

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
2024年第2季度报告

2024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

报告送出日期：2024年7月19日

§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责任。

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 2024 年 7 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 4 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	62,855,801.75 份
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。		
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		
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的份额总额	35,768,411.06 份	23,579,959.21 份	3,507,431.48 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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 4 月 1 日-2024 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
1. 本期已实现收益	201,430.02	168,524.20	14,113.30
2. 本期利润	51,776.14	103,746.55	1,102.50
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0014	0.0042	0.0003

4. 期末基金资产净值	26,349,281.52	21,640,987.01	2,531,648.89
5. 期末基金份额净值	0.7367	0.9178	0.7218

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、上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。

3.2 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	净值增长率①	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
过去三个月	0.20%	0.86%	-1.13%	0.56%	1.33%	0.30%
过去六个月	-3.08%	1.02%	1.65%	0.67%	-4.73%	0.35%
过去一年	-12.39%	0.97%	-6.03%	0.65%	-6.36%	0.32%
自基金合同生效起至今	-26.33%	1.15%	-19.98%	0.79%	-6.35%	0.36%

兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B

阶段	净值增长率①	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
过去三个月	0.20%	0.86%	-1.13%	0.56%	1.33%	0.30%
过去六个月	-3.08%	1.02%	1.65%	0.67%	-4.73%	0.35%
过去一年	-12.39%	0.97%	-6.03%	0.65%	-6.36%	0.32%
自基金合同生效起至今	-23.52%	1.15%	-18.75%	0.78%	-4.77%	0.37%

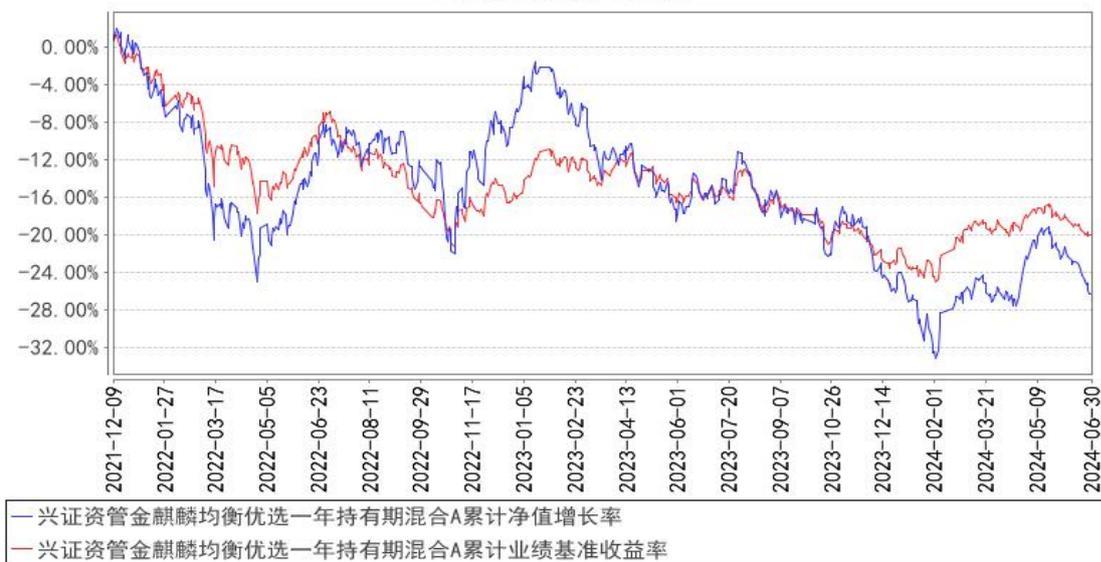
兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C

阶段	净值增长率①	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
----	--------	-----------	------------	---------------	-----	-----

