兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金
2026 年中期报告

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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 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的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 08 月 27 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。

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及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 年 06 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 5

2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6

§3 主要财务指标和基金净值表现 6

3.1 主要会计数据和财务指标 6
3.2 基金净值表现 7

§4 管理人报告 8

4.1 基金管理人及基金经理情况 8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 11
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 11

§5 托管人报告 12

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 12
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 12
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 12

§6 半年度财务会计报告（未经审计） 12

6.1 资产负债表 12
6.2 利润表 14
6.3 净资产变动表 15
6.4 报表附注 17

§7 投资组合报告 41

7.1 期末基金资产组合情况 41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 41
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 42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 44
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 44

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 45
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 45
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 45
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 45
7.11 投资组合报告附注 45

§8 基金份额持有人信息 46

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 46
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 47
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情况 47

§9 开放式基金份额变动 47

§10 重大事件揭示 48

10.1 基金份额持有人大会决议 48
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 48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 48
10.4 基金投资策略的改变 48
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 48
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 48
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 49
10.8 其他重大事件 50

§11 影响投资者决策的其他重要信息 51

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 51
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 51

§12 备查文件目录 52

12.1 备查文件目录 52
12.2 存放地点 52
12.3 查阅方式 52

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金	
基金简称	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券	
基金主代码	970204	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 7 日	
基金管理人	兴证证券资产管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	48,634,374.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C
下属分级基金的交易代码	970204	970205
报告期末下属分级基金的份额总额	36,050,657.56 份	12,583,716.68 份

注：1、2022 年 11 月 7 日，“兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划”变更为“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”。2025 年 10 月 20 日，“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”变更为“兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金”；

2、根据本基金《基金合同》和《招募说明书》的约定，本基金 A 类和 C 类基金份额的最短持有期为六个月，最短持有期内，投资者不能提出申请赎回所持有的该笔 A 类和 C 类基金份额，期满后投资者可提出赎回申请。A 类基金份额包含原《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资产管理合同》生效前存续的份额，其持有期限自原兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划份额被确认之日起连续计算。基金份额持有人持有原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的期限连续计算。

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制风险的前提下，通过积极主动的资产配置，追求资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金主要策略包括大类资产配置策略、固定收益投资策略、股票投资策略、金融衍生工具投资策略等。大类资产配置策略通过密切关注宏观经济走势，深入分析货币和财政政策、国家产业政策以及资本市场资金环境、证券市场走势等，综合考量各类资产的市场容量、市场流动性和风险收益特征等因素，在固定收益类资产、权益类资产、衍生品等资产类别之间进行动态配置。固定收益投资策略涵盖资产配置策略、债券投资策略、可交换债券投资策略、可转债投资策略、证券公司短期公司债券投资策略、杠杆投资策略、银行存款、同业存单投资策略等。 股票投资策略涵盖个股投资策略、行业配置策略等。金融衍生工具投资策略包括国债期货投资策略等。

业绩比较基准	中债-综合全价(总值)指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%
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、混合型基金，高于货币市场基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	翁建国	冯萌
	联系电话	95562-3	021-52629999-213310
	电子邮箱	zcgl@xyzq.com.cn	fengmeng@cib.com.cn
客户服务电话		95562-3	95561
传真		021-68581323	021-62159217
注册地址		福建省平潭县金井镇天山北路 3 号金井湾商务营运中心 6 栋 15 层 110 室	福建省福州市台江区江滨中大道 398 号兴业银行大厦
办公地址		上海市浦东新区长柳路 36 号兴业证券大厦 9 层	上海市浦东新区银城路 167 号 4 楼
邮政编码		200135	200120
法定代表人		王焕舟	吕家进

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.ixzzcgl.com
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的办公场所

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

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日-2026 年 6 月 30 日)	
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C
本期已实现收益	308,299.51	21,068.96
本期利润	1,012,815.91	230,682.75
加权平均基金份额本期利润	0.0321	0.0454
本期加权平均净值利润率	2.87%	4.21%
本期基金份额净值增长率	2.77%	2.65%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	4,265,830.22	865,502.59
期末可供分配基金份额利润	0.1183	0.0688

期末基金资产净值	40,978,423.35	13,687,127.78
期末基金份额净值	1.1367	1.0877
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	10.09%	8.77%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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、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

