

金鹰主题优势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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况.....	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	47
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.....	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
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.....	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	53

7.12 投资组合报告附注.....	54
§8 基金份额持有人信息.....	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	55
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	56
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
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.....	57
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	57
10.9 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
11.1 影响投资者决策的其他重要信息.....	62
§12 备查文件目录.....	62
12.1 备查文件目录.....	62
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰主题优势混合型证券投资基金
基金简称	金鹰主题优势混合
基金主代码	210005
交易代码	210005
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010 年 12 月 20 日
基金管理人	金鹰基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	137,691,087.38 份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

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

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
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）
本期已实现收益	-11,177,660.13
本期利润	-28,206,235.19
加权平均基金份额本期利润	-0.2074
本期加权平均净值利润率	-9.39%
本期基金份额净值增长率	-9.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	139,441,157.79
期末可供分配基金份额利润	1.0127
期末基金资产净值	277,132,245.17
期末基金份额净值	2.013
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	101.30%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）

扣除相关费用和信用减值损失后的余额；

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.05%	0.87%	1.02%	0.65%	-0.97%	0.22%
过去三个月	-10.01%	0.79%	-3.37%	0.62%	-6.64%	0.17%
过去六个月	-9.41%	0.80%	0.25%	0.63%	-9.66%	0.17%
过去一年	-18.27%	0.96%	-9.74%	0.74%	-8.53%	0.22%
过去三年	5.50%	1.68%	-1.92%	0.90%	7.42%	0.78%
自基金合同生效起至今	101.30%	1.69%	35.91%	1.04%	65.39%	0.65%

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰主题优势混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2010 年 12 月 20 日至 2023 年 6 月 30 日）



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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 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	2022-04-26	-	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。
潘李剑	本基金的基金经理助理	2019-07-11	2023-03-29	10	潘李剑先生，西南财经大学金融学硕士，2014年12月加入金鹰基金管理有限公司，曾任行业研究员、消费行业研究组长、研究部总经理助理等职务，现任权益研究部基金经理。
李龙杰	本基金的基金经理助理	2023-03-29	-	6	李龙杰先生，西南财经大学经济学硕士，2017年7月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究员职务。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“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》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合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 板块表示亮眼，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：其一是一年初市场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。

年初以来，本产品主要以“自上而下”的宏观视角及经济将步入疫后修复期的基本逻辑判断来寻找可能的投资机会。策略层面，则以总体积极和兼顾均衡（即平衡消费与成长）的“哑铃型”操作作为本产品的主要应对策略。同时，基于对自身能力圈和投资风格的客观评估，实际较少参与到今年 A 股市场主题热点的捕捉之中。在这样的策略选择下，本产品净值表现阶段性落后于产品基准。对此，基金经理谨表示真诚的歉意。

观察到 A 股市场交易层面今年以来出现的较大风格变化，至二季度时段，我们在产品组合上实际也做了一定程度的微调：其一，适当增加了新能源车方向的布局。我们认为，尽管年初该行业一度出现过度价格战的激烈场面，但随着需求的逐步好转和供给层面的结构性出清，行业格局已开始出现显著好转迹象。这其中，主动适应调整、新品储备较多且产品拥有较高性价比的困境反转型企业可能具备相对较大的估值弹性。其二，面对人工智能技术未来广阔的发展前景以及当前“0-1”发展阶段的巨大不确定性，我们重点选择了相对具备业绩支撑、新技术已能发挥重要应用并能显著提高效率，及具有“卖铲人”特点的算力领域有相对成熟应用和稳健前景的公司。其三，在大国博弈当前依然激烈且未来可能长期存在的场景下，适当增配跟“国防安全”相关的 A 股优质品种。

