

兴证资管玉麒麟2号  
集合资产管理计划  
2024年第2季度资产管理报告  
(2024年4月1日-2024年6月30日)

资产管理人：兴证证券资产管理有限公司  
资产托管人：兴业银行股份有限公司  
报告送出日期：2024年7月19日

## 一、重要提示

本报告依据《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》（以下简称“管理办法”）、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》（以下简称“运作管理规定”）、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》（以下简称“指导意见”）及其他有关规定制作。

本报告并非宣传推介材料，所载内容仅供本集合计划客户参考。任何人不得对本报告进行任何形式的发布、复制或删改，否则将构成侵权。

管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用本集合计划资产，但不保证本集合计划一定盈利，也不保证最低收益。本计划的过往业绩及净值高低并不预示其未来业绩表现，管理人管理的其他资产的业绩也不构成本计划业绩表现的保证。

管理人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。

本报告未经审计，本报告书中的内容由管理人负责解释。

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

## 二、集合计划产品概况

**产品名称：**兴证资管玉麒麟 2 号集合资产管理计划（原“兴证资管玉麒麟 2 号消费升级集合资产管理计划”）

**简称：**兴证资管玉麒麟 2 号

**产品类型：**集合资产管理计划

**计划运作方式：**开放式

**投资目标：**管理人应当在合同约定的投资范围内，力争为投资者谋求投资回报。

**投资策略：**

### 1、资产配置策略

在具体的资产配置过程中，本计划将根据风险程度和收益特征，决定本计划资产在权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品等金融资产上的分布，在可控下行风险下，力争实

现计划资产的收益。

## 2、股票投资策略

本集合计划将专注于精选优质成长型企业，通过长期持有高回报资产的方式，争取为客户带来良好的长期收益并创造有市场竞争力的风险收益比。

本集合计划运作期间将精选具备行业定价权的优势企业，同时高度关注企业的内生增长动力、自由现金流与长期护城河。在行业和个股配置上，本产品将以自下而上的选股方法为主导，偏重选择大消费、医疗健康、科技、高端制造、现代服务等行业的高回报龙头型公司。在组合构成上，本产品注重行业和个股的均衡配置，力求在追求适当收益预期的前提下降低持有个股之间的相关性。

## 3、新股申购策略

本计划深入研究股票一级市场申购的投资机会，选择具有成长优势的股票进行投资，追求计划资产的投资回报。

## 4、债券投资策略

### （1）债券类属配置策略

根据国债、企业债等不同债券板块之间的相对投资价值分析，增持价值被相对低估的债券板块，减持价值被相对高估的债券板块，借以取得较高收益。

### （2）信用债投资策略

信用债券收益率是与其具有相同期限的无风险收益率和反映信用风险收益的信用利差之和。基准收益率主要受宏观经济环境的影响，信用利差收益率主要受对应的信用利差曲线以及该信用债券本身的信用变化的影响，因此本计划主要采用持有到期策略，并结合信用利差曲线变化的策略。

#### ① 持有到期策略

本计划主要配置期限在一年以内的短期融资券、公司债、企业债等品种，采用持有到期策略。

本计划在采用持有到期策略为主的前提下重点跟踪所持债券品种的信用状况，依靠内部信用评级系统持续跟踪研究发债主体的经营状况、财务指标等情况，对其信用风险进行评估并作出及时反应。

为了准确评估发债主体的信用风险，本计划设计了定性和定量相结合的内部信用评级体系。内部信用评级体系遵循从“行业风险”—“公司风险”（包括公司背景、公司行业地位、企业盈利模式、公司治理结构和信息披露状况及企业财务状况）—“外部支持”（外部流动性支持能力及债券担保增信）—“得到评分”的评级过程。其中，定量分析主要是指对企业财务数据的定量分析，主要包括四个方面：盈利能力分析、偿债能力分析、现金流获取能力分析、营运能力分析。定性分析包括所有非定量信息的分析和研究，它是对定量分析的重要补充，能够有效提高定量分析的准确性。本计划内部的信用评级体系定位为即期评级，侧重于评级

