

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(A类份额)产品资料概要更新

编制日期：2024年6月20日

送出日期：2024年6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3个月(FOF)	集合计划代码	970194
下属分级集合计划简称	兴证资管金麒麟3个月(FOF)A	下属分级集合计划代码	970194
管理人	兴证证券资产管理有限公司	托管人	中国农业银行股份有限公司
资产管理合同生效日	2022年9月5日		
集合计划类型	偏股混合型基金中基金	交易币种	人民币
运作方式	其他开放式	开放频率	每个开放日开放，每份A类集合计划份额最短持有期3个月
投资经理	王德伦	开始担任本集合计划投资经理的日期	2022年9月6日
		证券从业日期	2011年7月1日
投资经理	斯苑蓓	开始担任本集合计划投资经理的日期	2022年9月5日
		证券从业日期	2017年7月17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本资产管理合同等，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》等法规对照公募基金对兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划进行了规范，并在收到中国证监会关于准予兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划合同变更的回函后，完成了向集合计划份额持有人的意见征询。《兴证资管金麒麟

麟3个月持有期混合型基金中基金(FOF)集合资产管理计划资产管理合同》已于2022年9月5日生效，“兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划”正式更名为“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”。

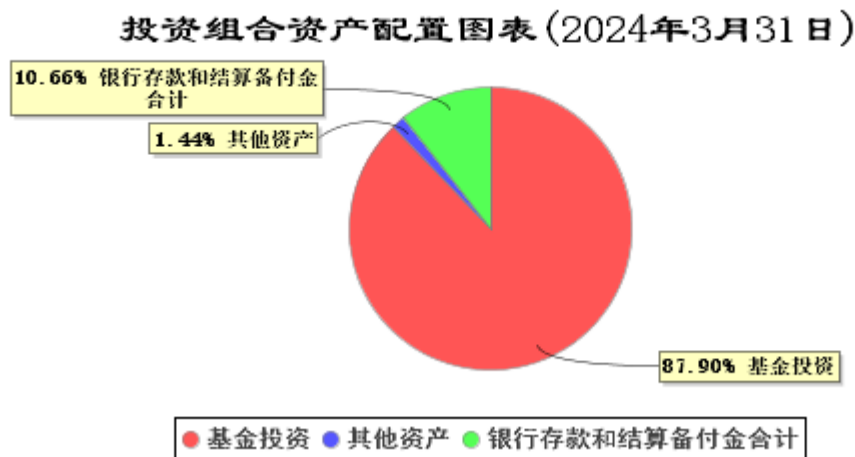
二、集合计划投资与净值表现

(一) 投资目标与投资策略

投资目标	本集合计划在有效控制组合风险的前提下,通过优选基金积极把握基金市场的投资机会,力求实现集合计划资产的长期稳健增值。
投资范围	<p>本集合计划的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括经中国证监会核准或注册的公开募集证券投资基金(包括QDII基金、商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)和香港互认基金)、国内依法发行上市的股票(包括主板、科创板、创业板以及其他中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、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、地方政府债及其他经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(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具以及中国证监会允许集合计划投资的其他金融工具,但须符合中国证监会相关规定。</p> <p>如法律法规或监管机构以后允许集合资产管理计划投资其他品种,管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。</p> <p>本集合计划的投资组合比例为:投资于中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金的资产比例不低于集合计划资产的80%,其中,股票(含存托凭证)、股票型基金、混合型基金(权益类资产比例不低于60%)和商品基金(含商品期货基金和黄金ETF)等合计占集合计划资产的比例为60%-95%,投资于货币市场基金的资产占集合计划资产的比例不高于15%;本集合计划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。</p> <p>如法律法规或中国证监会变更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。</p>
主要投资策略	<p>本集合计划坚持自上而下为主、自下而上为辅,把握“一个中心、四个基本点”,即以大类资产配置为中心的β性机会,以风格配置、行业配置、基金筛选、辅助业绩增厚为四个基本点的α性机会,互为支撑的投资策略。从战略层面和战术层面动态调整配置组合,贯彻全流程风控合规的稳健投资理念。主要策略包括大类资产配置策略(β性机会)、市场风格策略(α机会)、行业配置策略(α机会)、基金筛选策略(α机会)和辅助业绩增厚策略(α机会)。</p> <p>其中,基金筛选策略(α机会)主要聚焦在选择基金的α机会,拟结合基金覆盖与研究范围,通过对产品业绩、投研能力、风险控制等指标定量与定性分析相结合,优选基金赚取α收益。对子基金进行业绩指标、业绩归因、综合调研等定量定性结合研究,结合公司基金池制度,动态跟踪基金市场变化,定期调整。</p>
业绩比较基准	中证偏股型基金指数收益率×70%+中债-综合全价(总值)指数收益率×25%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本集合计划是混合型基金中基金集合资产管理计划,其预期收益和风险水平高于货币市场基金、货币型基金中基金、债券型基金、债券型基金中基金,低于股票型基金、股票型基金中基金。