对于本产品前期已有重点布局的偏复苏方向的泛消费品种，报告期内我们仍然主要选择了坚守。诚然，今年（尤其二季度）以来的国内经济复苏情况的确相对偏弱，但整体上看，步入疫后复苏的大趋势并未被彻底颠覆。过去 3 年疫情“疤痕”效应的深刻影响下，企业和居民端信心的重建过程虽然更为曲折漫长，但大致的方向依然是相对明确的，相关标的从中期的投资维度看依然值得坚守。另外，基于长期处于低估阶段的金融板块可能面临疫后经济修复期政策利好推动下的业绩估值双轮驱动的预判，我们也持续在该板块保持有相对积极的仓位配置。

7 月下旬政治局召开的重要会议从政策层面给予了更多的有效指引，并值得从 A 股投资层面做

更关键审慎的重新评估。在房地产政策优化、活跃资本市场及一揽子化债等投资者关注的重要领域的超预期表述，或将成为下阶段 A 股市场重要的政策催化。我们预期，在保持定力和坚持高质量发展的同时，政策端中短期内可望在相关领域持续发力，以切实有效提振信心、提振内需，推动国内经济更平稳修复。由此，或将对今年以来的市场格局和风格演变带来新的阶段性变化和机会。

总体而言，本基金经理将继续保持较为积极的心态和谨慎应对的操作，密切关注并及时跟踪重要政策、宏观经济的适时变化，不断审视和优化投资组合，力图尽可能多地通过与优质企业共同成长而非存量博弈的方式来获取相对稳定的投资业绩，回报投资者的信任和支持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值为 2.013 元，本报告期基金净值增长率为-9.41%，同期业绩比较基准增长率为 0.25%。

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、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。

行业配置上，我们将继续以均衡布局稳妥应对可能的市场轮动。短期，顺周期相对收益或更明显。今年以来受制于经济修复动能不足而股价表现显著滞后的消费（白酒/医药/医美/保险）和地产

链（厨电/消费建材/家装家居）等顺周期板块，以及“活跃资本市场”政策预期发酵下的大金融（券商/保险/银行），或将较大程度受益于政策博弈下的预期修复以及汇率压力和外资流向方面的转好态势而持续迎来阶段性回暖。中期看，经济弱复苏大环境下，数字经济、机器人、航天航空、半导体、创新药等科技成长方向都是自主可控发展的重要领域。我们也将利用季度内有望出现风格较大变化的可能机会，适时从中寻找和挖掘值得中长期关注的高价值方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对金鹰基金管理有限公司编制和披露的金鹰主题优势混合型证券投资基金 2023 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

报告截止日：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
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	16,666,324.82	15,463,405.50
结算备付金		288,047.07	113,164.28
存出保证金		22,975.06	37,790.01
交易性金融资产	6.4.7.2	261,583,896.03	291,268,998.18

其中：股票投资		261,583,896.03	289,749,736.95
基金投资		-	-
债券投资		-	1,519,261.23
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		393,316.73	-
应收股利		-	-
应收申购款		170,587.45	114,620.34
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		279,125,147.16	306,997,978.31
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,038,850.89	-
应付赎回款		161,206.32	99,069.60
应付管理人报酬		345,150.97	399,172.49
应付托管费		57,525.16	66,528.75
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	390,168.65	441,229.69
负债合计		1,992,901.99	1,006,000.53
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	137,691,087.38	137,684,657.55
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	139,441,157.79	168,307,320.23
净资产合计		277,132,245.17	305,991,977.78
负债和净资产总计		279,125,147.16	306,997,978.31

注：截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日，本基金基金份额净值为 2.013 元，基金份额总额为 137,691,087.38 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：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
一、营业总收入		-25,517,581.45	-44,738,641.27
1.利息收入		30,620.78	83,323.63
其中：存款利息收入	6.4.7.9	30,345.69	77,635.89
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		275.09	5,687.74
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-8,534,341.76	-13,209,152.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-11,001,219.36	-14,716,033.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	9,655.45	627.38
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,457,222.15	1,506,252.74
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-17,028,575.06	-31,659,061.95
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	14,714.59	46,249.93
减：二、营业总支出		2,688,653.74	3,061,377.78
1. 管理人报酬		2,239,565.97	2,554,939.02
2. 托管费		373,261.01	425,823.16
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	2.25
8. 其他费用	6.4.7.19	75,826.76	80,613.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-28,206,235.19	-47,800,019.05
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-28,206,235.19	-47,800,019.05

