

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
2024 年第 3 季度报告

2024 年 9 月 30 日

基金管理人：兴证证券资产管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2024 年 10 月 25 日

§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责任。

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 2024 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 7 月 1 日起至 2024 年 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

基金简称	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券
基金主代码	970169
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2022 年 5 月 30 日
报告期末基金份额总额	232,668,157.93 份
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

	<p>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。</p>		
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。		
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司		
基金托管人	中国工商银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C
下属分级基金的交易代码	970168	970169	970170
报告期末下属分级基金的份额总额	53,629,764.19 份	68,703,222.72 份	110,335,171.02 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”（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，在本集合计划存续期间，对于每份 A 类、C 类份额，设定 30 天的滚动运作期。运作期内 A 类、C 类份额不办理赎回或其他业务。每份 A 类、C 类份额可以在运作期到期日就该份额提出赎回申请。如果 A 类、C 类份额持有人在当期运作期到期日未申请赎回，则自该运作期到期日下一日起，该份额自动进入下一个运作期。对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期起始日指该集合计划份额申购确认日；对于每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额，第一个运作期起始日为红利再投资确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份 A 类、C 类份额的下一运作期起始日，指该份额上一运作期到期日的下一工作日；对于上一运作期到期日未赎回的每笔 A 类、C 类份额红利再投资份额的下一运作期起始日，指该红利再投资份额上一运作期到期日的下一工作日。对于每份 A 类、C 类份额，第一个运作期到期日指自该笔集合计划份额申购确认日起（含当日）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日），第二个运作期到期日指自该笔份额申购确认日起（含当日）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日），以此类推；每份 A 类、C 类份额的红利再投资份额的第一个运作期到期日指自该笔红利再投资份额确认日起（含当日）的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日），第二个运作期到期日为自该笔红利再投资份额确认日起（含当日）的第 30×2 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日），以此类推。“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 类份额自 2022 年 5 月 31 日起每个工作日只开放赎回，不开放申购，

且不设定 30 天滚动运作期。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2024 年 7 月 1 日-2024 年 9 月 30 日）		
	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C
1. 本期已实现收益	316,638.18	513,705.56	612,252.38
2. 本期利润	195,360.52	340,138.07	356,928.87
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0035	0.0047	0.0029
4. 期末基金资产净值	57,014,882.30	82,148,282.52	116,767,327.06
5. 期末基金份额净值	1.0631	1.1957	1.0583

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、上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。

3.2 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

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.31%	0.02%	0.43%	0.01%	-0.12%	0.01%
过去六个月	0.99%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.02%	0.00%
过去一年	2.43%	0.01%	2.37%	0.01%	0.06%	0.00%
自基金合同生效起至今	6.31%	0.02%	5.23%	0.01%	1.08%	0.01%

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B

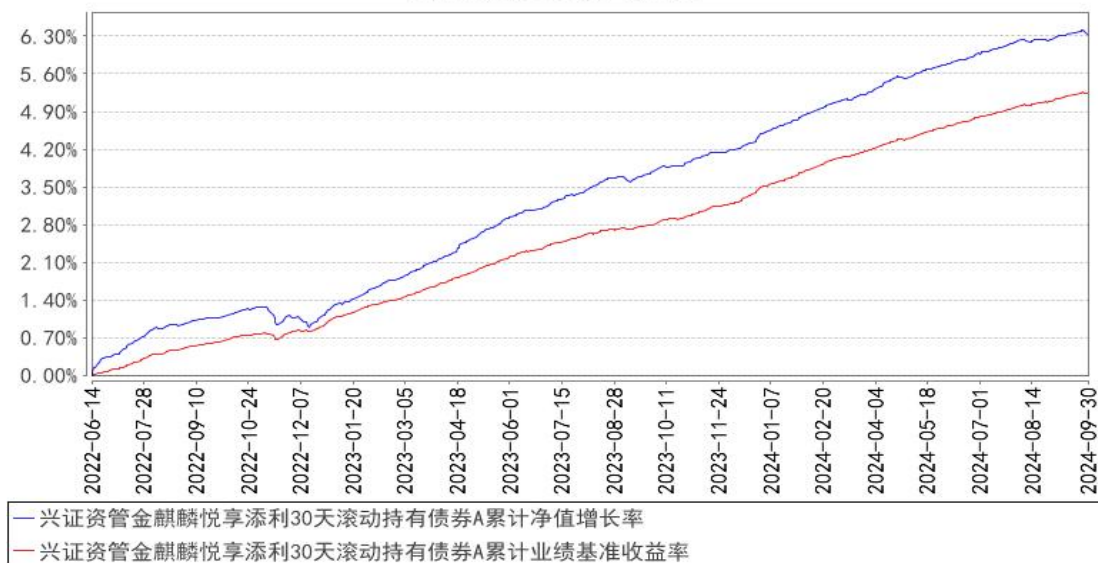
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.39%	0.01%	0.43%	0.01%	-0.04%	0.00%
过去六个月	1.14%	0.01%	1.01%	0.01%	0.13%	0.00%
过去一年	2.73%	0.01%	2.37%	0.01%	0.36%	0.00%
自基金合同生效起至今	7.05%	0.02%	5.30%	0.01%	1.75%	0.01%

