

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 2023 年中期报告

2023 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：招商银行股份有限公司

送出日期：2023 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。

集合计划托管人招商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 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 2023 年 1 月 1 日起至 2023 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..... | 7 |
| 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 |
| §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..... | 15 |
| 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..... | 16 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明..... | 16 |
| 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 | 52 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 52 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 52 |
| 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 | 53 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 54 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 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 | 56 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 56 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 56 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 56 |
| §8 基金份额持有人信息 | 58 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 58 |
| 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 58 |
| 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 | 59 |
| §9 开放式基金份额变动 | 60 |
| §10 重大事件揭示 | 61 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 61 |
| 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 | 61 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 61 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 61 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 61 |
| 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 | 61 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 61 |
| 10.8 其他重大事件 | 62 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| 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 | 63 |

| | |
|---------------------------|-----------|
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息 | 63 |
| §12 备查文件目录 | 64 |
| 12.1 备查文件目录 | 64 |
| 12.2 存放地点 | 64 |
| 12.3 查阅方式 | 64 |

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | |
|----------------|--------------------------------|----------------------|----------------------|
| 基金名称 | 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 | | |
| 基金简称 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 | | |
| 基金主代码 | 970094 | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | |
| 基金合同生效日 | 2021 年 11 月 15 日 | | |
| 基金管理人 | 兴证证券资产管理有限公司 | | |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 | | |
| 报告期末基金份额总额 | 59,136,006.09 份 | | |
| 基金合同存续期 | 本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年。 | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 970093 | 970094 | 970095 |
| 报告期末下属分级基金份额总额 | 32,556,830.99 份 | 25,585,579.17 份 | 993,595.93 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业证券金麒麟顶端优势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业证券金麒麟顶端优势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，《兴证资管金麒麟均衡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 11 月 15 日生效。

“兴业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划”正式更名为“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”（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为对日。

“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”B 类份额自 2021 年 11 月 16 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，重视优秀商业模式带来的长期价值，选择具有核心竞争优势和持续增长能力的优质上市公司， |
|------|--|

| | |
|--------|---|
| | 通过组合管理进行均衡配置，力争实现集合计划资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本集合计划主要策略包括资产配置策略、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。资产配置策略将根据对宏观经济形势、市场运行趋势和对行业与上市公司投资价值的研究，综合考虑宏观经济指标、微观经济指标、市场指标、政策等各方面因素，确定组合中股票、债券、货币市场工具及其他金融工具的比例。股票投资在对宏观周期和行业比较有基本认识的前提下，遵循“自下而上”与“自上而下”相结合的个股投资策略。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、积极的流动性管理策略。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。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 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 付志坚 |
| | 联系电话 | 021-38565866 |
| | 电子邮箱 | zcgl@xyzq.com.cn |
| 客户服务电话 | 95562-3 | 95555 |
| 传真 | 021-38565863 | 0755-83195201 |
| 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 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 办公地址 | 上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 层 | 深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | 200135 | 518040 |
| 法定代表人 | 孙国雄 | 缪建民 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---------------------|---|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 中国证券报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.ixzcgsl.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 | 兴证资管金麒麟均衡 优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡 优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟 均衡优选一年持 有期混合 C |
|---------------|-------------------------------------|-------------------------------------|-------------------------------------|
| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2023年1月1 日 - 2023年6月30 日) | 报告期(2023年1月1 日 - 2023年6月30 日) | 报告期(2023年1 月1日 - 2023年 6月30日) |
| 本期已实现收益 | -181,412.14 | -378,169.81 | -4,381.09 |
| 本期利润 | -2,275,402.94 | -3,038,100.77 | -62,748.89 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.0886 | -0.1136 | -0.0552 |
| 本期加权平均净值利润率 | -9.88% | -10.19% | -6.18% |
| 本期基金份额净值增长率 | -9.67% | -9.67% | -10.03% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2023年6月30日) | | |
| 期末可供分配利润 | -5,181,189.55 | 1,217,597.24 | -168,388.69 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.1591 | 0.0476 | -0.1695 |
| 期末基金资产净值 | 27,375,641.44 | 26,803,176.41 | 825,207.24 |
| 期末基金份额净值 | 0.8409 | 1.0476 | 0.8305 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2023年6月30日) | | |
| 基金份额累计净值增长率 | -15.91% | -12.70% | -16.95% |

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

兴证资管金麒麟均衡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 | 3.29% | 0.88% | 0.98% | 0.65% | 2.31% | 0.23% |
| 过去三个月 | -5.79% | 0.90% | -3.51% | 0.62% | -2.28% | 0.28% |
| 过去六个月 | -9.67% | 0.95% | -0.03% | 0.63% | -9.64% | 0.32% |
| 过去一年 | -8.35% | 1.18% | -9.81% | 0.74% | 1.46% | 0.44% |

| | | | | | | |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|
| 自基金合同 生效起至今 | -15.91% | 1.26% | -15.75% | 0.86% | -0.16% | 0.40% |
|----------------|---------|-------|---------|-------|--------|-------|

兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B

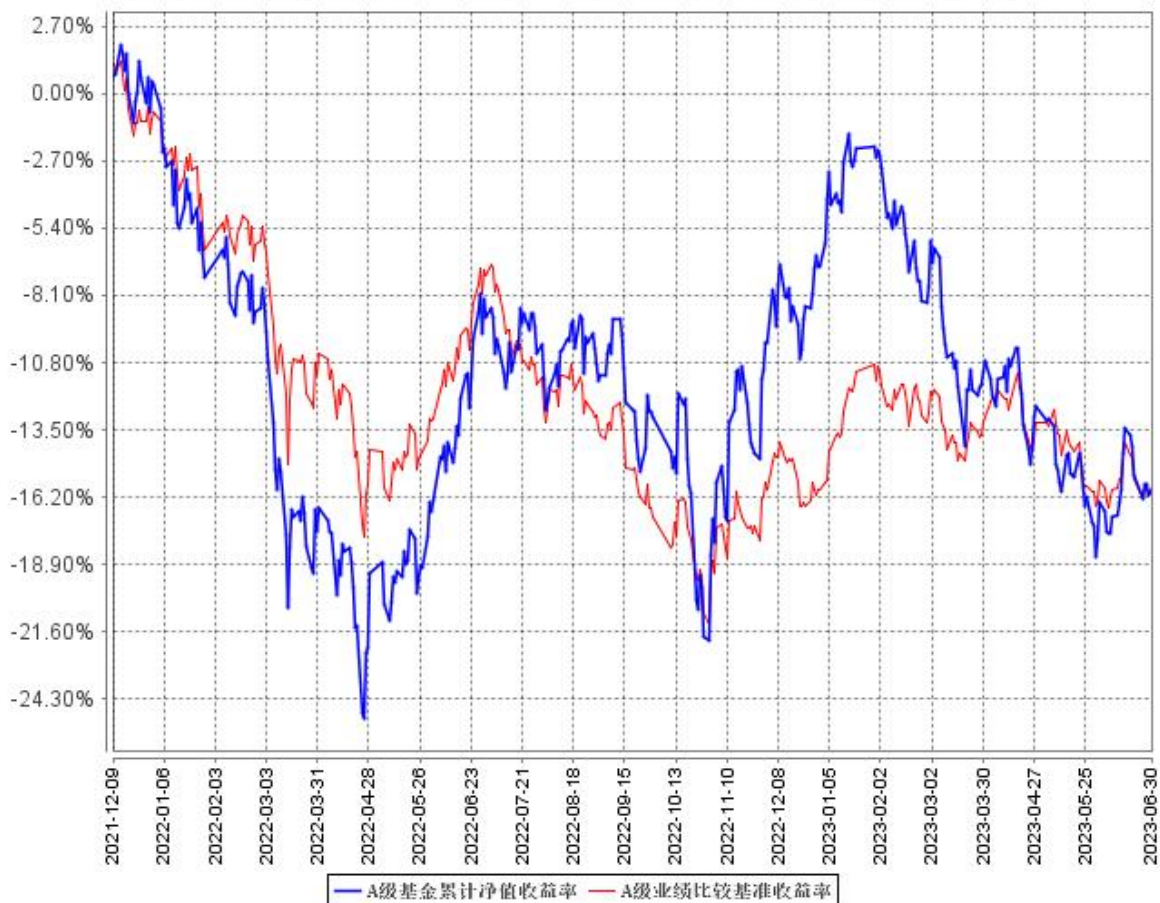
| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准 差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|--------|-------|
| 过去一个月 | 3.29% | 0.88% | 0.98% | 0.65% | 2.31% | 0.23% |
| 过去三个月 | -5.80% | 0.90% | -3.51% | 0.62% | -2.29% | 0.28% |
| 过去六个月 | -9.67% | 0.95% | -0.03% | 0.63% | -9.64% | 0.32% |
| 过去一年 | -8.36% | 1.18% | -9.81% | 0.74% | 1.45% | 0.44% |
| 自基金合同 生效起至今 | -12.70% | 1.24% | -14.40% | 0.85% | 1.70% | 0.39% |

兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C

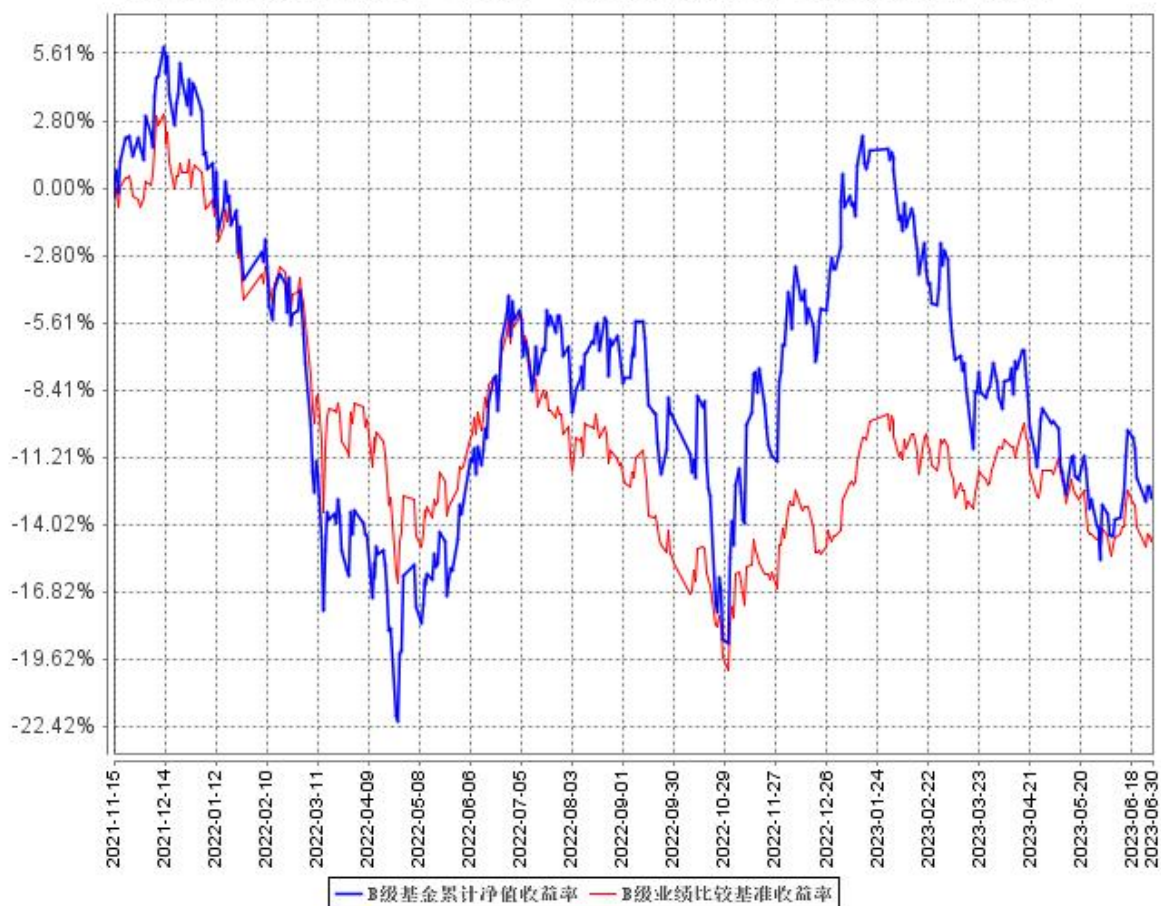
| 阶段 | 份额净值增 长率① | 份额净值 增长率标 准差② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较基准 收益率标准 差④ | ①—③ | ②—④ |
|----------------|--------------|---------------------|--------------------|-----------------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 3.22% | 0.88% | 0.98% | 0.65% | 2.24% | 0.23% |
| 过去三个月 | -5.99% | 0.90% | -3.51% | 0.62% | -2.48% | 0.28% |
| 过去六个月 | -10.03% | 0.95% | -0.03% | 0.63% | -10.00% | 0.32% |
| 过去一年 | -9.10% | 1.18% | -9.81% | 0.74% | 0.71% | 0.44% |
| 自基金合同 生效起至今 | -16.95% | 1.26% | -15.75% | 0.86% | -1.20% | 0.40% |