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-28,206,235.19	-47,800,019.05

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金鹰主题优势混合型证券投资基金

本报告期：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）	137,684,657.55	-	168,307,320.23	305,991,977.78
二、本期期初净资产（基金净值）	137,684,657.55	-	168,307,320.23	305,991,977.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,429.83	-	-28,866,162.44	-28,859,732.61
（一）、综合收益总额	-	-	-28,206,235.19	-28,206,235.19
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	6,429.83	-	-659,927.25	-653,497.42
其中：1.基金申购款	10,253,975.16	-	11,921,837.97	22,175,813.13
2.基金赎回款	-10,247,545.33	-	-12,581,765.22	-22,829,310.55
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	137,691,087.38	-	139,441,157.79	277,132,245.17
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	150,598,193.90	-	267,093,190.90	417,691,384.8

产（基金净值）				0
二、本期期初净资产（基金净值）	150,598,193.90	-	267,093,190.90	417,691,384.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,924,196.14	-	-49,531,892.19	-51,456,088.33
（一）、综合收益总额	-	-	-47,800,019.05	-47,800,019.05
（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）	-1,924,196.14	-	-1,731,873.14	-3,656,069.28
其中：1.基金申购款	17,446,397.03	-	22,582,214.70	40,028,611.73
2.基金赎回款	-19,370,593.17	-	-24,314,087.84	-43,684,681.01
（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）	148,673,997.76	-	217,561,298.71	366,235,296.47

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰主题优势混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行和上市交易的股票（含存托凭

证)、债券、权证,以及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。股票资产占基金总资产的比例为 60%~95%,其中,不低于 80%的股票资产将配置于投资主题驱动下的行业与上市公司,债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金总资产的 5%~40%,其中,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,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 会计年度

本基金会计年度采用公历年度,即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征,在初始确认时将金融资产分为不同类别:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（a）金融工具的初始确认

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

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

（b）金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（c）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利

率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于该次可供分配利润的 20%，若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；

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

- 4、每一基金份额享有同等分配权；
- 5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

6.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

6.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

6.4.4.14 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[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税

[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

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

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

2018 年 1 月 1 日（含）以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，

暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

(e) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 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	16,666,324.82
等于：本金	16,664,871.57
加：应计利息	1,453.25
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	16,666,324.82

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	300,884,235.95	-	261,583,896.03	-39,300,339.92
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	300,884,235.95		-	261,583,896.03
				-39,300,339.92

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	219.66
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	115,565.23
其中：交易所市场	115,565.23
银行间市场	-
应付利息	-
审计费用	14,876.39
预提信息披露费	259,507.37

合计	390,168.65
----	------------

6.4.7.7 实收基金

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	137,684,657.55	137,684,657.55
本期申购	10,253,975.16	10,253,975.16
本期赎回（以“-”号填列）	-10,247,545.33	-10,247,545.33
本期末	137,691,087.38	137,691,087.38

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	246,718,073.66	-78,410,753.43	168,307,320.23
本期利润	-11,177,660.13	-17,028,575.06	-28,206,235.19
本期基金份额交易产生的变动数	-86,657.03	-573,270.22	-659,927.25
其中：基金申购款	18,140,958.44	-6,219,120.47	11,921,837.97
基金赎回款	-18,227,615.47	5,645,850.25	-12,581,765.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	235,453,756.50	-96,012,598.71	139,441,157.79

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
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	1,011.94
其他	198.85
合计	30,345.69

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
减：卖出股票成本总额	121,411,327.33
减：交易费用	314,531.53
买卖股票差价收入	-11,001,219.36

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	9,960.45
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-305.00
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	9,655.45

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	1,732,980.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,700,305.00
减：应计利息总额	32,980.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-305.00

