兴证资管金麒麟均衡优选
混合型证券投资基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：2026 年 10 月 27 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。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 26 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 07 月 01 日起至 2026 年 09 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	55,898,897.48 份
投资目标	在控制组合风险的前提下，本基金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，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金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、行业配置策略和港股通标的股票投资策略。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*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%
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	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混合 A	兴证资管金麒麟均衡优选混合 B	兴证资管金麒麟均衡优选混合 C	兴证资管金麒麟均衡优选混合 D	兴证资管金麒麟均衡优选混合 E
下属分级基金的交易代码	970093	970094	970095	025750	025751
报告期末下属分级基金的份额总额	22,645,228.06 份	8,146,048.01 份	654,691.19 份	24,431,896.85 份	21,033.37 份

注：1、2021 年 11 月 15 日，“兴业证券金麒麟顶端优势集合资产管理计划”变更为“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”。2025 年 10 月 20 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”变更注册为“兴证资管金麒麟均衡优选混合型证券投资基金”（以下简称“本基金”）；

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金增设 D 类和 E 类基金份额，份额首次确认日为 2025 年 10 月 22 日；

3、根据本基金《基金合同》和《招募说明书》的约定，原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 A 类、B 类、C 类份额，自 2025 年 10 月 20 日起，投资者持有的上述份额分别全部自动转换为本基金 A 类、B 类、C 类基金份额。A 类、B 类、C 类基金份额只开放赎回，不开放申购。

4、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”。自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率(使用估值汇率折算)*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。

§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 7 月 1 日-2026 年 9 月 30 日）				
	兴证资管金麒麟均衡优选混合 A	兴证资管金麒麟均衡优选混合 B	兴证资管金麒麟均衡优选混合 C	兴证资管金麒麟均衡优选混合 D	兴证资管金麒麟均衡优选混合 E
1.本期已实现收益	77,751.13	34,848.98	1,387.54	61,454.62	9.14
2.本期利润	862,956.45	386,787.87	23,302.41	895,823.70	589.04
3.加权平均基金份额	0.0381	0.0475	0.0356	0.0368	0.0300

本期利润					
4.期末基金资产净值	18,614,090.73	8,343,070.31	518,777.42	20,015,046.22	16,602.56
5.期末基金份额净值	0.8220	1.0242	0.7924	0.8192	0.7893

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

兴证资管金麒麟均衡优选混合 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	4.86%	0.64%	-5.17%	0.80%	10.03%	-0.16%
过去六个月	-3.10%	0.71%	-1.21%	0.84%	-1.89%	-0.13%
过去一年	-8.54%	0.85%	-4.92%	0.81%	-3.62%	0.04%
过去三年	0.64%	0.96%	16.30%	0.84%	-15.66%	0.12%
自基金合同生效起至今	-17.80%	1.06%	-5.25%	0.84%	-12.55%	0.22%

兴证资管金麒麟均衡优选混合 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	4.86%	0.64%	-5.17%	0.80%	10.03%	-0.16%
过去六个月	-3.10%	0.71%	-1.21%	0.84%	-1.89%	-0.13%
过去一年	-8.55%	0.85%	-4.92%	0.81%	-3.63%	0.04%
过去三年	0.65%	0.96%	16.30%	0.84%	-15.65%	0.12%
自基金合同生效起至今	-14.65%	1.06%	-3.61%	0.84%	-11.04%	0.22%

兴证资管金麒麟均衡优选混合 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	4.70%	0.64%	-5.17%	0.80%	9.87%	-0.16%
过去六个月	-3.39%	0.71%	-1.21%	0.84%	-2.18%	-0.13%
过去一年	-9.11%	0.85%	-4.92%	0.81%	-4.19%	0.04%
过去三年	-1.58%	0.96%	16.30%	0.84%	-17.88%	0.12%
自基金合同生效起至今	-20.76%	1.06%	-5.25%	0.84%	-15.51%	0.22%

兴证资管金麒麟均衡优选混合 D

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	4.76%	0.64%	-5.17%	0.80%	9.93%	-0.16%
过去六个月	-3.29%	0.71%	-1.21%	0.84%	-2.08%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-8.32%	0.84%	-4.83%	0.79%	-3.49%	0.05%

兴证资管金麒麟均衡优选混合 E

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	4.60%	0.64%	-5.17%	0.80%	9.77%	-0.16%
过去六个月	-3.59%	0.71%	-1.21%	0.84%	-2.38%	-0.13%
自基金合同生效起至今	-8.88%	0.84%	-4.83%	0.79%	-4.05%	0.05%

