

# 金鹰主题优势混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

### 2024 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## § 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	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合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	9
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.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	38
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.....	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	43
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.....	43
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.....	44
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.....	44
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.....	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	44

7.12 投资组合报告附注.....	44
<b>§8 基金份额持有人信息.....</b>	<b>45</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	45
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	45
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	46
8.4 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的情况.....	46
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	46
<b>§9 开放式基金份额变动.....</b>	<b>46</b>
<b>§10 重大事件揭示.....</b>	<b>46</b>
10.1 基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	47
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
10.4 基金投资策略的改变.....	47
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	47
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	47
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
10.9 其他重大事件.....	52
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息.....</b>	<b>53</b>
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	53
<b>§12 备查文件目录.....</b>	<b>53</b>
12.1 备查文件目录.....	53
12.2 存放地点.....	53
12.3 查阅方式.....	53

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰主题优势混合型证券投资基金
基金简称	金鹰主题优势混合
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 20 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	122,283,091.70 份
基金合同存续期	不定期

### 2.2 基金产品说明

投资目标	以追求资本可持续增值为目的，以深入的基本面分析为基础，把握主题投资的脉络，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。
投资策略	本基金坚持“自上而下”为主、“自下而上”为辅的投资视角，在实际投资过程中充分体现“主题优势”这个核心理念，以主题情景分析法把握经济发展不同阶段的主题投资节奏，优选并深挖不同阶段热点主题投资机会，优化资产配置，降低市场波动的冲击，扩大投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。
风险收益特征	本基金为主动操作的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中的高收益、高风险品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金和债券型基金。

### 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		金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	郭明
	联系电话	020-83936180	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95588
传真		020-83282856	010-66105798

注册地址	广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510623	100140
法定代表人	姚文强	陈四清

## 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## §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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-6,212,303.92
本期利润	-26,973,438.50
加权平均基金份额本期利润	-0.2156
本期加权平均净值利润率	-12.37%
本期基金份额净值增长率	-11.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)
期末可供分配利润	78,082,812.14
期末可供分配基金份额利润	0.6385
期末基金资产净值	200,365,903.84
期末基金份额净值	1.639
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)
基金份额累计净值增长率	63.90%

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；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，指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（为期末余额，不是当期发生数）；

4、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，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

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
过去一个月	-7.09%	0.72%	-2.24%	0.36%	-4.85%	0.36%
过去三个月	-8.69%	0.95%	-1.11%	0.56%	-7.58%	0.39%
过去六个月	-11.55%	1.28%	1.83%	0.67%	-13.38%	0.61%
过去一年	-18.58%	1.10%	-5.87%	0.65%	-12.71%	0.45%
过去三年	-29.08%	1.47%	-22.98%	0.78%	-6.10%	0.69%
自基金合同生效起至今	63.90%	1.65%	27.93%	1.02%	35.97%	0.63%

注：本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

#### 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

金鹰主题优势混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 12 月 20 日至 2024 年 6 月 30 日）



- 注：1、本基金合同于 2010 年 12 月 20 日生效；
- 2、本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定；
- 3、本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×75%+中证全债指数收益率×25%。

## §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

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。

“以人为本、互信协作；创新谋变、挑战超越”是金鹰人的核心价值观。公司坚持价值投资为导向，着力打造高水准的投研团队，努力为投资者创造丰厚回报。金鹰基金拥有一支经验丰富，风格多元的投资团队。

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 68 只。

#### 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		
杨刚	本基金的基金经理，公司首席经济学家	2022-04-26	-	28	杨刚先生，1996年7月至2001年4月就职于大鹏证券综合研究所，先后负责行业研究、宏观策略研究和协助研究所管理工作，历任高级研究员和部门主管；2001年5月至2009年3月就职于平安证券综合研究所，负责行业研究、宏观策略研究及研究管理，历任高级研究员、部门主管和副所长等职务；2009年4月至2010年4月就职于平安证券资产管理部，担任执行总经理。杨刚先生于2010年5月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究发展部研究总监，现任权益研究部基金经理。
李龙杰	本基金的基金经理助理	2023-03-29	-	7	李龙杰先生，西南财经大学经济学硕士。2017年6月加入金鹰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理，现任权益研究部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、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。

#### 4.2 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，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无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

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资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。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统中的公平交易功能执行交易，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现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。

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

今年上半年，A 股市场整体演绎了一波较经典的“V”型反转及其后的快速退潮过程。

从国内经济层面看：年初以来，虽在结构上继续有些亮点，但总体上并未有显著超出市场预期。在半年度完成 5% 的 GDP 增速背后，相对表现较佳的出口数据与疫后第 2 年复苏仍相对偏慢的内需数据相对冲，尤其房地产在 5 月迎来政策加码带来的脉冲式修复后，并未能显著扭转行业不利态势，对上半年国内经济的持续复苏构成较大拖累。整体而言，内需市场仍相对疲弱，企业和居民信心的持续提振，有赖于国内政策端有效用、有力度的针对性举措的进一步加持。

