

# 金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

## 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.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	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.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
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.....	13
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
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.....	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
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.....	46
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.....	46
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.....	47
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.....	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	47

7.12 投资组合报告附注 .....	47
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>48</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	48
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	49
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	49
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 .....	49
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	49
§9 开放式基金份额变动 .....	49
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>50</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	50
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 .....	50
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	50
10.4 基金投资策略的改变 .....	50
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	50
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	50
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 .....	50
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	51
10.9 其他重大事件 .....	54
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>56</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 .....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	57
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>57</b>
12.1 备查文件目录 .....	57
12.2 存放地点 .....	57
12.3 查阅方式 .....	57

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰红利价值混合	
基金主代码	210002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 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	915,853,322.77 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
下属分级基金的交易代码	210002	016563
报告期末下属分级基金的份额总额	541,844,790.70 份	374,008,532.07 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	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	中国（上海）自由贸易试验区

	2号3212房	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
本期已实现收益	39,855,518.78	17,756,760.41
本期利润	67,484,386.62	28,668,573.54
加权平均基金份额本期利润	0.2893	0.2296
本期加权平均净值利润率	11.79%	9.39%
本期基金份额净值增长率	36.78%	36.39%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
期末可供分配利润	660,415,538.38	451,394,280.67
期末可供分配基金份额利润	1.2188	1.2069
期末基金资产净值	1,358,331,277.66	932,764,267.13
期末基金份额净值	2.5069	2.4940
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	

	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
基金份额累计净值增长率	499.13%	24.77%

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

##### 金鹰红利价值混合 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	-1.52%	1.28%	-1.45%	0.46%	-0.07%	0.82%
过去三个月	2.38%	1.32%	-0.60%	0.50%	2.98%	0.82%
过去六个月	36.78%	1.44%	2.73%	0.45%	34.05%	0.99%
过去一年	27.77%	1.25%	1.33%	0.55%	26.44%	0.70%
过去三年	76.90%	1.33%	20.03%	0.67%	56.87%	0.66%
自基金合同生效起至今	499.13%	1.22%	155.17%	0.87%	343.96%	0.35%

##### 金鹰红利价值混合 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	-1.57%	1.28%	-1.45%	0.46%	-0.12%	0.82%
过去三个月	2.23%	1.32%	-0.60%	0.50%	2.83%	0.82%
过去六个月	36.39%	1.44%	2.73%	0.45%	33.66%	0.99%
自基金合同生效起至今	24.77%	1.32%	1.99%	0.68%	22.78%	0.64%

注：本基金自 2022 年 8 月 24 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2022 年 8 月 25 日。

本基金原业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。自 2013 年 6 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收

益率×40%。

### 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

金鹰红利价值灵活配置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

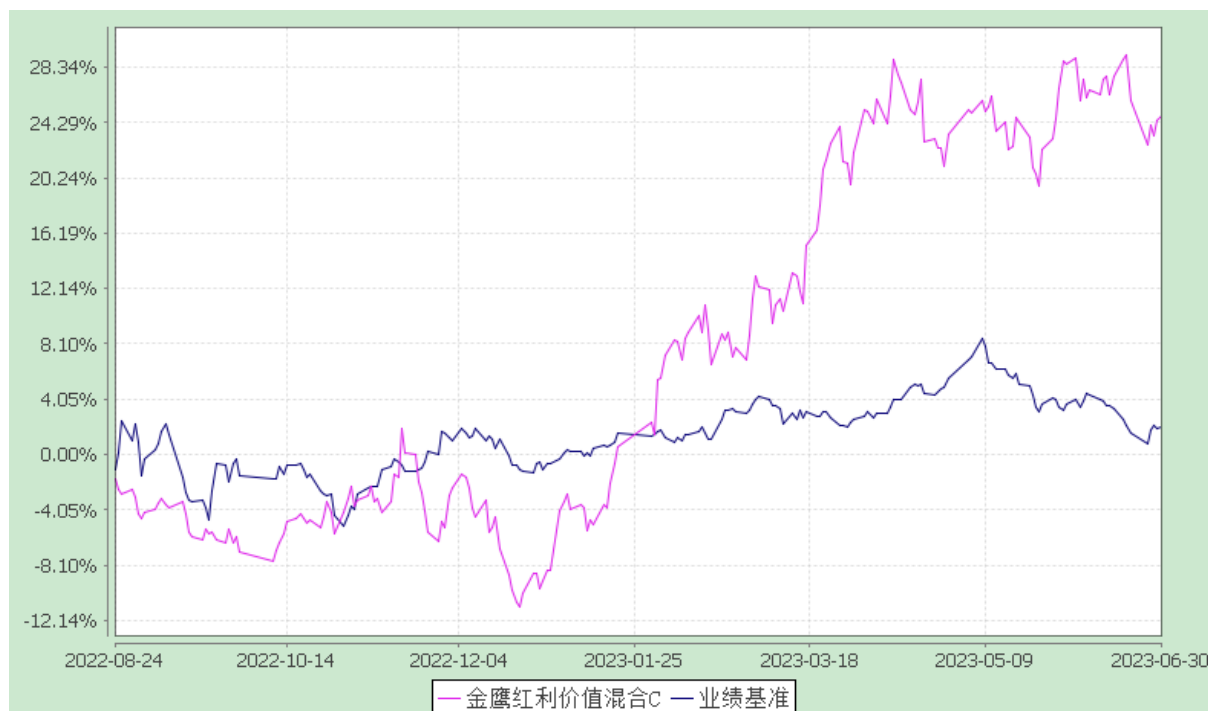
(2008 年 12 月 4 日至 2023 年 6 月 30 日)

