 基金主代码 | 001006 | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | |
| 基金合同生效日 | 2015 年 03 月 31 日 | | | |
| 基金管理人 | 中信建投基金管理有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 11,307,910,558.17 份 | | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 中信建投凤凰货币 A | 中信建投凤凰货币 B | 中信建投凤凰货币 C | 中信建投凤凰货币 D |
| 下属分级基金的交易代码 | 001006 | 004553 | 018873 | 024681 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 364,967,022.25 份 | 10,495,733,277.50 份 | 447,108,961.90 份 | 101,296.52 份 |

## 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 | 本基金将通过对宏观经济发展态势、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的分析，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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 朱伟 | 张立学 |
| | 联系电话 | 010-56950806 | 010-68858126 |
| | 电子邮箱 | zhuweibj@csc.com.cn | zhanglixue@psbcoa.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4009-108-108 | 95580 |

| | | |
|---|---|---|
| 传真 | 010-65289868 | 010-86353609 |
| 注册地址 | 北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室 | 北京市西城区金融大街 3 号 |
| 办公地址 | 北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层 | 北京市西城区金融大街 3 号 A 座 |
| 邮政编码 | 100010 | 100808 |
| 法定代表人 | 金强 | 郑国雨 |

## 2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告的管理人互联网网址 | www.cfund108.com |
| 基金中期报告置备地点 | 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 188 号鸿安国际大厦 6、8 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（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日） | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 中信建投凤凰货币 A | 中信建投凤凰货币 B | 中信建投凤凰货币 C | 中信建投凤凰货币 D |
| 本期已实现收益 | 1,934,207.54 | 82,803,889.21 | 2,795,206.91 | 850.17 |
| 本期利润 | 1,934,207.54 | 82,803,889.21 | 2,795,206.91 | 850.17 |
| 本期净值收益率 | 0.5210% | 0.6410% | 0.5403% | 0.6407% |
| **3.1.2 期末数据和指标** | 报告期末（2026 年 06 月 30 日） | | | |
| 期末基金资产净值 | 364,967,022.25 | 10,495,733,277.50 | 447,108,961.90 | 101,296.52 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |
| **3.1.3 累计期末指标** | 报告期末（2026 年 06 月 30 日） | | | |
| 累计净值收益率 | 28.5852% | 20.5617% | 4.1520% | 1.3531% |

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

本基金按实际利率法计算账面价值，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

**中信建投凤凰货币 A 净值表现**

| 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 | 0.2503% | 0.0002% | 0.3413% | 0.0000% | -0.0910% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.5210% | 0.0002% | 0.6788% | 0.0000% | -0.1578% | 0.0002% |
| 过去一年 | 1.0872% | 0.0003% | 1.3688% | 0.0000% | -0.2816% | 0.0003% |
| 过去三年 | 4.4334% | 0.0012% | 4.1100% | 0.0000% | 0.3234% | 0.0012% |
| 过去五年 | 8.2633% | 0.0013% | 6.8475% | 0.0000% | 1.4158% | 0.0013% |
| 过去七年 | 12.7793% | 0.0018% | 9.5888% | 0.0000% | 3.1905% | 0.0018% |
| 过去十年 | 24.2706% | 0.0038% | 13.6950% | 0.0000% | 10.5756% | 0.0038% |
| 自基金合同生效起至今 | 28.5852% | 0.0042% | 15.4125% | 0.0000% | 13.1727% | 0.0042% |

**中信建投凤凰货币 B 净值表现**

| 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 | 0.3105% | 0.0002% | 0.3413% | 0.0000% | -0.0308% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.6410% | 0.0002% | 0.6788% | 0.0000% | -0.0378% | 0.0002% |
| 过去一年 | 1.3305% | 0.0003% | 1.3688% | 0.0000% | -0.0383% | 0.0003% |
| 过去三年 | 5.1880% | 0.0012% | 4.1100% | 0.0000% | 1.0780% | 0.0012% |
| 过去五年 | 9.5703% | 0.0013% | 6.8475% | 0.0000% | 2.7228% | 0.0013% |
| 过去七年 | 14.6910% | 0.0018% | 9.5888% | 0.0000% | 5.1022% | 0.0018% |
| 自基金合同生效起至今 | 20.5617% | 0.0035% | 11.9925% | 0.0000% | 8.5692% | 0.0035% |

