

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
2024 年中期报告

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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2024 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独立董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国农业银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2024 年 8 月 28 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 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	42
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	42

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	42
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	42
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	42
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	42
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	42
7.12 本报告期投资基金情况	43
7.13 投资组合报告附注	47
§ 8 基金份额持有人信息	48
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	48
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	48
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情况	48
§ 9 开放式基金份额变动	49
§ 10 重大事件揭示	49
10.1 基金份额持有人大会决议	49
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	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	49
10.4 基金投资策略的改变	49
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	49
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	50
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	50
10.9 其他重大事件	51
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	51
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	51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	52
§ 12 备查文件目录	52
12.1 备查文件目录	52
12.2 存放地点	52
12.3 查阅方式	52

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	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	
基金简称	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)	
基金主代码	970194	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 9 月 5 日	
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	115,831,812.55 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, 后续按照中国证监会有关规定执行。	
下属分级基金的基 金简称	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) C
下属分级基金的交 易代码	970194	970195
报告期末下属分级 基金的份额总额	90,191,910.06 份	25,639,902.49 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 3 号优选基金组合集合资产管理计划进行了规范, 并在收到中国证监会关于准予兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》已于 2022 年 9 月 5 日生效, “兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划” 正式更名为 “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” (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 3 个月。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 (含该日), 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 3 个月后的对日的前一个工作日, 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。

3、投资者依据原《兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划份额, 自 2022 年 9 月 5 日起全部自动转换为 “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” A 类份额, 其持有期限自原兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算, 该部分投资者仍可通过原 “兴业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划” 的销售机构自 2022 年 9 月 6 日起办理前述份额的赎回业务。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在有效控制组合风险的前提下, 通过优选基金积极把握
------	--------------------------------

	基金市场的投资机会，力求实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资策略	本集合计划坚持自上而下为主、自下而上为辅，把握“一个中心、四个基本点”，即以大类资产配置为中心的β性机会，以风格配置、行业配置、基金筛选、辅助业绩增厚为四个基本点的α性机会，互为支撑的投资策略。从战略层面和战术层面动态调整配置组合，贯彻全流程风控合规的稳健投资理念。主要策略包括大类资产配置策略（β性机会）、市场风格策略（α机会）、行业配置策略（α机会）、基金筛选策略（α机会）和辅助业绩增厚策略（α机会）。其中，基金筛选策略（α机会）主要聚焦在选择基金的α机会，拟结合基金覆盖与研究范围，通过对产品业绩、投研能力、风险控制等指标定量与定性分析相结合，优选基金赚取α收益。对于基金进行业绩指标、业绩归因、综合调研等定量定性结合研究，结合公司基金池制度，动态跟踪基金市场变化，定期调整。
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×70%+中债-综合全价（总值）指数收益率×25%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本集合计划是混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		兴证证券资产管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	付志坚	任航
	联系电话	021-38565866	010-66060069
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95562-3	95599
传真		021-38565863	010-68121816
注册地址		福建省平潭县金井镇天山北路3号金井湾商务营运中心6栋15层110室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		上海市浦东新区长柳路36号兴业证券大厦9层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		200135	100031
法定代表人		孙国雄	谷澍

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.ixzcg1.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

3.1.1 期间数 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)C
本期已实现收益	-8,014,408.62	-2,286,179.58
本期利润	-4,899,835.99	-1,437,702.39
加权平均基金份 额本期利润	-0.0519	-0.0539
本期加权平均净 值利润率	-6.28%	-6.54%
本期基金份额净 值增长率	-5.86%	-6.08%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-16,331,794.41	-4,733,472.61
期末可供分配基 金份额利润	-0.1811	-0.1846
期末基金资产净 值	73,860,115.65	20,906,429.88
期末基金份额净 值	0.8189	0.8154
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净 值增长率	-18.11%	-18.46%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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 3 个月 (FOF) A