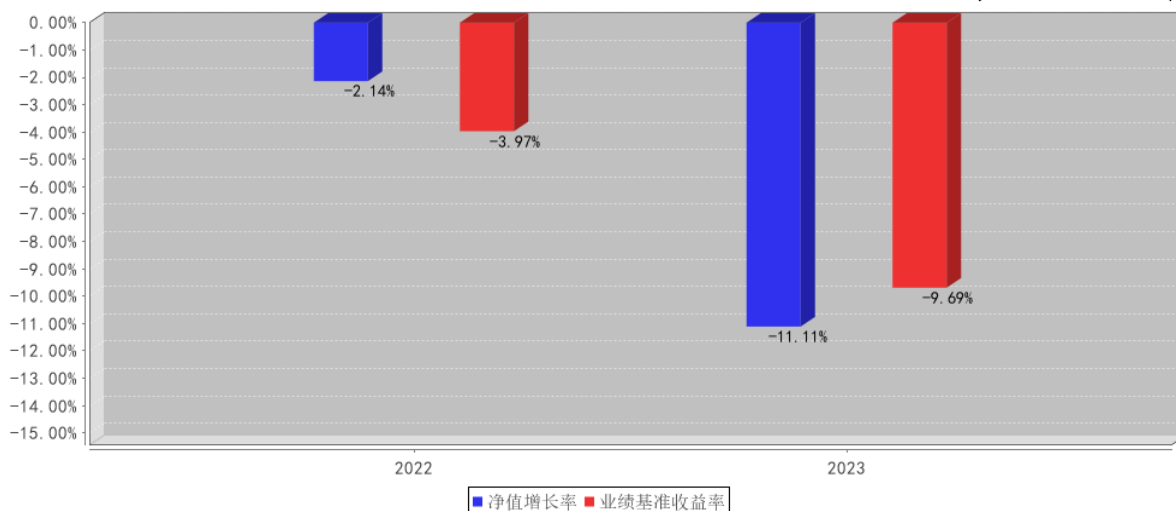
注：投资者欲了解本集合计划的详细情况，请仔细阅读本集合计划的《招募说明书》。本集合计划产品有风险，投资需谨慎。

(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3个月(FOF)A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9月5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)	M<100万元	1.5%	-
	100万元≤M<500万元	0.8%	-

赎回费	500万元 \leq M $<$ 1000万元	0.5%	-
	M \geq 1000万元	1000元/笔	-
	N $<$ 7日	1.50%	-
	7日 \leq N $<$ 30日	0.75%	-
	30日 \leq N $<$ 180日	0.50%	-
	N \geq 180日	0.00%	-

注：本集合计划已经存续，因此没有发售安排，未设置认购费。

本集合计划A类份额按实际持有天数计算赎回费，每份A类份额设置3个月的最短持有期。投资者依据原《兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划资产管理合同》参与集合计划获得的兴业证券金麒麟3号优选基金组合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A类份额，其持有期限自原兴业证券金麒麟3号优选基金组合集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算。

(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	0.8%	管理人和销售机构
托管费	0.1%	托管人
审计费用	50,000.00	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注册登记机构相关费用（包括登记结算费、服务月费、年度电子合同服务费）、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、券商佣金的结算费、相关账户费用及其他类似性质的费用等）及投资其他基金的费用；集合计划的银行汇划费用、银行账户维护费用；集合计划投资证券投资基金份额产生的费用（包括但不限于申购费、赎回费等），但法律法规禁止从集合计划财产中列支的除外；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用测算

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）

1.07%

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。

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、关联交易与利益冲突的风险、操作和技术风险、合规性风险、本集合计划特有风险、科创板股票投资风险、税收风险和其他风险。

本集合资产管理计划财产投资于科创板股票，会面临科创板因投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括但不限于市场风险、流动性风险、退市风险、系统性风险、政策及宏观环境风险等。

本集合计划特有风险：

本集合计划为混合型基金中基金集合资产管理计划，存在资产配置风险，虽然资产配置可能为本集合计划资产的增值带来超额回报，但由于信息来源的不足、滞后或错误，导致管理人在判断宏观市场、行业周期时产生偏差，且在选择证券品种时产生失误，造成集合计划资产的配置未能达到预期的目标，投资者可能将蒙受一定的损失。本集合计划存在基金投资风险，在挑选基金等投资品种的过程中，管理人的专业技能、研究能力及投资管理水平直接影响到其对信息的占有、分析和对经济形势、证券价格走势的判断，进而影响集合计划的投资收益水平，且管理人在构建基金投资组合时，对基金的选择在很大的程度上依靠了基金的历史业绩表现，但是基金的过往业绩往往不能代表基金未来的表现，所以可能引起一定的风险。另外，由于本集合计划投资于不同投资目标和投资策略的基金，本集合计划将间接承担所投资基金净值波动所带来的风险。再者，本集合计划所投资基金的持仓可能集中于某一行业或某一证券发行人，从而增加本集合计划净值的波动。其他特有风险包括双重收费降低本集合计划收益的风险、集合计划运作风险、A类/C类份额最短持有期限内不能赎回集合计划份额的风险、投资于QDII基金及香港互认基金的风险、投资商品基金的风险、投资科创板股票的特定风险、投资创业板股票的特定风险、投资存托凭证的风险、资产支持证券投资风险、投资可交换债券的风险、可转换债券的投资风险、次级债的投资风险、债券回购风险、流通受限证券及流通受限基金的投资风险、暂停估值的风险。

（二）重要提示

中国证监会对本集合计划的注册，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。仲裁委员会是中国国际经济贸易仲裁委员会, 仲裁地点是北京。

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.ixzscgl.com/>)。客服电话: 95562-3。

- 1、本集合计划合同、托管协议、招募说明书;
- 2、定期报告, 包括集合计划季度报告、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