

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（B 类份额）产品资料概要更新

编制日期：2024 年 5 月 20 日

送出日期：2024 年 5 月 27 日

本概要提供本集合计划的重要信息，是招募说明书的一部分。

作出投资决定前，请阅读完整的招募说明书等销售文件。

一、产品概况

| | | | |
|------------|--------------------------------------------------------------------------|------------------|---------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 集合计划简称 | 兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券 | 集合计划代码 | 970169 |
| 下属分级集合计划简称 | 兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券B | 下属分级集合计划代码 | 970169 |
| 管理人 | 兴证证券资产管理有限公司 | 托管人 | 中国工商银行股份有限公司 |
| 资产管理合同生效日 | 2022年5月30日 | | |
| 集合计划类型 | 债券型 | 交易币种 | 人民币 |
| 运作方式 | 其他开放式 | 开放频率 | 本集合计划B类份额，自资产管理合同生效日起每个工作日开放赎回，不开放申购。投资者依据原《兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划份额，自资产管理合同生效之日起全部自动转换为本集合计划B类份额。B类份额持有期间自B类份额持有人持有原兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算。 |
| 投资经理 | 吕晓威 | 开始担任本集合计划投资经理的日期 | 2022年5月30日 |
| | | 证券从业日期 | 2013年12月1日 |
| 其他 | 资产管理合同生效后，连续20个工作日出现份额持有人数量不满200人或者集合计划资产净值低于5000万元情形的，管理人应当在定期报告中予以披露；连 | | |

续60个工作日出现前述情形的，管理人应当在10个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他大集合产品合并或者终止资产管理合同等，并在6个月内召开集合计划份额持有人大会进行表决。

法律法规或中国证监会另有规定时，从其规定。

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。

注：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定享纯利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定享纯利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。《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 5 月 30 日生效。“兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划”正式更名为“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”。

二、集合计划投资与净值表现

（一）投资目标与投资策略

投资目标 本集合计划在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求集合计划资产的稳健增值。

投资范围 本集合计划的投资范围包括国内依法发行、上市的债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、次级债、企业债、短期融资券、超短期融资券，中期票据、公司债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、证券公司短期公司债券等）、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金融工具。

本集合计划不参与新股申购或增发新股，也不直接买入股票等权益类资产，但可持有因可转换债券转股和可交换债券换股形成的股票。因上述原因持有的股应在其可交易之日起的 10 个交易日内卖出。

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，本集合计划可以将其纳入投资范围。

本集合计划的投资组合比例为：

本集合计划投资于债券资产不低于集合计划资产的 80%。每个交易日日终，扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，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，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。

主要投资策略 本集合计划主要策略包括固定收益类资产投资策略，即通过综合分析和持续跟踪基本面、政策面、市场面等多方面因素，结合国内外宏观经济运行所处的经济周期及趋势，分析不同政策对各类资产的市场影响，并在严格控制投资组合风险的前提下，对组合中股票、债券、货币市场工具和法律法规或中国证监会允许集合计划投资的其他品种的投资比例进行配置和调整，力争实现集合计划资产的中长期稳健增值。具体涵盖债券投资策略、资产支持证券投资策略、可转换债券和可交换债券投资策略、杠杆投资策略、银行存款、同业存单投资策略。

对于衍生产品投资策略，本集合计划可投资国债期货。若本集合计划投资国债期货，将根据风险管理的原则，主要选择流动性好、交易活跃的国债期货合约进行交易，以对冲投资组合的系统性风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。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。本集合计划将关注其他金融衍生产品的推出情况，如