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

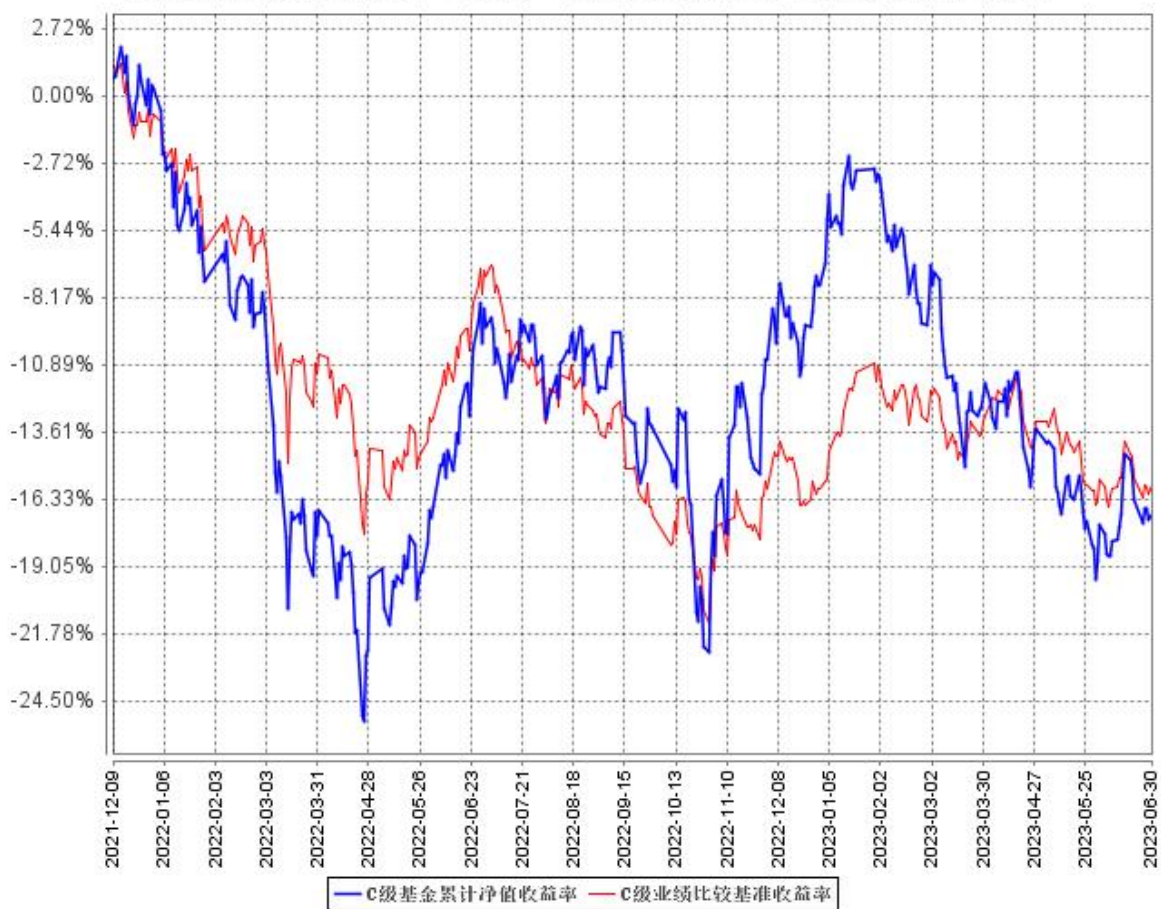
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



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：净值表现所取数据截至到 2023 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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，兴证资管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、组合投资、同业投资等多元业务齐头并进，可为机构客户与个人客户提供一站式投融资解决方案。

截止2023年6月30日，兴证证券资产管理有限公司共有10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、兴证资管金麒麟3个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划、兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期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 | | |
| 何斯源 | 兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理 | 2022年9月16日 | - | 7 | 伦敦大学玛丽皇后学院硕士。2016年4月进入金融行业，并加入兴证证券资产管理有限公司，历任兴证证券资产管理有限公司研究部研究员、权益投资部投资经理、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。 |
| 游臻 | 兴证证 | 2022年9月16 | - | 11 | 新加坡管理大学硕士。 |

| | | | | |
|--|--------------------------------------|---|--|--|
| | 券资产管理有 限公司 公募业务部公 募投资 经理 | 日 | | 2012 年 9 月进入金融行业，任兴业证券股份有限公司资产管理分公司交易员。2014 年 12 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任交易运营部交易员、固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。 |
|--|--------------------------------------|---|--|--|

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

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

3、证券从业的含义遵从行业协会《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

截止本报告期末，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划和其他组合的投资经理。

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

报告期内，我们保持了配置方向上的稳定，重点投资于具有一定性价比的优质成长资产。2023 年一季度，随着市场对于国内经济复苏节奏预期有所反复，A 股及港股市场在定价逻辑上产生了一定程度的波动，我们所持有的部分或有良好增长前景的个股受到阶段性压制。

进入二季度，市场在经历反复轮动后逐步进入修整期，主题投资有所分化，部分行业和个股的走势重新呈现出盈利驱动的迹象，整体市场风格更加均衡，投资机会的分布也更加分散。

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均衡优选一年持有期混合 A 集合计划份额净值为 0.8409 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-9.67%；同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

截至本报告期末兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B 集合计划份额净值为 1.0476 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-9.67%；同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

截至本报告期末兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C 集合计划份额净值为 0.8305 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-10.03%；同期业绩比较基准收益率为-0.03%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