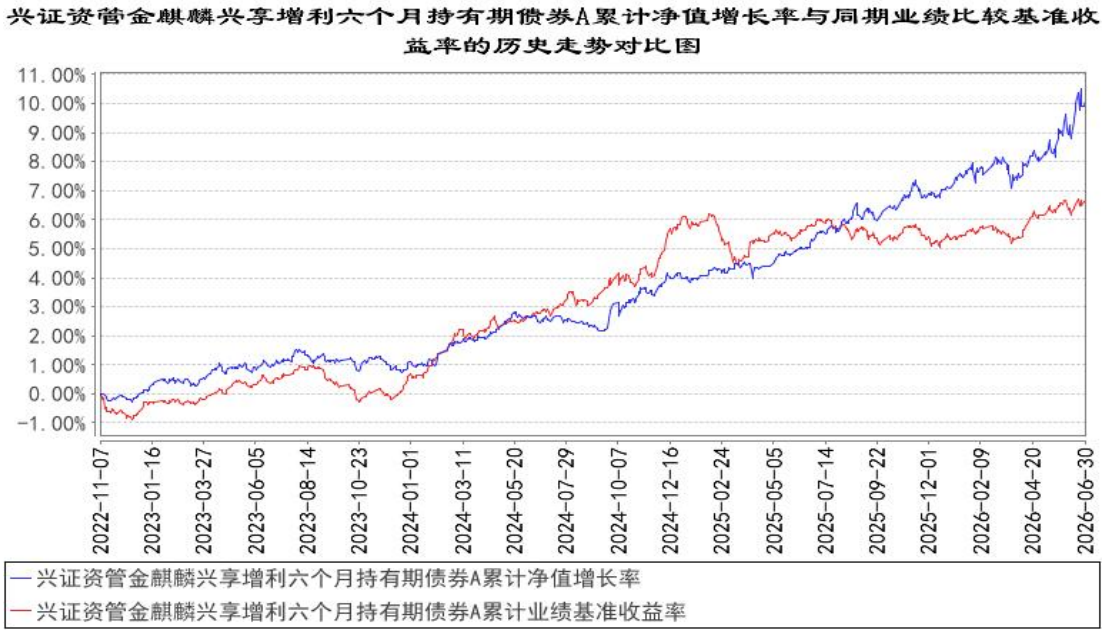
兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A

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
过去三个月	2.55%	0.21%	1.16%	0.08%	1.39%	0.13%
过去六个月	2.77%	0.18%	1.21%	0.07%	1.56%	0.11%
过去一年	4.51%	0.14%	0.84%	0.07%	3.67%	0.07%
过去三年	9.03%	0.10%	6.14%	0.07%	2.89%	0.03%
自基金合同生效起至今	10.09%	0.09%	6.64%	0.07%	3.45%	0.02%

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 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
过去三个月	2.49%	0.22%	1.16%	0.08%	1.33%	0.14%
过去六个月	2.65%	0.19%	1.21%	0.07%	1.44%	0.12%
过去一年	4.20%	0.14%	0.84%	0.07%	3.36%	0.07%
过去三年	7.81%	0.10%	6.14%	0.07%	1.67%	0.03%
自基金合同生效起至今	8.77%	0.09%	7.11%	0.07%	1.66%	0.02%

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





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，公司注册资本金为 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（SH601377）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。目前公司经营范围为证券资产管理；公开募集证券投资基金管理。

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。公司已形成公、私募两大业务板块，固收、权益、FOF 和多资产业务齐头并进、均衡发展。

兴证证券资产管理有限公司现有 12 只公开募集证券投资基金，分别为兴证资管金麒麟领先优势一年持有期混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟消费升级混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟均衡优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟兴享优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟兴睿优选混合型证券投资基金、兴证资管金麒麟恒睿致远一年持有期混合型证券投资基金、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、兴证资管金麒麟 3 个月持有期混合型基金中基金(FOF)、兴证资管金麒麟现金添利货币市场基金、兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金、兴证资管国企红利优选混合型发起式证券投资基金、兴证资管恒睿致胜混合型发起式证券投资基金。

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		
吕晓威	兴证证券资产管理有限公司公募投资部（原公募业务部）基金经理	2025 年 10 月 20 日	-	13 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 11 月 7 日至 2025 年 10 月 19 日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。

4.1.3 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 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 5%的情况。本报告期内,未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2026 年上半年债券市场收益率整体呈现先上后下的走势。一季度央行没有进行降准降息操作，在年初通胀预期有所抬头的情况下，长端利率债有所上行，但受资金利率较为宽松的影响，中短端收益率下行。期限利差走扩。信用债整体表现好于利率债，信用利差持续压缩。进入二季度，债券市场收益率震荡下行，部分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。二季度的信贷增速面临回落的压力，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。超长端期限利差处于较高区间。上半年权益市场呈现分化特征，科技行业受业绩驱动涨幅较大，后期出现较明

显回调，传统行业表现相对较弱。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，权益维持了部分科技和红利的配置，产品整体维持了少量杠杆。

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兴享增利六个月持有期债券 A 份额净值为 1.1367 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.77%；同期业绩比较基准收益率为 1.21%。兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C 份额净值为 1.0877 元，本报告期基金份额净值增长率为 2.65%；同期业绩比较基准收益率为 1.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，主要经济数据依然相对偏弱，经济基本面依然呈现 K 型分化的特征，信贷需求回落的趋势或有所延续，居民部门的资产负债表依然在缩减，消费处于低位震荡，通胀有所放缓，为债券市场提供了支撑。 但是三季度债券供给或有所提速，货币政策虽然具有空间，但调整的紧迫性有所降低。海外市场通胀依然处于高位，科技等行业依然处于景气区间。整体市场或将围绕经济复苏以及政策力度进行交易，低利率环境下，波动区间或有所收敛。权益市场在科技板块深度回调后，依然具有配置机会，但在大幅波动后，市场风格或偏向相对均衡。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值管理委员会，并制定了相关制度及流程。估值管理委员会对公司依法管理的基金的估值政策、估值方法和估值模型进行研究、决策、评估，确定基金估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理，切实维护持有人利益。估值管理委员会由公司总裁、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、战略与产品部负责人、综合管理部负责人、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基金的具体估值业务。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