金鹰红利价值混合 A



金鹰红利价值混合 C





注：1、本基金合同 2008 年 12 月 4 日生效。

2、本报告期末，本基金各项投资比例符合基金合同约定。

3、本基金原业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数收益率  $\times 60\%$  + 上证国债指数收益率  $\times 40\%$ 。自 2013 年 6 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率  $\times 60\%$  + 上证国债指数收益率  $\times 40\%$ 。

4、本基金自 2022 年 8 月 24 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2022 年 8 月 25 日。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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		
陈颖	本基金的基金经理，公司权益投资部首席投资官	2020-04-28	-	13	陈颖先生，北京大学学士，中山大学工商管理硕士。曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普有限公司，历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职，2012 年 9 月加入金鹰基金管理有限公司，先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等。现任权益投资部基金经理。
张展华	本基金的基金经理助理	2023-07-05	-	8	张展华先生，西南民族大学管理学硕士。曾任金鹰基金管理有限公司研究员、中信资本(深圳)投资管理有限公司研究员、华美国际投资集团有限公司研究副总监兼基金经理、远信（珠海）私募基金管理有限公司研究员。2023 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益研究部基金经理助理。

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、《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期

内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统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

上半年，以美联储为代表的海外各国央行在高通胀的压力下，持续进行加息，试图遏制通胀上行。虽然海外利率敏感部门因为高利率出现部分风险事件，但在科技技术突破和创新的带领下，全球股市仍然呈现震荡上行的走势。随着美联储 7 月加息预期升温，目前市场普遍认为 7 月加息后，美联储再次加息的概率不大。

上半年国内货币政策较为宽松，经济呈现温和复苏态势，复苏力度略低于市场预期，导致上半年指数呈现震荡下行的趋势。受到海外 AI 技术创新的刺激以及国内对数字经济政策扶持，上半年科技板块呈现结构性牛市走势，相关板块涨幅较大。

回顾上半年，本基金保持了较高仓位，重点配置了以计算机、传媒为代表的高科技板块，具体基金投资方面，在 5 月初本基金减持了部分涨幅较大、短期透支的品种，降低整体仓位的同时增持了部分低估值品种。随着 5-6 月部分科技股调整到合理区间，本基金逐步增持了部分性价比突出、

以电子和计算机为主的低位科技股。

#### 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 2.5069 元，本报告期份额净值增长率为 36.78%，同期业绩比较基准增长率为 2.73%；C 类基金份额净值为 2.4940 元，本报告期份额净值增长率为 36.39%，同期业绩比较基准增长率为 2.73%。

#### 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，我们认为随着国内经济的温和复苏，前期市场对经济的悲观预期将得到大幅改善，下半年市场整体或有望呈现震荡向上的走势。科技股经历了 5-6 月调整后，将进入震荡寻底阶段，预计 3 季度末和 4 季度有可能迎来新一波上涨的机会。

上半年指数受到市场悲观预期影响，导致指数整体震荡下行，而科技板块受海外人工智能刺激，在上半年呈现出结构性牛市特点。我们认为，下半年指数整体可能将呈现与上半年相反的走势。而人工智能板块在经历了贝塔行情后，基本透支了未来的成长性，未来需要自下而上寻找能够推出人工智能相关产品并产生较好流量或者收入的公司。同时以信创和消费电子为主导的科技板块仍将是下半年重点关注的方向，努力自下而上寻找其中具有较强成长性或处于严重低估状态的公司是我们下半年投研重点的工作。

预计下半年本基金仍将维持高仓位策略，在选股上仍将以成长类公司为主，重点关注电子、计算机、高端装备制造等板块，同时也会增加对低估值顺周期板块和个股的关注，如金属、金融、消费等。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，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

本报告期内，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、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。

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

本报告期内，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金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金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：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

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	607,672,391.87	10,082,044.99
结算备付金		3,391,887.19	522,595.75
存出保证金		302,393.36	118,409.87
交易性金融资产	6.4.7.2	1,758,020,076.18	134,622,697.34
其中：股票投资		1,620,227,653.57	114,045,072.12
基金投资		-	-
债券投资		137,792,422.61	20,577,625.22
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		-	3,817,619.96
应收股利		-	-
应收申购款		7,809,022.86	36,759.45
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,377,195,771.46	149,200,127.36
<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		72,896,937.57	-
应付赎回款		7,688,172.66	350,662.17
应付管理人报酬		2,275,989.11	195,170.95
应付托管费		379,331.50	32,528.48
应付销售服务费		347,725.70	27,147.88
应付投资顾问费		-	-

应交税费		373.29	297.14
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,511,696.84	907,637.50
负债合计		86,100,226.67	1,513,444.12
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	915,853,322.77	80,645,451.78
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,375,242,222.02	67,041,231.46
净资产合计		2,291,095,544.79	147,686,683.24
负债和净资产总计		2,377,195,771.46	149,200,127.36

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 2.5069 元，A 类基金份额总额为 541,844,790.70 份；C 类基金份额净值为 2.4940 元，C 类基金份额总额为 374,008,532.07 份；基金份额总额为 915,853,322.77 份；

