

# 金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

## 2023 年中期报告

### 2023 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## §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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 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.....	6
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> .....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	15
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.....	15
<b>§5 托管人报告</b> .....	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	15
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.....	15
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.....	15
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	16
6.1 资产负债表.....	16
6.2 利润表.....	17
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	20
<b>§7 投资组合报告</b> .....	39
7.1 期末基金资产组合情况.....	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	40
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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	42
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	44
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	45
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	45
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	45
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	45
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	45
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	45

7.12 投资组合报告附注 .....	45
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>46</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	46
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	47
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	47
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 .....	47
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	47
§9 开放式基金份额变动 .....	47
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>48</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	48
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	48
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	48
10.4 基金投资策略的改变 .....	48
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	48
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	48
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 .....	48
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	49
10.9 其他重大事件 .....	51
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>53</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	53
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	54
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>54</b>
12.1 备查文件目录 .....	54
12.2 存放地点 .....	54
12.3 查阅方式 .....	54

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）	
基金简称	金鹰先进制造股票（LOF）	
场内简称	金鹰先进制造	
基金主代码	162107	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 1 月 11 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	13,664,953.79 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰先进制造股票（LOF） A	金鹰先进制造股票（LOF） C
下属分级基金的交易代码	162107	013479
报告期末下属分级基金的份额总额	8,069,373.78 份	5,595,580.01 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，通过精选股票和严格的风险控制，力争实现超过业绩比较基准的长期回报。
投资策略	本基金在主要投向于“先进制造”主题公司的前提下，通过定量与定性相结合的方法精选具有核心竞争力、未来成长空间大、持续经营能力强的优质股票；“先进制造”主题相关行业是指推动制造业升级和新兴产业发展所需的行业，具有技术先进、知识密集、信息密集等特征，具备较高技术附加值、能够引领产业发展方向的产业。
业绩比较基准	中证高端装备制造指数收益率*60%+中证港股通综合指数收益率*20%+中债总财富（总值）指数收益率*20%
风险收益特征	本基金为股票型证券投资基金，其预期收益及风险水平高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险，包括港股市场股价波动较大的风险（港股市场实行 T+0 回转交易，且对个股不设涨跌幅限制，港股股价可能表现出比 A 股更为剧烈的股价波动）、汇率风险（汇率波动可能对基金的投资收益造成损失）、港股通机制下交易日不连贯可能带来的风险（在内地开市香港休市的情形下，港股通不能正常交易，港股不能及时卖出，可能带来一定的流动性风险）等。

## 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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	陆志俊
	联系电话	020-83936180	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街 2号3212房	中国（上海）自由贸易试验区 银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18 号
邮政编码		510623	200336
法定代表人		姚文强	任德奇

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京西城区太平大街 17 号
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

注：本基金 A 类份额注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，C 类份额注册登记机构为金鹰基金管理有限公司。

## §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（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	金鹰先进制造股票（LOF）A	金鹰先进制造股票（LOF）C
本期已实现收益	-576,031.99	-271,359.70
本期利润	-415,286.90	-172,274.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0519	-0.0429
本期加权平均净值利润率	-6.43%	-5.41%
本期基金份额净值增长率	-6.06%	-6.24%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	金鹰先进制造股票（LOF）A	金鹰先进制造股票（LOF）C
期末可供分配利润	-5,649,061.99	-3,942,326.74
期末可供分配基金份额利润	-0.7001	-0.7045
期末基金资产净值	6,417,452.70	4,423,752.03
期末基金份额净值	0.7953	0.7906
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	金鹰先进制造股票（LOF）A	金鹰先进制造股票（LOF）C
基金份额累计净值增长率	-25.59%	-26.03%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、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、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、本基金合同于 2022 年 1 月 11 日生效，故本基金上年度可比期间为 2022 年 1 月 11 日至 2022 年 6 月 30 日（下同）。

## 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

金鹰先进制造股票（LOF）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
过去一个月	3.03%	1.36%	3.48%	0.83%	-0.45%	0.53%
过去三个月	-1.18%	1.22%	-1.22%	0.79%	0.04%	0.43%

过去六个月	-6.06%	1.25%	2.89%	0.77%	-8.95%	0.48%
过去一年	-16.58%	1.48%	-9.89%	0.92%	-6.69%	0.56%
自基金合同生效起至今	-25.59%	1.67%	-14.66%	1.13%	-10.93%	0.54%

## 金鹰先进制造股票（LOF）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
过去一个月	3.00%	1.36%	3.48%	0.83%	-0.48%	0.53%
过去三个月	-1.27%	1.22%	-1.22%	0.79%	-0.05%	0.43%
过去六个月	-6.24%	1.25%	2.89%	0.77%	-9.13%	0.48%
过去一年	-16.91%	1.48%	-9.89%	0.92%	-7.02%	0.56%
自基金合同生效起至今	-26.03%	1.67%	-14.66%	1.13%	-11.37%	0.54%

注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于 2022 年 1 月 11 日转型而来；

2、业绩比较基准：中证高端装备制造指数收益率\*60%+中证港股通综合指数收益率\*20%+中债总财富（总值）指数收益率\*20%；

3、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 3.2.2 自基金转型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