从海外层面看：一方面，上半年美联储降息预期出现反复，折返跑不断，但总体而言年内降息概率已越来越大，至年中时，有望在 9 月首度降息的概率达 90%。但另一方面，俄乌战事、以哈冲突等重大地缘政治风险此起彼伏，海外重要大选临近，不确定性也有所上升。

从全球各类资产表现看：上半年主要市场大多表现较好，日经 225、纳斯达克指数及标普 500 的涨幅分别达到 18.29%、18.13% 及 14.48%。另外，COMEX 黄金涨 12.80%，ICE 布油涨 10.12%。

而从 A 股上半年的整体表现看：首先是年初股指的较大回撤及其后的强势上涨。导致市场当时出现较大波动的关键因素，主要来自于流动性暨资金面的较大变化及预期跳转。1 月中下旬，以雪球为代表的杠杆资金快速调整的过程中，持续的负向反馈带来市场风险的急剧上升。这其中，对流动性边际变化反应更为敏感的成长方向和中小盘品种，股价的波动更加剧烈。其后，在管理层果断出手积极维稳之下，投资者紧张情绪迅速缓解，流动性枯竭状况极大改善，A 股市场迎来一轮较为

快速的超跌反弹。其次，进入二季度之后，因国内经济层面重新面临的回缩压力、海外地缘政治风险的再度上升及股指短期积累一定涨幅后的浮盈兑现等多重因素共振，A 股又一次呈现出较快的回落。

上证指数、沪深 300 及创业板指上半年涨幅分别为-0.25%、0.89%和-10.99%。申万一级行业方面：银行、煤炭、公用、家电及石化雄踞上半年 A 股行业涨幅榜前五，半年度涨幅分别达到 17.02%、11.96%、11.76%、8.48%和 7.90%；涨跌幅榜排名垫底的则为综合、计算机、商贸、社服和传媒，半年度跌幅分别为 33.34%、24.88%、24.59%、24.05%和 21.33%。整体看，上半年 A 股“红利策略”继续大行其道，涨幅榜靠前的行业清一色为典型的红利类方向（其中，煤炭行业更是已连续 3 年多大幅跑赢市场主要基准，A 股史上罕见）。与此同时，涨跌幅榜排名垫底的则大多是与经济复苏方向有较强相关的行业。从市场交易层面的观察看，A 股上半年涨跌结构的极致演绎，或与宏观总量逻辑上的持续缺失及存（减）量博弈格局下偏绝对收益型特征的机构资金成为市场的重要增量有密切关联。

上半年，本产品坚持以“自上而下”的宏观视角及经济已步入疫后渐进修复期的基本逻辑框架来寻找可能的投资机会。策略层面，则继续以总体积极和兼顾均衡（即平衡消费与成长）的“哑铃型”操作作为产品的主要应对。同时，基于对自身能力圈和投资风格的客观评估，对 A 股市场中短期如电风扇般快速轮动的主题热点实际较少参与。在这样的策略选择下，本产品净值表现仍阶段性落后于产品基准。

报告期内，我们在产品组合上实际也继续做了一定程度的微调（尤其在二季度）：其一，在新一轮的猪周期已较大概率进入行业底部拐点右侧的判断下，适当增加了对生猪养殖链条相关优质龙头的配置头寸。其二，在军工行业较大范围的人事安排基本落定、预计在“十四五”仅剩的一年半时间内订单有望出现较快恢复的行业底部稍偏左侧位置，继续增配跟“国防安全”相关的 A 股优质品种。中短期，上述仓位结构的适度调整对组合贡献尚有限，但我们预期后续有望对产品净值带来可能的向上弹性和一定的灵活性。

对于本产品持续有重点布局的偏复苏方向的泛消费品种，报告期内我们仍保留了较多头寸。客观而言，地产依旧不振、财政发力滞后背景下，国内经济呈波折式修复，企业、居民信心仍较低迷，消费方向迄今尚难看到实质性的较大回暖。映射到股市层面，食品饮料上半年整体表现偏弱，尤其在 2 季度出现较大回撤，偏高端和可选的白酒板块更一度遭遇较大的股价冲击。但换个视角看，在海外普遍面临大选带来的新的较大不确定性，地缘风险继续上升的不利外部环境下，国内的总量政策方面，成功向内求或曰攘外必先安内，较大概率仍是应对外部较大冲击的可能选择，地产政策持续优化、财政政策抓紧发力、货币政策适度配合等，最终有望构筑令中国经济真正完成破局重生的

必由之路。而估值已处于历史极低分位水平、预期未来仍有望保持一定增长（尤其在可能的针对性政策扶持下）的消费板块，已然具备一定胜率和较高赔率。一旦权益市场已演绎较为极致充分的结构分化态势出现反转，整个泛消费板块的估值修复过程或仍可期待。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.639 元，本报告期基金净值增长率为-11.55%，同期业绩比较基准增长率为 1.83%。

