

兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产
管理计划
2023 年中期报告

2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

集合计划管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

集合计划托管人交通银行股份有限公司根据本集合计划合同规定，于 2023 年 8 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	8
§4 管理人报告	13
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	13
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.....	15
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	16
§5 托管人报告	17
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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表.....	18
6.2 利润表.....	19
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	20

6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	53
7.1 期末基金资产组合情况	53
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	58
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	58
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	58
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	58
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	59
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	59
7.12 投资组合报告附注	59
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	61
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66

11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§12 备查文件目录	67
12.1 备查文件目录	67
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划		
基金简称	兴证资管金麒麟消费升级混合		
基金主代码	970068		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2021 年 8 月 2 日		
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司		
基金托管人	交通银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	195,397,411.14 份		
基金合同存续期	本集合计划自资产管理合同变更生效日起存续期不得超过 3 年，后续按照中国证监会有关规定执行。		
下属分级基金的基金简称	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	兴证资管金麒麟消费升级混合 C
下属分级基金的交易代码	970067	970068	970069
报告期末下属分级基金份额总额	108,371,460.96 份	58,878,255.00 份	28,147,695.18 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业证券金麒麟消费升级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业证券金麒麟消费升级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。《兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 8 月 2 日生效。“兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟消费升级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，“兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划”B 类份额自 2021 年 8 月 3 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	本集合计划主要投资于消费相关优质上市公司，同时通过合理的资产配置，追求超越业绩比较基准的长期资产增值。
投资策略	本集合计划主要策略包括大类资产配置策略，即主要是通过对宏观经济周期运行规律的研究，基于定量与定性相结合的宏观及市场分析，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，力争通过大类资产配置获得部分超额收益。 本集合计划投资策略还包括股票投资策略、固定收益投资策略和金融衍生工具投资策略。股票投资方向为经济增长带动居民收入增长以及人口结构变化驱动消费结构升级的相关主题行业。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。
业绩比较基准	中证内地消费主题指数收益率×65%+中证香港 300 消费指数收益率×20%+中债综合（全价）指数收益率×15%
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。本集合计划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。

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	交通银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	付志坚	陆志俊
	联系电话	021-38565866	95559
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		95562-3	95559
传真		021-38565863	021-62701216
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	中国（上海）自由贸易试验区银城中路 188 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	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码		200135	200336
法定代表人		孙国雄	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.ixzzcgl.com
基金中期报告备置地点	集合计划管理人及集合计划托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

基金级别	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	兴证资管金麒麟消费升级混合 C
3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)	报告期(2023年1月1日 - 2023年6月30日)
本期已实现收益	402,661.48	-47,720.81	65,961.68
本期利润	-3,731,847.67	-2,119,617.65	-948,224.95
加权平均基金份额本期利润	-0.0337	-0.0346	-0.0326
本期加权平均净值利润率	-3.83%	-4.03%	-3.73%
本期基金份额净值增长率	-3.92%	-3.92%	-4.17%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)		
期末可供分配利润	-16,855,882.17	-10,294,846.43	-4,593,747.43
期末可供分配基金份额利润	-0.1555	-0.1748	-0.1632
期末基金资产净值	91,515,578.79	48,583,408.57	23,553,947.75
期末基金份额净值	0.8445	0.8252	0.8368
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)		
基金份额累计净值增长率	-15.55%	-17.48%	-16.32%

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

兴证资管金麒麟消费升级混合 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
过去一个月	2.82%	0.86%	4.27%	1.09%	-1.45%	-0.23%
过去三个月	-4.72%	0.75%	-7.45%	0.89%	2.73%	-0.14%
过去六个月	-3.92%	0.87%	-6.23%	0.95%	2.31%	-0.08%
过去一年	-13.20%	1.04%	-16.82%	1.18%	3.62%	-0.14%
自基金合同	-15.55%	1.06%	-17.19%	1.31%	1.64%	-0.25%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

兴证资管金麒麟消费升级混合 B

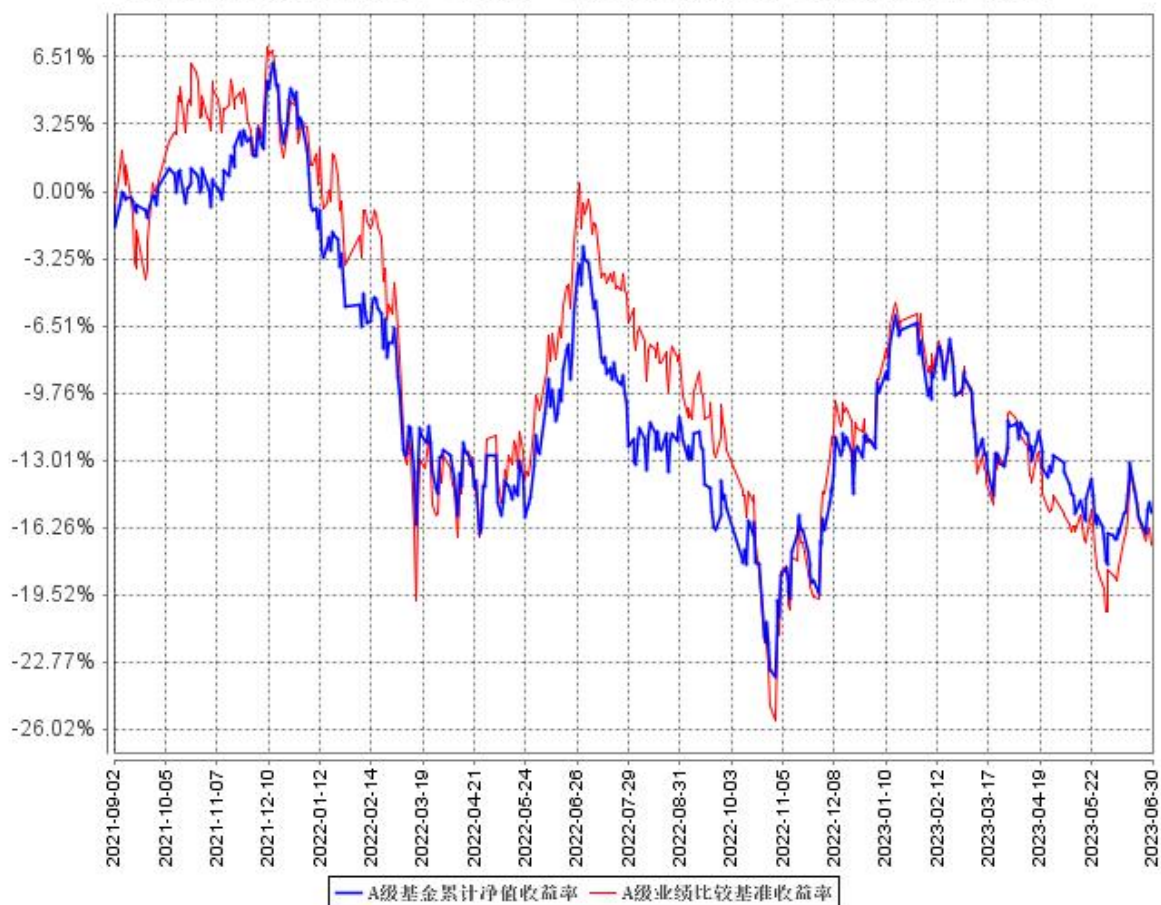
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.83%	0.86%	4.27%	1.09%	-1.44%	-0.23%
过去三个月	-4.71%	0.75%	-7.45%	0.89%	2.74%	-0.14%
过去六个月	-3.92%	0.87%	-6.23%	0.95%	2.31%	-0.08%
过去一年	-13.19%	1.04%	-16.82%	1.18%	3.63%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-17.48%	1.07%	-16.12%	1.32%	-1.36%	-0.25%