的准确性，从而为信用产品的实时交易提供参考。本计划会对宏观、行业、公司自身信用状况的变化和趋势进行跟踪，发掘相对价值被低估的债券，以便及时有效地抓住信用债券本身信用变化带来的市场交易机会。

本计划将根据信用债券市场的收益率水平，在综合考虑信用等级、期限、流动性、息票率、提前偿还和赎回等因素的基础上，建立收益率曲线预测模型和信用利差曲线预测模型，并通过这些模型进行估值，重点选择具备以下特征的信用债券：较高到期收益率、预期信用质量将改善以及价值尚未被市场充分发现的个券。

### ② 基于信用利差曲线变化的策略

本计划将从以下两方面分析信用利差的变化情况，并采取相应的投资策略：

宏观经济环境对信用利差的影响：当宏观经济向好时，信用利差可能由于发债主体盈利能力改善而收窄；反之，信用利差可能扩大。本计划将根据宏观经济的变化情况，加大对信用利差收窄的债券的投资比例。

市场供求关系对信用利差的影响：信用债券的发行利率、企业的融资需求等都将影响债券的供给，而政策的变化、其他类属资产的收益率等也将影响投资者对信用债券的需求，从而对信用利差产生影响。本计划将综合分析信用债券市场容量、市场形势预期、流动性等因素，在具有不同信用利差的品种间进行动态调整。

### (3) 利率策略

本计划将通过全面研究和分析宏观经济运行情况和金融市场资金供求状况变化趋势及结构，结合对财政政策、货币政策等宏观经济政策取向的研判，从而预测出金融市场利率水平变动趋势。在此基础上，结合期限利差与凸度综合分析，制定出具体的利率策略。

#### ① 期限配置策略

根据对流动性的要求、市场收益率的波动情况决定采用子弹型策略(Bullet Strategy)、哑铃型策略(Barbell Strategy)或梯形策略(Stair Strategy)，在各期限债券间进行配置。

期限配置尽量选择在预期市场利率的高点或流动性需求较大的时点到期的债券，以减少因流动性不足导致的可能损失。通过分析不同期限债券的收益率绝对差额和相对差额，利用均值回归策略或收益率差额预期策略选择合适期限品种投资。

#### ② 久期偏离策略

根据对利率水平的预期，在预期利率下降时，增加组合久期，以较多地获得债券价格上升带来的收益，在预期利率上升时，减小组合久期，以规避债券价格下降的风险。管理人对债券市场收益率变动具有较高把握的预期的情况下，交易头寸投资过程中可以主动采用久期偏离策略，使组合久期较为明显的偏离基准。

#### ③ 收益率曲线策略

在确定组合或类属久期后，进一步确定同一债券发行者不同期限债券的相对价值。确定采用哑铃型策略、梯形策略和子弹型策略等，在长期、中期和短期债券间进行配置，以从其

相对价格变化中获利。

#### （4）资产支持证券投资策略

基于对发行主体和资产支持证券风险收益特征的考察，通过对抵押的资产质量和现金流特征的研究，分析资产支持证券可能出现的提前偿付比例和违约率，选择具有投资价值的资产支持证券投资。本计划将会严格控制资产支持证券的投资比例，并且分散投资。

#### （5）跨市场套利交易策略

在法律法规和监管机构许可的条件下，积极运用跨市场套利交易策略，提高组合收益。根据中国债券市场分割的现状，发现交易所市场与银行间市场可跨市交易的相同品种收益率的差异，通过在交易所市场和银行间市场买卖同时在两市托管的债券，或者在两市之间买卖到期期限相同但收益率不同的债券，可以获取二者之间可能存在的差价。

#### （6）可交换债券投资策略

管理人将积极把握新上市可交换债券的申购收益、二级市场的波段机会以及偏股型和平衡型可交换债的战略结构性投资机遇，适度把握可交换债券回售、赎回、修正相关条款博弈变化所带来的投资机会及套利机会，选择最具吸引力标的进行配置。

#### （7）可转换债券投资策略

由于可转换债券兼具债性和股性，其投资风险和收益介于股票和债券之间，可转换债券通过分析不同市场环境下其股性和债性的相对价值，把握可转换债券的价值走向，选择相应券种，从而获取较高投资收益。本集合计划将选择公司基本面优良、具有较高上涨潜力的可转换债券进行投资，以合理价格买入并持有。

