

兴证资管金麒麟恒睿致远
一年持有期混合型证券投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 20 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合
基金主代码	970120
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021 年 12 月 27 日
报告期末基金份额总额	46,206,794.57 份
投资目标	本基金在控制风险和保持资产流动性的前提下，通过对不同资产类别的灵活配置，充分挖掘市场潜在的投资机会，追求资产的长期增值。
投资策略	本基金主要策略包括大类资产配置策略，即综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产、权益类资产、衍生品等资产类别之间进行动态配置。 本基金投资策略还包括固定收益投资策略、股票投资策略和金融衍生工具投资策略。固定收益投资策略主要包括资产配置策略、债券投资策略、可转换债券及可交换债券投资策略、资产支持证券投资策略、证券公司短期公司债券投资策略。股票投资策略包括个股投资策略、行业配置策略。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	中债综合（全价）指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×15%+恒生指数收益率×5%
风险收益特征	本基金是混合型基金，其预期收益和风险水平高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。基金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	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 C
下属分级基金的交易代码	970119	970120	970121
报告期末下属分级基金的份额总额	32,240,065.37 份	13,538,678.07 份	428,051.13 份

注：1、2021 年 12 月 27 日，兴证资管金麒麟核心优势集合资产管理计划变更为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。2025 年 8 月 11 日，“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”变更注册为“兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金”；

2、根据本基金《基金合同》和《招募说明书》的约定，本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额的最短持有期为 1 年，最短持有期内，投资者不能提出申请赎回所持有的该笔 A 类和 C 类基金份额，期满后投资者可提出赎回申请。本基金 B 类基金份额每个工作日开放赎回，不开放申购。基金份额持有人持有原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的期限连续计算。

§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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）		
	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 C
1. 本期已实现收益	-76,219.72	-34,710.39	-1,650.16
2. 本期利润	1,486,728.63	823,048.45	20,089.07
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0471	0.0602	0.0473
4. 期末基金资产净值	34,972,884.31	18,316,947.59	476,608.58
5. 期末基金份额净值	1.0848	1.3529	1.1134

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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

兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 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	4.65%	0.41%	1.90%	0.23%	2.75%	0.18%
过去六个月	3.77%	0.39%	1.33%	0.22%	2.44%	0.17%
过去一年	5.93%	0.29%	3.28%	0.19%	2.65%	0.10%
过去三年	11.05%	0.24%	9.58%	0.21%	1.47%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.48%	0.32%	6.25%	0.22%	2.23%	0.10%

兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 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	4.65%	0.41%	1.90%	0.23%	2.75%	0.18%
过去六个月	3.77%	0.39%	1.33%	0.22%	2.44%	0.17%
过去一年	5.92%	0.29%	3.28%	0.19%	2.64%	0.10%
过去三年	11.04%	0.24%	9.58%	0.21%	1.46%	0.03%
自基金合同生效起至今	4.15%	0.32%	5.86%	0.22%	-1.71%	0.10%

兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 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
过去三个月	4.49%	0.41%	1.90%	0.23%	2.59%	0.18%
过去六个月	3.46%	0.39%	1.33%	0.22%	2.13%	0.17%
过去一年	5.28%	0.29%	3.28%	0.19%	2.00%	0.10%
过去三年	9.05%	0.24%	9.58%	0.21%	-0.53%	0.03%
自基金合同生效起至今	11.34%	0.30%	9.20%	0.21%	2.14%	0.09%

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

兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合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



兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合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



兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合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 2026 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		
范驾云	兴证证券资产管理有限公司公募投资部（原公募业务部）基金经理	2025 年 8 月 11 日	—	15 年	南京大学工学学士、管理学硕士。2011 年 6 月进入金融行业，曾任兴业证券股份有限公司资产管理分公司研究员。2014 年 7 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任研究策划部研究员，权益投资部投资经理，创新投资部投资经理，公募投资部投资经理，公募业务部投资经理、公募投资部（原公募业务部）投资经理。现任公募投资部（原公募业务部）基金经理。
吕晓威	兴证证券资产管理有限公司公募投资部（原公募业务部）基金经理	2025 年 8 月 11 日	—	16 年	上海交通大学硕士。2010 年 5 月进入金融行业，曾任一德期货有限公司金融工程研究中心副总监，银河期货有限公司金融市场部投资经理及量化团队负责人，天风证券股份有限公司固定收益总部投资经理，浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益部/FICC 部投资主办。2021 年 8 月加入兴证证券资产管理有限公司，历任固定收益部投资经理，公募投资部投资经理，公募业务部投资经理，公募投资部（原公募业务部）投资经理。现任公募投资部（原公募业务部）基金经理。

