

# 兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2020 年中期报告

2020 年 6 月 30 日

基金管理人：兴证证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2020 年 8 月 28 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2020 年 8 月 26 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。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2020 年 4 月 13 日（集合计划合同变更生效日）起至 2020 年 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	<b>6</b>
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	<b>8</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
<b>§4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
<b>§5 托管人报告</b> .....	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	<b>16</b>
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18

6.4 报表附注.....	19
<b>§7 投资组合报告.....</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况.....	45
7.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	45
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	47
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	49
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49
7.12 市场中性策略执行情况.....	49
7.13 投资组合报告附注.....	49
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	51
8.3 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的情况.....	51
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>53</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>54</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	54
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.....	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	54
10.4 基金投资策略的改变.....	54
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
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.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	55
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>57</b>

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
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>58</b>
12.1 备查文件目录.....	58
12.2 存放地点.....	58
12.3 查阅方式.....	58

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合	
基金主代码	959993	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 13 日	
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	798,110,428.20 份	
基金合同存续期	本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基金简称：	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码：	959991	959993
报告期末下属分级基金的份额总额	741,743,285.51 份	56,367,142.69 份

注：根据本集合计划《资产管理合同》和《招募说明书》的约定，“兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划” A 类份额（以下简称“A 类份额”）每份份额设定最短持有期，最短持有期为 1 年。每份 A 类份额的最短持有期到期日即进入开放持有期，在开放持有期期间投资者可以办理赎回业务，每份 A 类份额的开放持有期首日为最短持有期到期日。

最短持有期指 A 类份额申购确认日起至该 A 类份额申购确认日 1 年后的对日的前一个工作日（即最短持有期到期日）止，若该对日不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日视同为对日。

“兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划” C 类份额自 2020 年 4 月 15 日起每个工作日只开放赎回，不开放申购。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，通过精选有较高成长性和各领域竞争力突出的龙头企业，结合估值水平进行积极的组合管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划主要策略包括大类资产配置策略，即本集合计划通过定性与定量相结合的方法，对宏观经济的发展周期，各项经济政策对经济发展趋势和证券市场的影响，证券市场中各投资品种的风险收益水平进行评估，确定投资组合中股票、债券、金融衍生品、货币市场工具等大类资产的比例，并适时依据环境变化进行动态调整。 本集合计划投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略和金融衍生工具投资策略。股票投资策略侧重“自下而上”的选股方法，精选基本面优秀，竞争优势明显，成长性较高的企业在合适的估值水平进行配置。债券投资策略主要包

	括资产配置策略、利率类品种投资策略、信用债投资策略、可交换债券投资策略、可转债投资策略、资产支持证券投资策略。金融衍生工具投资策略主要包括股指期货投资策略、国债期货投资策略。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%
风险收益特征	本集合计划是混合型集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于债券型集合资产管理计划和货币型集合资产管理计划，低于股票型集合资产管理计划。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证证券资产管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	林丹	郭明
	联系电话	021-38565866	010-66105799
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95562-3	95588
传真		021-38565863	010-66105798
注册地址		福建省平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区长柳路 36 号 兴业证券大厦 9 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		郭小军	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ixzzcgl.com">http://www.ixzzcgl.com</a>
基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年4月13日 - 2020年6月30日)	报告期(2020年4月13日 - 2020年6月30日)
本期已实现收益	3,972,422.77	2,239,589.81
本期利润	47,893,857.25	7,391,766.65
加权平均基金份额本期利润	0.0785	0.1203
本期加权平均净值利润率	7.31%	11.40%
本期基金份额净值增长率	6.40%	12.60%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年6月30日)	
期末可供分配利润	43,449,928.76	2,005,657.35
期末可供分配基金份额利润	0.0586	0.0356
期末基金资产净值	831,194,280.07	63,166,743.03
期末基金份额净值	1.1206	1.1206
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	6.40%	12.06%

注：1、本期已实现收益指集合计划本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日生效，至报告期末未满一个季度。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	5.82%	0.59%	5.72%	0.67%	0.10%	-0.08%
自基金合同生效起至今	6.40%	0.50%	3.79%	0.68%	2.61%	-0.18%