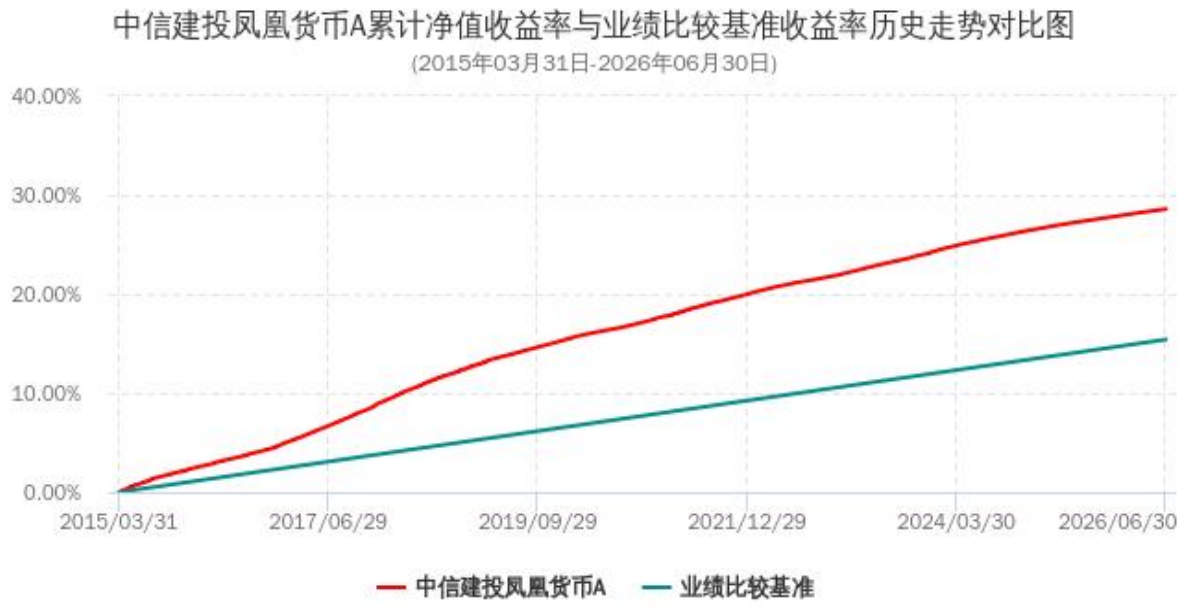
**中信建投凤凰货币 C 净值表现**

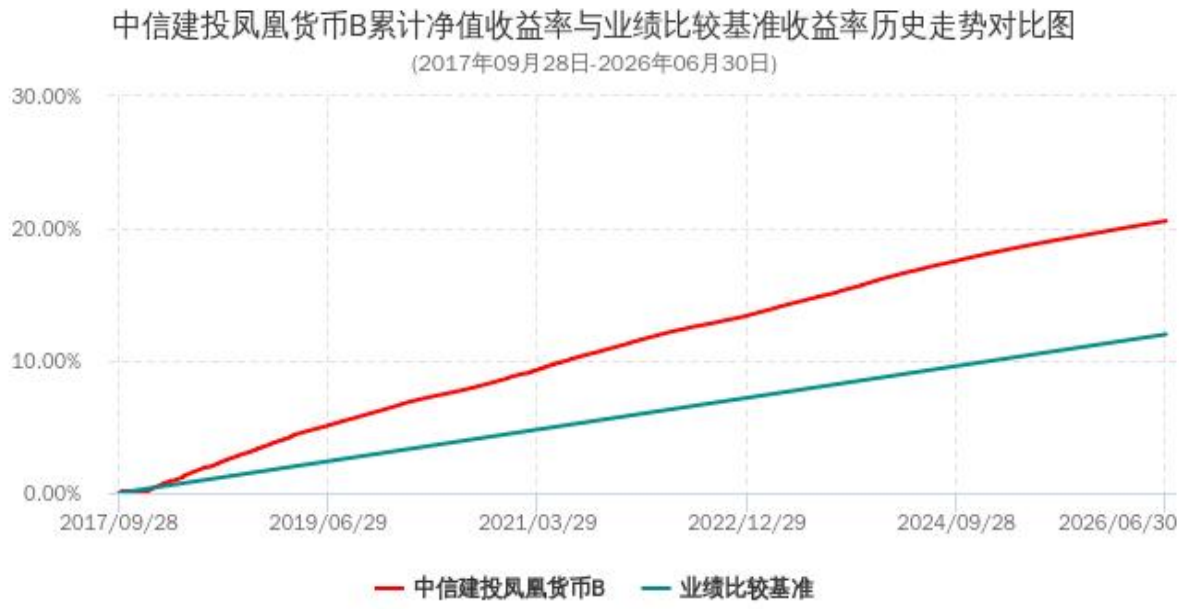
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.2505% | 0.0002% | 0.3413% | 0.0000% | -0.0908% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.5403% | 0.0004% | 0.6788% | 0.0000% | -0.1385% | 0.0004% |
| 过去一年 | 1.1066% | 0.0003% | 1.3688% | 0.0000% | -0.2622% | 0.0003% |
| 自基金合同生效起至今 | 4.1520% | 0.0012% | 3.8288% | 0.0000% | 0.3232% | 0.0012% |