兴证资管金麒麟消费升级混合 C

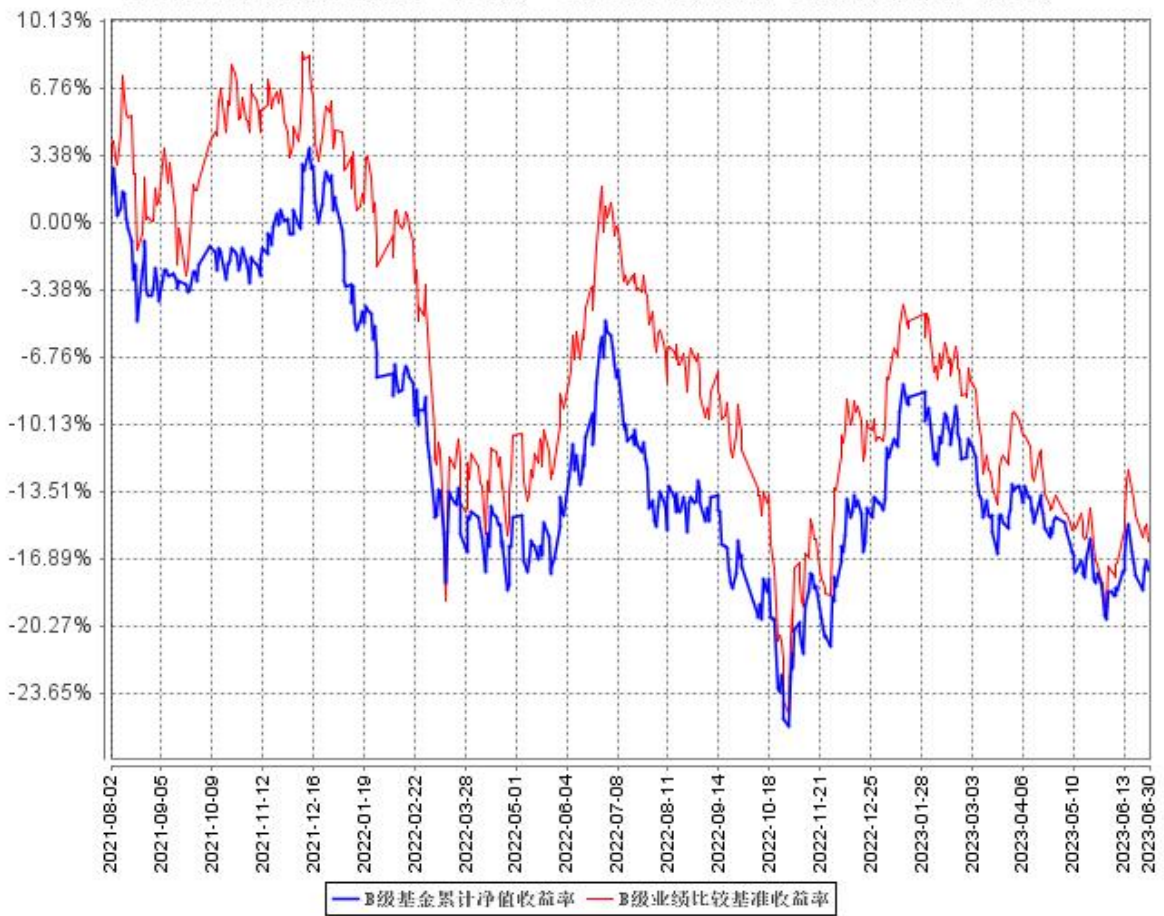
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.78%	0.86%	4.27%	1.09%	-1.49%	-0.23%
过去三个月	-4.84%	0.75%	-7.45%	0.89%	2.61%	-0.14%
过去六个月	-4.17%	0.87%	-6.23%	0.95%	2.06%	-0.08%
过去一年	-13.63%	1.04%	-16.82%	1.18%	3.19%	-0.14%
自基金合同生效起至今	-16.32%	1.06%	-17.19%	1.31%	0.87%	-0.25%

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

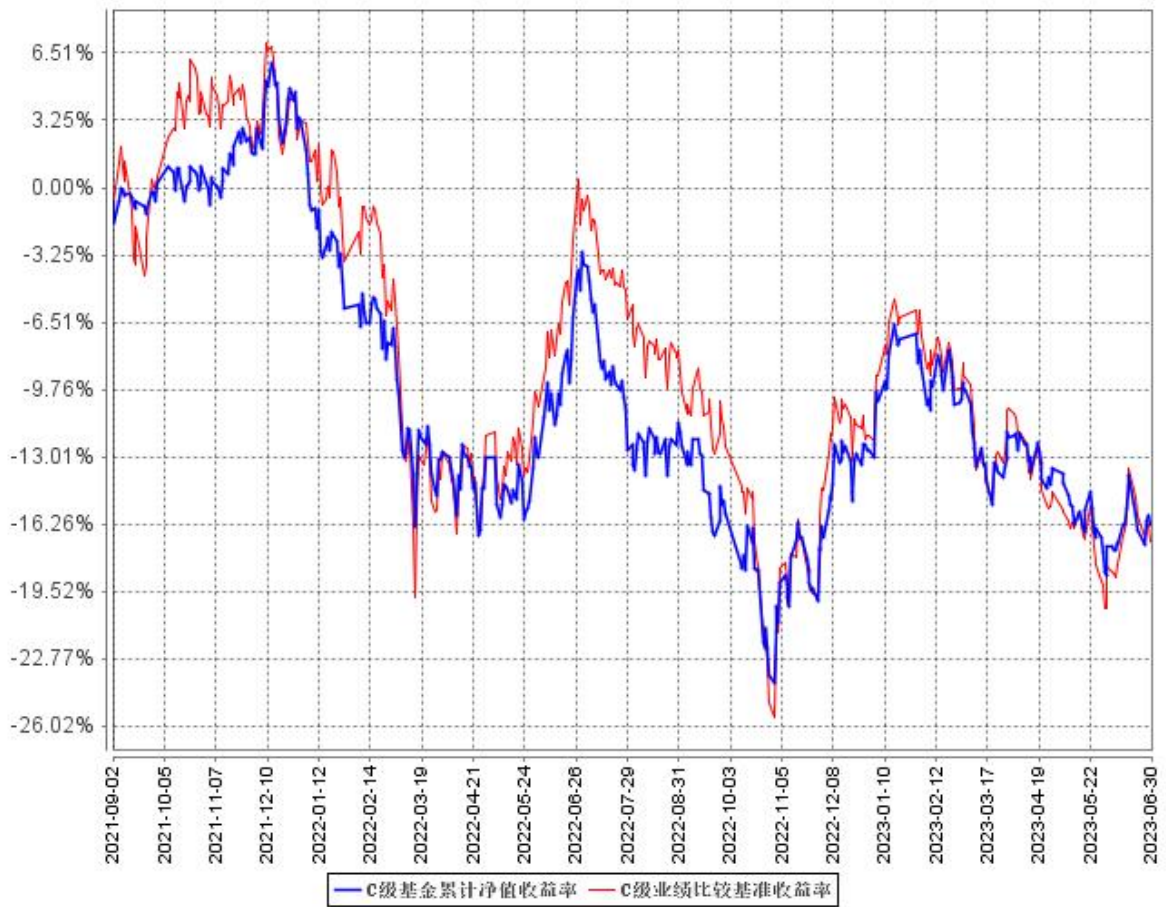
A级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



B级基金累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



C级基金累计净值收益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 2023 年 6 月 30 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

