

# 兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 型集合资产管理计划 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 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

送出日期：2022 年 3 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。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人中国工商银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2022 年 3 月 29 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。

本报告期自 2021 年 1 月 1 日起至 2021 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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.....	7
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	9
3.3 其他指标.....	12
3.4 过去三年基金的利润分配情况.....	12
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>12</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	14
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	17
4.9 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.....	17
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	17
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.....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	18
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息.....	18
6.2 审计报告的基本内容.....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>21</b>
7.1 资产负债表.....	21
7.2 利润表.....	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	23
7.4 报表附注.....	25
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>57</b>
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 期末按行业分类的股票投资组合.....	57
8.3 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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	64
8.6 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.....	64

8.7 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 .....	64
8.8 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 .....	64
8.9 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 .....	64
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
8.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>66</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	66
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	66
9.3 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的情况 .....	67
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	67
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>68</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	68
11.2 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 .....	68
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
11.4 基金投资策略的改变 .....	69
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
11.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
12.1 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 .....	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
13.1 备查文件目录 .....	73
13.2 存放地点 .....	73
13.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划	
基金简称	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合	
基金主代码	959993	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2020 年 4 月 13 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	
报告期末基金份额总额	648,741,904.97 份	
基金合同存续期	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三年。	
下属分级基金的基金简称:	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
下属分级基金的场内简称:	-	-
下属分级基金的交易代码:	959991	959993
报告期末下属分级基金的份额总额	617,363,951.31 份	31,377,953.66 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》等法规规定对照公募基金对兴证资管金麒麟领先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证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2020 年 4 月 13 日生效。“兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟领先优势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，“兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划”A 类份额（以下简称“A 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 类份额的最短持有期到期日即进入开放持有期，在开放持有期期间投资者可以办理赎回业务，每份 A 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 类份额申购确认日起至该 A 类份额申购确认日 1 年后的对日的前一个工作日（即最短持有期到期日）止，若该对日不存在对应日期的，则顺延至下一个工作日视为对日。

“兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划”C 类份额自 2020 年 4 月 15 日起每个工作日只开放赎回，不开放申购。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划在严格控制风险的前提下，通过精选有较高成长性和各领域竞争力
------	------------------------------------

	突出的龙头企业，结合估值水平进行积极的组合管理，追求超越业绩比较基准的投资回报和资产的长期稳健增值。
投资策略	<p>本集合计划主要策略包括大类资产配置策略，即本集合计划通过定性与定量相结合的方法，对宏观经济的发展周期，各项经济政策对经济发展趋势和证券市场的影响，证券市场中各投资品种的风险收益水平进行评估，确定投资组合中股票、债券、金融衍生品、货币市场工具等大类资产的比例，并适时依据环境变化进行动态调整。</p> <p>本集合计划投资策略还包括股票投资策略、债券投资策略和金融衍生工具投资策略。股票投资策略侧重“自下而上”的选股方法，精选基本面优秀，竞争优势明显，成长性较高的企业在合适的估值水平进行配置。债券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、可转债投资策略、资产支持证券投资策略。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。</p>
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。

### 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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	付志坚	余宏伟
	联系电话	021-38565866	(021) 68089632
	电子邮箱	zcg1@xyzq.com.cn	yuhongwei1@sh.icbc.com.cn
客户服务电话		95562-3	95588
传真		021-38565863	010-66105798
注册地址		福建省平潭综合实验区管委会现场指挥部办公大楼一楼	北京市西城区复兴门内大街 55 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 55 号
邮政编码		200135	100140
法定代表人		胡平生	陈四清

### 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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.ixzcg1.com">http://www.ixzcg1.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2021 年		2020 年 4 月 13 日(基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日		2019 年	
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
本期已实现收益	256,420,480.79	11,668,522.31	112,686,676.65	9,097,235.17	-	-
本期利润	33,229,082.85	4,078,455.57	384,123,387.84	28,632,001.12	-	-
加权平均基金份额本期利润	0.0401	0.1192	0.5264	0.5556	-	-
本期加权平均净值利润率	2.50%	7.43%	40.85%	45.08%	-	-
本期基金份额净值增长	6.64%	6.64%	48.20%	56.08%	-	-

率						
3.1.2 期末 数据和指 标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
期末 可供 分配 利润	324,368,46 3.04	15,761,923 .16	160,011,789.85	7,570,474.71	-	-
期末 可供 分配 基金 份额 利润	0.5254	0.5023	0.2018	0.1788	-	-
期末 基金 资产 净值	1,027,529, 212.12	52,225,275 .62	1,237,659,798. 26	66,088,031.9 7	-	-
期末 基金 份额 净值	1.6644	1.6644	1.5608	1.5608	-	-
3.1.3 累计 期末 指标	2021 年末		2020 年末		2019 年末	
基金 份额 累计 净值 增长 率	58.03%	66.44%	48.20%	56.08%	-	-

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、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

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A

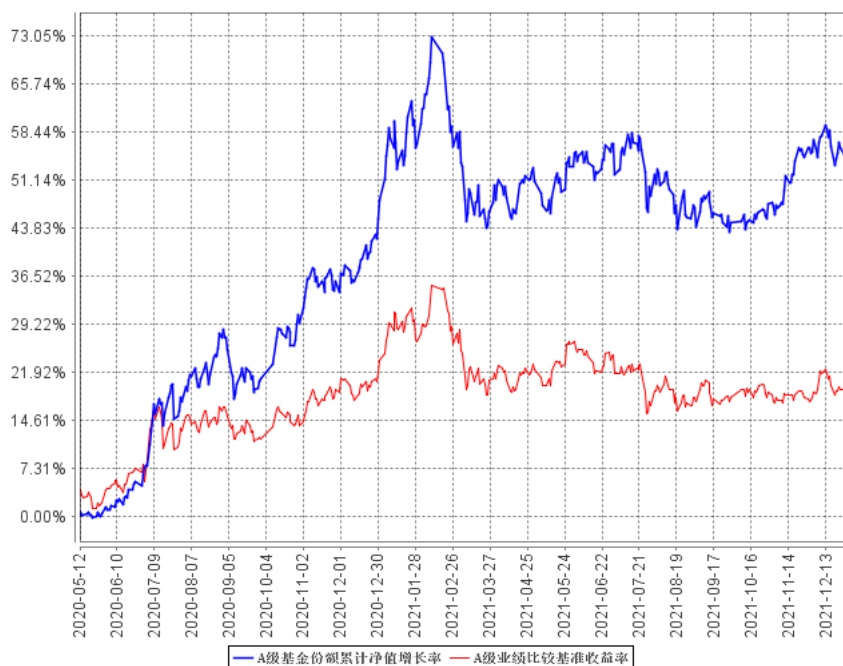
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.15%	0.79%	1.40%	0.60%	7.75%	0.19%
过去六个月	0.82%	1.08%	-3.44%	0.77%	4.26%	0.31%
过去一年	6.64%	1.25%	-2.84%	0.88%	9.48%	0.37%
自基金合同生效起至今	58.03%	1.20%	19.75%	0.91%	38.28%	0.29%

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C

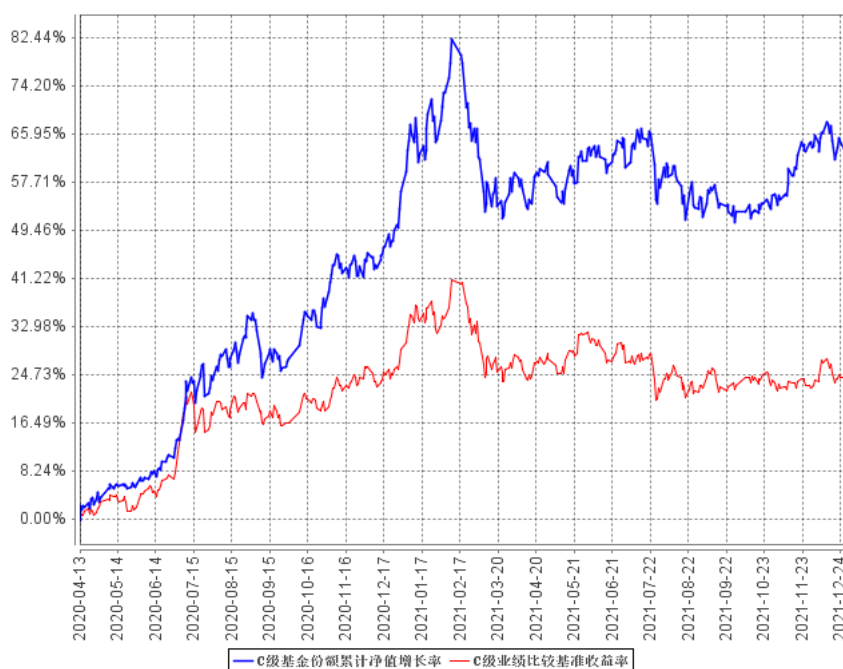
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	9.15%	0.79%	1.40%	0.60%	7.75%	0.19%
过去六个月	0.82%	1.08%	-3.44%	0.77%	4.26%	0.31%
过去一年	6.64%	1.25%	-2.84%	0.88%	9.48%	0.37%
自基金合同生效起至今	66.44%	1.19%	24.62%	0.90%	41.82%	0.29%

