

# 金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

金

## 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

## §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。本年度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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	17
4.10 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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	17
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	18
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	61
8.3 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 .....	62
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	74
8.6 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 .....	75
8.7 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 .....	75
8.8 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 .....	75
8.9 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 .....	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	76
8.12 投资组合报告附注 .....	76
<b>§ 9 基金份额持有人信息</b> .....	<b>78</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	78
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	78
9.4 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情况 .....	79
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	79
<b>§ 10 开放式基金份额变动</b> .....	<b>79</b>
<b>§ 11 重大事件揭示</b> .....	<b>79</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	79
11.2 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 .....	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	80
11.4 基金投资策略的改变 .....	80
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	80
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	80
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	80
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	81
11.9 其他重大事件 .....	82
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>85</b>
12.1 影响投资者决策的其他重要信息 .....	85
<b>§ 13 备查文件目录</b> .....	<b>85</b>
13.1 备查文件目录 .....	85
13.2 存放地点 .....	85
13.3 查阅方式 .....	85

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰民安回报定开混合	
基金主代码	006972	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019 年 8 月 29 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国民生银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,239,428,590.80 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
下属分级基金的交易代码	006972	007735
报告期末下属分级基金的份额总额	2,036,291,606.99 份	203,136,983.81 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	<p>在封闭期内，本基金将从宏观经济、财政货币政策、经济景气度和货币资金供求等多个维度进行综合分析，主动判断市场时机，在严格控制投资组合风险的前提下，进行积极灵活的资产配置，合理确定基金在股票类、债券类、现金类等大类资产上的投资比例，根据各类资产的特点采取不同的研究分析方法，最大限度地提高基金资产的收益。</p> <p>在开放期内，本基金为保持较高的组合流动性，在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下，将主要投资于高流动性的投资品种，防范流动性风险，满足开放期流动性的需求。</p>
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富（总值）指数收益率×80%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，其预期收益和风险水平低于股票型基金，高于债券型基金和货币市场基金。

**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		金鹰基金管理有限公司	中国民生银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	罗菲菲
	联系电话	020-83936180	010-58560666
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	tgxxpl@cmbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95568
传真		020-83282856	010-57093382
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2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2号
邮政编码		510623	100031
法定代表人		姚文强	高迎欣

**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》
登载基金年度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>
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江东路 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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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、基金净值表现及利润分配情况

## 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	2022 年		2021 年		2020 年	
	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回报 定开 C
本期已 实现收 益	-118,567,05 6.58	-13,081,630 .49	281,809,024. 88	29,732,997.4 4	162,187,475. 22	24,568,397.30
本期利 润	-245,260,93 5.00	-26,127,091 .31	249,324,309. 35	26,277,657.2 4	194,825,786. 76	27,381,367.80
加权平 均基金 份额本 期利润	-0.0992	-0.1029	0.1613	0.1601	0.2773	0.2627
本期加 权平均 净值利 润率	-9.02%	-9.44%	13.45%	13.41%	25.18%	23.92%
本期基 金份额 净值增 长率	-8.33%	-8.70%	18.88%	18.41%	25.38%	24.87%
3.1.2 期末 数据和指 标	2022 年末		2021 年末		2020 年末	
	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回报 定开 C
期末可 供分配 利润	156,514,214 .27	13,142,047. 20	402,940,029. 93	39,372,190.9 8	135,970,798. 79	14,466,964.49
期末可 供分配 基金份 额利润	0.0769	0.0647	0.1547	0.1461	0.1200	0.1172
期末基 金资产 净值	2,192,805,8 21.26	216,279,031 .01	3,060,900,93 8.33	314,343,307. 15	1,321,827,09 2.99	143,578,112.9 4
期末基 金份额 净值	1.0769	1.0647	1.1748	1.1662	1.1664	1.1635
3.1.3 累计	2022 年末		2021 年末		2020 年末	

期末指标	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C	金鹰民安回 报定开 A	金鹰民安回 报定开 C
基金份额 累计 净值增 长率	45.62%	43.68%	58.85%	57.38%	33.63%	32.91%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；

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、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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字；

4、期末可供分配利润，采用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）。

### 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

##### 金鹰民安回报定开 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	-0.28%	0.76%	0.64%	0.24%	-0.92%	0.52%
过去六个月	-4.32%	0.74%	-1.37%	0.21%	-2.95%	0.53%
过去一年	-8.33%	0.78%	-1.88%	0.26%	-6.45%	0.52%
过去三年	36.63%	0.74%	9.85%	0.26%	26.78%	0.48%
自基金合同生 效起至今	45.62%	0.71%	12.67%	0.25%	32.95%	0.46%

##### 金鹰民安回报定开 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	-0.38%	0.76%	0.64%	0.24%	-1.02%	0.52%
过去六个月	-4.52%	0.74%	-1.37%	0.21%	-3.15%	0.53%
过去一年	-8.70%	0.78%	-1.88%	0.26%	-6.82%	0.52%
过去三年	34.99%	0.74%	9.85%	0.26%	25.14%	0.48%
自基金合同生 效起至今	43.68%	0.71%	12.67%	0.25%	31.01%	0.46%



效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

注：1.1 本基金的业绩比较基准是：中债总财富（总值）指数收益率\*80+沪深 300 指数收益率\*20%；

1.2 截至报告期末本基金的各项投资比例已达到基金合同规定的各项比例。

### 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

金鹰民安回报一年定期开放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  
 （2019 年 8 月 29 日至 2022 年 12 月 31 日）

#### 金鹰民安回报定开 A



#### 金鹰民安回报定开 C



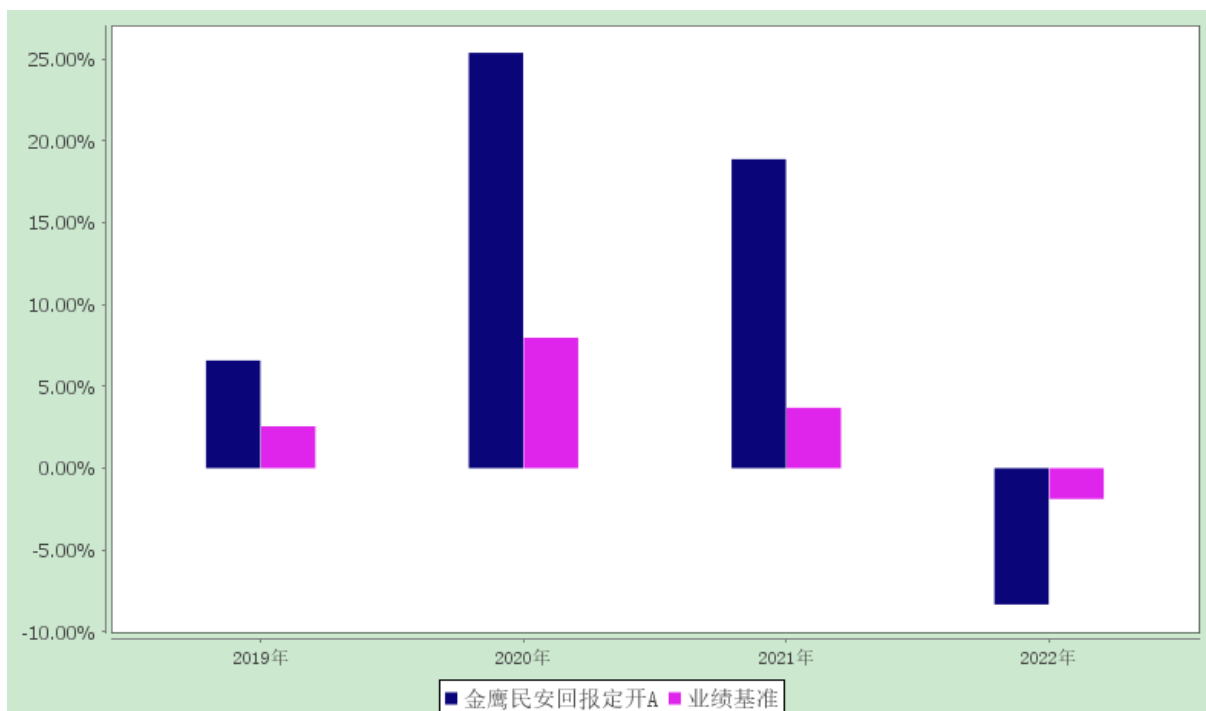
注：本基金的业绩比较基准是：中债总财富（总值）指数收益率\*80+沪深 300 指数收益率\*20%

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

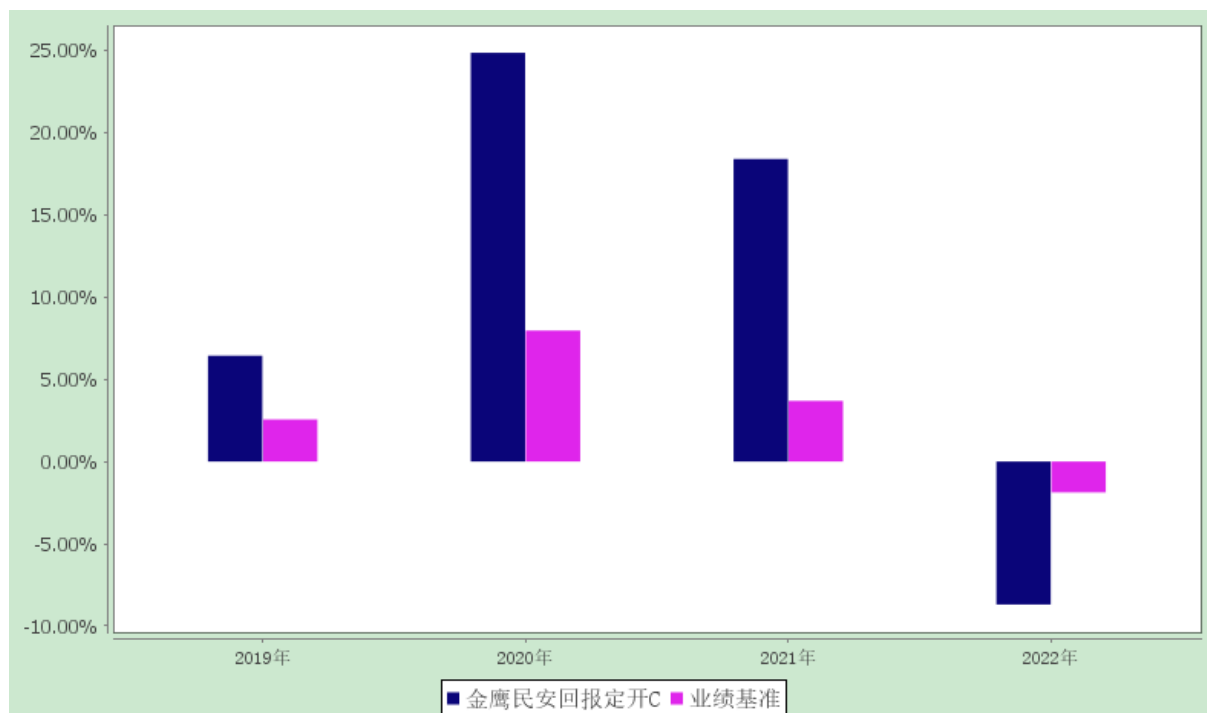
金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