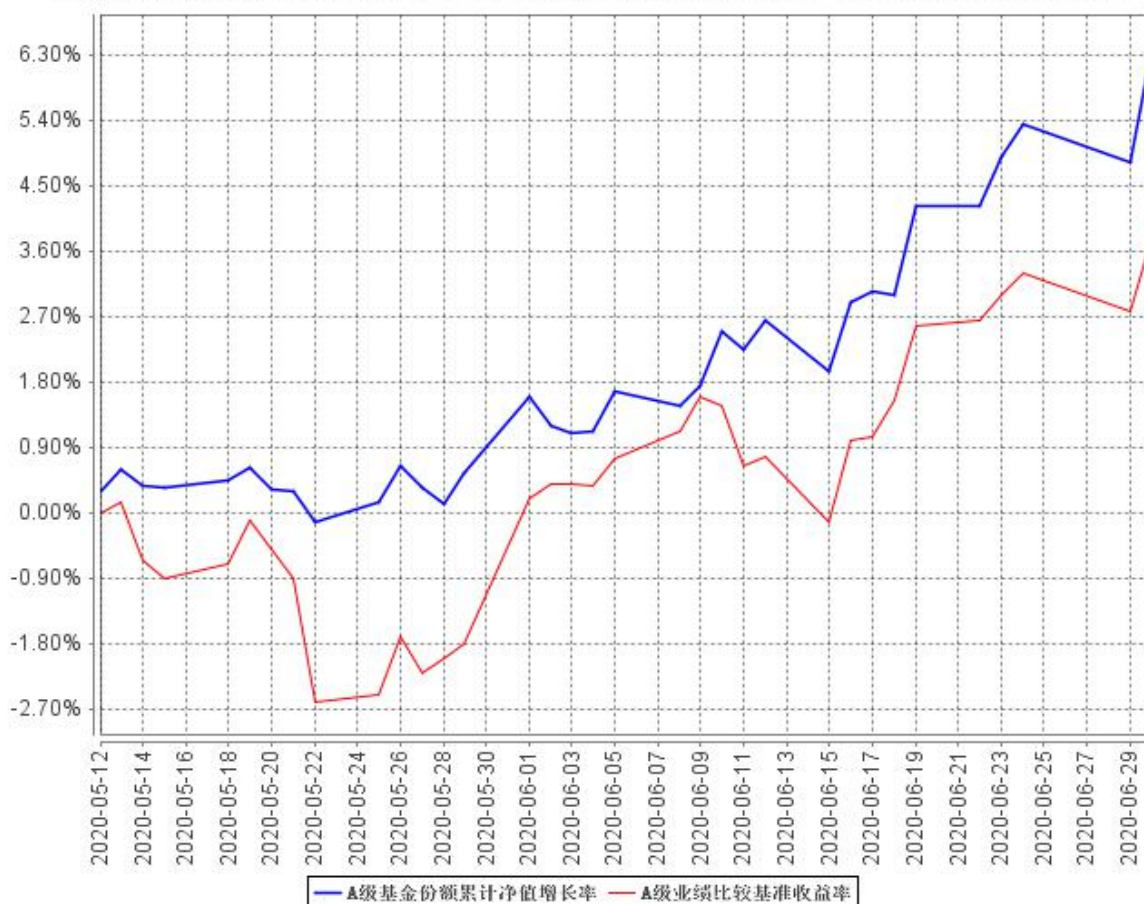


兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C

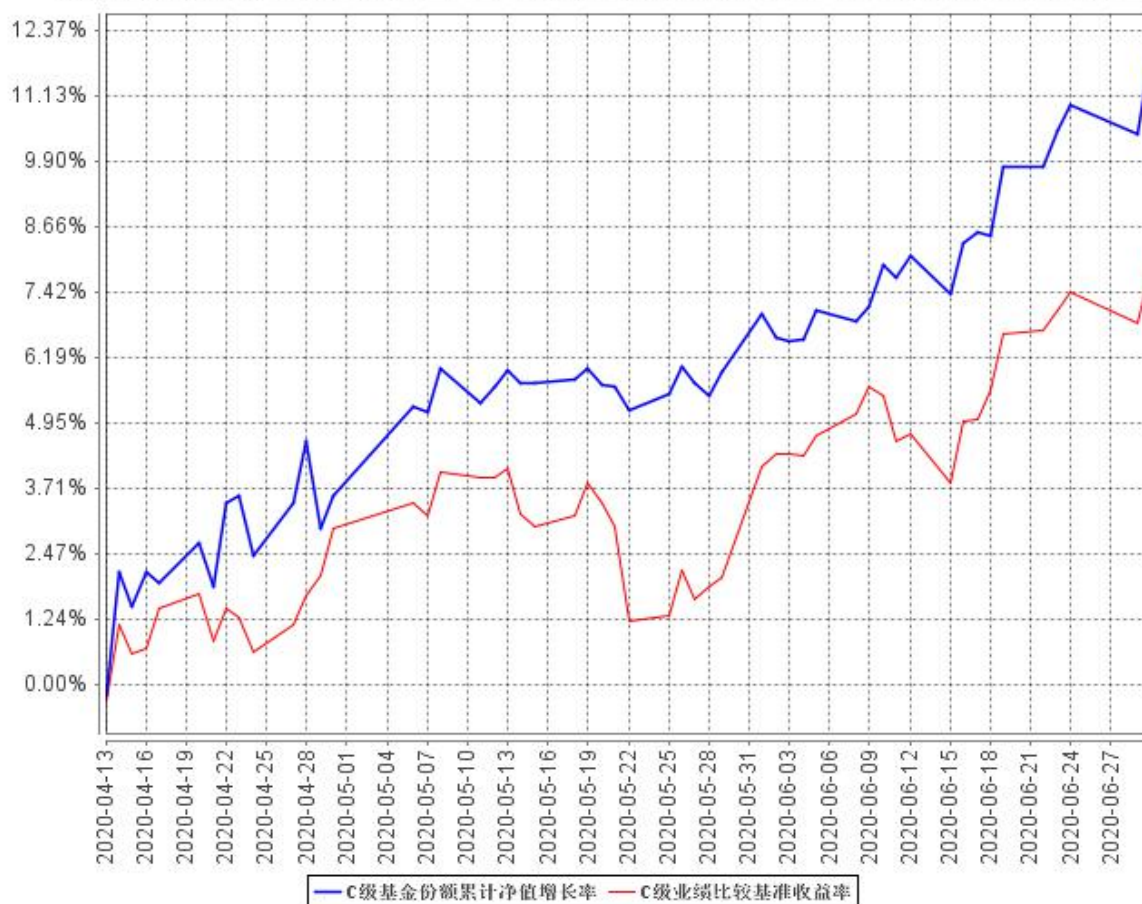
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	5.82%	0.59%	5.72%	0.67%	0.10%	-0.08%
自基金合同生效起至今	12.06%	0.73%	7.92%	0.65%	4.14%	0.08%

