

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 型集合资产管理计划 2022 年中期报告

2022 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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2022 年 8 月 31 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。

集合计划托管人兴业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	6
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	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	9
3.1 主要会计数据和财务指标	9
3.2 基金净值表现	9
3.3 其他指标	13
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
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	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	19
6.1 资产负债表	19
6.2 利润表	20

6.3 净资产（基金净值）变动表.....	21
6.4 报表附注.....	24
§7 投资组合报告.....	60
7.1 期末基金资产组合情况.....	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	60
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.....	61
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	62
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
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.....	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	65
7.12 投资组合报告附注.....	65
§8 基金份额持有人信息.....	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	67
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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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.....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变.....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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.....	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	70
10.8 其他重大事件.....	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72

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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录.....	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划		
基金简称	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合		
基金主代码	970113		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 12 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	兴业银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	86,998,949.46 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。		
下属分级基金的基金简称	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	970112	970113	970114
报告期末下属分级基金份额总额	693,041.30 份	86,050,448.49 份	255,459.67 份

注：1、管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对照公募基金对兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划进行了规范，并在收到中国证监会准予兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向集合计划份额持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》已于 2021 年 12 月 13 日生效，“兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划”（以下称本集合计划）。

2、根据本集合计划《资产管理合同》和《招募说明书》的约定，本集合计划 A 类份额和 C 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 类份额和 C 类份额自最短持有期到期日起即进入开放持有期，期间可以办理赎回业务，每份 A 类份额和 C 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 类份额和 C 类份额申购申请确认日/红利再投资确认日起至该 A 类份额和 C 类份额申购申请确认日/红利再投资确认日 1 年后的对日的前一个工作日（即最短持有期到期日，但不含该日）止，若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。

“兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划”B 类份额自 2021 年 12 月 14 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	本集合计划在控制组合风险的前提下，本集合计划投资于具有核心竞争力、价值被低估的上市公司，通过组合管理，力争实现资产的
------	--

	长期稳健增值。
投资策略	<p>本集合计划主要策略包括资产配置策略，即主要通过对国际和国内宏观经济运行情况、国际和国内宏观经济政策、产业政策环境进行分析，结合行业状况、公司价值和成长性分析，综合评价证券市场系统性风险和各类资产预期收益与风险，据此制定本集合计划在股票、债券、现金、金融衍生工具等大类资产之间的配置比例及调整原则。本集合计划将持续跟踪组合资产配置情况，适时地做出相应调整。同时适时调整国内 A 股 和香港（港股通标的股票）两地股票的配置比例和投资策略。</p> <p>本集合计划投资策略还包括行业配置策略、股票投资策略、固定收益投资策略和金融衍生工具投资策略。股票投资遵循“自下而上”的个股投资策略，利用管理人投研团队的资源，通过扎实的深度产业研究，挖掘出各行业里有护城河和竞争力的上市公司股票进行投资，包括 A 股个股投资策略及港股通投资策略。固定收益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、可转换债券投资策略、资产支持证券投资策略及积极的流动性管理。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。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*75%+中债综合财富（总值）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。本集合计划若投资港股通标的股票，将承担汇率风险以及因投资环境、投资标的、市场制度、交易规则差异等带来的境外市场的风险。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	付志坚	李真
	联系电话	021-38565866	021-52629999-212051
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	tgb_lizhen@cib.com.cn
客户服务电话		95562-3	95561
传真		021-38565863	021-62159217
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	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 层	上海市银城路 167 号兴业大厦 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		孙国雄	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ixzzcgl.com
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	兴证资管金麒麟兴睿 优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿 优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟 兴睿优选一年持 有期混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022年1月1 日 - 2022年6月30 日)	报告期(2022年1月1 日 - 2022年6月30 日)	报告期(2022年1 月1日 - 2022年 6月30日)
本期已实现收益	-67,715.60	-8,490,826.54	-25,646.28
本期利润	-17,251.14	-8,442,138.62	-3,933.81
加权平均基金份额本期利润	-0.0260	-0.0961	-0.0165
本期加权平均净值利润率	-2.86%	-10.57%	-1.82%
本期基金份额净值增长率	-2.46%	-8.66%	-2.82%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022年6月30日)		
期末可供分配利润	-69,491.25	-3,373,879.31	-26,425.12
期末可供分配基金份额利润	-0.1003	-0.0392	-0.1034
期末基金资产净值	675,961.07	82,676,569.18	248,255.19
期末基金份额净值	0.9754	0.9608	0.9718
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-2.46%	-8.76%	-2.82%

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。

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

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 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	9.53%	1.30%	7.21%	0.80%	2.32%	0.50%
过去三个月	9.15%	1.28%	4.92%	1.07%	4.23%	0.21%
自基金合同 生效起至今	-2.46%	1.27%	-4.03%	1.11%	1.57%	0.16%