### 5、现金类资产投资策略

本集合计划将在确定总体流动性要求的基础上，结合不同类型货币市场工具的流动性、预期收益水平及期限等因素来确定现金类资产的配置，并定期对现金类资产组合平均剩余期限以及投资品种比例进行适当调整。

### 6、资产管理产品投资策略

本集合计划将从研究基金价值入手，结合定性分析与定量分析，选择业绩优良、管理规范基金管理公司旗下的优秀基金品种。本计划可能通过资产管理产品间接投资于境外权益类资产、固定收益类资产、期货和衍生品类资产（含黄金现货合约、白银期货合约、原油期货等）。

对于 QDII 基金，本集合计划通过自上而下的海外市场配置、行业配置以及自下而上的定价择券相结合的主动投资策略，在严格控制风险的同时，追求为投资者提高分红收益和长期资本增值。

在商品基金选择上，重点选择具备有效抵御通胀，与其他资产的相关度低的基金。

### 7、衍生品投资策略

本集合计划参与股指期货交易的目的以对冲风险为主，管理人可通过构建“现货多头+

股指期货空头”力争对冲权益类资产市值下跌的风险。

上述投资策略为管理人主要运用的投资策略，本集合计划投资策略包括但不限于上述策略。投资经理可在本集合计划投资范围内，根据市场变动及自主判断采用其他投资策略。

#### 资产管理计划费用的计提标准、计提方式与支付方式：

##### （一）资产管理人的固定管理费

在通常情况下，资产管理计划管理费按前一日资产管理计划资产净值的 1.0% 年费率计提，成立日当日按照成立规模计提管理费。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年管理费率为 1.0%

H 为每日应计提的资产管理计划管理费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划管理费自计划成立日起，每日计提，按季支付。由资产管理人每季末向资产托管人发送资产管理计划管理费划付指令，经资产托管人复核后于下一季度首日起 3 个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产管理人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。

##### （二）资产托管人的托管费

在通常情况下，资产管理计划托管费按前一日资产管理计划资产净值的 0.02% 年费率计提，成立日当日按照成立规模计提托管费。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本资产管理计划年托管费率为 0.02%

H 为每日应计提的资产管理计划托管费

E 为前一日资产管理计划资产净值

资产管理计划托管费自计划成立日起，每日计提，按季支付。由资产管理人每季末向资产托管人发送资产管理计划托管费划付指令，经资产托管人复核后于下一季度首日起 3 个工作日内从资产管理计划财产中一次性支付给资产托管人，若遇法定节假日、休息日，支付日期顺延。管理人在约定的托管费支付日未向托管人发送托管费划付指令的，托管人有权在托管费支付日当日或后续任一日自行扣收全部或部分应付未付托管费。费用自动划扣后，托管人应向管理人告知托管费支付金额及计算方式，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

##### （三）业绩报酬（浮动管理费）

业绩报酬计提日：本计划的业绩报酬计提日为分红日、投资者退出日和计划终止日。

本集合计划业绩报酬计提基准为 8%。

在业绩报酬计提日，若投资者在该期内的实际年化收益率 S 小于或等于业绩报酬计提基准 8%，管理人不计提业绩报酬；若在该期内的实际年化收益率 S 大于业绩报酬计提基准 8%，管理人将对超过部分收益的 20% 计提业绩报酬，剩余部分归投资者所有。