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

A级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2020 年 6 月 30 日。

2、本集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日生效，至报告期末未满一年。

3、按照本集合计划《资产管理合同》和《招募说明书》的约定，本集合计划建仓期为自资产管理合同变更生效之日起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例应符合集合计划合同约定，截至本报告期末本集合计划尚处于建仓期。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证证券资产管理有限公司经中国证监会证监许可[2014]145号文批复，于2014年6月9日正式成立。目前，公司注册资本为8亿元人民币。兴证证券资产管理有限公司是兴业证券股份有限公司（SH 601377）的全资子公司，前身为兴业证券股份有限公司资产管理部，2000年即获准开展资产管理业务，2014年正式成为兴业证券股份有限公司旗下子公司。

十多年来，基于母公司作为现代大型证券金融集团业务链条齐全的禀赋，依托自主培养的、稳健扎实的投资研究底蕴，兴证证券资产管理有限公司已经发展成为一家极具投资能力禀赋的综合型资产管理机构，投资资管、投行资管两大资管业务并驾齐驱，固收投资、权益投资、定增投资、员工持股计划等业务均在业界具备领先优势，可为机构客户与个人客户提供多元化的投资及融资解决方案。

截止2020年6月30日，兴证证券资产管理有限公司第一只公募基金性质产品为兴证资管金麒麟领先优势一年持有混合型集合资产管理计划（即本集合计划），由原大集合产品兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划参照公募基金改造变更而来。

#### 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		
匡伟	兴证证券资产管理有限公司权益投资部总经理助理、投资经理	2020年4月13日	-	12	兴证证券资产管理有限公司权益投资部总经理助理、投资经理。北京理工大学硕士。2008年7月进入金融行业，曾任天相投资顾问有限公司医药分析师，万家基金管理有限公司医药分析师。2014年10月加入兴证证券资产管理有限公司，历任研究部研究员、权益投资部投资经理，现任兴证证券资产管理有限公司权益投资部总经理助理、投资经理。
李健	兴证证券资产	2020年4月13日	2020年4月30日	22	李健，兴证证券资产管理有限公司权益投资部投

	管理有限公司 权益投资部 投资经理				资经理。工商管理硕士。1997年12月进入证券行业，2006年加入兴业证券股份有限公司，历任兴业证券股份有限公司证券投资部研究员、兴业证券股份有限公司资产管理部研究员、投资经理。现任兴证证券资产管理有限公司权益投资部投资经理。
--	-------------------------	--	--	--	---

注：1、集合计划的首任投资经理，其“任职日期”为集合计划合同生效日，其“离职日期”为根据公司决议确定的解聘日期； 2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期； 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值（元）	任职时间
匡伟	公募基金	1	894,361,023.10	2020-04-13
	私募资产管理计划	1	96,164,320.85	2017-07-20
	其他组合	-	-	-
	合计	2	990,525,343.95	-

注：兴证资管鑫享12号集合资产管理计划于2020年5月29日结束，投资经理匡伟、张昌平，产品类型均为混合型。

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

#### 4.3 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

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》。本集合计划管理人通过科学、制衡的投资决策体系，

加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本集合计划管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定。各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；交易执行环节对各类交易严格流程控制、并持续技术改进，确保了公平交易原则的实现。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 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

2020 年 4 月 13 日至 2020 年 6 月 30 日上证指数上涨 6.72%，创业板上涨 25.04%，沪深 300 上涨 10.47%。期间，从行业上看休闲服务、医药、食品饮料、电子、传媒、电器设备涨幅相对靠前，钢铁、银行、采掘、纺织服装、农林牧渔、通信、建筑偏周期行业相对表现不太理想。期间全球的大背景是疫情持续发酵，短期经济增长预期下调，长期不确定。各国相继采取宽松的货币政策，钱多叠加经济差，基本面相对确定的行业估值得到较大扩张，医药与食品饮料的消费刚需属性强，业绩确定性相对较高。电子行业受益于 5G 周期，新能源汽车行业受益于各国政策支持带来的渗透率提升。中美贸易摩擦仍在持续，美对华为的芯片进口业务进一步限制，贸易摩擦对我国科技行业发展形成复杂的影响。