### 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

A级基金份额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



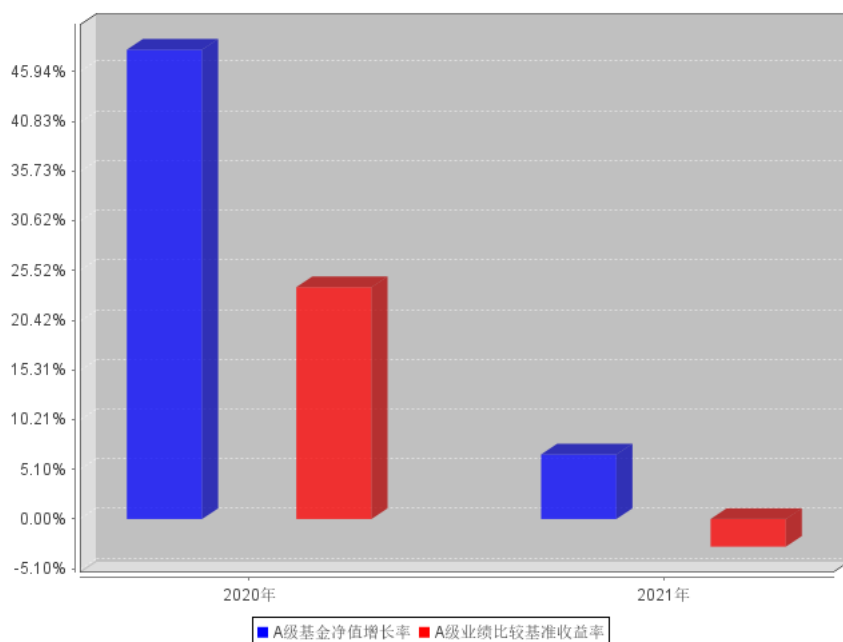
C级基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



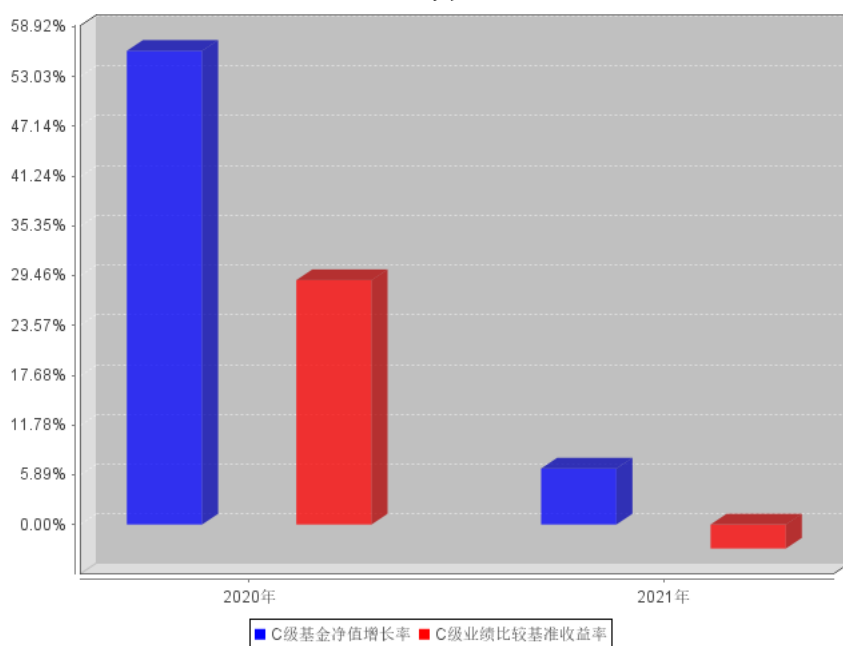
注：净值表现所取数据截至到 2021 年 12 月 31 日。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

A级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



C级自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的对比图



- 注：1、本集合计划 A 类份额自 2020 年 5 月 11 日起开放申购，2020 年 4 月 13 日（集合计划合同生效之日）至 2020 年 5 月 11 日期间，兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A 类份额为零。
- 2、合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。
- 3、本集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日生效，至本报告期末未满五年。

### 3.3 其他指标

无。

### 3.4 过去三年基金的利润分配情况

本集合计划合同于 2020 年 4 月 13 日生效，本集合计划自 2020 年 4 月 13 日（合同生效日）至本报告期末未进行利润分配。

## § 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。

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，兴证证券资产管理有限公司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，投资资管、投行资管两大资管业务并驾齐驱，固收投资、权益投资、定增投资、员工持股计划等业务均在业界具备领先优势，可为机构客户与个人客户提供多元化的投资及融资解决方案。

截止 2021 年 12 月 31 日，兴证证券资产管理有限公司共有 6 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。

#### 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		
匡伟	兴证证券资产管理有限公司	2020 年 4 月 13 日	-	13	北京理工大学硕士。2008 年 7 月进入金融行业，曾任天相投

	公募投资部副总经理、投资经理				资顾问有限公司医药分析师, 万家基金管理有限公司医药分析师。2014 年 10 月加入兴证证券资产管理有限公司, 历任研究部研究员、权益投资部投资经理、权益投资部总经理助理、公募投资部总经理助理。现任兴证证券资产管理有限公司公募投资部副总经理、投资经理。
游臻	兴证证券资产管理有限公司公募投资部投资经理	2021 年 7 月 29 日	-	9	新加坡管理大学硕士。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。现任兴证证券资产管理有限公司公募投资部投资经理。

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“离职日期”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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值 (元)	任职时间
游臻	公募基金	4	1,470,561,022.22	2021-07-29
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	1	1,183,681,603.00	2021-05-21
	合计	5	2,654,242,625.22	-

注: 截止本报告期末, 游臻管理的其他组合包括 1 只大集合资产管理计划: 兴证资管金麒麟现金添利集合资产管理计划。

截止本报告期末，匡伟未兼任私募小集合资产管理计划和其他组合投资经理。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本报告期内，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

### 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 公平交易制度和控制方法

本集合计划管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》。本集合计划管理人通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易执行环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督，从而达到保证管理人旗下不同的投资组合得到公平对待、保护投资者合法权益的目的。

#### 4.3.2 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，制定并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，共享交易资源。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，同时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，确保了公平交易原则的实现。

公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，在本报告期内，公司旗下所有资产管理组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，公司对各投资组合公平对待，不存在不公平交易或利益输送的行为。

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本报告期内，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

#### 4.3.3 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 5%的情况。本报告期内，未发现本集合计划有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 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

2021 年上证指数上涨 4.80%，创业板上涨 12.02%，沪深 300 下跌 5.20%，上证 50 下跌 10.06%。

2021 年，成长股整体表现好于白马价值股。主要表现为电动车销售不断超预期带动电动车相关产业链。大类行业上，消费类板块震荡下行消化估值，周期类板块年内受供给端限制波动较大，制造业受电动车拉动整体表现较好，科技类板块分化较大。

2021 年第一季度市场先扬后抑，一月到二月上旬，市场快速上扬，部分优质资产估值逐渐脱离合理区间，呈现出一定的趋势投资的特征，春节后市场快速向下调整，特别是优质资产调整幅度更大。内在原因是优质资产短期估值提升过快，此外外部主要受美国十年期国债收益率上行的影响。二季度市场比较活跃，行业景气度较高、渗透率提升空间较大的细分行业受到关注度高，二级市场表现相对较好，这些行业包括新能源汽车、光伏、医药研发与生产外包、半导体。三季度市场最大的特点是周期股表现良好，碳中和大背景下，周期性行业供给端扩张受到了一定的限制，煤炭、钢铁、有色、化工等行业产品价格快速上扬。上游价格的变化逐步开始影响到经济稳定，随后随着拉闸限电一刀切政策纠偏，周期股相应有所回落。四季度消费相对表现不错，医药、新能源、周期回调。2021 年是整体震荡波动的一年，每个季度都有表现不错的板块，同时也有板块回调。

本产品全年维持较高仓位运行，相对年初，减持消费类、服务类行业配置，增加科技、制造业、公用事业配置。报告期内，本产品换手率有所提升，主要是因为报告期内各类资产价格有所波动。相对而言，本产品报告期内组合内个股市值有所下沉，加大了对一些细分行业有潜力企业的研究和投资，坚持对投资标的质量的要求。