兴证证券资产管理有限公司经中国证监会证监许可[2014]145号文批复，于2014年6月9日正式成立。目前，公司注册资本为8亿元人民币。兴证证券资产管理有限公司是兴业证券股份有限公司（SH 601377）的全资子公司，前身为兴业证券股份有限公司资产管理部，2000年即获准开展资产管理业务，2014年正式成为兴业证券股份有限公司旗下子公司。

十多年来，基于母公司作为现代大型证券金融集团业务链条齐全的禀赋，依托自主培养的、稳健扎实的投资研究底蕴，兴证资管已经发展成为一家极具投资能力禀赋的综合型资产管理机构。固收、权益、创新投资、组合投资、同业投资等多元业务齐头并进，可为机构客户与个人客户提供一站式投融资解决方案。

截止2023年6月30日，兴证证券资产管理有限公司共有10只按照公募基金要求规范运作的大集合资产管理计划，分别为兴证资管金麒麟领先优势一年持有混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟均衡优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴享优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴睿优选一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟3个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划、兴证资管金麒麟现金添利货币型集合资产管理计划、兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型集合资产管理计划。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
匡伟	兴证证券资产管理有限公司权益研究部副总经理、权益投资副总监、公募业务部	2021年8月2日	-	15	北京理工大学硕士。2008年7月进入金融行业，曾任天相投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

	公募投资经理				部总经理助理、公募投资部副总经理。现任权益研究部副总经理、权益投资副总监、公募业务部公募投资经理。
刘欢	兴证证券资产管理有限公司权益研究部总经理助理、公募业务部公募投资经理	2022年9月30日	-	11	复旦大学经济学硕士。2012年7月进入金融行业，2014年10月加入兴证证券资产管理有限公司，历任兴业证券股份有限公司研究所分析师、兴证证券资产管理有限公司研究部研究员、研究部总经理助理、公募投资经理。现任权益研究部总经理助理、公募业务部公募投资经理。
游臻	兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理	2021年8月2日	-	11	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、公募投资部公募投资经理。现任公募业务部公募投资经理。

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“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任投资经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会《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

截止本报告期末，本集合计划投资经理未兼任私募小集合资产管理计划和其他组合的投资经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本集合计划管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法

律法规、证监会规定和集合计划合同的约定，本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用集合计划资产，在严格控制风险的前提下，为集合计划份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本集合计划无重大违法违规行为及违反集合计划合同约定的行为，未有损害集合计划份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本集合计划管理人根据《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》。公司通过科学、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。

本集合计划管理人一贯公平对待旗下管理的所有集合计划和组合，严格遵守相应的制度和流程，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。各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；交易执行环节对各类交易严格流程控制、并持续技术改进，确保了公平交易原则的实现。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本管理人管理的所有投资组合不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况，未发现可能导致不公平交易和利益输送的异常交易情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，市场缺乏整体性机会，TMT 在生成式人工智能技术进步催化下，表现较好。大消费板块内部，分化比较大。食品饮料板块整体回调较多，家电板块由于补库需求以及部分公司激励机制改善，表现较好。医药板块中多数细分板块回调，中药板块表现相对较好，政策支持和基本面较好或是主要原因。

报告期内，本产品主要配置大消费相关行业，具体配置上以食品饮料、家电、家居、医药为主。

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消费升级混合 A 集合计划份额净值为 0.8445 元，本报告期集

合计划份额净值增长率为-3.92%；同期业绩比较基准收益率为-6.23%。

截至本报告期末兴证资管金麒麟消费升级混合 B 集合计划份额净值为 0.8252 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-3.92%；同期业绩比较基准收益率为-6.23%。

截至本报告期末兴证资管金麒麟消费升级混合 C 集合计划份额净值为 0.8368 元，本报告期集合计划份额净值增长率为-4.17%；同期业绩比较基准收益率为-6.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前 A 股市场估值处于较好的性价比位置，但经济处于弱修复中，是影响投资者信心的核心因素。近期，随着政策发力，经济有望逐渐恢复到常态，投资者信心将逐渐恢复，股市有望实现估值逐步修复。

下半年，本产品仍然围绕大消费进行配置，根据经济恢复程度，可能适当增加食品饮料和医药配置比例。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本集合计划管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会对公司依法管理的资管产品的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定资管产品估值业务的操作流程和风险控制，确保资管产品估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值委员会由公司总裁、公司副总裁、公司合规总监、公司总裁助理、各投资部门负责人、各研究部门负责人、合规风控部负责人、交易运营部负责人等人员组成。上述参与估值流程人员均具有专业胜任能力和相关工作经验且投资经理不参与其管理集合计划的具体估值业务。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本集合计划合同，在符合有关集合计划分红条件的前提下，本集合计划每年收益分配次数由管理人决定，若《资产管理合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；集合计划可供分配利润指截至收益分配基准日集合计划未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本集合计划本报告期末进行利润分配，符合相关法规及本集合计划合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划资产净值低于五千万的情形。

本报告期内未出现连续二十个工作日集合计划份额持有人数量不满两百人的情形。

§ 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，托管人在兴证资管金麒麟消费升级混合的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、资产管理合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害集合计划持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，兴证证券资产管理有限公司在兴证资管金麒麟消费升级混合投资运作、资产净值的计算、份额申购赎回价格的计算、费用开支、收益分配等问题上，托管人未发现损害集合计划持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由兴证证券资产管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关兴证资管金麒麟消费升级混合的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,729,676.34	23,441,479.38
结算备付金		190,696.96	222,089.60
存出保证金		55,183.88	64,528.23
交易性金融资产	6.4.7.2	132,747,836.62	160,731,889.62
其中：股票投资		132,747,836.62	148,606,123.04
基金投资		-	-
债券投资		-	12,125,766.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		1,402,015.38	-
应收股利		4,296.00	5,813.47
应收申购款		4,757.87	10,916.61
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		164,134,463.05	184,476,716.91
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.06	1.73

应付赎回款		12,460.48	5,827.13
应付管理人报酬		201,660.11	231,662.12
应付托管费		33,609.99	38,610.36
应付销售服务费		9,702.33	11,606.31
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	149.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	224,094.97	379,761.21
负债合计		481,527.94	667,618.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	195,397,411.14	210,834,302.54
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-31,744,476.03	-27,025,204.48
净资产合计		163,652,935.11	183,809,098.06
负债和净资产总计		164,134,463.05	184,476,716.91

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，兴证资管金麒麟消费升级混合 A 份额净值 0.8445 元，份额总额 108,371,460.96 份；

兴证资管金麒麟消费升级混合 B 份额净值（暂估业绩报酬前）0.8252 元，份额总额 58,878,255.00 份，资产净值（暂估业绩报酬前）48,583,408.57 元，暂估业绩报酬 2,540,449.10 元，资产净值（暂估业绩报酬后）46,042,959.47 元；

兴证资管金麒麟消费升级混合 C 份额净值 0.8368 元，份额总额 28,147,695.18 份；

上述暂估业绩报酬余额是兴证资管金麒麟消费升级混合 B 份额持有人于 2023 年 6 月 30 日暂估业绩报酬的分类合计，兴证资管金麒麟消费升级混合 B 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。

6.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,760,840.27	-14,231,128.05
1.利息收入		40,791.50	103,044.13
其中：存款利息收入	6.4.7.13	39,993.07	93,074.88
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		798.43	9,969.25
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,418,386.75	-17,918,622.62
其中：股票投资收益	6.4.7.14	391,734.17	-19,532,461.77
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	101,743.82	4,031.51
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-	-
股利收益	6.4.7.19	1,924,908.76	1,609,807.64
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-7,220,592.62	3,551,927.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	574.10	32,522.71
减：二、营业总支出		2,038,850.00	2,007,102.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,650,791.53	1,564,531.19
2. 托管费	6.4.10.2.2	218,018.81	260,755.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	63,181.30	78,084.55
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		2.40	29.90
8. 其他费用	6.4.7.23	106,855.96	103,701.28
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,799,690.27	-16,238,230.17
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,799,690.27	-16,238,230.17
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-6,799,690.27	-16,238,230.17