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**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,457,222.15
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,457,222.15

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	-17,028,575.06
——股票投资	-17,029,580.06
——债券投资	1,005.00
——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	-17,028,575.06

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	12,973.29
转换费收入	1,741.30
合计	14,714.59

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	14,876.39
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,443.00
合计	75,826.76

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无需披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

- 1、本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。
- 2、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。
- 3、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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
当期发生的基金应支付的管理费	2,239,565.97	2,554,939.02
其中：支付销售机构的客户维护费	866,106.13	979,255.83

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；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

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1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	373,261.01	425,823.16

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；由基金托管人于次月前两个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 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
基金合同生效日（2010年12月20日）持有的基金份额	0.00	0.00
报告期初持有的基金份额	729,261.41	729,261.41
报告期间申购/买入总份额	0.00	0.00
报告期间因拆分变动份额	0.00	0.00
减：报告期间赎回/卖出总份额	0.00	0.00
报告期末持有的基金份额	729,261.41	729,261.41
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.53%	0.49%

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 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	1,896,870.92	1.38%	1,896,870.92	1.38%

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
中国工商银行股份有限公司	16,666,324.82	29,134.90	19,845,437.02	70,499.88

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；本基金本报告期末清算备付金余额为 288,047.07 元，清算备付金利息收入为 1,011.94 元；上年度可比期间清算备付金期末余额为 210,629.40 元，清算备付金利息收入为 5,769.30 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**

本基金报告期内无其他需说明的关联交易事项。

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	99.00	15,085.62	13,461.03	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	网下配售锁定	245.56	122.11	73.00	12,032.44	8,914.03	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	网下配售锁定	135.80	120.41	103.00	13,987.40	12,402.23	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	网下配售锁定	125.80	118.03	71.00	8,931.80	8,380.13	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	网下配售锁定	76.80	107.95	141.00	10,828.80	15,220.95	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	网下配售锁定	75.00	90.76	114.00	8,550.00	10,346.64	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	网下配售锁定	125.88	86.79	75.00	9,441.00	6,509.25	-
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	网下配售锁定	67.28	65.43	186.00	12,514.08	12,169.98	-
68836	中科	2023-0	6 个月	网下	23.60	64.67	230.00	5,428.	14,874	-

1	飞测	5-12		配售 锁定				00	.10	
30123 2	飞沃 科技	2023-0 6-08	6 个月	网下 配售 锁定	72.50	58.42	132.00	9,570. 00	7,711. 44	-
68860 3	天承 科技	2023-0 6-30	1 个月 内 (含)	网下 新股 中签	55.00	55.00	1,391. 00	76,505 .00	76,505 .00	-
68854 3	国科 军工	2023-0 6-14	6 个月	网下 配售 锁定	43.67	53.05	185.00	8,078. 95	9,814. 25	-
68853 5	华海 诚科	2023-0 3-28	6 个月	网下 配售 锁定	35.00	51.23	153.00	5,355. 00	7,838. 19	-
30131 5	威士 顿	2023-0 6-13	6 个月	网下 配售 锁定	32.29	51.12	226.00	7,297. 54	11,553 .12	-
30121 0	金杨 股份	2023-0 6-21	6 个月	网下 配售 锁定	57.88	49.17	168.00	9,723. 84	8,260. 56	-
30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	6 个月	网下 配售 锁定	73.45	46.64	116.00	8,520. 20	5,410. 24	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	网下 配售 锁定	23.77	42.89	290.00	6,893. 30	12,438 .10	-
30139 7	溯联 股份	2023-0 6-15	6 个月	网下 配售 锁定	53.27	40.20	197.00	10,494 .19	7,919. 40	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	1 个月 内 (含)	网下 新股 中签	36.90	36.90	1,748. 00	64,501 .20	64,501 .20	-
30138 3	天键 股份	2023-0 5-31	6 个月	网下 配售 锁定	46.16	35.72	290.00	13,386 .40	10,358 .80	-
30117 0	锡南 科技	2023-0 6-16	6 个月	网下 配售 锁定	34.00	34.93	203.00	6,902. 00	7,090. 79	-
30122 5	恒勃 股份	2023-0 6-08	6 个月	网下 配售 锁定	35.66	33.26	293.00	10,448 .38	9,745. 18	-
00128 2	三联 锻造	2023-0 5-15	6 个月	网下 配售 锁定	27.93	33.03	100.00	2,793. 00	3,303. 00	-