#### 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，我们认为，结合国内已召开的重要会议所释放的重磅政策讯息、国内经济下半年预期走向、股市当前估值所处的相对位置、海外重要大选及美联储降息进程等多角度的综合评估，A 股市场或仍有较大概率进入新的布局期，权益投资可更积极。

二十届三中全会释放出全面深化改革、持续推动开放创新的明确方略，中国式现代化、高水平社会主义市场经济体制、高质量发展、新质生产力等热词，定调了偏中长期维度的国内宏观大政。与此同时，政治局会议在中短期层面有更积极表述和重磅政策定调，包括对当前面临压力的客观评价、对提振消费的再度强调，以及重提资本市场等的重要论断，都令市场前期过于悲观的风险偏好有所回暖。

当前，国内市场对政策后续的具体措施和可能效果尚处于密切观察跟踪的阶段。综合考虑海外重要大选可能带来的较大不确定性对出口方面造成的潜在压力，以及美联储大概率即将进入降息窗口后对国内宏观政策掣肘的缓释等，如前述国内政策层面的积极表述能较快地在经济基本上得到持续反映和有效验证，经济动能环比或有望重新改善，A 股市场风险偏好有进一步提振的潜力。

行业配置上，我们将继续以均衡布局稳妥应对可能的市场轮动。

1) 科技制造：预计下半年仍有高低切换的反复轮动机会，重点关注军工（从订单逐步增加到业绩预期开始修复）。

2) 资源品：关注“特朗普交易”和美联储降息的影响，继续关注黄金等方向。

3) 消费：关注受益于较强的政策利好预期且前期回撤显著的一些被错杀的行业优质标的，继续重点配置已进入周期右侧的生猪养殖板块及前期因行业政策因素严重受压的医药板块。

4) 红利方向：对于上半年已有较好表现的高股息资产，等待跌出来的空间，缩圈关注具有业绩稳定性的核心品种。

总体而言，本基金经理将继续保持较为积极的心态和谨慎应对的操作，密切关注并及时跟踪重要政策、宏观经济适时变化、上市公司财报披露信息等，不断审视和优化投资组合，力图尽可能多

地通过与优质企业共同成长而非存量博弈的方式来获取相对稳定的投资业绩，努力回报投资者的持续信任和不吝支持。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场债券品种的估值数据及交易所交易的债券品种的估值数据、流通受限股票流动性折扣。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 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

本报告期内无应当说明的预警事项。

### §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

本报告期内，本基金托管人在对金鹰主题优势混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行

为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

## 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

本报告期内，金鹰主题优势混合型证券投资基金的管理人——金鹰基金管理有限公司在金鹰主题优势混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，金鹰主题优势混合型证券投资基金未进行利润分配。

## 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

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰主题优势混合型证券投资基金 2024 年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：金鹰主题优势混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	10,644,902.65	12,584,395.62
结算备付金		163,111.78	42,339.12
存出保证金		14,524.05	20,325.64
交易性金融资产	6.4.7.2	189,722,473.22	225,588,280.24
其中：股票投资		189,519,062.67	225,387,118.46
基金投资		-	-
债券投资		203,410.55	201,161.78
资产支持证券投资		-	-
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	-	-
应收清算款		473,729.88	497,511.88
应收股利		-	-
应收申购款		33,250.55	29,263.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		201,051,992.13	238,762,116.09
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年6月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		-	-
应付清算款		84,891.25	136,565.57
应付赎回款		95,714.51	153,547.00
应付管理人报酬		206,743.15	242,893.35
应付托管费		34,457.15	40,482.22
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	264,282.23	304,867.18
负债合计		686,088.29	878,355.32
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	122,283,091.70	128,402,954.88
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	78,082,812.14	109,480,805.89
净资产合计		200,365,903.84	237,883,760.77
负债和净资产总计		201,051,992.13	238,762,116.09

注：截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 1.639 元，基金份额总额为 122,283,091.70 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至	上年度可比期间 2023年1月1日至
----	-----	------------------	-----------------------

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-25,376,202.27	-25,517,581.45
1.利息收入		22,211.13	30,620.78
其中：存款利息收入	6.4.7.9	22,211.13	30,345.69
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		-	275.09
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,652,311.85	-8,534,341.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-6,687,569.91	-11,001,219.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1,958.77	9,655.45
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,033,299.29	2,457,222.15
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-20,761,134.58	-17,028,575.06
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	15,033.03	14,714.59
<b>减：二、营业总支出</b>		1,597,236.23	2,688,653.74
1. 管理人报酬		1,299,567.00	2,239,565.97
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		216,594.45	373,261.01
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	81,074.78	75,826.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-26,973,438.50</b>	<b>-28,206,235.19</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-26,973,438.50</b>	<b>-28,206,235.19</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-26,973,438.50</b>	<b>-28,206,235.19</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日