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	210,834,302.54	-	-27,025,204.48	183,809,098.06
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	210,834,302.54	-	-27,025,204.48	183,809,098.06
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-15,436,891.40	-	-4,719,271.55	-20,156,162.95
(一)、综合收益总额	-	-	-6,799,690.27	-6,799,690.27
(二)、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)	-15,436,891.40	-	2,080,418.72	-13,356,472.68
其中：1.基金申购款	1,745,661.06	-	-220,152.65	1,525,508.41
2.基金赎回款	-17,182,552.46	-	2,300,571.37	-14,881,981.09
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收	-	-	-	-

益结转留存收益				
四、本期期末净资产 (基金净值)	195,397,411.14	-	-31,744,476.03	163,652,935.11
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	242,632,881.03	-	6,554,263.25	249,187,144.28
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	242,632,881.03	-	6,554,263.25	249,187,144.28
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-18,527,008.30	-	-14,250,932.45	-32,777,940.75
(一)、综合收益总额	-	-	-16,238,230.17	-16,238,230.17
(二)、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)	-18,527,008.30	-	1,987,297.72	-16,539,710.58
其中: 1.基金申购款	9,319,021.59	-	-690,930.20	8,628,091.39
2.基金赎回款	-27,846,029.89	-	2,678,227.92	-25,167,801.97
(三)、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)	-	-	-	-

（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	224,105,872.73	-	-7,696,669.20	216,409,203.53

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

 孙国雄 孙国雄 林潘颖
 基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划（以下简称“本集合计划”）由兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划变更而来。

2011 年 9 月 20 日，中国证券监督管理委员会作出《关于核准兴业证券股份有限公司设立兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划的批复》（监管许可（2011）1518 号），兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划核准设立，自 2011 年 11 月 7 日起向社会公众发行，2011 年 12 月 2 日结束募集并于 2011 年 12 月 7 日成立。

管理人根据《关于规范金融机构资产管理业务的指导意见》和《证券公司大集合资产管理业务适用〈关于规范金融机构资产管理业务的指导意见〉操作指引》等法规对兴业证券金麒麟消费升级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业证券金麒麟消费升级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。《兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划资产管理合同》于 2021 年 8 月 2 日生效。“兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划”正式更名为“兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划”。

本集合计划为契约型开放式，本集合计划自本资产管理合同变更生效日起存续期不得超过三年，后续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，托管人为交通银行股份有限公司。

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交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、

可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。

如法律法规或监管机构以后允许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比例为集合计划总资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于消费升级主题相关股票的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的投资比例限制，管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本集合计划业绩比较基准：中证内地消费主题指数收益率×65%+中证香港 300 消费指数收益率×20%+中债综合（全价）指数收益率×15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本集合计划财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号〈年度和中期报告〉》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本集合计划财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本集合计划 2023 年 6 月 30 日的财务状况、2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 差错更正的说明

本集合计划本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

如 6.4.1 集合计划基本情况所述，本集合计划已遵照公开募集证券投资基金相关法律、行政法规及中国证监会的规定管理运作。本集合计划目前比照证券投资基金的相关税务法规进行税务处理。如果日后涉及本集合计划的有关税收法规颁布，本集合计划的税务处理可能会根据日后出台的相关税务法规而作出调整。本集合计划适用的主要税项列示如下：

(a) 根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)，自 2016 年 5 月 1 日起，金融业纳入“营改增”试点范围；自 2018 年 1 月 1 日以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

(b) 本集合计划进行的证券交易所适用的印花税税率为 0.10%，根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券(股票)交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方按 0.10% 的税率征收印花税，对受让方不再征税。

(c) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，按照资管产品管理人所在地适用的城市维护建设税税率，计算缴纳城市维护建设税。

(d) 对资管产品在 2018 年 1 月 1 日(含)以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照资管产品管理人所在地适用的费率计算缴纳教育费附加、地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	29,729,676.34
等于：本金	29,728,109.85
加：应计利息	1,566.49
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-

减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计：	29,729,676.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	135,547,218.19	-	132,747,836.62	-2,799,381.57
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	135,547,218.19	-	132,747,836.62	-2,799,381.57

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本集合计划本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本集合计划本报告期末未持有期货合约。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本集合计划本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本集合计划本报告期末各项买入返售金融资产余额为零。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本集合计划本报告期末未通过买断式逆回购交易取得债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本集合计划本报告期末未发生按预期信用损失一般模型计提减值准备。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

本集合计划本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本集合计划本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

本集合计划本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	130,334.82
其中：交易所市场	130,179.82
银行间市场	155.00
-	-
应付利息	-
预提审计费用	29,752.78
预提信息披露费	59,507.37
预提账户维护费	4,500.00
合计	224,094.97

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 A		
项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,528,052.95	113,528,052.95
本期申购	536,613.14	536,613.14
本期赎回(以“-”号填列)	-5,693,205.13	-5,693,205.13
- 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	108,371,460.96	108,371,460.96

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 B		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	65,924,419.51	65,924,419.51
本期申购	-	-
本期赎回(以“-”号填列)	-7,046,164.51	-7,046,164.51
- 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	58,878,255.00	58,878,255.00

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 C		
项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	31,381,830.08	31,381,830.08
本期申购	1,209,047.92	1,209,047.92
本期赎回(以“-”号填列)	-4,443,182.82	-4,443,182.82
- 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	28,147,695.18	28,147,695.18

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本集合计划本报告期末无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-14,460,842.86	720,452.65	-13,740,390.21
本期利润	402,661.48	-4,134,509.15	-3,731,847.67
本期基金份额交易产生的变动数	604,467.37	11,888.34	616,355.71
其中：基金申购款	-63,419.15	-724.45	-64,143.60
基金赎回款	667,886.52	12,612.79	680,499.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,453,714.01	-3,402,168.16	-16,855,882.17

单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 B			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-6,288,743.81	-3,015,448.40	-9,304,192.21
本期利润	-47,720.81	-2,071,896.84	-2,119,617.65
本期基金份额交易产生的变动数	916,235.25	212,728.18	1,128,963.43
其中：基金申购款	-	-	-
基金赎回款	916,235.25	212,728.18	1,128,963.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,420,229.37	-4,874,617.06	-10,294,846.43

单位：人民币元

兴证资管金麒麟消费升级混合 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-4,172,720.68	192,098.62	-3,980,622.06
本期利润	65,961.68	-1,014,186.63	-948,224.95
本期基金份额交易产生的变动数	393,911.51	-58,811.93	335,099.58

其中：基金申购款	-147,704.55	-8,304.50	-156,009.05
基金赎回款	541,616.06	-50,507.43	491,108.63
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-3,712,847.49	-880,899.94	-4,593,747.43

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
活期存款利息收入	35,418.48
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	4,053.58
其他	521.01
合计	39,993.07

注：其他包括保证金利息收入。

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	161,121,994.70
减：卖出股票成本总额	160,226,933.18
减：交易费用	503,327.35
买卖股票差价收入	391,734.17

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	80,820.82
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	20,923.00

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	101,743.82

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	12,214,453.40
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,978,388.00
减：应计利息总额	214,987.40
减：交易费用	155.00
买卖债券差价收入	20,923.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本集合计划本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

贵金属暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

本集合计划本报告期内未进行衍生工具买卖交易。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,924,908.76
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	1,924,908.76

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
1. 交易性金融资产	-7,220,592.62
——股票投资	-7,207,380.62
——债券投资	-13,212.00
——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	-7,220,592.62