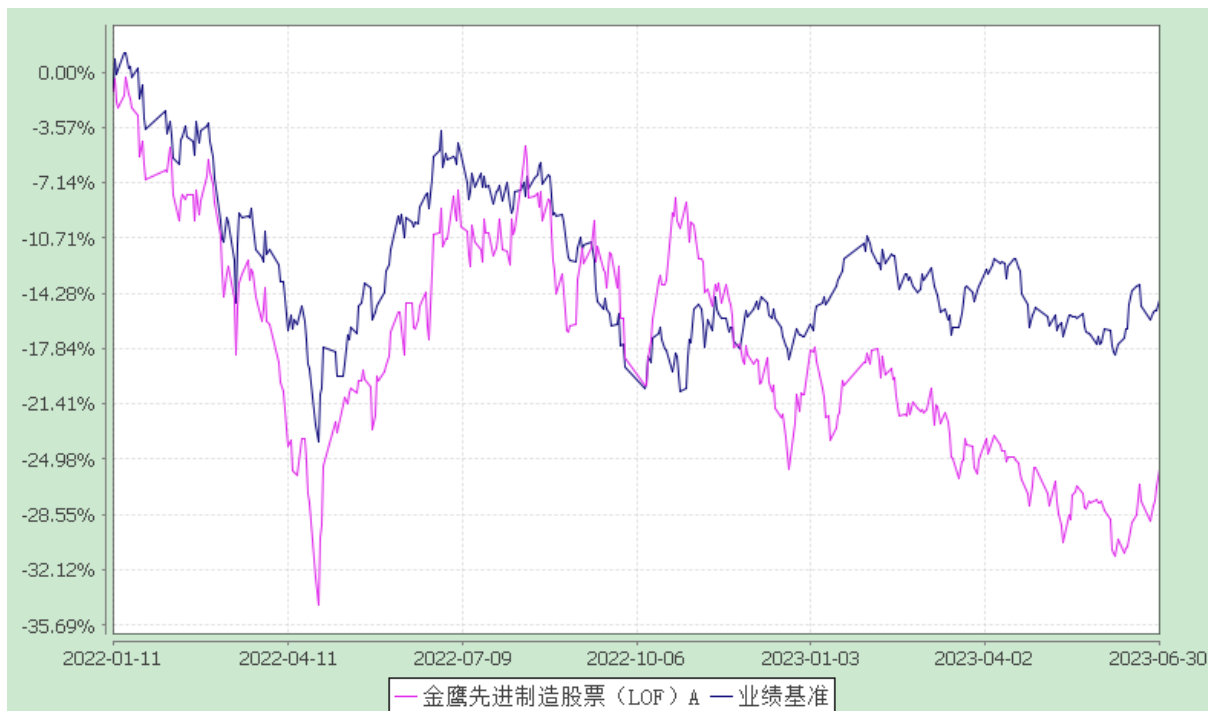
金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

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

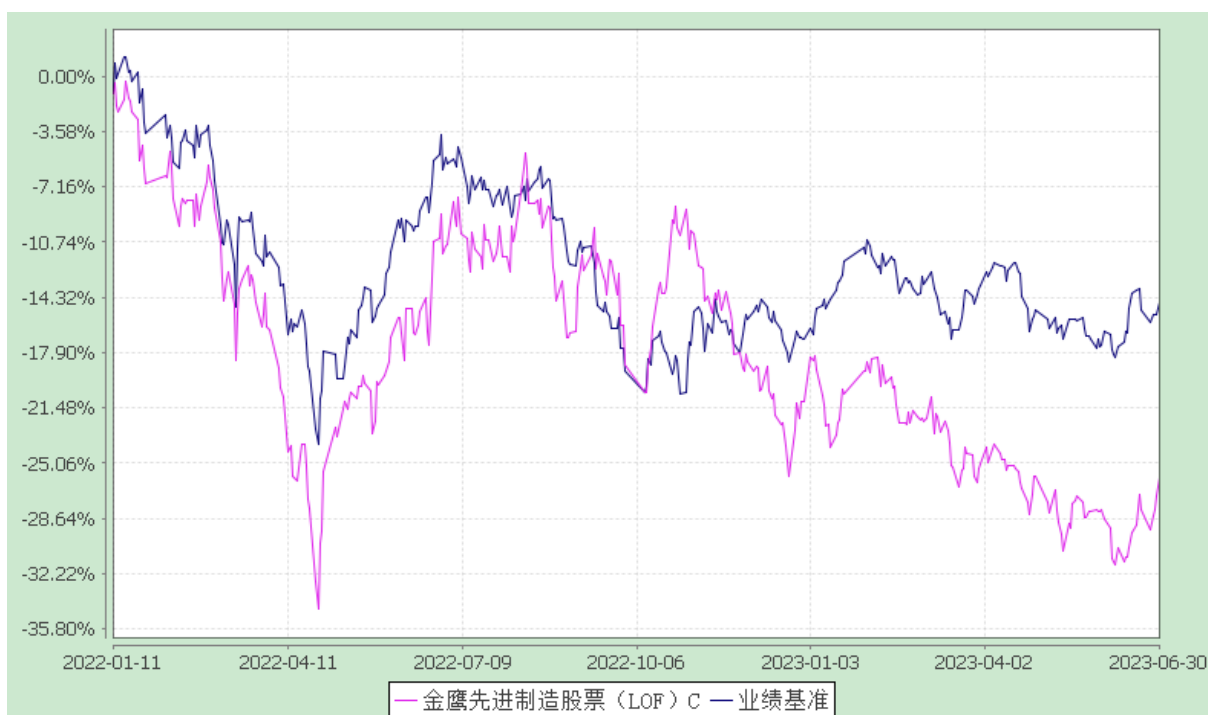
（2022 年 1 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日）