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B

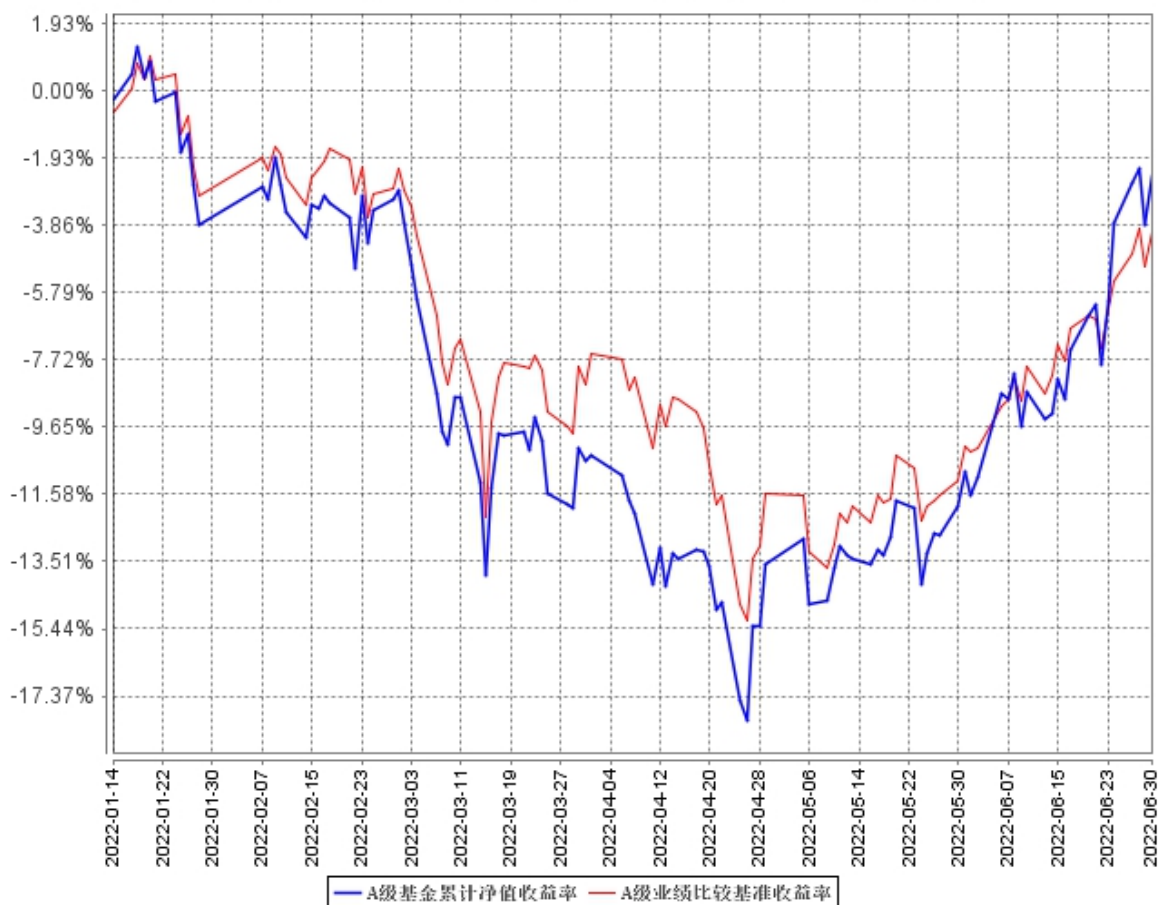
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.53%	1.30%	7.21%	0.80%	2.32%	0.50%
过去三个月	9.14%	1.29%	4.92%	1.07%	4.22%	0.22%
过去六个月	-8.66%	1.27%	-6.46%	1.09%	-2.20%	0.18%
自基金合同生效起至今	-8.76%	1.24%	-7.89%	1.05%	-0.87%	0.19%

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C

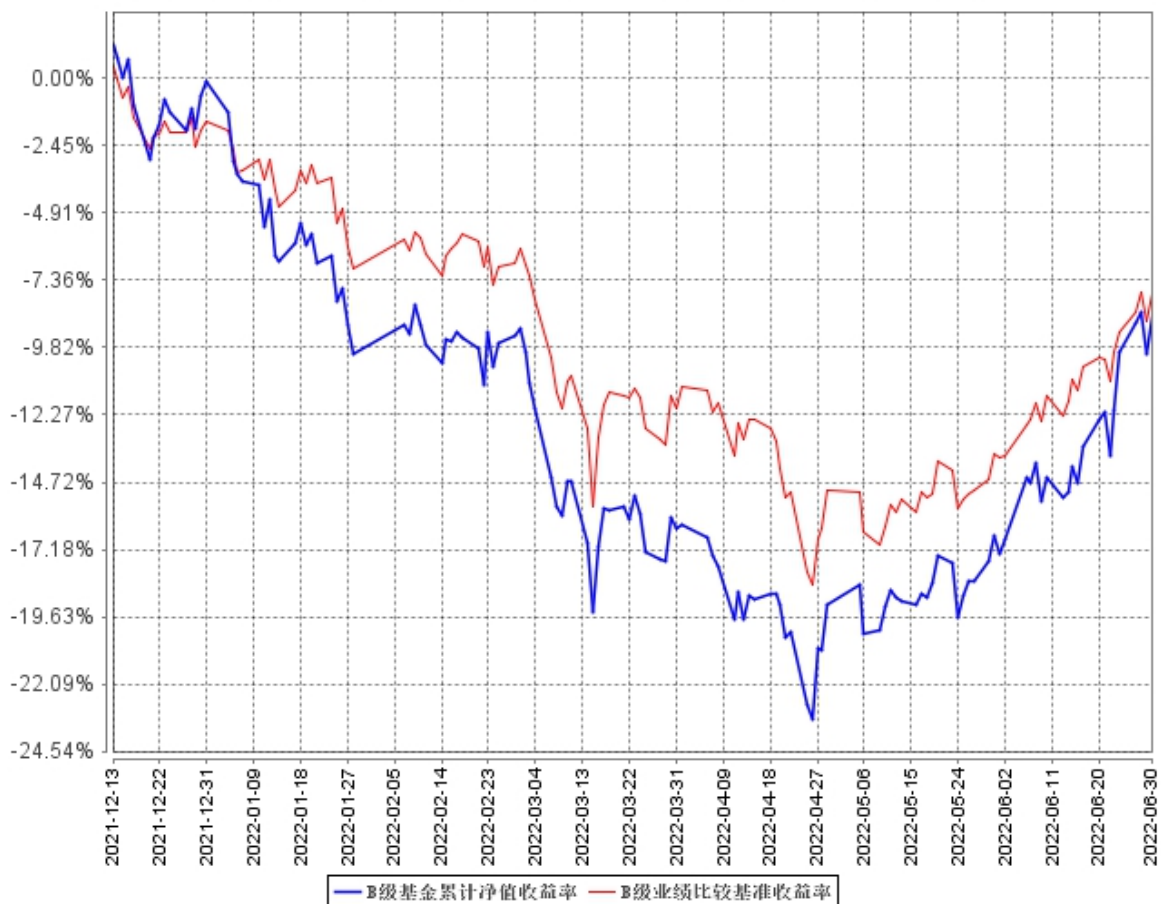
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	9.45%	1.30%	7.21%	0.80%	2.24%	0.50%
过去三个月	8.92%	1.28%	4.92%	1.07%	4.00%	0.21%
自基金合同生效起至今	-2.82%	1.27%	-4.03%	1.11%	1.21%	0.16%