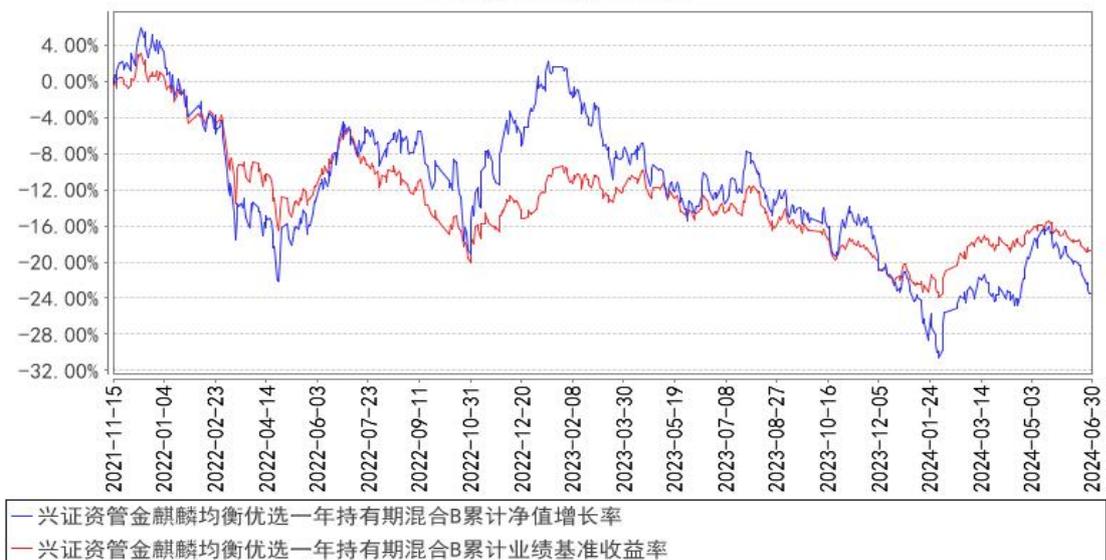
		准差②	收益率③	收益率标准差 ④		
过去三个月	0.00%	0.86%	-1.13%	0.56%	1.13%	0.30%
过去六个月	-3.48%	1.02%	1.65%	0.67%	-5.13%	0.35%
过去一年	-13.09%	0.97%	-6.03%	0.65%	-7.06%	0.32%
自基金合同 生效起至今	-27.82%	1.15%	-19.98%	0.79%	-7.84%	0.36%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

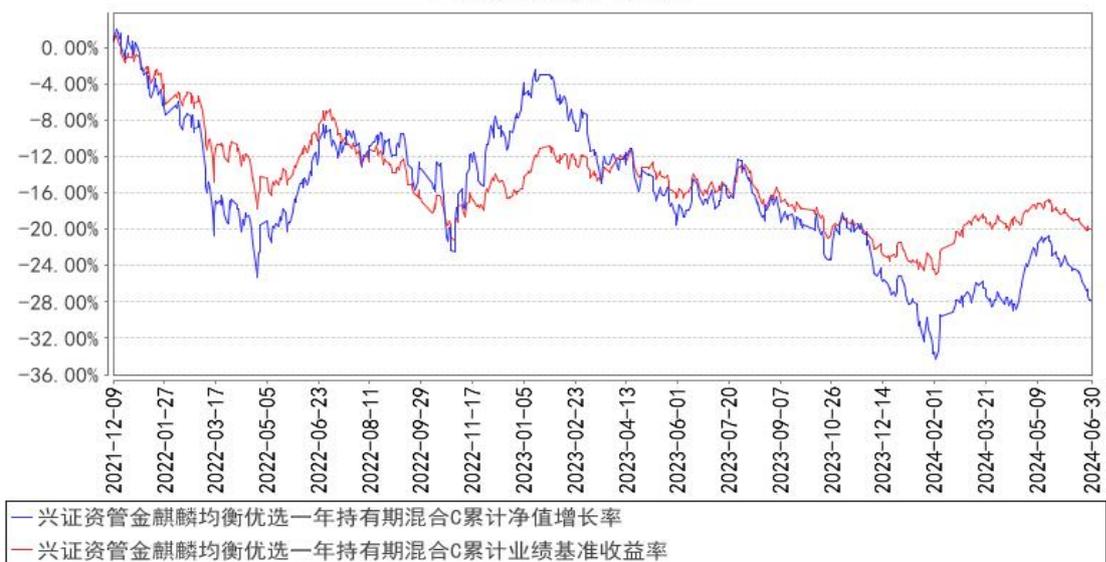
兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2024 年 06 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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	2022年9月16日	-	8年	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