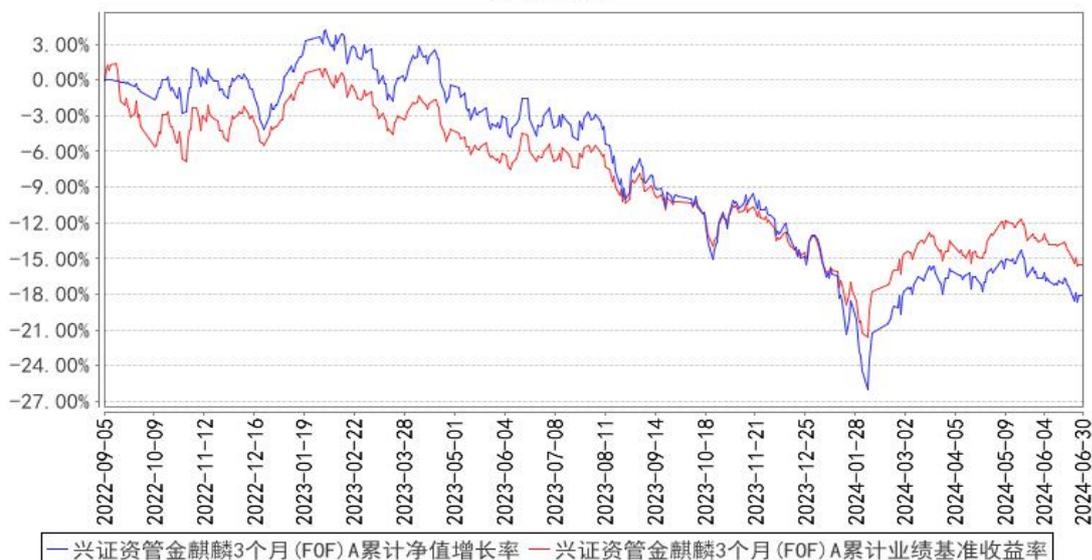
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.73%	0.55%	-2.44%	0.42%	0.71%	0.13%
过去三个月	-1.69%	0.61%	-1.56%	0.57%	-0.13%	0.04%
过去六个月	-5.86%	0.92%	-3.13%	0.78%	-2.73%	0.14%
过去一年	-15.56%	0.83%	-10.47%	0.68%	-5.09%	0.15%
自基金合同生效起至今	-18.11%	0.74%	-15.52%	0.66%	-2.59%	0.08%

兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) C

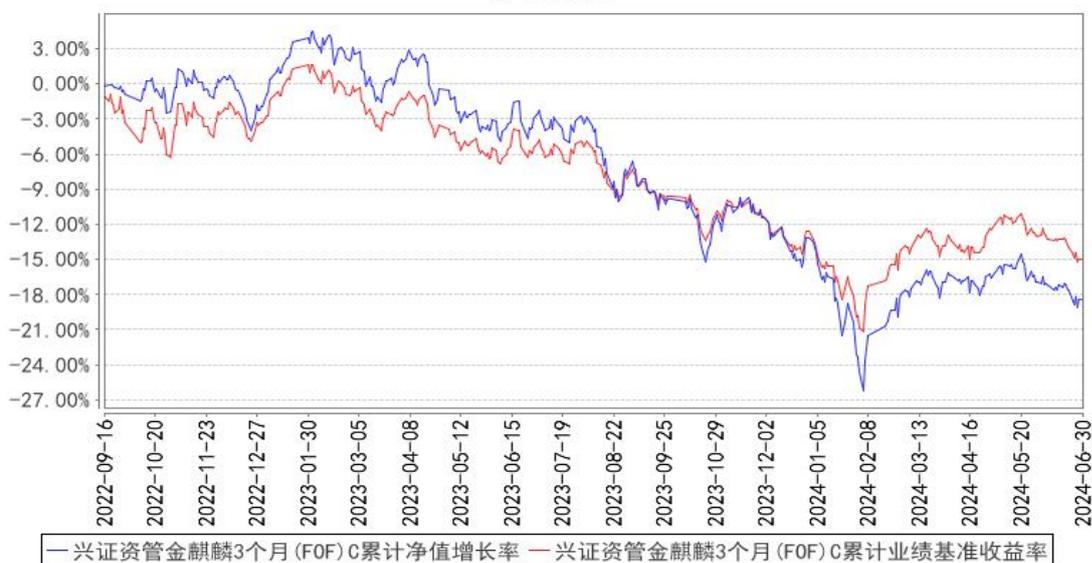
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-1.77%	0.55%	-2.44%	0.42%	0.67%	0.13%
过去三个月	-1.79%	0.61%	-1.56%	0.57%	-0.23%	0.04%
过去六个月	-6.08%	0.92%	-3.13%	0.78%	-2.95%	0.14%
过去一年	-15.96%	0.83%	-10.47%	0.68%	-5.49%	0.15%
自基金合同生效起至今	-18.46%	0.75%	-15.01%	0.66%	-3.45%	0.09%

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

兴证资管金麒麟3个月 (FOF) 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3个月 (FOF) 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。目前公司经营范围为证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。

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 2024 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		
王德伦	兴证证券资产管理有限公司首席经济学家、总裁助理、资产配置总监、公募投资经理	2022 年 9 月 6 日	-	13 年	北京大学硕士。2011 年 7 月进入金融行业，历任申银万国证券研究所分析师、国泰君安证券研究所分析师、兴业证券研究所首席策略分析师、兴业证券策略研究中心总经理、兴业证券经济与金融研究院院长助理。2021 年 6 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任公司首席经济学家、总裁助理、公募组合投资部总经理、固收研究部总经理、公募业务部公募组合投资处总经理。现任公司首席经济学家、总裁助理、资产配置总监、公募投资经理。
斯苑蓓	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 5 日	-	7 年	FRM，哥伦比亚大学金融数学硕士。2017 年 7 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任研究部研究员、创新投资部投资经理、公募组合投资部投资经理。现任公募业务部公募投资经理。
王诗韵	兴证证券资产管理有限公司	2023 年 3 月 14 日	2024 年 4 月 24 日	3 年	王诗韵，复旦大学金融学硕士，2018 年进