根据本基金合同，在符合有关基金分红条件的前提下，本基金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；基金可供分配利润指截至收益分配基准日基金未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及本基金合同的规定。

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

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的情形。

报告期内，本基金出现大于连续六十个工作日基金资产净值低于五千万的情形。本基金管理

人已将解决方案上报中国证券监督管理委员会。

自 2025 年 11 月 29 日起至本报告期末，由本基金管理人承担本基金信息披露费、审计费等费用。

§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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据自身能够获取的数据和信息，依据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人根据自身能够获取的数据和信息，认真复核了本中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	1,006,562.44	74,768.28
结算备付金		132,478.23	406,578.77
存出保证金		7,403.54	4,067.17
交易性金融资产	6.4.7.2	50,786,413.79	39,156,645.68
其中：股票投资		6,003,401.00	3,333,102.68
基金投资		-	-

债券投资		44,783,012.79	33,214,179.72
资产支持证券投资		-	2,609,363.28
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	3,500,001.75	-
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		1,180,799.42	3,092,050.69
应收股利		-	-
应收申购款		1,998.40	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	79,710.22	7,855.60
资产总计		56,695,367.79	42,741,966.19
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 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		-	5,450,140.23
应付清算款		1,932,379.50	-
应付赎回款		-	3,095,680.00
应付管理人报酬		13,407.99	9,518.25
应付托管费		4,469.33	3,172.77
应付销售服务费		6,563.73	145.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		713.52	413.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	72,282.59	62,269.73
负债合计		2,029,816.66	8,621,339.65
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	48,634,374.24	30,850,676.87
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	6,031,176.89	3,269,949.67
净资产合计		54,665,551.13	34,120,626.54
负债和净资产总计		56,695,367.79	42,741,966.19

注： 报告截止日 2026 年 06 月 30 日，兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A 基金份额净

值 1.1367 元，基金份额总额 36,050,657.56 份；兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C 基金份额净值 1.0877 元，基金份额总额 12,583,716.68 份。兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券份额总额合计为 48,634,374.24 份。

6.2 利润表

会计主体：兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,340,153.90	716,946.90
1.利息收入		2,116.63	17,661.52
其中：存款利息收入	6.4.7.13	1,971.88	2,343.78
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		144.75	15,317.74
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		423,907.08	803,535.84
其中：股票投资收益	6.4.7.14	98,775.95	72,861.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	285,721.19	655,560.77
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	12,283.19	31,600.17
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.17	-	-
股利收益	6.4.7.18	27,126.75	43,513.25
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）	6.4.7.19	914,130.19	-104,250.46
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	-	-
减：二、营业总支出		96,655.24	151,106.15
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	60,333.06	72,732.23

其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	20,111.03	24,244.11
3．销售服务费	6.4.10.2.3	6,632.61	2,874.89
4．投资顾问费		-	-
5．利息支出		8,821.44	5,831.41
其中：卖出回购金融资产支出		8,821.44	5,831.41
6．信用减值损失	6.4.7.21	-	-
7．税金及附加		311.08	362.36
8．其他费用	6.4.7.22	446.02	45,061.15
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,243,498.66	565,840.75
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,243,498.66	565,840.75
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,243,498.66	565,840.75

6.3 净资产变动表

会计主体：兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	30,850,676.87	-	3,269,949.67	34,120,626.54
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	30,850,676.87	-	3,269,949.67	34,120,626.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	17,783,697.37	-	2,761,227.22	20,544,924.59
（一）、综合收益总额	-	-	1,243,498.66	1,243,498.66
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变	17,783,697.37	-	1,517,728.56	19,301,425.93

动数（净资产减少以“-”号填列）				
其中：1.基金申购款	22,083,397.74	-	1,997,284.20	24,080,681.94
2.基金赎回款	-4,299,700.37	-	-479,555.64	-4,779,256.01
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	48,634,374.24	-	6,031,176.89	54,665,551.13
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	51,783,887.23	-	3,822,727.94	55,606,615.17
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	51,783,887.23	-	3,822,727.94	55,606,615.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,435,074.38	-	181,422.06	-5,253,652.32
（一）、综合收益总额	-	-	565,840.75	565,840.75
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-5,435,074.38	-	-384,418.69	-5,819,493.07
其中：1.基金申购款	4,321,896.94	-	353,017.78	4,674,914.72

2. 基金赎回款	-9,756,971.32	-	-737,436.47	-10,494,407.79
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	46,348,812.85	-	4,004,150.00	50,352,962.85

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：

王焕舟	杨华	吴勇滨
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

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金由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变更而来，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由兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划变更而来，兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划由兴业卓越 1 号集合资产管理计划变更而来。