注：1、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

2、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

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

注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

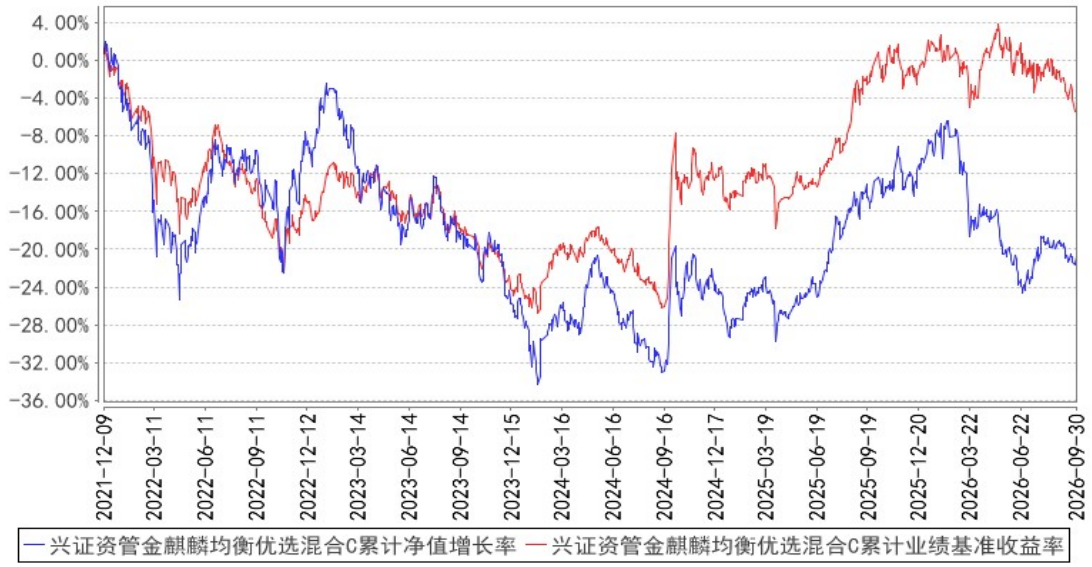
3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

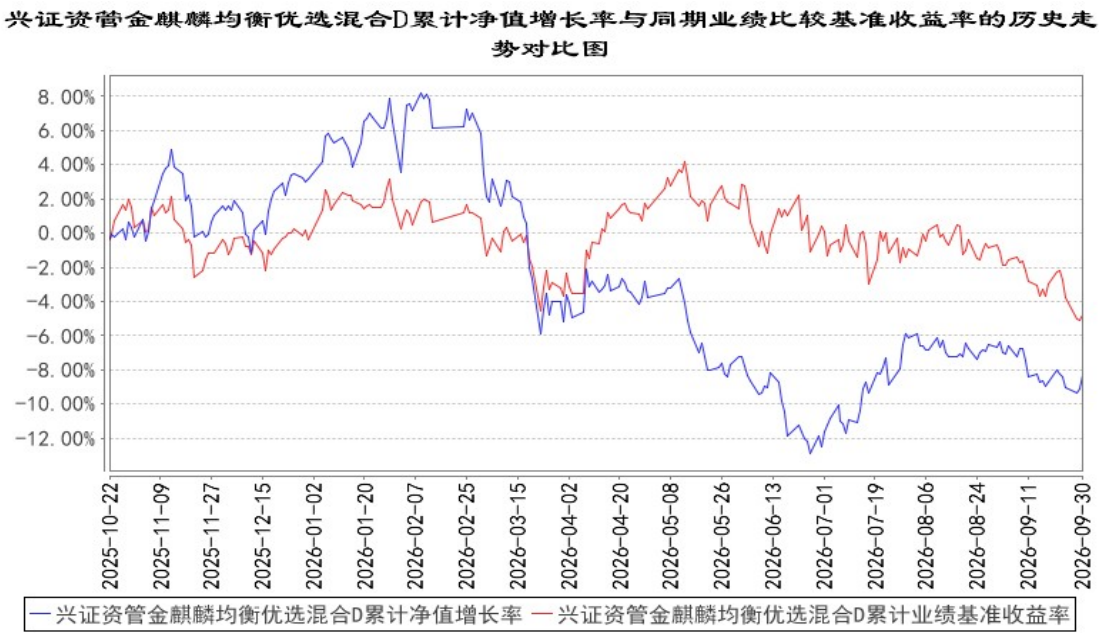
兴证资管金麒麟均衡优选混合C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*75%+上证国债指数收益率*25%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