长期来看，中国经济在需求和供给两端都具有较强的国际比较优势，尽管经济复苏的节奏不可避免存在反复，但不必过度悲观，当下市场中广泛存在着优质资产，因此我们仍将致力于优质资产的挖掘，尽最大努力回报持有人的信任和托付。

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、公司合规总监、公司总裁助理、各投资部门负责人、各研究部门负责人、合规风控部负责人、交易运营部负责人等人员组成。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由管理人决定，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

本报告期内出现超过连续二十个工作日未超过连续六十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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，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：兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 10,679,412.86 | 3,416,586.07 |
| 结算备付金 | | 18,730.66 | 329,365.58 |
| 存出保证金 | | 6,888.40 | 18,194.59 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 44,425,500.30 | 57,263,350.28 |
| 其中：股票投资 | | 44,425,500.30 | 54,202,721.51 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | 3,060,628.77 |
| 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 | | - | 358,502.41 |
| 应收股利 | | 10,608.81 | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 55,141,141.03 | 61,385,998.93 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 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 | | 2.03 | 287,324.33 |

| | | | |
|-------------|----------|---------------|---------------|
| 应付赎回款 | | - | 9,187.31 |
| 应付管理人报酬 | | 24,802.39 | 30,982.23 |
| 应付托管费 | | 10,334.32 | 12,909.26 |
| 应付销售服务费 | | 1,664.62 | 3,257.23 |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.9 | 100,312.58 | 214,718.64 |
| 负债合计 | | 137,115.94 | 558,379.00 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 59,136,006.09 | 58,652,198.37 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -4,131,981.00 | 2,175,421.56 |
| 净资产合计 | | 55,004,025.09 | 60,827,619.93 |
| 负债和净资产总计 | | 55,141,141.03 | 61,385,998.93 |

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A 份额净值(暂估业绩报酬前)0.8409 元，份额总额 32,556,830.99 份，资产净值(暂估业绩报酬前)27,375,641.44 元，暂估业绩报酬 2,728.17 元，资产净值(暂估业绩报酬后)27,372,913.27 元；

兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B 份额净值(暂估业绩报酬前) 1.0476 元，份额总额 25,585,579.17 份，资产净值(暂估业绩报酬前)26,803,176.41 元，暂估业绩报酬 0.00 元，资产净值(暂估业绩报酬后) 26,803,176.41 元；

兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C 份额净值(暂估业绩报酬前)0.8305，份额总额 993,595.93 份，资产净值(暂估业绩报酬前)825,207.24 元，暂估业绩报酬 20.49 元，资产净值(暂估业绩报酬后) 825,186.75 元；

上述暂估业绩报酬余额是各类集合份额持有人于 2023 年 6 月 30 日暂估业绩报酬的分类合计，各集合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：兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 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 |
|---------|-----|------------------------------------|------------------------------------|
| | | 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 |
| 一、营业总收入 | | -5,132,427.48 | -3,545,197.27 |

| | | | |
|----------------------------|------------|---------------|---------------|
| 1.利息收入 | | 11,656.13 | 9,718.89 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 11,656.13 | 8,681.37 |
| 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 | | - | 1,037.52 |
| 证券出借利息收入 | | - | - |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -331,794.05 | -2,767,700.87 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -804,294.84 | -3,138,848.76 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 1,669.23 | 13,955.45 |
| 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 | 470,831.56 | 357,192.44 |
| 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 | -4,812,289.56 | -789,435.60 |
| 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 | - | 2,220.31 |
| 减：二、营业总支出 | | 243,825.12 | 295,527.92 |
| 1. 管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 163,868.12 | 143,758.52 |
| 2. 托管费 | 6.4.10.2.2 | 67,158.67 | 59,899.38 |
| 3. 销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 4,122.50 | 5,430.58 |
| 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 | | - | 3.11 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.23 | 8,675.83 | 86,436.33 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -5,376,252.60 | -3,840,725.19 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -5,376,252.60 | -3,840,725.19 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -5,376,252.60 | -3,840,725.19 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 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) | 58,652,198.37 | - | 2,175,421.56 | 60,827,619.93 |
| 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) | 58,652,198.37 | - | 2,175,421.56 | 60,827,619.93 |
| 三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列) | 483,807.72 | - | -6,307,402.56 | -5,823,594.84 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -5,376,252.60 | -5,376,252.60 |
| (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) | 483,807.72 | - | -931,149.96 | -447,342.24 |
| 其中：1.基金申购款 | 10,324,544.45 | - | -1,447,426.70 | 8,877,117.75 |
| 2.基金赎回款 | -9,840,736.73 | - | 516,276.74 | -9,324,459.99 |
| (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) | - | - | - | - |

| | | | | |
|-------------------------------------|--|--------|---------------|---------------|
| 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) | 59,136,006.09 | - | -4,131,981.00 | 55,004,025.09 |
| 项目 | 上年度可比期间 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) | 40,552,511.23 | - | 7,830,762.55 | 48,383,273.78 |
| 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) | 40,552,511.23 | - | 7,830,762.55 | 48,383,273.78 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 14,577,455.08 | - | -5,751,050.71 | 8,826,404.37 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -3,840,725.19 | -3,840,725.19 |
| (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) | 14,577,455.08 | - | -1,910,325.52 | 12,667,129.56 |
| 其中：1.基金申购款 | 16,377,633.04 | - | -1,742,039.10 | 14,635,593.94 |
| 2.基金赎回款 | -1,800,177.96 | - | -168,286.42 | -1,968,464.38 |
| (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) | 55,129,966.31 | - | 2,079,711.84 | 57,209,678.15 |

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：

 孙国雄 孙国雄 林潘颖
 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

兴证资管金麒麟均衡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”）由兴业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划变更而来。

兴业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划自 2013 年 5 月 10 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 22 日结束募集并于 2013 年 5 月 27 日成立。2013 年 6 月 5 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顶端优势集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕589 号）。

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》等法规对兴业证券金麒麟顶端优势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业证券金麒麟顶端优势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。《兴证资管金麒麟均衡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 11 月 15 日生效，“兴业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划”正式更名为“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”。

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，托管人为招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、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%+上证国债指数收益率*25%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划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和《资产管理产品相关会计处理规定》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