#### 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领先优势一年持有期混合 A 集合计划份额净值为 1.6644 元，

本报告期计划份额净值增长率为 6.64%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%；截至本报告期末兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C 集合计划份额净值为 1.6644 元，本报告期计划份额净值增长率为 6.64%，同期业绩比较基准收益率为-2.84%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年开年 A 股回调较多，国内方面市场担忧经济较弱，海外担忧美国通胀引发美联储收紧。交易层面，新发基金规模有所降低，增量资金暂时偏弱。我们对未来不悲观，国内稳增长的决心和工具都具备，虽然经济受地产影响可能有所偏弱，但整体相对可控。美联储加息并不必然导致国内跟随，中美利差仍有缓冲空间，A 股定价整体上是以前国内利率为基准。

稳增长类资产在下跌市场中可能有相对收益，但绝对收益空间仍不够吸引力；以沪深 300 为代表的优质白马股，长期估值合理；以创业板为代表的成长股，在快速下调后，投资价值或逐步显现，其中汽车零部件、新能源相关资产、半导体或值得关注。未来本产品仍以自下而上选择优质公司配置为主，在行业及风格上适当均衡。中国经济长期向上大趋势基本没有改变，我们对资本市场长期向上保持一定的信心。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内本管理人依照国家相关法律法规和公司内部管理制度全面深入持续加强治理建设、制度建设、合规管理和监察稽核工作，主要包括：

1、完善治理架构：建立由股东、董事会、监事会、公司经营管理层、各专业委员会和各部门组成的治理架构，形成了权力机构、决策机构、监督机构和管理层之间权责明确、运作规范的相互协调和制衡机制。

2、加强制度建设：年内公司就风险管理委员会、资产配置委员会修订优化相关议事规则，并就档案管理办法等基本制度，以及各业务相关管理办法、操作规程等进行了完善性修订。

3、开展监察稽核：根据监管要求等完成各项定期稽核和专项稽核，开展各项审计和审查，检查内容覆盖公司多个业务部门和业务环节，对整改情况进行跟踪，促进公司业务合规运作、稳健经营。

4、员工行为管理：依据《基金管理公司投资管理人员管理指导意见》等规定，建立信息系统和内部流程机制，定期开展投资行为监督管理，防范内幕交易和利益输送。

5、合规培训：高度重视法律法规和监管政策培训，开展现场培训、在线培训，以及邀请律师事务所、会计师事务所现场培训等多种形式，主题覆盖反洗钱、制度建设、直播宣传、新金融工具准则等多项专题培训。

本报告期内，本集合计划整体运作合规合法，无不当内幕交易和关联交易，有效保障了集合



计划持有人利益。本管理人将继续以风险控制为核心，一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，提高监察稽核工作的科学性和有效性，最大限度地防范和化解经营风险，切实保障集合计划安全、合规运作。

#### 4.7 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、研究部负责人、公募投资部负责人、权益投资部负责人、固定收益部负责人、合规风控部负责人、交易运营部负责人组成。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。

#### 4.8 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最多为 4 次，若集合计划合同生效不满 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。

#### 4.9 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

本报告期内，本托管人在对兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和资产管理合同的有关规定，不存在任何损害资产管理计划份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了托管人应尽的义务。

### 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

本报告期内，托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同和托管协议的规定，对本资产管理计划管理人的投资运作进行了必要的监督，对资产净值的计算、份额参

与退出价格计算、以及费用开支等方面进行了认真地复核。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，本托管人依法对兴证证券资产管理有限公司编制和披露的兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 2021 年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中账务数据内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

本报告期内，未发现本计划管理人存在损害份额持有人利益的行为。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2202150 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划全体份额持有人：
审计意见	我们审计了后附的兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“兴证资管金麒麟领先优势”）财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表、2021 年度的利润表、所有者权益（集合计划净值）变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、在财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了兴证资管金麒麟领先优势 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度的经营成果及集合计划净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于兴证资管金麒麟领先优势，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	-
其他事项	兴证资管金麒麟领先优势管理人兴证证券资产管理有限公司（以下简称“管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括兴证资管

	<p>金麒麟领先优势 2021 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理人管理层负责按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理人管理层负责评估兴证资管金麒麟领先优势的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非兴证资管金麒麟领先优势计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>管理人治理层负责监督兴证资管金麒麟领先优势的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重</p>

	<p>大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对导致对兴证资管金麒麟领先优势持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致兴证资管金麒麟领先优势不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报、结构和内容（包括披露），并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	黄小熠 蔡晓晓
会计师事务所的地址	上海静安区南京西路 1266 号恒隆广场二期 16 楼
审计报告日期	2022 年 3 月 18 日

## § 7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	70,911,347.54	116,963,059.95
结算备付金		2,323,469.54	2,061,973.56
存出保证金		427,870.47	262,742.87
交易性金融资产	7.4.7.2	919,954,725.40	1,181,613,693.36
其中：股票投资		919,954,725.40	1,181,613,693.36
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		90,254,354.73	2,351,843.29
应收利息	7.4.7.5	-14,761.93	15,329.87
应收股利		-	-
应收申购款		67,138.02	2,575,957.13
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,083,924,143.77	1,305,844,600.03
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2020 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,935,700.00	436,551.89
应付管理人报酬		595,042.12	613,477.36
应付托管费		232,106.15	253,542.48
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,204,331.15	778,198.07
应交税费		2,476.61	-
应付利息		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	200,000.00	15,000.00
负债合计		4,169,656.03	2,096,769.80
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	7.4.7.9	648,741,904.97	835,316,269.31
未分配利润	7.4.7.10	431,012,582.77	468,431,560.92
所有者权益合计		1,079,754,487.74	1,303,747,830.23
负债和所有者权益总计		1,083,924,143.77	1,305,844,600.03

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A 份额净值（暂估业绩报酬前）1.6644 元，份额总额 617,363,951.31 份，资产净值（暂估业绩报酬前）1,027,529,212.12 元，暂估业绩报酬 20,900,098.05 元，资产净值（暂估业绩报酬后）1,006,629,114.07 元；

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C 份额净值（暂估业绩报酬前）1.6644 元，份额总额 31,377,953.66 份，资产净值（暂估业绩报酬前）52,225,275.62 元，暂估业绩报酬 2,805,041.49 元，资产净值（暂估业绩报酬后）49,420,234.13 元；

上述暂估业绩报酬余额是各类集合计划份额持有人于 2021 年 12 月 31 日暂估业绩报酬的分类合计，各集合计划份额持有人实际应承担的业绩报酬金额根据其持有期间的实际收益情况计算确认，可能与上述暂估业绩报酬金额存在差异。

## 7.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 13 日(基 金合同生效日)至 2020 年 12 月 31 日
<b>一、收入</b>		60,554,350.13	422,157,768.87
1.利息收入		821,912.13	462,803.33
其中：存款利息收入	7.4.7.11	739,143.10	462,803.33
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		82,769.03	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		290,513,902.68	130,708,488.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	276,808,288.11	126,187,531.97

基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	13,705,614.57	4,520,956.43
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-230,781,464.68	290,971,477.14
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	-	15,000.00
<b>减：二、费用</b>		23,246,811.71	9,402,379.91
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,318,026.53	3,886,269.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,465,844.39	1,619,279.15
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	11,205,196.58	3,862,802.87
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		282.22	7,277.72
7. 其他费用	7.4.7.20	257,461.99	26,750.20
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		37,307,538.42	412,755,388.96
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		37,307,538.42	412,755,388.96

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划

本报告期：2021年1月1日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	835,316,269.31	468,431,560.92	1,303,747,830.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	37,307,538.42	37,307,538.42

三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-186,574,364.34	-74,726,516.57	-261,300,880.91
其中：1. 基金申购款	393,720,015.33	271,967,101.15	665,687,116.48
2. 基金赎回款	-580,294,379.67	-346,693,617.72	-926,987,997.39
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	648,741,904.97	431,012,582.77	1,079,754,487.74
项目	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	69,753,713.02	-6,308.45	69,747,404.57
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	412,755,388.96	412,755,388.96
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	765,562,556.29	55,682,480.41	821,245,036.70
其中：1. 基金申购款	792,974,961.30	60,561,449.12	853,536,410.42
2. 基金赎回款	-27,412,405.01	-4,878,968.71	-32,291,373.72
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	835,316,269.31	468,431,560.92	1,303,747,830.23

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

曾旭

基金管理人负责人

曾旭

主管会计工作负责人

郑启旭

会计机构负责人



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划变更而来，兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划由兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划变更而来。

2013 年 7 月 8 日，中国证券业协会作出《关于兴业证券股份有限公司发起设立兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划的备案确认函》（中证协函〔2013〕666 号），兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划设立，自 2013 年 5 月 8 日起向社会公众发行，2013 年 5 月 24 日结束募集并于 2013 年 5 月 29 日成立。2014 年 10 月 30 日，兴业证券金麒麟领先优势集合资产管理计划变更为兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划。

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》等法规对兴证资管金麒麟领先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证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向产品持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2020 年 4 月 13 日生效。“兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划”。