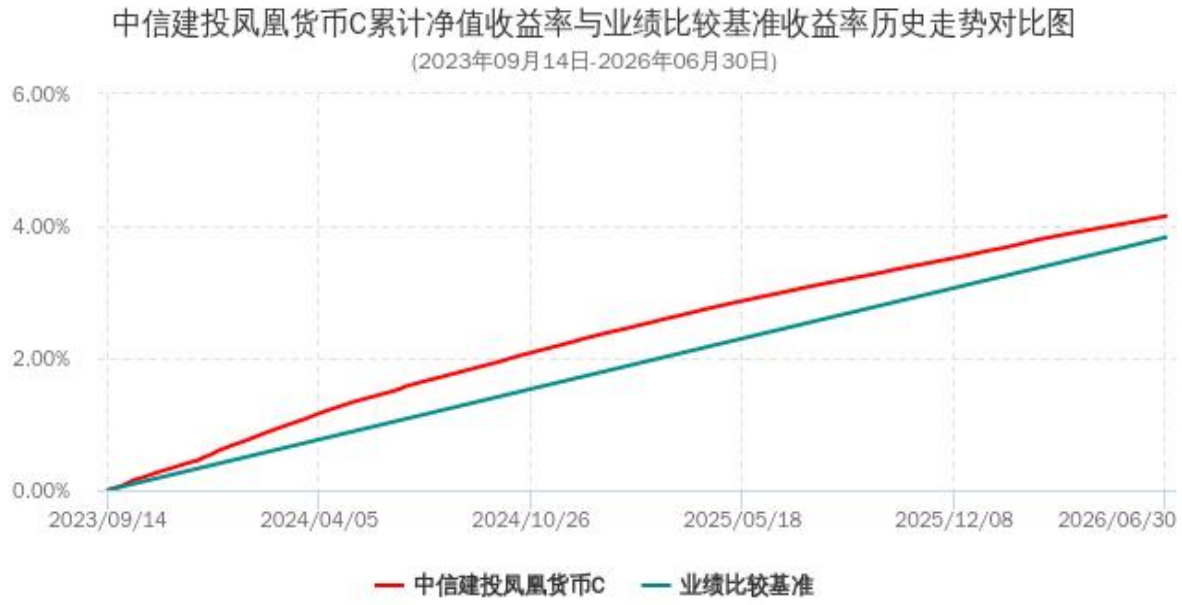
**中信建投凤凰货币 D 净值表现**

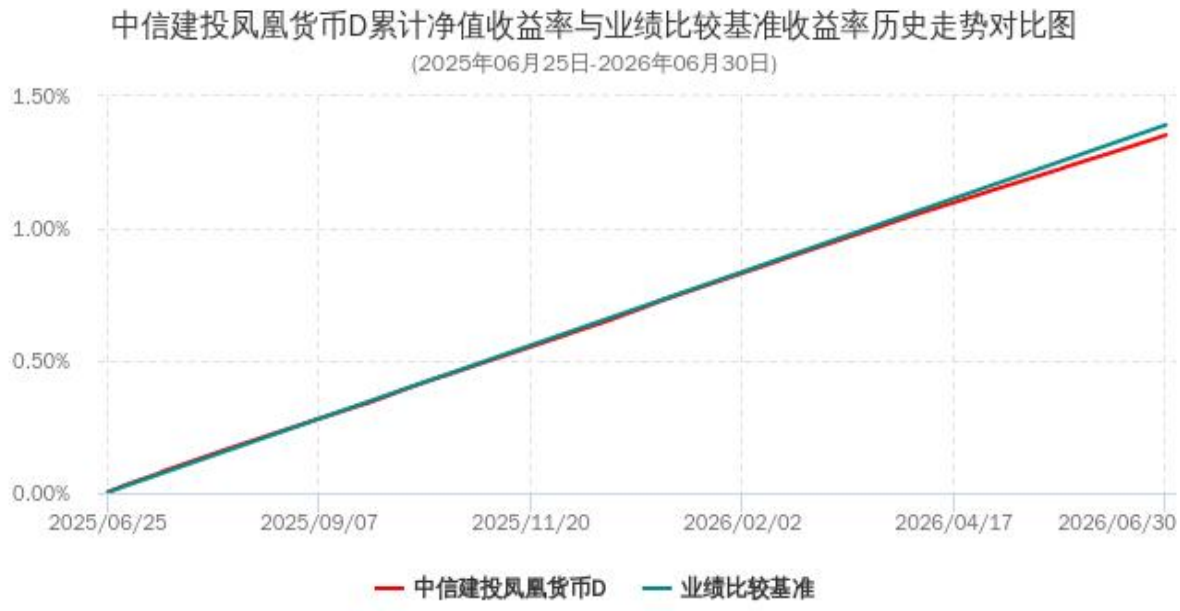
| 阶段 | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月 | 0.3103% | 0.0002% | 0.3413% | 0.0000% | -0.0310% | 0.0002% |
| 过去六个月 | 0.6407% | 0.0002% | 0.6788% | 0.0000% | -0.0381% | 0.0002% |
| 过去一年 | 1.3273% | 0.0003% | 1.3688% | 0.0000% | -0.0415% | 0.0003% |
| 自基金合同生效起至今 | 1.3531% | 0.0003% | 1.3913% | 0.0000% | -0.0382% | 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**




中信建投凤凰货币B累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年09月28日-2026年06月30日)
30.00%
20.00%
10.00%
0.00%
2017/09/28
2019/06/29
2021/03/29
2022/12/29
2024/09/28
2026/06/30
中信建投凤凰货币B
业绩比较基准


中信建投凤凰货币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09月14日-2026年06月30日)
6.00%
4.00%
2.00%
0.00%
2023/09/14
2024/04/05
2024/10/26
2025/05/18
2025/12/08
2026/06/30
中信建投凤凰货币C
业绩比较基准




注：1、以上第 1 张图为中信建投凤凰货币 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 03 月 31 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日；
2、以上第 2 张图为中信建投凤凰货币 B 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 2017 年 09 月 28 日（首笔份额登记日）至 2026 年 06 月 30 日；
3、以上第 3 张图为中信建投凤凰货币 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 09 月 14 日（首笔份额登记日）至 2026 年 06 月 30 日；
4、以上第 4 张图为中信建投凤凰货币 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 2025 年 06 月 25 日（首笔份额登记日）至 2026 年 06 月 30 日。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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管理、私募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 71 只。

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 | 2021-04-01 | - | 9 年 | 中国籍，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，担任中信建投景和中短债债券型证券投资基金、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、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投景明一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信建投景润 3 个月定期开放债券型证券投资基金、中信建投中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中信建投景荣债券型证券投资基金、中信建投双和债券型证券投资基金基金经理。 |
| 王炳旸 | 本基金的基金经理助理 | 2026-06-01 | - | 7 年 | 中国籍，福特汉姆大学全球金融硕士。曾任大成基金管理有限公司固定收益部研究员。2022 年 6 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任固定收益研究部研究员，现任本公司固定收益研究部基金经理助理，担任中信建投景和中短债债券型证券投资基金、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、中信建投稳祥债券型证券投资基金、中信建投稳悦一年定期开放债券型发起式证券投资基金、中信 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 建投稳硕债券型证券投资基金、中信建投景安债券型证券投资基金、中信建投景荣债券型证券投资基金、中信建投中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、中信建投惠享债券型证券投资基金、中信建投欣享债券型证券投资基金、中信建投智多鑫货币市场基金的基金经理助理。 |

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、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行业协会相关规定。

## 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，本基金运作整体合法合规。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》、其他有关法律法规及基金合同的约定，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，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司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，我国主要经济指标运行平稳，以高端制造、AI、半导体为代表的新动能行业表现强劲，对 GDP 增长贡献率不断加大；外贸方面，2026 年上半年出口同比增长 13.4%，进口同比增长 22.1%，进出口总额不断提升；金融市场方面，上证指数窄幅震荡，主要国债收益率震荡下行，外汇市场窄幅震荡，人民币汇率在合理均衡水平上保持基本稳定。银行间流动性合理充裕，资金利率在政策利率附近波动，存单价格也跟随资金利率窄幅波动。