本集合计划财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》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 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

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 差错更正的说明

本集合计划本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

如 6.4.1 集合计划基本情况所述，本集合计划已遵照公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作。本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规进行税务处理。如果日后涉及本集合计划的有关税收法规颁布，本集合计划的税务处理可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。本集合计划适用的主要税项列示如下：

(a) 根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)，自 2016 年 5 月 1 日起，金融业纳入“营改增”试点范围；自 2018 年 1 月 1 日以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，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。

(b) 本集合计划进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券(股票)交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方按 0.10% 的税率征收印花税，对受让方不再征税。

(c) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，按照资管产品管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(d) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、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 2023 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 活期存款 | 10,679,412.86 |
| 等于：本金 | 10,678,412.72 |

| | |
|----------------|---------------|
| 加：应计利息 | 1,000.14 |
| 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： | 10,679,412.86 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 | | | |
|-----------------------|-----------------|------|---------------|---------------|
| | 2023 年 6 月 30 日 | | | |
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 46,215,716.14 | - | 44,425,500.30 | -1,790,215.84 |
| 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 | 46,215,716.14 | - | 44,425,500.30 | -1,790,215.84 |

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 2023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 | 31,345.81 |
| 其中：交易所市场 | 31,345.81 |
| 银行间市场 | - |
| - | - |
| 应付利息 | - |
| 预提审计费用 | 24,795.19 |
| 预提信息披露费 | 39,671.58 |
| 预提账户维护费 | 4,500.00 |
| 合计 | 100,312.58 |

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | | |
|----------------------|----------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 29,524,683.15 | 29,524,683.15 |
| 本期申购 | 10,295,820.51 | 10,295,820.51 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -7,263,672.67 | -7,263,672.67 |
| - 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 | 32,556,830.99 | 32,556,830.99 |

金额单位：人民币元

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | | |
|----------------------|---------------------------------------|---------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 27,287,201.95 | 27,287,201.95 |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -1,701,622.78 | -1,701,622.78 |
| - 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 | 25,585,579.17 | 25,585,579.17 |

金额单位：人民币元

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | | |
|----------------------|---------------------------------------|--------------|
| 项目 | 本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 1,840,313.27 | 1,840,313.27 |
| 本期申购 | 28,723.94 | 28,723.94 |
| 本期赎回(以“-”号填列) | -875,441.28 | -875,441.28 |
| - 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 | 993,595.93 | 993,595.93 |

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

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

兴证资管金麒麟均衡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 | -488,432.44 | -1,552,800.60 | -2,041,233.04 |
| 本期利润 | -181,412.14 | -2,093,990.80 | -2,275,402.94 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -251,729.00 | -612,824.57 | -864,553.57 |
| 其中：基金申购款 | -272,343.88 | -1,170,418.88 | -1,442,762.76 |
| 基金赎回款 | 20,614.88 | 557,594.31 | 578,209.19 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -921,573.58 | -4,259,615.97 | -5,181,189.55 |

单位：人民币元

| 兴证资管金麒麟均衡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 | 19,729,989.91 | -15,371,796.09 | 4,358,193.82 |
| 本期利润 | -378,169.81 | -2,659,930.96 | -3,038,100.77 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -1,227,387.38 | 1,124,891.57 | -102,495.81 |
| 其中：基金申购款 | - | - | - |
| 基金赎回款 | -1,227,387.38 | 1,124,891.57 | -102,495.81 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 18,124,432.72 | -16,906,835.48 | 1,217,597.24 |

单位：人民币元

| 兴证资管金麒麟均衡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 | -44,129.03 | -97,410.19 | -141,539.22 |
| 本期利润 | -4,381.09 | -58,367.80 | -62,748.89 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 9,620.86 | 26,278.56 | 35,899.42 |

| | | | |
|----------|------------|-------------|-------------|
| 其中：基金申购款 | -1,038.75 | -3,625.19 | -4,663.94 |
| 基金赎回款 | 10,659.61 | 29,903.75 | 40,563.36 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -38,889.26 | -129,499.43 | -168,388.69 |

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 活期存款利息收入 | 10,010.30 |
| 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 | 927.44 |
| 其他 | 718.39 |
| 合计 | 11,656.13 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 40,109,859.19 |
| 减：卖出股票成本总额 | 40,778,917.01 |
| 减：交易费用 | 135,237.02 |
| 买卖股票差价收入 | -804,294.84 |

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

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|-------------------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 2,071.23 |
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | -402.00 |

| | |
|----------------|----------|
| 债券投资收益——赎回差价收入 | - |
| 债券投资收益——申购差价收入 | - |
| 合计 | 1,669.23 |

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额 | 3,063,000.00 |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 3,000,402.00 |
| 减：应计利息总额 | 63,000.00 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -402.00 |

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 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 470,831.56 |
| 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 | 470,831.56 |

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 |
|------------|----------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -4,812,289.56 |
| ——股票投资 | -4,812,991.56 |
| ——债券投资 | 702.00 |
| ——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 | -4,812,289.56 |

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 |
|----------|----------------------|
| | 2023年1月1日至2023年6月30日 |
| 审计费用 | 24,795.19 |
| 信息披露费 | -30,328.42 |
| 证券出借违约金 | - |
| 注册登记费 | 1,718.14 |
| 银行间账户维护费 | 9,000.00 |
| 银行费用 | 2,955.06 |
| 港股通证券组合费 | 535.86 |
| 合计 | 8,675.83 |

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 |
| 招商银行股份有限公司（“招商银行”） | 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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022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 | 75,758,042.55 | 100.00% | 139,466,806.21 | 100.00% |

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | 上年度可比期间 |
|-------|----|---------|
|-------|----|---------|

| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|------|----------------------|--------------|----------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 |
| 兴业证券 | - | - | 3,000,402.00 | 100.00% |

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 | |
|-------|----------------------------|----------------|---------------------------------|----------------|
| | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 回购成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 |
| 兴业证券 | - | - | 2,400,000.00 | 100.00% |

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间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 2023年1月1日至2023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 | 67,095.12 | 100.00% | 31,345.81 | 100.00% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 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 | 130,727.01 | 100.00% | 56,611.72 | 100.00% |