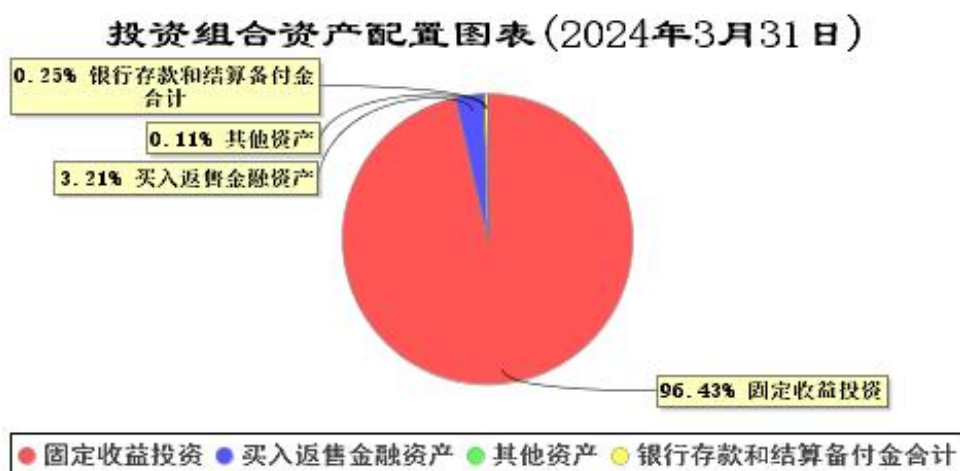
法律法规或监管机构允许集合计划投资前述衍生工具，本集合计划将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本集合计划投资目标相适应的投资策略和估值政策，在充分评估衍生产品的风险和收益的基础上，谨慎地进行投资。

业绩比较基准 中债综合财富（1 年以下）指数收益率*85%+一年期定期存款基准利率（税后）*15%。

风险收益特征 本集合计划为债券型集合资产管理计划，其风险收益水平低于股票型集合资产管理计划和混合型集合资产管理计划，高于货币型集合资产管理计划及货币市场基金。

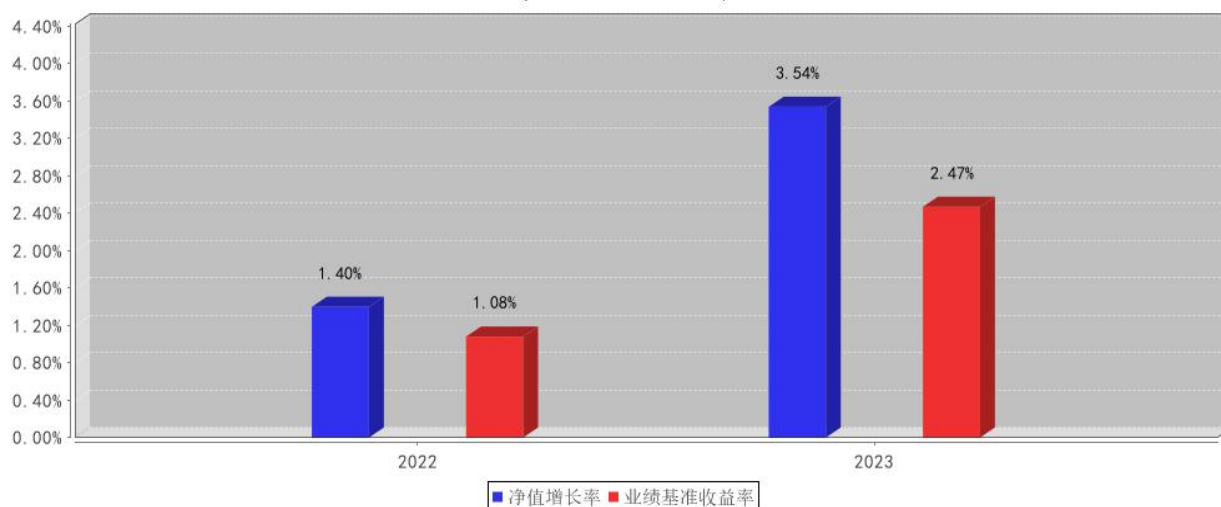
注：投资者欲了解本集合计划的详细情况，请仔细阅读本集合计划的《招募说明书》。本集合计划产品有风险，投资需谨慎。

（二）投资组合资产配置图表



（三）自集合计划合同变更生效以来/最近十年（孰短）集合计划每年的净值增长率及与同期业绩比较基准的比较图

兴证资管金麒麟悦享添利30天滚动持有债券B基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图 (2023年12月31日)



注：1、业绩表现截止日期 2023 年 12 月 31 日。集合计划的过往业绩不代表未来表现。

2、本集合计划合同于 2022 年 5 月 30 日生效，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。