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

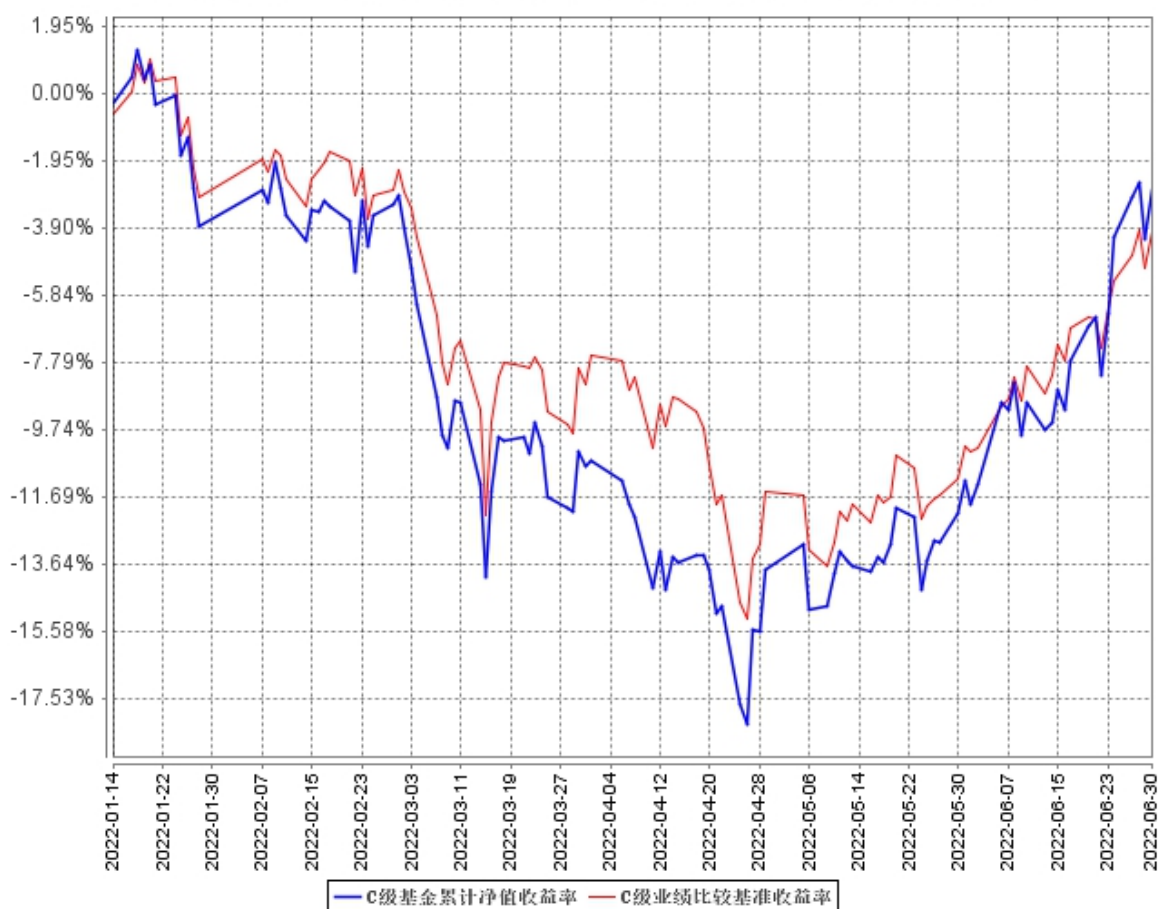
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金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



C级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2022 年 6 月 30 日。

2、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。

3.3 其他指标

无。

§ 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，固收、权益、创新投资、大类资产配置等四大资管业务齐头并进，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2022年6月30日，兴证证券资产管理有限公司共有7只按照公募基金要求规范运作的大集合资产管理计划，分别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、兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券型集合资产管理计划。

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公募投资部副总经理、投资经理	2021年12月13日	-	14	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、权益投资部总经理助理、公募投资部总经理助理。现任兴证证券资产管理有限公司公募投资部副经理

					理、投资经理。
游臻	兴证证券资产管理有限公司公募投资部投资经理	2021年12月13日	-	10	新加坡管理大学硕士。2012年9月进入金融行业，任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014年12月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易运营部交易员、固定收益部投资经理。现任兴证证券资产管理有限公司公募投资部投资经理。

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“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《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
游臻	公募资产管理产品	4	1,206,811,369.66	2021-07-29
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	1,170,630,242.00	2021-05-21
	合计	5	2,377,441,611.66	-