金鹰先进制造股票（LOF）A





### 金鹰先进制造股票（LOF）C



- 注：1、本基金由原金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）于 2022 年 1 月 11 日转型而来；
- 2、业绩比较基准： $\text{中证高端装备制造指数收益率} \times 60\% + \text{中证港股通综合指数收益率} \times 20\% + \text{中债总财富（总值）指数收益率} \times 20\%$ ；
- 3、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本基金建仓期结束时，本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关

约定。

## §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 63 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	2022-01-11	-	27	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。

梁梓颖	本基金的基金经理	2022-06-18	-	8	梁梓颖女士，英国华威大学商学院金融专业硕士，2015 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，担任行业研究员职务，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。

3、本基金基金经理梁梓颖女士因休产假，于 2023 年 4 月 3 日起暂离工作岗位，拟于 2023 年 9 月 28 日回岗履职。在其休假期间，本基金由同为基金经理的杨刚先生继续进行管理。该事项已于 2023 年 3 月 30 日进行了披露。

#### 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、《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》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，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从疫后修复到主题投资的较大风格切换。

实际从 2022 年四季度后半段疫情防控政策出现重大调整之后，A 股市场就进入到疫后修复期的较强预判和风格演绎之中，其间并伴随着外资的再度较显著净流入，这样的风格表现一直持续到春节前后。但在因 3 年疫情而产生的“积压能量”一次性释放之后，A 股市场也迅速由“强预期弱现实”的交易而迈向了“弱预期弱现实”的阶段。持续披露的各方面重要宏观金融数据，不断展现出国内经济复苏动能仍然偏弱、内需修复程度相对偏慢的现实场景，并导致 A 股参与者们的乐观预期快速转向了谨慎。存量甚至减量博弈的资金状态，主宰了 A 股上半年的主要时段。

上证指数、沪深 300 及创业板指上半年涨幅分别为 3.65%、-0.75%和-5.61%。申万一级行业方面：TMT 板块表现亮眼，通信、传媒、计算机雄踞上半年 A 股行业涨幅榜前三甲，半年度涨幅分别达到 50.66%、42.76%和 27.57%，此外，排名相对靠前的机械、家电和电子也均有 10 个百分点以上的不等涨幅；涨跌幅榜排名垫底的则清一色为主要偏内需及地产链条方向的商贸、地产、美护、建材、农业、食饮等，半年度跌幅大多在 10-20 个点之间，跌幅最大的商贸行业，上半年累计跌幅达 23.44%。

与 A 股市场尚在疫后修复期艰难行进的状态迥异，海外市场今年上半年大多表现不错。其中，纳斯达克指数、日经 225 指数和意大利富时指数累计涨幅分别为 31.73%、27.19%和 19.08%。此外，COMEX 黄金及美元兑离岸人民币汇率分别升 5.56%和 5.01%，也引发较多的关注。

总体看，或至少有以下两大原因，导致今年上半年国际不同重要市场间产生较大分化：其一是年初市场达成共识的今年中美经济/政策错位走向的基本判断——即中国将确定性迈向疫后修复而美国将大概率由滞胀走向衰退——在实际过程中已逐步转变为中国经济的相对慢复苏和美国经济较强韧性下的衰退预期迟迟未兑现；其二或与大国间的复杂博弈场景下，相当部分低风险偏好的国际资金（尤其欧美资金）流向变化有较大关联。

今年以来，在国内经济修复相对较弱、A 股尚难有系统性机会的背景下，以存量资金博弈为主要特征的主题驱动行情风生水起，人工智能和中特估成为其中最耀眼的光环。至二季度，市场主题虽开始呈现出新的阶段性变化，但存量资金仍主要在上述主题中持续寻找可能机会。

上半年，A 股申万军工指数上涨 6.76%，在 31 个申万一级行业指数中表现不错，但板块内差异显著。其中，船舶、卫星及重要重组类品种表现突出并对行业指数有重要贡献，但军工白马类优质品种普遍表现不尽人意。军工上市企业较普遍的短期业绩弱于市场预期，以及如十四五中后期订单

增速会否下滑、部分军品会否有较大降价压力及军工企业部分税收项的缴纳调整会否带来较大负面影响等诸多负面因素的普遍担忧，导致机构投资者对军工股的持仓一度出现较明显的减配并在优质板块股价层面体现出较明显压力。不过，在二季度临近尾声阶段，随着市场对军工板块十四五中期规划调整乐观预期的不断上升、对军工国企改革预期的再度升温及预期人事调整的逐渐到位等，A 股存量博弈的市场格局下，军工板块的受关注程度重新开始提高，机构增配迹象有所体现。

报告期内，本产品继续坚持以行业基本面研究为先的投资原则，在中期视角的基础上，重点布局了一些暂被市场短期忽视但企业基本面仍然优秀、风险收益比逐步占优的白马品种。我们始终坚信，随着市场风格的继续演绎和不断变化，在军工行业景气度仍大概率向上的前提下，优质的白马龙头终将有望获取更丰厚的行业红利。这其中，航天航空板块为本产品组合当期新增的投资重点，而部分可能受益于国企改革红利和订单有望出现快速增长的潜质品种，也成为我们的重点关注方向。

特别需要强调的是，正如我们在过去几期季报中反复阐述的观点，对于 A 股军工板块的发展前景，我们始终抱有坚定的信心。我们坚持认为，百年未有之大变局之下，大国博弈的日趋尖锐复杂和逆全球化态势的愈演愈烈，已迅速凸显出各国对安全需求的重大关切。而俄乌冲突爆发及激烈战场演变的实景呈现，更强化了国内军工行业在新质新域方面的巨大新增需求。从军工上市企业过去几年的业绩表现看，这个板块已经跨越传统意义上的主题炒作时代而成为 A 股市场中新的成长方向的重要备选。