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

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 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		104,675,915.93	3,643,158.58
1.利息收入		806,420.37	88,647.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	806,420.37	88,328.32
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		-	319.31
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		63,775,633.85	-2,042,842.41
其中：股票投资收益	6.4.7.10	55,891,260.32	-2,078,032.98
基金投资收益	6.4.7.11	-	-
债券投资收益		4,654,036.37	-532,026.17
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	3,230,337.16	567,216.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.17	38,540,680.97	5,509,954.91

填列)			
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	1,553,180.74	87,398.45
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>8,522,955.77</b>	<b>864,004.82</b>
1. 管理人报酬		6,461,617.06	688,255.92
2. 托管费		1,076,936.20	114,709.33
3. 销售服务费		897,853.84	-
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		-	-
7. 税金及附加		238.79	43.48
8. 其他费用	6.4.7.19	86,309.88	60,996.09
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>96,152,960.16</b>	<b>2,779,153.76</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>96,152,960.16</b>	<b>2,779,153.76</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>96,152,960.16</b>	<b>2,779,153.76</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

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）	80,645,451.78	-	67,041,231.46	147,686,683.24
二、本期期初净资产（基金净值）	80,645,451.78	-	67,041,231.46	147,686,683.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	835,207,870.99	-	1,308,200,990.56	2,143,408,861.55
（一）、综合收益总额	-	-	96,152,960.16	96,152,960.16
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	835,207,870.99	-	1,212,048,030.40	2,047,255,901.39



(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,171,078,817.71	-	1,706,574,728.43	2,877,653,546.14
2.基金赎回款	-335,870,946.72	-	-494,526,698.03	-830,397,644.75
(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)	915,853,322.77	-	1,375,242,222.02	2,291,095,544.79
项目	上年度可比期间 2022年1月1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)	39,475,491.51	-	36,875,374.43	76,350,865.94
二、本期期初净资产(基金净值)	39,475,491.51	-	36,875,374.43	76,350,865.94
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	22,688,800.40	-	22,935,628.12	45,624,428.52
(一)、综合收益总额	-	-	2,779,153.76	2,779,153.76
(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)	22,688,800.40	-	20,156,474.36	42,845,274.76
其中：1.基金申购款	42,073,266.48	-	35,150,526.90	77,223,793.38
2.基金赎回款	-19,384,466.08	-	-14,994,052.54	-34,378,518.62
(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)	62,164,291.91	-	59,811,002.55	121,975,294.46

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

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金(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[2008]521号文《关于核准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》、基金部函字[2008]509号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2008年12月4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367,018,547.39份基金份额。本基金募集期间自2008年10月8日起至2008年11月29日止,认购金额为366,942,740.65元,认购资金在认购期间的银行利息75,806.74元折算成基金资产。上述资金已于2008年12月4日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所。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,包括投资于国内依法公开发行上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业,股票资产占基金资产净值比例为30%—80%;现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为20%—70%,其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况、本报告期的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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	607,672,391.87
等于：本金	607,553,467.64
加：应计利息	118,924.23
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	607,672,391.87

#### 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	1,589,731,831.50	-	1,620,227,653.57	30,495,822.07
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,107,546.21		
	市场	135,708,445.76	137,792,422.61	976,430.64
	银行间		-	
	市场	-	-	-
合计	135,708,445.76	1,107,546.21	137,792,422.61	976,430.64
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,725,440,277.26	1,107,546.21	1,758,020,076.18	31,472,252.71

#### 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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 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	9,406.91
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,976,877.75
其中：交易所市场	1,976,877.75
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	250,000.00
预提信息披露费	259,507.37
预提审计费用	11,404.81
预提中债登账户维护费	4,500.00
合计	2,511,696.84

## 6.4.7.7 实收基金

## 金鹰红利价值混合 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	52,258,498.86	52,258,498.86
本期申购	693,023,205.41	693,023,205.41
本期赎回（以“-”号填列）	-203,436,913.57	-203,436,913.57
本期末	541,844,790.70	541,844,790.70

## 金鹰红利价值混合 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	28,386,952.92	28,386,952.92
本期申购	478,055,612.30	478,055,612.30
本期赎回（以“-”号填列）	-132,434,033.15	-132,434,033.15

本期末	374,008,532.07	374,008,532.07
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 金鹰红利价值混合 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	51,791,082.97	-8,272,490.19	43,518,592.78
本期利润	39,855,518.78	27,628,867.84	67,484,386.62
本期基金份额交易产生的变动数	568,768,936.63	136,714,570.93	705,483,507.56
其中：基金申购款	808,984,255.42	197,069,388.84	1,006,053,644.26
基金赎回款	-240,215,318.79	-60,354,817.91	-300,570,136.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	660,415,538.38	156,070,948.58	816,486,486.96

##### 金鹰红利价值混合 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	28,008,796.70	-4,486,158.02	23,522,638.68
本期利润	17,756,760.41	10,911,813.13	28,668,573.54
本期基金份额交易产生的变动数	405,628,723.56	100,935,799.28	506,564,522.84
其中：基金申购款	561,435,510.24	139,085,573.93	700,521,084.17
基金赎回款	-155,806,786.68	-38,149,774.65	-193,956,561.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	451,394,280.67	107,361,454.39	558,755,735.06

#### 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	788,011.40
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	16,848.98
其他	1,559.99
合计	806,420.37

注：其他为结算保证金利息收入。

#### 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	973,625,250.44
减：卖出股票成本总额	913,729,240.25
减：交易费用	4,004,749.87
买卖股票差价收入	55,891,260.32