单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	128,402,954.88	-	109,480,805.89	237,883,760.77
二、本期期初净资产	128,402,954.88	-	109,480,805.89	237,883,760.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-6,119,863.18	-	-31,397,993.75	-37,517,856.93
（一）、综合收益总额	-	-	-26,973,438.50	-26,973,438.50
（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）	-6,119,863.18	-	-4,424,555.25	-10,544,418.43
其中：1.基金申购款	8,342,185.45	-	6,662,968.21	15,005,153.66
2.基金赎回款	-14,462,048.63	-	-11,087,523.46	-25,549,572.09
（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、本期期末净资产	122,283,091.70	-	78,082,812.14	200,365,903.84
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	137,684,657.55	-	168,307,320.23	305,991,977.78
二、本期期初净资产	137,684,657.55	-	168,307,320.23	305,991,977.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,429.83	-	-28,866,162.44	-28,859,732.61
（一）、综合收益总额	-	-	-28,206,235.19	-28,206,235.19

(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)	6,429.83	-	-659,927.25	-653,497.42
其中: 1.基金申购款	10,253,975.16	-	11,921,837.97	22,175,813.13
2.基金赎回款	-10,247,545.33	-	-12,581,765.22	-22,829,310.55
(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、本期期末净资产	137,691,087.38	-	139,441,157.79	277,132,245.17

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：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰主题优势混合型证券投资基金（原名：金鹰主题优势股票型证券投资基金）（以下简称“本基金”）经中国证监会证监许可【2010】1480 号文核准《关于核准金鹰主题优势股票型证券投资基金募集的批复》批准募集，于 2010 年 12 月 20 日正式成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，设立募集规模为 2,051,271,200.80 份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰主题优势混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票（含存托凭证）、债券、权证，以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产占基金总资产的比例为 60%~95%，其中，不低于 80%的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司，债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金总资产的 5%~40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### **6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明**

本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本报告期末的财务状况、本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### **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**

本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### **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**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《关于继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》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 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《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局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》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)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b)自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得

税的应纳税所得额：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% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

(e) 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。

(f) 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。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后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费附加。

## 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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	10,644,902.65
等于：本金	10,643,939.17
加：应计利息	963.48
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	10,644,902.65

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	264,612,131.43	-	189,519,062.67	-75,093,068.76
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,110.55	203,410.55	595.00
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,110.55	203,410.55	595.00
		199,705.00		
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	264,811,836.43	3,110.55	189,722,473.22	-75,092,473.76

#### 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

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 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

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	41.03
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	84,678.08
其中：交易所市场	84,678.08
银行间市场	-

应付利息	-
预提信息披露费	159,672.34
预提审计费用	19,890.78
合计	264,282.23

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	128,402,954.88	128,402,954.88
本期申购	8,342,185.45	8,342,185.45
本期赎回（以“-”号填列）	-14,462,048.63	-14,462,048.63
本期末	122,283,091.70	122,283,091.70

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	213,634,284.04	-104,153,478.15	109,480,805.89
本期期初	213,634,284.04	-104,153,478.15	109,480,805.89
本期利润	-6,212,303.92	-20,761,134.58	-26,973,438.50
本期基金份额交易产生的变动数	-10,046,987.86	5,622,432.61	-4,424,555.25
其中：基金申购款	13,566,627.81	-6,903,659.60	6,662,968.21
基金赎回款	-23,613,615.67	12,526,092.21	-11,087,523.46
本期已分配利润	0.00	-	0.00
本期末	197,374,992.26	-119,292,180.12	78,082,812.14

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	647.37
其他	111.80
合计	22,211.13

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

卖出股票成交总额	90,898,607.17
减：卖出股票成本总额	97,378,885.42
减：交易费用	207,291.66
买卖股票差价收入	-6,687,569.91

#### 6.4.7.11 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	1,958.77
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1,958.77

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

##### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

##### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,033,299.29
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	2,033,299.29

##### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----



	2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-20,761,134.58
——股票投资	-20,761,424.58
——债券投资	290.00
——资产支持证券投资	-
——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	-20,761,134.58

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	14,278.72
转换费收入	754.31
合计	15,033.03

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	19,890.78
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,511.66
合计	81,074.78

### 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，本基金无需披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

### 6.4.9 关联方关系

#### 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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 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
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

- 1、本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。
- 2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。
- 3、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等。

##### 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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,299,567.00	2,239,565.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	488,684.34	866,106.13
应支付基金管理人的净管理费	810,882.66	1,373,459.84

注：1、本基金本期基金管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值  $\times$ 1.20%/ 当年天数

2、本基金上年度可比期间基金管理费按前一日基金资产净值 1.50%的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日基金管理费=前一日基金资产净值  $\times$ 1.50%/ 当年天数

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	216,594.45	373,261.01

注：1、本基金本期基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值  $\times$ 0.20%/ 当年天数

