

兴证资管金麒麟悦享添利
30 天滚动持有债券型证券投资基金
2026 年第 2 季度报告

2026 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：2026 年 7 月 21 日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 7 月 20 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。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金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基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。
本报告期自 2026 年 4 月 1 日起至 2026 年 6 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	176,483,038.50 份
投资目标	本基金在控制风险和保持较高流动性的前提下，追求基金资产的稳健增值。
投资策略	本基金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基金投资的其他品种的投资比例进行配置和调整，力争实现基金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。 对于衍生品投资策略，本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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。本基金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。本基金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基金投资其他衍生工具，本基金将按届时有效的法律法规和监管机构的规定，制定与本基金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-综合全价（总值）指数收益率*80%+一年期定期存款基准利率（税后）*20%		
风险收益特征	本基金为债券型基金，其风险收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。		
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	57,083,923.72 份	50,402,832.60 份	68,996,282.18 份

注：1、2022 年 5 月 30 日，“兴证资管金麒麟定享纯利集合资产管理计划”正式变更为“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）。2025 年 8 月 1 日，“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”变更注册为“兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金”（以下简称“本基金”）；

2、根据本基金《基金合同》和《招募说明书》的约定，本基金对于每份 A 类、C 类基金份额，设定 30 天的滚动运作期。运作期内 A 类、C 类基金份额不办理赎回或其他业务。每份 A 类、C 类基金份额可以在运作期到期日就该基金份额提出赎回申请。如果 A 类、C 类基金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，该基金份额自动进入下一个运作期。

对于依据原《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》申购获得的每份 A 类、C 类基金份额，第一个运作期起始日指该基金份额申购确认日；对于依据基金合同申购获得的每份 A 类、C 类基金份额，第一个运作期起始日指该基金份额申购确认日；对于上一运作期到期日未赎回的每份 A 类、C 类基金份额的下一运作期起始日，指该基金份额上一运作期到期日的次一日。

对于依据原《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》申购获得的每份 A 类、C 类基金份额，第一个运作期到期日指自该基金份额申购申请日后的第 30 天（如该日非工作日，则顺延到下一工作日，下同）；对于依据基金合同申购获得的每份 A 类、C 类基金份额，第一个运作期到期日指自该基金份额申购申请日后的第 30 天，第二个运作期到期日指自该基金份额申购申请日后的第 60 天，以此类推。

在本基金存续期间，B 类基金份额只开放赎回，不开放申购，且不设定 30 天的滚动运作期。

基金份额持有人持有原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的期限连续计算。

§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（2026 年 4 月 1 日-2026 年 6 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	345,040.73	379,686.43	377,361.92
2. 本期利润	310,829.44	347,618.09	338,063.14
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0051	0.0067	0.0045
4. 期末基金资产净值	63,107,919.25	62,992,293.35	75,657,855.26
5. 期末基金份额净值	1.1055	1.2498	1.0965

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、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、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（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	0.46%	0.01%	0.57%	0.03%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	0.95%	0.01%	0.88%	0.03%	0.07%	-0.02%
过去一年	1.67%	0.01%	0.16%	0.04%	1.51%	-0.03%
过去三年	7.21%	0.02%	4.39%	0.03%	2.82%	-0.01%
自基金合同生效起至今	10.55%	0.02%	6.87%	0.02%	3.68%	0.00%

兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B

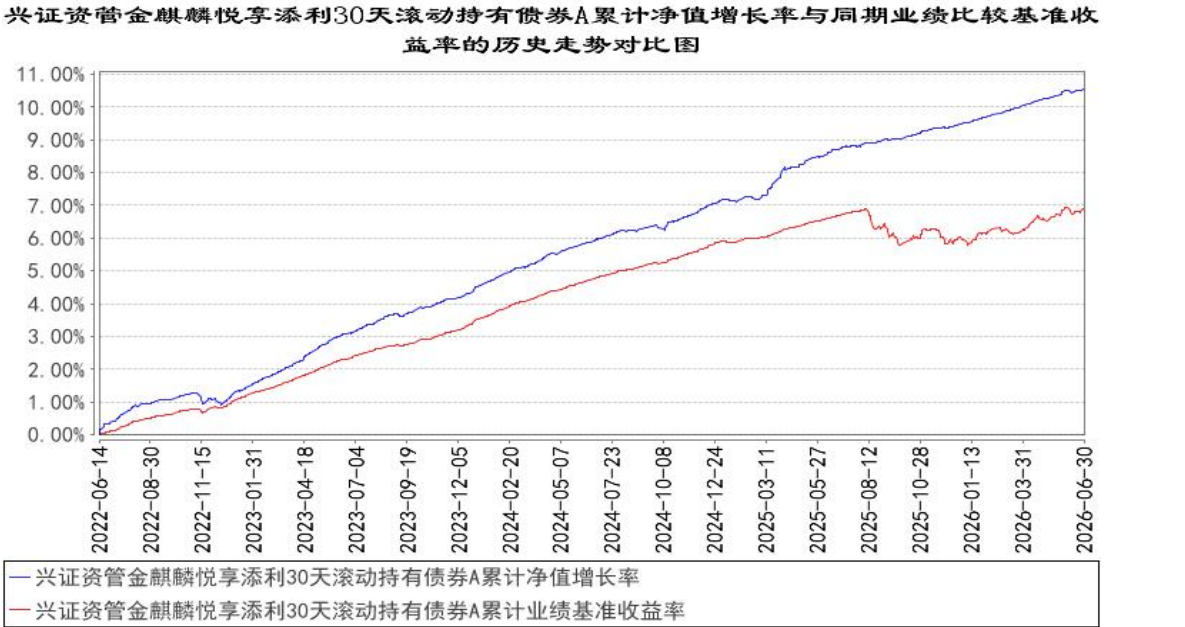
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.54%	0.01%	0.57%	0.03%	-0.03%	-0.02%
过去六个月	1.11%	0.01%	0.88%	0.03%	0.23%	-0.02%
过去一年	1.99%	0.01%	0.16%	0.04%	1.83%	-0.03%
过去三年	8.15%	0.02%	4.39%	0.03%	3.76%	-0.01%
自基金合同	11.89%	0.02%	6.94%	0.02%	4.95%	0.00%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

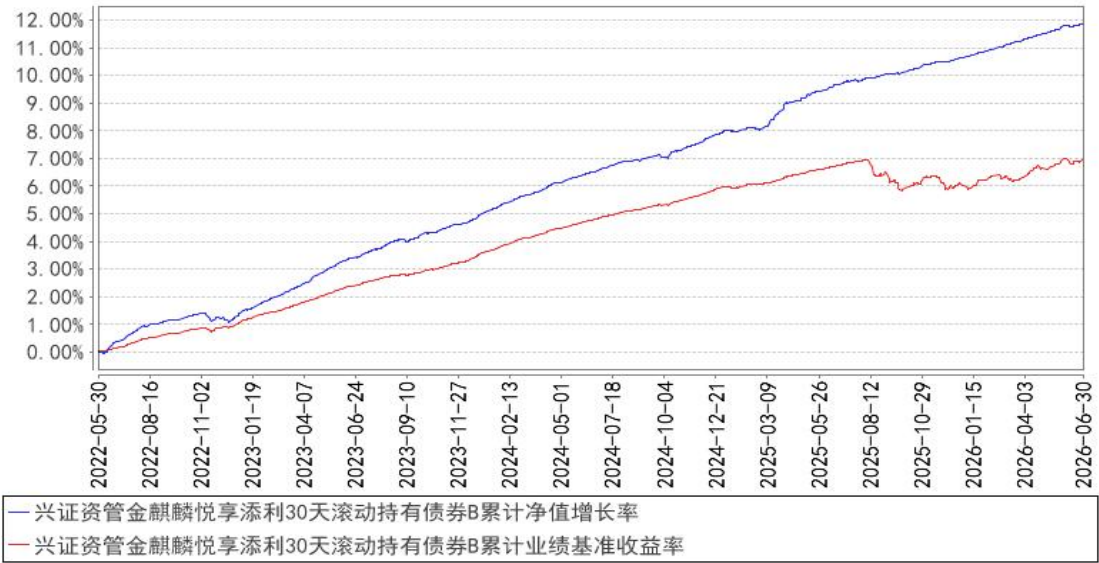
兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C