#### 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	74,821.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,579,215.13
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	4,654,036.37

##### 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	45,130,480.26
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	40,462,415.68
减：应计利息总额	84,742.62
减：交易费用	4,106.83
买卖债券差价收入	4,579,215.13

#### 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	3,230,337.16
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	3,230,337.16

**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	38,540,680.97
——股票投资	36,412,224.71
——债券投资	2,128,456.26
——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	38,540,680.97

**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	1,500,526.98
转换费收入_金鹰红利 C	5,937.91
转换费收入_金鹰红利 A	46,715.85
合计	1,553,180.74

**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	11,404.81
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	1,897.70
帐户维护费	13,500.00
合计	86,309.88

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

根据相关法规以及本基金收益分配政策，本基金向截至 2023 年 8 月 16 日登记在册的全体持有人进行利润分配，每 10 份 A 类基金份额派发红利 6.145 元，每 10 份 C 类基金份额派发红利 6.080 元。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

###### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

###### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

##### 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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,461,617.06	688,255.92
其中：支付销售机构的客户维护费	2,394,258.33	282,253.57

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H = E \times 1.5\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金管理人报酬划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人，若遇节假日、休息日等，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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,076,936.20	114,709.33

注：1、基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月底，按月支付；由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 15 个工作日内，从基金资产中一次性支付，若遇节假日、休息日等，支付日期顺延。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	215,069.61	215,069.61

合计	-	215,069.61	215,069.61
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1日至2022年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰红利价值混合A	金鹰红利价值混合C	合计
合计	-	-	-

注：1、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 0.60% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.60\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

2、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首日起 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给登记机构，由登记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。

3、本基金上年度可比期间无应支付给关联方的销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间均无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 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

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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1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	607,672,391.87	788,011.40	33,070,667.31	83,891.92

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。该科目 2023 年 6 月 30 日余额 3,391,887.19 元，当期清算备付金利息收入为 16,848.98 元；2022 年 6 月 30 日余额 200,516.51 元，当期清算备付金利息收入为 3,906.65 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

本基金报告期及上年度可比期间内均无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	网下配售锁定	152.38	135.97	110.00	16,761.80	14,956.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	网下配售锁定	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
688343	云天励飞	2023-03-28	6 个月	网下配售锁定	43.92	50.67	4,825.00	211,914.00	244,482.75	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	网下配售	73.45	46.64	60.00	4,407.00	2,798.40	-

				锁定						
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	网下配售锁定	23.77	42.89	142.00	3,375.34	6,090.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	网下配售锁定	33.73	31.85	135.00	4,553.55	4,299.75	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	网下配售锁定	20.68	25.49	124.00	2,564.32	3,160.76	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	网下配售锁定	25.98	24.53	107.00	2,779.86	2,624.71	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	网下配售锁定	17.80	17.89	331.00	5,891.80	5,921.59	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	网下配售锁定	19.99	16.90	228.00	4,557.72	3,853.20	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	网下配售锁定	11.66	12.26	351.00	4,092.66	4,303.26	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	网下配售锁定	10.36	11.84	324.00	3,356.64	3,836.16	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	网下配售锁定	9.60	9.41	3,767.00	36,163.20	35,447.47	-

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告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设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

##### 1、风险管理控制制度

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

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

##### 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

##### 3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司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、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	45,445,952.24	20,577,625.22
未评级	0.00	0.00
合计	45,445,952.24	20,577,625.22

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 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	607,672,391.87	-	-	-	607,672,391.87
结算备付金	3,391,887.19	-	-	-	3,391,887.19
存出保证金	302,393.36	-	-	-	302,393.36
交易性金融资产	-	39,472,554.77	98,319,867.84	1,620,227,653.57	1,758,020,076.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,809,022.86	7,809,022.86
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	611,366,672.42	39,472,554.77	98,319,867.84	1,628,036,676.43	2,377,195,771.46
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	-	-	-	72,896,937.57	72,896,937.57
应付赎回款	-	-	-	7,688,172.66	7,688,172.66
应付管理人报酬	-	-	-	2,275,989.11	2,275,989.11
应付托管费	-	-	-	379,331.50	379,331.50
应付销售服务费	-	-	-	347,725.70	347,725.70
应交税费	-	-	-	373.29	373.29
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,511,696.84	2,511,696.84
负债总计	-	-	-	86,100,226.67	86,100,226.67
利率敏感度缺口	611,366,672.42	39,472,554.77	98,319,867.84	1,541,936,449.76	2,291,095,544.79
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	10,082,044.99	-	-	-	10,082,044.99
结算备付金	522,595.75	-	-	-	522,595.75
存出保证金	118,409.87	-	-	-	118,409.87
交易性金融资产	6,740,338.19	13,837,287.03	-	114,045,072.12	134,622,697.34
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	3,817,619.96	3,817,619.96
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	36,759.45	36,759.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,463,388.80	13,837,287.03	-	117,899,451.53	149,200,127.36
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	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	350,662.17	350,662.17
应付管理人报酬	-	-	-	195,170.95	195,170.95
应付托管费	-	-	-	32,528.48	32,528.48

应付销售服务费	-	-	-	27,147.88	27,147.88
应交税费	-	-	-	297.14	297.14
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	907,637.50	907,637.50
负债总计	-	-	-	1,513,444.12	1,513,444.12
利率敏感度缺口	17,463,388.80	13,837,287.03	-	116,386,007.41	147,686,683.24