#### 金鹰民安回报定开 A



#### 金鹰民安回报定开 C



注：本基金的基金合同于 2019 年 8 月 29 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

金鹰民安回报定开 A

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	-	-	-	-	-
2021	2.100	219,207,469.41	18,784,210.04	237,991,679.45	-
2020	1.552	77,407,886.87	1,995,478.81	79,403,365.68	-
合计	3.652	296,615,356.28	20,779,688.85	317,395,045.13	-

金鹰民安回报定开 C

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022	-	-	-	-	-
2021	2.100	23,410,757.13	2,503,171.69	25,913,928.82	-
2020	1.515	14,354,071.37	383,559.62	14,737,630.99	-

合计	3.615	37,764,828.50	2,886,731.31	40,651,559.81	-
----	-------	---------------	--------------	---------------	---

## §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。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理资格。

“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 60 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		
林龙军	本基金的基金经理，公司总经理助理、绝对收益投资部总经理	2019-08-29	-	14	林龙军先生，曾任兴全基金管理有限公司产品经理、研究员、基金经理助理、投资经理兼固收投委会委员等职务。2018 年 3 月加入金鹰基金管理有限公司，现任绝对收益投资部基金经理。
周雅雯	本基金的基金经理助理	2020-10-15	-	5	周雅雯女士，上海财经大学金融学硕士研究生，2018 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，担任绝对收益投资部信用研究员职务，现任基金经理职

					务。
--	--	--	--	--	----

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日；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”指公司公告聘任或解聘日期；

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》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，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 公平交易制度和控制方法

为了保证本基金管理人管理的不同投资组合得到公平对待，本基金管理人根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司内部控制指导意见》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，以及公司内控大纲的要求，制定了《金鹰基金管理有限公司公平交易管理规定》并严格执行，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。本基金管理人通过投资交易系统公平交易功能，对不同投资组合进行公平交易事前控制。同时，本基金管理人引入公平交易分析系统，定期或不定期对公司旗下投资组合在一定期间内买卖相同证券的情况进行监控和分析。

##### 4.3.2 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内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。

报告期内，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间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。

#### 4.3.3 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

2022 年，权益市场震荡下行，全年主要宽基指数均录得负收益。从年初开始对核心成长板块景气度二阶导环比下行的悲观预期，在疫情形势趋于严峻的背景下被放大，四月底在政策与疫情防控趋势边际向好的预期下，市场在“低位”形成对成长板块方向的决断，强基本面支撑下的光伏、海外户储、汽车和零部件行业，以及对基本面形成环比改善趋势一致预期的风电、锂电池、光伏新技术等行业板块都在四月底开启修复反弹；行情进展至 7 月，兑现业绩能力预期弱的行业调整，进入 9 月，景气度见顶或边际向下预期的行业也开始调整，市场开始交易展望 2023 年景气度边际变化预期更为明显的方向，例如海外大储、复合集流体、钠离子电池等板块；进入四季度，风光储与新能源车调整，而基于多重利好预期下的底部行业如半导体、传媒、计算机等行业开启反弹。全年市场在 3-4 月、9-10 月发生较大幅度的调整，也正是 4 月底与 10 月底的“决断”影响后市行情。操作方面，我们延续顺着盈利变化弹性的思路做行业选择，同时在仓位的配置上更趋于均衡，增加了对稳定、困境反转板块的配置，不足之处在于个别时间点上单一风格的仓位过重导致组合出现较大回撤，在消费等后疫情板块上的低配也让我们跑输相关指数。

中证转债指数出现自 2017 年以来最大幅度的全年调整，但比多数宽基指数仍有相对收益，年初至 8 月中旬可转债市场呈现“V”形走势，四季度权益和债券市场的调整同时压缩可转债平价和估值。操作上，我们增加了平衡型转债的仓位，在可转债绝对价格快速回落的阶段用部分可转债代替股票资产，但仍不免在估值收缩过程中受到挤压。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金报告期内 A 类份额净值为 1.0769 元，本报告期份额净值增长率为-8.33%，同期业绩比较基准增长率为-1.88%；C 类基金份额净值为 1.0647 元，本报告期份额净值增长率为

-8.70%，同期业绩比较基准增长率为-1.88%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于内需重于外需的判断在我们的四季度策略及展望中已有提及，对于金融环境的判断我们也认为超额流动性最宽松的时机已经过去，从钟摆的判断上对大盘价值更为有利，傲娇 2 年的成长赛道也或多或少地遇到了逻辑冲击。从四季度的表现来看，尽管市场在“翘首”政策转向的过程中经历了一波三折，但最终与我们的判断较为贴合。

站在当前的时间点，在防疫、封控、地产供给侧改革等政策不确定性下降的背景下，市场的估值体系回归常态框架。宏观层面上，信贷数据二次探底确立，企业中长期贷款增速持续向上，部分行业加速去库存甚至步入补库存；微观层面上，压抑两年之久的个体户、小微企业主的设备采购有所恢复，直接反应消费场景放开的餐饮、服装设备采购率先复苏，刚需购房群体开始陆续入场，诸此等等，均佐证居民、企业主的信心在修复，风险偏好在回暖。尽管过程和斜率暂时无法判断，但底部或是确立的，对于权益市场需要更乐观一些。

市场总是先人一步。正如我们在去年四季度看到的，在明确的消费数据改善之前，白酒指数已经上涨 20%，地产交房未显著变动之前，地产链已经领跑 30%……不少行业已经迅速兑现了估值修复。这就对我们的投研给予了极大的考验。

在资金领先的情景下，我们能否消化逐步抬升的估值，这些多存在于市场对复苏看法高度一致的板块，比如与场景密切相关的食品饮料、择期手术、旅游出行娱乐以及亟待回补的竣工装修等可选消费领域；当然，这其中，有些领域的成长期还没走完，而经历疫情的考验后，龙头公司的先发优势、技术/外延沉淀更为明确，估值仍有抬升空间，有希望走出独立的景气和阿尔法，需要区别看待。对于市场未形成高度一致的深度价值、周期、材料板块，pb 充分反应了悲观预期，估值和筹码均十分有利于我们作为困境反转来布局。而我们依然坚信成长才是未来，在过去两年如火如荼的成长赛道，部分领域的产业趋势出现微妙变化甚至迭代，我们应密切跟踪产业变化，降低在市场过度一致、趋势生变、风险收益比下降的领域的敞口。对于海内外互联网巨头紧锣密鼓布局的 AIGC 产业链，假设在今明两年见到算法成本下降、性价比提升的临界点，应用场景和市场规模就会出现 0-1 和 1-N 的巨变，这对消沉已久的传媒互联网、电子半导体、通信计算机等板块带来反转甚至重生，对于这一类产业革命我们需积极把握，布局生命初期的黄金投资时光。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本

基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

#### 4.7 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。



#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

#### 4.10 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，中国民生银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，依法安全保管了基金财产，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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，按照相关法律法规和基金合同、托管协议的有关规定，本托管人对本基金的投资运作方面进行了监督，对基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人有关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。

#### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确和完整。

### §6 审计报告

毕马威华振审字第 2303364 号

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了后附的金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表、2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及，2022 年度的经营成果和基金净值变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

该基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2022 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相

关的事项 (如适用), 并运用持续经营假设, 除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

## 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证, 并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证, 但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致, 如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策, 则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中, 我们运用职业判断, 并保持职业怀疑。同时, 我们也执行以下工作:

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险, 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制, 以设计恰当的审计程序, 但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时, 根据获取的审计证据, 就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性, 审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露; 如果披露不充分, 我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而, 未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容, 并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通, 包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)

中国注册会计师

叶云晖 黄倾媛

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2023 年 3 月 27 日

## §7 年度财务报表

## 7.1 资产负债表

会计主体：金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	7,799,023.88	22,468,850.30
结算备付金		17,503,755.33	21,508,953.98
存出保证金		1,309,125.87	1,285,081.10
交易性金融资产	7.4.7.2	2,957,179,624.06	3,750,917,860.38
其中：股票投资		957,018,055.73	1,167,850,569.23
基金投资		-	-
债券投资		2,000,161,568.33	2,583,067,291.15
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	43,950,863.64
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	38,752,199.54
<b>资产总计</b>		<b>2,983,791,529.14</b>	<b>3,878,883,808.94</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		519,904,920.55	489,399,805.90
应付清算款		49,254,055.17	7,799,478.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,080,809.36	2,875,881.74
应付托管费		312,121.41	431,382.24
应付销售服务费		74,735.11	107,151.82
应付投资顾问费		-	-
应交税费		28,883.53	40,250.15
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	3,051,151.74	2,985,612.90
<b>负债合计</b>		<b>574,706,676.87</b>	<b>503,639,563.46</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	2,239,428,590.80	2,874,917,333.04
未分配利润	7.4.7.8	169,656,261.47	500,326,912.44
<b>净资产合计</b>		<b>2,409,084,852.27</b>	<b>3,375,244,245.48</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>2,983,791,529.14</b>	<b>3,878,883,808.94</b>