总体上，我们认为，随着投资者前期普遍担忧的军工行业系统性风险因素的逐步消退，特别是行业积极因素的不断催化，A 股军工板块正迎来越来越有利的投资时机。相对而言，中报窗口期内，行业中短期业绩的或为平淡、部分领域重大人事调整所带来的局部“干扰”等，或只是以“后视镜”方式对军工行业状况所做的表象评价。换言之，中短期更多受制于情绪影响所造成的股价波动，或更可能成为对该板块再度增配的良机。而长期看，无论国际局势是否出现阶段性缓和，保障国家整体安全的优先需求及全球军事科技正在快速进步的宏观大背景之下，A 股军工行业的朝阳特质和成长前景都值得持续重视。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 0.7953 元，本报告期份额净值增长率为-6.06%，同期业绩比较基准增长率为 2.89%；C 类基金份额净值为 0.7906 元，本报告期份额净值增长率为-6.24%，同期业绩比较基准增长率为 2.89%。

#### 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，结合国内外相关重要政策演进、国内经济预期走向及股市估值安全性

的纵横向对比看，A 股市场或较大概率进入一段相对可为的窗口期，权益投资可更积极。

海外经济看，美国经济软着陆概率有所提升，此轮快速加息过程将进入尾声，对全球其它重要市场的负面影响或有消减。新兴市场尤其前期受制诸多不利因素阻碍但基本面已开始展现一定改善迹象的表现“滞后”的市场，或将迎来股市风险偏好和上市公司业绩共振改善的曙光。

国内经济层面，我们预期 2023 年二季度至三季度可能是全年环比经济动能低点，下半年逐步进入向潜在增长中枢回归的弱复苏阶段。基建继续发力，消费温和修复，地产或有企稳。下半年，预计中国有望领先全球率先迎来补库拐点。

国内政策层面，已召开的 7 月重要会议上释放出多重积极讯号：经济形势判断上，已清晰表达对当前国内经济面临的困难挑战的足够认知；政策基调上，稳增长诉求有所增强；任务部署上，“扩内需”重新置于靠前位置；宏观政策上，重提“逆周期”表述并要求加强政策储备；总量和结构性货币工具、加快地方专项发行及进一步减税降费等具体政策措施可以期待，汇率稳定也得到监管层重视；“活跃资本市场”等以往类似的高级别会议上较少见的提法，也展现政策层对资本市场所表现出的充分关注；产业政策上，适时调整优化房地产政策；地方化债等前期市场较为担忧的风险点，亦有“一揽子”政策方案部署。

总体上看，预计国内权益市场下半年或将面临年内更为友好的时间窗。

在主要受到政策博弈驱动下的短期市场环境中，预计顺周期方向相对收益或更明显。而人事调整基本到位及十四五“中调”的水落石出，预计也将给军工板块带来新的行业催化。在市场中短期风格可能出现变化的过程中，我们将重点围绕相关上市公司中报信息披露及市场波动情况等做耐心观察和细致研究，并持续跟踪军工行业基本面的最新重要变化，适时优化投资组合，与军工优质企业共同成长，争取为投资者获取更好回报。

#### 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

本基金本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

报告期内，本基金资产净值已发生连续超过 60 个工作日低于 5000 万元的情形，本基金管理人已按法规要求向证监会报送解决方案。

### §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

2023 年上半年，基金托管人在先进制造股票型证券投资基金（LOF）的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

2023 年上半年，金鹰基金管理有限公司在先进制造股票型证券投资基金（LOF）投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

#### 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

2023 年上半年，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关先进制造股票型证券投资基金（LOF）的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投

资组合报告等内容真实、准确、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：金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	605,267.62	84,696.14
结算备付金		19,267.76	6,199.53
存出保证金		5,132.24	4,355.58
交易性金融资产	6.4.7.2	10,244,289.65	8,460,296.31
其中：股票投资		10,244,289.65	8,052,212.47
基金投资		-	-
债券投资		-	408,083.84
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		177,920.25	24,881.13
应收股利		-	-
应收申购款		10,100.59	1,387.87
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		11,061,978.11	8,581,816.56
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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		177,065.77	31,455.53
应付赎回款		11,166.46	2,886.09
应付管理人报酬		12,721.97	11,281.88



应付托管费		2,120.31	1,880.33
应付销售服务费		1,385.05	683.36
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	16,313.82	29,873.96
负债合计		220,773.38	78,061.15
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	13,664,953.79	10,053,921.38
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-2,823,749.06	-1,550,165.97
净资产合计		10,841,204.73	8,503,755.41
负债和净资产总计		11,061,978.11	8,581,816.56

注：截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 0.7953 元，A 类基金份额总额为 8,069,373.78 份；C 类基金份额净值为 0.7906 元，C 类基金份额总额为 5,595,580.01 份；基金份额总额为 13,664,953.79 份。

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 11 日（基 金合同生效日）至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-487,904.17	-685,525.06
1.利息收入		2,460.01	1,486.94
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,378.59	1,486.94
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		81.42	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-755,903.64	-1,222,441.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-788,595.00	-1,247,747.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-263.81	525.97
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	32,955.17	24,779.99
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	259,830.10	531,597.45
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	5,709.36	3,831.63
<b>减：二、营业总支出</b>		99,657.42	62,405.25
1. 管理人报酬		71,477.64	45,103.38
2. 托管费		11,912.97	7,517.24
3. 销售服务费		6,250.76	140.54
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	10,016.05	9,644.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-587,561.59</b>	<b>-747,930.31</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-587,561.59</b>	<b>-747,930.31</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>-587,561.59</b>	<b>-747,930.31</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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（基金净值）	10,053,921.38	-	-1,550,165.97	8,503,755.41
二、本期期初净资产（基金净值）	10,053,921.38	-	-1,550,165.97	8,503,755.41
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	3,611,032.41	-	-1,273,583.09	2,337,449.32
（一）、综合收益	-	-	-587,561.59	-587,561.59