2、本基金上年度可比期间托管费按前一日基金资产净值 0.25%的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

日基金托管费=前一日基金资产净值  $\times$ 0.25%/ 当年天数

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

#### 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无与关联方进行银行间同业市场的债券（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

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

##### 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

本基金本报告期及上年度可比期间无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。

#### 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 2024年1月1日至2024年6月30	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月30

	日	日
报告期初持有的基金份额	729,261.41	729,261.41
报告期内申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期内因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期内赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	729,261.41	729,261.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.60%	0.53%

#### 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

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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
广州金鹰资产管理有限公司	1,896,870.92	1.55%	1,896,870.92	1.48%

#### 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		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023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
中国工商银行股份有限公司	10,644,902.65	21,451.96	16,666,324.82	29,134.90

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；本基金本报告期末清算备付金余额为 163,111.78 元，清算备付金利息收入为 647.37 元；上年度可比期间清算备付金期末余额为 288,047.07 元，清算备付金利息收入为 1,011.94 元。

#### 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无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

## 6.4.12 期末（2024 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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301580	C 爱迪特	2024-06-19	6 个月	网下配售锁定	44.95	65.93	129.00	5,798.55	8,504.97	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6 个月	网下配售锁定	19.86	42.51	211.00	4,190.46	8,969.61	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6 个月	网下配售锁定	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	网下配售锁定	28.01	37.83	138.00	3,865.38	5,220.54	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	网下配售锁定	17.43	34.56	193.00	3,363.99	6,670.08	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6 个月	网下配售锁定	16.16	32.27	394.00	6,367.04	12,714.38	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	网下配售锁定	22.43	31.55	186.00	4,171.98	5,868.30	-
603381	C 永臻	2024-06-19	6 个月	网下配售锁定	23.35	25.13	90.00	2,101.50	2,261.70	-
603344	星德胜	2024-03-13	6 个月	网下配售锁定	19.18	22.66	127.00	2,435.86	2,877.82	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	网下配售锁定	11.88	18.98	458.00	5,441.04	8,692.84	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	网下配售锁定	15.69	18.79	394.00	6,181.86	7,403.26	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1 个月内	网下新股	18.65	18.65	1,029.00	19,190.85	19,190.85	-

			(含)	中签						
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	网下配售锁定	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	网下配售锁定	16.20	15.96	317.00	5,135.40	5,059.32	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	网下配售锁定	16.98	13.48	172.00	2,920.56	2,318.56	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

#### 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，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，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，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，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

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

###### 1、风险管理控制制度

风险控制制度由总则、风险控制的目标和原则、风险控制的机构设置、风险控制的程序、风险类型的界定、风险控制的主要措施、风险控制的具体制度、风险控制制度的监督与评价等部分组成。

风险控制的具体制度主要包括投资风险管理制度、交易风险控制制度、财务风险控制制度、公司资产管理制度等业务风险控制制度，以及岗位分离制度、业务空间隔离制度、作业规则、岗位职责、反馈制度、资料保全制度、保密制度、员工行为守则等程序性风险管理制度。

## 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

制订研究业务管理制度的目的是保持研究工作的独立、客观。研究业务管理制度包括：建立严密的研究工作业务流程，形成科学、有效的研究方法；根据基金合同要求，在充分研究的基础上建立和维护投资对象备选库；建立研究与投资的业务交流制度，保持通畅的交流渠道；建立研究报告质量评价体系。

制订投资决策业务管理制度的目的是严格遵守法律法规的有关规定，确保基金的投资符合基金合同所规定的投资目标、投资范围、投资策略、投资组合和投资限制等要求。投资决策业务管理制度包括投资决策授权制度；投资决策支持制度，重要投资要有详细的研究报告和风险分析支持；投资风险评估与管理制度，在设定的风险权限额度内进行投资决策；投资管理业绩评价制度等。

制订基金交易管理制度的目的是保证基金投资交易的安全、有效、公平。基金交易管理制度包括基金交易的集中交易制度；交易监测、预警、反馈机制；投资指令审核制度；投资指令公平分配制度；交易记录保管制度；交易绩效评价制度等。

## 3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门业务流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以

控制相应的信用风险。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
--------	-------------------	---------------------



AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	0.00
AAA 以下	-	0.00
未评级	-	0.00
合计	-	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金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、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

##### 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。本基金持有的大

部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	10,644,902.65	-	-	-	10,644,902.65
结算备付金	163,111.78	-	-	-	163,111.78
存出保证金	14,524.05	-	-	-	14,524.05
交易性金融资产	203,410.55	-	-	189,519,062.67	189,722,473.22
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	473,729.88	473,729.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	33,250.55	33,250.55
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	11,025,949.03	-	-	190,026,043.10	201,051,992.13
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	84,891.25	84,891.25
应付赎回款	-	-	-	95,714.51	95,714.51
应付管理人报酬	-	-	-	206,743.15	206,743.15
应付托管费	-	-	-	34,457.15	34,457.15
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	264,282.23	264,282.23
负债总计	-	-	-	686,088.29	686,088.29
利率敏感度缺口	11,025,949.03	-	-	189,339,954.81	200,365,903.84