2020 年 4 月 13 日至 5 月上旬，本集合计划保持高仓位运行。行业上配置大消费类行业和科技板块为主，具体包括食品饮料、医药、电子、新能源汽车、轻工等。地产、周期等为辅。2020 年 4 月 13 日起，本集合计划按照公募基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定等监管规则进行管理运作，5 月 11 日起本集合计划开放日常申购，新申购资金摊薄仓位，6 月本集合计划处于持续建仓中，建仓行业以消费、医药、科技、周期、综合等为主。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A 计划份额净值为 1.1206 元，本报告期计划份额净值增长率为 6.40%，同期业绩比较基准收益率为 3.79%；截至本报告期末兴证资管

金麒麟领先优势一年持有期混合 C 计划份额净值为 1.1206 元，本报告期计划份额净值增长率为 12.06%，同期业绩比较基准收益率为 7.92%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，新冠疫情发展和相关疫苗、药物研发或是影响中短期经济恢复和货币政策的核心要素，中美关系持续紧张，从贸易、科技领域开始有所延伸，这可能对中国及全球中长期经济发展形成一定的负面影响。但中国宏观风险整体处于相对较低水平，统一而庞大的内需消费市场为经济发展提供韧性，货币和财政政策还有调节空间，我们对中国经济长期发展保持乐观。未来本产品仍然以价值投资为基础，配置各细分行业内竞争优势明确、长期预期复合回报率具有吸引力的优质公司，以期力争获得超越基准的投资回报率。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由公司总裁、公司副总裁、研究部负责人、权益投资部负责人、国定收益部负责人、合规风控部负责人、交易运营部负责人组成。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且投资经理不参与其管理集合计划的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划合同，在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，若集合计划合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本集合计划本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及本集合计划合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本集合计划托管人在对兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和集合计划合同的有关规定，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了集合计划托管人应尽的义务。

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

本报告期内，兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合的管理人——兴证证券资产管理有限公司在兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合的投资运作、集合计划资产净值计算、集合计划份额申购赎回价格计算、集合计划费用开支等问题上，不存在任何损害集合计划份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照集合计划合同的规定进行。

### 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

本托管人依法对兴证证券资产管理有限公司编制和披露的兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 2020 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 6 月 30 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	326,950,651.73	-
结算备付金		3,140,748.50	-
存出保证金		134,344.08	-
交易性金融资产	6.4.7.2	569,677,466.56	-
其中：股票投资		569,677,466.56	-
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	33,072.34	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,110,602.60	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		901,046,885.81	-
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2019 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		-	-
应付证券清算款		4,420,596.36	-
应付赎回款		836,474.96	-
应付管理人报酬		428,781.46	-
应付托管费		177,204.50	-
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	669,319.57	-
应交税费		146,027.50	-



应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	7,458.36	-
负债合计		6,685,862.71	-
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	798,110,428.20	-
未分配利润	6.4.7.10	96,250,594.90	-
所有者权益合计		894,361,023.10	-
负债和所有者权益总计		901,046,885.81	-

注：1、报告截止日 2020 年 6 月 30 日，兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A 份额净值 1.1206 元，份额总额 741,743,285.51 份；兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C 份额净值 1.1206 元，份额总额 56,367,142.69 份。

2、本财务报表的实际编制期间为 2020 年 4 月 13 日（集合计划合同变更生效日）至 2020 年 6 月 30 日。

## 6.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日）至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2020 年 4 月 13 日(基 金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		57,017,045.03	-
1.利息收入		182,861.06	-
其中：存款利息收入	6.4.7.11	182,861.06	-
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,745,572.65	-
其中：股票投资收益	6.4.7.12	5,579,837.41	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,165,735.24	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	49,073,611.32	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	15,000.00	-
<b>减：二、费用</b>		1,731,421.13	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	637,155.67	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	265,481.50	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	810,580.16	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		7,277.72	-
7. 其他费用	6.4.7.20	10,926.08	-
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		55,285,623.90	-
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		55,285,623.90	-

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 4 月 13 日，因此无上年度可比期间数据。

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,753,713.02	-6,308.45	69,747,404.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	55,285,623.90	55,285,623.90
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	728,356,715.18	40,971,279.45	769,327,994.63

其中：1.基金申购款	741,743,285.51	41,557,137.31	783,300,422.82
2.基金赎回款	-13,386,570.33	-585,857.86	-13,972,428.19
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	798,110,428.20	96,250,594.90	894,361,023.10
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	-	-	-
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-	-
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	-	-	-

注：本集合计划合同变更生效日为 2020 年 4 月 13 日，因此无上年度可比期间数据。

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：

\_\_\_\_\_  
郭小军

基金管理人负责人

\_\_\_\_\_  
郭小军

主管会计工作负责人

\_\_\_\_\_  
伍明月

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划变更而来，兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计