总额				
（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）	3,611,032.41	-	-686,021.50	2,925,010.91
其中：1.基金申购款	6,226,713.97	-	-1,202,078.64	5,024,635.33
2.基金赎回款	-2,615,681.56	-	516,057.14	-2,099,624.42
（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）	13,664,953.79	-	-2,823,749.06	10,841,204.73
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 11 日（基金合同生效日）至 2022 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（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	688,720.14	-	474,172.42	7,361,373.82
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,195,482.08	-	-851,950.16	343,531.92
（一）、综合收益总额	-	-	-747,930.31	-747,930.31
（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）	1,195,482.08	-	-104,019.85	1,091,462.23
其中：1.基金申购款	2,324,649.43	-	-221,951.27	2,102,698.16
2.基金赎回款	-1,129,167.35	-	117,931.42	-1,011,235.93
（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）	8,082,683.48	-	-377,777.74	7,704,905.74

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：耿源，会计机构负责人：董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

金鹰中证 500 指数分级证券投资基金(简称"本基金")，经中国证券监督管理委员会（简称"中国证监会"）证监许可[2012]247 号文《关于核准金鹰中证 500 指数分级证券投资基金募集的批复》、基金部函[2012]458 号文《关于金鹰中证 500 指数分级证券投资基金备案确认的函》批准，于 2012 年 6 月 5 日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定。首次设立募集规模为 393,471,186.50 份，根据《基金合同》约定，其中场外募集资金及其利息确认金鹰 500 份额 341,051,468.50 份，场内募集资金及其利息按 1: 1 的比例确认金鹰 500A 份额 26,209,859.00 份和金鹰 500B 份额 26,209,859.00 份。

根据《关于准予金鹰中证 500 指数分级证券投资基金变更注册的批复》[证监许可(2016)984 号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。依据持有人大会决议公告，自金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金份额转换基准日的次日起，即 2016 年 8 月 25 日，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰中证 500 指数分级证券投资基金基金合同》同时失效。

根据《关于准予金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）变更注册的批复》[证监许可(2021)1993 号]，本基金以通讯方式召开本基金的基金份额持有人大会。依据持有人大会决议公告，自金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金份额转换基准日的次日起，即 2022 年 1 月 11 日，《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》生效，《金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）基金合同》同时失效。

本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

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（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、次级债、中期票据、

短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指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（但须符合中国证监会的相关规定）。

#### 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

除下述变更后的其他重要的会计政策和会计估计，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会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 其他重要的会计政策和会计估计

根据中国基金业协会中基协字 [2022] 566 号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下简称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

#### 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[2008]1号《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》、2008年9月18日《上海、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[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140号《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]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，主要税项列示如下：

1.证券投资基金(封闭式证券投资基金,开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税;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。2018年1月1日(含)以后,资管产品管理人(以下称管理人)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。

2.对证券投资基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入,股权的股息、红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不缴纳企业所得税。

3.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。

4.对基金取得的债券利息收入,由发行债券的企业在向基金支付上述收入时代扣代缴20%的个人所得税,暂不缴纳企业所得税。

5.对于基金从事A股买卖,出让方按0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税,对受让方不再缴

纳印花税。

6.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。

7.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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	605,267.62
等于：本金	605,142.54
加：应计利息	125.08
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	605,267.62

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	10,268,816.30	-	10,244,289.65	-24,526.65
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	-	-	-
	市场	-	-	-
	银行间	-	-	-
市场	-	-	-	-

	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计	10,268,816.30	-	10,244,289.65	-24,526.65	

### 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 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1.68
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,891.09
其中：交易所市场	6,891.09
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	9,421.05
合计	16,313.82

### 6.4.7.7 实收基金

#### 金鹰先进制造股票（LOF）A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日



	基金份额（份）	账面金额
上年度末	7,785,953.31	7,785,953.31
本期申购	1,783,445.96	1,783,445.96
本期赎回（以“-”号填列）	-1,500,025.49	-1,500,025.49
本期末	8,069,373.78	8,069,373.78

**金鹰先进制造股票（LOF）C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,267,968.07	2,267,968.07
本期申购	4,443,268.01	4,443,268.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,115,656.07	-1,115,656.07
本期末	5,595,580.01	5,595,580.01

**6.4.7.8 未分配利润****金鹰先进制造股票（LOF）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	-4,886,018.13	3,691,527.68	-1,194,490.45
本期利润	-576,031.99	160,745.09	-415,286.90
本期基金份额交易产生的变动数	-187,011.87	144,868.14	-42,143.73
其中：基金申购款	-1,191,142.19	860,503.46	-330,638.73
基金赎回款	1,004,130.32	-715,635.32	288,495.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,649,061.99	3,997,140.91	-1,651,921.08

**金鹰先进制造股票（LOF）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	-1,430,724.94	1,075,049.42	-355,675.52
本期利润	-271,359.70	99,085.01	-172,274.69
本期基金份额交易产生的变动数	-2,240,242.10	1,596,364.33	-643,877.77
其中：基金申购款	-2,994,959.33	2,123,519.42	-871,439.91
基金赎回款	754,717.23	-527,155.09	227,562.14
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-3,942,326.74	2,770,498.76	-1,171,827.98
-----	---------------	--------------	---------------