注：截止本报告期末，游臻管理的其他组合包括 1 只大集合资产管理计划：兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划。

截止本报告期末，匡伟未兼任私募小集合资产管理计划和其他组合投资经理。

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》。公司通过科学、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

上半年市场呈现 V 形走势，1 月到 4 月，市场在俄乌关系紧张、国内疫情、地产行业持续低迷等影响下，出现了一定的回调。其中成长性行业及消费行业回调幅度较大，煤炭、地产、银行表现相对较好。5 月到 6 月，俄乌冲突向常态化演进，国内疫情好转，流动性上内松外紧，以新能源为代表的成长股表现相对较好。

报告期内本产品以配置各行业具有竞争优势的白马龙头公司为主，成长性行业里，主要配置电子、军工，新能源相关行业中，选取相对具有长期成长性和竞争优势的公司。增加了对港股互联网等资产的配置。

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兴睿优选一年持有期混合 A 集合计划份额净值为 0.9754 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-2.46%，同期业绩比较基准收益率为-4.03%；

截至本报告期末兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B 集合计划份额净值为 0.9608 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-8.66%，同期业绩比较基准收益率为-6.46%；

截至本报告期末兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C 集合计划份额净值为 0.9718 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-2.82%，同期业绩比较基准收益率为-4.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，或将关注经济企稳下，与传统经济相关度高的行业恢复性机会，包括地产链、大金融、大消费。新能源与智能车赛道上，或更加关注长期具有竞争力优质公司的阿尔法机会，行业已经处于相对较热状态，预计未来波动性可能加大。成长赛道上凭借中国在新能源与智能车制造领域的崛起，或将可能培育出世界级的公司。年底需要密切关注经济回调可能存在的风险，一是欧美经济衰退的传导，二是国内地产边际改善程度和稳经济措施的落实情况。本产品根据实际情况坚持择机配置各行业优质龙头公司，进行可持续的价值投资。

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。估值委员会由研究、投资的分管领导、投研条线分管领导、公募投资部负责人、固定收益部负责人、研究部负责人、权益投资部负责人、创新投资部负责人、大类资产配置部负责人、同业投资部负责人、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，管理人根据实际情况进行收益分配，若《资产管理合同》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

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划资产净值低于五千万的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本托管人认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	9,504,557.70	17,886,153.40
结算备付金		116,652.25	208,794.26
存出保证金		45,987.03	71,162.42
交易性金融资产	6.4.7.2	74,457,509.95	80,482,941.82
其中：股票投资		74,457,509.95	80,482,941.82
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		29,725.23	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		84,154,432.16	98,649,051.90
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 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		-	-
应付清算款		342,230.53	-

应付赎回款		-	746,428.71
应付管理人报酬		39,080.54	88,806.23
应付托管费		13,026.86	18,346.27
应付销售服务费		450.13	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	10,913.70
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	158,858.66	87,426.26
负债合计		553,646.72	951,921.17
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	86,998,949.46	92,873,537.79
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-3,398,164.02	4,823,592.94
净资产合计		83,600,785.44	97,697,130.73
负债和净资产总计		84,154,432.16	98,649,051.90

注：报告截止日 2022 年 6 月 30 日，兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A 份额净值（暂估业绩报酬前）0.9754 元，份额总额 693,041.30 份，资产净值（暂估业绩报酬前）675,961.07 元，暂估业绩报酬 0 元，资产净值（暂估业绩报酬后）675,961.07 元；

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B 份额净值（暂估业绩报酬前）0.9608 元，份额总额 86,050,448.49 份，资产净值（暂估业绩报酬前）82,676,569.18 元，暂估业绩报酬 0 元，资产净值（暂估业绩报酬后）82,676,569.18 元；

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C 份额净值（暂估业绩报酬前）0.9718 元，份额总额 255,459.67 份，资产净值（暂估业绩报酬前）248,255.19 元，暂估业绩报酬 0 元，资产净值（暂估业绩报酬后）248,255.19 元；

上述暂估业绩报酬余额是各类集合计划份额持有人于 2022 年 6 月 30 日暂估业绩报酬的分类合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

6.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-8,019,330.76	-

1.利息收入		31,889.16	-
其中：存款利息收入	6.4.7.13	31,889.16	-
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）		-8,172,084.77	-
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-8,544,482.40	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	372,397.63	-
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	120,864.85	-
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-	-
减：二、营业总支出		443,992.81	-
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	240,586.15	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,195.38	-
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	799.42	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.23	122,411.86	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,463,323.57	-
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,463,323.57	-
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,463,323.57	-

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 12 月 13 日，因此无上年度可比期间数据。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	92,873,537.79	-	4,823,592.94	97,697,130.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	92,873,537.79	-	4,823,592.94	97,697,130.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-5,874,588.33	-	-8,221,756.96	-14,096,345.29
(一)、综合收益总额	-	-	-8,463,323.57	-8,463,323.57
(二)、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)	-5,874,588.33	-	241,566.61	-5,633,021.72
其中：1.基金申购款	948,500.97	-	-3,099.76	945,401.21
2.基金赎回款	-6,823,089.30	-	244,666.37	-6,578,422.93
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益	-	-	-	-

结转留存收益				
四、本期期末净资产(基金净值)	86,998,949.46	-	-3,398,164.02	83,600,785.44
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	-	-	-	-
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(一)、综合收益总额	-	-	-	-
(二)、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	-	-	-	-
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益	-	-	-	-
结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产(基金净值)	-	-	-	-
-----------------	---	---	---	---

注：本集合计划合同变更生效日为 2021 年 12 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：

<u>孙国雄</u>	<u>孙国雄</u>	<u>郑启旭</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟兴睿优选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 5 号集合资产管理计划变更而来，兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划由兴业证券金麒麟 5 号集合资产管理计划变更而来。