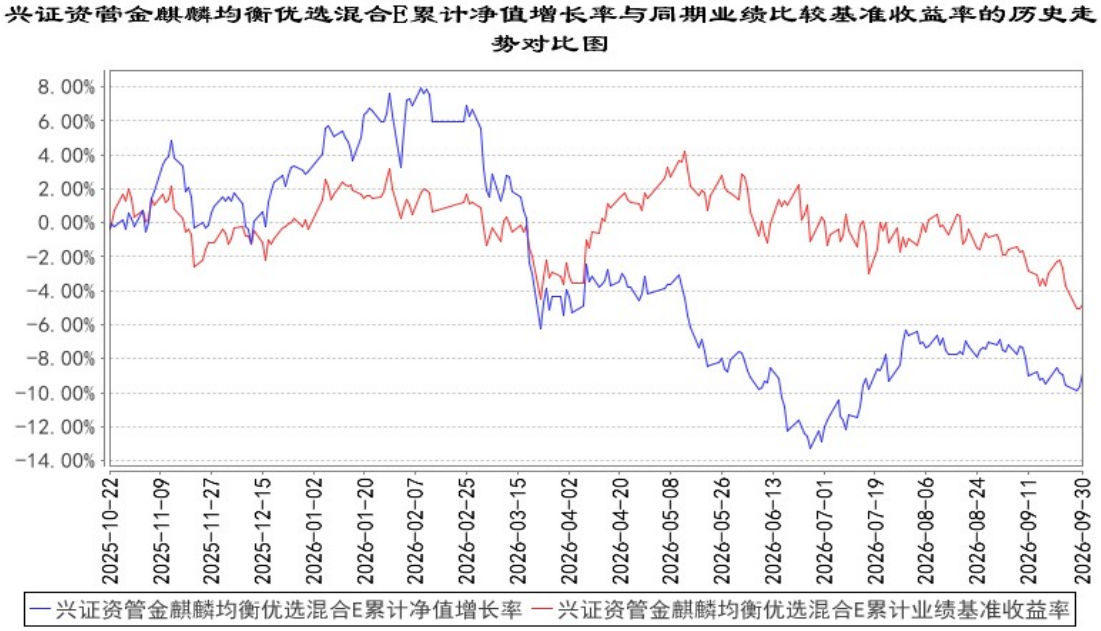
3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。



注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金增设 D 类基金份额，份额首次确认日为 2025 年 10 月 22 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。



注：1、净值表现所取数据截至到 2026 年 09 月 30 日。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金增设 E 类基金份额，份额首次确认日为 2025 年 10 月 22

日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3、自 2026 年 9 月 21 日起，本基金业绩比较基准由“沪深 300 指数收益率*55%+恒生指数收益率（使用估值汇率折算）*25%+上证国债指数收益率*20%”调整为“沪深 300 指数收益率*55%+中证港股通综合指数（人民币）收益率*25%+上证国债指数收益率*20%”。基金业绩比较基准收益率在调整前后期间分别根据相应的指标计算。

§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投资部（原公募业务部）基金经理	2025 年 10 月 20 日	-	10 年	伦敦大学玛丽皇后学院硕士。2016 年 4 月加入兴证证券资产管理有限公司并进入金融行业，历任研究部研究员，权益投资部投资经理，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。

注：1、何斯源自 2022 年 9 月 16 日至 2025 年 10 月 19 日担任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的投资经理；

2、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；

3、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；

4、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、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遵规守信情况的说明

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，各公募基金和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，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

报告期内，A 股波动有所加大，市场风格变化较为显著。部分此前涨幅较大的板块及个股在报告期内出现了一定幅度的调整。本基金在运作中仍基本维持此前风格，重点配置了一批估值相对较低的优质蓝筹股，因此在报告期内表现相对好于市场整体。

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混合 A 份额净值为 0.8220 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.86%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。兴证资管金麒麟均衡优选混合 B 份额净值为 1.0242 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.86%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。兴证资管金麒麟均衡优选混合 C 份额净值为 0.7924 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.70%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。兴证资管金麒麟均衡优选混合 D 份额净值为 0.8192 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.76%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。兴证资管金麒麟均衡优选混合 E 份额净值为 0.7893 元，本报告期基金份额净值增长率为 4.60%；同期业绩比较基准收益率为-5.17%。