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凤凰货币 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 0.5210%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；截至报告期末中信建投凤凰货币 B 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 0.6410%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；截至报告期末中信建投凤凰货币 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 0.5403%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%；截至报告期末中信建投凤凰货币 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 0.6407%，同期业绩比较基准收益率为 0.6788%。

## 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、韧性强的基本格局没有发生改变，经济增速将保持在一个合理稳定区间，预期央行将保持银行间市场流动性合理充裕，资金利率和存单收益率在较小的区间波动。

## 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，每日将当日收益结转为基金份额，当日收益参与下一日基金收益分配，并按日结转到投资者基金账户。本报告期基金应分配利润为 87,534,153.83 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

本报告期内，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在中信建投凤凰货币市场基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金共进行利润分配 87,534,153.83 元。

### 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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投凤凰货币市场基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 1,225,425,831.95 | 46,889,236.73 |
| 结算备付金 | | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 存出保证金 | | - | 800.19 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 6,942,687,255.94 | 8,177,159,458.07 |
| 其中：股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 6,942,687,255.94 | 8,177,159,458.07 |
| 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 | 3,263,087,770.02 | 4,584,795,327.04 |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | 14,411,280.69 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 11,431,200,857.91 | 12,823,256,102.72 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2026 年 06 月 30 日** | **上年度末<br>2025 年 12 月 31 日** |
| **负 债：** | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | 120,005,194.52 | - |
| 应付清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,696,733.94 | 1,065,329.68 |
| 应付托管费 | | 565,577.98 | 568,175.83 |
| 应付销售服务费 | | 272,823.23 | 250,885.78 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 1,529.88 | 7,768.57 |
| 应付利润 | | 389,148.95 | 537,991.79 |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 359,291.24 | 365,533.60 |
| 负债合计 | | 123,290,299.74 | 2,795,685.25 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 11,307,910,558.17 | 12,820,460,417.47 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | - | - |
| 净资产合计 | | 11,307,910,558.17 | 12,820,460,417.47 |
| 负债和净资产总计 | | 11,431,200,857.91 | 12,823,256,102.72 |

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 11,307,910,558.17 份，其中中信建投凤凰货币 A 类基金份额 364,967,022.25 份；中信建投凤凰货币 B 类基金份额 10,495,733,277.50 份；中信建投凤凰货币 C 类基金份额 447,108,961.90 份；中信建投凤凰货币 D

类基金份额 101,296.52 份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投凤凰货币市场基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至<br>2025 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | 104,776,571.08 | 107,626,420.12 |
| 1.利息收入 | | 37,762,142.60 | 39,953,558.94 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 6,285,897.44 | 4,280,637.80 |
| 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 | | 31,476,245.16 | 35,672,921.14 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | 67,014,428.48 | 67,672,861.18 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | 67,014,428.48 | 67,672,861.18 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | - | - |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | - | - |
| **减：二、营业总支出** | | 17,242,417.25 | 16,242,153.23 |
| 1.管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 10,341,706.91 | 9,080,581.11 |
| 2.托管费 | 6.4.10.2.2 | 4,945,876.51 | 4,842,976.57 |
| 3.销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 1,641,385.11 | 1,871,557.88 |
| 4.投资顾问费 | | - | - |
| 5.利息支出 | | 210,773.08 | 329,258.72 |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | 210,773.08 | 329,258.72 |
| 6.信用减值损失 | 6.4.7.17 | - | - |
| 7.税金及附加 | | 2,252.78 | - |
| 8.其他费用 | 6.4.7.18 | 100,422.86 | 117,778.95 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”** | | 87,534,153.83 | 91,384,266.89 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| **号填列）** | | | |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | 87,534,153.83 | 91,384,266.89 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | 87,534,153.83 | 91,384,266.89 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投凤凰货币市场基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 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 | 12,820,460,417.47 | - | 12,820,460,417.47 |
| 二、本期期初净资产 | 12,820,460,417.47 | - | 12,820,460,417.47 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -1,512,549,859.30 | - | -1,512,549,859.30 |
| （一）、综合收益总额 | - | 87,534,153.83 | 87,534,153.83 |
| （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） | -1,512,549,859.30 | - | -1,512,549,859.30 |
| 其中：1.基金申购款 | 107,323,102,813.96 | - | 107,323,102,813.96 |
| 2.基金赎回款 | -108,835,652,673.26 | - | -108,835,652,673.26 |
| （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） | - | -87,534,153.83 | -87,534,153.83 |
| 四、本期期末净资产 | 11,307,910,558.17 | - | 11,307,910,558.17 |
| **项 目** | **上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 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 | 20,157,141,299.94 | - | 20,157,141,299.94 |
| 二、本期期初净资产 | 20,157,141,299.94 | - | 20,157,141,299.94 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -11,519,681,858.53 | - | -11,519,681,858.53 |
| （一）、综合收益总额 | - | 91,384,266.89 | 91,384,266.89 |
| （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） | -11,519,681,858.53 | - | -11,519,681,858.53 |
| 其中：1.基金申购款 | 34,199,407,034.54 | - | 34,199,407,034.54 |
| 2.基金赎回款 | -45,719,088,893.07 | - | -45,719,088,893.07 |
| （三）、本期向基金份额持有人 | - | -91,384,266.89 | -91,384,266.89 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | | | |
| 四、本期期末净资产 | 8,637,459,441.41 | - | 8,637,459,441.41 |