2008 年 12 月 30 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卓越 1 号集合资产管理计划的批复》（证监许可[2008]1468 号），兴业卓越 1 号集合资产管理计划设立。兴业卓越 1 号集合资产管理计划自 2009 年 2 月 23 日起向社会公众发行，2009 年 3 月 23 日结束募集并于 2009 年 3 月 27 日成立。2010 年 9 月 20 日，中国证券监督管理委员会福建监管局作出《关于兴业证券股份有限公司集合资产管理计划更名无异议的函》（闽证监函[2010]277 号），兴业卓越 1 号集合资产管理计划更名为兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划。

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 1 号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 1 号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。《兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券

型集合资产管理计划资产管理合同》于 2022 年 11 月 7 日生效。“兴业证券金麒麟 1 号集合资产管理计划”正式更名为“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”。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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》（证监会公告〔2018〕39 号）、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等规定及中国证监会《关于准予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变更注册的批复》（证监许可〔2025〕1705 号），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于 2025 年 9 月 23 日通过份额持有人大会表决通过《关于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变更为兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金有关事项的议案》，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于 2025 年 10 月 20 日起正式变更为兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他在境内经中国证监会核准或注册发行上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、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、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货以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证券品种。

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，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；投资于可转换债券、可交换债券以及股票的投资比例合计不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金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。

本基金业绩比较基准：中债-综合全价（总值）指数收益率×90%+沪深 300 指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金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》（以下合称“企业会计准则”）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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 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的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况、2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 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

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

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 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《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[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部　税务总局　中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部　税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 基金管理人运营基金过程中发生的增值税应税行为，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。基金管理人运营基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内(含 1 个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年(含 1 年)的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	1,006,562.44
等于：本金	1,006,514.40
加：应计利息	48.04
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	1,006,562.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,908,150.59	-	6,003,401.00	1,095,250.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	25,052,072.35	243,244.40	25,247,534.30	-47,782.45
	银行间市场	19,322,588.00	277,278.49	19,535,478.49	-64,388.00
	合计	44,374,660.35	520,522.89	44,783,012.79	-112,170.45
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		49,282,810.94	520,522.89	50,786,413.79	983,079.96

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

本基金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

本基金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

本基金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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	3,500,001.75	-
银行间市场	-	-
合计	3,500,001.75	-

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有其他权益工具投资。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	79,710.22
待摊费用	-
合计	79,710.22

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 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	10,914.32
其中：交易所市场	8,141.82
银行间市场	2,772.50
应付利息	-
预提费用	61,368.27
合计	72,282.59

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	30,796,887.59	30,796,887.59
本期申购	9,525,548.64	9,525,548.64
本期赎回（以“-”号填列）	-4,271,778.67	-4,271,778.67
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	36,050,657.56	36,050,657.56

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,789.28	53,789.28
本期申购	12,557,849.10	12,557,849.10
本期赎回（以“-”号填列）	-27,921.70	-27,921.70
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	12,583,716.68	12,583,716.68

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

本基金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

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,331,675.00	-64,931.34	3,266,743.66
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,331,675.00	-64,931.34	3,266,743.66
本期利润	308,299.51	704,516.40	1,012,815.91
本期基金份额交易产生的变动数	625,855.71	22,350.51	648,206.22
其中：基金申购款	1,106,148.14	19,729.57	1,125,877.71

基金赎回款	-480,292.43	2,620.94	-477,671.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,265,830.22	661,935.57	4,927,765.79

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,242.86	-36.85	3,206.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	3,242.86	-36.85	3,206.01
本期利润	21,068.96	209,613.79	230,682.75
本期基金份额交易产生的变动数	841,190.77	28,331.57	869,522.34
其中：基金申购款	842,987.52	28,418.97	871,406.49
基金赎回款	-1,796.75	-87.40	-1,884.15
本期已分配利润	-	-	-
本期末	865,502.59	237,908.51	1,103,411.10

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,569.69
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	371.24
其他	30.95
合计	1,971.88

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 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	98,775.95
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	98,775.95

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	6,326,890.68
减：卖出股票成本总额	6,220,520.17
减：交易费用	7,594.56
买卖股票差价收入	98,775.95

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	468,476.74
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-182,755.55
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	285,721.19

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	61,212,768.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	60,448,270.77
减：应计利息总额	936,297.42
减：交易费用	10,955.52
买卖债券差价收入	-182,755.55

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

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
资产支持证券投资收益——利息收入	9,785.22
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	2,497.97
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,283.19

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

单位：人民币元

项目	本期

	2026年1月1日至2026年6月30日
卖出资产支持证券成交总额	2,618,441.44
减：卖出资产支持证券成本总额	2,571,500.00
减：应计利息总额	44,341.44
减：交易费用	102.03
资产支持证券投资收益	2,497.97

6.4.7.17 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.18 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	27,126.75
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	27,126.75

6.4.7.19 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	914,130.19
股票投资	911,342.54
债券投资	6,387.65
资产支持证券投资	-3,600.00
基金投资	-
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	914,130.19

6.4.7.20 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.21 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行费用	446.02
合计	446.02