	有限公司 公募业务 部公募投 资经理助 理				入金融行业，曾任中国工商银行权益投资经理。2021 年 10 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任大类资产配置部基金评价、大类资产配置部投资经理助理、公募业务部公募投资经理助理。现任固收研究部研究员。
--	-----------------------------------	--	--	--	--

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。

4.1.3 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，各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，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行，各组合享有平等的交易权利。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。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。公司对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估，未发现违反公平交易制度的异常行为。

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

2024 年上半年，权益市场整体呈现出震荡的走势，年初基本面预期偏弱叠加赚钱效应较差，市场缺少有效增量资金，大盘震荡下行，春节前上证指数迅速跌破 2700 点，节后，在政策呵护下，A 股市场强势反弹至 5 月下旬，上证指数收复 3174 点，随后开始回调。上半年来看，宽基指数表现分化较大，红利、大盘风格占优；截至 6 月 30 日，上证 50 指数上涨 2.95%，红利指数上涨 11.29%，而中证 500 指数下跌-8.96%，创业板指下跌-10.99%，中证 1000 指数下跌-16.84%，万得微盘股指数下跌-25.44%。行业板块来看，中信一级行业中，涨幅居前的板块为银行(19.19%)、煤炭(12.79%)、石油石化(11.36%)，跌幅居前的板块为综合(-37.10%)、消费者服务(-23.82%)、计算机(-21.62%)。

产品方面，年初的市场环境对组合风险管理以及策略调整形成了不小的挑战，虽然我们在市场调整初期略降了一些权益仓位，并减少组合在部分拥挤度偏高板块的暴露，但前期配置的量化选股策略类产品回撤较大，对组合形成明显影响，为了规避组合净值进一步大幅回调，我们做了部分止损操作，但也错过了一定在市场反弹中净值修复的机会。节后，市场情绪明显好转，我们迅速作出积极应对，增加了对红利类资产和上游资源等板块的配置。同时对传媒、通信等细分板块进行了波段交易，获得了一定的收益。在一季度末二季度初，我们增配了多重因素催化的 TMT 板块，性价比较高的港股仓位，估值较低的新能源板块，以及全球视野多资产策略下的 QDII 基金和黄金 ETF。产品持有的红利类和贵金属类资产在上半年给产品带来了一定的收益。我们在低点对港股的增配也对净值产生了一定的贡献。TMT 板块和新能源板块在我们配置后确有反弹的窗口，但在二季度没有形成持续的态势，我们没有把握好最佳的止盈时点，导致在 6 月的回调过程中，该部分持仓对产品造成了一定的影响。另外，全球视野多资产策略下的 QDII 基金和黄金 ETF 在分散组合风险的同时也创造了一定的收益。

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 3 个月 (FOF)A 份额净值为 0.8189 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-5.86%；同期业绩比较基准收益率为-3.13%。兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)C 份额净值为 0.8154 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-6.08%；同期业绩比较基准收益率为-3.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来,截至 7 月末,上证综指已经低于 2900,我们认为谨慎的预期大部分已被市场计价,未来或维持震荡格局直至反弹到来,风格方面,下半年可能将持续进行行业轮动,把握各个板块轮替及止盈的时点和价位,或将是下半年操作的重点,后续我们将密切跟踪市场变化,积极关注市场机会,并不断优化风险控制以及组合管理的框架,力争为持有人获取更稳健的回报。

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末未进行利润分配,符合相关法规及本集合计划合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本集合计划的过程中,本集合计划托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及集合计划合同、托管协议的约定,对本集合计划管理人—兴证证券资产管理有限公司 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日集合计划的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,没有从事任何损害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

本托管人认为,兴证证券资产管理有限公司在本集合计划的投资运作、集合计划资产净值的

计算、集合计划份额申购赎回价格的计算、集合计划费用开支及利润分配等问题上，不存在损害集合计划份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》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

本托管人认为，兴证证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，集合计划管理人所编制和披露的本集合计划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、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害集合计划持有人利益的行为。

§ 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 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,831,135.46	7,305,844.84
结算备付金		46,885.57	2,728.49
存出保证金		18,660.32	8,016.56
交易性金融资产	6.4.7.2	88,085,215.29	102,706,860.68
其中：股票投资		-	-
基金投资		88,085,215.29	102,706,860.68
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		-	-
应收申购款		10.00	-

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		94,981,906.64	110,023,450.57
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023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		-	-
应付赎回款		10,442.13	72,986.84
应付管理人报酬		63,059.96	74,632.98
应付托管费		7,282.65	9,054.31
应付销售服务费		7,001.32	26,050.05
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	127,575.05	348,675.66
负债合计		215,361.11	531,399.84
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	115,831,812.55	125,921,480.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-21,065,267.02	-16,429,429.74
净资产合计		94,766,545.53	109,492,050.73
负债和净资产总计		94,981,906.64	110,023,450.57

注：报告截止日2024年06月30日，兴证资管金麒麟3个月(FOF)A集合计划份额净值0.8189元，份额总额90,191,910.06份；兴证资管金麒麟3个月(FOF)C集合计划份额净值0.8154元，份额总额25,639,902.49份。