300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	网下配售锁定	42.45	32.97	226.00	9,593.70	7,451.22	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	网下配售锁定	33.73	31.85	277.00	9,343.21	8,822.45	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	网下配售锁定	28.84	30.78	149.00	4,297.16	4,586.22	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	网下配售锁定	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	网下配售锁定	25.28	29.87	228.00	5,763.84	6,810.36	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	网下配售锁定	33.99	29.49	208.00	7,069.92	6,133.92	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	网下配售锁定	37.88	29.49	468.00	17,727.84	13,801.32	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	网下新股中签	26.68	26.68	3,680.00	98,182.40	98,182.40	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	网下新股中签	25.82	25.82	2,209.00	57,036.38	57,036.38	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	网下配售锁定	19.20	25.53	327.00	6,278.40	8,348.31	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	网下配售锁定	30.22	25.50	383.00	11,574.26	9,766.50	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	网下配售锁定	20.68	25.49	114.00	2,357.52	2,905.86	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	网下配售锁定	30.26	25.33	292.00	8,835.92	7,396.36	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	网下配售锁定	25.98	24.53	98.00	2,546.04	2,403.94	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	网下配售	21.86	23.85	423.00	9,246.78	10,088.55	-

				锁定						
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	网下配售锁定	21.17	23.50	383.00	8,108.11	9,000.50	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	网下配售锁定	24.66	22.51	343.00	8,458.38	7,720.93	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	网下配售锁定	12.68	22.31	598.00	7,582.64	13,341.38	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	网下配售锁定	25.25	19.69	381.00	9,620.25	7,501.89	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	网下配售锁定	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	网下配售锁定	20.92	19.16	401.00	8,388.92	7,683.16	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	网下配售锁定	17.80	17.89	304.00	5,411.20	5,438.56	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	网下配售锁定	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	网下配售锁定	11.10	17.04	1,037.00	11,510.70	17,670.48	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	网下配售锁定	19.99	16.90	430.00	8,595.70	7,267.00	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	网下配售锁定	14.16	16.21	608.00	8,609.28	9,855.68	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	网下配售锁定	10.68	12.34	767.00	8,191.56	9,464.78	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	网下配售锁定	11.66	12.26	323.00	3,766.18	3,959.98	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	网下配售锁定	10.36	11.84	298.00	3,087.28	3,528.32	-
00128	陕西	2023-0	6 个月	网下	9.60	9.41	3,767.	36,163	35,447	-

6	能源	3-31		配售 锁定			00	.20	.47	
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月	网下 配售 锁定	5.69	5.41	2,829. 00	16,097 .01	15,304 .89	-