划由兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划变更为而来。

2013 年 7 月 8 日，中国证券业协会作出《关于兴业证券股份有限公司发起设立兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕666 号），兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划设立，自 2013 年 5 月 8 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 24 日结束募集并于 2013 年 5 月 29 日成立。2014 年 10 月 30 日，兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划。

本集合计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对照公募基金对本集合计划进行了规范改造，并在收到中国证监会准予本集合计划合同变更生效的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。改造后的集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日变更生效，即自 2020 年 4 月 13 日起，《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》生效，原《兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划资产管理计划合同》同日起失效。

本集合计划为契约性开放式，本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。本集合计划的管理人为兴证证券资产管理有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，托管人为中国工商银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划业绩比较基准：沪深 300 指数收益率\*75%+上证国债指数收益率\*25%。

## 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、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《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 XBRL 模板第 3 号〈年度报告和中期报告〉》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本集合计划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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2020 年 6 月 30 日的财务状况以及 2020 年 4 月 13 日（集合计划合同变更生效日）至 2020 年 6 月 30 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

## 6.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

### 6.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2020 年 4 月 13 日（集合计划合同变更生效日）至 2020 年 6 月 30 日止。

### 6.4.4.2 记账本位币

本集合计划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集合计划的金融资产（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

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融

资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

## (2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

### 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

本集合计划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的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

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；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划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；本集合计划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。

### 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。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本集合计划在计量日能够进入的

交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。本集合计划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，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

在财务报表中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。

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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，集合计划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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 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，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 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

当本集合计划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，同时本集合计划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集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

#### 6.4.4.9 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；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公



司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他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。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

1、在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数最多为 4 次，若本集合计划合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式为现金分红；

3、集合计划收益分配后份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类别份额净值减去每单位该类别份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 分部报告**

本集合计划以内部组织结构、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。经营分部是指本集合计划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) 本集合计划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) 本集合计划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。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

#### 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

本集合计划本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，主要税项列示如下：

##### 1. 增值税

根据财政部和国家税务总局 2017 年 6 月 30 日发布的《关于资管产品增值税有关问题的通知》，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，通知自 2018 年 1 月 1 日起施行。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。

##### 2. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券(股票)交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券(股票)交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变。

##### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业

费附加的单位外) 及地方教育费附加。

#### 4. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《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 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日
活期存款	326,950,651.73
定期存款	-
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	-
合计:	326,950,651.73

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	515,591,646.37	569,677,466.56	54,085,820.19
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	515,591,646.37	569,677,466.56	54,085,820.19

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

### 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

本集合计划本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应收活期存款利息	31,598.64
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	1,413.30
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	60.40
合计	33,072.34

### 6.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
交易所市场应付交易费用	669,319.57
银行间市场应付交易费用	-
合计	669,319.57

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	7,458.36
合计	7,458.36

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A		
项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	-	-
本期申购	741,743,285.51	741,743,285.51
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	741,743,285.51	741,743,285.51

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C		
项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	69,753,713.02	69,753,713.02
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-13,386,570.33	-13,386,570.33
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	56,367,142.69	56,367,142.69

注：1、本集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日生效。

2、申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,972,422.77	43,921,434.48	47,893,857.25
本期基金份额交易产生的变动数	39,477,505.99	2,079,631.32	41,557,137.31
其中：基金申购款	39,477,505.99	2,079,631.32	41,557,137.31
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	43,449,928.76	46,001,065.80	89,450,994.56

单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-6,308.45	-	-6,308.45
本期利润	2,239,589.81	5,152,176.84	7,391,766.65
本期基金份额交易产生的变动数	-227,624.01	-358,233.85	-585,857.86
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-227,624.01	-358,233.85	-585,857.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,005,657.35	4,793,942.99	6,799,600.34

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	177,881.44
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	4,618.69
其他	360.93
合计	182,861.06

### 6.4.7.12 股票投资收益

#### 6.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	112,125,261.17
减：卖出股票成本总额	106,545,423.76
买卖股票差价收入	5,579,837.41

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益。

#### 6.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

#### 6.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

**6.4.7.15 衍生工具收益****6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

**6.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,165,735.24
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,165,735.24

**6.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日
1. 交易性金融资产	49,073,611.32
——股票投资	49,073,611.32
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估	-



增值税	
合计	49,073,611.32

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
基金赎回费收入	-
其他收入	15,000.00
合计	15,000.00

注：1、本集合计划的赎回费率按持有期间递减，不低于赎回费总额的 25%归入集合计划资产。

2、本集合计划的转换费由转出集合计划赎回费和集合计划申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25%归入转出集合计划的集合计划资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年 6月30日
交易所市场交易费用	810,580.16
银行间市场交易费用	-
交易基金产生的费用	-
其中：申购费	-
赎回费	-
合计	810,580.16

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020 年6月30日
审计费用	3,237.42
信息披露费	-
证券出借违约金	-
注册登记费	5,596.66

银行费用	92.00
电子合同费	2,000.00
合计	10,926.08

## 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，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无其他需要披露的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