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:

| 金强 | 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

中信建投凤凰货币市场基金(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 1 号《关于准予中信建投凤凰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《中信建投凤凰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_A08 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投凤凰货币市场基金基金合同》于 2015 年 3 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 360,070,444.87 份基金份额，其中认购资金利息折合 33,775.27 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，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《关于中信建投凤凰货币市场基金增加 B 类份额并修改基金合同的公告》、《中信建投基金管理有限公司关于中信建投凤凰货币市场基金增加 C 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》和《中信建投基金管理有限公司关于中信建投凤凰货币市场基金增加 D 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告》，本基金自 2017 年 9 月 1 日起增加 B 类基金份额类别，自 2023 年 9 月 13 日起增加本基金 C 类基金份额，自 2025 年 6 月 24 日起增加本基金 D 类基金份额。增加基金份额类别后，本基金分设 A 类、B 类、C 类、D 类四类基金份额，四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%，B 类基金份额的销售服务费率为 0.01%,C 类基金份额的销售服务费率为 0.25%,D 类基金份额的销售服务费率为 0.01%。依据《中信建投基金管理有限公司关于中信建投凤凰货币市场基金取消自动升降级业务的公告》和《中信建投凤凰货币市场基金招募说明书》，自 2025 年 1 月 27 日起，本基金取消 A 类基金份额、B 类基金份额的自动升降级业务。本基金各类基金份额均不参与升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投凤凰货币市场基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为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、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”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《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信息披露内容与格式准则第 2 号-定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 5 号<货币市场基金信息披露特别规定>》、中国证券投资基金业协会颁布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号-年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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

本基金会计年度采用公历年度，即自 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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于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。

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金融负债，在初始确认时以公允价值计量；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 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。以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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，即按实际利率法计算金融资产的账面价值，同时为了避免按实际利率法计算的基金资产净值与按其他可参考公允价值指标计算的基金资产净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用其他可参考公允价值指标，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。当按实际利率法计算确定的基金资产净值与影子定价确定的基金资产净值产生重大偏离，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资产价值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 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，且该种法定权利现在是可执行的，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。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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

（1）存款利息收入按存款的本金与适用的实际利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示。另外，根据中国证监会令第 120 号《货币市场基金监督管理办法》的规定，如果出现因提前支取而导致的利息损失的情形，基金管理人应当使用风险准备金予以弥补，风险准备金不足的，应当使用固有资金予以弥补；

（2）债券投资和资产支持证券投资按实际利率法计算的利息扣除在适用情况下的相关税费后的净额计入投资收益，在债券投资和资产支持证券投资的实际持有期内逐日计提；处置债券投资和资

产支持证券投资的投资收益于成交日确认，并按成交金额与其账面价值的差额入账；

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

（4）其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.4.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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。当日申购的基金份额自下一个工作日起，享有基金的收益分配权益；当日赎回的基金份额自下一个工作日起，不享有基金的收益分配权益。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

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。

#### 6.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

### 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

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

（1）增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（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股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，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；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。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；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，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；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（2）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（3）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

## 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<br>2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 1,225,425,831.95 |
| 等于：本金 | 1,224,945,552.15 |
| 加：应计利息 | 480,279.80 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 其中：存款期限 1 个月以内 | - |
| 存款期限 1-3 个月 | - |
| 存款期限 3 个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 1,225,425,831.95 |

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 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 | 6,942,687,255.94 | 6,943,114,126.03 | 426,870.09 | 0.0038 |
| | 合计 | 6,942,687,255.94 | 6,943,114,126.03 | 426,870.09 | 0.0038 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 6,942,687,255.94 | 6,943,114,126.03 | 426,870.09 | 0.0038 |

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

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 2026 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 | 3,263,087,770.02 | - |
| 合计 | 3,263,087,770.02 | - |

#### 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 其他资产

无余额。

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2026 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 | 223,468.38 |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | 223,468.38 |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 135,822.86 |
| 合计 | 359,291.24 |

### 6.4.7.7 实收基金

**中信建投凤凰货币 A**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 348,497,861.69 | 348,497,861.69 |
| 本期申购 | 2,243,423,473.67 | 2,243,423,473.67 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -2,226,954,313.11 | -2,226,954,313.11 |
| 本期末 | 364,967,022.25 | 364,967,022.25 |

**中信建投凤凰货币 B**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 11,954,429,389.52 | 11,954,429,389.52 |
| 本期申购 | 103,480,030,026.83 | 103,480,030,026.83 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -104,938,726,138.85 | -104,938,726,138.85 |
| 本期末 | 10,495,733,277.50 | 10,495,733,277.50 |

**中信建投凤凰货币 C**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 517,262,428.21 | 517,262,428.21 |
| 本期申购 | 1,599,648,455.56 | 1,599,648,455.56 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -1,669,801,921.87 | -1,669,801,921.87 |
| 本期末 | 447,108,961.90 | 447,108,961.90 |

**中信建投凤凰货币 D**

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 270,738.05 | 270,738.05 |
| 本期申购 | 857.90 | 857.90 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -170,299.43 | -170,299.43 |
| 本期末 | 101,296.52 | 101,296.52 |

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

### 6.4.7.8 未分配利润

**中信建投凤凰货币 A**

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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 1,934,207.54 | - | 1,934,207.54 |
| 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 | -1,934,207.54 | - | -1,934,207.54 |
| 本期末 | - | - | - |

**中信建投凤凰货币 B**

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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 82,803,889.21 | - | 82,803,889.21 |
| 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 | -82,803,889.21 | - | -82,803,889.21 |
| 本期末 | - | - | - |

**中信建投凤凰货币 C**

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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 2,795,206.91 | - | 2,795,206.91 |
| 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 | -2,795,206.91 | - | -2,795,206.91 |
| 本期末 | - | - | - |

**中信建投凤凰货币 D**

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 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | 850.17 | - | 850.17 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 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 | -850.17 | - | -850.17 |
| 本期末 | - | - | - |

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 6,217,888.80 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | 68,008.64 |
| 合计 | 6,285,897.44 |

**6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入**

无。

**6.4.7.11 债券投资收益**

**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 66,516,535.78 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | 497,892.70 |
| 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 | 67,014,428.48 |

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 17,781,631,000.83 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 17,747,287,532.24 |
| 减：应计利息总额 | 33,845,575.89 |
| 减：交易费用 | - |

| | |
|---|---|
| 买卖债券差价收入 | 497,892.70 |

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

无。

**6.4.7.13 衍生工具收益**

无。

**6.4.7.14 股利收益**

无。

**6.4.7.15 公允价值变动收益**

无。

**6.4.7.16 其他收入**

无。

**6.4.7.17 信用减值损失**

无。

**6.4.7.18 其他费用**

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 22,315.49 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 账户维护费 | 18,600.00 |
| 合计 | 100,422.86 |