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C

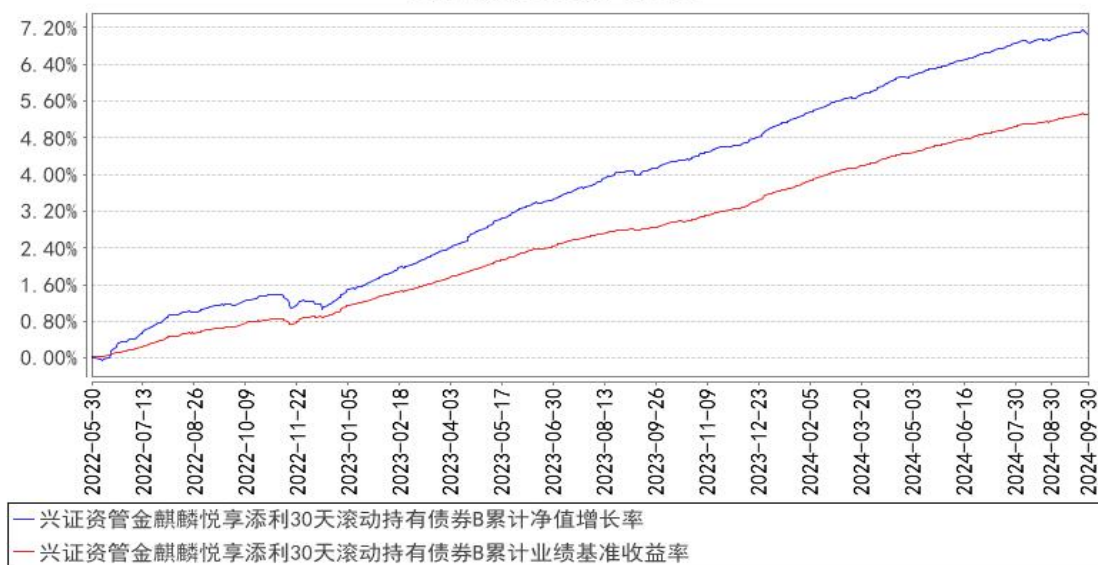
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.27%	0.01%	0.43%	0.01%	-0.16%	0.00%
过去六个月	0.89%	0.01%	1.01%	0.01%	-0.12%	0.00%
过去一年	2.22%	0.01%	2.37%	0.01%	-0.15%	0.00%
自基金合同生效起至今	5.83%	0.02%	5.23%	0.01%	0.60%	0.01%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

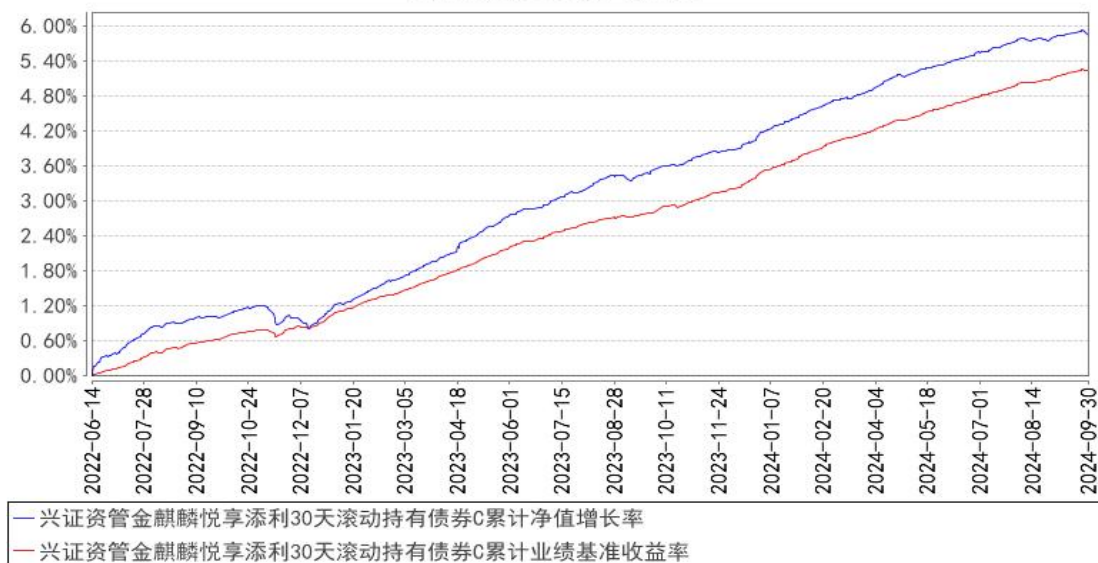
兴证资管麒麟悦享添利30天滚动持有债券A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证资管麒麟悦享添利30天滚动持有债券B累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