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日，基金份额总额 2,239,428,590.80 份；其中金鹰民安回报定开 A 基金份额净值 1.0769 元，份额总额 2,036,291,606.99 份；金鹰民安回报定开 C 基金份额净值 1.0647 元，份额总额 203,136,983.81 份。

## 7.2 利润表

会计主体：金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-229,454,439.16</b>	<b>327,711,048.66</b>
1.利息收入		3,347,450.16	63,766,219.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	707,330.24	768,563.44
债券利息收入		-	61,784,034.16
资产支持证券利息收入		-	275,303.98
买入返售金融资产收入		2,640,119.92	938,317.55
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-93,063,352.42	299,785,518.86
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-182,212,372.39	263,634,126.83
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	83,433,158.46	29,014,850.89
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	5,715,861.51	7,136,541.14
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-139,739,339.24	-35,940,055.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	802.34	99,366.40
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>41,933,587.15</b>	<b>52,109,082.07</b>
1. 管理人报酬		30,032,197.10	20,536,734.54
2. 托管费		4,504,829.69	3,080,510.09
3. 销售服务费		1,109,421.14	785,198.87
4. 投资顾问费		-	-

5. 利息支出		6,024,609.25	13,841,555.66
其中：卖出回购金融资产支出		6,024,609.25	13,841,555.66
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		52,152.66	42,141.61
8. 其他费用	7.4.7.19	210,377.31	13,822,941.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-271,388,026.31</b>	<b>275,601,966.59</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-271,388,026.31</b>	<b>275,601,966.59</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-271,388,026.31</b>	<b>275,601,966.59</b>

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,874,917,333.04	500,326,912.44	3,375,244,245.48
二、本期期初净资产（基金净值）	2,874,917,333.04	500,326,912.44	3,375,244,245.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-635,488,742.24	-330,670,650.97	-966,159,393.21
（一）、综合收益总额	-	-271,388,026.31	-271,388,026.31
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-635,488,742.24	-59,282,624.66	-694,771,366.90
其中：1.基金申购款	18,410,018.25	1,675,712.76	20,085,731.01

2.基金赎回款	-653,898,760.49	-60,958,337.42	-714,857,097.91
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,239,428,590.80	169,656,261.47	2,409,084,852.27
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,256,693,371.77	208,711,834.16	1,465,405,205.93
二、本期期初净资产(基金净值)	1,256,693,371.77	208,711,834.16	1,465,405,205.93
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,618,223,961.27	291,615,078.28	1,909,839,039.55
(一)、综合收益总额	-	275,601,966.59	275,601,966.59
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,618,223,961.27	279,918,719.96	1,898,142,681.23
其中: 1.基金申购款	2,400,899,678.00	416,636,715.28	2,817,536,393.28
2.基金赎回款	-782,675,716.73	-136,717,995.32	-919,393,712.05
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-263,905,608.27	-263,905,608.27
四、本期期末净资产(基金净值)	2,874,917,333.04	500,326,912.44	3,375,244,245.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，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：耿源，会计机构负责人：董霞



## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”)证监许可[2019]1057号《关于准予金鹰添悦债券型证券投资基金变更注册的批复》核准,准予金鹰添悦债券型证券投资基金变更注册为金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金。由金鹰基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于2019年8月5日向社会公开发行人募集并于2019年8月29日正式成立。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司,基金托管人为中国民生银行股份有限公司。

本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金总额和利息合计为人民币608,897,718.34元,其中,A类基金为人民币511,619,626.46元,C类基金为人民币97,278,091.88元。

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》和基金合同等有关规定,本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(含国债、地方政府债、金融债、公司债、企业债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债、可转换债券、可交换债券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货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。

### 7.4.2 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。

### 7.4.3 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7.4.2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 2022 年 12 月 31 日的财务状况、2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、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。

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产。

###### （2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

###### （a）金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。对于其他类

别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

#### (b)金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

#### (d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为企业面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

对于应收账款，本基金始终按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备。

除应收账款外，本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债

的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且目前可执行该种法定权利，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并全额转入“未分配利润 / (累计亏损)”。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(4) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(5) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(6) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相

关税费后的净额入账；

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后两类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的两类基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

#### 7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理，根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与现行准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,468,850.30 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 935.38 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 22,469,785.68 元。

结算备付金 于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,508,953.98 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 9,679.10 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00



元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 21,518,633.08 元。

存出保证金 于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,285,081.10 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 578.30 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,285,659.40 元。

应收利息 于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 38,752,199.54 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 935.38 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 9,679.10 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 578.30 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 38,741,006.76 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量及其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产 于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,750,917,860.38 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 38,741,006.76 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 3,789,658,867.14 元。

以摊余成本计量的金融负债：

卖出回购金融资产款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 489,399,805.90

元，自应付利息转入的重分类金额为人民币-72,724.28 元。经上述重分类后，卖出回购金融资产款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 489,327,081.62 元。

应付利息 于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币-72,724.28 元，转出至卖出回购金融资产款的重分类金额为人民币-72,724.28 元。经上述重分类后，应付利息不再作为财务报表项目单独列报。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 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。

### 7.4.5.3 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。

### 7.4.6 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, 以管理人为增值税一般纳税人, 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	7,799,023.88	22,468,850.30
等于：本金	7,796,301.20	22,468,850.30
加：应计利息	2,722.68	-
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	7,799,023.88	22,468,850.30

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,052,995,097.19	-	957,018,055.73	-95,977,041.46
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	6,350,929.79	970,701,685.90	-20,464,516.60
	银行间市场	1,023,729,071.53	10,005,882.43	-4,275,071.53
	合计	2,008,544,344.24	16,356,812.22	2,000,161,568.33
资产支持证券	-	-	-	-

基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,061,539,441.4 3	16,356,812.22	2,957,179,624.06	-120,716,629.59
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,162,163,849.5 3	-	1,167,850,569.23	5,686,719.70
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	699,545,639.64	-	701,588,141.15	2,042,501.51
	银行间市场	1,870,185,661.5 6	-	1,881,479,150.00	11,293,488.44
	合计	2,569,731,301.2 0	-	2,583,067,291.15	13,335,989.95
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		3,731,895,150.7 3	-	3,750,917,860.38	19,022,709.65

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

## 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	38,752,199.54
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	38,752,199.54

注：本基金本报告期末无其他资产。

## 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 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	2,886,151.74	2,893,337.18
其中：交易所市场	2,876,783.25	2,881,736.47
银行间市场	9,368.49	11,600.71
应付利息	-	-72,724.28
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费用	45,000.00	45,000.00
合计	3,051,151.74	2,985,612.90

## 7.4.7.7 实收基金

金鹰民安回报定开 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	2,605,379,902.96	2,605,379,902.96
本期申购	13,454,810.15	13,454,810.15
本期赎回（以“-”号填列）	-582,543,106.12	-582,543,106.12
本期末	2,036,291,606.99	2,036,291,606.99

金鹰民安回报定开 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	269,537,430.08	269,537,430.08
本期申购	4,955,208.10	4,955,208.10
本期赎回（以“-”号填列）	-71,355,654.37	-71,355,654.37
本期末	203,136,983.81	203,136,983.81

**7.4.7.8 未分配利润**

金鹰民安回报定开 A

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	402,940,029.93	52,581,005.44	455,521,035.37
本期利润	-118,567,056.58	-126,693,878.42	-245,260,935.00
本期基金份额交易产生的变动数	-70,586,164.91	16,840,278.81	-53,745,886.10
其中：基金申购款	1,658,033.19	-396,074.33	1,261,958.86
基金赎回款	-72,244,198.10	17,236,353.14	-55,007,844.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	213,786,808.44	-57,272,594.17	156,514,214.27

金鹰民安回报定开 C

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	39,372,190.98	5,433,686.09	44,805,877.07

本期利润	-13,081,630.49	-13,045,460.82	-26,127,091.31
本期基金份额交易产生的变动数	-7,499,734.60	1,962,996.04	-5,536,738.56
其中：基金申购款	543,725.99	-129,972.09	413,753.90
基金赎回款	-8,043,460.59	2,092,968.13	-5,950,492.46
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,790,825.89	-5,648,778.69	13,142,047.20

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	177,073.73	198,380.45
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	514,377.62	556,926.64
其他	15,878.89	13,256.35
合计	707,330.24	768,563.44

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	6,253,533,543.67	4,776,776,050.41
减：卖出股票成本总额	6,419,050,952.51	4,513,141,923.58
减：交易费用	16,694,963.55	-
买卖股票差价收入	-182,212,372.39	263,634,126.83

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元



项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	63,737,416.41	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,695,742.05	29,014,850.89
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	83,433,158.46	29,014,850.89

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,958,380,027.73	3,270,720,226.42
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,888,046,584.41	3,198,750,082.70
减：应计利息总额	50,573,866.97	42,955,292.83
减：交易费用	63,834.30	-
买卖债券差价收入	19,695,742.05	29,014,850.89

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出资产支持证券成交总额	-	18,396,551.64
减：卖出资产支持证券成本总额	-	18,165,000.00
减：应计利息总额	-	231,551.64
减：交易费用	-	-
资产支持证券投资收益	-	-

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**7.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**7.4.7.14 衍生工具收益****7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

**7.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	5,715,861.51	7,136,541.14
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	5,715,861.51	7,136,541.14

**7.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-139,739,339.24	-35,940,055.73
——股票投资	-101,663,761.16	-60,766,612.28
——债券投资	-38,075,578.08	24,844,556.55
——资产支持证券投资	-	-18,000.00
——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	-139,739,339.24	-35,940,055.73

#### 7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	802.34	99,366.40
合计	802.34	99,366.40

#### 7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

#### 7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	45,000.00	45,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	8,477.31	5,595.06
帐户维护费	35,700.00	35,850.00
其他项目	1,200.00	1,200.00
交易费用	-	13,615,296.24
合计	210,377.31	13,822,941.30

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须披露的或有事项。

#### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截止本财务报表批准报出日，本基金无需用披露的重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国民生银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广州越秀资本控股集团股份有限公司	基金管理人股东
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
东旭集团有限公司	基金管理人股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 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。

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 7.4.10.1.3 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。

###### 7.4.10.1.4 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。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	30,032,197.10	20,536,734.54
其中：支付销售机构的客户维护费	14,938,249.50	10,184,322.16