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

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证证券资产管理有限公司（“兴证资管”）	集合计划管理人
兴业证券股份有限公司（“兴业证券”）	集合计划管理人的股东、集合计划销售机构
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至 2020年6月30日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例	成交金额	占当期股票 成交总额的比例
兴业证券	682,408,267.66	100.00%	-	-

### 6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

### 6.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

### 6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
兴业证券	635,524.84	100.00%	669,319.57	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	637,155.67
其中：支付销售机构的客户维护费	96,129.37	-

注：集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：  
每日应支付的集合计划管理费=前一日的集合计划资产净值×0.6%÷当年天数。

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款

指令，托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	265,481.50	-

注：集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 年费率计提。托管费的计算方法如下：  
每日应支付的集合计划托管费 = 前一日的集合计划资产净值 × 0.25% ÷ 当年天数。

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 2 个工作日内从集合计划财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本集合计划无销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)至 2020 年 6 月 30 日	
	兴证资管金麒麟领先优势一年	兴证资管金麒麟领先优势一

	持有期混合 A	年持有期混合 C
基金合同生效日（2020年4月13日）持有的基金份额	-	11,002,248.69
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	11,002,248.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.3785%

项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年6月30日	
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020年4月13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	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、本集合计划合同于2020年4月13日生效。

2、本报告期内，本集合计划管理人投资本集合计划的适用费率符合本集合计划招募说明书和相关公告的规定。

#### 6.4.10.5.2 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

除本集合计划的管理人外，无其他关联方投资本集合计划的情况。

#### 6.4.10.6 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	上年度可比期间
	2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年6月30日	2019年1月1日至2019年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	326,950,651.73	177,881.44	-	-

注：本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本集合计划本报告期内无其他关联方交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2020年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688027	国盾量子	2020年6月30日	2020年7月9日	新股流通受限	36.18	36.18	2,111	76,375.98	76,375.98	-
688377	迪威尔	2020年6月29日	2020年7月8日	新股流通受限	16.42	16.42	6,797	111,606.74	111,606.74	-
688528	秦川物联	2020年6月19日	2020年7月1日	新股流通受限	11.33	11.33	4,742	53,726.86	53,726.86	-
688568	中科星图	2020年6月30日	2020年7月8日	新股流通受限	16.21	16.21	10,697	173,398.37	173,398.37	-
688600	皖仪科技	2020年6月23日	2020年7月3日	新股流通受限	15.50	15.50	4,100	63,550.00	63,550.00	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2020 年 6 月 30 日止，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

转融通证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为混合型集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于债券型集合资产管理计划和货币型集合资产管理计划，低于股票型集合资产管理计划。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债、政府支持债券、地方政府债、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。本集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本集合计划在科学的风险管理的前提下，实现计划财产的安全和增值。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人实施全面风险管理，由公司董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险等各类风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析产品投资运作管理各环节的各类风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立由董事会、监事会、经营管理层、风险管理部门、各部门组成的全面风险管理组织架构，即董事会及其风险管理委员会、监事会——公司经营管理层——风险管理部门——各部门。

本集合计划管理人确立风险管理三道防线，即各部门实施有效自我控制为第一道防线，风险管理部门风险管理人员在事前和事中实施专业的风险管理为第二道防线，合规风控部内控稽核人员实施事后监督、评价为第三道防线。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的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。本集合计划于本报告期末未持有债券、资产支持证券、同业存单。本集合计划的银行存款存放在本集合计划开立于托管人中国工商银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本集合计划在交易所进行的交易均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，违约风险可能性很小；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。

本集合计划的管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的集合计划份额，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，本集合计划的管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进



行严密监控并预测流动性需求，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划资产管理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，有效保障集合计划持有人利益。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》（自 2017 年 10 月 1 日起施行）等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；本集合计划管理人管理的全部大集合资产管理计划（大集合资产管理计划系指投资人数不受 200 人限制的资产管理计划，下同）持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股股票，不得超过该上市公司可流通股股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本集合计划所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本集合计划于期末持有的流通受限证券外，本期末本集合计划的其他资产均能及时变现。此外，本集合计划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，其上限一般不超过集合计划持有的债券投资的公允价值。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的 15%。

本集合计划的管理人每日对集合计划组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划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

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020年6月 30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	326,950,651.73	-	-	-	-326,950,651.73
结算备付金	3,140,748.50	-	-	-	3,140,748.50
存出保证金	134,344.08	-	-	-	134,344.08
交易性金融资产	-	-	-	569,677,466.56	569,677,466.56
应收利息	-	-	-	33,072.34	33,072.34
应收申购款	-	-	-	1,110,602.60	1,110,602.60
资产总计	330,225,744.31	-	-	570,821,141.50	901,046,885.81
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,420,596.36	4,420,596.36
应付赎回款	-	-	-	836,474.96	836,474.96
应付管理人报酬	-	-	-	428,781.46	428,781.46
应付托管费	-	-	-	177,204.50	177,204.50
应付交易费用	-	-	-	669,319.57	669,319.57
应交税费	-	-	-	146,027.50	146,027.50
其他负债	-	-	-	7,458.36	7,458.36
负债总计	-	-	-	6,685,862.71	6,685,862.71
利率敏感度缺口	330,225,744.31	-	-	564,135,278.79	894,361,023.10
上年度末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2019 年 12 月 31 日			上		
资产					
资产总计	-	-	-	-	-
负债					
负债总计	-	-	-	-	-
利率敏感度 缺口	-	-	-	-	-