本集合计划为契约性开放式，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三年。本集合计划自资产管理合同变更生效日起三年后，按照中国证监会有关规定执行。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，托管人为中国工商银行股份有限公司。

本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。

如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，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：本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；

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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，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：沪深 300 指数收益率\*75%+上证国债指数收益率\*25%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证券投资基金业协会修订并发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会制定的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》及其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。本财务报表以本集合计划持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本集合计划于 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止会计期间的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

本集合计划财务报表所载财务信息依照企业会计准则、《证券投资基金会计核算业务指引》和其他相关规定所厘定的主要会计政策和会计估计编制。

##### 7.4.4.1 会计年度

本集合计划会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为自 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本集合计划记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本集合计划的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本集合计划的金融资产于初始确认时分为以下两类：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、贷款和应收款项；本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要包括股票投资、债券投资和衍生工具等；

#### (2) 金融负债分类

本集合计划的金融负债于初始确认时归类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债和其他金融负债。本集合计划目前持有的金融负债划分为其他金融负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本集合计划于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产的股票、债券等，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

在持有以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产期间取得的利息或现金股利，应当确认为当期收益。每日，本集合计划将以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债的公允价值变动计入当期损益；

处置该金融资产或金融负债时，其公允价值与初始入账金额之间的差额应确认为投资收益，同时调整公允价值变动收益；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除的，该金融负债或其一部分将终止确认；

本集合计划已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本集合计划既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本集合计划以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本集合计划假定该交易在

相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场(或最有利市场)是本集合计划在计量日能够进入的交易市场。本集合计划采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。本集合计划采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术，优先使用相关可观察输入值，只有在可观察输入值无法取得或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

本集合计划持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，集合计划管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，集合计划管理人可根据具体情况与集合计划托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本集合计划具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本集合计划计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的集合计划份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于集合计划申购确认日及集合计划赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括集合计划转换所引起的转入集合计划的实收基金增加和转出集合计划的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回集合计划份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占集合计划净值比例计算的金额。损益平准金于集合计划申购确认日或集合计划赎回确认日确认。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

(3) 资产支持证券利息收入按证券票面价值与票面利率计算的金额，扣除应由资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在证券实际持有期内逐日计提；

(4) 买入返售金融资产收入，按买入返售金融资产的成本及实际利率（当实际利率与合同利率差异较小时，也可以用合同利率），在回购期内逐日计提；

(5) 股票投资收益/（损失）于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交金额与其成本的差额入账；

(6) 债券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(7) 资产支持证券投资收益/（损失）于成交日确认，并按成交总额与其成本、应收利息的差额入账；

(8) 权证收益/（损失）于卖出权证成交日确认，并按卖出权证成交金额与其成本的差额入账；

(9) 股指期货投资收益/（损失）于平仓日确认，并按平仓成交金额与其初始合约价值的差额入账；

(10) 股利收益于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额入账；

(11) 公允价值变动收益/（损失）系本集合计划持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(12) 其他收入在主要风险和报酬已经转移给对方，经济利益很可能流入且金额可以可靠计量的时候确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本集合计划的管理人报酬和托管费等费用在费用涵盖期间按集合计划合同或相关公告约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、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最多为 4 次，若本集合计划合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本集合计划收益分配方式为现金分红；

3、集合计划收益分配后份额净值不能低于面值；即集合计划收益分配基准日的各类别份额净值减去每单位该类别份额收益分配金额后不能低于面值；

4、每一集合计划份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 分部报告

本集合计划以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本集合计划内同时满足下列条件的组成部分：

(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本集合计划管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本集合计划能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本集合计划目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

无。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本集合计划本报告期无会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本集合计划本报告期无会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本集合计划本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 7.4.6 税项

本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规及其他相关国内税务法规计提和缴纳税款，根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本集合计划参考适用的主要税项列示如下：

(a) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自2016年5月1日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

2018年1月1日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的

增值税应税行为，以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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	70,911,347.54	116,963,059.95
定期存款	-	-



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	-	-
合计：	70,911,347.54	116,963,059.95

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	854,752,504.07	919,954,725.40	65,202,221.33
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	854,752,504.07	919,954,725.40	65,202,221.33
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	885,630,007.35	1,181,613,693.36	295,983,686.01
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	-	-	-
其他	-	-	-
合计	885,630,007.35	1,181,613,693.36	295,983,686.01

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 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。

##### 7.4.7.4.2 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。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	15,293.45	14,179.27
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	1,150.05	1,020.58
应收债券利息	-	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-31,417.29	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	211.86	130.02
合计	-14,761.93	15,329.87

#### 7.4.7.6 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,204,331.15	778,198.07
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,204,331.15	778,198.07

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31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	-	-
预提费用	200,000.00	15,000.00
合计	200,000.00	15,000.00

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	792,974,961.30	792,974,961.30
本期申购	393,720,015.33	393,720,015.33
本期赎回（以“-”号填列）	-569,331,025.32	-569,331,025.32
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	617,363,951.31	617,363,951.31

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C		
项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	42,341,308.01	42,341,308.01
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-10,963,354.35	-10,963,354.35
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	31,377,953.66	31,377,953.66

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

上年度末	160,011,789.85	284,673,047.11	444,684,836.96
本期利润	256,420,480.79	-223,191,397.94	33,229,082.85
本期基金份额交易产生的变动数	-92,063,807.60	24,315,148.60	-67,748,659.00
其中：基金申购款	135,261,935.93	136,705,165.22	271,967,101.15
基金赎回款	-227,325,743.53	-112,390,016.62	-339,715,760.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	324,368,463.04	85,796,797.77	410,165,260.81

单位：人民币元

兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	7,570,474.71	16,176,249.25	23,746,723.96
本期利润	11,668,522.31	-7,590,066.74	4,078,455.57
本期基金份额交易产生的变动数	-3,477,073.86	-3,500,783.71	-6,977,857.57
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	-3,477,073.86	-3,500,783.71	-6,977,857.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,761,923.16	5,085,398.80	20,847,321.96

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
活期存款利息收入	691,779.09	441,257.27
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	41,394.14	19,230.43
其他	5,969.87	2,315.63
合计	739,143.10	462,803.33

注：其他包括保证金利息收入。

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月

		31 日
卖出股票成交总额	3,772,780,288.84	1,008,823,206.75
减：卖出股票成本总额	3,495,972,000.73	882,635,674.78
买卖股票差价收入	276,808,288.11	126,187,531.97

### 7.4.7.13 债券投资收益

#### 7.4.7.13.1 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。

#### 7.4.7.13.2 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。

#### 7.4.7.13.3 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。

#### 7.4.7.13.4 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。

#### 7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

### 7.4.7.14 贵金属投资收益

#### 7.4.7.14.1 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。

#### 7.4.7.14.2 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。

#### 7.4.7.14.3 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。

#### 7.4.7.14.4 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。

### 7.4.7.15 衍生工具收益

#### 7.4.7.15.1 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。

**7.4.7.15.2 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。

**7.4.7.16 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	13,705,614.57	4,520,956.43
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	13,705,614.57	4,520,956.43

**7.4.7.17 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-230,781,464.68	290,971,477.14
——股票投资	-230,781,464.68	290,971,477.14
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-230,781,464.68	290,971,477.14

**7.4.7.18 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
其他收入	-	15,000.00

合计	-	15,000.00
----	---	-----------

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。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 13 日(基金合同生 效日)至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	11,205,196.58	3,862,802.87
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	-	-
其中：申购费	-	-
赎回费	-	-
合计	11,205,196.58	3,862,802.87

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 13 日(基金合同 生效日)至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	80,000.00	10,779.06
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
银行费用	738.46	442.41
电子合同费	2,000.00	2,000.00
注册登记费	54,723.53	13,528.73
合计	257,461.99	26,750.20

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
兴证证券资产管理有限公司（“兴证资管”）	集合计划管理人、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
中国工商银行股份有限公司（“工商银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构

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。

### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至 2020年12月31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例
兴业证券	7,217,730,410.46	100.00%	2,699,689,431.26	100.00%

##### 7.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31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	6,723,366.72	100.00%	1,204,331.15	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31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	2,514,213.77	100.00%	778,198.07	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。

## 7.4.10.2 关联方报酬

### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,318,026.53	3,886,269.97
其中：支付销售机构的客户维护费	3,997,994.68	535,370.05

注：(a) 固定管理费

集合计划的管理费按前一日集合计划资产净值的0.6%年费率计提。管理费的计算方法如下：每日应支付的集合计划管理费=前一日的集合计划资产净值×0.6%÷当年天数。

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2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。

(b) 业绩报酬

(1) 业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在集合计划投资人退出日或本集合计划终止日计提业绩报酬。本集合计划分红日，管理人不提取业绩报酬。

(2) 业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。以业绩报酬计提期间的年化收益率R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = (A - B) / C \times 365 / N \times 100\%$$