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	0.41%	0.01%	0.57%	0.03%	-0.16%	-0.02%
过去六个月	0.85%	0.01%	0.88%	0.03%	-0.03%	-0.02%
过去一年	1.47%	0.01%	0.16%	0.04%	1.31%	-0.03%
过去三年	6.54%	0.02%	4.39%	0.03%	2.15%	-0.01%
自基金合同 生效起至今	9.65%	0.02%	6.87%	0.02%	2.78%	0.00%

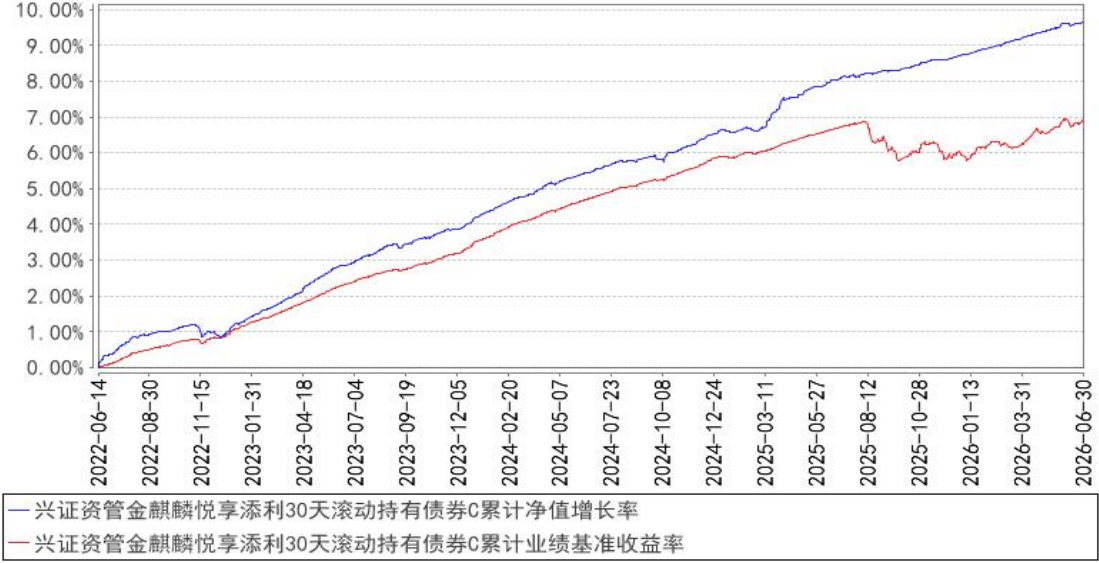
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收
率变动的比较



兴证资管金麒麟悦享添利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



兴证资管金麒麟悦享添利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 2026 年 06 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投资部（原公	2025 年 8 月 11 日	—	16 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

	募业务部) 基金经理				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, 公募投资部投资经理, 公募业务部投资经理, 公募投资部(原公募业务部)投资经理。现任公募投资部(原公募业务部)基金经理。
--	------------	--	--	--	---

注: 1、吕晓威自 2022 年 5 月 30 日至 2025 年 8 月 10 日担任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的投资经理;

2、基金的首任基金经理, 其“任职日期”为基金合同生效日, 其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期;

3、非首任基金经理, 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;

4、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, 本基金基金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遵规守信情况的说明

本报告期内, 本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定, 本着诚实守信、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产, 在严格控制风险的前提下, 为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内, 本基金无重大违法违规行为及违反基金合同约定的行为, 未有损害基金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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有公募基金和投资组合, 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。报告期内, 本基金管理人严格执行了《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。公司对投资交易行为进行监测, 未发现违反公平交易制度的情况。