注：1、范驾云自 2022 年 9 月 16 日至 2025 年 8 月 10 日担任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的投资经理；

2、吕晓威自 2022 年 1 月 10 日至 2025 年 8 月 10 日担任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的投资经理；

3、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

4、非首任基金经理，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；

5、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，本基金基金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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金无重大违法违规行为及违反基金合同约定的行为，未有损害基金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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有公募基金和投资组合，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。报告期内，本基金管理人严格执行了《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。公司对投资交易行为进行监测，未发现违反公平交易制度的情况。

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

2026 年二季度全球经济走出一季度地缘影响后的修复路径，整体呈现 “前半段滞胀担忧压制、后半段地缘缓和风险偏好回升” 的分化格局，美伊谈判落地、油价大幅回落是贯穿本季度全球宏观与资本市场的核心转折点。海外层面，一季度持续发酵的地缘政治冲突进入协商周期，原油价格自 4 月高位持续下行，输入性通胀压力缓解，但美联储受前期高油价扰动维持偏鹰政策取向，年内仍有加息预期，海外市场持续在 AI 高景气与流动性收紧之间博弈。国内宏观政策持续加码，经济呈现 “新旧动能持续分化、核心城市边际修复、传统行业仍承压” 的韧性特征，新质生产力相关产业盈利兑现持续超预期，地产、大众消费、传统周期板块修复节奏相对偏弱，仅核心一二线城市地产出现结构性改善信号。

产业层面，AI 算力全产业链进入业绩验证周期，海外云厂商持续上调资本开支指引，国内 PCB、存储、光模块、半导体设备国产替代进度提速，板块量价齐升逻辑持续兑现；新能源海外出口需求维持高景气。反观煤炭、石油石化等高油价受益板块随原油下行有所走弱，地产、银行、美容护理、农林牧渔等内需板块受居民修复偏弱、库存高企、资金持续调仓影响持续磨底，行业景气度分化进一步拉大。

股票市场层面，二季度呈行业高度分化特征，继续反映各行业基本面的分化。AI 产业链受益于高景气驱动而继续表现强势，而消费、地产、传统周期、能源等板块继续承压，主要受内需疲软、油价回落、资金调仓至科技成长板块等多重因素压制。同时，我们看到，当下很多高景气度行业的估值已处于历史分位数较高位；而很多低景气度行业的估值处于历史分位数较低位。综合考虑其成长性、估值等因素，我们认为高景气度和低景气度行业中，都有一些公司具备良好的复利空间。因此，我们在行业配置上选择相对均衡，以力争提高投资组合的鲁棒性。二季度，本产品股票仓位整体基本稳定，可转债仓位则相应进行了一定的上调，主要是我们认为部分转债已具备良好的性价比。在行业结构上，股票方面做了小幅的优化调整，可转债主要增配了新能源、轻工行业。

债券方面，2026 年二季度债券市场整体以收益率震荡下行为主。经济基本面依然呈现 K 型分化，PMI 等经济数据呈现冲高回落的特征，包括社零，固定资产投资等数据同比下滑，通胀数据呈现温和修复的特征，整体看经济数据有所降温。6 月的信贷增速面临回落的压力，社融增速回落至 7.5%，信贷需求的疲弱为债券市场的收益率的震荡下行提供了支撑。央行于二季度末创设了隔夜逆回购等货币政策工具，同时完善了短端利率调控机制，将隔夜正、逆回购的操作区间收窄至 50bp，二季度末资金面基本维持平稳。二季度期限利差特别是长端利率维持在较高区间。信用债表现好于利率债，信用利差压缩。产品债券部分主要以中高等级信用债为底仓，基本维持了中

短久期信用债和利率债的哑铃型配置结构。

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恒睿致远一年持有期混合 A 份额净值为 1.0848 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.65%; 同期业绩比较基准收益率为 1.90%。兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 B 份额净值为 1.3529 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.65%; 同期业绩比较基准收益率为 1.90%。兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 C 份额净值为 1.1134 元,本报告期基金份额净值增长率为 4.49%; 同期业绩比较基准收益率为 1.90%。

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,本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人的情形。

报告期内,本基金出现大于连续二十个工作日小于连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。

自 2026 年 03 月 03 日起至本报告期末,由本基金管理人承担本基金信息披露费、审计费等费用。

§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	14,038,547.87	25.82
	其中:股票	14,038,547.87	25.82
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	39,168,085.50	72.05
	其中:债券	39,168,085.50	72.05
	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	863,556.79	1.59
8	其他资产	290,652.68	0.53
9	合计	54,360,842.84	100.00

注:本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 2,105,056.87 元,占资产净值比例为 3.92%。