A=为本次业绩报酬计提日累计单位净值；

B=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的累计单位净值；

C=为上一个业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）的单位净值；

N=为本次计提业绩报酬区间天数，即前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日的间隔天数。

业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划终止日。从前一次业绩报酬计提日（若无则为份额参与本集合计划日）至本次业绩报酬计提日，若计划单位份额年化收益率 R 小于或等于 6%时，管理人提取业绩报酬；若计划单位份额年化收益率 R 大于 6%，管理人对超过 6%以上的部分提取 20%作为业绩报酬。

$$H=(R-6\%) \times 20\% \times C \times F \times N/365$$

（F 为参与计提业绩报酬的份额数）

如投资人退出的份额为多笔参与，则采用“先进先出”法分别对每笔参与的份额计算业绩报酬。

### （3）业绩报酬的支付

管理人的业绩报酬的计算和复核工作由管理人完成，由管理人向托管人发送划付指令，托管人于收到指令后 5 个工作日内从集合计划资产中一次性支付给管理人。

于 2020 年 4 月 13 日（集合计划合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日，本集合计划发生的应支付管理人的业绩报酬为 295,041.12 元；于 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日，本集合计划发生的应支付管理人的业绩报酬为 52,870,245.84 元。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 4 月 13 日（基金合同生效日） 至 2020 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	3,465,844.39	1,619,279.15

注：集合计划的托管费按前一日集合计划资产净值的 0.25%年费率计提。托管费的计算方法如下：

每日应支付的集合计划托管费=前一日的集合计划资产净值×0.25%÷当年天数。

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 2 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。

**7.4.10.2.3 销售服务费**

本集合计划无销售服务费。

**7.4.10.3 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末与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

**7.4.10.4 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****7.4.10.4.1 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。

**7.4.10.4.2 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。

**7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

份额单位：份

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020年4月13日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	0.00	11,002,248.69
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	11,002,248.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	1.6959%

项目	上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至2020年12月31日	
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020年4月13日）持有的基金份额	0.00	11,002,248.69
报告期初持有的基金份额	0.00	11,002,248.69

报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	0.00	11,002,248.69
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0000%	1.3171%

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。

#### 7.4.10.5.2 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。

#### 7.4.10.6 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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年4月13日(基金合同生效日)至 2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	70,911,347.54	691,779.09	116,963,059.95	441,102.11

注：本集合计划的银行存款由本集合计划的托管人中国工商银行股份有限公司保管，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.7 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内未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

#### 7.4.10.8 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。

#### 7.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期末未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688176	亚虹	2021年	2022	新股流	22.98	22.98	37,986	872,918.28	872,918.28	-

	医药	12月29日	2021年1月7日	通受限							
601728	中国电信	2021年8月11日	2022年2月21日	新股流通受限	4.53	4.27	59,111	267,772.83	252,403.97		-
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股流通受限	41.98	41.98	5,297	222,368.06	222,368.06		-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股流通受限	60.66	96.75	831	50,408.46	80,399.25		-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	60.64	234.74	145	8,792.80	34,037.30		-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股流通受限	22.04	56.28	441	9,719.64	24,819.48		-
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股流通受限	93.09	75.34	297	27,647.73	22,375.98		-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股流通受限	10.45	11.22	1,625	16,981.25	18,232.50		-
301029	怡合达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股流通受限	14.14	89.87	194	2,743.16	17,434.78		-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股流通受限	6.96	12.51	1,373	9,556.08	17,176.23		-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股流通受限	79.60	78.53	204	16,238.40	16,020.12		-
301211	亨迪药业	2021年12月14日	2022年6月22日	新股流通受限	25.80	33.65	459	11,842.20	15,445.35		-
301127	C 天源	2021年12月23日	2022年6月30日	新股流通受限	12.03	17.12	851	10,237.53	14,569.12		-
301221	光庭信息	2021年12月15日	2022年6月22日	新股流通受限	69.89	88.72	159	11,112.51	14,106.48		-
301189	C 奥尼	2021年12月21日	2022年6月28日	新股流通受限	66.18	56.62	228	15,089.04	12,909.36		-

301166	C 优 宁维	2021 年 12 月 21 日	2022 年 6 月 28 日	新股流 通受限	86.06	94.50	135	11,618.10	12,757.50	-
301069	凯盛 新材	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流 通受限	5.17	44.21	249	1,287.33	11,008.29	-
301093	华兰 股份	2021 年 10 月 21 日	2022 年 5 月 2 日	新股流 通受限	58.08	49.85	220	12,777.60	10,967.00	-
301179	泽宇 智能	2021 年 12 月 1 日	2022 年 6 月 8 日	新股流 通受限	43.99	50.77	189	8,314.11	9,595.53	-
301099	雅创 电子	2021 年 11 月 10 日	2022 年 5 月 23 日	新股流 通受限	21.99	71.36	133	2,924.67	9,490.88	-
301100	风光 股份	2021 年 12 月 10 日	2022 年 6 月 17 日	新股流 通受限	27.81	31.14	304	8,454.24	9,466.56	-
301190	善水 科技	2021 年 12 月 17 日	2022 年 6 月 24 日	新股流 通受限	27.85	27.46	343	9,552.55	9,418.78	-
301168	通灵 股份	2021 年 12 月 2 日	2022 年 6 月 10 日	新股流 通受限	39.08	52.13	180	7,034.40	9,383.40	-
301088	戎美 股份	2021 年 10 月 19 日	2022 年 4 月 28 日	新股流 通受限	33.16	24.67	380	12,600.80	9,374.60	-
301058	中粮 工科	2021 年 9 月 1 日	2022 年 3 月 9 日	新股流 通受限	3.55	18.24	499	1,771.45	9,101.76	-
301108	洁雅 股份	2021 年 11 月 25 日	2022 年 6 月 3 日	新股流 通受限	57.27	53.71	163	9,335.01	8,754.73	-
300994	久祺 股份	2021 年 8 月 2 日	2022 年 2 月 14 日	新股流 通受限	11.90	45.45	173	2,058.70	7,862.85	-
301018	申菱 环境	2021 年 6 月 28 日	2022 年 1 月 7 日	新股流 通受限	8.29	26.06	268	2,221.72	6,984.08	-
301046	能辉 科技	2021 年 8 月 10 日	2022 年 2 月 17 日	新股流 通受限	8.34	48.99	141	1,175.94	6,907.59	-
301101	明月 镜片	2021 年 12 月 9 日	2022 年 6 月	新股流 通受限	26.91	43.36	154	4,144.14	6,677.44	-

		日	16日								
301089	拓新药业	2021年10月20日	2022年4月27日	新股流通受限	19.11	67.93	97	1,853.67	6,589.21	-	
301149	隆华新材	2021年11月3日	2022年5月10日	新股流通受限	10.07	16.76	381	3,836.67	6,385.56	-	
301118	恒光股份	2021年11月9日	2022年5月18日	新股流通受限	22.70	49.02	129	2,928.30	6,323.58	-	
301092	争光股份	2021年10月21日	2022年5月2日	新股流通受限	36.31	35.52	178	6,463.18	6,322.56	-	
301199	迈赫股份	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	29.28	32.00	195	5,709.60	6,240.00	-	
301180	万祥科技	2021年11月9日	2022年5月16日	新股流通受限	12.20	22.72	259	3,159.80	5,884.48	-	
301138	华研精机	2021年12月8日	2022年6月15日	新股流通受限	26.17	44.86	124	3,245.08	5,562.64	-	
301026	浩通科技	2021年7月8日	2022年1月17日	新股流通受限	18.03	62.73	87	1,568.61	5,457.51	-	
301082	久盛电气	2021年10月14日	2022年4月27日	新股流通受限	15.48	21.53	253	3,916.44	5,447.09	-	
301028	东亚机械	2021年7月12日	2022年1月20日	新股流通受限	5.31	13.50	390	2,070.90	5,265.00	-	
301021	英诺激光	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	9.46	41.43	126	1,191.96	5,220.18	-	
301048	金鹰重工	2021年8月11日	2022年2月18日	新股流通受限	4.13	12.96	391	1,614.83	5,067.36	-	
301111	粤万年青	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	10.48	36.68	134	1,404.32	4,915.12	-	
301126	达嘉维康	2021年11月30日	2022年6月7日	新股流通受限	12.37	19.23	254	3,141.98	4,884.42	-	
301060	兰卫	2021年	2022	新股流	4.17	30.94	151	629.67	4,671.94	-	