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 | 上年度可比期间 |
|----|----|---------|
|----|----|---------|

| | 2023年1月1日至2023年6月30日 | 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|-----------------|----------------------|----------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 163,868.12 | 143,758.52 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 57,290.56 | 62,338.51 |

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。业绩报酬计提时，管理人通过约定方式提前将计提金额等数据发送至托管人，托管人根据管理人发送的数据进行账务处理。

(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。于 2023 年 1 月 1 日至 2023 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 2,687.51 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年1月1日至2023年6月30日 | 上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日 |
|----------------|----------------------------|---------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 67,158.67 | 59,899.38 |

注：本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

每日应计提的集合计划托管费 = 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，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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | | |
|----------------|----------------------------|----------------------|----------------------|----------|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 合计 |
| 兴业证券 | - | - | 3,591.81 | 3,591.81 |

| | | | | |
|----------------|---------------------------------|----------------------|----------------------|----------|
| 招商银行 | - | - | 287.21 | 287.21 |
| 合计 | - | - | 3,879.02 | 3,879.02 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间 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 | | | |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 合计 |
| 兴业证券 | - | - | 5,095.94 | 5,095.94 |
| 招商银行 | - | - | 331.53 | 331.53 |
| 合计 | - | - | 5,427.47 | 5,427.47 |

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及上年度可比期间未发生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 2023年1月1日至2023年6月30日 | | |
|---------|----------------------------|----------------------|----------------------|
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C |
| 基金合同生效日 | - | 6,905,232.87 | - |

| | | | |
|---------------------------------|---|--------------|---|
| (2021 年 11 月 15 日) 持有的基金份额 | | | |
| 报告期初持有的基金份额 | - | 6,905,232.87 | - |
| 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 | - | 6,905,232.87 | - |
| 报告期末持有的基金份 额 占基金总份额比例 | - | 11.6769% | - |

| 项目 | 上年度可比期间 | | |
|--|---------------------------------|--------------------------|--------------------------|
| | 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日 | | |
| | 兴证资管金麒麟均衡 优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡 优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡 优选一年持有期混合 C |
| 基金合同生效日 (2021 年 11 月 15 日) 持有的基金份额 | - | 6,905,232.87 | - |
| 报告期初持有的基金 份额 | - | 6,905,232.87 | - |
| 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 | - | 6,905,232.87 | - |
| 报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例 | - | 12.5254% | - |

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

份额单位：份

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | | | | |
|----------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| 兴证期货有限公司 | 5,982,527.53 | 10.1166% | 5,982,527.53 | 10.2000% |

份额单位：份

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | | | | |
|----------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| - | - | - | - | - |

份额单位：份

| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | | | | |
|----------------------|------------------------|--------------------------|--------------------------|--------------------------|
| 关联方名称 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 | |
| | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 | 持有的 基金份额 | 持有的基金份额 占基金总份额的 比例 |
| - | - | - | - | - |

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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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 |
| 招商银行 | 10,679,412.86 | 10,010.30 | 2,295,060.08 | 7,388.70 |

注：本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人招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及上年度可比期间未发生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（2023 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 2023 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，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本集合计划从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，无抵押债券。

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 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。

6.4.13.1.1 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。

6.4.13.1.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本集合计划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。

6.4.13.1.3 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。

6.4.13.1.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | 上年度末 2022 年 12 月 31 日 |
|--------|------------------------|--------------------------|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |

| | | |
|-----|---|--------------|
| 未评级 | - | 3,060,628.77 |
| 合计 | - | 3,060,628.77 |

注：此处列示的未评级债券包括国债等非信用债券投资。

6.4.13.1.5 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。

6.4.13.1.6 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。

6.4.13.2 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。针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划流动性情况良好，持有的资产主要为现金类资产和股票，且本集合计划报告期末股票持仓未出现停牌或其他流动受限的情况，均能以合理价格适时变现。本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.2.1 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，不得超过该上市公司可流通股票的 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，不得超过该上市公司可流通股票的 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。

6.4.13.3 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。

6.4.13.3.1 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、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.3.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023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 | 10,679,412.86 | - | - | - | -10,679,412.86 |
| 结算备付金 | 18,730.66 | - | - | - | 18,730.66 |
| 存出保证金 | 6,888.40 | - | - | - | 6,888.40 |
| 交易性金融资 | - | - | - | -44,425,500.30 | 44,425,500.30 |

| | | | | | |
|--------------------------|---------------|-------|-------|---------------|---------------|
| 产 | | | | | |
| 应收股利 | - | - | - | 10,608.81 | 10,608.81 |
| 资产总计 | 10,705,031.92 | - | - | 44,436,109.11 | 55,141,141.03 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 2.03 | 2.03 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 24,802.39 | 24,802.39 |
| 应付托管费 | - | - | - | 10,334.32 | 10,334.32 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 1,664.62 | 1,664.62 |
| 其他负债 | - | - | - | 100,312.58 | 100,312.58 |
| 负债总计 | - | - | - | 137,115.94 | 137,115.94 |
| 利率敏感度缺口 | 10,705,031.92 | - | - | 44,298,993.17 | 55,004,025.09 |
| 上年度末 2022 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 | 3,416,586.07 | - | - | - | 3,416,586.07 |
| 结算备付金 | 329,365.58 | - | - | - | 329,365.58 |
| 存出保证金 | 18,194.59 | - | - | - | 18,194.59 |
| 交易性金融资产 | 3,060,628.77 | - | - | 54,202,721.51 | 57,263,350.28 |
| 应收清算款 | - | - | - | 358,502.41 | 358,502.41 |
| 资产总计 | 6,824,775.01 | - | - | 54,561,223.92 | 61,385,998.93 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 287,324.33 | 287,324.33 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 9,187.31 | 9,187.31 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 30,982.23 | 30,982.23 |
| 应付托管费 | - | - | - | 12,909.26 | 12,909.26 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | 3,257.23 | 3,257.23 |
| 其他负债 | - | - | - | 214,718.64 | 214,718.64 |
| 负债总计 | - | - | - | 558,379.00 | 558,379.00 |
| 利率敏感度缺口 | 6,824,775.01 | - | - | 54,002,844.92 | 60,827,619.93 |