业绩报酬计算方法如下：

本期实际年化收益率 S	计提比例
$S \leq 8\%$	0
$S > 8\%$	20%

业绩报酬计提办法：

$$S = \frac{(C'' - C')}{C} \times \frac{365}{D}$$

$$H = Q \times C \times (S - \mathbf{【8】\%}) \times \frac{D}{365} \times 20\%$$

其中：

$C''$ ：在业绩报酬计提日的累计单位净值；

$C'$ ：为上一个业绩报酬计提日（实际提取到业绩报酬的日期）本集合计划的累计单位净值（首次业绩报酬分配时，该净值为产品投资者参与确认日单位净值）；

$C$ ：为上一个业绩报酬计提日（实际提取到业绩报酬的日期）本集合计划的单位净值（首次业绩报酬分配时，该净值为产品投资者参与确认日单位净值）；

$D$ ：为本次计提业绩报酬区间天数，即该投资者上一个业绩报酬计提日（实际提取到业绩报酬的日期）至本次业绩报酬计提日的间隔天数；

$H$ ：业绩报酬计提日管理人应计提的业绩报酬；

$Q$ ：业绩报酬计提日投资者退出份额数或计划分红、终止时持有份额总数；

本集合计划在分红日计提业绩报酬的，业绩报酬金额上限为分红金额；即若按照上述公式计算的业绩报酬金额大于该次分红金额的，该次业绩报酬金额以分红金额为限，超出部分管理人予以免收。

从分红资金中提取业绩报酬的频率不超过每6个月一次。

业绩报酬的支付，由托管人根据管理人发送的业绩报酬划付指令于5个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人，若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至最近可支付日支付。

由于涉及注册登记数据，业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成。

业绩报酬计提基准不是预期收益或者保证收益率，不构成管理人、销售机构、托管人对受托财产收益状况的任何承诺和担保，投资者仍可能面临投资收益甚至本金受损的风险。

#### （四）税收

本合同各方当事人应根据国家法律法规规定，履行纳税义务。投资者应缴纳的税收由投资者负责，管理人不承担代扣代缴或纳税的义务。

为免歧义，各方特别约定并优先使用如下条款：本合同各方特别约定，如依据相关法律法规或财政税务主管部门的规定，就本计划投资运营过程中发生的增值税应税行为及其他应税行为，管理人需要承担相应纳税义务的，该税费由计划财产承担，管理人有权以计划财产予以缴纳，且无需事先征得投资者的同意（除本约定外，本计划已列明的资产管理业务费用产生的税费由各收款方自行缴纳的，相关方应自行缴纳）；管理人在向投资者交付利益或资产后税务机关要求管理人缴纳相关税费的，投资者应按照管理人通知要求缴纳相应税费（具体以管理人通知为准），管理人亦有权以计划剩余财产直接缴纳；投资者不得要求管理人以任何方式向其返还或补偿该等税费。如管理人因此垫付相应税费等款项的，管理人有权向投资者追索垫付的税费和孳息款项，投资者应按管理人通知向管理人指定账户返还垫付款。投资者已知悉并同意，计划财产承担上述税费可能导致资产变现损失或投资收益减损。

#### （五）其他费用的支付

资产管理计划银行账户发生的银行结算费用等银行费用，由托管人直接从资金账户中扣划，无须管理人出具指令。

资产管理计划运作期间投资所发生的交易手续费、印花税等有关证券交易税费，作为交易成本直接扣除。

资产管理计划存续期间发生的信息披露费、与资产管理计划相关的律师费和会计师费、以及按照国家有关规定可以列入的其他费用等，由托管人根据有关法规及相应协议的规定，根据管理人的指令，按费用实际支出金额从资产管理计划资产中支付，列入资产管理计划费用。

#### （六）不得列入资产管理计划财产费用的项目

资产管理计划成立前发生的费用，以及存续期间发生的与募集有关的费用，不得在计划资产中列支。

管理人和托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或资产管理计划财产的损失，以及处理与资产管理计划财产运作无关事项或不合理事项所发生的费用等不得列入资产管理计划的费用。

#### （七）费率的调整

管理人可以调减管理费率，并在新的管理费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。管理人、托管人可以协商调减托管费率，并在新的托管费率开始实施前在管理人网站公告并发送至托管人。



**风险收益特征：**根据《证券期货投资者适当性管理办法》、《证券经营机构投资者适当性管理实施指引（试行）》，经由管理人审慎评估，本计划的产品风险等级为 R4，仅适合向合格投资者中的专业投资者及风险承受能力等级为 C4 及高于 C4 的普通投资者推广<sup>1</sup>，具体以销售机构确认的风险等级为准。投资者承诺并确认自身风险承受能力符合本计划要求，自愿承担参与本计划投资所产生的全部风险。