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	-3,493,580.69	0.00
	利率下降 25 个基点	3,871,536.95	0.00

#### 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	1,620,227,653.57	70.72	114,045,072.12	77.22
交易性金融资产—债券投资	45,445,952.24	1.98	20,577,625.22	13.93

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>1,665,673,605.81</b>	<b>72.70</b>	<b>134,622,697.34</b>	<b>91.15</b>

注：其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险，主要涉及股票、可转债、可交换债、权证等交易性金融资产。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

##### 金鹰红利价值混合 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	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	75,850,022.62	3,535,147.26
	业绩比较基准变动-5%	-75,850,022.62	-3,535,147.26

##### 金鹰红利价值混合 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	上年度末
		2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	52,046,444.28	587,207.31
	业绩比较基准变动-5%	-52,046,444.28	-587,207.31

#### 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	本期末	上年度末
--------------	-----	------

次	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,665,333,582.65	134,622,697.34
第二层次	92,346,470.37	-
第三层次	340,023.16	-
合计	1,758,020,076.18	134,622,697.34

#### 6.4.14.2 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	1,620,227,653.57	68.16
	其中：股票	1,620,227,653.57	68.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	137,792,422.61	5.80
	其中：债券	137,792,422.61	5.80
	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	611,064,279.06	25.71
8	其他各项资产	8,111,416.22	0.34
9	合计	2,377,195,771.46	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	83,630,510.42	3.65
C	制造业	778,422,366.33	33.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,176,757.17	0.27
E	建筑业	4,303.26	0.00
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	505,052,716.50	22.04
J	金融业	115,149,225.09	5.03
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	131,791,774.80	5.75
S	综合	-	-
	合计	1,620,227,653.57	70.72

### 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	600150	中国船舶	2,570,000	84,578,700.00	3.69
2	300036	超图软件	3,170,000	75,160,700.00	3.28
3	000066	中国长城	4,170,028	57,671,487.24	2.52
4	688088	虹软科技	1,270,000	54,292,500.00	2.37
5	603501	韦尔股份	517,021	50,688,738.84	2.21
6	603893	瑞芯微	667,000	48,590,950.00	2.12
7	603496	恒为科技	2,324,000	43,644,720.00	1.90
8	300115	长盈精密	3,570,056	42,519,366.96	1.86
9	601727	上海电气	9,300,035	42,501,159.95	1.86
10	000997	新大陆	2,230,000	42,147,000.00	1.84
11	688058	宝兰德	737,000	42,001,630.00	1.83
12	601336	新华保险	1,100,017	40,447,625.09	1.77
13	600699	均胜电子	2,289,967	40,395,017.88	1.76
14	600547	山东黄金	1,670,033	39,212,374.84	1.71
15	000555	神州信息	2,970,053	36,531,651.90	1.59
16	688039	当虹科技	933,832	33,468,538.88	1.46
17	002635	安洁科技	2,390,000	32,982,000.00	1.44
18	601628	中国人寿	910,000	31,813,600.00	1.39
19	600489	中金黄金	2,969,926	30,679,335.58	1.34
20	601318	中国平安	660,000	30,624,000.00	1.34
21	601858	中国科传	860,000	28,896,000.00	1.26
22	300133	华策影视	3,900,000	27,651,000.00	1.21
23	300031	宝通科技	1,070,000	26,450,400.00	1.15
24	688201	信安世纪	617,065	26,373,358.10	1.15
25	002036	联创电子	2,710,000	26,314,100.00	1.15
26	600482	中国动力	1,110,000	26,018,400.00	1.14
27	300017	网宿科技	3,600,000	25,596,000.00	1.12
28	600633	浙数文化	1,570,065	25,450,753.65	1.11
29	300007	汉威科技	1,190,000	25,168,500.00	1.10
30	300182	捷成股份	3,970,000	25,050,700.00	1.09
31	300709	精研科技	1,010,000	24,916,700.00	1.09
32	688579	山大地纬	1,510,000	24,884,800.00	1.09
33	300782	卓胜微	257,060	24,839,707.80	1.08