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,068.87
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	267.11
其他	42.61
合计	2,378.59

**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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	19,707,632.48
减：卖出股票成本总额	20,437,419.84
减：交易费用	58,807.64
买卖股票差价收入	-788,595.00

**6.4.7.11 债券投资收益****6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	298.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-562.00
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	-263.81

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	508,245.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）	500,407.00

成本总额	
减：应计利息总额	8,400.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-562.00

#### 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——买卖资产支持证券差价收入

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

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 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	32,955.17
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	32,955.17

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	259,830.10
——股票投资	259,219.10
——债券投资	611.00
——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	259,830.10

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	5,589.60
基金转换费收入	119.76
合计	5,709.36

#### 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 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	9,421.05
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	595.00
合计	10,016.05

### 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，本基金无须披露的或有事项。

#### 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，本基金没有重大须作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
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
交通银行股份有限公司	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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

本基金本报告期内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

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。

#### 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 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月11日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	71,477.64	45,103.38
其中：支付销售机构的客户维护费	21,383.33	16,867.88

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 1.50\% \div \text{当年天数}$$

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付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月11日（基金合同 生效日）至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	11,912.97	7,517.24

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

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、公休假等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰先进制造股票 (LOF) A	金鹰先进制造股票 (LOF) C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	4,882.13	4,882.13
合计	-	4,882.13	4,882.13
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年1月11日（基金合同生效日）至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰先进制造股票 (LOF) A	金鹰先进制造股票 (LOF) C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	0.58	0.58
合计	-	0.58	0.58

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。

本基金的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% 的年费率计提。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基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计算，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付给登记结算机构，由登记结算机构代收后支付给销售机构。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

**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自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

##### 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

###### 金鹰先进制造股票（LOF）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。

###### 金鹰先进制造股票（LOF）C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022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	4,154,779.46	74.25%	1,681,532.46	74.14%

##### 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月11日（基金合同生效 日）至2022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
交通银行股份有限公司	605,267.62	2,068.87	1,179,820.49	1,277.52

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 19,267.76 元，本期清算备付金利息收入 267.11 元；上年度可比期间清算备付金余额 5,771.19 元，清算备付金存款利息收入 165.81 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

本基金本报告期内未实施利润分配。

#### **6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**

##### **6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

##### **6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

###### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，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 2023 年 6 月 30 日止，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。

### 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。

#### 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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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 2023年6月30日	上年度末 2022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：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、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

2023 年 6 月 30 日					
资产					
银行存款	605,267.62	-	-	-	605,267.62
结算备付金	19,267.76	-	-	-	19,267.76
存出保证金	5,132.24	-	-	-	5,132.24
交易性金融资产	-	-	-	10,244,289.65	10,244,289.65
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	177,920.25	177,920.25
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10,100.59	10,100.59
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	629,667.62	-	-	10,432,310.49	11,061,978.11
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	-	-	-	177,065.77	177,065.77
应付赎回款	-	-	-	11,166.46	11,166.46
应付管理人报酬	-	-	-	12,721.97	12,721.97
应付托管费	-	-	-	2,120.31	2,120.31
应付销售服务费	-	-	-	1,385.05	1,385.05
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	16,313.82	16,313.82
负债总计	-	-	-	220,773.38	220,773.38
利率敏感度缺口	629,667.62	-	-	10,211,537.11	10,841,204.73
上年度末 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	84,696.14	-	-	-	84,696.14
结算备付金	6,199.53	-	-	-	6,199.53
存出保证金	4,355.58	-	-	-	4,355.58
交易性金融资产	408,083.84	-	-	8,052,212.47	8,460,296.31
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	24,881.13	24,881.13

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	1,387.87	1,387.87
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	503,335.09	-	-	8,078,481.47	8,581,816.56
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	-	-	-	31,455.53	31,455.53
应付赎回款	-	-	-	2,886.09	2,886.09
应付管理人报酬	-	-	-	11,281.88	11,281.88
应付托管费	-	-	-	1,880.33	1,880.33
应付销售服务费	-	-	-	683.36	683.36
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	29,873.96	29,873.96
负债总计	-	-	-	78,061.15	78,061.15
利率敏感度缺口	503,335.09	-	-	8,000,420.32	8,503,755.41

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
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-	-35.59
	利率下降 25 个基点	-	35.60

注：本基金本期末未持有债券投资组合。

#### 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 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	10,244,289.65	94.49	8,052,212.47	94.69
交易性金融资产—债券投资	-	-	408,083.84	4.80
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	10,244,289.65	94.49	8,460,296.31	99.49

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰先进制造股票（LOF）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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	242,075.49	284,252.58
	业绩比较基准变动-5%	-242,075.49	-284,252.58

金鹰先进制造股票（LOF）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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	161,699.76	36,539.37
	业绩比较基准变动-5%	-161,699.76	-36,539.37

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	10,244,289.65	8,052,212.47
第二层次	-	408,083.84
第三层次	-	-
合计	10,244,289.65	8,460,296.31

##### 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 2023 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 2023 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	10,244,289.65	92.61
	其中：股票	10,244,289.65	92.61

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	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	624,535.38	5.65
8	其他各项资产	193,153.08	1.75
9	合计	11,061,978.11	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,592,659.65	88.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	651,630.00	6.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-