**合同生效日、成立日期：**2011 年 6 月 3 日

**成立规模：**272,117,197.56

**存续期：**20 年，可展期

**管理人：**兴证证券资产管理有限公司

**托管人：**兴业银行股份有限公司

### 三、主要财务指标和集合计划净值表现

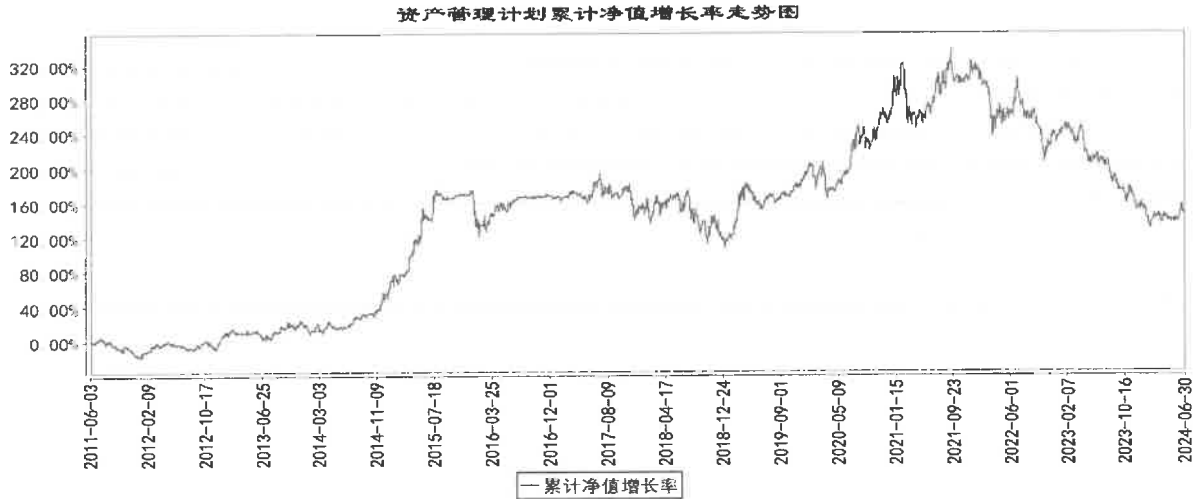
#### （一）主要财务指标

单位：人民币元

序号	主要财务指标	2024 年 4 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日
1	本期利润	122,914.72
2	本期利润扣减本期公允价值变动损益后的净额	137,982.41
3	加权平均计划份额本期利润	0.0572
4	期末集合计划资产净值	4,646,124.69
5	可供分配利润	2,693,187.49
6	期末单位集合计划资产净值	2.3790
7	期末累计单位集合计划资产净值	2.4900
8	本期单位净值增长率	3.79%

<sup>1</sup>根据《兴证证券资产管理有限公司私募资产管理计划风险等级评价实施细则》，产品风险等级 R4 对应的产品风险特征为中高风险。投资者认/申购产品的风险等级分类以销售机构的风险等级评价情况为准。

## （二）集合计划净值表现



注：上图净值数据截止日期为2024年06月30日

## 四、集合计划投资经理报告

### （一）投资经理简介

徐骥：权益研究部副总经理、投资经理

上海财经大学经济学博士，专注于全球宏观经济研究及大类资产配置，擅长自上而下挖掘大板块、大行业机会，注重行业轮动以及择时、择仓。曾任开源证券首席经济学家团队海外组组长、资深宏观分析师，团队曾多次获得新财富、水晶球等研究奖项。

### （二）投资经理工作报告

#### 1、2024年第2季度行情回顾及运作分析

2季度，A股和港股走势都整体呈现先扬后抑的形态。5月中旬前，随着外资持续回补人民币资产，以及国内多个行业1季报表现较理想，A股和港股总体保持较好的表现，尤其是港股，在外资和南向资金双双大幅流入的助推下，短短几周内获得较大回升。然而，5月中旬后，市场走势突然出现显著变化。无论是A股、还是港股，都自前期高点持续回落，大部分板块行业同步调整，仅红利及消费电子等少数几个板块维持震荡或有所上行。