34	603057	紫燕食品	970,005	24,376,225.65	1.06
35	003021	兆威机电	270,000	23,687,100.00	1.03
36	002237	恒邦股份	2,170,000	23,631,300.00	1.03
37	002123	梦网科技	1,770,058	23,524,070.82	1.03
38	600158	中体产业	2,270,015	23,063,352.40	1.01
39	300426	唐德影视	1,510,000	22,483,900.00	0.98
40	603232	格尔软件	1,510,000	21,955,400.00	0.96
41	300997	欢乐家	1,390,019	20,252,576.83	0.88
42	301338	凯格精机	517,059	20,113,595.10	0.88
43	603005	晶方科技	970,000	19,594,000.00	0.86
44	300556	丝路视觉	777,074	19,069,395.96	0.83
45	600640	国脉文化	1,570,044	18,856,228.44	0.82
46	601989	中国重工	3,370,000	16,243,400.00	0.71
47	301312	智立方	151,050	16,035,468.00	0.70
48	601069	西部黄金	1,070,000	13,738,800.00	0.60
49	601319	中国人保	2,100,000	12,264,000.00	0.54
50	600685	中船防务	389,952	11,679,062.40	0.51
51	000559	万向钱潮	2,100,000	11,445,000.00	0.50
52	000301	东方盛虹	770,000	9,101,400.00	0.40
53	300351	永贵电器	510,000	8,379,300.00	0.37
54	003029	吉大正元	210,000	6,814,500.00	0.30
55	600903	贵州燃气	709,978	6,141,309.70	0.27
56	300291	百纳千成	660,060	4,646,822.40	0.20
57	002465	海格通信	290,000	2,998,600.00	0.13
58	688083	中望软件	15,400	2,231,306.00	0.10
59	688343	云天励飞	4,825	244,482.75	0.01
60	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
61	688531	日联科技	110	14,956.70	0.00
62	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
63	301358	湖南裕能	142	6,090.38	0.00
64	603135	中重科技	331	5,921.59	0.00
65	601133	柏诚股份	351	4,303.26	0.00
66	301373	凌玮科技	135	4,299.75	0.00
67	301439	泓淋电力	228	3,853.20	0.00
68	601065	江盐集团	324	3,836.16	0.00
69	001328	登康口腔	124	3,160.76	0.00
70	301345	涛涛车业	60	2,798.40	0.00
71	603125	常青科技	107	2,624.71	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000066	中国长城	80,014,606.09	54.18
2	600150	中国船舶	76,131,365.40	51.55
3	300182	捷成股份	65,008,347.12	44.02
4	300036	超图软件	60,296,664.86	40.83
5	688088	虹软科技	56,762,797.65	38.43
6	603893	瑞芯微	55,320,298.67	37.46
7	603501	韦尔股份	51,088,672.57	34.59
8	600547	山东黄金	50,664,937.38	34.31
9	601336	新华保险	46,644,859.15	31.58
10	002291	遥望科技	45,816,532.40	31.02
11	688039	当虹科技	42,954,680.06	29.09
12	601727	上海电气	42,815,922.85	28.99
13	300017	网宿科技	42,116,582.34	28.52
14	601858	中国科传	41,710,478.14	28.24
15	000555	神州信息	40,943,088.24	27.72
16	600699	均胜电子	40,780,078.73	27.61
17	300115	长盈精密	38,380,175.60	25.99
18	601318	中国平安	37,947,911.00	25.69
19	000997	新大陆	37,343,171.84	25.29
20	002123	梦网科技	37,258,736.04	25.23
21	688201	信安世纪	36,120,524.14	24.46
22	601628	中国人寿	35,616,589.82	24.12
23	600633	浙数文化	35,393,254.94	23.97
24	300709	精研科技	35,059,600.72	23.74
25	688058	宝兰德	34,433,345.16	23.32
26	002635	安洁科技	33,693,407.76	22.81
27	300031	宝通科技	33,482,366.10	22.67
28	600489	中金黄金	32,956,582.95	22.32
29	300426	唐德影视	32,872,386.00	22.26
30	300782	卓胜微	32,869,309.88	22.26
31	300351	永贵电器	30,321,246.77	20.53
32	603357	设计总院	30,303,970.20	20.52
33	603496	恒为科技	29,885,187.54	20.24
34	300007	汉威科技	29,612,342.34	20.05
35	301338	凯格精机	29,183,814.92	19.76
36	603232	格尔软件	28,739,976.80	19.46
37	300133	华策影视	27,928,941.00	18.91
38	300997	欢乐家	27,118,835.70	18.36
39	002237	恒邦股份	27,096,412.00	18.35
40	002036	联创电子	26,883,404.00	18.20
41	603918	金桥信息	26,419,862.07	17.89

42	603057	紫燕食品	25,937,786.29	17.56
43	600839	四川长虹	24,617,212.87	16.67
44	600158	中体产业	24,349,223.80	16.49
45	688158	优刻得	23,846,932.65	16.15
46	600584	长电科技	23,621,837.43	15.99
47	688579	山大地纬	23,554,861.86	15.95
48	600482	中国动力	23,190,438.00	15.70
49	300556	丝路视觉	22,630,859.25	15.32
50	601319	中国人保	22,433,134.00	15.19
51	003021	兆威机电	21,533,011.80	14.58
52	601899	紫金矿业	21,057,695.00	14.26
53	002343	慈文传媒	20,978,008.00	14.20
54	000837	秦川机床	20,958,980.00	14.19
55	603005	晶方科技	20,453,505.22	13.85
56	600640	国脉文化	19,519,177.92	13.22
57	300570	太辰光	18,914,880.00	12.81
58	601611	中国核建	18,249,342.80	12.36
59	301312	智立方	18,216,890.44	12.33
60	300291	百纳千成	17,154,412.00	11.62
61	601989	中国重工	16,124,033.00	10.92
62	600977	中国电影	15,724,672.51	10.65
63	002465	海格通信	14,534,167.18	9.84
64	601069	西部黄金	14,338,920.00	9.71
65	600271	航天信息	14,253,890.46	9.65
66	688256	寒武纪	14,241,239.62	9.64
67	002739	万达电影	13,823,710.50	9.36
68	600037	歌华有线	13,800,806.24	9.34
69	688083	中望软件	13,333,874.81	9.03
70	000559	万向钱潮	11,646,975.80	7.89
71	603103	横店影视	11,403,560.74	7.72
72	300229	拓尔思	11,314,248.16	7.66
73	600685	中船防务	11,018,623.60	7.46
74	000975	银泰黄金	10,659,219.40	7.22
75	300528	幸福蓝海	10,261,442.60	6.95
76	002384	东山精密	9,766,952.00	6.61
77	000603	盛达资源	9,118,600.00	6.17
78	688220	翱捷科技	9,051,376.16	6.13
79	000301	东方盛虹	9,005,672.00	6.10
80	002153	石基信息	8,701,385.64	5.89
81	600072	中船科技	8,180,626.38	5.54
82	001330	博纳影业	7,636,003.60	5.17
83	600085	同仁堂	7,294,706.87	4.94
84	600903	贵州燃气	7,114,709.93	4.82
85	601985	中国核电	6,982,749.00	4.73