注：基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,504,829.69	3,080,510.09

注：基金托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 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。

#### 7.4.10.2.3 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		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C	合计
民生银行股份有限公司	-	1,025,532.32	1,025,532.32

司			
金鹰基金管理有限公司	-	189.22	189.22
合计	-	1,025,721.54	1,025,721.54
获得销售服务费的各 关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰民安回报定开A	金鹰民安回报定开C	合计
民生银行股份有限公司	-	586,269.15	586,269.15
金鹰基金管理有限公司	-	67.55	67.55
合计	-	586,336.70	586,336.70

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。本基金销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40% 年费率计提，销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记结算机构，由登记结算机构代付给销售机构。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 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

##### 7.4.10.4.1 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。

##### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

##### 7.4.10.5.2 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

###### 金鹰民安回报定开 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

###### 金鹰民安回报定开 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.6 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	
	2022年1月1日至2022年12月31日		2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国民生银行股份有限公司	7,799,023.88	177,073.73	22,468,850.30	198,380.45

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；2022年12月31日清算备付金期末余额17,503,755.33元，清算备付金利息收入514,377.62元；2021年12月31日清算备付金期末余额21,508,953.98元，清算备付金利息收入556,926.64元。

#### 7.4.10.7 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。

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 7.4.12 期末（2022年12月31日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	网下配售锁定	237.50	176.97	242.00	57,475.00	42,826.74	-
688271	联影医疗	2022-08-12	6个月	网下配售锁定	109.88	171.68	7,365.00	809,266.20	1,264,423.20	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	网下配售锁定	138.88	103.52	180.00	24,998.40	18,633.60	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	网下配售锁定	78.80	76.96	191.00	15,050.80	14,699.36	-
301195	北路智控	2022-07-25	6个月	网下配售锁定	71.17	73.04	330.00	23,486.10	24,103.20	-
688353	华盛锂电	2022-07-06	6个月	网下配售锁定	98.35	63.86	4,358.00	428,609.30	278,301.88	-
301308	江波龙	2022-07-27	6个月	网下配售锁定	55.67	56.72	819.00	45,593.73	46,453.68	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月	网下配售锁定	52.69	51.41	235.00	12,382.15	12,081.35	-
301356	天振股份	2022-11-03	6个月	网下配售锁定	63.00	43.33	614.00	38,682.00	26,604.62	-
301318	维海德	2022-08-03	6个月	网下配售锁定	64.68	41.74	206.00	13,324.08	8,598.44	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6个月	网下配售锁定	30.66	37.85	445.00	13,643.70	16,843.25	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6个月	网下配售	37.89	37.79	277.00	10,495.53	10,467.83	-



				锁定							
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月	网下配售锁定	49.98	33.82	420.00	20,991.60	14,204.40	-	
301330	熵基科技	2022-08-10	6个月	网下配售锁定	43.32	31.31	694.00	30,064.08	21,729.14	-	
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	网下配售锁定	36.15	29.37	211.00	7,627.65	6,197.07	-	
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	网下配售锁定	30.38	25.25	434.00	13,184.92	10,958.50	-	
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	网下配售锁定	26.80	24.48	468.00	12,542.40	11,456.64	-	
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	网下配售锁定	39.00	24.46	228.00	8,892.00	5,576.88	-	
301365	矩阵股份	2022-11-14	6个月	网下配售锁定	34.72	23.87	516.00	17,915.52	12,316.92	-	
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	网下配售锁定	40.66	22.61	303.00	12,319.98	6,850.83	-	
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	网下配售锁定	25.49	20.38	275.00	7,009.75	5,604.50	-	
301171	易点天下	2022-08-10	6个月	网下配售锁定	18.18	17.72	985.00	17,907.30	17,454.20	-	
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月	网下配售锁定	23.88	16.89	544.00	12,990.72	9,188.16	-	
688252	天德钰	2022-09-20	6个月	网下配售锁定	21.68	15.78	5,201.00	112,757.68	82,071.78	-	
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月	网下配售锁定	18.19	14.90	1,042.00	18,953.98	15,525.80	-	
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	网下配售锁定	7.60	14.32	359.00	2,728.40	5,140.88	-	
301285	鸿日	2022-09-21	6个月	网下	14.60	12.60	565.00	8,249.00	7,119.00	-	

	达			配售 锁定						
688432	有研 硅	2022-11-03	6 个月	网下 配售 锁定	9.91	11.24	20,044.00	198,636.04	225,294.56	-

#### 7.4.12.2 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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 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 70,020,008.41 元，是以如下债券作为质押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值 单价	数量（张）	期末估值总额
180321	18 进出 21	2023-01-05	102.60	740,000.00	75,925,155.62
合计				740,000.00	75,925,155.62

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 449,884,912.14 元。于 2023 年 1 月 3 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 7.4.12.4 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。

#### 7.4.13 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。

#### 7.4.13.1 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系的建立，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；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

#### 7.4.13.2 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等级的证券，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。本基金的基金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控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

#### 7.4.13.2.1 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 2022年12月31日	上年度末 2021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、地方政府债和同业存单。

#### 7.4.13.2.2 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 2022年12月31日	上年度末 2021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

#### 7.4.13.2.3 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	上年度末

	2022年12月31日	2021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。

#### 7.4.13.2.4 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	1,092,041,083.93	1,656,753,677.20
AAA 以下	402,105,223.89	170,459,613.95
未评级	0.00	0.00
合计	1,494,146,307.82	1,827,213,291.15

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债和同业存单。

#### 7.4.13.2.5 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 2022年12月31日	上年度末 2021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

#### 7.4.13.2.6 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	374,749,422.15	467,570,000.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00

合计	374,749,422.15	467,570,000.00
----	----------------	----------------

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

### 7.4.13.4 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。

#### 7.4.13.4.1 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。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	7,799,023.88	-	-	-	7,799,023.88
结算备付金	17,503,755.33	-	-	-	17,503,755.33
存出保证金	1,309,125.87	-	-	-	1,309,125.87
交易性金融资产	831,700,107.79	615,236,919.84	553,224,540.70	957,018,055.73	2,957,179,624.06
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	858,312,012.87	615,236,919.84	553,224,540.70	957,018,055.73	2,983,791,529.14
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	519,904,920.55	-	-	-	519,904,920.55
应付证券清算款	-	-	-	49,254,055.17	49,254,055.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,080,809.36	2,080,809.36
应付托管费	-	-	-	312,121.41	312,121.41
应付销售服务费	-	-	-	74,735.11	74,735.11
应交税费	-	-	-	28,883.53	28,883.53
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,051,151.74	3,051,151.74
负债总计	519,904,920.55	-	-	54,801,756.32	574,706,676.87
利率敏感度缺口	338,407,092.32	615,236,919.84	553,224,540.70	902,216,299.41	2,409,084,852.27
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	22,468,850.30	-	-	-	22,468,850.30
结算备付金	21,508,953.98	-	-	-	21,508,953.98

存出保证金	1,285,081.10	-	-	-	1,285,081.10
交易性金融资产	865,101,150.00	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,167,850,569.23	3,750,917,860.38
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	43,950,863.64	43,950,863.64
应收利息	-	-	-	38,752,199.54	38,752,199.54
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	910,364,035.38	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,250,553,632.41	3,878,883,808.94
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	489,399,805.90	-	-	-	489,399,805.90
应付证券清算款	-	-	-	7,799,478.71	7,799,478.71
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,875,881.74	2,875,881.74
应付托管费	-	-	-	431,382.24	431,382.24
应付销售服务费	-	-	-	107,151.82	107,151.82
应付交易费用	-	-	-	2,893,337.18	2,893,337.18
应交税费	-	-	-	40,250.15	40,250.15
应付利息	-	-	-	-72,724.28	-72,724.28
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债总计	489,399,805.90	-	-	14,239,757.56	503,639,563.46
利率敏感度缺口	420,964,229.48	1,416,451,928.30	301,514,212.85	1,236,313,874.85	3,375,244,245.48

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 7.4.13.4.1.2 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日



	利率上升 25 个基点	-3,295,092.30	-12,921,062.60
	利率下降 25 个基点	3,365,650.01	13,261,911.49

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	957,018,055.73	39.73	1,167,850,569.23	34.60
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	553,920,200.42	22.99	41,018,141.15	1.22
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	1,510,938,256.15	62.72	1,208,868,710.38	35.82

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰民安回报定开 A

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	241,484,287.51	279,429,417.10
	业绩比较基准变动-5%	-241,484,287.51	-279,429,417.10

## 金鹰民安回报定开 C

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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	23,826,385.90	28,690,126.04
	业绩比较基准变动-5%	-23,826,385.90	-28,690,126.04

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

本基金对以公允价值进行后续计量的金融资产与金融负债根据对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值确定公允价值计量层级。公允价值计量层次可分为：

第一层次输入值是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。

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	1,508,717,529.74	1,205,087,050.33
第二层次	1,446,241,367.91	2,545,830,810.05
第三层次	2,220,726.41	-
合计	2,957,179,624.06	3,750,917,860.38

## 7.4.14.2.2 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。

## 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	10,045,633.18	10,045,633.18
转出第三层次	-	9,798,678.64	9,798,678.64
当期利得或损失总额	-	1,973,771.87	1,973,771.87
其中：计入损益的利得或损失	-	1,973,771.87	1,973,771.87
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	2,220,726.41	2,220,726.41
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	224,948.40	224,948.40
项目	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：本基金上年度无第三层次公允价值余额及变动情况。

**7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

**7.4.14.4 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。

**7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2022 年 12 月 31 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。

**§8 投资组合报告****8.1 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	957,018,055.73	32.07
	其中：股票	957,018,055.73	32.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,000,161,568.33	67.03
	其中：债券	2,000,161,568.33	67.03
	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	25,302,779.21	0.85
8	其他各项资产	1,309,125.87	0.04
9	合计	2,983,791,529.14	100.00