本产品于2季度做了较大的持仓调整。5月中旬前，产品的持仓主要聚焦A股和港股的资源板块。不过随着铜、原油等期货价格持续走弱，产品在5月中旬后逐步调出了资源板块。6月开始，面对消费电子及传统半导体板块（成熟制程产业链）出现较为明显的景气复苏，叠加美股相应板块出现较大幅度反弹，本产品大幅增加了消费电子及传统半导体板块的配置，并同步提升了美股相关ETF的仓位。此外，伴随着市场对国内宏观经济的预期逐步趋于一致，本

产品还择机增持了红利类资产，包括电力、煤炭等板块。

总体来看，在5月中旬前，本产品净值表现一般，未能跑赢市场。5月中旬后，受益于及时调仓及增加美股相关ETF的配置，本产品获得了相对不错表现。

本报告期末，本计划投资未运用杠杆；本报告期内，本计划杠杆运用情况符合合同约定。本产品本报告期内未参与股指期货、国债期货投资。

## 2、2024年第3季度展望与投资策略

5月中旬以来，A股和港股走势出现较为明显的变化背后，或与微观层面的高频数据显示国内消费、投资等内需相关需求边际走弱，叠加美国总统大选周期开启、出口预期受到压制等因素有关。往后看，在中央“固本培元”大的政策思路，以及美国、欧盟等经济边际走弱的大背景下，国内经济总体或继续呈现稳健高质的增长态势。

与此同时，美国国内流动性缓解依然较为宽松，AI等核心产业的发展仍然处于快速阶段，苹果公司将AI功能导入至手机，或有可能带动一轮全球范围内的换机潮。而国内电子及传统半导体产业链，或将直接受益于这一换机潮。

结合上述对3季度国内外宏观经济、流动性环境及核心产业链的判断，本产品3季度预计将继续关注A股的红利、消费电子（包括传统半导体产业链），以及美股相关ETF等。此外，考虑到A股的波动较大、部分时期受到非理性因素的影响，本产品或将择机跟随大盘，对配置的A股相关板块进行更加灵活的仓位调整。

## 五、集合计划风险控制报告

### 1、集合计划运作合规性声明

本报告期内，集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》、《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他法律法规的规定，本着诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用本集合计划资产，在严格控制风险的基础上，为集合计划持有人谋求最大利益。本集合计划运作合法合规，无损害集合计划持有人利益的行为，本集合计划的投资管理符合有关法规的规定。

### 2、风险控制报告

本报告期内，集合计划管理人通过独立的合规风控部门，对各项业务风险进行全面的监督、检查和评价。公司专门设有合规风控部，通过系统监控和人工检查相结合的方式，对集

合资产管理计划的投资风险、信用风险、操作风险等进行全面的监督和检查，同时在交易系统中对各类风险指标进行限制，实现交易的事前控制，确保集合资产管理计划合法合规。对日常集合资产管理计划出现的各类问题，合规风控部及时进行风险提示，提出合规管理与风险管理建议，并督促相关部门及时整改。

经过审慎核查，本报告期内，本集合计划的投资决策、投资交易程序、投资权限管理等各方面均符合有关规定要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；本集合计划的投资运作严格按照合同约定及有关外规要求执行；相关的信息披露和财务数据皆真实、完整、准确、及时。集合计划管理人通过动态评估集合计划运作过程中面临的市场风险、信用风险和流动性风险，确保本集合计划运作风险水平与其投资目标相一致。

### 3、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、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。

## 六、集合计划管理人报告

### （一）本报告期集合计划收益分配情况

无。

## （二）集合计划投资组合报告

### 1、报告期末资产组合情况

日期：2024年6月30日

单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占资产管理计划总资产比例（%）
1	权益投资	273,287.15	5.56
	其中：股票	273,287.15	5.56
2	基金投资	3,261,533.30	66.40
3	固定收益投资	138,943.66	2.83
	其中：债券	138,943.66	2.83
	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	1,123,858.14	22.88
8	其他资产	114,270.71	2.33
9	合计	4,911,892.96	100.00