6.2 利润表

会计主体：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

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年1月1日至2024 年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年6月30日
一、营业总收入		-5,749,901.51	3,085,032.64
1. 利息收入		35,013.12	46,580.62
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,013.12	46,580.62
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		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		-9,747,984.50	-1,090,404.34
其中: 股票投资收益	6.4.7.14	-	-
基金投资收益	6.4.7.15	-9,820,525.57	-1,456,142.89
债券投资收益	6.4.7.16	-	-
资产支持证券投资	6.4.7.17	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.18	-	-
衍生工具收益	6.4.7.19	-	-
股利收益	6.4.7.20	72,541.07	365,738.55
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)	6.4.7.21	3,963,049.82	4,057,957.19
4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.22	20.05	70,899.17
减: 二、营业总支出		587,636.87	926,962.24
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	397,614.68	644,505.92
其中: 暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	46,481.83	73,122.31
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	43,716.16	90,517.18
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	6.4.7.24	-	-
7. 税金及附加		-	3,286.67
8. 其他费用	6.4.7.25	99,824.20	115,530.16
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-6,337,538.38	2,158,070.40
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-6,337,538.38	2,158,070.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-

六、综合收益总额		-6,337,538.38	2,158,070.40
----------	--	---------------	--------------

6.3 净资产变动表

会计主体：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

本报告期：2024年1月1日至2024年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024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	125,921,480.47	-	-16,429,429.74	109,492,050.73
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	125,921,480.47	-	-16,429,429.74	109,492,050.73
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-10,089,667.92	-	-4,635,837.28	-14,725,505.20
(一)、综合收益总额	-	-	-6,337,538.38	-6,337,538.38
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-10,089,667.92	-	1,701,701.10	-8,387,966.82
其中：1.基金申购款	164,081.37	-	-28,872.59	135,208.78
2.基金赎回款	-10,253,749.29	-	1,730,573.69	-8,523,175.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	115,831,812.55	-	-21,065,267.02	94,766,545.53

项目	上年度可比期间 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	239,251,933.56	-	-4,935,116.91	234,316,816.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	239,251,933.56	-	-4,935,116.91	234,316,816.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-105,281,800.83	-	909,136.59	-104,372,664.24
(一)、综合收益总额	-	-	2,158,070.40	2,158,070.40
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-105,281,800.83	-	-1,248,933.81	-106,530,734.64
其中：1. 基金申购款	542,518.96	-	11,920.94	554,439.90
2. 基金赎回款	-105,824,319.79	-	-1,260,854.75	-107,085,174.54
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	133,970,132.73	-	-4,025,980.32	129,944,152.41

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

徐翔

吴勇滨

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3个月持有期混合型基金中基金(FOF)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3号优选基金组合集合资产管理计划变更而来。

2010年6月4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3号优选基金组合集合资产管理计划的批复》(证监许可〔2010〕784号),兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划设立,自2010年7月12日起向社会公众发行,2010年8月13日结束募集并于2010年8月19日成立。

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3号优选基金组合集合资产管理计划进行了规范,并在收到中国证监会关于准予兴业证券金麒麟3号优选基金组合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3个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》已于2022年9月5日生效,“兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划”正式更名为“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”。

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3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,托管人为中国农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,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、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、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。

如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种,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：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%；本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，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：中证偏股型基金指数收益率×70%+中债-综合全价（总值）指数收益率×25%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合资产管理计划财务报表以持续经营为基础编制。

本集合资产管理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》（以下合称“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

本集合资产管理计划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的要求，真实、完整地反映了本集合资产管理计划 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 1 月 1 日至 2024 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

本集合报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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 会计政策变更的说明

本集合资产管理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

本集合资产管理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

本集合资产管理计划在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

如 6.4.1 集合资产管理计划基本情况所述，本集合资产管理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。本集合资产管理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资产管理计划的有关税收法规颁布，本集合资产管理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。本集合资产管理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)，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。

(b) 本集合资产管理计划进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》(财政部税务总局公告 2023 年第 39 号)，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易所适用的印花税实施减半征收。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，即仅对出让方征收印花税，对受让方不再征税。

(c) 对集合资产管理计划在运营过程中缴纳的增值税，分别按照集合资产管理计划管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税税率、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,831,135.46
等于：本金	6,829,695.75
加：应计利息	1,439.71
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	6,831,135.46

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	-	-	-	-
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	89,167,306.80	-	88,085,215.29	-1,082,091.51
其他	-	-	-	-
合计	89,167,306.80	-	88,085,215.29	-1,082,091.51

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 2024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	43,039.69
其中：交易所市场	43,039.69
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	84,535.36
合计	127,575.05

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟3个月(FOF)A

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
----	----------------------------

	基金份额(份)	账面金额
上年度末	98,267,003.06	98,267,003.06
本期申购	37,181.09	37,181.09
本期赎回(以“-”号填列)	-8,112,274.09	-8,112,274.09
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	90,191,910.06	90,191,910.06