注：其他资产包括：存出保证金、应收利息（股利）、应收证券清算款、应收申购款、待摊费用、其他应收款。

## 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 8.2.1 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	27,242.60	0.00
B	采矿业	65,301.18	0.00
C	制造业	624,148,129.20	25.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,961.69	0.01
E	建筑业	116,062.22	0.00
F	批发和零售业	758,628.32	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	47,464,574.32	1.97
H	住宿和餐饮业	15,141.60	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,650,715.27	2.31
J	金融业	12,587,658.14	0.52
K	房地产业	180,000,085.25	7.47
L	租赁和商务服务业	16,730,661.01	0.69
M	科学研究和技术服务业	1,416,639.66	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	392,394.33	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	17,246,750.65	0.72
R	文化、体育和娱乐业	232,110.29	0.01
S	综合	-	-
	合计	957,018,055.73	39.73

### 8.2.2 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。

## 8.3 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	000402	金融街	10,949,921	57,487,085.25	2.39
2	600383	金地集团	5,600,000	57,288,000.00	2.38
3	600487	亨通光电	3,219,923	48,492,040.38	2.01
4	601155	新城控股	2,250,000	46,125,000.00	1.91
5	688016	心脉医疗	220,000	41,588,800.00	1.73
6	600732	爱旭股份	950,000	35,929,000.00	1.49
7	002415	海康威视	1,000,000	34,680,000.00	1.44
8	600699	均胜电子	2,349,974	33,017,134.70	1.37
9	000819	岳阳兴长	1,350,000	30,105,000.00	1.25
10	300438	鹏辉能源	370,000	28,856,300.00	1.20
11	300014	亿纬锂能	310,000	27,249,000.00	1.13
12	600399	抚顺特钢	1,869,950	26,758,984.50	1.11
13	300745	欣锐科技	700,000	26,488,000.00	1.10
14	002885	京泉华	749,919	22,362,584.58	0.93
15	601111	中国国航	2,100,000	22,260,000.00	0.92
16	000063	中兴通讯	800,000	20,688,000.00	0.86
17	601156	东航物流	1,302,090	19,869,893.40	0.82
18	688561	奇安信	300,000	19,731,000.00	0.82
19	000656	金科股份	10,000,000	19,100,000.00	0.79
20	300855	图南股份	400,000	18,716,000.00	0.78
21	688599	天合光能	270,034	17,217,367.84	0.71
22	300015	爱尔眼科	549,955	17,087,101.85	0.71
23	002027	分众传媒	2,500,000	16,700,000.00	0.69
24	300565	科信技术	700,000	16,282,000.00	0.68
25	688111	金山办公	60,000	15,869,400.00	0.66
26	000625	长安汽车	1,200,000	14,772,000.00	0.61
27	300316	晶盛机电	220,000	13,983,200.00	0.58
28	002782	可立克	800,000	13,776,000.00	0.57
29	002126	银轮股份	1,099,997	13,650,962.77	0.57
30	601877	正泰电器	480,000	13,296,000.00	0.55
31	600958	东方证券	1,299,980	11,621,821.20	0.48
32	603035	常熟汽饰	520,000	11,050,000.00	0.46
33	600850	电科数字	549,990	11,043,799.20	0.46
34	300057	万顺新材	1,011,612	8,962,882.32	0.37
35	002585	双星新材	700,000	8,925,000.00	0.37
36	688063	派能科技	26,152	8,254,878.80	0.34
37	300916	朗特智能	179,975	7,738,925.00	0.32

38	688345	博力威	142,332	7,468,160.04	0.31
39	002865	钧达股份	40,000	7,404,000.00	0.31
40	300648	星云股份	200,000	7,404,000.00	0.31
41	688223	晶科能源	500,000	7,325,000.00	0.30
42	300587	天铁股份	479,902	5,528,471.04	0.23
43	688676	金盘科技	149,948	5,425,118.64	0.23
44	300271	华宇软件	780,000	5,327,400.00	0.22
45	603712	七一二	150,000	5,238,000.00	0.22
46	603056	德邦股份	250,000	5,207,500.00	0.22
47	688162	巨一科技	99,867	4,326,238.44	0.18
48	688303	大全能源	30,456	1,452,142.08	0.06
49	688271	联影医疗	7,365	1,264,423.20	0.05
50	688072	拓荆科技	5,300	1,148,775.00	0.05
51	688232	新点软件	18,893	1,078,034.58	0.04
52	688349	三一重能	33,495	981,068.55	0.04
53	688050	爱博医疗	3,520	812,064.00	0.03
54	300243	瑞丰高材	99,913	772,327.49	0.03
55	688275	万润新能	4,399	770,484.85	0.03
56	688082	盛美上海	9,337	746,026.30	0.03
57	688186	广大特材	25,000	608,000.00	0.03
58	601456	国联证券	50,077	563,366.25	0.02
59	301177	迪阿股份	7,920	498,801.60	0.02
60	688382	益方生物	36,208	480,842.24	0.02
61	688112	鼎阳科技	4,901	457,018.25	0.02
62	301327	华宝新能	2,417	452,270.49	0.02
63	688700	东威科技	3,049	436,464.35	0.02
64	688270	臻镭科技	3,705	429,668.85	0.02
65	688778	厦钨新能	5,075	394,226.00	0.02
66	688062	迈威生物	27,002	390,178.90	0.02
67	688256	寒武纪	6,894	376,136.64	0.02
68	688586	江航装备	23,010	375,063.00	0.02
69	688061	灿瑞科技	3,972	370,786.20	0.02
70	300896	爱美客	648	366,994.80	0.02
71	688639	华恒生物	2,302	357,385.50	0.01
72	688192	迪哲医药	8,926	351,416.62	0.01
73	688377	迪威尔	7,894	347,178.12	0.01
74	688380	中微半导	12,677	344,053.78	0.01
75	301200	大族数控	8,566	335,787.20	0.01
76	688105	诺唯赞	6,180	328,405.20	0.01
77	300999	金龙鱼	7,177	312,630.12	0.01
78	688207	格灵深瞳	13,391	307,993.00	0.01
79	688332	中科蓝讯	5,870	300,661.40	0.01
80	688739	成大生物	9,882	300,610.44	0.01

81	688351	微电生理	10,946	289,740.62	0.01
82	688027	国盾量子	2,830	288,235.50	0.01
83	688153	唯捷创芯	7,674	281,866.02	0.01
84	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.01
85	301356	天振股份	6,132	276,680.38	0.01
86	688035	德邦科技	4,981	257,069.41	0.01
87	301207	华兰疫苗	5,687	253,526.46	0.01
88	688776	国光电气	1,447	253,340.76	0.01
89	301195	北路智控	3,300	245,962.20	0.01
90	688789	宏华数科	1,400	241,682.00	0.01
91	301168	通灵股份	3,281	237,445.97	0.01
92	688151	华强科技	12,238	233,378.66	0.01
93	688269	凯立新材	2,717	233,118.60	0.01
94	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.01
95	688306	均普智能	47,094	223,696.50	0.01
96	301330	熵基科技	6,937	222,941.03	0.01
97	688401	路维光电	4,947	215,639.73	0.01
98	688073	毕得医药	2,544	208,989.60	0.01
99	688152	麒麟信安	1,189	203,200.10	0.01
100	688677	海泰新光	1,768	199,784.00	0.01
101	688211	中科微至	4,501	187,286.61	0.01
102	301096	百诚医药	2,714	185,393.34	0.01
103	301363	美好医疗	4,447	184,567.07	0.01
104	688322	奥比中光	8,529	183,799.95	0.01
105	301171	易点天下	9,845	183,224.80	0.01
106	301201	诚达药业	3,525	179,070.00	0.01
107	688206	概伦电子	6,000	168,720.00	0.01
108	688665	四方光电	1,687	167,013.00	0.01
109	301039	中集车辆	20,640	164,500.80	0.01
110	688125	安达智能	3,774	162,583.92	0.01
111	301091	深城交	6,812	162,125.60	0.01
112	301296	新巨丰	10,411	160,276.85	0.01
113	301103	何氏眼科	5,065	159,648.80	0.01
114	300834	星辉环材	6,349	157,709.16	0.01
115	688459	哈铁科技	17,259	156,366.54	0.01
116	301328	维峰电子	1,910	153,250.76	0.01
117	605117	德业股份	458	151,689.60	0.01
118	301235	华康医疗	4,178	149,447.06	0.01
119	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.01
120	688282	理工导航	3,185	145,395.25	0.01
121	301123	奕东电子	6,551	143,532.41	0.01
122	688553	汇宇制药	8,928	139,187.52	0.01
123	688697	纽威数控	5,837	133,141.97	0.01



124	301100	风光股份	5,985	132,627.60	0.01
125	688130	晶华微	3,112	132,353.36	0.01
126	301365	矩阵股份	5,160	129,624.36	0.01
127	688209	英集芯	6,822	126,957.42	0.01
128	688267	中触媒	3,390	125,565.60	0.01
129	688051	佳华科技	4,053	125,521.41	0.01
130	301283	聚胶股份	2,344	125,419.01	0.01
131	301189	奥尼电子	4,345	124,180.10	0.01
132	301088	戎美股份	7,036	121,933.88	0.01
133	301132	满坤科技	4,672	118,322.32	0.00
134	688273	麦澜德	3,568	116,316.80	0.00
135	688456	有研粉材	3,396	115,464.00	0.00
136	688370	丛麟科技	3,254	114,963.82	0.00
137	301282	金禄电子	4,333	113,385.23	0.00
138	301273	瑞晨环保	2,761	112,485.71	0.00
139	605499	东鹏饮料	632	112,432.80	0.00
140	301179	泽宇智能	2,941	112,257.97	0.00
141	688253	英诺特	4,364	103,950.48	0.00
142	301093	华兰股份	4,088	103,835.20	0.00
143	688667	菱电电控	1,191	103,640.82	0.00
144	688103	国力股份	1,595	102,622.30	0.00
145	688768	容知日新	907	102,454.72	0.00
146	688338	赛科希德	3,041	100,322.59	0.00
147	688175	高凌信息	2,851	100,098.61	0.00
148	688670	金迪克	2,310	99,306.90	0.00
149	688698	伟创电气	4,751	98,393.21	0.00
150	688236	春立医疗	4,052	96,478.12	0.00
151	301118	恒光股份	3,142	94,919.82	0.00
152	301176	逸豪新材	5,431	94,661.79	0.00
153	688225	亚信安全	5,534	93,579.94	0.00
154	601825	沪农商行	15,480	91,022.40	0.00
155	301196	唯科科技	2,705	90,833.90	0.00
156	688143	长盈通	1,938	90,349.56	0.00
157	688618	三旺通信	1,117	89,248.30	0.00
158	688661	和林微纳	1,452	87,555.60	0.00
159	301318	维海德	2,052	87,053.44	0.00
160	301092	争光股份	3,230	87,016.20	0.00
161	688087	英科再生	2,469	85,797.75	0.00
162	301137	哈焊华通	6,431	85,596.61	0.00
163	300994	久祺股份	4,195	82,725.40	0.00
164	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.00
165	301198	喜悦智行	3,397	82,343.28	0.00
166	688244	永信至诚	1,506	82,077.00	0.00