### 2、报告期末按市值占集合计划资产净值比例大小排序的前十名证券明细

证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	占资产管理计划资产净值比例（%）
513110	纳指100	402,100.00	674,321.70	14.51
159632	纳斯达克	398,700.00	669,417.30	14.41
513300	华夏纳斯达克100ETF(QDII)	345,100.00	655,344.90	14.11
511090	鹏扬中债-30年期国债ETF	4,700.00	539,287.40	11.61
501225	景顺长城全球半导体芯片股票A(QDII-LOF)(人民币)	331,000.00	468,034.00	10.07
113043	财通转债	1,250.00	138,943.66	2.99
159509	纳指科技	66,600.00	113,952.60	2.45
002594	比亚迪	400.00	100,100.00	2.15
501018	南方原油(QDII-FOF-LOF)	73,100.00	97,149.90	2.09
688347	华虹公司	1,577.00	56,535.45	1.22

### 3、投资组合报告附注

1) 本集合计划本期投资的前十名证券中，不存在报告期内发行主体被监管部门立案调查的，或在报告编制日前一年内受到证监会、证券交易所公开谴责、处罚的证券。

2) 本集合计划投资的前十名证券中，没有投资于超出集合资产管理计划合同规定范围之外的证券。

#### 4、股指期货、国债期货投资情况

无。

### 七、集合计划份额变动情况

期初总份额（份）	期间参与份额（份）	期间退出份额（份）	期末总份额（份）
2,547,975.96	-	595,038.76	1,952,937.20

### 八、重大事项提示

（一）本报告期内，本集合计划的管理人、托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员未受到监管部门的任何处罚。

（二）本报告期内无涉及对公司运营管理及本集合计划运作产生重大影响的，与本集合计划管理人、受托财产、托管业务相关的重大诉讼或仲裁事项。

（三）本报告期内，本集合计划未发生合同变更。

（四）本报告期内，本集合计划未发生投资经理变更。

（五）本报告期内，本集合计划投资策略未发生重大改变。

（六）本报告期内，本集合计划未发生自有资金参与或退出。

（七）本报告期内，本集合计划未发生重大关联交易及其他需披露的关联交易事项。

（八）董事、监事、从业人员及其配偶、控股股东、实际控制人或者其他关联方参与情况。

项目	持有份额总数（份）	占总份额比例
报告期末董事、监事、从业人员及其配偶持有本计划份额情况	-	-
报告期末控股股东、实际控制人或者其他关联方持有本计划份额情况	-	-

（九）其他涉及投资者利益的重大事项

## 九、托管人履职报告

本托管人依据与兴证证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）签订的集合计划的合同、托管协议以及集合计划说明书，托管了管理人发行的本集合资产管理计划的资产。

报告期内，本托管人严格遵守《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》、《证券期货经营机构私募资产管理计划运作管理规定》及其他有关法律法规、本集合计划合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了托管人义务，不存在损害本集合计划委托人利益的行为。

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、各集合计划合同和托管协议的规定，对管理人在本集合计划的投资运作、资产净值的计算、收益的计算、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委托人利益的行为。

本托管人认真复核了本报告期内本集合资产管理计划资产管理报告中的财务指标、净值表现、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。

## 十、备查文件目录

### （一）本集合计划备查文件目录

- 1、中国证监会关于兴业证券股份有限公司“兴业证券玉麒麟2号消费升级集合资产管理计划”设立的批复；
- 2、“兴业证券玉麒麟2号消费升级集合资产管理计划”验资报告；
- 3、关于“兴业证券玉麒麟2号消费升级集合资产管理计划”成立的公告；
- 4、“兴证资管玉麒麟2号集合资产管理计划”计划说明书；
- 5、“兴证资管玉麒麟2号集合资产管理计划”托管协议；
- 6、管理人业务资格批件、营业执照；
- 7、管理人法人主体形式变更的公告；
- 8、关于产品合同变更的公告；
- 9、关于变更投资经理的公告。

## （二）存放地点及查阅方式

文件存放地点：上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦9楼

网址：[www.ixzzcgl.com](http://www.ixzzcgl.com)

联系人：高丹丹

服务电话：95562-3

EMAIL：[zcgl@xyzq.com.cn](mailto:zcgl@xyzq.com.cn)

投资者对本报告书如有任何疑问，可咨询管理人兴证证券资产管理有限公司。

兴证证券资产管理有限公司

2024年7月19日