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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、结算备付金等。本基金管理人每日对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	16,666,324.82	-	-	-	16,666,324.82
结算备付金	288,047.07	-	-	-	288,047.07
存出保证金	22,975.06	-	-	-	22,975.06
交易性金融资产	-	-	-	261,583,896.03	261,583,896.03
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	393,316.73	393,316.73
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	170,587.45	170,587.45
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	16,977,346.95	-	-	262,147,800.21	279,125,147.16
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	-	-	-	1,038,850.89	1,038,850.89
应付赎回款	-	-	-	161,206.32	161,206.32
应付管理人报酬	-	-	-	345,150.97	345,150.97
应付托管费	-	-	-	57,525.16	57,525.16
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	390,168.65	390,168.65
负债总计	-	-	-	1,992,901.99	1,992,901.99
利率敏感度缺口	16,977,346.95	-	-	260,154,898.22	277,132,245.17
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	15,463,405.50	-	-	-	15,463,405.50
结算备付金	113,164.28	-	-	-	113,164.28
存出保证金	37,790.01	-	-	-	37,790.01
交易性金融资产	1,519,261.23	-	-	289,749,736.95	291,268,998.18
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	114,620.34	114,620.34
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	17,133,621.02	-	-	289,864,357.29	306,997,978.31
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	-	-	-	99,069.60	99,069.60
应付管理人报酬	-	-	-	399,172.49	399,172.49
应付托管费	-	-	-	66,528.75	66,528.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	441,229.69	441,229.69
负债总计	-	-	-	1,006,000.53	1,006,000.53
利率敏感度缺口	17,133,621.02	-	-	288,858,356.76	305,991,977.78

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 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	利率上升 25 个基点	-	-1,171.70
	利率下降 25 个基点	-	1,175.38

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	261,583,896.03	94.39	289,749,736.95	94.69
交易性金融资产—债券投资	0.00	0.00	-	-
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	261,583,896.03	94.39	289,749,736.95	94.69

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 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%	16,073,465.86	17,702,579.88

	业绩比较基准变动-5%	-16,073,465.86	-17,702,579.88
--	-------------	----------------	----------------

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	260,830,632.30	289,000,417.35
第二层次	296,224.98	1,519,261.23
第三层次	457,038.75	749,319.60
合计	261,583,896.03	291,268,998.18

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	261,583,896.03	93.72
	其中：股票	261,583,896.03	93.72
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	16,954,371.89	6.07
8	其他各项资产	586,879.24	0.21
9	合计	279,125,147.16	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	14,777,720.00	5.33
B	采矿业	6,548,680.00	2.36
C	制造业	147,796,060.61	53.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.01

E	建筑业	6,335.49	0.00
F	批发和零售业	38,080.63	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	3,951,000.00	1.43
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	27,809,218.54	10.03
J	金融业	34,847,230.00	12.57
K	房地产业	5,843,536.00	2.11
L	租赁和商务服务业	8,599,234.00	3.10
M	科学研究和技术服务业	2,601,237.06	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	84,715.23	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	3,750,600.00	1.35
Q	卫生和社会工作	4,104,921.00	1.48
R	文化、体育和娱乐业	789,880.00	0.29
S	综合	-	-
	合计	261,583,896.03	94.39

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	12,300	20,799,300.00	7.51
2	600276	恒瑞医药	297,100	14,231,090.00	5.14
3	002376	新北洋	1,708,000	13,783,560.00	4.97
4	300738	奥飞数据	1,065,590	10,869,018.00	3.92
5	601658	邮储银行	2,202,500	10,770,225.00	3.89
6	600132	重庆啤酒	110,600	10,192,896.00	3.68
7	002714	牧原股份	238,600	10,056,990.00	3.63
8	601633	长城汽车	363,800	9,156,846.00	3.30
9	688066	航天宏图	143,800	8,757,420.00	3.16
10	601456	国联证券	956,100	8,700,510.00	3.14
11	601888	中国中免	77,800	8,599,234.00	3.10
12	002756	永兴材料	116,090	7,268,394.90	2.62