167	688252	天德钰	5,201	82,071.78	0.00
168	688416	恒烁股份	2,147	81,607.47	0.00
169	688678	福立旺	4,198	80,559.62	0.00
170	688628	优利德	2,789	80,183.75	0.00
171	301237	和顺科技	2,610	77,073.30	0.00
172	301110	青木股份	2,013	76,212.18	0.00
173	688163	赛伦生物	3,607	76,071.63	0.00
174	301048	金鹰重工	8,424	71,772.48	0.00
175	688226	威腾电气	2,693	70,718.18	0.00
176	688329	艾隆科技	1,846	70,351.06	0.00
177	301276	嘉曼服饰	3,026	70,269.50	0.00
178	301020	密封科技	4,210	70,264.90	0.00
179	001270	铖昌科技	568	69,296.00	0.00
180	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
181	601568	北元集团	12,108	68,652.36	0.00
182	688210	统联精密	3,105	68,527.35	0.00
183	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.00
184	603529	爱玛科技	1,427	65,456.49	0.00
185	301028	东亚机械	7,329	65,447.97	0.00
186	688508	芯朋微	1,000	64,810.00	0.00
187	301300	远翔新材	2,107	63,702.75	0.00
188	688786	悦安新材	1,513	62,744.11	0.00
189	003035	南网能源	11,046	62,630.82	0.00
190	688718	唯赛勃	3,145	62,616.95	0.00
191	688071	华依科技	1,101	62,217.51	0.00
192	688799	华纳药厂	1,917	61,018.11	0.00
193	688611	杭州柯林	1,400	60,704.00	0.00
194	688685	迈信林	2,612	60,441.68	0.00
195	301158	德石股份	3,783	59,960.55	0.00
196	600906	财达证券	7,597	57,509.29	0.00
197	688669	聚石化学	2,681	57,480.64	0.00
198	301231	荣信文化	2,744	57,404.12	0.00
199	301228	实朴检测	3,721	57,377.82	0.00
200	688571	杭华股份	8,200	57,318.00	0.00
201	301309	万得凯	2,271	56,692.74	0.00
202	688296	和达科技	2,173	56,215.51	0.00
203	301052	果麦文化	2,520	56,095.20	0.00
204	301035	润丰股份	644	56,092.40	0.00
205	301182	凯旺科技	2,932	55,180.24	0.00
206	300922	天秦装备	4,008	54,989.76	0.00
207	001269	欧晶科技	546	54,185.04	0.00
208	688171	纬德信息	2,821	53,570.79	0.00
209	300979	华利集团	925	52,826.75	0.00

210	688314	康拓医疗	1,085	52,047.45	0.00
211	301063	海锅股份	1,524	51,846.48	0.00
212	300774	倍杰特	4,435	51,490.35	0.00
213	301038	深水规院	3,458	51,109.24	0.00
214	688216	气派科技	2,000	51,040.00	0.00
215	601963	重庆银行	7,472	50,660.16	0.00
216	001203	大中矿业	3,808	49,237.44	0.00
217	301098	金埔园林	3,069	48,306.06	0.00
218	301059	金三江	2,581	47,748.50	0.00
219	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
220	301081	严牌股份	4,024	46,436.96	0.00
221	301083	百胜智能	4,160	45,926.40	0.00
222	688501	青达环保	1,759	45,470.15	0.00
223	301057	汇隆新材	2,173	43,742.49	0.00
224	301056	森赫股份	5,716	43,498.76	0.00
225	001330	博纳影业	3,564	42,696.72	0.00
226	600916	中国黄金	3,371	42,609.44	0.00
227	688255	凯尔达	1,648	42,370.08	0.00
228	688511	天微电子	1,490	42,345.80	0.00
229	301049	超越科技	1,954	41,170.78	0.00
230	301041	金百泽	2,150	41,129.50	0.00
231	301219	腾远钴业	578	39,841.54	0.00
232	300948	冠中生态	3,229	39,781.28	0.00
233	301033	迈普医学	1,076	39,682.88	0.00
234	688622	禾信仪器	1,204	39,130.00	0.00
235	300920	润阳科技	2,503	38,871.59	0.00
236	301027	华蓝集团	2,856	38,556.00	0.00
237	605589	圣泉集团	1,750	37,432.50	0.00
238	301072	中捷精工	1,802	36,941.00	0.00
239	301206	三元生物	945	36,855.00	0.00
240	688217	睿昂基因	1,040	36,764.00	0.00
241	688607	康众医疗	1,890	35,815.50	0.00
242	301068	大地海洋	1,436	35,268.16	0.00
243	600955	维远股份	1,694	35,184.38	0.00
244	001338	永顺泰	1,649	34,826.88	0.00
245	300973	立高食品	360	34,624.80	0.00
246	301037	保立佳	2,115	33,988.05	0.00
247	301036	双乐股份	2,047	33,939.26	0.00
248	688679	通源环境	3,139	33,932.59	0.00
249	301211	亨迪药业	967	33,506.55	0.00
250	605020	永和股份	850	33,388.00	0.00
251	001258	立新能源	3,188	33,346.48	0.00
252	300995	奇德新材	1,909	33,044.79	0.00

253	301007	德迈仕	3,022	32,879.36	0.00
254	003021	兆威机电	680	32,687.60	0.00
255	301050	雷电微力	419	32,334.23	0.00
256	301268	铭利达	641	32,184.61	0.00
257	301216	万凯新材	1,120	32,121.60	0.00
258	605338	巴比食品	1,012	32,110.76	0.00
259	605507	国邦医药	1,202	31,816.94	0.00
260	605090	九丰能源	1,526	31,511.90	0.00
261	688328	深科达	1,499	30,969.34	0.00
262	300854	中兰环保	2,026	30,957.28	0.00
263	688565	力源科技	3,450	30,567.00	0.00
264	300860	锋尚文化	578	30,073.34	0.00
265	600927	永安期货	1,859	29,967.08	0.00
266	001227	兰州银行	7,868	29,662.36	0.00
267	688395	正弦电气	1,627	29,383.62	0.00
268	300869	康泰医学	862	28,075.34	0.00
269	601665	齐鲁银行	6,731	28,068.27	0.00
270	301090	华润材料	2,764	27,805.84	0.00
271	688367	工大高科	1,717	27,162.94	0.00
272	601089	福元医药	1,749	26,812.17	0.00
273	601022	宁波远洋	1,983	26,770.50	0.00
274	688092	爱科科技	1,137	26,401.14	0.00
275	603071	物产环能	1,627	26,324.86	0.00
276	301150	中一科技	404	26,062.04	0.00
277	605337	李子园	1,103	25,843.29	0.00
278	301079	邵阳液压	1,396	25,560.76	0.00
279	603191	望变电气	1,149	25,530.78	0.00
280	688038	中科通达	2,132	25,349.48	0.00
281	300900	广联航空	879	25,253.67	0.00
282	003029	吉大正元	716	25,246.16	0.00
283	001213	中铁特货	5,818	25,133.76	0.00
284	605286	同力日升	597	25,115.79	0.00
285	003009	中天火箭	623	24,577.35	0.00
286	688272	富吉瑞	1,263	24,502.20	0.00
287	001322	箭牌家居	1,595	24,244.00	0.00
288	688681	科汇股份	1,899	24,231.24	0.00
289	688067	爱威科技	1,259	23,581.07	0.00
290	601921	浙版传媒	3,154	23,339.60	0.00
291	605060	联德股份	883	22,790.23	0.00
292	300887	谱尼测试	680	22,174.80	0.00
293	001318	阳光乳业	1,142	21,926.40	0.00
294	603255	鼎际得	488	21,911.20	0.00
295	600935	华塑股份	4,811	21,649.50	0.00

296	603209	兴通股份	595	21,610.40	0.00
297	300873	海晨股份	774	21,014.10	0.00
298	605167	利柏特	2,471	20,805.82	0.00
299	301117	佳缘科技	262	20,776.60	0.00
300	001308	康冠科技	667	20,703.68	0.00
301	300981	中红医疗	1,082	20,319.96	0.00
302	003038	鑫铂股份	460	20,276.80	0.00
303	300872	天阳科技	1,568	20,274.24	0.00
304	001205	盛航股份	808	19,812.16	0.00
305	605339	南侨食品	863	19,633.25	0.00
306	001215	千味央厨	295	19,340.20	0.00
307	688701	卓锦股份	2,340	19,211.40	0.00
308	001323	慕思股份	573	18,977.76	0.00
309	001228	永泰运	383	18,962.33	0.00
310	001236	弘业期货	1,399	18,956.45	0.00
311	300871	回盛生物	927	18,910.80	0.00
312	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
313	605555	德昌股份	917	18,615.10	0.00
314	605296	神农集团	740	18,522.20	0.00
315	003012	东鹏控股	2,278	17,905.08	0.00
316	003039	顺控发展	1,024	17,315.84	0.00
317	603057	紫燕食品	549	17,277.03	0.00
318	300909	汇创达	579	17,254.20	0.00
319	003002	壶化股份	921	16,946.40	0.00
320	300893	松原股份	621	16,704.90	0.00
321	603235	天新药业	572	16,656.64	0.00
322	001339	智微智能	812	16,516.08	0.00
323	603051	鹿山新材	272	16,295.52	0.00
324	001217	华尔泰	1,239	16,206.12	0.00
325	605133	嵘泰股份	618	16,197.78	0.00
326	603211	晋拓股份	1,286	16,152.16	0.00
327	001216	华瓷股份	1,177	16,066.05	0.00
328	603132	金徽股份	1,342	16,063.74	0.00
329	300996	普联软件	385	15,804.25	0.00
330	300982	苏文电能	317	15,628.10	0.00
331	003016	欣贺股份	1,681	15,431.58	0.00
332	603170	宝立食品	542	15,354.86	0.00
333	301073	君亭酒店	216	15,141.60	0.00
334	605368	蓝天燃气	1,204	14,869.40	0.00
335	301069	凯盛新材	539	14,865.62	0.00
336	605268	王力安防	1,642	14,449.60	0.00
337	605208	永茂泰	1,081	14,420.54	0.00
338	301248	杰创智能	472	14,386.56	0.00