兴证资管麒麟悦享添利30天滚动持有债券C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：净值表现所取数据截至到 2024 年 09 月 30 日。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
吕晓威	兴证证券资产管理有限公司公募业务部公募投资经理	2022年5月30日	-	14年	上海交通大学硕士。2010年5月进入金融行业，曾任一德期货有限公司金融工程研究中心副总监、银河期货有限公司金融市场部投资经理及量化团队负责人、天风证券股份有限公司固定收益总部投资经理、浙江浙商证券资产管理有限公司固定收益部/FICC部投资主办。2021年8月加入兴证证券资产管理有限公司，历任固定收益部投资经理、公募投资部公募投资经理。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《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

截止本报告期末，本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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《兴证证券资产管理有限公司公平交易管理办法》的规定，遵循各项内部风险控制制度和流程，通过系统和人工相结合的方式在各环节严格控制交易的公平执行。严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易，确保各投资组合之间得到公平对待，切实防范利益输送行为，保护投资者合法权益。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度债券市场收益率先下后上，前期利率债下行幅度较大，长期国债收益再次突破历史低点。三季度债券供给有所上升，但市场配置力量较大，并未对收益率产生影响，地方债发行相较于二季度也有所上升，居民信贷继续收缩也对收益率下行有所促进。信用利差进一步压缩。三季度央行降息降低了债券的收益率波动中枢，令市场各期限收益率加速下行，海外市场美联储也如期降息。但三季度公布经济数据依然较弱。季末，政策组合拳出台对权益市场产生利好刺激，权益市场较大幅回升，预期开始转向，对债券市场亦产生影响，各品种收益率均开始上行，其中信用债上行幅度大于利率债，部分理财资金赎回对市场亦有影响。但组合政策产生效果依然需要时间。三季度整体维持短久期运作，维持适度杠杆，兼顾流动性，同时关注市场波段带来的机会。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末兴证资管麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A 份额净值为 1.0631 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.31%；同期业绩比较基准收益率为 0.43%。兴证资管麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B 份额净值为 1.1957 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.39%；同期业绩比较基准收益率为 0.43%。兴证资管麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C 份额净值为 1.0583 元，本报告期集合计划份额净值增长率为 0.27%；同期业绩比较基准收益率为 0.43%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	246,468,355.85	76.22
	其中：债券	217,423,839.24	67.24
	资产支持证券	29,044,516.61	8.98
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	69,814,709.66	21.59
	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	2,276,990.27	0.70
8	其他资产	4,798,357.84	1.48
9	合计	323,358,413.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本集合计划本报告期末未持有境内股票。

5.2.2 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末未持有港股通股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本集合计划本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	148,271,514.31	57.93
	其中：政策性金融债	15,104,186.30	5.90
4	企业债券	49,990,919.45	19.53
5	企业短期融资券	19,161,405.48	7.49
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	217,423,839.24	84.95

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	190311	19 进出 11	200,000	20,682,934.43	8.08
2	2023005	20 平安人寿	170,000	17,415,633.70	6.80
3	2028013	20 农业银行二级 01	160,000	16,285,917.81	6.36
4	1923009	19 太平财险	150,000	15,576,918.03	6.09
5	240304	24 进出 04	150,000	15,104,186.30	5.90

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

序号	证券代码	证券名称	数量（份）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	144463	崖州湾 2A	135,000	13,515,793.15	5.28
2	262080	周口 03 优	70,000	7,051,042.47	2.76
3	261635	工瑞 5 优	70,000	6,406,789.36	2.50
4	261646	G 恒信 2A1	80,000	2,070,891.63	0.81

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本集合计划本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本集合计划本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.9.1 本期国债期货投资政策

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。

5.9.2 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。

5.9.3 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。

5.10 投资组合报告附注

5.10.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本集合计划投资的前十名证券的发行主体中，中国农业银行股份有限公司、中国人民财产保险股份有限公司、[中邮人寿保险股份有限公司](#)在报告编制日前一年内曾受到监管部门处罚。上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外，本集合计划投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.10.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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。

5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	3,988.83
2	应收证券清算款	4,794,369.01
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	其他	-

8	合计	4,798,357.84
---	----	--------------

5.10.4 报告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。

5.10.5 报告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。

5.10.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 A	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B	兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C
报告期期初基金份额总额	52,578,163.85	72,964,434.32	127,223,478.87
报告期期间基金总申购份额	9,066,160.68	-	20,714,609.47
减：报告期期间基金总赎回份额	8,014,560.34	4,261,211.60	37,602,917.32
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-	-
报告期期末基金份额总额	53,629,764.19	68,703,222.72	110,335,171.02

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

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	5,880,691.18
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,880,691.18
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	2.5275

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本集合计划管理人不存在申购、赎回或交易本集合计划的情况。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
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计划份额比例达到或超过 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

2024 年 9 月，孙国雄先生代为履行公司总经理职务，徐翔先生不再担任公司总经理。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会关于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；
- 2、《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》；
- 3、《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托管协议》；
- 4、《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。

9.2 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）

9.3 查阅方式

投资者可登录集合计划管理人的网站 (<http://www.ixzcg1.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

2024 年 10 月 25 日