2011 年 7 月 14 日，中国证券监督管理委员会作出《关于核准兴业证券股份有限公司设立兴业证券金麒麟 5 号集合资产管理计划的批复》（证监许可〔2011〕1097 号），兴业证券金麒麟 5 号集合资产管理计划设立，自 2011 年 8 月 15 日起向社会公众发行，2011 年 9 月 9 日结束募集并于 2011 年 9 月 15 日成立。2015 年 2 月 16 日，兴业证券金麒麟 5 号集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划。

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》等法规对兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划进行了规范，并在收到中国证监会准予兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 12 月 13 日生效，“兴证资管金麒麟 5 号集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划”。

本集合计划为契约型开放式，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，托管人为兴业银行股份有限公司。

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、创业板及其他中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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的纯债部分）、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：本集合计划投资股票资产占集合计划总资产的比例为 60%—95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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%+中债综合财富（总值）指数收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划以持续经营为基础编制财务报表。本财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本集合计划 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本集合计划的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间。

6.4.4.2 记账本位币

本集合计划的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本集合计划选定记

账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：

本集合计划在初始确认时按取得资产或承担负债的目的，把金融资产和金融负债分为不同类别：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、应收款项、持有至到期投资、可供出售金融资产和其他金融负债。本集合计划现无金融资产分类为持有至到期投资和可供出售金融资产。本集合计划现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

本集合计划持有的股票投资和债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融资产的分类

本集合计划通常根据管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

本集合计划持有的股票投资、基金投资及债券投资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。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。本集合计划现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

除非本集合计划改变管理金融资产的商业模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在商业模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本集合计划将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本集合计划管理该金融资产的商业模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本集合计划将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。在初始确认时，如果能够消除或显著减少会计错配，本集合计划可以将本应以摊余成本计量的金融资产不可撤销地指定为以公允价值计量且其变动计入

当期损益的金融资产。

管理金融资产的商业模式，是指本集合计划如何管理金融资产以产生现金流量。商业模式决定本集合计划所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本集合计划以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的商业模式。

本集合计划对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本集合计划对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本集合计划将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本集合计划现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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

自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止期间：

金融资产和金融负债在本集合计划成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

初始确认后，金融资产和金融负债的后续计量如下：

-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以公允价值计量，公允价值变

动形成的利得或损失计入当期损益。

-应收款项以实际利率法按摊余成本计量。

-除以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债以外的金融负债采用实际利率法按摊余成本进行后续计量。

满足下列条件之一时，本集合计划终止确认该金融资产：

-收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

-该金融资产已转移，且本集合计划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；

-该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本集合计划将下列两项金额的差额计入当期损益：

-所转移金融资产的账面价值

-因转移而收到的对价

金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，本集合计划终止确认该金融负债或其一部分。

自 2022 年 1 月 1 日起：

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本集合计划成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于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，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本集合计划终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本集合计划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；

- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本集合计划将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本集合计划终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本集合计划以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本集合计划持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本集合计划按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本集合计划需考虑的最长期限为企面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少

于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本集合计划始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本集合计划对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本集合计划在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本集合计划不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本集合计划确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本集合计划催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本集合计划按下述原则计量公允价值：

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。

本集合计划在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据《企业会计准则》的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。

与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本集合计划不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本集合计划具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本集合计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于集合计划份额折算引起的实收基金份额变动于集合计划份额折算日根据折算前的集合计划份额数及确定的折算比例计算认列。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认列。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

损益平准金核算在集合计划份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的

差额确认。本集合计划的交易费用用于进行股票、债券、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

股利收益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确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债,根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后,计算利息计入当期损益。如票面利率与实际利率出现重大差异,按实际利率计算利息计入当期损益。

利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬、托管费和【销售服务费】在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本集合计划的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产利息支出按到期应付或实际支付的金额与初始确认金额的差额,在资金实际占用期间内以实际利率法逐日确认,直线法与实际利率法确定的支出差异较小的可采用直线法。

本集合计划的其他费用如无需在收益期内预提或分摊,则于发生时直接计入基金损益;如需采用预提或待摊的方法,预提或待摊时计入基金损益。

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 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 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。

本集合计划目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本集合计划根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自2018年1月1日起，资管产品管理人（以下称管理人）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。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以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，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

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 2022 年 6 月 30 日
----	------------------------

活期存款	9,504,557.70
等于：本金	9,503,640.45
加：应计利息	917.25
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：	9,504,557.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	69,019,146.98	-	74,457,509.95	5,438,362.97
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	69,019,146.98	-	74,457,509.95	5,438,362.97

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

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

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。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本集合计划本报告期末未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022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	-
应付交易费用	41,679.88
其中：交易所市场	41,679.88
银行间市场	-
-	-
应付利息	-
预提费用	117,178.78
合计	158,858.66

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A		
项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	-	-
本期申购	693,041.30	693,041.30
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	693,041.30	693,041.30
-----	------------	------------

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	92,873,537.79	92,873,537.79
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-6,823,089.30	-6,823,089.30
- 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	86,050,448.49	86,050,448.49

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C		
项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
本期期初	-	-
本期申购	255,459.67	255,459.67
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	255,459.67	255,459.67

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本集合计划本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	-	-	-
本期利润	-67,715.60	50,464.46	-17,251.14
本期基金份额交易产生的变动数	-1,775.65	1,946.56	170.91
其中：基金申购款	-1,775.65	1,946.56	170.91
基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-69,491.25	52,411.02	-17,080.23