339	003037	三和管桩	1,274	14,345.24	0.00
340	300986	志特新材	369	14,298.75	0.00
341	300911	亿田智能	309	14,257.26	0.00
342	003042	中农联合	546	14,206.92	0.00
343	601528	瑞丰银行	2,230	14,071.30	0.00
344	301097	天益医疗	249	14,063.52	0.00
345	003030	祖名股份	480	13,977.60	0.00
346	605598	上海港湾	553	13,769.70	0.00
347	603070	万控智造	775	13,640.00	0.00
348	605016	百龙创园	623	13,500.41	0.00
349	603176	汇通集团	1,924	13,333.32	0.00
350	301149	隆华新材	1,214	13,232.60	0.00
351	300925	法本信息	1,020	13,209.00	0.00
352	603130	云中马	480	13,176.00	0.00
353	001317	三羊马	300	12,840.00	0.00
354	003025	思进智能	616	12,800.48	0.00
355	603230	内蒙新华	1,140	12,574.20	0.00
356	001256	炜冈科技	474	12,390.36	0.00
357	001333	光华股份	426	12,332.70	0.00
358	300997	欢乐家	928	12,064.00	0.00
359	301151	冠龙节能	703	11,958.03	0.00
360	001300	三柏硕	763	11,826.50	0.00
361	605162	新中港	1,377	11,814.66	0.00
362	603836	海程邦达	733	11,698.68	0.00
363	001299	美能能源	576	11,635.20	0.00
364	001313	粤海饲料	1,232	11,580.80	0.00
365	301258	富士莱	295	11,578.75	0.00
366	605056	咸亨国际	933	11,391.93	0.00
367	001331	胜通能源	385	11,330.55	0.00
368	603151	邦基科技	535	11,256.40	0.00
369	301015	百洋医药	462	11,014.08	0.00
370	300891	惠云钛业	1,143	11,007.09	0.00
371	300918	南山智尚	1,063	10,927.64	0.00
372	001206	依依股份	449	10,919.68	0.00
373	301221	光庭信息	280	10,894.80	0.00
374	001319	铭科精技	536	10,843.28	0.00
375	001238	浙江正特	374	10,797.38	0.00
376	001222	源飞宠物	434	10,758.86	0.00
377	300876	蒙泰高新	350	10,755.50	0.00
378	603112	华翔股份	920	10,718.00	0.00
379	603213	镇洋发展	799	10,562.78	0.00
380	001218	丽臣实业	490	10,422.30	0.00
381	605365	立达信	645	10,371.60	0.00

382	300895	铜牛信息	373	10,343.29	0.00
383	605228	神通科技	1,217	10,320.16	0.00
384	605122	四方新材	703	10,320.04	0.00
385	605028	世茂能源	615	10,313.55	0.00
386	300884	狄耐克	1,047	10,281.54	0.00
387	605058	澳弘电子	548	10,220.20	0.00
388	605289	罗曼股份	474	10,124.64	0.00
389	601279	英利汽车	2,004	10,060.08	0.00
390	301017	漱玉平民	555	9,984.45	0.00
391	605599	菜百股份	980	9,976.40	0.00
392	605566	福莱茵特	435	9,952.80	0.00
393	300864	南大环境	535	9,897.50	0.00
394	300932	三友联众	689	9,887.15	0.00
395	605259	绿田机械	295	9,885.45	0.00
396	605319	无锡振华	764	9,878.52	0.00
397	603097	江苏华辰	577	9,860.93	0.00
398	603182	嘉华股份	546	9,778.86	0.00
399	605567	春雪食品	629	9,705.47	0.00
400	001268	联合精密	409	9,697.39	0.00
401	001230	劲旅环境	375	9,671.25	0.00
402	605005	合兴股份	634	9,624.12	0.00
403	301009	可靠股份	801	9,612.00	0.00
404	300993	玉马遮阳	738	9,594.00	0.00
405	301108	洁雅股份	280	9,452.80	0.00
406	300881	盛德鑫泰	291	9,338.19	0.00
407	300968	格林精密	1,162	9,319.24	0.00
408	001207	联科科技	682	9,241.10	0.00
409	300940	南极光	491	9,166.97	0.00
410	001266	宏英智能	346	9,155.16	0.00
411	300877	金春股份	569	9,121.07	0.00
412	001219	青岛食品	353	9,100.34	0.00
413	300868	杰美特	593	9,055.11	0.00
414	603280	南方路机	363	8,893.50	0.00
415	002998	优彩资源	1,353	8,875.68	0.00
416	300962	中金辐照	576	8,784.00	0.00
417	300967	晓鸣股份	507	8,720.40	0.00
418	603511	爱慕股份	553	8,632.33	0.00
419	300882	万胜智能	572	8,602.88	0.00
420	605018	长华集团	840	8,601.60	0.00
421	603219	富佳股份	528	8,474.40	0.00
422	603215	比依股份	575	8,423.75	0.00
423	003001	中岩大地	560	8,288.00	0.00
424	300933	中辰股份	1,112	8,273.28	0.00

425	605488	福莱新材	603	8,056.08	0.00
426	001231	农心科技	355	8,037.20	0.00
427	003004	声迅股份	306	8,020.26	0.00
428	605011	杭州热电	525	7,990.50	0.00
429	300892	品渥食品	272	7,969.60	0.00
430	001288	运机集团	537	7,969.08	0.00
431	001210	金房节能	311	7,939.83	0.00
432	605580	恒盛能源	654	7,893.78	0.00
433	605189	富春染织	422	7,798.56	0.00
434	605138	盛泰集团	723	7,779.48	0.00
435	001296	长江材料	403	7,745.66	0.00
436	300966	共同药业	286	7,722.00	0.00
437	001234	泰慕士	333	7,675.65	0.00
438	603272	联翔股份	443	7,646.18	0.00
439	301021	英诺激光	290	7,479.10	0.00
440	300926	博俊科技	359	7,477.97	0.00
441	300614	百川畅银	329	7,425.53	0.00
442	003041	真爱美家	419	7,374.40	0.00
443	605033	美邦股份	423	7,241.76	0.00
444	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
445	300937	药易购	244	7,041.84	0.00
446	300945	曼卡龙	474	7,034.16	0.00
447	603048	浙江黎明	464	6,927.52	0.00
448	605055	迎丰股份	1,146	6,921.84	0.00
449	605303	园林股份	610	6,612.40	0.00
450	605298	必得科技	508	6,548.12	0.00
451	301279	金道科技	296	6,517.92	0.00
452	603150	万朗磁塑	250	6,492.50	0.00
453	300927	江天化学	391	6,435.86	0.00
454	301011	华立科技	227	6,335.57	0.00
455	300952	恒辉安防	340	6,317.20	0.00
456	300889	爱克股份	479	6,131.20	0.00
457	001209	洪兴股份	450	6,102.00	0.00
458	300814	中富电路	328	5,923.68	0.00
459	301002	崧盛股份	261	5,872.50	0.00
460	605577	龙版传媒	588	5,844.72	0.00
461	300987	川网传媒	391	5,841.54	0.00
462	300950	德固特	328	5,710.48	0.00
463	300963	中洲特材	368	5,586.24	0.00
464	300991	创益通	406	5,464.76	0.00
465	301055	张小泉	355	5,403.10	0.00
466	300998	宁波方正	201	5,089.32	0.00
467	300956	英力股份	371	5,015.92	0.00



468	300971	博亚精工	245	4,848.55	0.00
469	300943	春晖智控	382	4,610.74	0.00
470	300975	商络电子	738	4,546.08	0.00
471	300931	通用电梯	672	4,428.48	0.00
472	300886	华业香料	191	4,161.89	0.00
473	301025	读客文化	403	4,082.39	0.00
474	300960	通业科技	234	3,987.36	0.00
475	300992	泰福泵业	200	3,590.00	0.00
476	300929	华骐环保	293	3,325.55	0.00
477	301053	远信工业	155	3,144.95	0.00
478	300627	华测导航	100	2,780.00	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	603035	常熟汽饰	142,346,947.33	4.22
2	601111	中国国航	141,739,496.74	4.20
3	601788	光大证券	120,990,083.85	3.58
4	600487	亨通光电	120,922,767.81	3.58
5	002594	比亚迪	111,236,532.99	3.30
6	300750	宁德时代	104,821,139.10	3.11
7	002466	天齐锂业	94,529,401.56	2.80
8	601155	新城控股	93,688,485.39	2.78
9	600732	爱旭股份	92,418,233.43	2.74
10	300627	华测导航	81,793,019.80	2.42
11	600383	金地集团	80,291,434.74	2.38
12	603366	日出东方	78,506,046.61	2.33
13	600699	均胜电子	75,961,979.41	2.25
14	002284	亚太股份	74,829,116.08	2.22
15	300207	欣旺达	73,325,085.79	2.17
16	300919	中伟股份	72,216,771.79	2.14
17	300587	天铁股份	72,058,042.91	2.13
18	300776	帝尔激光	71,635,339.44	2.12
19	002050	三花智控	70,574,845.30	2.09
20	300724	捷佳伟创	69,226,425.75	2.05
21	600603	广汇物流	67,936,700.00	2.01