兴证资管金麒麟3个月(FOF)C

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,654,477.41	27,654,477.41
本期申购	126,900.28	126,900.28
本期赎回(以“-”号填列)	-2,141,475.20	-2,141,475.20
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-	-
本期末	25,639,902.49	25,639,902.49

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3个月(FOF)A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,536,207.19	-5,247,627.57	-12,783,834.76
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-7,536,207.19	-5,247,627.57	-12,783,834.76
本期利润	-8,014,408.62	3,114,572.63	-4,899,835.99
本期基金份额交易产生的变动数	1,100,834.24	251,042.10	1,351,876.34
其中：基金申购款	-4,478.41	-2,686.90	-7,165.31
基金赎回款	1,105,312.65	253,729.00	1,359,041.65
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-14,449,781.57	-1,882,012.84	-16,331,794.41

兴证资管金麒麟3个月(FOF)C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2, 225, 479. 12	-1, 420, 115. 86	-3, 645, 594. 98
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-2, 225, 479. 12	-1, 420, 115. 86	-3, 645, 594. 98
本期利润	-2, 286, 179. 58	848, 477. 19	-1, 437, 702. 39
本期基金份额交易产生的变动数	272, 757. 20	77, 067. 56	349, 824. 76
其中：基金申购款	-19, 305. 28	-2, 402. 00	-21, 707. 28
基金赎回款	292, 062. 48	79, 469. 56	371, 532. 04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4, 238, 901. 50	-494, 571. 11	-4, 733, 472. 61

6. 4. 7. 13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	34, 467. 06
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	443. 38
其他	102. 68
合计	35, 013. 12

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 股票投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无股票投资收益。

6. 4. 7. 14. 2 股票投资收益——买卖股票差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益-买卖股票差价收入

6. 4. 7. 14. 3 股票投资收益——证券出借差价收入

本集合计划本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6. 4. 7. 15 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	111, 471, 408. 22
减：卖出/赎回基金成本总额	121, 082, 355. 22
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-

减：交易费用	209,578.57
基金投资收益	-9,820,525.57

6.4.7.16 债券投资收益

6.4.7.16.1 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。

6.4.7.16.2 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-买卖债券差价收入。

6.4.7.16.3 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。

6.4.7.16.4 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。

6.4.7.17 资产支持证券投资收益

6.4.7.17.1 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。

6.4.7.17.2 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。

6.4.7.17.3 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。

6.4.7.17.4 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。

6.4.7.18 贵金属投资收益

6.4.7.18.1 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。

6.4.7.18.2 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。

6.4.7.18.3 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。

6.4.7.18.4 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。

6.4.7.19 衍生工具收益

6.4.7.19.1 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。

6.4.7.19.2 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。

6.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	72,541.07
合计	72,541.07

6.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	3,963,049.82
股票投资	-
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	3,963,049.82
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	3,963,049.82

6.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	20.05
合计	20.05

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

2、本集合计划的转换费由转出集合计划赎回费和集合计划申购补差费构成，其中不低于赎回费部

分的 25% 归入转出集合计划的集合计划资产。

6.4.7.23 持有基金产生的费用

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务费 (元)	5,548.28
当期持有基金产生的应支付管理费 (元)	400,632.68
当期持有基金产生的应支付托管费 (元)	72,671.45

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本集合计划对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

6.4.7.24 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	24,863.02
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行费用	2,109.84
银行间账户维护费	9,300.00
注册登记费	3,879.00
合计	99,824.20

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	集合计划管理人、集合计划销售机构

管”)	
中国农业银行股份有限公司(“农业银行”)	集合计划托管人、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
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
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

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股票交易。

6.4.10.1.2 债券交易

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债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

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债券回购交易。

6.4.10.1.4 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例(%)
兴业证券	87,456,211.15	100.00	58,900,751.40	100.00

6.4.10.1.5 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。

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	83,958.43	100.00	43,039.69	100.00
关联方名称	上年度可比期间 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	56,544.70	100.00	15,990.24	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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费	397,614.68
其中：应支付销售机构的客户维护 费	165,531.43	271,307.40
应支付基金管理人的净管理费	232,083.25	373,198.52

注：管理人不得对本集合计划财产中持有的管理人自身管理的公开募集证券投资基金的部分收取管理费。

本集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值扣除本集合计划财产中持有的管理人自身管理的公开募集证券投资基金部分所对应基金资产净值后的剩余部分（若为负数，则取0）的0.8%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.8\% \div \text{当年天数}$$

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扣除本集合计划财产中持有的管理人自身管理的公开募集证券投资基金部分所对应基金资产净值后的剩余部分（若为负数，则取0）

集合计划管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人复核后于次月前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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,481.83	73,122.31

注：托管人不得对本集合计划财产中持有的托管人自身托管的公开募集证券投资基金的部分收取托管费。

本集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值扣除本集合计划财产中持有的托管人自身托管的公开募集证券投资基金部分所对应基金资产净值后的剩余部分（若为负数，则取 0）的 0.1% 的费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

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扣除本集合计划财产中持有的托管人自身托管的公开募集证券投资基金部分所对应基金资产净值后的剩余部分（若为负数，则取 0）