单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	11,259,208.05	-6,435,615.11	4,823,592.94
本期利润	-8,490,826.54	48,687.92	-8,442,138.62
本期基金份额交易产生的变动数	-654,512.99	899,179.36	244,666.37
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-654,512.99	899,179.36	244,666.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,113,868.52	-5,487,747.83	-3,373,879.31

单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-	-	-
本期利润	-25,646.28	21,712.47	-3,933.81
本期基金份额交易产生的变动数	-778.84	-2,491.83	-3,270.67
其中：基金申购款	-778.84	-2,491.83	-3,270.67

基金赎回款	-	-	-
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-26,425.12	19,220.64	-7,204.48

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	28,906.05
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	2,272.98
其他	710.13
合计	31,889.16

注：其他包括保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	125,351,897.18
减：卖出股票成本总额	133,665,648.46
减：交易费用	230,731.12
买卖股票差价收入	-8,544,482.40

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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。

6.4.7.15.3 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-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 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-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	372,397.63
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	372,397.63

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	120,864.85
——股票投资	120,864.85
——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	120,864.85

6.4.7.21 其他收入

本集合计划本报告期内无其他收入。

6.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	29,752.78
信息披露费	70,704.03

证券出借违约金	-
其他费用	3,839.30
银行间账户维护费	18,000.00
银行费用	45.00
港股通证券组合费	70.75
合计	122,411.86

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、集合计划销售机构
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
兴业银行股份有限公司（“兴业银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构
兴证期货有限公司（“兴证期货”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证创新资本管理有限公司（“兴证资本”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证投资管理有限公司（“兴证投资”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证全球基金管理有限公司（“兴证基金”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
福州兴证物业管理有限公司	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证(香港)金融控股有限公司（“兴证香港”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证国际金融集团有限公司（“兴证国际”）	受集合计划管理人的股东控制的公司

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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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	252,871,248.92	100.00%	-	-

6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期末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末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末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 2022年1月1日至2022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	62,378.72	100.00%	41,679.88	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021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 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	240,586.15	-
其中：支付销售机构的客户维护费	104,675.73	-

注：（1）固定管理费

本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：

$$H = E \times 0.6\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划管理费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经管理人与托管人双方核对无误后，托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 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。

（2）业绩报酬

（2.1）业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在集合计划投资人退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬。本集合计划分红日，管理人不提取业绩报酬。

（2.2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。以业绩报酬计提期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = (A - B) / C * 365 / N * 100\%$$

A = 为本次业绩报酬计提日累计单位净值；

B = 为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的累计单位净值；

C = 为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的单位净值；

N = 为本次计提业绩报酬区间天数，即前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日的间隔天数。

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无

则为份额参与本集合计划日)至本次业绩报酬计提日,若计划单位份额年化收益率 R 小于或等于 6%时,管理人不提取业绩报酬;若计划单位份额年化收益率 R 大于 6%,管理人对超过 6%以上的部分提取 20%作为业绩报酬。

$$H=(R-6\%)*20\%*C*F*N/365$$

(F 为参与计提业绩报酬的份额数)

如投资人退出的份额为多笔参与,则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。开放期参与价格为受理申请当日份额净值,红利再投资的参与价格为红利转份额当日份额净值。

(2.3) 业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成,由管理人向托管人发送划付指令,托管人根据指令从集合计划资产中一次性支付给管理人。

于 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日,本集合计划发生的应支付管理人的业绩报酬为 0 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	80,195.38	-

注:本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下:

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的集合计划托管费

E 为前一日的集合计划资产净值

集合计划托管费每日计算,逐日累计至每月月末,按月支付,经管理人与托管人双方核对无误后,托管人按照与管理人协商一致的方式于次月前 5 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

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	兴证资管金麒麟兴	兴证资管金麒麟兴	兴证资管金麒麟	合计

	睿优选一年持有期混合 A	睿优选一年持有期混合 B	兴睿优选一年持有期混合 C	
兴业证券	-	-	799.44	799.44
合计	-	-	799.44	799.44
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C	合计
合计	-	-	-	-

注：本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.80%。

计算公式为： $H=E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 12 月 13 日)	-	14,907,885.15	-

持有的基金份额			
报告期初持有的基金份额	-	14,907,885.15	-
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	-	14,907,885.15	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	17.1357%	-

项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	兴证资管金麒麟兴睿 优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿 优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟兴睿 优选一年持有期混合 C
基金合同生效日 (2021 年 12 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：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 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021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
兴业银行股份有限公司	9,503,640.45	28,906.05	-	-

注：本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人兴业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内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2022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**

本集合计划本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

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 2022 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、创业板及其他中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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的纯债部分）、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：本集合计划投资股票资产占集合计划总资产的比例为 60%—95%，其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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、监事会——公司经营管理层及其风险管理委员会——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兴业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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

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》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、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022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	9,503,640.45	-	-	917.25	9,504,557.70
结算备付金	116,424.69	-	-	227.56	116,652.25
存出保证金	45,963.19	-	-	23.84	45,987.03
交易性金融资 产	-	-	-	74,457,509.95	74,457,509.95
应收股利	-	-	-	29,725.23	29,725.23
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	9,666,028.33	-	-	74,488,403.83	84,154,432.16
负债					
应付证券清算 款	-	-	-	342,230.53	342,230.53
应付管理人报 酬	-	-	-	39,080.54	39,080.54
应付托管费	-	-	-	13,026.86	13,026.86
应付销售服务 费	-	-	-	450.13	450.13
应付交易费用	-	-	-	41,679.88	41,679.88
其他负债	-	-	-	117,178.78	117,178.78
负债总计	-	-	-	553,646.72	553,646.72
利率敏感度缺	9,666,028.33	-	-	73,934,757.11	83,600,785.44