	医学	9月6日	2021年3月14日	通受限							
301020	密封科技	2021年6月28日	2022年1月6日	新股流通受限	10.64	30.44	148	1,574.72	4,505.12	-	
301193	家联科技	2021年12月2日	2022年6月9日	新股流通受限	30.73	29.14	153	4,701.69	4,458.42	-	
301098	金埔园林	2021年11月4日	2022年5月12日	新股流通受限	12.36	22.17	193	2,385.48	4,278.81	-	
301078	孩子王	2021年9月30日	2022年4月14日	新股流通受限	5.77	12.14	344	1,984.88	4,176.16	-	
301185	鸥玛软件	2021年11月11日	2022年5月19日	新股流通受限	11.88	21.16	190	2,257.20	4,020.40	-	
301133	金钟股份	2021年11月19日	2022年5月26日	新股流通受限	14.33	26.95	147	2,106.51	3,961.65	-	
300814	中富电路	2021年8月4日	2022年2月14日	新股流通受限	8.40	23.88	165	1,386.00	3,940.20	-	
301066	万事利	2021年9月13日	2022年3月22日	新股流通受限	5.24	22.84	171	896.04	3,905.64	-	
300774	倍杰特	2021年7月26日	2022年2月4日	新股流通受限	4.57	21.08	185	845.45	3,899.80	-	
301030	仕净科技	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	6.10	31.52	116	707.60	3,656.32	-	
301055	张小泉	2021年8月26日	2022年3月7日	新股流通受限	6.90	21.78	156	1,076.40	3,397.68	-	
301040	中环海陆	2021年7月26日	2022年2月3日	新股流通受限	13.57	38.51	88	1,194.16	3,388.88	-	
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股流通受限	15.14	59.97	55	832.70	3,298.35	-	
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股流通受限	7.46	33.41	95	708.70	3,173.95	-	



301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股流通受限	19.34	32.92	92	1,779.28	3,028.64	-
301182	凯旺科技	2021年12月16日	2022年6月23日	新股流通受限	27.12	30.58	99	2,684.88	3,027.42	-
301198	喜悦智行	2021年11月25日	2022年6月2日	新股流通受限	21.76	29.20	96	2,088.96	2,803.20	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月7日	新股流通受限	23.38	29.93	92	2,150.96	2,753.56	-
301053	远信工业	2021年8月25日	2022年3月1日	新股流通受限	11.87	28.78	95	1,127.65	2,734.10	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股流通受限	3.93	11.09	245	962.85	2,717.05	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股流通受限	17.40	36.11	75	1,305.00	2,708.25	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股流通受限	7.31	28.21	95	694.45	2,679.95	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股流通受限	4.97	12.51	214	1,063.58	2,677.14	-
301025	读客文化	2021年7月6日	2022年1月19日	新股流通受限	1.55	20.88	127	196.85	2,651.76	-
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股流通受限	12.95	17.44	150	1,942.50	2,616.00	-
301038	深水规院	2021年7月22日	2022年2月4日	新股流通受限	6.68	20.23	126	841.68	2,548.98	-
301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股流通受限	12.24	32.00	72	881.28	2,304.00	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股流通受限	8.09	19.30	118	954.62	2,277.40	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月	新股流通受限	9.96	27.29	83	826.68	2,265.07	-

			16 日							
301027	华蓝集团	2021 年 7 月 8 日	2022 年 1 月 17 日	新股流通受限	11.45	16.65	135	1,545.75	2,247.75	-
301057	汇隆新材	2021 年 8 月 31 日	2022 年 3 月 9 日	新股流通受限	8.03	19.02	107	859.21	2,035.14	-
301083	百胜智能	2021 年 10 月 13 日	2022 年 4 月 21 日	新股流通受限	9.08	14.21	130	1,180.40	1,847.30	-
301068	大地海洋	2021 年 9 月 16 日	2022 年 3 月 28 日	新股流通受限	13.98	28.38	63	880.74	1,787.94	-
301037	保立佳	2021 年 7 月 21 日	2022 年 1 月 31 日	新股流通受限	14.82	24.26	73	1,081.86	1,770.98	-
301079	邵阳液压	2021 年 10 月 11 日	2022 年 4 月 19 日	新股流通受限	11.92	24.82	63	750.96	1,563.66	-
001234	泰慕士	2021 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 11 日	新股流通受限	16.53	16.53	90	1,487.70	1,487.70	-

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2021 年 12 月 31 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。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本集合计划本报告期末未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.4 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,故此不适用于。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划为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。

本集合计划的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、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、可转换债券（含分离交易的可转债）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他证券品种。本集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资占集合计划总资产的比例为 50%-95%；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。

#### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 信用风险

本集合计划于本报告期末持有债券、资产支持证券、同业存单合计金额占资产净值的比例为 0%（上年末：0%）。

本集合计划的管理人在交易前对交易对手资信状况进行了充分的评估。本集合计划的银行存款存放在本集合计划开立于托管人交通银行股份有限公司的托管账户，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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划的管理人在集合计划运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本集合计划组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本集合计划的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本集合计划持有一家公司发行的证券，其市值不超过集合计划资产净值的 10%；本集合计划管理人管理的全部大集合资产管理计划（大集合资产管理计划系指投资人数不受 200 人限制的资产管理计划，下同）持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本集合计划管理人管理的全部公开募集性质的集合资产管理计划持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 15%；本集合计划管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制）。

本集合计划所持证券均在证券交易所上市；因此，除在附注 7.4.12 中列示的本集合计划于期末持有的流通受限证券外，本期末本集合计划的其他资产均能及时变现。此外，本集合计划可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过集合计划持有的债券投资的公允价值。本集合计划主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过集合计划资产净值的 15%。

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。

本集合计划的管理人每日预测本集合计划的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产					
银行存款	70,911,347.54	-	-	-	70,911,347.54
结算备付金	2,323,469.54	-	-	-	2,323,469.54
存出保证金	427,870.47	-	-	-	427,870.47
交易性金融 资产	-	-	-	919,954,725.40	919,954,725.40
应收证券清	-	-	-	90,254,354.73	90,254,354.73

算款					
应收利息		-	-	-	-14,761.93
应收申购款		-	-	-	67,138.02
资产总计	73,662,687.55			-1,010,261,456.22	1,083,924,143.77
负债					
应付赎回款		-	-	-	1,935,700.00
应付管理人报酬		-	-	-	595,042.12
应付托管费		-	-	-	232,106.15
应付交易费用		-	-	-	1,204,331.15
应交税费		-	-	-	2,476.61
其他负债		-	-	-	200,000.00
负债总计		-	-	-	4,169,656.03
利率敏感度缺口	73,662,687.55			-1,006,091,800.19	1,079,754,487.74
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	116,963,059.95				116,963,059.95
结算备付金	2,061,973.56				2,061,973.56
存出保证金	262,742.87				262,742.87
交易性金融资产				-1,181,613,693.36	1,181,613,693.36
应收证券清算款					2,351,843.29
应收利息					15,329.87
应收申购款					2,575,957.13
资产总计	119,287,776.38			-1,186,556,823.65	1,305,844,600.03
负债					
应付赎回款					436,551.89
应付管理人报酬					613,477.36
应付托管费					253,542.48
应付交易费用					778,198.07
其他负债					15,000.00
负债总计					2,096,769.80
利率敏感度缺口	119,287,776.38			-1,184,460,053.85	1,303,747,830.23

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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：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 6.82%，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。

#### 7.4.13.4.2 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，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

本集合计划所面临的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证券交易所上市交易的股票，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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	919,954,725.40	85.20	1,181,613,693.36	90.63
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	919,954,725.40	85.20	1,181,613,693.36	90.63

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除本计划业绩比较基准外的其他市场变量保持不变。
----	-------------------------

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（2021年12月31日）	上年度末（2020年12月31日）
	业绩比较基准上升 5%	51,286,720.61	80,627,327.01
	业绩比较基准下降 5%	-51,286,720.61	-80,627,327.01

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）。

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 7.4.14.1 以公允价值计量的资产和负债

下表列示了本集合计划在每个资产负债表日持续和非持续以公允价值计量的资产和负债于本报告期末的公允价值信息及其公允价值计量的层次。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。

##### (a) 第二层次的公允价值计量

对于本集合计划投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本集合计划不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本集合计划综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

于 2021 年 12 月 31 日，本集合持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 917,990,927.13 元，第二层次的余额为 1,963,798.27 元，无属于第三层次的余额。

于 2020 年 12 月 31 日，本集合持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融工具中属于第一层次的余额为 1,179,007,731.28 元，第二层次的余额为 2,605,962.08 元，无属于第三层次的余额。

##### (b) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于 2021 年 12 月 31 日，本集合计划无非持续的以公允价值计量的金融工具。



## 7.4.14.2 其他金融工具的公允价值（期末非以公允价值计量的项目）

其他金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	919,954,725.40	84.87
	其中：股票	919,954,725.40	84.87
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	73,234,817.08	6.76
8	其他各项资产	90,734,601.29	8.37
9	合计	1,083,924,143.77	100.00

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	663,104,269.81	61.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	69,429,795.00	6.43
E	建筑业	21,133,478.81	1.96
F	批发和零售业	40,683.56	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	11,213,284.00	1.04
H	住宿和餐饮业	2,304.00	0.00