集合计划托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 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		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 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 3 个月 (FOF)A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)C	合计
兴业证券	-	42,873.32	42,873.32
农业银行	-	747.22	747.22
合计	-	43,620.54	43,620.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	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 3 个月 (FOF)A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF)C	合计
兴业证券	-	88,899.39	88,899.39

农业银行	-	1,345.65	1,345.65
合计	-	90,245.04	90,245.04

注：本集合计划 A 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 0.40%。

计算公式为： $H=E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$

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自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) C
基金合同生效日（2022 年 9 月 5 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	20,123,767.36	-
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	3,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	17,123,767.36	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	14.7833%	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	

	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) C
基金合同生效日 (2022 年 9 月 5 日) 持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	20,123,767.36	-
报告期内申购/买入总份额	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-
减: 报告期内赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	20,123,767.36	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	15.0211%	-

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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
农业银行	6,831,135.46	34,467.06	8,834,092.75	45,703.75

注: 本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人中国农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及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 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。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费 (元)	-	-
当期交易基金产生的赎回费 (元)	-	5,087.79

当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	-	1,541.28
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	-	440.35

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本集合计划对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率和计算方法计算得出。

根据相关法律法规及本集合计划合同的约定，集合计划管理人不得对集合计划财产中持有的自身管理的其他集合计划和公开募集证券投资基金的部分收取管理费，集合计划托管人不得对集合计划财产中持有的自身托管的其他集合计划和公开募集证券投资基金的部分收取托管费。集合计划管理人运用本集合计划财产申购自身管理的其他集合资产管理计划和公开募集证券投资基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不得收取申购费、赎回费（按照相关法规、招募说明书约定应当收取，并记入集合计划财产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用。其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本集合计划管理人从被投资基金收取后返还至本集合计划资产。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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 2024 年 06 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 2024 年 06 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

本集合计划是混合型基金中基金集合资产管理计划，其预期收益和风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）和香港互认基金）、国内依法发行上市的股票（包括主板、科创板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、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、地方政府债及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具，但须符合中国证监会相关规定。本集合计划的投资组合比例为：投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%；本集合计划每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货保证金后，应当保持不低于集合计划资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

本集合计划在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括市场风险、流动性风险及信用风险。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。

6.4.13.2.3 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集合计划份额，另一方面来

自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本集合计划的管理人每日对本集合计划的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本集合计划的管理人在集合计划资产管理合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障集合计划持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划的管理人主要通过限制、跟踪和控制集合计划投资于流动性受限资产来实现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划每份计划份额的最短持有期限为 3 个月。对于每份集合计划份额，最短持有期指集合计划合同生效日（对认购份额而言，下同）或集合计划份额申购确认日（对申购份额而言，下同）起（即最短持有期起始日），至集合计划合同生效日或集合计划份额申购申请日起满 3 个月后的下一工作日（即最短持有期到期日）。本集合计划每份计划份额在其最短持有期到期日（含该日）后，集合计划份额持有人方可就该集合计划份额提出赎回申请。本集合计划管理人针对集合计划特定的运作方式，建立了相应的流动性风险监控与预警机制。本集合计划管理人每日预测集合计划的流动性需求，通过独立的风险管理部门设置流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，并按照集合计划类型建立并定期开展专项的流动性压力测试工作，对流动性风险进行预警。本集合计划所持的证券在证券交易所上市或可于银行间同业市场交易。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。截止本报告期末，单一投资者持有集合计划份额比例未超过集合计划总份额 50%，本集合计划投资未违背法律法规对流通受限资产的相关比例要求。

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 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,831,135.46	-	-	-	6,831,135.46
结算备付金	46,885.57	-	-	-	46,885.57
存出保证金	18,660.32	-	-	-	18,660.32
交易性金融资产	-	-	-	88,085,215.29	88,085,215.29
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
资产总计	6,896,681.35	-	-	88,085,225.29	94,981,906.64
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,442.13	10,442.13
应付管理人报酬	-	-	-	63,059.96	63,059.96
应付托管费	-	-	-	7,282.65	7,282.65
应付销售服务费	-	-	-	7,001.32	7,001.32
其他负债	-	-	-	127,575.05	127,575.05
负债总计	-	-	-	215,361.11	215,361.11
利率敏感度缺口	6,896,681.35	-	-	87,869,864.18	94,766,545.53
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	7,305,844.84	-	-	-	7,305,844.84
结算备付金	2,728.49	-	-	-	2,728.49
存出保证金	8,016.56	-	-	-	8,016.56
交易性金融资产	-	-	-	102,706,860.68	102,706,860.68
资产总计	7,316,589.89	-	-	102,706,860.68	110,023,450.57
负债					
应付赎回款	-	-	-	72,986.84	72,986.84
应付管理人报酬	-	-	-	74,632.98	74,632.98
应付托管费	-	-	-	9,054.31	9,054.31
应付销售服务费	-	-	-	26,050.05	26,050.05
其他负债	-	-	-	348,675.66	348,675.66
负债总计	-	-	-	531,399.84	531,399.84
利率敏感度缺口	7,316,589.89	-	-	-102,175,460.84	109,492,050.73