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，本基金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，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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基金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”)	基金管理人、基金销售机构
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人、基金销售机构
兴业证券股份有限公司(“兴业证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
兴证期货有限公司(“兴证期货”)	基金管理人的股东的子公司
兴证全球基金管理有限公司(“兴证基金”)	基金管理人的股东的子公司
兴证投资管理有限公司(“兴证投资”)	基金管理人的股东的子公司
福州兴证物业管理有限公司	基金管理人的股东的子公司
兴证(香港)金融控股有限公司(“兴证香港”)	基金管理人的股东的子公司
兴证创新资本管理有限公司(“兴证资本”)	基金管理人的股东的子公司
兴证国际金融集团有限公司(“兴证国际”)	同受基金管理人控股股东控制

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
兴业证券	14,290,963.69	100.00	3,010,280.11	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	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 成交总额的比例（%）
兴业证券	80,865,271.03	100.00	36,853,074.81	100.00

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
兴业证券	104,953,000.00	100.00	104,105,467.75	100.00

6.4.10.1.4 权证交易

本基金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 2026年1月1日至2026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	10,886.37	100.00	8,141.82	100.00
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	5,385.38	100.00	2,923.19	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基金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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	60,333.06	72,732.23
其中：应支付销售机构的客户维护费	20,582.62	24,252.35

应支付基金管理人的净管理费	39,750.44	48,479.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.3%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×0.3%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	20,111.03	24,244.11

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.1%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.1%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C	合计
兴业证券	-	83.39	83.39
兴证资管	-	1,019.97	1,019.97
合计	-	1,103.36	1,103.36
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	兴证资管金麒麟兴享	兴证资管金麒麟兴享	合计

	增利六个月持有期债券 A	增利六个月持有期债券 C	
兴业证券	-	2,864.61	2,864.61
合计	-	2,864.61	2,864.61

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。

销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.25%年费率计提。

销售服务费的计算方法如下：

H=E×0.25%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

本基金本报告期及上年度可比期间未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基金的投资范围，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基金的投资范围，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C
基金合同生效日（ 2022 年 11 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	4,379,771.83	-
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	500,000.00	-
报告期末持有的基金份额	3,879,771.83	-
报告期末持有的基金份额	7.9774%	-

占基金总份额比例		
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C
基金合同生效日（ 2022 年 11 月 7 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	7,379,567.24	-
报告期间申购/买入总份额	918,597.56	-
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	8,298,164.80	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.9037%	-

注：本报告期内，本基金管理人投资本基金的适用费率符合本基金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

份额单位：份

兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例(%)
兴证期货有限公司	6,708,113.43	13.7929	-	-

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至 2025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
兴业银行	1,006,562.44	1,569.69	368,533.23	2,147.68

注：本基金的银行存款由本基金的托管人兴业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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内直接购入关联方承销证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期内，基金管理人自主承担本基金的审计费、信息披露费和银行间账户维护费合计

70,668.27 元（上年度可比期间，基金管理人自主承担本基金的审计费、信息披露费和银行间账户维护费合计 0.00 元）。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金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 2026 年 06 月 30 日止，本基金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 2026 年 06 月 30 日止，本基金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基金的投资范围，故此项不适用。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为债券型基金，其风险收益水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。

本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板及其他在境内经中国证监会核准或注册发行上市的股票）、国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、证券公司短期公司债券、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、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、国债期货以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证券品种。本基金的投资组合比例为：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%；投资于同业存单的比例不超过基金资产的 20%；投资于可转换债券、可交换债券以及股票的投资比例合计不超过基金资产的 20%。本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 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。

本基金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。本基金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，使本基金在科学的风险管理的前提下，实现基金财产的安全和增值。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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。本基金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。

本基金管理人建立组织架构健全、职责边界清晰的风险管理组织架构，明确董事会及其下设风险控制委员会、董事会下设审计委员会、经理层及其下设风险管理委员会、首席风险官，以及各部门、风险管理部门在全面风险管理中的职责分工，建立各部门、风险管理部门之间密切协作、相互衔接、有效制衡的运行机制。

本基金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

信用风险是指债券发行人出现违约、拒绝支付到期本息，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下降的风险，信用风险也包括证券交易对手因违约而产生的证券交割风险。

本基金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。本基金的银行存款存放在本基金开立于托管人的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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。

本基金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。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,180,510.02	2,022,098.41
合计	8,180,510.02	2,022,098.41

注：1、持有发行期限在一年以内（含）的债券按其债项评级作为短期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为长期信用评级进行列示。债券投资以全价列示。

2、未评级部分为国债。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金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

本基金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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	25,651,614.34	21,796,454.75
AAA 以下	6,201,201.64	5,076,887.79
未评级	4,749,686.79	4,318,738.77
合计	36,602,502.77	31,192,081.31

注：1.持有发行期限在一年以上的债券按其债项评级作为长期信用评级进行列示，持有的其他债券以其债项评级作为短期信用评级进行列示。

2.债券投资以全价列示。

3.未评级部分为期限在一年以上的国债、政策性金融债。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	1,589,887.94
AAA 以下	-	1,019,475.34
未评级	-	-
合计	-	2,609,363.28