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	574.10
合计	574.10

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

2、本集合计划的转换费由转出集合计划赎回费和集合计划申购补差费构成，其中不低于赎回费部分的 25%归入转出集合计划的集合计划资产。

6.4.7.22 信用减值损失

本集合计划本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
注册登记费	6,488.31
银行间账户维护费	9,000.00
银行费用	1,775.19
港股通证券组合费	332.31
合计	106,855.96

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本集合计划无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本集合计划无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内未发生与本集合计划存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
兴证证券资产管理有限公司（“兴证资管”）	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
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	集合计划托管人、集合计划销售机构
兴证期货有限公司（“兴证期货”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证创新资本管理有限公司（“兴证资本”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证投资管理有限公司（“兴证投资”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证全球基金管理有限公司（“兴证基金”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
福州兴证物业管理有限公司	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证(香港)金融控股有限公司（“兴证香港”）	集合计划管理人的股东控制的子公司
兴证国际金融集团有限公司（“兴证国际”）	受集合计划管理人的股东控制的公司

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票	成交金额	占当期股票

		成交总额的比例		成交总额的比例
兴业证券	310,470,601.74	100.00%	438,526,686.82	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	回购成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例	回购成交金额	占当期债券 回购 成交总额的比例
兴业证券	6,320,000.00	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 权证交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
兴业证券	288,793.90	100.00%	130,179.82	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量 的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
兴业证券	405,433.90	100.00%	205,382.47	100.00%

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本集合计划提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,650,791.53	1,564,531.19
其中：支付销售机构的客户维护费	572,349.44	693,628.97

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 1.5% 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 × 1.5% ÷ 当年天数。

集合计划管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送管理费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

（b）业绩报酬

本集合计划只有 B 类份额收取业绩报酬，A 类份额和 C 类份额不收取业绩报酬。

（1）业绩报酬计提原则

符合业绩报酬计提条件时，在投资者退出日或本集合计划分红日或终止日计提业绩报酬。

（2）业绩报酬计提方法

业绩报酬计提日为投资者退出日或本集合计划分红日或终止日。以上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日（如上一个发生业绩报酬计提的业绩报酬计提日不存在，推广期参与的为本集合计划成立日，存续期参与的为参与当日）至本次业绩报酬计提日期间的年化收益率 R，作为计提业绩报酬的基准。

$$R = (A - B) / C \times \text{当年实际天数} / N \times 100\%$$

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）

$$H = (R - 5\%) \times 20\% \times C \times F \times N / \text{当年实际天数}$$

（F 为参与计提业绩报酬的份额数）

如投资者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。

开放期参与价格为受理申请当日份额净值，红利再投资的参与价格为红利转份额当日份额净值。

（3）业绩报酬支付：因业绩报酬计算涉及 TA 数据，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 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日，本集合计划发生的应支付管理人的业绩报酬为 122,576.53 元；于 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日，本集合计划发生的应支付管理人的业绩报酬为 342,678.69 元。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	218,018.81	260,755.20

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提，逐日累计至每月月末，按月支付，由管理人向托管人发送托管费划款指令，托管人复核后于次月前 5 个工作日内从集合计划财产中一次性支付给管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期			
	2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	兴证资管金麒麟消费升级混合 C	合计
兴业证券	-	-	46,135.90	46,135.90
交通银行	-	-	674.77	674.77
合计	-	-	46,810.67	46,810.67
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间			
	2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	兴证资管金麒麟消费升级混合 C	合计
兴业证券	-	-	54,679.20	54,679.20
交通银行	-	-	949.16	949.16
合计	-	-	55,628.36	55,628.36

注：本集合计划 A 类份额与 B 类份额不收取销售服务费，C 类份额的销售服务费年费率为 0.50%。

计算公式为： $H=E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$

H 为 C 类份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类份额前一日集合计划资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过银行间同业市场进行债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	兴证资管金麒麟消费升级混合 C
基金合同生效日 (2021年8月2日) 持有的基金份额	0.00	19,384,753.80	-
报告期初持有的基金份额	20,119,718.31	12,369,247.93	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	5,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	20,119,718.31	7,369,247.93	-

报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	10.2968%	3.7714%	-
-------------------------	----------	---------	---

项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	兴证资管金麒麟消费 升级混合 A	兴证资管金麒麟消费 升级混合 B	兴证资管金麒麟消费 升级混合 C
基金合同生效日 (2021 年 8 月 2 日) 持有的基金份额	0.00	19,384,753.80	-
报告期初持有的基金 份额	20,119,718.31	12,369,247.93	-
报告期间申购/买入总 份额	-	-	-
报告期间因拆分变动 份额	-	-	-
减: 报告期间赎回/卖 出总份额	-	-	-
报告期末持有的基金 份额	20,119,718.31	12,369,247.93	-
报告期末持有的基金 份额 占基金总份额比例	8.9778%	5.5194%	-

注: 本报告期内, 本集合计划管理人投资本集合计划的适用费率符合本集合计划招募说明书和相关公告的规定。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除本集合计划的管理人外, 无其他关联方投资本集合计划的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位: 人民币元

关联方 名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行	29,728,109.85	35,418.48	15,513,200.43	84,927.94

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本集合计划本报告期及上年度可比期间未发生在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况

本集合计划本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
301395	仁信新材	2023年6月21日	1个月以内(含)	新股流通受限	26.68	26.68	1,448	38,632.64	38,632.64	-
301261	恒工精密	2023年6月29日	1个月以内(含)	新股流通受限	36.90	36.90	832	30,700.80	30,700.80	-
301202	朗威股份	2023年6月28日	1个月以内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	1,245	32,145.90	32,145.90	-
301292	海科新源	2023年6月29日	1个月以内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	1,775	35,482.25	35,482.25	-
301295	美硕科技	2023年6月19日	6个月	新股流通受限	37.40	36.07	108	4,039.20	3,895.56	-
301170	锡南科技	2023年6月16日	6个月	新股流通受限	34.00	34.93	92	3,128.00	3,213.56	-
301291	明阳电气	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	38.13	31.03	198	7,549.74	6,143.94	-
301210	金杨股份	2023年6月21日	6个月	新股流通受限	57.88	49.17	43	2,488.84	2,114.31	-
301293	三博脑科	2023年4月25日	6个月	新股流通受限	29.60	71.42	142	4,203.20	10,141.64	-
001282	三联锻造	2023年5月15日	6个月	新股流通受限	27.93	33.03	38	1,061.34	1,255.14	-
301428	世纪恒通	2023年5月10日	6个月	新股流通受限	26.35	30.60	109	2,872.15	3,335.40	-