上年度末 2023 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	12,584,395.62	-	-	-	12,584,395.62
结算备付金	42,339.12	-	-	-	42,339.12
存出保证金	20,325.64	-	-	-	20,325.64
交易性金融资产	201,161.78	-	-	225,387,118.46	225,588,280.24
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	497,511.88	497,511.88
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	29,263.59	29,263.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	12,848,222.16	-	-	225,913,893.93	238,762,116.09
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	136,565.57	136,565.57
应付赎回款	-	-	-	153,547.00	153,547.00
应付管理人报酬	-	-	-	242,893.35	242,893.35
应付托管费	-	-	-	40,482.22	40,482.22
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	304,867.18	304,867.18
负债总计	-	-	-	878,355.32	878,355.32
利率敏感度缺口	12,848,222.16	-	-	225,035,538.61	237,883,760.77

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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	上年度末

		2024 年 6 月 30 日	2023 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-101.25	-341.11
	利率下降 25 个基点	101.53	343.51

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他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。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	189,519,062.67	94.59	225,387,118.46	94.75
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	189,519,062.67	94.59	225,387,118.46	94.75

注：其他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，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金融资产。

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日

	业绩比较基准变动+5%	16,650,187.62	14,607,782.92
	业绩比较基准变动-5%	-16,650,187.62	-14,607,782.92

#### 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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	189,408,648.50	224,964,440.83
第二层次	222,601.40	201,161.78
第三层次	91,223.32	422,677.63
合计	189,722,473.22	225,588,280.24

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无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

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## §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	189,519,062.67	94.26
	其中：股票	189,519,062.67	94.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	203,410.55	0.10
	其中：债券	203,410.55	0.10
	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	-	-
	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	10,808,014.43	5.38
8	其他各项资产	521,504.48	0.26
9	合计	201,051,992.13	100.00

注：其他各项资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

## 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

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	17,074,806.00	8.52
B	采矿业	5,062,132.00	2.53
C	制造业	106,255,335.44	53.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,749,396.00	1.37

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	398,196.00	0.20
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,235,680.71	10.10
J	金融业	17,569,181.20	8.77
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,955,457.00	2.47
M	科学研究和技术服务业	1,907,524.00	0.95
N	水利、环境和公共设施管理业	5,059.32	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,522,052.00	1.26
R	文化、体育和娱乐业	10,784,243.00	5.38
S	综合	-	-
	合计	189,519,062.67	94.59

### 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通过港股通投资的股票。

### 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	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	10,200	14,967,378.00	7.47
2	002714	牧原股份	301,800	13,158,480.00	6.57
3	601633	长城汽车	493,900	12,495,670.00	6.24
4	300738	奥飞数据	851,800	8,620,216.00	4.30
5	688066	航天宏图	429,800	7,650,440.00	3.82
6	600132	重庆啤酒	117,800	7,150,460.00	3.57
7	600276	恒瑞医药	185,800	7,145,868.00	3.57
8	002353	杰瑞股份	173,800	6,096,904.00	3.04
9	300750	宁德时代	32,830	5,910,384.90	2.95
10	000768	中航西飞	232,800	5,594,184.00	2.79
11	601658	邮储银行	1,023,800	5,190,666.00	2.59
12	600988	赤峰黄金	309,800	5,062,132.00	2.53