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

2026 年二季度债券市场以收益率震荡下行为主。经济基本面依然整体呈现 K 型分化，PMI 等经济数据呈现冲高回落的特征，包括社零，固定资产投资等数据同比下滑，通胀数据呈现温和修复的特征，整体看经济数据有所降温。6 月的信贷增速面临回落的压力，社融增速回落至 7.5%，信贷需求的疲弱为债券市场的收益率的震荡下行提供了支撑。央行于二季度末创设了隔夜逆回购等货币政策工具，同时完善了短端利率调控机制，将隔夜正、逆回购的操作区间收窄至 50bp，二季度末资金面基本维持平稳。二季度期限利差特别是长端利率维持在相对较高区间。信用债表现整体好于利率债，信用利差压缩。产品主要以高等级短久期债券为底仓，在二季度参与了利率债的阶段性机会，产品整体维持了适度杠杆。

4.5 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悦享添利 30 天滚动持有债券 A 份额净值为 1.1055 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.46%；同期业绩比较基准收益率为 0.57%。兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 B 份额净值为 1.2498 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.54%；同期业绩比较基准收益率为 0.57%。兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券 C 份额净值为 1.0965 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.41%；同期业绩比较基准收益率为 0.57%。

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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满两百人或者基金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	228,149,744.59	95.32
	其中：债券	228,149,744.59	95.32
	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	2,901,080.56	1.21
	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	2,150,842.43	0.90
8	其他资产	6,151,544.85	2.57
9	合计	239,353,212.43	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

本基金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

本基金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

本基金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	8,766,391.86	4.35
2	央行票据	—	—
3	金融债券	127,907,353.69	63.40
	其中：政策性金融债	10,295,498.63	5.10
4	企业债券	81,450,281.23	40.37
5	企业短期融资券	10,025,717.81	4.97
6	中期票据	—	—
7	可转债（可交换债）	—	—
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	228,149,744.59	113.08

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	160310	16 进出 10	100,000	10,295,498.63	5.10
2	240480	24 中邮 01	100,000	10,195,109.59	5.05
3	072610084	26 财信证券 CP003	100,000	10,025,717.81	4.97
4	149776	22 国信 02	90,000	9,224,699.18	4.57
5	2420034	24 厦门国际银行 01	90,000	9,197,247.95	4.56

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金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

本基金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

本基金可投资国债期货。若本基金投资国债期货，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。

本基金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

本基金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

本基金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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，中国进出口银行、厦门国际银行股份有限公司、中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内受到监管部门处罚。

除上述主体外，本基金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约定的备选股票库

本报告期内，本基金投资的前十名股票未超出基金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	6,610.92
2	应收证券清算款	5,999,750.96
3	应收股利	—
4	应收利息	—
5	应收申购款	140,501.99
6	其他应收款	—
7	待摊费用	4,680.98
8	其他	—
9	合计	6,151,544.85

5.10.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金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

本基金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	62,892,591.40	53,099,776.51	76,176,426.24
报告期期间基金总申购份额	4,832,751.22	—	23,323,053.71
减：报告期期间基金总赎回份额	10,641,418.90	2,696,943.91	30,503,197.77
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	57,083,923.72	50,402,832.60	68,996,282.18

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	24,080,228.16
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	24,080,228.16
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	13.6445

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，本基金管理人不存在申购、赎回或交易本基金的情况。

§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							
本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况，故不涉及本项特有风险。							

注：本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金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

本报告期内，2026 年 4 月 9 日起，王焕舟同志担任本公司董事长职务，刘宇先生不再担任公司董事长职务；

2026 年 4 月 10 日起，王焕舟先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，刘宇先生不再代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务；

2026 年 4 月 10 日起，陈怡女士担任公司副总裁；

2026 年 4 月 28 日起，公司法定代表人变更为王焕舟先生。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会准予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变更注册的批复文件；

2、《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金基金合同》；

3、《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金托管协议》；

4、《兴证资管金麒麟悦享添利 30 天滚动持有债券型证券投资基金招募说明书》；

5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金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

本基金管理人的办公场所（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

投资者可登录基金管理人的网站（<http://www.ixzzcgl.com>）查询，或在营业时间内至基金管理人办公场所免费查阅。

兴证证券资产管理有限公司

2026 年 7 月 21 日