86	600993	马应龙	6,969,000.37	4.72
87	300331	苏大维格	6,758,569.80	4.58
88	003029	吉大正元	6,492,111.00	4.40
89	601618	中国中冶	5,825,080.00	3.94
90	002283	天润工业	3,984,970.00	2.70
91	601390	中国中铁	3,536,161.00	2.39
92	300043	星辉娱乐	3,102,647.00	2.10

注：该表的累计买入金额按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300182	捷成股份	43,004,565.70	29.12
2	000066	中国长城	35,545,979.00	24.07
3	603357	设计总院	34,707,669.38	23.50
4	603918	金桥信息	33,014,917.70	22.35
5	002291	遥望科技	33,008,064.00	22.35
6	600977	中国电影	30,734,883.61	20.81
7	600633	浙数文化	30,277,030.01	20.50
8	601858	中国科传	25,196,327.66	17.06
9	688158	优刻得	24,288,537.60	16.45
10	000837	秦川机床	24,223,022.52	16.40
11	600839	四川长虹	23,580,838.52	15.97
12	300351	永贵电器	23,488,206.71	15.90
13	300570	太辰光	22,587,402.00	15.29
14	600584	长电科技	22,340,821.23	15.13
15	300426	唐德影视	22,211,100.00	15.04
16	688256	寒武纪	22,160,943.29	15.01
17	002343	慈文传媒	21,349,702.00	14.46
18	002123	梦网科技	20,824,469.92	14.10
19	300229	拓尔思	19,294,747.84	13.06
20	601899	紫金矿业	18,904,815.00	12.80
21	601611	中国核建	18,892,640.60	12.79
22	300031	宝通科技	18,595,225.71	12.59
23	300709	精研科技	16,938,288.71	11.47
24	688088	虹软科技	15,991,544.88	10.83
25	300017	网宿科技	13,686,618.00	9.27
26	600271	航天信息	13,670,685.00	9.26
27	600547	山东黄金	13,476,020.00	9.12
28	002739	万达电影	13,232,728.50	8.96
29	688039	当虹科技	13,218,107.03	8.95

30	600037	歌华有线	13,214,496.23	8.95
31	603103	横店影视	11,896,663.60	8.06
32	002465	海格通信	11,031,298.00	7.47
33	603232	格尔软件	10,001,990.00	6.77
34	688095	福昕软件	9,951,812.03	6.74
35	002384	东山精密	9,917,528.00	6.72
36	000975	银泰黄金	9,530,338.07	6.45
37	300556	丝路视觉	9,404,812.00	6.37
38	300528	幸福蓝海	9,369,251.60	6.34
39	688220	翱捷科技	9,267,973.81	6.28
40	300291	百纳千成	9,205,088.00	6.23
41	603496	恒为科技	9,054,387.07	6.13
42	688083	中望软件	8,909,403.39	6.03
43	301338	凯格精机	8,857,674.00	6.00
44	601319	中国人保	8,710,776.00	5.90
45	002153	石基信息	8,286,131.35	5.61
46	600072	中船科技	7,855,419.99	5.32
47	000997	新大陆	7,675,979.98	5.20
48	300782	卓胜微	7,581,832.20	5.13
49	600085	同仁堂	7,456,537.00	5.05
50	000603	盛达资源	7,441,152.00	5.04
51	600993	马应龙	7,217,660.69	4.89
52	300007	汉威科技	7,150,485.00	4.84
53	001330	博纳影业	7,089,588.12	4.80
54	300997	欢乐家	6,887,321.01	4.66
55	601985	中国核电	6,819,194.00	4.62
56	600640	国脉文化	6,736,427.00	4.56
57	300331	苏大维格	6,635,327.00	4.49
58	600150	中国船舶	6,290,398.00	4.26
59	301312	智立方	6,208,798.00	4.20
60	601618	中国中冶	6,180,954.00	4.19
61	688201	信安世纪	4,313,107.52	2.92
62	601318	中国平安	4,238,815.00	2.87
63	000555	神州信息	3,850,454.00	2.61
64	601390	中国中铁	3,811,659.00	2.58
65	002283	天润工业	3,696,519.00	2.50
66	300043	星辉娱乐	3,121,395.00	2.11

注：该表的累计卖出金额按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,未考虑相关交易费用。

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,383,499,596.99
卖出股票收入（成交）总额	973,625,250.44

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	92,346,470.37	4.03
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	45,445,952.24	1.98
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	137,792,422.61	6.01

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019547	16 国债 19	879,610.00	92,346,470.37	4.03
2	118003	华兴转债	190,000.00	26,931,458.90	1.18
3	128083	新北转债	51,090.00	6,720,931.49	0.29
4	127086	恒邦转债	59,729.00	5,973,397.47	0.26
5	113616	韦尔转债	50,000.00	5,820,164.38	0.25

## 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投资。

**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之一的上海电气集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会的处罚，受到上海证券交易所公开谴责。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。