注：表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金及部分应收申购款，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本集合计划本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对集合计划资产净值的影响并不显著。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本集合计划所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指集合计划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。

本集合计划主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 6 月 30 日		上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金资 产净值比 例 (%)
交易性金融资产-股票投资	569,677,466.56	63.70	-	-

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	569,677,466.56	63.70	-	-

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本集合计划业绩比较标准外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2020年6月30日）	上年度末（2019年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	38,122,793.36	-
业绩比较基准下降 5%	-38,122,793.36		

注：本集合计划管理人运用资本—资产定价模型方法对本集合计划的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对集合计划资产净值产生的影响（其中，本集合计划所持新股距离上市时间过短、样本数据过少，贝塔值设定为1）。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 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	权益投资	569,677,466.56	63.22
	其中：股票	569,677,466.56	63.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	330,091,400.23	36.63
8	其他各项资产	1,278,019.02	0.14
9	合计	901,046,885.81	100.00

### 7.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值 (元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	32,145,080.00	3.59
C	制造业	428,297,317.23	47.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,990.48	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	173,398.37	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	41,991,296.00	4.70
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	66,671,020.48	7.45

N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	392,364.00	0.04
S	综合	-	-
	合计	569,677,466.56	63.70

## 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期期末未持有港股通投资股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	1,265,300	51,889,953.00	5.80
2	300012	华测检测	2,375,148	46,932,924.48	5.25
3	600519	贵州茅台	30,846	45,123,996.48	5.05
4	600276	恒瑞医药	467,584	43,158,003.20	4.83
5	000002	万科A	1,606,400	41,991,296.00	4.70
6	603899	晨光文具	686,600	37,488,360.00	4.19
7	002475	立讯精密	700,164	35,953,421.40	4.02
8	300750	宁德时代	205,800	35,883,288.00	4.01
9	600426	华鲁恒升	1,910,888	33,784,499.84	3.78
10	601899	紫金矿业	7,305,700	32,145,080.00	3.59
11	300760	迈瑞医疗	91,500	27,971,550.00	3.13
12	603986	兆易创新	87,980	20,755,361.80	2.32
13	000710	贝瑞基因	330,400	19,738,096.00	2.21
14	603833	欧派家居	166,277	19,271,504.30	2.15
15	600600	青岛啤酒	199,200	15,238,800.00	1.70
16	600585	海螺水泥	242,700	12,841,257.00	1.44
17	300453	三鑫医疗	601,300	11,689,272.00	1.31
18	600309	万华化学	224,300	11,212,757.00	1.25
19	002371	北方华创	55,000	9,400,050.00	1.05
20	002078	太阳纸业	936,900	8,919,288.00	1.00
21	002557	洽洽食品	43,200	2,341,008.00	0.26
22	000651	格力电器	34,869	1,972,539.33	0.22
23	000977	浪潮信息	30,800	1,206,744.00	0.13

24	000401	冀东水泥	73,200	1,174,128.00	0.13
25	000860	顺鑫农业	11,900	678,062.00	0.08
26	300144	宋城演艺	22,680	392,364.00	0.04
27	688568	中科星图	10,697	173,398.37	0.02
28	688377	迪威尔	6,797	111,606.74	0.01
29	688027	国盾量子	2,111	76,375.98	0.01
30	688600	皖仪科技	4,100	63,550.00	0.01
31	688528	秦川物联	4,742	53,726.86	0.01
32	603087	甘李药业	381	38,214.30	0.00
33	600956	新天绿能	1,387	6,990.48	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002179	中航光电	42,479,148.79	4.75
2	000002	万科A	40,630,177.89	4.54
3	300012	华测检测	38,499,154.39	4.30
4	600519	贵州茅台	37,697,927.40	4.22
5	600276	恒瑞医药	35,975,252.23	4.02
6	600426	华鲁恒升	35,573,855.77	3.98
7	603899	晨光文具	31,088,032.00	3.48
8	601899	紫金矿业	30,151,133.00	3.37
9	300750	宁德时代	30,021,544.00	3.36
10	600036	招商银行	29,388,566.64	3.29
11	002475	立讯精密	25,558,641.00	2.86
12	300760	迈瑞医疗	25,045,094.00	2.80
13	000710	贝瑞基因	21,426,693.00	2.40
14	600867	通化东宝	21,408,930.32	2.39
15	300453	三鑫医疗	21,253,439.00	2.38
16	603833	欧派家居	18,982,904.65	2.12
17	603986	兆易创新	17,054,479.40	1.91
18	600585	海螺水泥	12,586,766.00	1.41
19	600600	青岛啤酒	11,138,231.49	1.25
20	600309	万华化学	10,170,395.00	1.14