13	300059	东方财富	459,320	6,522,344.00	2.35
14	000001	平安银行	536,700	6,027,141.00	2.17
15	002353	杰瑞股份	232,600	5,845,238.00	2.11
16	000002	万科A	416,800	5,843,536.00	2.11
17	600570	恒生电子	125,980	5,579,654.20	2.01
18	002304	洋河股份	42,300	5,556,105.00	2.00
19	002466	天齐锂业	68,900	4,816,799.00	1.74
20	688180	君实生物	122,000	4,701,880.00	1.70
21	603477	巨星农牧	138,800	4,628,980.00	1.67
22	600809	山西汾酒	22,800	4,219,596.00	1.52
23	000516	国际医学	488,100	4,104,921.00	1.48
24	688676	金盘科技	128,000	3,877,120.00	1.40
25	600988	赤峰黄金	284,900	3,834,754.00	1.38
26	002607	中公教育	798,000	3,750,600.00	1.35
27	300681	英搏尔	169,435	3,607,271.15	1.30
28	002460	赣锋锂业	56,000	3,413,760.00	1.23
29	300124	汇川技术	46,600	2,992,186.00	1.08
30	300760	迈瑞医疗	9,800	2,938,040.00	1.06
31	002179	中航光电	59,020	2,676,557.00	0.97
32	603811	诚意药业	204,260	2,538,951.80	0.92
33	301096	百诚医药	41,326	2,504,768.86	0.90
34	000768	中航西飞	83,600	2,236,300.00	0.81
35	600760	中航沈飞	44,240	1,990,800.00	0.72
36	688516	奥特维	10,331	1,946,360.40	0.70
37	000425	徐工机械	276,300	1,870,551.00	0.67
38	300750	宁德时代	7,830	1,791,425.70	0.65
39	603712	七一二	56,700	1,712,907.00	0.62
40	600030	中信证券	80,300	1,588,334.00	0.57
41	605123	派克新材	13,200	1,434,180.00	0.52
42	601901	方正证券	189,400	1,238,676.00	0.45
43	002738	中矿资源	23,688	1,206,666.72	0.44
44	688599	天合光能	28,300	1,205,863.00	0.44
45	300775	三角防务	34,000	1,148,520.00	0.41
46	688378	奥来德	21,149	1,044,760.60	0.38
47	300629	新劲刚	49,920	1,029,849.60	0.37
48	601857	中国石油	137,000	1,023,390.00	0.37
49	688507	索辰科技	7,520	981,715.64	0.35
50	601006	大秦铁路	131,300	975,559.00	0.35
51	600028	中国石化	152,700	971,172.00	0.35
52	601000	唐山港	272,800	962,984.00	0.35
53	000059	华锦股份	143,700	903,873.00	0.33
54	300596	利安隆	20,700	841,869.00	0.30
55	300144	宋城演艺	63,700	789,880.00	0.29
56	688343	云天励飞	12,300	782,403.00	0.28

57	002737	葵花药业	29,800	725,332.00	0.26
58	600938	中国海油	39,700	719,364.00	0.26
59	301269	华大九天	5,800	712,472.00	0.26
60	601012	隆基绿能	22,798	653,618.66	0.24
61	688239	航宇科技	7,800	545,610.00	0.20
62	688172	燕东微	21,800	518,404.00	0.19
63	600377	宁沪高速	52,300	514,109.00	0.19
64	001965	招商公路	53,200	510,720.00	0.18
65	600012	皖通高速	47,800	500,944.00	0.18
66	601333	广深铁路	122,900	486,684.00	0.18
67	688768	容知日新	3,848	307,339.76	0.11
68	002917	金奥博	24,300	300,348.00	0.11
69	301198	喜悦智行	19,100	289,938.00	0.10
70	688332	中科蓝讯	1,878	157,151.04	0.06
71	301276	嘉曼服饰	5,636	143,718.00	0.05
72	301395	仁信新材	3,680	98,182.40	0.04
73	688459	哈铁科技	9,965	96,062.60	0.03
74	301356	天振股份	4,194	91,848.60	0.03
75	300498	温氏股份	5,000	91,750.00	0.03
76	301335	天元宠物	3,678	87,683.52	0.03
77	301365	矩阵股份	5,262	86,612.52	0.03
78	301210	金杨股份	1,680	85,871.52	0.03
79	688370	丛麟科技	2,033	77,213.34	0.03
80	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.03
81	688163	赛伦生物	3,487	74,447.45	0.03
82	688623	双元科技	750	68,521.50	0.02
83	688479	友车科技	2,074	64,856.94	0.02
84	301261	恒工精密	1,748	64,501.20	0.02
85	301309	万得凯	2,271	62,543.34	0.02
86	301202	朗威股份	2,209	57,036.38	0.02
87	301376	致欧科技	1,624	38,080.63	0.01
88	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.01
89	688472	阿特斯	1,037	17,670.48	0.01
90	688469	中芯集成	2,829	15,304.89	0.01
91	301325	曼恩斯特	141	15,220.95	0.01
92	688361	中科飞测	230	14,874.10	0.01
93	688443	智翔金泰	468	13,801.32	0.00
94	688531	日联科技	99	13,461.03	0.00
95	688562	航天软件	598	13,341.38	0.00
96	300634	彩讯股份	500	13,200.00	0.00
97	301358	湖南裕能	290	12,438.10	0.00
98	688576	西山科技	103	12,402.23	0.00
99	301310	鑫宏业	186	12,169.98	0.00
100	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00