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。

6.4.13.3.1.2 利率风险的敏感性分析

| | |
|----|----------------------|
| 假设 | 1. 其他影响债券公允价值的变量保持不变 |
|----|----------------------|

| 2. 假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线） | | | |
|-----------------------------------|-----------|---------------------------------|-------------------|
| 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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 市场利率+1% | - | 1,150.66 |
| 市场利率-1% | - | -1,144.81 | |

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对本集合计划净值产生的影响。

6.4.13.3.2 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

6.4.13.3.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023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 | - | 9,308,840.80 | - | 9,308,840.80 |
| 应收股利 | - | 10,608.81 | - | 10,608.81 |
| 资产合计 | - | 9,319,449.61 | - | 9,319,449.61 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | - | 2.03 | - | 2.03 |
| 负债合计 | - | 2.03 | - | 2.03 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 9,319,447.58 | - | 9,319,447.58 |
| 项目 | 上年度末 2022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 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 15,397,687.01 | - | 15,397,687.01 |
| 应收证券清算款 | - | 358,502.41 | - | 358,502.41 |
| 资产合计 | - | 15,756,189.42 | - | 15,756,189.42 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 应付证券清算款 | - | 287,324.33 | - | 287,324.33 |
| 负债合计 | - | 287,324.33 | - | 287,324.33 |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 15,468,865.09 | - | 15,468,865.09 |

6.4.13.3.2 外汇风险的敏感性分析

| | | | |
|----|------------------|---------------------------------|-------------------|
| 假设 | 除汇率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（2023年6月30日） | 上年度末（2022年12月31日） |
| | 港币相对人民币升值 5% | 465,972.38 | 773,443.25 |
| | 港币相对人民币贬值 5% | -465,972.38 | -773,443.25 |

6.4.13.3.3 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。

6.4.13.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2022 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 | 44,425,500.30 | 80.77 | 54,202,721.51 | 89.11 |
| 交易性金融资产—基金投资 | — | — | — | — |
| 交易性金融资产—债券投资 | — | — | 3,060,628.77 | 5.03 |
| 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 | 44,425,500.30 | 80.77 | 57,263,350.28 | 94.14 |

6.4.13.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 1. 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 | | |
|-----------|--|-------------------------------|-------------------------|
| | 2. 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 | | |
| | 3. 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 (2023 年 6 月 30 日) | 上年度末 (2022 年 12 月 31 日) |
| | 业绩比较基准+5% | 2,229,550.98 | 3,141,958.37 |
| 业绩比较基准-5% | -2,229,550.98 | -3,141,958.37 | |

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 2023年6月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|-------------------|---------------------|
| 第一层次 | 44,425,500.30 | 54,202,721.51 |
| 第二层次 | - | 3,060,628.77 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 44,425,500.30 | 57,263,350.28 |

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

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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 2023 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 | 44,425,500.30 | 80.57 |
| | 其中：股票 | 44,425,500.30 | 80.57 |
| 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 | 10,698,143.52 | 19.40 |
| 8 | 其他各项资产 | 17,497.21 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 55,141,141.03 | 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 9,308,840.80 元，占总资产比例 16.88%

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 | 19,898,455.50 | 36.18 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| 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 | 2,125,865.00 | 3.86 |
| J | 金融业 | 2,390,160.00 | 4.35 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 2,587,119.00 | 4.70 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,658,550.00 | 8.47 |

| | | | |
|---|---------------|---------------|-------|
| 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 | 3,456,510.00 | 6.28 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 35,116,659.50 | 63.84 |

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 | 2,281,662.18 | 4.15 |
| C 消费者常用品 | - | - |
| D 能源 | - | - |
| E 金融 | - | - |
| F 医疗保健 | 3,529,724.26 | 6.42 |
| G 工业 | 129,844.95 | 0.24 |
| H 信息技术 | - | - |
| I 电信服务 | 2,901,364.41 | 5.27 |
| J 公用事业 | - | - |
| K 房地产 | 466,245.00 | 0.85 |
| 合计 | 9,308,840.80 | 16.92 |

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 | 300012 | 华测检测 | 238,900 | 4,658,550.00 | 8.47 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 14,700 | 4,407,060.00 | 8.01 |
| 3 | 600519 | 贵州茅台 | 2,500 | 4,227,500.00 | 7.69 |
| 4 | 000516 | 国际医学 | 411,000 | 3,456,510.00 | 6.28 |
| 5 | 00700 | 腾讯控股 | 9,490 | 2,901,364.41 | 5.27 |
| 6 | 002027 | 分众传媒 | 379,900 | 2,587,119.00 | 4.70 |
| 7 | 600298 | 安琪酵母 | 65,700 | 2,378,997.00 | 4.33 |
| 8 | 03690 | 美团-W | 20,235 | 2,281,662.18 | 4.15 |
| 9 | 600150 | 中国船舶 | 65,600 | 2,158,896.00 | 3.92 |
| 10 | 02269 | 药明生物 | 51,218 | 1,773,182.53 | 3.22 |
| 11 | 601318 | 中国平安 | 34,500 | 1,600,800.00 | 2.91 |
| 12 | 600570 | 恒生电子 | 35,700 | 1,581,153.00 | 2.87 |