口					
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	17,884,852.56	-	-	1,300.84	17,886,153.40
结算备付金	208,690.97	-	-	103.29	208,794.26
存出保证金	71,127.22	-	-	35.20	71,162.42
交易性金融资 产	-	-	-	-80,482,941.82	-80,482,941.82
应收利息	-	-	-	0.00	0.00
其他资产	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	18,164,670.75	-	-	-80,484,381.15	98,649,051.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	746,428.71	746,428.71
应付管理人报 酬	-	-	-	88,806.23	88,806.23
应付托管费	-	-	-	18,346.27	18,346.27
应付交易费用	-	-	-	40,704.29	40,704.29
应交税费	-	-	-	10,913.70	10,913.70
其他负债	-	-	-	46,721.97	46,721.97
负债总计	-	-	-	951,921.17	951,921.17
利率敏感度缺 口	18,164,670.75	-	-	-79,532,459.98	97,697,130.73

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，其合计市值占净值比较低，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

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。本集合计划持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	15,064,667.87	-	15,064,667.87
应收股利	-	29,725.23	-	29,725.23
资产合计	-	15,094,393.10	-	15,094,393.10
以外币计价的负债				
应付证券清算款	-	3.32	-	3.32
负债合计	-	3.32	-	3.32
资产负债表外汇风险敞口净额	-	15,094,389.78	-	15,094,389.78
项目	上年度末			
	2021 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除外汇以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（2022 年 6 月 30 日）	上年度末（2021 年 12 月 31 日）
		港币相对人民币升值	754,719.49

	5%		
	港币相对人民币贬值	-754, 719. 49	-
	5%		

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，所面临的最大的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 2022年6月30日		上年度末 2021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	74, 457, 509. 95	89. 06	80, 482, 941. 82	82. 38
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	74, 457, 509. 95	89. 06	80, 482, 941. 82	82. 38

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值按照资本-资产定价模型（CAPM）描述的规律进行变动	
	使用本集合计划业绩比较基准所对应的市场组合进行分析	
	在业绩基准变化 5%时，对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到本集合计划净值的变化	
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（2022年6月30日）	上年度末（2021年12月31日）
	业绩比较基准+5%	6,448,719.67	4,653,938.53
	业绩比较基准-5%	-6,448,719.67	-4,653,938.53

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（采用报告期末前推 120 个交易日作为参数计算的样本数据，上市日期距离期末不足 120 个交易日的新股、次新股鉴于距离上市时间过短、样本数据过少，贝塔值设定为 1）。

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

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到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	74,457,509.95	80,482,941.82
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	74,457,509.95	80,482,941.82

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本报告期持有的金融工具公允价值所属层次间未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具(2021 年 12 月 31 日：无)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2022 年 6 月 30 日，本集合计划无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	74,457,509.95	88.48
	其中：股票	74,457,509.95	88.48
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	9,621,209.95	11.43
8	其他各项资产	75,712.26	0.09
9	合计	84,154,432.16	100.00

注：本集合本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 15,064,667.87 元，占总资产比例 17.90%。

7.2 报告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	-	-
C	制造业	43,644,710.08	52.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,584,451.00	1.90
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	-	-
J	金融业	8,291,036.00	9.92
K	房地产业	1,794,888.00	2.15
L	租赁和商务服务业	822,406.00	0.98
M	科学研究和技术服务业	2,409,198.00	2.88

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	846,153.00	1.01
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	59,392,842.08	71.04

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	4,761,099.29	5.70
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	4,023,070.32	4.81
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	6,280,498.26	7.51
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	15,064,667.87	18.02

注：以上分类采用全球行业标准（GICS）

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	600690	海尔智家	178,296	4,896,008.16	5.86
2	600309	万华化学	44,400	4,306,356.00	5.15
3	600456	宝钛股份	70,500	4,187,700.00	5.01
4	300059	东方财富	155,100	3,939,540.00	4.71
5	300750	宁德时代	7,000	3,738,000.00	4.47
6	600703	三安光电	143,400	3,524,772.00	4.22
7	01024	快手-W	45,100	3,370,936.63	4.03
8	03690	美团-W	19,100	3,172,087.85	3.79
9	002475	立讯精密	90,240	3,049,209.60	3.65
10	00700	腾讯控股	9,600	2,909,561.63	3.48
11	600887	伊利股份	73,800	2,874,510.00	3.44
12	300782	卓胜微	19,091	2,577,285.00	3.08

13	00570	中国中药	618,000	2,563,260.99	3.07
14	300012	华测检测	103,800	2,409,198.00	2.88
15	601628	中国人寿	74,700	2,321,676.00	2.78
16	300408	三环集团	74,516	2,242,931.60	2.68
17	002007	华兰生物	97,000	2,211,600.00	2.65
18	600036	招商银行	48,100	2,029,820.00	2.43
19	600048	保利发展	102,800	1,794,888.00	2.15
20	09868	小鹏汽车—W	14,700	1,589,011.44	1.90
21	600905	三峡能源	251,900	1,584,451.00	1.90
22	600150	中国船舶	82,900	1,573,442.00	1.88
23	01548	金斯瑞生物科技	60,000	1,459,809.33	1.75
24	002859	洁美科技	50,800	1,398,016.00	1.67
25	603606	东方电缆	17,000	1,302,200.00	1.56
26	002920	德赛西威	8,600	1,272,800.00	1.52
27	601717	郑煤机	83,200	1,198,912.00	1.43
28	603833	欧派家居	6,300	949,284.00	1.14
29	300015	爱尔眼科	18,900	846,153.00	1.01
30	002027	分众传媒	122,200	822,406.00	0.98
31	688116	天奈科技	4,689	794,691.72	0.95
32	603260	合盛硅业	4,700	554,412.00	0.66
33	600237	铜峰电子	50,000	411,000.00	0.49
34	300751	迈为股份	800	392,720.00	0.47
35	603801	志邦家居	7,000	188,860.00	0.23