13	601888	中国中免	79,300	4,955,457.00	2.47
14	300059	东方财富	452,820	4,781,779.20	2.39
15	002739	万达电影	382,600	4,625,634.00	2.31
16	600809	山西汾酒	19,800	4,175,424.00	2.08
17	002756	永兴材料	116,090	4,153,700.20	2.07
18	300251	光线传媒	457,500	3,847,575.00	1.92
19	002179	中航光电	95,900	3,648,995.00	1.82
20	688180	君实生物	122,000	3,544,100.00	1.77
21	600760	中航沈飞	87,940	3,526,394.00	1.76
22	601318	中国平安	75,800	3,135,088.00	1.56
23	300124	汇川技术	60,100	3,083,130.00	1.54
24	603477	巨星农牧	106,900	3,068,030.00	1.53
25	600011	华能国际	285,800	2,749,396.00	1.37
26	600570	恒生电子	155,680	2,749,308.80	1.37
27	000516	国际医学	538,900	2,522,052.00	1.26
28	688281	华秦科技	29,200	2,432,944.00	1.21
29	000001	平安银行	233,800	2,373,070.00	1.18
30	300144	宋城演艺	287,800	2,311,034.00	1.15
31	300760	迈瑞医疗	7,800	2,269,098.00	1.13
32	300775	三角防务	73,800	2,258,280.00	1.13
33	603712	七一二	103,800	1,888,122.00	0.94
34	002460	赣锋锂业	56,000	1,604,400.00	0.80
35	301096	百诚医药	26,800	1,556,544.00	0.78
36	688375	国博电子	18,800	1,328,032.00	0.66
37	601456	国联证券	129,800	1,251,272.00	0.62
38	300715	凯伦股份	151,800	1,092,960.00	0.55
39	002572	索菲亚	70,600	1,082,298.00	0.54
40	301517	陕西华达	19,900	1,074,600.00	0.54
41	301269	华大九天	12,800	986,240.00	0.49
42	688239	航宇科技	27,900	970,920.00	0.48
43	300498	温氏股份	42,800	848,296.00	0.42
44	601881	中国银河	77,100	837,306.00	0.42
45	605123	派克新材	14,900	837,082.00	0.42
46	000425	徐工机械	105,800	756,470.00	0.38
47	002465	海格通信	72,600	752,136.00	0.38
48	300115	长盈精密	61,800	740,982.00	0.37
49	300699	光威复材	28,800	715,104.00	0.36
50	603517	绝味食品	45,800	705,320.00	0.35
51	603986	兆易创新	5,800	554,596.00	0.28
52	002738	中矿资源	18,688	500,838.40	0.25
53	002371	北方华创	1,500	479,835.00	0.24
54	688525	佰维存储	6,800	436,220.00	0.22
55	600961	株冶集团	45,800	432,352.00	0.22
56	601333	广深铁路	122,900	398,196.00	0.20



57	603057	紫燕食品	25,800	395,256.00	0.20
58	300415	伊之密	17,800	369,884.00	0.18
59	600418	江淮汽车	23,100	365,904.00	0.18
60	688334	西高院	21,800	350,980.00	0.18
61	301308	江波龙	2,800	265,272.00	0.13
62	002279	久其软件	49,800	214,638.00	0.11
63	002475	立讯精密	3,800	149,378.00	0.07
64	688516	奥特维	2,800	117,068.00	0.06
65	688050	爱博医疗	1,000	73,320.00	0.04
66	603285	键邦股份	1,029	19,190.85	0.01
67	688578	艾力斯	200	12,748.00	0.01
68	301536	星宸科技	394	12,714.38	0.01
69	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
70	688691	灿芯股份	211	8,969.61	0.00
71	301565	中仑新材	458	8,692.84	0.00
72	301580	C 爱迪特	129	8,504.97	0.00
73	688709	成都华微	394	7,403.26	0.00
74	001389	广合科技	193	6,670.08	0.00
75	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
76	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
77	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
78	601033	永兴股份	317	5,059.32	0.00
79	688599	天合光能	200	3,384.00	0.00
80	688389	普门科技	200	3,252.00	0.00
81	603344	星德胜	127	2,877.82	0.00
82	001379	腾达科技	172	2,318.56	0.00
83	603381	C 永臻	90	2,261.70	0.00
84	601012	隆基绿能	100	1,402.00	0.00
85	300681	英搏尔	100	1,304.00	0.00
86	688472	阿特斯	100	1,018.00	0.00
87	600572	康恩贝	100	447.00	0.00

#### 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	600011	华能国际	5,785,230.00	2.43
2	300715	凯伦股份	4,665,699.20	1.96
3	300750	宁德时代	4,388,837.20	1.84

4	688066	航天宏图	4,230,080.83	1.78
5	601318	中国平安	3,782,145.00	1.59
6	002739	万达电影	3,727,795.16	1.57
7	688281	华秦科技	2,768,232.31	1.16
8	301517	陕西华达	2,461,246.20	1.03
9	002714	牧原股份	2,284,902.00	0.96
10	000768	中航西飞	2,262,004.00	0.95
11	600809	山西汾酒	2,170,364.00	0.91
12	300760	迈瑞医疗	2,033,278.00	0.85
13	603477	巨星农牧	1,976,622.00	0.83
14	600754	锦江酒店	1,744,902.00	0.73
15	603712	七一二	1,607,009.00	0.68
16	300251	光线传媒	1,463,837.00	0.62
17	002572	索菲亚	1,357,372.00	0.57
18	000425	徐工机械	1,338,622.00	0.56
19	600961	株冶集团	1,269,093.00	0.53
20	000001	平安银行	1,255,621.00	0.53

注：买入金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 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	601456	国联证券	8,726,820.00	3.67
2	002376	新北洋	7,159,646.00	3.01
3	600030	中信证券	3,437,923.00	1.45
4	600011	华能国际	3,296,406.00	1.39
5	600519	贵州茅台	3,281,906.00	1.38
6	300738	奥飞数据	3,264,042.00	1.37
7	300715	凯伦股份	3,087,365.00	1.30
8	000001	平安银行	3,062,135.00	1.29
9	600809	山西汾酒	2,790,769.00	1.17
10	600988	赤峰黄金	2,580,136.00	1.08
11	300251	光线传媒	2,563,266.00	1.08
12	000090	天健集团	2,420,292.00	1.02
13	002353	杰瑞股份	2,130,026.00	0.90
14	601658	邮储银行	2,120,970.00	0.89
15	600754	锦江酒店	1,836,944.00	0.77
16	603811	诚意药业	1,777,343.80	0.75
17	603002	宏昌电子	1,456,398.00	0.61
18	301517	陕西华达	1,449,556.68	0.61
19	600150	中国船舶	1,390,741.00	0.58