N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	10,244,289.65	94.49

### 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	002179	中航光电	20,280	919,698.00	8.48
2	000768	中航西飞	26,800	716,900.00	6.61
3	688066	航天宏图	10,700	651,630.00	6.01
4	600862	中航高科	24,600	622,626.00	5.74
5	600760	中航沈飞	13,180	593,100.00	5.47
6	600893	航发动力	13,900	587,414.00	5.42
7	600685	中船防务	18,600	557,070.00	5.14
8	688239	航宇科技	7,800	545,610.00	5.03
9	600118	中国卫星	18,500	521,885.00	4.81
10	600435	北方导航	39,800	457,302.00	4.22
11	300855	图南股份	12,090	427,018.80	3.94
12	002025	航天电器	6,600	421,080.00	3.88
13	603712	七一二	10,800	326,268.00	3.01
14	300101	振芯科技	14,800	286,972.00	2.65
15	600372	中航电子	16,600	251,988.00	2.32
16	002049	紫光国微	2,700	251,775.00	2.32
17	300034	钢研高纳	6,300	248,157.00	2.29
18	600391	航发科技	9,800	236,278.00	2.18
19	688281	华秦科技	1,045	211,612.50	1.95
20	002985	北摩高科	4,600	202,952.00	1.87
21	688510	航亚科技	10,015	199,198.35	1.84
22	300114	中航电测	3,900	191,685.00	1.77
23	300474	景嘉微	2,100	188,979.00	1.74
24	688311	盟升电子	2,300	160,862.00	1.48

25	600416	湘电股份	8,300	158,447.00	1.46
26	688297	中无人机	2,800	143,612.00	1.32
27	000733	振华科技	1,000	95,850.00	0.88
28	000738	航发控制	2,800	68,320.00	0.63

#### 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	002179	中航光电	934,291.00	10.99
2	600685	中船防务	714,298.00	8.40
3	000768	中航西飞	703,571.00	8.27
4	002049	紫光国微	683,441.00	8.04
5	600760	中航沈飞	637,176.00	7.49
6	600416	湘电股份	593,821.20	6.98
7	300474	景嘉微	557,176.00	6.55
8	600862	中航高科	553,868.00	6.51
9	600893	航发动力	540,030.00	6.35
10	600118	中国卫星	536,043.00	6.30
11	301117	佳缘科技	515,628.00	6.06
12	300101	振芯科技	497,492.00	5.85
13	300738	奥飞数据	479,717.00	5.64
14	688311	盟升电子	470,823.71	5.54
15	688239	航宇科技	469,948.22	5.53
16	688066	航天宏图	459,156.33	5.40
17	600435	北方导航	454,204.00	5.34
18	300661	圣邦股份	437,876.00	5.15
19	300395	菲利华	419,034.00	4.93
20	688052	纳芯微	406,629.41	4.78
21	688800	瑞可达	398,246.24	4.68
22	688037	芯源微	393,757.10	4.63
23	688297	中无人机	347,099.93	4.08
24	603712	七一二	337,796.00	3.97
25	600399	抚顺特钢	318,936.00	3.75
26	688281	华秦科技	316,841.07	3.73
27	688682	霍莱沃	290,885.75	3.42
28	000519	中兵红箭	289,195.46	3.40
29	603893	瑞芯微	281,878.00	3.31
30	003029	吉大正元	277,855.00	3.27

31	001270	铖昌科技	275,913.00	3.24
32	688381	帝奥微	273,155.51	3.21
33	300458	全志科技	266,161.00	3.13
34	300123	亚光科技	259,716.00	3.05
35	600372	中航电子	255,934.00	3.01
36	601698	中国卫通	239,678.00	2.82
37	688378	奥来德	234,696.72	2.76
38	688270	臻镭科技	224,827.07	2.64
39	300114	中航电测	222,482.00	2.62
40	002977	天箭科技	220,903.00	2.60
41	688676	金盘科技	207,026.62	2.43
42	688207	格灵深瞳	203,393.94	2.39
43	002985	北摩高科	197,605.00	2.32
44	600391	航发科技	192,412.00	2.26
45	300855	图南股份	190,060.00	2.24
46	688522	纳睿雷达	185,457.30	2.18
47	300593	新雷能	185,122.00	2.18
48	301050	雷电微力	179,172.00	2.11
49	600765	中航重机	177,698.00	2.09
50	688283	坤恒顺维	177,376.06	2.09
51	688333	铂力特	173,257.67	2.04
52	300762	上海瀚讯	169,726.00	2.00

## 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	002049	紫光国微	763,782.00	8.98
2	600399	抚顺特钢	507,316.00	5.97
3	600435	北方导航	491,175.00	5.78
4	688239	航宇科技	484,181.93	5.69
5	300738	奥飞数据	455,571.20	5.36
6	300474	景嘉微	454,011.00	5.34
7	688270	臻镭科技	452,322.42	5.32
8	688122	西部超导	450,645.81	5.30
9	688776	国光电气	437,033.82	5.14
10	300593	新雷能	436,951.40	5.14
11	600760	中航沈飞	430,543.00	5.06
12	300101	振芯科技	429,354.00	5.05
13	301117	佳缘科技	428,271.00	5.04
14	300699	光威复材	425,658.00	5.01
15	688037	芯源微	422,733.50	4.97
16	300661	圣邦股份	414,330.00	4.87