注：1.持有资产支持证券按其债项评级作为长期信用评级进行列示。

2.资产支持证券投资以全价列示。

3.本基金于本报告期末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

本基金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。本基金的流动性风险一方面来自于基金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，本基金的管理人每日对本基金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。本基金的管理人在基金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，有效保障基金持有人利益。针对投资品种变现的流动性风险，本基金的管理人主要通过限制、跟踪和控制基金投资于流动性受限资产来实现。此外本基金还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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的管理人在基金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》等法规的要求对本基金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基金的组合持仓集中度指标、流通受限制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。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%；本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%；本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过该基金资产净值的 15%。

本基金所持证券均在证券交易所上市或可在银行间同业市场交易；因此，除在附注 6.4.12 中列示的本基金于期末持有的流通受限证券外，本期末本基金的其他资产均能以合理价格适时变现。此外，本基金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，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

本基金的管理人每日对基金组合资产中 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。

本基金的管理人每日预测本基金的流动性需求，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，本基金未发生重大流动性风险事件。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金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

利率风险是指基金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。

本基金主要投资于交易所和银行间同业市场的固定收益品种，此外还持有银行存款及买入返售金融资产等利率敏感性资产，因此存在相应的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,006,562.44	-	-	-	1,006,562.44
结算备付金	132,478.23	-	-	-	132,478.23
存出保证金	7,403.54	-	-	-	7,403.54
交易性金融资产	15,391,795.59	13,846,424.08	15,544,793.12	6,003,401.00	50,786,413.79
买入返售金融资产	3,500,001.75	-	-	-	3,500,001.75
应收申购款	-	-	-	1,998.40	1,998.40
应收清算款	-	-	-	1,180,799.42	1,180,799.42
其他资产	-	-	-	79,710.22	79,710.22
资产总计	20,038,241.55	13,846,424.08	15,544,793.12	7,265,909.04	56,695,367.79
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,407.99	13,407.99
应付托管费	-	-	-	4,469.33	4,469.33
应付清算款	-	-	-	1,932,379.50	1,932,379.50
应付销售服务费	-	-	-	6,563.73	6,563.73
应交税费	-	-	-	713.52	713.52
其他负债	-	-	-	72,282.59	72,282.59
负债总计	-	-	-	2,029,816.66	2,029,816.66
利率敏感度缺口	20,038,241.55	13,846,424.08	15,544,793.12	5,236,092.38	54,665,551.13
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	74,768.28	-	-	-	74,768.28
结算备付金	406,578.77	-	-	-	406,578.77
存出保证金	4,067.17	-	-	-	4,067.17
交易性金融资产	27,353,438.46	4,920,143.27	3,549,961.27	3,333,102.68	39,156,645.68
应收清算款	-	-	-	3,092,050.69	3,092,050.69

其他资产	-	-	-	7,855.60	7,855.60
资产总计	27,838,852.68	4,920,143.27	3,549,961.27	6,433,008.97	42,741,966.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,095,680.00	3,095,680.00
应付管理人报酬	-	-	-	9,518.25	9,518.25
应付托管费	-	-	-	3,172.77	3,172.77
卖出回购金融资产款	5,450,140.23	-	-	-	5,450,140.23
应付销售服务费	-	-	-	145.48	145.48
应交税费	-	-	-	413.19	413.19
其他负债	-	-	-	62,269.73	62,269.73
负债总计	5,450,140.23	-	-	3,171,199.42	8,621,339.65
利率敏感度缺口	22,388,712.45	4,920,143.27	3,549,961.27	3,261,809.55	34,120,626.54

注：表中所示为本基金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

假设	1.其他影响债券公允价值的变量保持不变		
	2.假设所有期限的利率保持同方向同幅度的变化（即平移收益率曲线）		
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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日 ）
	市场利率+1%	-680,515.83	-260,248.60
	市场利率-1%	718,208.00	268,650.74

注：上表反映了在其他变量不变的假设下，利率发生合理、可能的变动时，为交易而持有的债券公允价值的变动将对本基金净值产生的影响。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

本基金所面临的其他价格风险主要系市场价格风险。市场价格风险是指基金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。

本基金部分仓位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。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	6,003,401.00	10.98	3,333,102.68	9.77
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－债券投资	-	-	-	-
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	6,003,401.00	10.98	3,333,102.68	9.77

注：

不受除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动影响的资产（包括债券、资产支持证券等）不填报其他价格风险敞口。

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.使用本基金股票部分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基金净值的变化		
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 （2026 年 6 月 30 日）	上年度末 （2025 年 12 月 31 日 ）
	业绩比较基准+5%	438,763.73	72,642.80
	业绩比较基准-5%	-438,763.73	-72,642.80

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金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，将对基金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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	6,070,574.78	7,024,787.95
第二层次	44,715,839.01	32,131,857.73
第三层次	-	-
合计	50,786,413.79	39,156,645.68

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金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