20	301096	百诚医药	1,340,985.40	0.56
----	--------	------	--------------	------

注：卖出金额按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	82,272,254.21
卖出股票收入（成交）总额	90,898,607.17

注：“买入股票成本”或“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	203,410.55	0.10
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	203,410.55	0.10

#### 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	019727	23 国债 24	1,000.00	101,849.04	0.05

2	019709	23 国债 16	1,000.00	101,561.51	0.05
---	--------	----------	----------	------------	------

注：本基金本报告期末仅持有 2 只债券。

#### 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 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未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。

**7.12.2** 本基金报告期内基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

#### 7.12.3 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	14,524.05
2	应收清算款	473,729.88
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	33,250.55
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	521,504.48

#### 7.12.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 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的情况。

#### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §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

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
29,410	4,157.87	19,058,308.98	15.59%	103,224,782.72	84.41%

#### 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

**8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况**

项目	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	91,844.84	0.08%

**8.4 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的情况**

项目	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

**8.5 发起式基金发起资金持有份额情况**

本基金非发起式基金。

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2010年12月20日）基金份额总额	2,051,271,200.80
本报告期期初基金份额总额	128,402,954.88
本报告期基金总申购份额	8,342,185.45
减：本报告期基金总赎回份额	14,462,048.63
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	122,283,091.70

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

**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**

- 1、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。
- 2、本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

**10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件**

本基金报告期内未持有基金。

**10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期未改聘会计师事务所。

**10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况****10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

**10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期，托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

**10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况****10.8.1 基金租用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	佣金	占当期佣金总量的	

			额的比例		比例	
天风证券	4	69,391,771.52	40.21%	64,944.06	43.07%	-
太平洋证券	4	33,984,008.49	19.69%	31,804.16	21.09%	-
中信建投证券	3	29,784,398.39	17.26%	21,918.66	14.54%	-
山西证券	1	12,038,679.34	6.98%	8,859.17	5.88%	-
国盛证券	2	10,418,988.31	6.04%	9,751.77	6.47%	-
长城证券	2	9,482,075.86	5.49%	6,977.95	4.63%	-
招商证券	1	3,219,970.50	1.87%	3,013.55	2.00%	-
首创证券	1	2,397,282.79	1.39%	1,763.83	1.17%	-
东北证券	3	1,856,290.07	1.08%	1,737.31	1.15%	-
中信证券华南 (广证)	3	-	-	-	-	-
五矿证券	4	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
国投证券(安 信)	2	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
西南证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券(联 讯)	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	6	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券(财 富)	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	3	-	-	-	-	-



东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	退租 2 个
方正证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券（齐 鲁）	5	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
湘财证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
新时代证券	3	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富（中 投证券）	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
国新证券（华 融）	4	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
甬兴证券（上 海华信证券）	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	6	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
中邮证券	3	-	-	-	-	新增 1 个

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单位作为本基金的专用交易单位。本基金专用交易单位的选择标准如下：

- （1）经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- （2）具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- （3）具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全

面的信息服务；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

### 10.8.2 基金租用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
天风证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国投证券（安信）	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券（联	-	-	-	-	-	-

讯)						
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券（财 富）	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐 鲁）	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中 投证券）	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国新证券（华	-	-	-	-	-	-

融)						
大同证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券（上海华信证券）	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-

## 10.9 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	金鹰基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2024-01-11
2	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-01-22
3	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2023 年第四季度报告	证监会规定媒介	2024-01-22
4	金鹰基金管理有限公司关于终止华融融达期货股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2024-02-01
5	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级评级方式相关事项的公告	证监会规定媒介	2024-02-01
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海大智慧基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-02-26
7	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增华西证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-05
8	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-13
9	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-03-14
10	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-03-29
11	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会规定媒介	2024-03-29
12	金鹰主题优势混合型证券投资基金 2024 年一	证监会规定媒介	2024-04-22

	季度报告		
13	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-04-22
14	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-31
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-05-31
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-06-17

注：相关信息披露文件请通过本基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站及规定报刊查询。

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
2. 《金鹰主题优势混合型证券投资基金基金合同》。
3. 《金鹰主题优势混合型证券投资基金托管协议》。
4. 金鹰基金管理有限公司批准成立批件和营业执照。
5. 基金托管人业务资格批件和营业执照。
6. 本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

### 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅或按工本费购买复印件，也可登录本基金管理人网站查阅，本基金管理人网址：<http://www.gefund.com.cn>。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日