**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、关联关系**

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

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、基金销售机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 基金托管人、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 |
| 中信建投期货有限公司 | 与基金管理人同一控股股东、基金销售机构 |
| 中信建投投资有限公司 | 与基金管理人同一控股股东 |

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

无。

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

无。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

无。

**6.4.10.1.5 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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
| --- | --- | --- |
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 10,341,706.91 | 9,080,581.11 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 1,932,097.41 | 1,834,201.05 |

| | | |
|---|---|---|
| 应支付基金管理人的净管理费 | 8,409,609.50 | 7,246,380.06 |

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 0.15%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×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,945,876.51 | 4,842,976.57 |

注：1、自 2025 年 1 月 1 日至 2026 年 5 月 12 日，支付基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.08%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×0.08%/当年天数。

2、根据《中信建投凤凰货币市场基金关于调低托管费率并修订基金合同和托管协议的公告》，自 2026 年 5 月 13 日（含该日）起，支付基金托管人中国邮政储蓄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 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 中信建投凤凰货币 A | 中信建投凤凰货币 B | 中信建投凤凰货币 C | 中信建投凤凰货币 D | 合计 |
| 中信建投基金管理有限公司 | 12,186.08 | 281,809.28 | 0.20 | - | 293,995.56 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 19,383.19 | 36,091.64 | - | - | 55,474.83 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 2,920.60 | 13,356.58 | 11,487.05 | - | 27,764.23 |
| 中信建投期货有限公司 | 1.10 | - | - | - | 1.10 |
| 合计 | 34,490.97 | 331,257.50 | 11,487.25 | - | 377,235.72 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 | | | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | |
| | 中信建投凤凰货币 A | 中信建投凤凰货币 B | 中信建投凤凰货币 C | 中信建投凤凰货币 D | 合计 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | - | 33,034.62 | - | - | 33,034.62 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 中信建投基金管理有限公司 | 13,019.99 | 227,896.46 | 0.93 | - | 240,917.38 |
| 中信建投期货有限公司 | 58.83 | 0.00 | - | - | 58.83 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 20,091.67 | 56,042.20 | - | - | 76,133.87 |
| 合计 | 33,170.49 | 316,973.28 | 0.93 | - | 350,144.70 |

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日 A 类基金份额、B 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、B 类基金份额、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%、0.01%、0.25%和 0.01%。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 A/B/C/D 类基金资产净值×约定年费率/当年天数。

2、根据《关于中信建投凤凰货币市场基金 C 类基金份额开展销售服务费优惠活动的公告》，自 2026 年 1 月 29 日（含）至 2026 年 2 月 28 日（含），支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的 0.025%年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日销售服务费＝前一日 C 类基金资产净值×0.025%/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**

**中信建投凤凰货币 B**

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 105,403,994.17 | 123,252,557.62 |
| 报告期间申购/买入总份额 | 100,818,335.18 | 31,059,429.50 |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | 70,092,769.33 | 15,000,000.00 |
| 报告期末持有的基金份额 | 136,129,560.02 | 139,311,987.12 |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 1.2970% | 1.8596% |

**中信建投凤凰货币 D**

份额单位：份

| 项目 | 本期<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日 |
|---|---|---|
| 报告期初持有的基金份额 | 100,650.75 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | 645.77 | - |
| 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 | 101,296.52 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 100.0000% | - |

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**

**中信建投凤凰货币 B**

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 | 持有的基金份额 | 持有的基金份额占基金总份额的比例 |
| 中信建投证券股份有限公司 | 803,909,446.98 | 7.6594% | 200,000,000.00 | 1.6730% |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 2,729,477,108.09 | 26.0056% | 1,212,937,101.13 | 10.1463% |
| 中信建投投资有限公司 | - | - | 195,015,827.28 | 1.6313% |

**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<br>2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2025 年 01 月 01 日至 2025 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 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | 19,250,642.35 | 42,699.20 | 9,680,757.37 | 95,410.62 |

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄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**

**中信建投凤凰货币 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 |
|---|---|---|---|---|
| 1,896,167.29 | 40,298.37 | -2,258.12 | 1,934,207.54 | - |

**中信建投凤凰货币 B**

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 |
|---|---|---|---|---|
| 77,725,891.89 | 5,218,670.53 | -140,673.21 | 82,803,889.21 | - |

**中信建投凤凰货币 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 |
|---|---|---|---|---|
| 2,800,777.54 | 332.95 | -5,903.58 | 2,795,206.91 | - |

**中信建投凤凰货币 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 |
|---|---|---|---|---|
| 857.90 | 0.20 | -7.93 | 850.17 | - |

**6.4.12 期末（2026 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 2026 年 06 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 120,005,194.52 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 |
|---|---|---|---|---|---|
| 112603088 | 26 农业银行 CD088 | 2026-07-01 | 99.51 | 1,277,000 | 127,070,320.97 |
| 合计 | | | | 1,277,000 | 127,070,320.97 |

#### 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或其他拥有相关资质的银行，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，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%。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 80,218,722.19 |
| 合计 | - | 80,218,722.19 |

注：以上按短期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | 6,901,811,394.74 | 7,370,087,197.52 |
| 合计 | 6,901,811,394.74 | 7,370,087,197.52 |

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | 10,213,294.87 | 61,090,929.83 |
| AAA 以下 | 10,216,434.94 | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | 20,429,729.81 | 61,090,929.83 |

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

### 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%。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）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约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%。