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	6,003,401.00	10.59
	其中：股票	6,003,401.00	10.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	44,783,012.79	78.99
	其中：债券	44,783,012.79	78.99
	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	3,500,001.75	6.17
	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	1,139,040.67	2.01
8	其他各项资产	1,269,911.58	2.24
9	合计	56,695,367.79	100.00

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	206,796.00	0.38
C	制造业	4,905,569.00	8.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	82,640.00	0.15
H	住宿和餐饮业	5,397.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	773,721.00	1.42
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	24,902.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,376.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	6,003,401.00	10.98

7.2.2 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。

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300308	中际旭创	600	762,000.00	1.39
2	002463	沪电股份	4,400	672,320.00	1.23
3	300750	宁德时代	1,700	668,117.00	1.22
4	603986	兆易创新	800	652,000.00	1.19
5	300502	新易盛	920	558,440.00	1.02
6	600487	亨通光电	2,400	262,416.00	0.48
7	002384	东山精密	700	183,645.00	0.34
8	601939	建设银行	18,400	177,192.00	0.32
9	601988	中国银行	28,200	161,304.00	0.30
10	600183	生益科技	900	156,060.00	0.29
11	300408	三环集团	900	150,210.00	0.27
12	600426	华鲁恒升	6,200	148,304.00	0.27
13	002128	电投能源	6,300	145,656.00	0.27
14	601398	工商银行	19,100	135,037.00	0.25
15	600919	江苏银行	12,500	134,750.00	0.25
16	688257	新锐股份	1,320	134,508.00	0.25
17	601677	明泰铝业	7,900	131,140.00	0.24
18	601328	交通银行	17,000	109,310.00	0.20
19	600690	海尔智家	3,900	79,599.00	0.15
20	301308	江波龙	100	70,380.00	0.13
21	600549	厦门钨业	700	59,640.00	0.11
22	002648	卫星化学	2,300	54,027.00	0.10
23	601899	紫金矿业	2,000	50,280.00	0.09
24	600096	云天化	1,400	42,560.00	0.08
25	601298	青岛港	5,000	40,250.00	0.07
26	600563	法拉电子	200	38,160.00	0.07
27	002028	思源电气	200	34,600.00	0.06
28	601872	招商轮船	1,800	31,626.00	0.06
29	601318	中国平安	600	28,644.00	0.05
30	603259	药明康德	200	24,902.00	0.05
31	601319	中国人保	2,800	18,928.00	0.03
32	600298	安琪酵母	300	10,860.00	0.02

33	600938	中国海油	400	10,860.00	0.02
34	600026	中远海能	600	10,764.00	0.02
35	605117	德业股份	100	10,618.00	0.02
36	600276	恒瑞医药	200	10,408.00	0.02
37	600582	天地科技	2,000	8,900.00	0.02
38	601601	中国太保	300	8,556.00	0.02
39	600566	济川药业	300	6,657.00	0.01
40	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.01
41	601811	新华文轩	400	4,376.00	0.01

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	300750	宁德时代	832,348.00	2.44
2	300308	中际旭创	601,342.00	1.76
3	002463	沪电股份	463,337.00	1.36
4	300502	新易盛	461,901.00	1.35
5	603986	兆易创新	345,273.00	1.01
6	000807	云铝股份	275,352.00	0.81
7	600487	亨通光电	200,546.00	0.59
8	600426	华鲁恒升	196,394.00	0.58
9	601899	紫金矿业	192,109.00	0.56
10	601138	工业富联	186,335.00	0.55
11	002384	东山精密	177,277.00	0.52
12	601988	中国银行	169,150.00	0.50
13	002128	电投能源	150,992.00	0.44
14	601677	明泰铝业	150,223.00	0.44
15	600919	江苏银行	145,135.00	0.43
16	600183	生益科技	142,463.00	0.42
17	300408	三环集团	140,686.00	0.41
18	002648	卫星化学	135,815.00	0.40
19	601600	中国铝业	133,736.00	0.39
20	600096	云天化	124,949.00	0.37

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	603986	兆易创新	241,300.00	0.71
2	000807	云铝股份	238,402.00	0.70
3	300308	中际旭创	238,200.00	0.70

4	601899	紫金矿业	228,091.00	0.67
5	601138	工业富联	207,395.00	0.61
6	300502	新易盛	161,800.00	0.47
7	600887	伊利股份	153,532.00	0.45
8	601298	青岛港	150,207.00	0.44
9	002532	天山铝业	145,283.00	0.43
10	601658	邮储银行	124,426.00	0.36
11	601600	中国铝业	115,037.00	0.34
12	600729	重百集团	103,108.00	0.30
13	600309	万华化学	97,700.00	0.29
14	600511	国药股份	95,167.00	0.28
15	002648	卫星化学	91,922.00	0.27
16	600900	长江电力	91,629.00	0.27
17	600938	中国海油	87,654.00	0.26
18	601288	农业银行	87,389.00	0.26
19	600566	济川药业	86,979.00	0.25
20	600941	中国移动	82,889.00	0.24

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	7,979,475.95
卖出股票收入（成交）总额	6,326,890.68