001287	中电港	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	11.88	21.02	138	1,639.44	2,900.76	-
301141	中科磁业	2023年3月27日	6个月	新股流通受限	41.20	42.69	106	4,367.20	4,525.14	-
301387	光大同创	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	58.32	45.36	81	4,723.92	3,674.16	-
301373	凌玮科技	2023年1月20日	6个月	新股流通受限	33.73	31.85	120	4,047.60	3,822.00	-
301357	北方长龙	2023年4月11日	6个月	新股流通受限	50.00	48.39	69	3,450.00	3,338.91	-
301408	华人健康	2023年2月22日	6个月	新股流通受限	16.24	16.95	262	4,254.88	4,440.90	-
301157	华塑科技	2023年3月1日	6个月	新股流通受限	56.50	52.93	64	3,616.00	3,387.52	-
001380	华纬科技	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	28.84	30.78	54	1,557.36	1,662.12	-
001360	南矿集团	2023年3月31日	6个月	新股流通受限	15.38	14.87	71	1,091.98	1,055.77	-
301203	国泰环保	2023年3月28日	6个月	新股流通受限	46.13	34.40	75	3,459.75	2,580.00	-
301383	天键股份	2023年5月31日	6个月	新股流通受限	46.16	35.72	118	5,446.88	4,214.96	-
301246	宏源药业	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	50.00	30.71	161	8,050.00	4,944.31	-
301332	德尔玛	2023年5月9日	6个月	新股流通受限	14.81	13.73	372	5,509.32	5,107.56	-
301225	恒勃股份	2023年6月8日	6个月	新股流通受限	35.66	33.26	106	3,779.96	3,525.56	-
301323	新莱福	2023年5月29日	6个月	新股流通受限	39.06	39.36	92	3,593.52	3,621.12	-
301325	曼恩斯特	2023年5月4日	6个月	新股流通受限	76.80	107.95	88	6,758.40	9,499.60	-
301386	未来电器	2023年3月21日	6个月	新股流通受限	29.99	23.79	135	4,048.65	3,211.65	-
301429	森泰股份	2023年4月10日	6个月	新股流通受限	28.75	21.02	156	4,485.00	3,279.12	-
301439	泓淋电力	2023年3月10日	6个月	新股流通受限	19.99	16.90	222	4,437.78	3,751.80	-
001367	海森药业	2023年3月30日	6个月	新股流通受限	44.48	39.48	25	1,112.00	987.00	-
301262	海看股份	2023年6月13日	6个月	新股流通受限	30.22	25.50	185	5,590.70	4,717.50	-
301345	涛涛	2023年3月	6个月	新股流通受限	73.45	46.64	58	4,260.10	2,705.12	-

	车业	月 10 日		受限							
301358	湖南裕能	2023 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	224	5,324.48	9,607.36		-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	57	1,178.76	1,452.93		-
301303	真兰仪表	2023 年 2 月 13 日	6 个月	新股流通受限	26.80	22.32	316	8,468.80	7,053.12		-
301281	科源制药	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	116	3,666.94	2,911.60		-
301307	美利信	2023 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	176	5,691.84	5,607.36		-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	165	4,068.90	3,714.15		-
301360	荣旗科技	2023 年 4 月 17 日	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	49	3,522.12	4,537.40		-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	152	3,617.60	4,991.68		-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股流通受限	13.06	20.62	277	3,617.62	5,711.74		-
301310	鑫宏业	2023 年 5 月 26 日	6 个月	新股流通受限	67.28	65.43	75	5,046.00	4,907.25		-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	58	1,095.04	1,136.80		-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	2,137	20,515.20	20,109.17		-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	57	4,132.50	3,329.94		-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本集合计划本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本集合计划从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 0 元，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本集合计划从事交易所市场债券正回购交易形成的卖

出回购证券款余额 0 元，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

转融通证券出借业务暂不属于本集合计划的投资范围，故此项不适用。

6.4.13 金融工具风险及管理

本集合计划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为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市交易的股票（包含主板、创业板及其他中国证监会核准或注册发行的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、债券（含国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、国债期货、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本集合计划的投资组合比例为：本集合计划股票投资比例为集合计划总资产的 60%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%），投资于消费升级主题相关股票的比例不低于非现金集合计划资产的 80%；每个交易日日终，扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于集合计划资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。国债期货、股指期货及其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。

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信用风险、流动性风险及市场风险。本集合计划管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本集合计划在科学的风险管理的前提下，实现计划财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本集合计划管理人实施全面风险管理，由公司董事会、经营管理层以及全体员工共同参与，对公司经营中的流动性风险、市场风险、信用风险、操作风险、声誉风险、洗钱风险等各类风险进行准确识别、审慎评估、动态监控、及时应对及全程管理。本集合计划管理人制定了政策和程序来识别及分析产品投资运作管理各环节的各类风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本集合计划管理人建立由董事会、监事会、经营管理层、风险管理部门、各部门组成的全面

风险管理组织架构，即董事会、监事会——公司经营管理层及其风险管理委员会——风险管理部——各部门。

本集合计划管理人确立风险管理三道防线，即各部门实施有效自我控制为第一道防线，风险管理部门风险管理人员在事前和事中实施专业的风险管理为第二道防线，合规风控部内控稽核人员实施事后监督、评价为第三道防线。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指产品在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致集合计划资产损失和收益变化的风险。

本集合计划的管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本集合计划于本报告期末未持有信用债券、资产支持证券、同业存单。本集合计划的银行存款存放在本集合计划开立于托管人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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	12,125,766.58
合计	-	12,125,766.58

注：此处列示的未评级债券为国债、政策性金融债等非信用债券投资，债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本产品于本报告期末及上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指产品在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本集合计划的流动性风险一方面来自于集合计划份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

针对投资品种变现的流动性风险，本集合计划流动性情况良好，持有的资产主要为现金类资产和股票，且本集合计划报告期末股票持仓未出现停牌或其他流动受限的情况，均能以合理价格适时变现。本报告期内，本集合计划未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本集合计划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、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间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 6.4.12 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。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指集合计划所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指集合计划的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本集合计划持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本集合计划的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本集合计划的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金及债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	29,729,676.34	-	-	-	29,729,676.34
结算备付金	190,696.96	-	-	-	190,696.96
存出保证金	55,183.88	-	-	-	55,183.88
交易性金融资产	-	-	-	134,149,852.00	134,149,852.00

应收股利	-	-	-	4,296.00	4,296.00
应收申购款	-	-	-	4,757.87	4,757.87
资产总计	29,975,557.18	-	-	134,158,905.87	164,134,463.05
负债					
应付清算款	-	-	-	0.06	0.06
应付赎回款	-	-	-	12,460.48	12,460.48
应付管理人报酬	-	-	-	201,660.11	201,660.11
应付托管费	-	-	-	33,609.99	33,609.99
应付销售服务费	-	-	-	9,702.33	9,702.33
应付交易费用	-	-	-	130,334.82	130,334.82
其他负债	-	-	-	93,760.15	93,760.15
负债总计	-	-	-	481,527.94	481,527.94
利率敏感度缺口	29,975,557.18	-	-	-133,677,377.93	163,652,935.11
上年度末 2022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	23,441,479.38	-	-	-	23,441,479.38
结算备付金	222,089.60	-	-	-	222,089.60
存出保证金	64,528.23	-	-	-	64,528.23
交易性金融资产	12,125,766.58	-	-	-148,606,123.04	160,731,889.62
应收股利	-	-	-	5,813.47	5,813.47
应收申购款	-	-	-	10,916.61	10,916.61
资产总计	35,853,863.79	-	-	-148,622,853.12	184,476,716.91
负债					
应付清算款	-	-	-	1.73	1.73
应付赎回款	-	-	-	5,827.13	5,827.13
应付管理人报酬	-	-	-	231,662.12	231,662.12
应付托管费	-	-	-	38,610.36	38,610.36
应付销售服务费	-	-	-	11,606.31	11,606.31
应交税费	-	-	-	149.99	149.99
其他负债	-	-	-	379,761.21	379,761.21
负债总计	-	-	-	667,618.85	667,618.85
利率敏感度缺口	35,853,863.79	-	-	-147,955,234.27	183,809,098.06

注：表中所示为本集合计划资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日

孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本集合计划本报告期末计息资产仅包括银行存款、结算备付金、存出保证金、其合计市值占净值比较低，且均以活期存款利率或相对固定的利率计息；假定利率变动仅影响其未来收益，而对其本身的公允价值无重大影响，因而在本集合计划本报告期末未持有其他计息资产/负债的情况下，利率变动对集合计划资产净值的影响并不显著。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本集合计划持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023 年 6 月 30 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,243,825.37	-	7,243,825.37
应收股利	-	4,296.00	-	4,296.00
资产合计	-	7,248,121.37	-	7,248,121.37
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,248,121.37	-	7,248,121.37
项目	上年度末			
	2022 年 12 月 31 日			
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	其他币种 折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	19,114,176.82	-	19,114,176.82