**7.12.2** 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

**7.12.3 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	302,393.36
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	7,809,022.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,111,416.22

#### 7.12.4 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	113616	韦尔转债	5,820,164.38	0.25
2	118003	华兴转债	26,931,458.90	1.18
3	128083	新北转债	6,720,931.49	0.29

#### 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
金鹰红利价值混合 A	55,247	9,807.68	188,393,892.82	34.77%	353,450,897.88	65.23%
金鹰红利价值混	24,974	14,975.92	293,880,521.24	78.58%	80,128,010.83	21.42%



合 C						
合计	80,221	11,416.63	482,274,414.06	52.66%	433,578,908.71	47.34%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	金鹰红利价值混合 A	235,717.50	0.04%
	金鹰红利价值混合 C	212,142.79	0.06%
	合计	447,860.29	0.05%

## 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、基金投资和相关部门负责人持有本开放式基金	金鹰红利价值混合 A	10~50
	金鹰红利价值混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰红利价值混合 A	0
	金鹰红利价值混合 C	0
	合计	0

## 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	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
基金合同生效日（2008 年 12 月 4 日）基金份额总额	367,018,547.39	-
本报告期期初基金份额总额	52,258,498.86	28,386,952.92
本报告期基金总申购份额	693,023,205.41	478,055,612.30
减：本报告期基金总赎回份额	203,436,913.57	132,434,033.15
本报告期基金拆分变动份额	-	-

本报告期末基金份额总额	541,844,790.70	374,008,532.07
-------------	----------------	----------------

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	
海通证券	2	465,748,790.12	13.88%	433,755.61	15.68%	-
金元证券	2	368,215,474.64	10.97%	265,594.37	9.60%	-
东方财富（西藏东财）	2	352,989,587.39	10.52%	254,615.59	9.20%	-
信达证券	2	335,406,663.00	10.00%	241,926.15	8.74%	-
华创证券	2	285,246,334.96	8.50%	262,798.18	9.50%	-
中信建投证券	1	204,778,583.89	6.10%	188,662.99	6.82%	-
国海证券	1	192,504,204.67	5.74%	177,349.76	6.41%	-
国信证券	1	181,797,948.92	5.42%	167,488.20	6.05%	-
国元证券	1	166,231,694.80	4.95%	119,903.96	4.33%	-
安信证券	3	163,012,093.65	4.86%	142,318.04	5.14%	-
中信证券	2	112,782,565.89	3.36%	103,906.61	3.76%	-
财达证券	1	112,525,922.31	3.35%	104,794.61	3.79%	-
联储证券	1	103,267,808.74	3.08%	74,486.87	2.69%	-
申港证券	2	71,513,637.30	2.13%	51,582.77	1.86%	-
湘财证券	3	66,376,031.85	1.98%	47,877.22	1.73%	-
华宝证券	1	66,158,338.44	1.97%	47,719.85	1.72%	-
华西证券	1	51,033,303.51	1.52%	36,810.39	1.33%	-
东北证券	1	33,023,165.40	0.98%	23,819.49	0.86%	-
中金财富（中投证券）	1	23,036,478.76	0.69%	21,223.71	0.77%	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
江南证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-

英大证券	2	-	-	-	-	-
日信证券	2	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南 (广证)	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-

注：1、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；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。

2、金鹰基金管理有限公司托管于交通银行的所有理财产品共用交易席位。

### 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
海通证券	5,810,947.55	3.00%	-	-	-	-
金元证券	3,054,226.70	1.58%	-	-	-	-
东方财富（西	99,299,610.5	51.26%	-	-	-	-

藏东财)	4					
信达证券	9,998,659.11	5.16%	-	-	-	-
华创证券	16,620,967.84	8.58%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	6,941,484.48	3.58%	-	-	-	-
安信证券	16,914,674.47	8.73%	-	-	-	-
中信证券	29,175,758.65	15.06%	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	5,889,845.10	3.04%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-

## 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	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 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	金鹰基金管理有限公司新增方正证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-03-22
7	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 2022 年年度报告	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	金鹰基金管理有限公司部分基金新增恒泰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	2023-03-30
10	金鹰基金管理有限公司部分基金新增中山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	2023-04-06
11	金鹰基金管理有限公司新增中国银河证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-04-07
12	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 2023 年一季度报告	证监会规定媒介	2023-04-21

13	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
14	金鹰基金管理有限公司新增江海证券有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-04-27
15	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增广发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	2023-05-08
16	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
17	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
18	金鹰基金管理有限公司新增安信证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-05-17
19	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
20	金鹰基金管理有限公司新增万家财富基金销售(天津)有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-05-25
21	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
22	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
23	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金(金鹰红利价值混合 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2023-06-01
24	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金(金鹰红利价值混合 C)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2023-06-01
25	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
26	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

27	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
28	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
29	金鹰基金管理有限公司新增财通证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-06-27
30	金鹰基金管理有限公司新增中信建投证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额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	2023-06-29
31	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1月3日至 2023年2月15日	21,047,098. 38	303,000,792 .44	5,804,504.3 0	318,243,386. 52	34.75 %
	2	2023年6月16日至 2023年6月30日	21,047,098. 38	303,000,792 .44	5,804,504.3 0	318,243,386. 52	34.75 %
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</p>							



动性风险：

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。

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。

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

### 12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

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

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人客户服务中心，客户服务中心电话：

4006-135-888 或 020-83936180。

金鹰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日