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	5,191,571.00	5.31
2	300012	华测检测	4,493,517.00	4.60
3	000999	华润三九	4,297,869.52	4.40
4	300750	宁德时代	3,718,103.40	3.81
5	300059	东方财富	3,600,745.77	3.69
6	002415	海康威视	3,542,622.00	3.63

7	300408	三环集团	3,332,412.28	3.41
8	603806	福斯特	3,180,471.68	3.26
9	603606	东方电缆	3,139,164.83	3.21
10	600703	三安光电	3,030,227.00	3.10
11	002475	立讯精密	2,967,490.40	3.04
12	03690	美团-W	2,964,177.16	3.03
13	00700	腾讯控股	2,963,368.58	3.03
14	01024	快手-W	2,962,323.65	3.03
15	01548	金斯瑞生物科技	2,946,563.10	3.02
16	002371	北方华创	2,937,457.00	3.01
17	000333	美的集团	2,706,335.00	2.77
18	600456	宝钛股份	2,604,069.99	2.67
19	300782	卓胜微	2,586,160.17	2.65
20	601390	中国中铁	2,475,992.00	2.53
21	601186	中国铁建	2,475,528.00	2.53
22	600690	海尔智家	2,390,911.00	2.45
23	00570	中国中药	2,332,085.31	2.39
24	600426	华鲁恒升	2,301,944.00	2.36
25	300347	泰格医药	2,297,510.00	2.35
26	002027	分众传媒	2,281,721.00	2.34
27	601628	中国人寿	2,122,076.00	2.17
28	002007	华兰生物	1,987,875.00	2.03
29	600905	三峡能源	1,972,754.00	2.02

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初基金资产净值 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	占期初基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	7,523,857.50	7.70
2	002415	海康威视	5,582,903.00	5.71
3	600519	贵州茅台	5,212,770.00	5.34
4	000999	华润三九	5,071,815.96	5.19
5	600036	招商银行	4,725,870.00	4.84
6	300012	华测检测	3,861,939.00	3.95
7	603606	东方电缆	3,590,516.00	3.68
8	600522	中天科技	3,104,629.00	3.18

9	688665	四方光电	3,000,999.61	3.07
10	603806	福斯特	2,860,798.40	2.93
11	603995	甬金股份	2,857,296.45	2.92
12	603893	瑞芯微	2,729,593.00	2.79
13	002241	歌尔股份	2,697,711.00	2.76
14	600456	宝钛股份	2,682,546.00	2.75
15	601186	中国铁建	2,644,137.00	2.71
16	002371	北方华创	2,611,218.00	2.67
17	002027	分众传媒	2,459,225.00	2.52
18	600011	华能国际	2,408,651.00	2.47
19	601390	中国中铁	2,340,228.00	2.40
20	300014	亿纬锂能	2,186,543.00	2.24
21	300347	泰格医药	2,122,457.00	2.17
22	600690	海尔智家	2,115,179.00	2.17
23	000333	美的集团	2,059,662.00	2.11
24	01548	金斯瑞生物科技	2,012,237.98	2.06

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	127,519,351.74
卖出股票收入（成交）总额	125,351,897.18

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 本基金投资股指期货的投资政策

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。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、流动性等情况进行空头套期保值。

7.11.2 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 投资组合报告附注

7.12.1 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

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，美团、腾讯控股有限公司在报告编制日前一年内受到国家市场监督管理总局的处罚。上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

7.12.3 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	45,987.03
2	应收清算款	-
3	应收股利	29,725.23
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	75,712.26

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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
兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	13	53,310.87	0.00	0.00%	693,041.30	100.00%
兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	306	281,210.62	15,907,884.97	18.49%	70,142,563.52	81.51%
兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C	6	42,576.61	102,817.19	40.25%	152,642.48	59.75%
合计	325	267,689.08	16,010,702.16	18.40%	70,988,247.30	81.60%

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	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	0.00	0.0000%
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	98,715.51	0.1147%
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C	0.00	0.0000%
	合计	98,715.51	0.1135%

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	0
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	0
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	0
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	0
	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合 C
基金合同生效日（2021 年 12 月 13 日）基金份额总额	-	102,292,036.51	-
本报告期期初基金份额总额	-	92,873,537.79	-
本报告期基金总申购份额	693,041.30	-	255,459.67
减：本报告期基金总赎回份额	-	6,823,089.30	-
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	693,041.30	86,050,448.49	255,459.67

注：总申购份额含红利再投、转换入份额和强制调增份额，总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，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本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	252,871,248.92	100.00%	62,378.72	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	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划开放日常申购、赎回业务公告	规定网站、规定报刊	2022 年 1 月 10 日
2	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划增加盈米基金为销售机构并参加相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2022 年 3 月 15 日
3	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分集合计划新增度小满基金为销售机构、开通定期定额投资业务并参加相关费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2022 年 3 月 22 日
4	兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年第 1 季度报告	规定网站	2022 年 4 月 22 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集合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

- 1、2022 年 7 月，胡平生先生不再担任公司董事长。2022 年 7 月起，孙国雄先生担任公司董事长。
- 2、2022 年 8 月，曾旭先生不再担任公司总经理。2022 年 7 月起，孙国雄先生兼任公司总经理。
- 3、2022 年 8 月起，郭贤珺女士担任公司副总经理。

§ 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 5 号集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟兴睿优选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

2022 年 8 月 31 日