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

净值比为 7.28%，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。本集合计划的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划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经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金、证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。本集合计划通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本集合计划管理人每日对本集合计划所持有的证券价格实施监控。

本集合计划投资于经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金（包括 QDII 基金、商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）和香港互认基金）的资产比例不低于集合计划资产的 80%；其中，股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%。本集合计划面临的整体市场价格风险列示如下：

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 2024年6月30日		上年度末 2023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	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	88,085,215.29	92.95	102,706,860.68	93.80
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	88,085,215.29	92.95	102,706,860.68	93.80

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 (2024 年 6 月 30 日)	上年度末 (2023 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+5%	3,465,825.64	4,534,011.33
	业绩比较基准-5%	-3,465,825.64	-4,534,011.33

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
---------------	------------------------	--------------------------

第一层次	88,085,215.29	102,706,860.68
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	88,085,215.29	102,706,860.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本集合计划不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

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

截至资产负债表日本集合计划无需要说明的其他重要事项。

§ 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	88,085,215.29	92.74
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	6,878,021.03	7.24
8	其他各项资产	18,670.32	0.02

9	合计	94,981,906.64	100.00
---	----	---------------	--------

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

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本集合计划本报告期期末未持有股票。

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

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

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

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本集合计划本报告期内未进行股票投资。

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

股指期货暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

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

国债期货暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

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 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

本集合计划是混合型基金中基金集合资产管理计划，坚持自上而下为主、自下而上为辅，把握“一个中心、四个基本点”，即以大类资产配置为中心的 β 性机会，以风格配置、行业配置、基金筛选、辅助业绩增厚为四个基本点的 α 性机会，互为支撑的投资策略。从战略层面和战术层面动态调整配置组合，贯彻全流程风控合规的稳健投资理念。其中，在基金筛选策略（ α 机会）方面，本集合计划将主要聚焦在选择基金的 α 机会，拟结合基金覆盖与研究范围，通过对产品业绩、投研能力、风险控制等指标定量与定性分析相结合，优选基金赚取 α 收益。对于基金进行业绩指标、业绩归因、综合调研等定量定性结合研究，结合公司基金池制度，动态跟踪基金市场变化，定期调整。

本集合计划投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的 80%，其中，股票（含存托凭证）、股票型基金、混合型基金（权益类资产比例不低于 60%）和商品基金（含商品期货基金和黄金 ETF）等合计占集合计划资产的比例为 60%-95%，投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于 15%；本集合计划应当保持不低于集合计划资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本集合计划整体风险中等，预期收益和风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金，低于股票型基金、股票型基金中基金，符合本集合计划合同约定的投资政策、投资限制等要求。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	是否属于基金管理人及管理人关联方所管理的基金
1	510310	易方达沪深300ETF发起式	交易型开放式 (ETF)	3,796,200.00	6,472,521.00	6.83	否
2	161611	融通内需驱动	契约型开	1,931,846.00	5,426,555.41	5.73	否

		混合 A/B	放式				
3	001513	易方达 信息产 业混合 A	契约 型开 放式	2,326,359.61	5,357,606.18	5.65	否
4	166301	华商新 趋势优 选混合	契约 型开 放式	475,589.63	4,338,328.60	4.58	否
5	006567	中泰星 元灵活 配置混 合 A	契约 型开 放式	1,754,501.25	4,290,983.71	4.53	否
6	013859	宝盈品 质甄选 混合 A	契约 型开 放式	3,409,213.23	4,154,808.16	4.38	否
7	515880	国泰中 证全指 通信设 备 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	3,387,200.00	3,990,121.60	4.21	否
8	001917	招商量 化精选 股票发 起式 A	契约 型开 放式	1,829,059.72	3,883,093.79	4.10	否
9	519002	华安安 信消费 混合 A	契约 型开 放式	787,945.87	3,549,696.14	3.75	否
10	517090	国泰富 时中国 国企开 放共赢 ETF	交易 型开 放式 (ETF)	2,235,300.00	3,357,420.60	3.54	否
11	159740	恒生科 技	交易 型开 放式 (ETF)	6,344,000.00	3,032,432.00	3.20	否

12	163822	中银主题策略混合 A	契约型开放式	918,178.72	2,836,254.07	2.99	否
13	162411	华宝油气	上市契约型开放式 (LOF)	3,300,200.00	2,661,281.28	2.81	否
14	003293	易方达科瑞混合	契约型开放式	1,548,242.36	2,622,103.26	2.77	否
15	159875	新能源	交易型开放式 (ETF)	6,004,000.00	2,437,624.00	2.57	否
16	005974	东方红配置精选混合 A	契约型开放式	1,638,417.29	2,378,490.38	2.51	否
17	100032	富国中证红利指数增强 A/B	契约型开放式	2,309,286.11	2,350,853.26	2.48	否
18	159652	有色基金	交易型开放式 (ETF)	2,638,300.00	2,266,299.70	2.39	否
19	003715	宝盈消费主题混合	契约型开放式	1,174,448.83	2,247,072.95	2.37	否
20	008481	永赢股息优选 C	契约型开放式	1,572,190.25	2,207,826.77	2.33	否
21	513500	博时标普 500ETF	交易型开放式 (ETF)	1,093,300.00	2,154,894.30	2.27	否