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	12,930,196.81	23.65
2	央行票据	-	-
3	金融债券	21,589,727.95	39.49
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	10,195,914.25	18.65
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	67,173.78	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	44,783,012.79	81.92

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	54,000	5,435,002.36	9.94
2	019792	25 国债 19	27,170	2,745,507.66	5.02
3	232280012	22 广州银行二级资本债 01	20,000	2,130,969.86	3.90
4	092280069	22 华夏银行二级资本债 01	20,000	2,088,657.53	3.82
5	2128036	21 平安银行二级	20,000	2,062,708.49	3.77

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

本基金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

本基金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

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 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。

7.10.2 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。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 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，广州银行股份有限公司、平安银行股份有限公司、中国邮政储蓄银行股份有限公司、交通银行股份有限公司、中国建设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。

7.11.2 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。

7.11.3 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	7,403.54
2	应收清算款	1,180,799.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,998.40
6	其他应收款	79,710.22
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,269,911.58

7.11.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	110085	通 22 转债	67,173.78	0.12

7.11.5 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。

§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（%）
兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	183	196,998.13	18,046,435.56	50.06	18,004,222.00	49.94
兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有	79	159,287.55	12,463,707.76	99.05	120,008.92	0.95

期债券 C						
合计	262	185,627.38	30,510,143.32	62.73	18,124,230.92	37.27

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	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	171,314.17	0.4752
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C	11,231.02	0.0893
	合计	182,545.19	0.3753

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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	0~10
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	0~10
	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 A	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 7 日）基金份额总额	78,405,124.70	-
本报告期期初基金份额总额	30,796,887.59	53,789.28
本报告期基金总申购份额	9,525,548.64	12,557,849.10
减：本报告期基金总赎回份额	4,271,778.67	27,921.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,050,657.56	12,583,716.68

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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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，本基金管理人的重大人事变动如下：

2026 年 2 月 27 日起，刘宇先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，宋琳女士不再担任本公司公募基金管理业务合规负责人。2026 年 3 月 3 日起，翁建国先生担任本公司合规总监、首席风险官，宋琳女士不再担任本公司合规总监、首席风险官。

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。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金管理人、基金财产的诉讼事项。

报告期内无涉及本基金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，本基金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

本报告期内本基金管理人未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人未受到监管部门调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人的高级管理人员、本基金的基金经理等相关从业人员未受到监管部门调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	14,290,963.69	100.00	10,886.37	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；具备本基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本基金进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本基金提供研究服务支持；佣金费率合理；本基金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：本基金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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

10.7.2 基金租用或者通过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	80,865,271.03	100.00	104,953,000.00	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；具备本基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足本基金进行证券交易的需要；具备较强的综合研究能力，能及时、全面地为本基金提供研究服务支持；佣金费率合理；本基金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：本基金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。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内无租用证券公司交易单元的变更情况。

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	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026 年 1 月 22 日
2	兴证证券资产管理有限公司关于旗下部分基金在北京汇成基金销售有限公司开展申购费率优惠活动的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 2 月 2 日
3	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 2 月 28 日
4	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 3 月 5 日
5	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026 年 3 月 31 日
6	兴证证券资产管理公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	规定网站、规定报刊	2026 年 3 月 31 日
7	兴证证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026 年 4 月 11 日
8	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026 年 4 月 22 日
9	兴证证券资产管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	规定网站、规定报刊	2026 年 4 月 30 日
10	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 6 月 16 日
11	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2026 年 6 月 16 日
12	兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金招募说明书更	规定网站	2026 年 6 月 16 日

	新（2026 年第 1 号）		

§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	1	20260421-20260422	0.00	9,657,784.01	-	9,657,784.01	19.8579
个人	-	-	-	-	-	-	-

产品特有风险

1、本基金单一机构投资者所持有的份额占比较大，单一机构投资者的大额赎回，可能会对本基金的资产运作及净值表现产生较大影响；

2、大额赎回有可能导致管理人被迫抛售证券以应付赎回的现金需要，则可能使基金资产净值受到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；

3、因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，大额赎回导致基金净值出现较大波动；

4、单一投资者的大额赎回时容易造成本基金发生巨额赎回。在发生巨额赎回情形时，在符合基金合同约定情况下，如管理人认为有必要，可延期办理本基金的赎回申请，投资者可能面临赎回申请被延期办理的风险；如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；

5、若本基金连续 60 个工作日基金份额持有人低于 200 人或基金资产净值低于 5000 万情形的，管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决，其他投资者可能面临终止基金合同等风险；

6、大额赎回导致本基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；

7、大额赎回导致基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，2026 年 2 月 27 日起，刘宇先生代为履行本公司公募基金管理业务合规负责人职务，宋琳女士不再担任本公司公募基金管理业务合规负责人。2026 年 3 月 3 日起，翁建国先生担任本公司合规总监、首席风险官，宋琳女士不再担任本公司合规总监、首席风险官。

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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予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变更注册的批复文件；

2、《兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金基金合同》；

3、《兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期债券型证券投资基金托管协议》；

4、《兴证资管金麒麟兴享增利六个月持有期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。

12.2 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）。

12.3 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 8 月 31 日