22	000402	金融街	67,343,564.23	2.00
----	--------	-----	---------------	------

#### 8.4.2 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	002466	天齐锂业	179,328,048.44	5.31
2	601111	中国国航	161,708,602.44	4.79
3	603035	常熟汽饰	142,957,838.17	4.24
4	601788	光大证券	123,327,137.42	3.65
5	002594	比亚迪	103,660,177.85	3.07
6	300627	华测导航	97,839,914.47	2.90
7	300750	宁德时代	91,355,329.38	2.71
8	600048	保利发展	87,631,973.37	2.60
9	300776	帝尔激光	83,980,315.72	2.49
10	002192	融捷股份	80,285,909.17	2.38
11	688005	容百科技	79,016,706.25	2.34
12	603366	日出东方	75,753,009.00	2.24
13	002050	三花智控	74,851,409.89	2.22
14	300724	捷佳伟创	74,797,702.21	2.22
15	300014	亿纬锂能	74,223,166.65	2.20
16	688599	天合光能	73,063,760.25	2.16
17	600603	广汇物流	72,801,846.98	2.16
18	600487	亨通光电	68,860,513.71	2.04
19	002284	亚太股份	66,423,992.37	1.97
20	002129	TCL 中环	66,054,133.55	1.96

#### 8.4.3 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	6,309,882,200.17
卖出股票收入（成交）总额	6,253,533,543.67

#### 8.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	836,550,272.33	34.72
	其中：政策性金融债	131,265,838.36	5.45
4	企业债券	60,971,764.38	2.53
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	173,969,909.05	7.22
7	可转债（可交换债）	553,920,200.42	22.99
8	同业存单	374,749,422.15	15.56
9	其他	-	-
10	合计	2,000,161,568.33	83.03

#### 8.6 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	1828011	18 中国银行二级 02	1,800,000.00	184,625,773.15	7.66
2	110075	南航转债	1,183,670.00	159,206,663.35	6.61
3	1828002	18 农业银行二级 01	1,000,000.00	103,568,602.74	4.30
4	163731	20 光证 G3	1,000,000.00	101,839,260.27	4.23
5	163903	20 海通 08	1,000,000.00	101,646,389.04	4.22

#### 8.7 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。

#### 8.8 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。

**8.9 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。

**8.10 本基金投资股指期货的投资政策**

无。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

无。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国农业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的杭州银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会深圳监管局、中国人民银行杭州市中心支行的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国进出口银行在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期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。

**8.12.2** 本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。

**8.12.3 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	1,309,125.87
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,309,125.87

#### 8.12.4 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	110068	龙净转债	23,021,931.35	0.96
2	110075	南航转债	159,206,663.35	6.61
3	110079	杭银转债	11,620,372.60	0.48
4	110082	宏发转债	3,272,436.99	0.14
5	113049	长汽转债	10,289,105.94	0.43
6	113053	隆 22 转债	16,003,154.52	0.66
7	113055	成银转债	37,096,098.75	1.54
8	113534	鼎胜转债	1,420,239.04	0.06
9	113641	华友转债	3,362,346.87	0.14
10	118005	天奈转债	177,421.11	0.01
11	123075	贝斯转债	3,163,794.01	0.13
12	123078	飞凯转债	790,597.54	0.03
13	123085	万顺转 2	7,569,928.66	0.31
14	123121	帝尔转债	21,743,764.42	0.90
15	127027	靖远转债	11,608,821.92	0.48
16	127030	盛虹转债	50,103,183.83	2.08
17	127036	三花转债	60,260,679.65	2.50
18	127037	银轮转债	19,039,773.74	0.79
19	127050	麒麟转债	36,283,852.50	1.51
20	128023	亚太转债	7,819,135.50	0.32

21	128087	孚日转债	2,415,986.30	0.10
22	128095	恩捷转债	40,477,665.22	1.68
23	128101	联创转债	1,404,892.09	0.06

### 8.12.5 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无流通受限情况。

### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 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
金鹰民安回报定开 A	11,496	177,130.45	0.00	0.00%	2,036,291,606.99	100.00%
金鹰民安回报定开 C	1,421	142,953.54	0.00	0.00%	203,136,983.81	100.00%
合计	12,917	173,370.64	0.00	0.00%	2,239,428,590.80	100.00%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

### 9.3 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	金鹰民安回报定开 A	1,098,419.53	0.05%
	金鹰民安回报定开 C	134,679.86	0.07%
	合计	1,233,099.39	0.06%

#### 9.4 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	金鹰民安回报定开 A	0~10
	金鹰民安回报定开 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰民安回报定开 A	10~50
	金鹰民安回报定开 C	0
	合计	10~50

#### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

#### §10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰民安回报定开 A	金鹰民安回报定开 C
本报告期期初基金份额总额	2,605,379,902.96	269,537,430.08
本报告期基金总申购份额	13,454,810.15	4,955,208.10
减：本报告期基金总赎回份额	582,543,106.12	71,355,654.37
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,036,291,606.99	203,136,983.81

#### §11 重大事件揭示

##### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

## 11.2 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、2022 年 3 月 5 日，王铁先生离任公司董事长，姚文强先生离任公司总经理并担任公司董事长，周蔚女士离任公司常务副总经理并担任公司总经理。2022 年 3 月 19 日，公司法定代表人由王铁先生变更为姚文强先生，姚文强先生离任公司首席信息官，刘盛先生离任公司督察长并担任公司副总经理兼首席信息官，凡湘平先生担任督察长。截至报告日，姚文强先生担任公司董事长、法定代表人，周蔚女士担任公司总经理，耿源先生担任公司副总经理，牟敦国先生担任公司副总经理，刘盛先生担任公司副总经理兼首席信息官，凡湘平先生担任公司督察长。

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

## 11.5 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。

## 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），已连续为本基金提供 4 年审计服务。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 45000 元。

## 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.7.1 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。

### 11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中未受到相关监管部门稽查或处罚。



## 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.8.1 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	占当期股票成交总额的比 例	佣金	占当期佣金总量的 比例	
长江证券	2	3,753,125,632.95	30.12%	2,700,198.20	29.00%	-
国金证券	2	2,908,281,264.47	23.34%	2,097,784.02	22.53%	新增 2 个
东吴证券	1	1,667,145,197.58	13.38%	1,196,990.14	12.86%	-
太平洋证券	2	1,510,203,669.41	12.12%	1,385,324.56	14.88%	-
东兴证券	4	861,014,274.04	6.91%	621,054.51	6.67%	新增 2 个
西部证券	1	736,737,449.87	5.91%	531,408.36	5.71%	新增 1 个
财通证券	1	504,181,608.23	4.05%	363,667.63	3.91%	新增 1 个
第一创业证券	1	221,365,689.36	1.78%	159,680.17	1.72%	新增 1 个
民生证券	2	190,822,188.50	1.53%	175,805.22	1.89%	-
东北证券	1	107,792,115.08	0.87%	77,752.28	0.84%	新增 1 个
五矿证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	1	-	-	-	-	-

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元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、个股分析报告及丰富全面的信息；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。

### 11.8.2 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
长江证券	162,879,746.33	7.21%	14,319,500,000.00	20.92%	-	-
国金证券	848,767,246.79	37.56%	11,144,000,000.00	16.28%	-	-
东吴证券	595,172,292.33	26.34%	17,851,300,000.00	26.08%	-	-
太平洋证券	273,884,191.73	12.12%	12,370,800,000.00	18.07%	-	-
东兴证券	77,850,911.69	3.45%	1,130,000,000.00	1.65%	-	-
西部证券	106,994,475.83	4.74%	7,362,000,000.00	10.76%	-	-
财通证券	129,493,128.26	5.73%	129,000,000.00	0.19%	-	-
第一创业证券	8,772,654.30	0.39%	100,000,000.00	0.15%	-	-
民生证券	25,844,889.45	1.14%	145,000,000.00	0.21%	-	-
东北证券	29,982,088.08	1.33%	3,897,200,000.00	5.69%	-	-

### 11.9 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旗下部分基金新增上海利得基金销售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	2022-01-06
2	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年四季度报告	证监会规定媒介	2022-01-24
3	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2021 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-01-24
4	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增德邦证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务的公告	证监会规定媒介	2022-01-28
5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增宁	证监会规定媒介	2022-02-15

	波银行股份有限公司同业易管家平台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		
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国信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	2022-03-01
7	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与阳光人寿保险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	2022-03-01
8	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
9	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
10	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2022-03-05
11	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-05
12	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与西部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	2022-03-10
13	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增北京创金启富基金销售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	2022-03-16
14	金鹰基金管理有限公司关于公司法定代表人变更的公告	证监会规定媒介	2022-03-19
15	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
16	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
17	金鹰基金管理有限公司基金行业高级管理人员变更公告	证监会规定媒介	2022-03-19
18	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增中信证券等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	2022-03-21
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海陆享基金销售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	2022-03-25
20	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2021 年年度报告	证监会规定媒介	2022-03-30
21	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-03-30
22	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富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	2022-04-13

23	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年一季度报告	证监会规定媒介	2022-04-22
24	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-04-22
25	金鹰基金管理有限公司关于董事变更的公告	证监会规定媒介	2022-05-21
26	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 A 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-06-02
27	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 C 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-06-02
28	金鹰基金管理有限公司基金管理人住所变更公告	证监会规定媒介	2022-06-08
29	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 C 类份额基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2022-06-02
30	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增华宝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	2022-07-05
31	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年二季度报告	证监会规定媒介	2022-07-21
32	金鹰基金管理有限公司旗下全部基金 2022 年第二季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-07-21
33	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年中期报告	证监会规定媒介	2022-08-30
34	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-08-30
35	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增招商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	2022-08-31
36	金鹰基金管理有限公司金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金开放日常申购(赎回、转换)业务公告	证监会规定媒介	2022-09-23
37	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金 2022 年三季度报告	证监会规定媒介	2022-10-26
38	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第三季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2022-10-26
39	金鹰基金管理有限公司关于终止深圳信诚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	2022-11-15
40	金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2022-12-29

注：相关信息披露文件可登录本基金管理人网站查询。

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰民安回报一年定期开放混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰民安回报一年定期开放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、营业执照、公司章程。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在中国证监会规定媒介上公开披露的基金份额净值、季度报告、更新的招募说明书及其他临时公告。

### 13.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 13.3 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

二〇二三年三月三十日