22	270023	广发全球精选股票 (QDII) 人民币 A	契约型开放式	575,461.41	2,142,673.01	2.26	否
23	002207	前海开源金银珠宝混合 C	契约型开放式	1,418,223.64	2,108,898.55	2.23	否
24	510100	易方达上证 50ETF	交易型开放式 (ETF)	1,676,400.00	1,998,268.80	2.11	否
25	159819	AI 智能	交易型开放式 (ETF)	2,585,900.00	1,851,504.40	1.95	否
26	260112	景顺长城能源基建混合 A	契约型开放式	718,601.96	1,749,795.77	1.85	否
27	001955	中欧养老混合 A	契约型开放式	603,717.90	1,422,057.51	1.50	否
28	159998	计算机	交易型开放式 (ETF)	2,072,000.00	1,344,728.00	1.42	否
29	159934	黄金 ETF	交易型开放式 (ETF)	231,500.00	1,213,291.50	1.28	否
30	159726	恒生红利	交易型开放式 (ETF)	1,076,500.00	1,064,658.50	1.12	否

31	002980	华夏创 新前沿 股票	契约 型开 放式	504,445.17	1,009,394.79	1.07	否
32	518880	华安黄 金易 (ETF)	交易 型开 放式 (ETF)	30,900.00	163,677.30	0.17	否

7.12.3 报告期末基金持有的全部公开募集基础设施证券投资基金情况

本集合计划本报告期末未持有公开募集基础设施证券投资基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	18,660.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	18,670.32

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本集合计划本报告期末未持有可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本集合计划本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例(%)	持有份额	占总份额比例(%)
兴证资管金麒麟3个月(FOF)A	957	94,244.42	20,749,968.14	23.01	69,441,941.92	76.99
兴证资管金麒麟3个月(FOF)C	541	47,393.54	4.01	0.00	25,639,898.48	100.00
合计	1,498	77,324.31	20,749,972.15	17.91	95,081,840.40	82.09

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3个月(FOF)A	2,638,665.85	2.9256
	兴证资管金麒麟3个月(FOF)C	1,722,713.30	6.7189
	合计	4,361,379.15	3.7653

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3个月(FOF)A	50~100
	兴证资管金麒麟3个月(FOF)C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟3个月(FOF)A	>100
	兴证资管金麒麟3个月(FOF)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 3 个月 (FOF) A	兴证资管金麒麟 3 个月 (FOF) C
基金合同生效日 (2022 年 9 月 5 日) 基金份额总额	43,185,479.71	-
本报告期期初基金份额总额	98,267,003.06	27,654,477.41
本报告期基金总申购份额	37,181.09	126,900.28
减：本报告期基金总赎回份额	8,112,274.09	2,141,475.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	90,191,910.06	25,639,902.49

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，本集合计划管理人的重大人事变动如下：

2024 年 6 月 6 日起，杨华先生担任公司副总经理。

本报告期内，本集合计划托管人的专门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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期本集合计划持有的基金未发生重大影响事件。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本集合计划管理人未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 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。

10.7.2 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。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 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	-	-	83,958.43	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。

10.8.2 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		基金交易	
	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 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)

兴业 证券	-	-	-	-	-	-	87,456,211.15	100.00
----------	---	---	---	---	---	---	---------------	--------

10.9 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	兴证证券资产管理有限公司关于投资经理代为履行职责的公告	规定网站、规定报刊	2024-01-08
2	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 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-01-22
3	兴证证券资产管理有限公司旗下公募资产管理产品风险评价结果的公告	规定网站	2024-01-24
4	兴证证券资产管理有限公司关于公司住所变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-02-02
5	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 2023 年年度报告	规定网站	2024-03-29
6	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 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-04-22
7	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-06-08
8	兴证资管金麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划招募说明书更新 (2024 年第 1 号)	规定网站	2024-06-27
9	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 (A 类份额) 产品资料概要更新	规定网站	2024-06-27
10	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 (C 类份额) 产品资料概要更新	规定网站	2024-06-27

§ 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、2024 年 1 月 8 日，管理人发布《兴证证券资产管理有限公司关于投资经理代为履行职责的公告》，投资经理斯苑蓓因个人原因自 2024 年 1 月 8 日至 2024 年 3 月 22 日休假，无法正常履行职责，在斯苑蓓休假期间，兴证资管金麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划由共同管理该产品的投资经理王德伦管理。

2、2024 年 6 月 6 日起，杨华先生担任公司副总经理。

3、2024 年 6 月 20 日，公司换领《中华人民共和国经营证券期货业务许可证》，经营范围为证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。

§ 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业证券金麒麟 3 号优选基金组合集合资产管理计划合同变更的回复；

2、《兴证资管金麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划资产管理合同》；

3、《兴证资管金麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF) 集合资产管理计划托管协议》；

4、《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

2024 年 8 月 31 日