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 2026 年 06 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 | 1,225,425,831.95 | - | - | - | - | 1,225,425,831.95 |
| 交易性金融资产 | 6,249,337,870.64 | 693,349,385.30 | - | - | - | 6,942,687,255.94 |
| 买入返售金融资产 | 3,263,087,770.02 | - | - | - | - | 3,263,087,770.02 |
| 资产总计 | 10,737,851,472.61 | 693,349,385.30 | - | - | - | 11,431,200,857.91 |
| 负债 | | | | | | |
| 卖出回购金融资产款 | 120,005,194.52 | - | - | - | - | 120,005,194.52 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,696,733.94 | 1,696,733.94 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 应付托管费 | - | - | - | - | 565,577.98 | 565,577.98 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | 272,823.23 | 272,823.23 |
| 应交税费 | - | - | - | - | 1,529.88 | 1,529.88 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 389,148.95 | 389,148.95 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 359,291.24 | 359,291.24 |
| 负债总计 | 120,005,194.52 | - | - | - | 3,285,105.22 | 123,290,299.74 |
| 利率敏感度缺口 | 10,617,846,278.09 | 693,349,385.30 | - | - | -3,285,105.22 | 11,307,910,558.17 |
| 上年度末 2025 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 | 46,889,236.73 | - | - | - | - | 46,889,236.73 |
| 存出保证金 | 800.19 | - | - | - | - | 800.19 |
| 交易性金融资产 | 7,728,604,995.71 | 448,554,462.36 | - | - | - | 8,177,159,458.07 |
| 买入返售金融资产 | 4,584,795,327.04 | - | - | - | - | 4,584,795,327.04 |
| 应收申购款 | - | - | - | - | 14,411,280.69 | 14,411,280.69 |
| 资产总计 | 12,360,290,359.67 | 448,554,462.36 | - | - | 14,411,280.69 | 12,823,256,102.72 |
| 负债 | | | | | | |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | - | 1,065,329.68 | 1,065,329.68 |
| 应付托管费 | - | - | - | - | 568,175.83 | 568,175.83 |
| 应付销 | - | - | - | - | 250,885.78 | 250,885.78 |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 售服务费 | | | | | | |
| 应交税费 | - | - | - | - | 7,768.57 | 7,768.57 |
| 应付利润 | - | - | - | - | 537,991.79 | 537,991.79 |
| 其他负债 | - | - | - | - | 365,533.60 | 365,533.60 |
| 负债总计 | - | - | - | - | 2,795,685.25 | 2,795,685.25 |
| 利率敏感度缺口 | 12,360,290,359.67 | 448,554,462.36 | - | - | 11,615,595.44 | 12,820,460,417.47 |

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**

于本期末及上年度末，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。

**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<br>2026 年 06 月 30 日 | 上年度末<br>2025 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | - | - |
| 第二层次 | 6,942,687,255.94 | 8,177,159,458.07 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 6,942,687,255.94 | 8,177,159,458.07 |

**6.4.14.2.2 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。本基金本期及上年度可比期间持有的持续以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次间未发生重大转换。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

# §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 | 6,942,687,255.94 | 60.73 |
| | 其中：债券 | 6,942,687,255.94 | 60.73 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 3,263,087,770.02 | 28.55 |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3 | 银行存款和结算备付金合计 | 1,225,425,831.95 | 10.72 |
| 4 | 其他各项资产 | - | - |
| 5 | 合计 | 11,431,200,857.91 | 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 | 0.08 | |
| | 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 | 120,005,194.52 | 1.06 |
| | 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个交易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**

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 | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 57 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 32 |

**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(天数) | 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 | 52.25 | 1.06 |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30 天(含)—60 天 | 10.51 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60 天（含）—90 天 | 6.85 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 4 | 90 天(含)—120 天 | 14.54 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120 天(含)—397 天（含） | 16.95 | - |
| | 其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债 | - | - |
| 合计 | | 101.09 | 1.06 |

## 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 | 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 | 40,875,861.20 | 0.36 |
| | 其中：政策性金融债 | 20,446,131.39 | 0.18 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 6,901,811,394.74 | 61.04 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 6,942,687,255.94 | 61.40 |
| 10 | 剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券 | - | - |

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 按实际利率计算的账面价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 112603088 | 26 农业银行 CD088 | 5,000,000 | 497,534,537.88 | 4.40 |
| 2 | 112696573 | 26 苏州银行 CD060 | 5,000,000 | 495,226,785.36 | 4.38 |
| 3 | 112693698 | 26 成都银行 CD053 | 4,000,000 | 398,510,370.84 | 3.52 |
| 4 | 112504040 | 25 中国银行 CD040 | 3,000,000 | 299,835,379.99 | 2.65 |
| 5 | 112621098 | 26 渤海银行 | 3,000,000 | 298,962,025.85 | 2.64 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | CD098 | | | |
| 6 | 112617016 | 26 光大银行 CD016 | 2,000,000 | 199,656,326.93 | 1.77 |
| 7 | 112585173 | 25 杭州银行 CD212 | 2,000,000 | 199,638,788.17 | 1.77 |
| 8 | 112519385 | 25 恒丰银行 CD385 | 2,000,000 | 199,360,699.42 | 1.76 |
| 9 | 112608171 | 26 中信银行 CD171 | 2,000,000 | 199,289,592.64 | 1.76 |
| 10 | 112693722 | 26 徽商银行 CD060 | 2,000,000 | 199,266,407.37 | 1.76 |

## 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 | 0.0195% |
| 报告期内偏离度的最低值 | -0.0035% |
| 报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0083% |

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出现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出现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。

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

本基金投资的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、恒丰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的处罚，苏州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江苏省分行的处罚，成都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，中国光大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，中信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、国家金融监督管理总局的处罚，徽商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安徽省分行、国家金融监督管理总局安徽监管局的处罚。

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

无。

### 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 |
| 中信建投凤凰货币 A | 48,201 | 7,571.77 | 158,963,238.01 | 43.5555% | 206,003,784.24 | 56.4445% |
| 中信建投凤凰货币 B | 153 | 68,599,563.91 | 10,475,729,711.82 | 99.8094% | 20,003,565.68 | 0.1906% |
| 中信建投凤凰货币 C | 67,827 | 6,591.90 | 10,471,671.37 | 2.3421% | 436,637,290.53 | 97.6579% |
| 中信建投凤凰货币 D | 1 | 101,296.52 | 101,296.52 | 100.0000% | 0.00 | 0.0000% |

| | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 合计 | 115,765 | 97,679.87 | 10,645,265,917.72 | 94.1400% | 662,644,640.45 | 5.8600% |