I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,047,458.64	1.12
J	金融业	92,794,754.12	8.59
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	11,354,616.00	1.05
M	科学研究和技术服务业	38,648,613.95	3.58
N	水利、环境和公共设施管理业	178,143.81	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,671.94	0.00
R	文化、体育和娱乐业	2,651.76	0.00
S	综合	-	-
	合计	919,954,725.40	85.20

### 8.2.2 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期末未持有港股通投资股票。

### 8.3 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	780,954	78,532,734.24	7.27
2	600519	贵州茅台	34,472	70,667,600.00	6.54
3	600036	招商银行	1,286,700	62,675,157.00	5.80
4	600456	宝钛股份	818,500	58,751,930.00	5.44
5	600690	海尔智家	1,811,100	54,133,779.00	5.01
6	600887	伊利股份	1,068,691	44,307,928.86	4.10
7	002415	海康威视	836,400	43,760,448.00	4.05
8	002241	歌尔股份	800,100	43,285,410.00	4.01
9	688665	四方光电	234,544	42,034,975.68	3.89
10	603995	甬金股份	720,105	41,665,275.30	3.86
11	600150	中国船舶	1,098,400	27,229,336.00	2.52
12	600011	华能国际	2,389,100	23,150,379.00	2.14
13	603893	瑞芯微	167,300	22,903,370.00	2.12
14	601669	中国电建	2,615,000	21,129,200.00	1.96
15	603259	药明康德	177,100	21,000,518.00	1.94
16	000661	长春高新	75,600	20,517,840.00	1.90
17	002304	洋河股份	122,300	20,146,479.00	1.87
18	002734	利民股份	1,492,288	19,548,972.80	1.81

19	600483	福能股份	1,083,100	17,632,868.00	1.63
20	300012	华测检测	655,425	17,611,269.75	1.63
21	600926	杭州银行	1,360,016	17,435,405.12	1.61
22	600905	三峡能源	2,240,300	16,824,653.00	1.56
23	603985	恒润股份	282,900	15,112,518.00	1.40
24	601688	华泰证券	714,200	12,684,192.00	1.17
25	300014	亿纬锂能	105,000	12,408,900.00	1.15
26	600027	华电国际	2,209,700	11,821,895.00	1.09
27	688099	晶晨股份	88,671	11,544,964.20	1.07
28	002027	分众传媒	1,386,400	11,354,616.00	1.05
29	600522	中天科技	661,600	11,220,736.00	1.04
30	603606	东方电缆	219,200	11,214,272.00	1.04
31	002352	顺丰控股	162,700	11,213,284.00	1.04
32	600585	海螺水泥	262,800	10,590,840.00	0.98
33	601012	隆基股份	95,200	8,206,240.00	0.76
34	605068	明新旭腾	144,600	5,227,290.00	0.48
35	688176	亚虹医药	37,986	872,918.28	0.08
36	688167	炬光科技	1,330	291,270.00	0.03
37	601728	中国电信	59,111	252,403.97	0.02
38	688262	国芯科技	5,297	222,368.06	0.02
39	301127	天源环保	8,505	168,950.30	0.02
40	301155	海力风电	831	80,399.25	0.01
41	301050	雷电微力	145	34,037.30	0.00
42	301035	润丰股份	441	24,819.48	0.00
43	301087	可孚医疗	297	22,375.98	0.00
44	301090	华润材料	1,625	18,232.50	0.00
45	301029	怡合达	194	17,434.78	0.00
46	301039	中集车辆	1,373	17,176.23	0.00
47	301096	百诚医药	204	16,020.12	0.00
48	301211	亨迪药业	459	15,445.35	0.00
49	301221	光庭信息	159	14,106.48	0.00
50	301189	奥尼电子	228	12,909.36	0.00
51	301166	优宁维	135	12,757.50	0.00
52	301069	凯盛新材	249	11,008.29	0.00
53	301093	华兰股份	220	10,967.00	0.00
54	301179	泽宇智能	189	9,595.53	0.00
55	301099	雅创电子	133	9,490.88	0.00
56	301100	风光股份	304	9,466.56	0.00
57	301190	善水科技	343	9,418.78	0.00

58	301168	通灵股份	180	9,383.40	0.00
59	301088	戎美股份	380	9,374.60	0.00
60	301058	中粮工科	499	9,101.76	0.00
61	301108	洁雅股份	163	8,754.73	0.00
62	300994	久祺股份	173	7,862.85	0.00
63	301018	申菱环境	268	6,984.08	0.00
64	301046	能辉科技	141	6,907.59	0.00
65	301101	明月镜片	154	6,677.44	0.00
66	301089	拓新药业	97	6,589.21	0.00
67	301149	隆华新材	381	6,385.56	0.00
68	301118	恒光股份	129	6,323.58	0.00
69	301092	争光股份	178	6,322.56	0.00
70	301199	迈赫股份	195	6,240.00	0.00
71	301180	万祥科技	259	5,884.48	0.00
72	301138	华研精机	124	5,562.64	0.00
73	301026	浩通科技	87	5,457.51	0.00
74	301082	久盛电气	253	5,447.09	0.00
75	301028	东亚机械	390	5,265.00	0.00
76	301021	英诺激光	126	5,220.18	0.00
77	301048	金鹰重工	391	5,067.36	0.00
78	301111	粤万年青	134	4,915.12	0.00
79	301126	达嘉维康	254	4,884.42	0.00
80	301060	兰卫医学	151	4,671.94	0.00
81	301020	密封科技	148	4,505.12	0.00
82	301193	家联科技	153	4,458.42	0.00
83	301098	金埔园林	193	4,278.81	0.00
84	301078	孩子王	344	4,176.16	0.00
85	301185	鸥玛软件	190	4,020.40	0.00
86	301133	金钟股份	147	3,961.65	0.00
87	300814	中富电路	165	3,940.20	0.00
88	301066	万事利	171	3,905.64	0.00
89	300774	倍杰特	185	3,899.80	0.00
90	301030	仕净科技	116	3,656.32	0.00
91	301055	张小泉	156	3,397.68	0.00
92	301040	中环海陆	88	3,388.88	0.00
93	301033	迈普医学	55	3,298.35	0.00
94	301072	中捷精工	95	3,173.95	0.00
95	301049	超越科技	92	3,028.64	0.00
96	301182	凯旺科技	99	3,027.42	0.00

97	301198	喜悦智行	96	2,803.20	0.00
98	301036	双乐股份	92	2,753.56	0.00
99	301053	远信工业	95	2,734.10	0.00
100	301056	森赫股份	245	2,717.05	0.00
101	301063	海锅股份	75	2,708.25	0.00
102	301041	金百泽	95	2,679.95	0.00
103	301032	新柴股份	214	2,677.14	0.00
104	301025	读客文化	127	2,651.76	0.00
105	301081	严牌股份	150	2,616.00	0.00
106	301038	深水规院	126	2,548.98	0.00
107	301073	君亭酒店	72	2,304.00	0.00
108	301059	金三江	118	2,277.40	0.00
109	300854	中兰环保	83	2,265.07	0.00
110	301027	华蓝集团	135	2,247.75	0.00
111	301057	汇隆新材	107	2,035.14	0.00
112	301083	百胜智能	130	1,847.30	0.00
113	301068	大地海洋	63	1,787.94	0.00
114	301037	保立佳	73	1,770.98	0.00
115	301079	邵阳液压	63	1,563.66	0.00
116	001234	泰慕士	90	1,487.70	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	181,796,822.10	13.94
2	002352	顺丰控股	135,679,363.44	10.41
3	002415	海康威视	110,117,899.89	8.45
4	000661	长春高新	109,174,452.54	8.37
5	600036	招商银行	109,020,251.67	8.36
6	600570	恒生电子	103,132,734.74	7.91
7	603986	兆易创新	88,668,083.92	6.80
8	002508	老板电器	81,037,507.07	6.22
9	600426	华鲁恒升	79,922,768.76	6.13
10	002371	北方华创	75,499,760.70	5.79
11	600690	海尔智家	72,402,871.87	5.55