应收股利	-	5,813.47	-	5,813.47
资产合计	-	19,119,990.29	-	19,119,990.29
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	19,119,990.29	-	19,119,990.29

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇率以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（2023年6月30日）	上年度末（2022年12月31日）
	港币相对人民币升值 5%	362,406.07	955,999.51
	港币相对人民币贬值 5%	-362,406.07	-955,999.51

6.4.13.4.3 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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金资 产净值比

		值比例 (%)		例 (%)
交易性金融资产-股票投资	132,747,836.62	81.12	148,606,123.04	80.85
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-	12,125,766.58	6.60
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	132,747,836.62	81.12	160,731,889.62	87.45

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 假设单个证券的公允价值和市场组合的公允价值按照资本-资产定价模型 (CAPM) 描述的规律进行变动		
	2. 使用本集合计划业绩比较基准所对应的市场组合进行分析		
	3. 在业绩基准变化 5% 时, 对单个证券相应的公允价值变化进行加总得到本集合计划净值的变化		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位: 人民币元)	
		本期末 (2023 年 6 月 30 日)	上年度末 (2022 年 12 月 31 日)
	业绩比较基准+5%	6,401,952.74	8,399,261.80
业绩比较基准-5%	-6,401,952.74	-8,399,261.80	

注: 本集合计划管理人运用资本-资产定价模型方法对本集合计划的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析, 反映了在其他变量不变的假设下, 证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时, 将对集合计划资产净值产生的影响 (采用报告期末前推 120 个交易日作为参数计算的样本数据, 上市日期距离期末不足 120 个交易日的新股、次新股鉴于距离上市时间过短、样本数据过少, 贝塔值设定为 1)。

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

- 第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;
- 第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;
- 第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	132,424,752.40	148,411,080.02
第二层次	323,084.22	12,320,809.60
第三层次	-	-
合计	132,747,836.62	160,731,889.62

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本集合计划本报告期持有的金融工具公允价值所属层次间未发生重大变动。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本集合计划本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2023 年 6 月 30 日，本集合计划无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	132,747,836.62	80.88
	其中：股票	132,747,836.62	80.88
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	29,920,373.30	18.23
8	其他各项资产	1,466,253.13	0.89
9	合计	164,134,463.05	100.00

注：本集合本报告期末通过港股通交易机制投资的港股市值为 7,243,825.37 元，占总资产比例 4.41%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	-	-
C	制造业	107,815,251.54	65.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	20,109.17	0.01
E	建筑业	266,816.00	0.16
F	批发和零售业	1,418,957.48	0.87
G	交通运输、仓储和邮政业	90,840.00	0.06
H	住宿和餐饮业	46,574.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,044.58	0.01
J	金融业	-	-
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	9,190,934.84	5.62

N	水利、环境和公共设施管理业	2,580.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,638,903.64	4.06
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	125,504,011.25	76.69

7.2.2 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（%）
A 基础材料	-	-
B 消费者非必需品	2,787,186.11	1.70
C 消费者常用品	-	-
D 能源	-	-
E 金融	-	-
F 医疗保健	4,456,639.26	2.72
G 工业	-	-
H 信息技术	-	-
I 电信服务	-	-
J 公用事业	-	-
K 房地产	-	-
合计	7,243,825.37	4.43

注：以上分类采用全球行业标准（GICS）

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	000858	五粮液	86,800	14,197,876.00	8.68
2	600519	贵州茅台	8,300	14,035,300.00	8.58
3	000333	美的集团	216,000	12,726,720.00	7.78
4	300012	华测检测	470,829	9,181,165.50	5.61
5	300760	迈瑞医疗	28,500	8,544,300.00	5.22
6	000568	泸州老窖	39,800	8,340,886.00	5.10
7	600085	同仁堂	123,900	7,131,684.00	4.36
8	000516	国际医学	788,200	6,628,762.00	4.05
9	603801	志邦家居	187,400	6,187,948.00	3.78
10	001215	千味央厨	78,100	5,192,869.00	3.17
11	000651	格力电器	125,300	4,574,703.00	2.80
12	002304	洋河股份	25,600	3,362,560.00	2.05

13	000596	古井贡酒	13,300	3,290,154.00	2.01
14	600422	昆药集团	125,900	2,608,648.00	1.59
15	688793	倍轻松	46,781	2,521,495.90	1.54
16	002557	洽洽食品	60,500	2,513,775.00	1.54
17	02015	理想汽车—W	19,000	2,373,637.51	1.45
18	000921	海信家电	87,700	2,363,515.00	1.44
19	600867	通化东宝	193,400	2,019,096.00	1.23
20	000860	顺鑫农业	54,900	1,849,581.00	1.13
21	09926	康方生物	47,000	1,531,823.67	0.94
22	01548	金斯瑞生物科技	94,000	1,525,323.71	0.93
23	603368	柳药集团	56,977	1,407,901.67	0.86
24	06078	海吉亚医疗	35,800	1,399,491.88	0.86
25	603899	晨光股份	23,400	1,044,576.00	0.64
26	603195	公牛集团	9,472	909,880.32	0.56
27	600690	海尔智家	29,900	702,052.00	0.43
28	600600	青岛啤酒	6,500	673,595.00	0.41
29	600276	恒瑞医药	13,600	651,440.00	0.40
30	002959	小熊电器	6,700	559,450.00	0.34
31	002508	老板电器	19,200	485,568.00	0.30
32	002705	新宝股份	24,600	443,538.00	0.27
33	002372	伟星新材	16,000	328,640.00	0.20
34	601390	中国中铁	35,200	266,816.00	0.16
35	01999	敏华控股	38,400	185,163.09	0.11
36	603816	顾家家居	3,800	144,970.00	0.09
37	03690	美团—W	1,240	139,820.11	0.09
38	600009	上海机场	2,000	90,840.00	0.06
39	02020	安踏体育	1,200	88,565.40	0.05
40	301291	明阳电气	1,977	64,139.34	0.04
41	001323	慕思股份	1,700	57,732.00	0.04
42	600754	锦江酒店	1,100	46,574.00	0.03
43	301395	仁信新材	1,448	38,632.64	0.02
44	301292	海科新源	1,775	35,482.25	0.02
45	301202	朗威股份	1,245	32,145.90	0.02
46	301261	恒工精密	832	30,700.80	0.02
47	301210	金杨股份	421	21,517.05	0.01
48	001286	陕西能源	2,137	20,109.17	0.01
49	301293	三博脑科	142	10,141.64	0.01