17	600765	中航重机	408,001.00	4.80
18	000519	中兵红箭	400,160.00	4.71
19	300395	菲利华	383,323.00	4.51
20	600416	湘电股份	382,400.00	4.50
21	688052	纳芯微	377,224.89	4.44
22	688800	瑞可达	366,506.29	4.31
23	601698	中国卫通	341,712.00	4.02
24	688682	霍莱沃	319,245.43	3.75
25	002179	中航光电	318,722.80	3.75
26	688311	盟升电子	308,540.16	3.63
27	688375	国博电子	299,455.67	3.52
28	300123	亚光科技	272,580.00	3.21
29	600038	中直股份	270,743.00	3.18
30	003029	吉大正元	266,872.00	3.14
31	603915	国茂股份	263,833.00	3.10
32	688378	奥来德	258,328.11	3.04
33	603893	瑞芯微	258,302.00	3.04
34	300458	全志科技	256,357.00	3.01
35	688381	帝奥微	250,330.44	2.94
36	001270	铖昌科技	247,830.00	2.91
37	688132	邦彦技术	233,261.12	2.74
38	600685	中船防务	229,903.00	2.70
39	688207	格灵深瞳	228,850.15	2.69
40	300855	图南股份	218,924.00	2.57
41	688676	金盘科技	215,412.70	2.53
42	002977	天箭科技	213,200.00	2.51
43	000733	振华科技	204,767.00	2.41
44	688522	纳睿雷达	201,445.40	2.37
45	002487	大金重工	188,286.00	2.21
46	600893	航发动力	181,350.00	2.13
47	688283	坤恒顺维	180,221.65	2.12
48	002544	普天科技	177,576.00	2.09

#### 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	22,370,277.92
卖出股票收入（成交）总额	19,707,632.48

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

本基金本报告期末未持有债券。

## 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

### 7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

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 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	5,132.24
2	应收清算款	177,920.25
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,100.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	193,153.08

#### 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

由于四舍五入的原因，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

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
金鹰先进制造股票（LOF）A	2,284	3,533.00	49.61	0.00%	8,069,324.17	100.00%
金鹰先进制造股票（LOF）C	84	66,614.05	4,154,779.46	74.25%	1,440,800.55	25.75%

合计	2,368	5,770.67	4,154,829.07	30.40%	9,510,124.72	69.60%
----	-------	----------	--------------	--------	--------------	--------

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	金鹰先进制造股票（LOF）A	9.36	0.00%
	金鹰先进制造股票（LOF）C	260,249.83	4.65%
	合计	260,259.19	1.90%

## 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	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	金鹰先进制造股票（LOF）A	0
	金鹰先进制造股票（LOF）C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰先进制造股票（LOF）A	0
	金鹰先进制造股票（LOF）C	10~50
	合计	10~50

## 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

项目	金鹰先进制造股票（LOF）A	金鹰先进制造股票（LOF）C
基金合同生效日（2022年1月11日）基金份额总额	6,887,201.40	-

本报告期期初基金份额总额	7,785,953.31	2,267,968.07
本报告期基金总申购份额	1,783,445.96	4,443,268.01
减：本报告期基金总赎回份额	1,500,025.49	1,115,656.07
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	8,069,373.78	5,595,580.01

## §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，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

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

### 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

本报告期末改聘会计师事务所。

### 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**

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

**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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	16,105,910.01	38.28%	14,838.84	41.46%	-
东北证券	1	9,445,912.80	22.45%	6,813.40	19.04%	-
金元证券	2	4,614,707.46	10.97%	3,328.55	9.30%	-
国联证券	2	4,045,278.19	9.61%	3,726.78	10.41%	-
中金公司	1	3,998,560.81	9.50%	3,723.85	10.41%	-
安信证券	3	1,994,812.00	4.74%	1,837.74	5.13%	新增 2 个
江海证券	1	1,045,597.10	2.48%	754.12	2.11%	新增 1 个
海通证券	2	827,132.03	1.97%	765.76	2.14%	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
东方财富（西藏东财）	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
申港证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券华南（广证）	2	-	-	-	-	-

日信证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
国信证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	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
华创证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	199,681.00	100.00%	750,000.00	100.00%	-	-

安信证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
东方财富（西藏东财）	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-

## 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	金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)2022 年四季度报告	证监会规定媒介	2023-01-20
2	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-01-20
3	金鹰基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	证监会规定媒介	2023-01-31
4	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增平安银行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	2023-02-20
5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增济安财富（北京）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	2023-02-23
6	金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)2022 年年度报告	证监会规定媒介	2023-03-30
7	金鹰基金管理有限公司关于基金经理休假期间由他人代为履职的公告	证监会规定媒介	2023-03-30
8	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-03-30
9	金鹰先进制造股票型证券投资基金(LOF)2023 年一季度报告	证监会规定媒介	2023-04-21
10	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-04-21
11	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	2023-05-08
12	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增博时财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	2023-05-09
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行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	2023-05-22
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海长量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	2023-05-26
15	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海万得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	2023-06-01
16	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增众惠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	2023-06-12
17	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中银国际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	2023-06-19

18	金鹰基金管理有限公司部分基金新增东吴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	2023-06-19
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增麦高证券有限责任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	2023-06-21
20	金鹰基金管理有限公司部分基金新增国金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	2023-06-30

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 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年3月27日至2023年6月30日	1,681,532.46	2,473,247.00	0.00	4,154,779.46	30.40%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，可能导致本基金面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p> <p>5) 基金规模过小导致的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p> <p>6) 份额占比较高的投资者申购申请被拒绝的风险：当某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额的50%时，本基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被</p>							

拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

## 11.2 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.中国证监会准予金鹰量化精选股票型证券投资基金（LOF）变更注册的文件。
- 2.《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）基金合同》。
- 3.《金鹰先进制造股票型证券投资基金（LOF）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上公开披露的公告。

### 12.2 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

### 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。

二〇二三年八月三十日