12	300750	宁德时代	70,377,733.44	5.40
13	600456	宝钛股份	69,489,994.40	5.33
14	002555	三七互娱	65,217,789.84	5.00
15	603259	药明康德	62,633,244.74	4.80
16	002572	索菲亚	61,325,413.57	4.70
17	000002	万科A	60,951,400.80	4.68
18	600519	贵州茅台	58,956,654.30	4.52
19	688981	中芯国际	57,248,252.75	4.39
20	603899	晨光文具	54,264,318.01	4.16
21	002241	歌尔股份	49,372,852.00	3.79
22	002142	宁波银行	46,522,955.24	3.57
23	600905	三峡能源	44,022,979.00	3.38
24	600887	伊利股份	43,941,029.00	3.37
25	600584	长电科技	43,348,184.00	3.32
26	300144	宋城演艺	41,218,561.00	3.16
27	300171	东富龙	39,686,726.06	3.04
28	000807	云铝股份	39,593,677.10	3.04
29	002938	鹏鼎控股	38,292,377.47	2.94
30	603833	欧派家居	37,819,547.00	2.90
31	603995	甬金股份	36,506,389.92	2.80
32	600150	中国船舶	36,019,719.04	2.76
33	600167	联美控股	35,853,755.41	2.75
34	688665	四方光电	34,565,123.09	2.65
35	603801	志邦家居	34,536,798.80	2.65
36	000333	美的集团	34,386,851.64	2.64
37	600760	中航沈飞	33,562,374.60	2.57
38	601225	陕西煤业	33,328,266.00	2.56
39	600522	中天科技	32,047,817.00	2.46
40	601066	中信建投	30,964,478.17	2.38
41	601567	三星医疗	30,478,465.82	2.34
42	603985	恒润股份	30,018,532.50	2.30
43	300244	迪安诊断	29,555,217.50	2.27
44	601658	邮储银行	28,769,893.18	2.21
45	600587	新华医疗	28,592,774.56	2.19
46	600011	华能国际	27,614,214.00	2.12
47	600085	同仁堂	26,875,475.80	2.06

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002179	中航光电	237,602,109.46	18.22
2	600426	华鲁恒升	193,613,495.87	14.85
3	002415	海康威视	176,051,200.85	13.50
4	300750	宁德时代	135,959,740.50	10.43
5	002371	北方华创	125,933,787.75	9.66
6	603899	晨光文具	111,188,085.85	8.53
7	002352	顺丰控股	110,700,096.94	8.49
8	603986	兆易创新	109,652,036.72	8.41
9	002142	宁波银行	108,375,990.53	8.31
10	000661	长春高新	101,057,307.36	7.75
11	000858	五粮液	95,164,426.80	7.30
12	600570	恒生电子	88,934,179.99	6.82
13	601318	中国平安	86,031,121.04	6.60
14	300454	深信服	80,096,001.00	6.14
15	000333	美的集团	78,201,633.80	6.00
16	600519	贵州茅台	73,583,459.61	5.64
17	300144	宋城演艺	71,619,439.63	5.49
18	603833	欧派家居	68,580,688.84	5.26
19	002508	老板电器	66,675,178.62	5.11
20	000002	万科A	57,750,603.88	4.43
21	002572	索菲亚	57,730,883.67	4.43
22	300012	华测检测	54,604,705.42	4.19
23	688981	中芯国际	54,357,003.95	4.17
24	002555	三七互娱	49,495,955.74	3.80
25	300760	迈瑞医疗	41,744,915.58	3.20
26	600584	长电科技	39,343,794.00	3.02
27	300059	东方财富	39,226,069.99	3.01
28	600036	招商银行	37,669,583.46	2.89
29	002938	鹏鼎控股	35,904,254.26	2.75
30	000807	云铝股份	34,518,416.40	2.65
31	603259	药明康德	33,932,717.12	2.60
32	603345	安井食品	32,824,994.53	2.52

33	601225	陕西煤业	32,493,594.00	2.49
34	600167	联美控股	31,928,342.00	2.45
35	601567	三星医疗	31,838,807.20	2.44
36	603985	恒润股份	31,442,998.12	2.41
37	600690	海尔智家	31,150,979.68	2.39
38	603801	志邦家居	31,126,237.20	2.39
39	600905	三峡能源	31,050,516.00	2.38
40	600276	恒瑞医药	30,294,696.14	2.32
41	600760	中航沈飞	30,181,891.04	2.32
42	002821	凯莱英	29,034,105.00	2.23
43	300171	东富龙	28,855,531.69	2.21
44	002092	中泰化学	28,586,360.00	2.19
45	600587	新华医疗	27,842,997.52	2.14
46	600085	同仁堂	27,022,732.00	2.07

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,465,094,497.45
卖出股票收入（成交）总额	3,772,780,288.84

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.5 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。

#### 8.6 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。

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

#### 8.9 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。

#### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

##### 8.10.1 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。



## 8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本集合计划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。本集合计划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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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，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。

### 8.11.2 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。

### 8.11.3 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到调查以及处罚的情况的说明

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辑日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

### 8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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。

### 8.12.3 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	427,870.47
2	应收证券清算款	90,254,354.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-14,761.93
5	应收申购款	67,138.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	90,734,601.29

**8.12.4 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。

**8.12.5 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。

**8.12.6 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。

**§ 9 基金份额持有人信息****9.1 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
兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	24,104	25,612.51	7,393,222.65	1.20%	609,970,728.66	98.80%
兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	107	293,251.90	11,002,248.69	35.06%	20,375,704.97	64.94%
合计	24,211	26,795.34	18,395,471.34	2.84%	630,346,433.63	97.16%

**9.2 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	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	958,485.94	0.1477%
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	0.00	0.0000%
	合计	958,485.94	0.1477%

### 9.3 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的情况

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	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	0~10
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	10~50
	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C	0
	合计	10~50

### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

本报告期内，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划的投资经理，故本项不适用。

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 A	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合 C
基金合同生效日（2020 年 4 月 13 日）基金份额总额	-	67,343,911.97
本报告期期初基金份额总额	792,974,961.30	42,341,308.01
本报告期基金总申购份额	393,720,015.33	-
减：本报告期基金总赎回份额	569,331,025.32	10,963,354.35
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	617,363,951.31	31,377,953.66

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。

## § 11 重大事件揭示

## 11.1 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。

## 11.2 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：

2021 年 1 月，郭小军先生不再担任公司董事长。2021 年 1 月至 2021 年 4 月，孔祥杰先生担任公司董事长，2021 年 4 月起，胡平生先生担任公司董事长。

2021 年 2 月，王承炜先生不再担任公司总裁，并由董事长孔祥杰先生代任总裁。之后曾旭先生担任公司总裁，董事长孔祥杰先生不再代任公司总裁。

2021 年 1 月，郭小军先生不再担任公司法定代表人。2021 年 1 月至 2021 年 5 月，孔祥杰先生担任公司法定代表人，2021 年 5 月起，胡平生先生担任公司法定代表人。

2021 年 4 月，林丹先生不再担任公司副总裁、合规总监、首席风险官。2021 年 4 月起，付志坚先生担任公司合规总监、首席风险官。

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

### 11.3 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。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内集合计划管理人未改聘会计师事务所。本集合计划聘请毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)为本集合计划提供审计服务。本年度支付给所聘任的会计师事务所 1.5 万元人民币。

### 11.6 管理人、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，本集合计划管理人、托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	7,217,730,410.46	100.00%	6,723,366.72	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。

#### 11.7.2 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
------	------	--------	------

	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
兴业证券	-	-	300,000,000.00	100.00%	-	-

## 11.8 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高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2021年1月5日
2	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2020年第4季度报告	规定网站、规定报刊	2021年1月22日
3	兴证证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	规定网站、规定报刊	2021年1月23日
4	兴证证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2021年2月5日
5	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加销售机构的公告	规定网站、规定报刊	2021年2月6日
6	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划调整天天基金申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021年2月20日
7	兴证证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2021年2月23日
8	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加蚂蚁基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021年3月5日
9	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2020年年度报告	规定网站	2021年3月31日
10	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划(A类份额)产品资料概要更新	规定网站	2021年4月12日
11	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划(C类份额)产品资料	规定网站	2021年4月12日

	概要更新		
12	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书更新(2021年4月更新)	规定网站	2021年4月12日
13	兴证证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2021年4月21日
14	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2021年第1季度报告	规定网站	2021年4月22日
15	兴证证券资产管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2021年4月29日
16	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划开放日常赎回业务公告	规定网站、规定报刊	2021年5月7日
17	兴证证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	规定网站、规定报刊	2021年5月20日
18	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划2021年第2季度报告	规定网站	2021年7月21日
19	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加腾安基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021年7月27日
20	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划(A类份额)产品资料概要更新	规定网站	2021年7月30日
21	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划(C类份额)产品资料概要更新	规定网站	2021年7月30日
22	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划招募说明书更新(2021年7月更新)	规定网站	2021年7月30日
23	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划变更投资经理的公告	规定网站、规定报刊	2021年7月30日
24	兴证证券资产管理有限公司	规定网站、规定报刊	2021年8月17日

	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加宁波银行股份有限公司为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告		
25	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2021 年中期报告	规定网站	2021 年 8 月 30 日
26	兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划 2021 年第 3 季度报告	规定网站	2021 年 10 月 27 日
27	关于兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划增加盈米基金为销售机构并参加申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2021 年 12 月 16 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。



## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴证资管金麒麟领先优势集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟领先优势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。

### 13.2 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）。

### 13.3 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

2022 年 3 月 31 日