| | | | | | |
|----|--------|--------|---------|--------------|------|
| 13 | 09996 | 沛嘉医疗-B | 224,000 | 1,272,185.60 | 2.31 |
| 14 | 002311 | 海大集团 | 25,600 | 1,199,104.00 | 2.18 |
| 15 | 688617 | 惠泰医疗 | 2,754 | 1,029,307.50 | 1.87 |
| 16 | 002142 | 宁波银行 | 31,200 | 789,360.00 | 1.44 |
| 17 | 601138 | 工业富联 | 31,000 | 781,200.00 | 1.42 |
| 18 | 300487 | 蓝晓科技 | 11,100 | 692,862.00 | 1.26 |
| 19 | 601698 | 中国卫通 | 27,400 | 544,712.00 | 0.99 |
| 20 | 600562 | 国睿科技 | 32,700 | 529,740.00 | 0.96 |
| 21 | 600990 | 四创电子 | 16,000 | 506,240.00 | 0.92 |
| 22 | 600372 | 中航电子 | 33,300 | 505,494.00 | 0.92 |
| 23 | 002935 | 天奥电子 | 25,200 | 498,456.00 | 0.91 |
| 24 | 600118 | 中国卫星 | 17,500 | 493,675.00 | 0.90 |
| 25 | 600855 | 航天长峰 | 37,200 | 489,924.00 | 0.89 |
| 26 | 02273 | 固生堂 | 10,400 | 476,552.96 | 0.87 |
| 27 | 01209 | 华润万象生活 | 13,000 | 466,245.00 | 0.85 |
| 28 | 00587 | 海螺环保 | 61,500 | 129,844.95 | 0.24 |
| 29 | 09995 | 荣昌生物 | 208 | 6,568.18 | 0.01 |
| 30 | 03347 | 泰格医药 | 30 | 1,234.99 | 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 | 03690 | 美团-W | 3,093,300.91 | 5.09 |
| 2 | 000516 | 国际医学 | 2,925,063.00 | 4.81 |
| 3 | 03347 | 泰格医药 | 1,488,643.83 | 2.45 |
| 3 | 300347 | 泰格医药 | 840,138.00 | 1.38 |
| 4 | 02269 | 药明生物 | 1,601,764.91 | 2.63 |
| 5 | 02331 | 李宁 | 1,322,589.58 | 2.17 |
| 6 | 600570 | 恒生电子 | 1,275,572.00 | 2.10 |
| 7 | 300012 | 华测检测 | 1,256,793.00 | 2.07 |
| 8 | 00700 | 腾讯控股 | 1,255,155.99 | 2.06 |
| 9 | 09996 | 沛嘉医疗-B | 1,233,311.18 | 2.03 |
| 10 | 01209 | 华润万象生活 | 1,219,242.88 | 2.00 |

| | | | | |
|----|--------|------|--------------|------|
| 11 | 601318 | 中国平安 | 1,204,054.00 | 1.98 |
| 12 | 002027 | 分众传媒 | 1,103,959.00 | 1.81 |
| 13 | 688085 | 三友医疗 | 1,084,148.97 | 1.78 |
| 14 | 000768 | 中航西飞 | 1,079,925.00 | 1.78 |
| 15 | 000738 | 航发控制 | 1,040,645.00 | 1.71 |
| 16 | 688617 | 惠泰医疗 | 996,167.12 | 1.64 |
| 17 | 601138 | 工业富联 | 968,820.00 | 1.59 |
| 18 | 300760 | 迈瑞医疗 | 935,099.00 | 1.54 |
| 19 | 600298 | 安琪酵母 | 930,766.00 | 1.53 |
| 20 | 09995 | 荣昌生物 | 756,018.32 | 1.24 |

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 | 02269 | 药明生物 | 4,370,812.73 | 7.19 |
| 2 | 03690 | 美团-W | 3,747,909.44 | 6.16 |
| 3 | 600570 | 恒生电子 | 2,647,945.00 | 4.35 |
| 4 | 002142 | 宁波银行 | 2,476,875.00 | 4.07 |
| 5 | 688085 | 三友医疗 | 2,288,059.90 | 3.76 |
| 6 | 300699 | 光威复材 | 2,243,980.00 | 3.69 |
| 7 | 300627 | 华测导航 | 2,174,974.00 | 3.58 |
| 8 | 03347 | 泰格医药 | 1,108,229.62 | 1.82 |
| 8 | 300347 | 泰格医药 | 572,085.00 | 0.94 |
| 9 | 600519 | 贵州茅台 | 1,424,569.00 | 2.34 |
| 10 | 00700 | 腾讯控股 | 1,337,616.20 | 2.20 |
| 11 | 00941 | 中国移动 | 1,216,542.87 | 2.00 |
| 12 | 600309 | 万华化学 | 1,194,579.00 | 1.96 |
| 13 | 601888 | 中国中免 | 1,185,614.00 | 1.95 |
| 14 | 02331 | 李宁 | 1,122,060.35 | 1.84 |
| 15 | 002027 | 分众传媒 | 1,051,689.00 | 1.73 |
| 16 | 300012 | 华测检测 | 1,020,256.00 | 1.68 |
| 17 | 000768 | 中航西飞 | 997,778.00 | 1.64 |
| 18 | 600298 | 安琪酵母 | 896,196.00 | 1.47 |
| 19 | 000738 | 航发控制 | 887,965.00 | 1.46 |
| 20 | 688111 | 金山办公 | 867,582.60 | 1.43 |

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 | 35,648,183.36 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 40,109,859.19 |

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 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，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 | 6,888.40 |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 10,608.81 |
| 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 | 17,497.21 |

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 |
| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 100 | 325,568.31 | 14,751,973.31 | 45.31% | 17,804,857.68 | 54.69% |
| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 114 | 224,434.91 | 9,963,791.15 | 38.94% | 15,621,788.02 | 61.06% |
| 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 110 | 9,032.69 | 238,567.15 | 24.01% | 755,028.78 | 75.99% |
| 合计 | 324 | 182,518.54 | 24,954,331.61 | 42.20% | 34,181,674.48 | 57.80% |

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 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 1,588,796.32 | 4.8801% |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 689,920.06 | 2.6965% |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 919.91 | 0.0926% |
| | 合计 | 2,279,636.29 | 3.8549% |

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 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 0 |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 10~50 |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 0 |
| | 合计 | 10~50 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | >100 |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 10~50 |
| | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C | 0 |
| | 合计 | >100 |

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 A | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C |
|---------------------------------|----------------------|----------------------|----------------------|
| 基金合同生效日（2021 年 11 月 15 日）基金份额总额 | - | 35,439,779.04 | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 29,524,683.15 | 27,287,201.95 | 1,840,313.27 |
| 本报告期基金总申购份额 | 10,295,820.51 | - | 28,723.94 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 7,263,672.67 | 1,701,622.78 | 875,441.28 |
| 本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - | - |
| 本报告期末基金份额总额 | 32,556,830.99 | 25,585,579.17 | 993,595.93 |

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，本集合计划托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，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

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划的管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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 | 75,758,042.55 | 100.00% | 67,108.44 | 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 | 兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告 | 规定网站 | 2023 年 1 月 20 日 |
| 2 | 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 2022 年年度报告 | 规定网站 | 2023 年 3 月 31 日 |
| 3 | 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 2023 年第 1 季度报告 | 规定网站 | 2023 年 4 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

无。

§ 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业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟均衡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、《兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟均衡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.ixzcgf.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

2023 年 8 月 31 日