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 | 银行类机构 | 2,729,477,108.09 | 24.1378% |
| 2 | 券商类机构 | 803,909,446.98 | 7.1093% |
| 3 | 银行类机构 | 704,008,774.59 | 6.2258% |
| 4 | 银行类机构 | 400,091,443.56 | 3.5382% |
| 5 | 银行类机构 | 257,569,844.12 | 2.2778% |
| 6 | 银行类机构 | 208,547,177.16 | 1.8443% |
| 7 | 银行类机构 | 208,295,060.22 | 1.8420% |
| 8 | 银行类机构 | 203,819,713.65 | 1.8025% |
| 9 | 银行类机构 | 201,445,646.97 | 1.7815% |
| 10 | 银行类机构 | 200,781,925.13 | 1.7756% |

## 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 | 中信建投凤凰货币 A | 128,256.51 | 0.0351% |
| | 中信建投凤凰货币 B | 0.00 | 0.0000% |
| | 中信建投凤凰货币 C | 20,150.34 | 0.0045% |
| | 中信建投凤凰货币 D | 0.00 | 0.0000% |
| | 合计 | 148,406.85 | 0.0013% |

## 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 | 中信建投凤凰货币 A | 0 |
| | 中信建投凤凰货币 B | 0 |
| | 中信建投凤凰货币 C | 0~10 |
| | 中信建投凤凰货币 D | 0 |
| | 合计 | 0~10 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 中信建投凤凰货币 A | 0~10 |
| | 中信建投凤凰货币 B | 0 |
| | 中信建投凤凰货币 C | 0 |
| | 中信建投凤凰货币 D | 0 |
| | 合计 | 0~10 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| | 中信建投凤凰货币 A | 中信建投凤凰货币 B | 中信建投凤凰货币 C | 中信建投凤凰货币 D |
|---|---|---|---|---|
| 基金合同生效日（2015 年 03 月 31 日）基金份额总额 | 360,070,444.87 | - | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 348,497,861.69 | 11,954,429,389.52 | 517,262,428.21 | 270,738.05 |
| 本报告期基金总申购份额 | 2,243,423,473.67 | 103,480,030,026.83 | 1,599,648,455.56 | 857.90 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 2,226,954,313.11 | 104,938,726,138.85 | 1,669,801,921.87 | 170,299.43 |
| 本报告期期末基金份额总额 | 364,967,022.25 | 10,495,733,277.50 | 447,108,961.90 | 101,296.52 |

# §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

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

本报告期内，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

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

## 10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

### 10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

### 10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚。

### 10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

## 10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

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 | |
| 中信建投证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |
| 国泰海通证券股份有限公司 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券股份有限公司 | 2 | - | - | - | - | - |

注：1、本报告期内，本基金租用的交易单元未发生变更。

2、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

## 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 2025 年第 4 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026-01-22 |
| 2 | 中信建投凤凰货币市场基金 2025 年第 4 季度报告 | 规定网站 | 2026-01-22 |
| 3 | 关于中信建投凤凰货币市场基金 C 类基金份额开展销售服务费优惠活动的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-01-29 |
| 4 | 中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026-03-31 |
| 5 | 中信建投凤凰货币市场基金 2025 年年度报告 | 规定网站 | 2026-03-31 |
| 6 | 中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2025 年度） | 规定网站 | 2026-03-31 |
| 7 | 中信建投凤凰货币市场基金招募说明书（更新） | 规定网站 | 2026-04-10 |
| 8 | 中信建投凤凰货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-04-10 |
| 9 | 中信建投凤凰货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-04-10 |
| 10 | 中信建投凤凰货币市场基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-04-10 |
| 11 | 中信建投凤凰货币市场基金（D 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-04-10 |
| 12 | 中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告 | 规定报刊 | 2026-04-22 |
| 13 | 中信建投凤凰货币市场基金 2026 年第 1 季度报告 | 规定网站 | 2026-04-22 |
| 14 | 中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-04-25 |
| 15 | 中信建投凤凰货币市场基金关于调低托管费率并修订基金合同和托管协议的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-05-13 |
| 16 | 中信建投凤凰货币市场基金基金合同 | 规定网站 | 2026-05-13 |
| 17 | 中信建投凤凰货币市场基金托管协议 | 规定网站 | 2026-05-13 |
| 18 | 中信建投凤凰货币市场基金招募说明书（更新） | 规定网站 | 2026-05-18 |
| 19 | 中信建投凤凰货币市场基金（A 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-05-18 |
| 20 | 中信建投凤凰货币市场基金（B 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-05-18 |
| 21 | 中信建投凤凰货币市场基金（C 类份额）基金产品资料概要更新 | 规定网站 | 2026-05-18 |
| 22 | 中信建投凤凰货币市场基金（D 类份额）基金 | 规定网站 | 2026-05-18 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 产品资料概要更新 | | |
| 23 | 中信建投凤凰货币市场基金调整 A 类和 B 类基金份额大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入业务的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-05-27 |
| 24 | 中信建投基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-03 |
| 25 | 中信建投基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-25 |
| 26 | 中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加福克斯（北京）基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告 | 规定网站、规定报刊 | 2026-06-26 |

# §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20260115-20260211<br>20260227-20260302<br>20260310-20260322<br>20260326-20260326<br>20260330-20260330<br>20260401-20260401<br>20260611-20260630 | 1,212,937,101.13 | 1,516,540,006.96 | 0.00 | 2,729,477,108.09 | 24.1378% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。 | | | | | | | |

## 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、《中信建投凤凰货币市场基金基金合同》；

3、《中信建投凤凰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；

7、中国证监会要求的其他文件。

## 12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可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**

**二〇二六年八月三十一日**