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	—	—
B	采矿业	435,145.00	0.81
C	制造业	9,412,641.00	17.51
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	637,013.00	1.18
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	799,344.00	1.49
K	房地产业	110,194.00	0.20
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	539,154.00	1.00
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	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	11,933,491.00	22.20

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	—	—
日常消费品	—	—
能源	—	—
金融	385,505.92	0.72
医疗保健	—	—
工业	1,289,640.41	2.40
信息技术	—	—
通信服务	429,910.54	0.80
公用事业	—	—
房地产	—	—
合计	2,105,056.87	3.92

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	300750	宁德时代	3,600	1,414,836.00	2.63
2	300308	中际旭创	1,100	1,397,000.00	2.60
3	300502	新易盛	2,160	1,311,120.00	2.44
4	603986	兆易创新	1,600	1,304,000.00	2.43
5	600690	海尔智家	51,100	1,042,951.00	1.94
6	002463	沪电股份	6,100	932,080.00	1.73
7	000333	美的集团	9,700	732,641.00	1.36
8	600426	华鲁恒升	26,800	641,056.00	1.19
9	300012	华测检测	38,900	539,154.00	1.00
10	600885	宏发股份	15,300	527,697.00	0.98

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	7,267,005.04	13.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	16,379,753.91	30.46
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	5,087,506.20	9.46
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	10,433,820.35	19.41
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	39,168,085.50	72.85

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	232680007	26 兴业银行二级资本债 01	30,000	3,021,411.62	5.62
2	232280012	22 广州银行二级资本债 01	20,000	2,130,895.89	3.96
3	2128036	21 平安银行二级	20,000	2,062,726.79	3.84
4	312410005	24 农行 TLAC 非资本债 01A(BC)	20,000	2,051,546.30	3.82
5	242306	25 万联 G2	20,000	2,043,512.33	3.80

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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

基金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。基金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

本基金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，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作，获取超额收益。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金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

本基金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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，兴业银行股份有限公司、广州银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司、万联证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚。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，本基金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。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金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	4,834.84
2	应收证券清算款	121,301.52
3	应收股利	72,100.00
4	应收利息	—
5	应收申购款	705.17
6	其他应收款	91,711.15
7	其他	—
8	合计	290,652.68

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	113053	隆 22 转债	1,786,360.68	3.32
2	113052	兴业转债	1,526,062.16	2.84
3	127089	晶澳转债	1,459,319.06	2.71
4	110085	通 22 转债	1,363,563.68	2.54
5	113059	福莱转债	1,337,893.90	2.49
6	113655	欧 22 转债	1,189,481.40	2.21
7	113670	金 23 转债	870,288.33	1.62
8	127085	韵达转债	869,801.01	1.62
9	127083	山路转债	31,050.13	0.06

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金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	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合 B	兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合
----	----------------------	----------------------	--------------------

			C
报告期期初基金份额总额	29,003,950.86	13,716,127.47	414,355.19
报告期期间基金总申购份额	3,260,047.43	—	13,802.59
减:报告期期间基金总赎回份额	23,932.92	177,449.40	106.65
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	32,240,065.37	13,538,678.07	428,051.13

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	28,118,658.10
报告期期间买入/申购总份额	2,823,978.06
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	30,942,636.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	66.9656

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率(%)
1	申购	2026-4-13	2,823,978.06	3,000,000.00	0.8
合计			2,823,978.06	3,000,000.00	

注：本报告期内，本基金管理人申购本基金 1 笔，申购费率 0.8%，收取申购费 23809.52 元。

§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	1	20260401-20260630	28,118,658.10	2,823,978.06	—	30,942,636.16	66.9656
个人	—	—	—	—	—	—	—

产品特有风险
1、本基金单一机构投资者所持有的份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响； 2、大额赎回有可能导致管理人被迫抛售证券以应付赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平； 3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动； 4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响； 5、若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临终止基金合同等风险； 6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险； 7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，2026 年 4 月 9 日起，王焕舟同志担任本公司董事长职务，刘宇先生不再担任公司董事长职务；

2026 年 4 月 10 日起，王焕舟先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，刘宇先生不再代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务；

2026 年 4 月 10 日起，陈怡女士担任公司副总裁；

2026 年 4 月 28 日起，公司法定代表人变更为王焕舟先生。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予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变更注册的批复文件；

2、《兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金基金合同》；

- 3、《兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金招募说明书》；
- 5、 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、 基金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

本基金管理人的办公场所（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

投资者可登录基金管理人的网站（<http://www.ixzzcgl.com>）查询，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

兴证证券资产管理有限公司

2026 年 7 月 21 日