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六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理

人已将解决方案上报中国证券监督管理委员会。

自 2026 年 06 月 26 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	35,615,657.21	72.22
	其中：股票	35,615,657.21	72.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,502,966.44	5.08
	其中：债券	2,502,966.44	5.08
	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	11,135,565.45	22.58
8	其他资产	62,453.41	0.13
9	合计	49,316,642.51	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 9,629,634.97 元，占资产净值比例为 20.27%。

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	1,103,700.00	2.32
B	采矿业	409,500.00	0.86
C	制造业	19,118,194.24	40.24
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	146,680.00	0.31
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	1,820,432.00	3.83

K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	683,280.00	1.44
N	水利、环境和公共设施管理业	981,684.00	2.07
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,236,456.00	2.60
R	文化、体育和娱乐业	486,096.00	1.02
S	综合	-	-
	合计	25,986,022.24	54.70

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	467,577.40	0.98
非日常生活消费品	60,871.66	0.13
日常消费品	917.82	0.00
能源	-	-
金融	1,351,292.41	2.84
医疗保健	2,495.05	0.01
工业	1,191,396.00	2.51
信息技术	258,418.75	0.54
通信服务	963,453.44	2.03
公用事业	959,260.00	2.02
房地产	4,373,952.44	9.21
合计	9,629,634.97	20.27

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	600426	华鲁恒升	94,120	1,828,751.60	3.85
2	02869	绿城服务	387,919	1,398,603.16	2.94
3	600019	宝钢股份	221,500	1,313,495.00	2.76
4	02423	贝壳-W	33,300	1,274,907.15	2.68
5	603806	福斯特	83,200	1,153,152.00	2.43
6	600519	贵州茅台	900	1,132,758.00	2.38
7	002714	牧原股份	26,000	1,103,700.00	2.32
8	06049	保利物业	45,871	1,102,546.18	2.32
9	002064	华峰化学	109,300	1,054,745.00	2.22
10	601601	中国太保	32,200	1,000,132.00	2.11

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	2,502,966.44	5.27
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,502,966.44	5.27

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	019846	26 国债 14	25,000	2,502,966.44	5.27

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

本基金投资前十名证券的发行主体中，保利物业在报告编制日前一年内曾受到监管部门行政处罚。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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	18,977.57
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	14,240.73
4	应收利息	-
5	应收申购款	79.88
6	其他应收款	28,514.35
7	待摊费用	640.88
8	其他	-
9	合计	62,453.41

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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	兴证资管金麒麟均衡优选混合 A	兴证资管金麒麟均衡优选混合 B	兴证资管金麒麟均衡优选混合 C	兴证资管金麒麟均衡优选混合 D	兴证资管金麒麟均衡优选混合 E
报告期期初基金份额总额	22,645,228.06	8,146,048.01	654,692.19	24,115,187.84	16,387.09
报告期期间基金总申购份额	-	-	-	317,145.49	5,542.36
减:报告期期间基金总赎回份额	-	-	1.00	436.48	896.08
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	22,645,228.06	8,146,048.01	654,691.19	24,431,896.85	21,033.37

注：1、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。

2、自 2025 年 10 月 20 日起，本基金增设 D 类和 E 类基金份额，份额首次确认日为 2025 年 10 月 22 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

§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	36,234,547.29
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	36,234,547.29
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	64.8216

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，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§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	1	20260701-20260930	36,234,547.29	0.00	0.00	36,234,547.29	64.8216
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

1、本报告期内，根据《公开募集证券投资基金业绩比较基准指引》的相关规定，为更好地反映基金投资风格，提高基金业绩表现与业绩比较基准的可比性，经与基金托管人协商一致，本基金管理人决定自 2026 年 9 月 21 日起调整本基金的业绩比较基准并对基金合同等法律文件有关条款进行修订。具体可参见基金管理人于 2026 年 8 月 22 日发布的《兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分基金调整业绩比较基准并修订基金合同等法律文件的公告》及修订后的基金法律文件。

2、本报告期内，2026 年 8 月 24 日起，翁建国先生担任本公司公募基金管理业务合规负责人职务，王焕舟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。

§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均衡优选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、《兴证资管金麒麟均衡优选混合型证券投资基金基金合同》；

3、《兴证资管金麒麟均衡优选混合型证券投资基金托管协议》；

4、《兴证资管金麒麟均衡优选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 10 月 27 日