	资经理				业务部公募投资经理。
游臻	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	-	12 年	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、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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定，遵循各项内部风险控制制度和流程，通过系统和人工相结合的方式在各环节严格控制交易的公平执行。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保各投资组合之间得到公平对待，切实防范利益输送行为，保护投资者合法权益。

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2024 年第二季度，A 股市场整体呈现震荡走势，以资源板块为代表的大盘红利股表现相对较好，而中小盘成长方向走势相对较弱。

报告期内，本产品仍坚持优选兼具性价比和资产质地的投资机会，在行业和风格配置上力求更加均衡、更加合理。同时，基于当前港股市场的估值和基本面情况，我们也适当加大了对于部分优质港股的配置力度。

4.5 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 份额净值为 0.7367 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.20%；同期业绩比较基准收益率为-1.13%。兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 B 份额净值为 0.9178 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.20%；同期业绩比较基准收益率为-1.13%。兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合 C 份额净值为 0.7218 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.00%；同期业绩比较基准收益率为-1.13%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	42,809,750.82	82.48
	其中：股票	42,809,750.82	82.48
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	8,116,140.22	15.64
8	其他资产	977,759.46	1.88
9	合计	51,903,650.50	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 13,299,265.72 元，占总资产比例 25.62%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	1,495,220.80	2.96
B	采矿业	-	-
C	制造业	20,266,310.30	40.11
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	-	-
J	金融业	1,429,218.00	2.83
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,937,382.00	3.83
M	科学研究和技术服务业	2,895,986.00	5.73
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	1,486,368.00	2.94
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	29,510,485.10	58.41

5.2.2 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（%）
原材料	-	-
非日常生活消费品	2,355,390.40	4.66
日常消费品	-	-
能源	-	-
金融	-	-
医疗保健	489,902.12	0.97
工业	-	-

信息技术	1,961,771.10	3.88
通信服务	2,803,346.74	5.55
公用事业	4,445,153.36	8.80
房地产	1,243,702.00	2.46
合计	13,299,265.72	26.32

注：以上分类采用全球行业标准（GICS）。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300760	迈瑞医疗	12,400	3,607,284.00	7.14
2	00700	腾讯控股	8,248	2,803,346.74	5.55
3	002311	海大集团	53,200	2,503,060.00	4.95
4	03690	美团-W	23,229	2,355,390.40	4.66
5	600298	安琪酵母	79,100	2,209,263.00	4.37
6	300661	圣邦股份	24,900	2,061,222.00	4.08
7	03800	协鑫科技	1,853,000	1,961,771.10	3.88
8	002027	分众传媒	319,700	1,937,382.00	3.83
9	300347	泰格医药	33,900	1,647,540.00	3.26
10	600519	贵州茅台	1,100	1,614,129.00	3.19

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 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。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

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

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	9,434.82
2	应收证券清算款	847,808.20
3	应收股利	120,377.83
4	应收利息	-
5	应收申购款	138.61
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	977,759.46
---	----	------------

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 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
报告期期初基金份额总额	35,782,251.12	24,762,366.60	3,530,176.33
报告期期间基金总申购份额	27,336.46	-	1,567.74
减：报告期期间基金总赎回份额	41,176.52	1,182,407.39	24,312.59
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	35,768,411.06	23,579,959.21	3,507,431.48

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	6,905,232.87
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	6,905,232.87
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	10.99

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本集合计划管理人不存在申购、赎回或交易本集合计划的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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计划份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

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

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§9 备查文件目录

9.1 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。

9.2 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）

9.3 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

2024 年 7 月 19 日