50	301297	富乐德	434	9,769.34	0.01
51	301358	湖南裕能	224	9,607.36	0.01
52	301325	曼恩斯特	88	9,499.60	0.01
53	301301	川宁生物	1,021	9,148.16	0.01
54	301303	真兰仪表	316	7,053.12	0.00
55	301320	豪江智能	277	5,711.74	0.00
56	301307	美利信	176	5,607.36	0.00
57	301332	德尔玛	372	5,107.56	0.00
58	301382	蜂助手	152	4,991.68	0.00
59	301246	宏源药业	161	4,944.31	0.00
60	301310	鑫宏业	75	4,907.25	0.00
61	301262	海看股份	185	4,717.50	0.00
62	301360	荣旗科技	49	4,537.40	0.00
63	301141	中科磁业	106	4,525.14	0.00
64	301408	华人健康	262	4,440.90	0.00
65	301383	天键股份	118	4,214.96	0.00
66	301295	美硕科技	108	3,895.56	0.00
67	301373	凌玮科技	120	3,822.00	0.00
68	301439	泓淋电力	222	3,751.80	0.00
69	301376	致欧科技	165	3,714.15	0.00
70	301387	光大同创	81	3,674.16	0.00
71	301323	新莱福	92	3,621.12	0.00
72	301225	恒勃股份	106	3,525.56	0.00
73	301157	华塑科技	64	3,387.52	0.00
74	301357	北方长龙	69	3,338.91	0.00
75	301428	世纪恒通	109	3,335.40	0.00
76	301232	飞沃科技	57	3,329.94	0.00
77	301429	森泰股份	156	3,279.12	0.00
78	301170	锡南科技	92	3,213.56	0.00
79	301386	未来电器	135	3,211.65	0.00
80	301281	科源制药	116	2,911.60	0.00
81	001287	中电港	138	2,900.76	0.00
82	301345	涛涛车业	58	2,705.12	0.00
83	301203	国泰环保	75	2,580.00	0.00
84	001380	华纬科技	54	1,662.12	0.00
85	001328	登康口腔	57	1,452.93	0.00
86	001282	三联锻造	38	1,255.14	0.00
87	001324	长青科技	58	1,136.80	0.00
88	001360	南矿集团	71	1,055.77	0.00

89	001367	海森药业	25	987.00	0.00
----	--------	------	----	--------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	000858	五粮液	12,510,077.00	6.81
2	000333	美的集团	11,373,254.00	6.19
3	000651	格力电器	8,211,258.00	4.47
4	000516	国际医学	8,151,913.00	4.43
5	600085	同仁堂	7,676,306.38	4.18
6	603801	志邦家居	6,643,160.00	3.61
7	300760	迈瑞医疗	6,150,624.00	3.35
8	002304	洋河股份	5,635,833.36	3.07
9	001215	千味央厨	5,442,058.00	2.96
10	000568	泸州老窖	5,344,213.00	2.91
11	300012	华测检测	5,042,666.00	2.74
12	002557	洽洽食品	4,413,458.00	2.40
13	09995	荣昌生物	4,275,877.14	2.33
14	01548	金斯瑞生物科技	4,081,590.07	2.22
15	600519	贵州茅台	4,041,368.00	2.20
16	000860	顺鑫农业	3,799,400.00	2.07
17	000661	长春高新	3,711,300.00	2.02
18	603368	柳药集团	3,665,545.81	1.99
19	000596	古井贡酒	3,560,241.00	1.94
20	600132	重庆啤酒	3,456,366.00	1.88

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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	600690	海尔智家	12,716,552.00	6.92
2	03690	美团-W	11,296,893.89	6.15
3	000858	五粮液	9,527,838.00	5.18

4	002304	洋河股份	8,982,576.00	4.89
5	600809	山西汾酒	7,741,880.97	4.21
6	300347	泰格医药	7,073,567.00	3.85
7	000596	古井贡酒	6,788,398.20	3.69
8	01548	金斯瑞生物科技	5,509,589.83	3.00
9	601888	中国中免	4,743,759.00	2.58
10	002475	立讯精密	4,672,287.00	2.54
11	300760	迈瑞医疗	4,135,615.00	2.25
12	000651	格力电器	4,022,009.00	2.19
13	00700	腾讯控股	3,846,395.65	2.09
14	600519	贵州茅台	3,808,191.00	2.07
15	002415	海康威视	3,707,645.00	2.02
16	09995	荣昌生物	3,669,338.02	2.00
17	002508	老板电器	3,617,574.00	1.97
18	600132	重庆啤酒	3,569,308.00	1.94
19	600066	宇通客车	3,543,249.00	1.93
20	603259	药明康德	3,424,902.40	1.86

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。

7.4.3 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	151,367,419.48
卖出股票收入（成交）总额	161,121,994.70

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本集合计划本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本集合计划本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

管理人可运用股指期货，以提高投资效率，更好地达到本集合计划的投资目标。本集合计划在股指期货投资中将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本集合计划还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本集合计划将根据风险管理的原则，以套期保值为目的进行国债期货投资，将构建量化分析体系，对国债期货和现货的基差、国债期货的流动性、波动水平、套期保值的有效性等指标进行跟踪监控，在最大限度保证集合计划资产安全的基础上管理利率波动风险，实现资产保值增值。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本集合计划本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 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。

7.12.3 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	55,183.88
2	应收清算款	1,402,015.38
3	应收股利	4,296.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,757.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,466,253.13

7.12.4 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。

7.12.5 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
兴证资管金麒麟消费升级混合 A	1,553	69,782.01	22,840,472.38	21.08%	85,530,988.58	78.92%
兴证资管金麒麟消费升级混合 B	128	459,986.37	7,369,247.93	12.52%	51,509,007.07	87.48%
兴证资管金麒麟消费升级混合 C	2,220	12,679.14	565,262.35	2.01%	27,582,432.83	97.99%
合计	3,901	50,089.06	30,774,982.66	15.75%	164,622,428.48	84.25%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	1,003,137.31	0.9256%
	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	-	-
	兴证资管金麒麟消费升级混合 C	34,596.69	0.1229%
	合计	1,037,734.00	0.5311%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	0
	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	0

	兴证资管金麒麟消费升级混合 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟消费升级混合 A	50~100
	兴证资管金麒麟消费升级混合 B	0
	兴证资管金麒麟消费升级混合 C	0~10
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟 消费升级混合 A	兴证资管金麒麟 消费升级混 合 B	兴证资管金麒麟 消费升级混 合 C
基金合同生效日（2021 年 8 月 2 日）基金 份额总额	-	89,477,158.72	-
本报告期期初基金份额总额	113,528,052.95	65,924,419.51	31,381,830.08
本报告期基金总申购份额	536,613.14	-	1,209,047.92
减：本报告期基金总赎回份额	5,693,205.13	7,046,164.51	4,443,182.82
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	108,371,460.96	58,878,255.00	28,147,695.18

注：总申购份额含红利再投、转换入份额和强制调增份额，总赎回份额含转换出份额和强制调减份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本集合计划未召开集合计划份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本集合计划管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，徐铁任交通银行资产托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本集合计划未发生对集合计划份额持有人权益或者集合计划份额的价格产生重大影响的涉及集合计划管理人、集合计划财产、集合计划托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本集合计划投资策略未发生改变。

10.5 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。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划的管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本集合计划托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	310,470,601.74	100.00%	288,793.90	100.00%	-

注：1、证券经营机构交易单元选择的标准和程序：

(1) 选择证券经营机构交易单元的标准：财务状况良好、经营管理规范、内部管理制度健全、风险管理严格；具备本集合计划运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本集合计划进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本集合计划提供研究服务支持；

佣金费率合理；本集合计划管理人要求的其他条件。

(2) 选择证券经营机构交易单元的程序：本集合计划管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构；本集合计划管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本集合计划本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 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	-	-	6,320,000.00	100.00%	-	-

10.8 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	兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划 2022 年第 4 季度报告	规定网站	2023 年 1 月 20 日
2	兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划 2022 年年度报告	规定网站	2023 年 3 月 31 日
3	兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划 2023 年第 1 季度报告	规定网站	2023 年 4 月 21 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：本集合计划本报告期内未出现单一投资者持有集合计划份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于准予兴业证券金麒麟消费升级集合资产管理计划合同变更的回函；
- 2、《兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划资产管理合同》；
- 3、《兴证资管金麒麟消费升级混合型集合资产管理计划托管协议》；
- 4、《兴证资管金麒麟消费升级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。

12.2 存放地点

本集合计划管理人的办公场所（地址：上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 楼）。

12.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站（<http://www.ixzcgf.com>）查询，或在营业时间内至集合计划管理人办公场所免费查阅。

兴证证券资产管理有限公司

2023 年 8 月 31 日