三、投资本集合计划涉及的费用

（一）集合计划销售相关费用

以下费用在申购/赎回集合计划过程中收取：

| 费用类型 | 金额（M）/持有期限（N） | 收费方式/费率 | 备注 |
|----------|---------------|---------|-----------|
| 申购费（前收费） | | | B类份额不开放申购 |
| 赎回费 | 0<N<7日 | 1.5% | - |
| | 7日≤N | 0% | - |

注：赎回费用由赎回集合计划份额的份额持有人承担，在份额持有人赎回集合计划份额时收取。

（二）集合计划运作相关费用

以下费用将从集合计划资产中扣除：

| 费用类别 | 收费方式/年费率或金额 | 收取方 |
|-------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|----------|
| 管理费 | B类份额不收取固定管理费，收取业绩报酬。 | 管理人和销售机构 |
| 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。B类份额的业绩报酬计提日为集合计划投资人退出日或本集合计划分红日或终止日。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B类份额年化收益率R小于或等于4.2%时，管理人提取业绩报酬；若B类份额年化收益率R大于4.2%，管理人对超过4.2%以上的部分提取20%作为业绩报酬。 | 管理人和销售机构 |
| 托管费 | 0.05% | 托管人 |
| 审计费用 | 60,000.00 | 会计师事务所 |
| 信息披露费 | 120,000.00 | 规定披露报刊 |
| 其他费用 | 《资产管理合同》生效后与集合计划相关的律师费、诉讼费、仲裁费和公证费；集合计划份额持有人大会费用；集合计划的证券账户等相关账户的开户费用；集合计划的证券/期货交易费用（包括但不限于经手费、印花税、证管费、过户费、手续费、券商佣金、相关账户费用及其他类似性质的费用等）；集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用；按照国家有关规定和《资产管理合同》约定，可以在集合计划财产中列支的其他费用。其他费用详见本集合计划资产管理合同、招募说明书及相关公告。 | 相关服务机构 |

注：1. 本集合计划交易证券、基金等产生的费用和税负，按实际发生额从集合计划资产扣除。
2. 审计费用、信息披露费为集合计划整体承担费用，非单个份额类别费用，且年金额为预估值，最终实际金额以集合计划定期报告披露为准。

（三）集合计划运作综合费率测算

若投资者认购/申购本集合计划份额，在持有期间，投资者需支出的运作费率如下表：

集合计划运作综合费率（年化）

0.13%

注：集合计划管理费率、托管费率、销售服务费率（若有）为集合计划现行费率，其他运作费用以最近一次集合计划年报披露的相关数据为基准测算，业绩报酬不纳入测算范围。

四、风险揭示与重要提示

（一）风险揭示

本集合计划不提供任何保证。投资者可能损失投资本金。

投资有风险，投资者购买本集合计划时应认真阅读本集合计划的《招募说明书》等销售文件。

本集合计划投资运作过程中面临的主要风险有：市场风险、流动性风险、管理风险、操作和技术风险、合规性风险及法律风险、本集合计划特有风险、启用侧袋机制的风险和其他风险。

本集合计划特有的风险：包括滚动持有运作方式的风险、可转换债券投资风险、可交换债券投资风险、国债期货投资风险、次级债券的投资风险、资产支持证券投资风险。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划的备案，并不表明其对本集合计划的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本集合计划没有风险。

管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用集合计划财产，但不保证集合计划一定盈利，也不保证最低收益。

投资者自依资产管理合同取得集合计划份额，即成为份额持有人和资产管理合同的当事人。

集合计划产品资料概要信息发生重大变更的，管理人将在三个工作日内更新，其他信息发生变更的，管理人每年更新一次。因此，本文件内容相比集合计划的实际情况可能存在一定的滞后，如需及时、准确获取集合计划的相关信息，敬请同时关注管理人发布的相关临时公告等。

与本集合计划/资产管理合同相关的争议解决方式为仲裁。仲裁委员会是上海国际经济贸易仲裁委员会，仲裁地点是上海。

五、其他资料查询方式

以下资料详见兴证证券资产管理有限公司网站（<http://www.ixzcg1.com/>）。客服电话：95562-3。

- 1、本集合计划资产管理合同、托管协议、招募说明书；
- 2、定期报告，包括集合计划季度报告（含资产组合季度报告）、中期报告和年度报告；
- 3、集合计划份额净值；
- 4、集合计划销售机构及联系方式；
- 5、其他重要资料。

六、其他情况说明

无