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例（%）
1	600036	招商银行	29,083,739.53	3.25
2	600867	通化东宝	20,795,932.64	2.33
3	300453	三鑫医疗	14,408,704.00	1.61
4	601933	永辉超市	12,982,010.00	1.45
5	002507	涪陵榨菜	3,866,118.00	0.43
6	002007	华兰生物	3,529,244.70	0.39
7	600887	伊利股份	3,473,233.00	0.39
8	300253	卫宁健康	3,426,755.00	0.38
9	000725	京东方 A	3,374,106.00	0.38
10	600305	恒顺醋业	3,141,160.00	0.35
11	601318	中国平安	2,642,556.00	0.30
12	000002	万科 A	2,012,691.90	0.23
13	300144	宋城演艺	1,811,468.00	0.20
14	002557	洽洽食品	1,511,802.00	0.17
15	300059	东方财富	1,412,162.40	0.16
16	600588	用友网络	1,332,571.00	0.15
17	000651	格力电器	1,293,599.00	0.14
18	600276	恒瑞医药	670,291.00	0.07
19	603899	晨光文具	656,972.00	0.07
20	603986	兆易创新	378,650.00	0.04

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	570,283,006.49
卖出股票收入（成交）总额	112,125,261.17

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。



## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

## 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

## 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

## 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划管理人可能出于套期保值为目的投资股指期货，以回避市场的系统风险。本集合计划管理人将遵守谨慎性原则，严格控制投资股指期货空头的合约价值，使之与股票组合的多头价值相对应，以对冲特殊情况下的流动性风险，改善组合的风险收益特性。

## 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划对国债期货的投资以套期保值、回避市场风险为主要目的。结合国债交易市场和期货市场的收益性、流动性等情况，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

### 7.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

### 7.11.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 市场中性策略执行情况

## 7.13 投资组合报告附注

### 7.13.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

本报告期内，本集合计划投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情况。

**7.13.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明**

本报告期内，本集合计划投资的前十名股票未超出集合计划合同规定的备选股票库。

**7.13.3 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	134,344.08
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	33,072.34
5	应收申购款	1,110,602.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,278,019.02

**7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

**7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.13.6 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
兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	11,728	63,245.51	13,468,871.84	1.82%	728,274,413.70	98.18%
兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	223	252,767.46	11,002,248.69	19.52%	45,364,894.00	80.48%
合计	11,951	66,781.90	24,471,120.53	3.07%	773,639,307.70	96.93%

### 8.2 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	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	1,728,861.29	0.2166%
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	-	-
	合计	1,728,861.29	0.2166%

### 8.3 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的情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	10~50

	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	10~50
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	0
	合计	10~50

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟 领先优势一年持 有期混合 A	兴证资管金麒麟 领先优势一年持 有期混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 13 日）基金份 额总额	-	69,753,713.02
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购 份额	741,743,285.51	-
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎 回份额	-	13,386,570.33
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变 动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	741,743,285.51	56,367,142.69

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

## § 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，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人的重大人事变动如下：2020 年 5 月，杨定光先生因工作变动不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，集合计划托管人的专门集合计划托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本集合计划未发生对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划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

本报告期内集合计划管理人未改聘会计师事务所。本集合计划聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划提供审计服务。

### 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

本报告期内，本集合计划管理人、托管人及其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	
兴业证券	2	682,408,267.66	100.00%	635,524.84	100.00%	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准：财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；具备本集合计划运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本集合计划进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本集合计划提供研究服务支持；佣金费率合理；本集合计划管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序：本集合计划管理人根据上述标准考察后确定选用交易单

元的证券经营机构；本集合计划管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本集合计划本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
兴业证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 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	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书	规定网站	2020年4月13日
2	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同	规定网站	2020年4月13日
3	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议	规定网站	2020年4月13日
4	兴证证券资产管理有限公司关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同等法律文件生效的公告	规定网站、规定报刊	2020年4月13日
5	兴证证券资产管理有限公司关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划变更投资经理的公告	规定网站、规定报刊	2020年4月30日
6	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务的公告	规定网站、规定报刊	2020年4月30日
7	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书（更新）	规定网站	2020年5月7日

	(2020 年第 1 号)		
8	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 5 月 9 日
9	兴证证券资产管理有限公司关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 5 月 14 日
10	兴证证券资产管理有限公司关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 5 月 23 日
11	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划参加部分销售机构申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 6 月 30 日
12	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划参加陆基金申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 7 月 2 日
13	兴证证券资产管理有限公司关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加挖财基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2020 年 7 月 3 日
14	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2020 年第 2 季度报告	规定网站	2020 年 7 月 21 日



## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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

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

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本集合计划管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对照公募基金对本集合计划进行了规范改造，并在收到中国证监会准予本集合计划合同变更生效的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。改造后的集合计划合同已于 2020 年 4 月 13 日变更生效。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书》；
- 5、 集合计划管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、 集合计划托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、 报告期内在规定媒介上披露的各项公告；
- 8、 法律法规及中国证监会要求的其他文件。

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

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

兴证证券资产管理有限公司

2020 年 8 月 28 日