101	301383	天键股份	290	10,358.80	0.00
102	688458	美芯晟	114	10,346.64	0.00
103	688523	航天环宇	423	10,088.55	0.00
104	688334	西高院	608	9,855.68	0.00
105	688543	国科军工	185	9,814.25	0.00
106	301262	海看股份	383	9,766.50	0.00
107	301225	恒勃股份	293	9,745.18	0.00
108	688620	安凯微	767	9,464.78	0.00
109	688552	航天南湖	383	9,000.50	0.00
110	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
111	688581	安杰思	71	8,380.13	0.00
112	688429	时创能源	327	8,348.31	0.00
113	301397	溯联股份	197	7,919.40	0.00
114	688535	华海诚科	153	7,838.19	0.00
115	301232	飞沃科技	132	7,711.44	0.00
116	688512	慧智微	401	7,683.16	0.00
117	301305	朗坤环境	381	7,501.89	0.00
118	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
119	688570	天玛智控	292	7,396.36	0.00
120	301439	泓淋电力	430	7,267.00	0.00
121	301170	锡南科技	203	7,090.79	0.00
122	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
123	688631	莱斯信息	228	6,810.36	0.00
124	603135	中重科技	304	5,438.56	0.00
125	301345	涛涛车业	116	5,410.24	0.00
126	001380	华纬科技	149	4,586.22	0.00
127	601133	柏诚股份	323	3,959.98	0.00
128	601065	江盐集团	298	3,528.32	0.00
129	001282	三联锻造	100	3,303.00	0.00
130	001328	登康口腔	114	2,905.86	0.00
131	603125	常青科技	98	2,403.94	0.00
132	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
133	001324	长青科技	114	2,234.40	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	601633	长城汽车	10,332,013.00	3.38

2	688066	航天宏图	8,520,234.21	2.78
3	300738	奥飞数据	6,123,305.00	2.00
4	002607	中公教育	6,075,452.00	1.99
5	000516	国际医学	5,383,325.00	1.76
6	600809	山西汾酒	5,088,959.00	1.66
7	688676	金盘科技	4,153,593.55	1.36
8	600988	赤峰黄金	4,031,952.00	1.32
9	603811	诚意药业	3,347,871.00	1.09
10	000703	恒逸石化	3,043,558.00	0.99
11	600188	兖矿能源	2,911,557.00	0.95
12	000768	中航西飞	1,666,769.00	0.54
13	688343	云天励飞	1,650,803.01	0.54
14	600004	白云机场	1,607,561.00	0.53
15	603712	七一二	1,536,729.00	0.50
16	600089	特变电工	1,522,199.00	0.50
17	600132	重庆啤酒	1,429,304.00	0.47
18	601901	方正证券	1,319,258.00	0.43
19	600399	抚顺特钢	1,137,705.00	0.37
20	688507	索辰科技	1,120,131.12	0.37

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	000876	新希望	7,900,121.00	2.58
2	300681	英搏尔	7,573,616.40	2.48
3	603477	巨星农牧	5,900,036.02	1.93
4	002376	新北洋	4,764,979.58	1.56
5	600276	恒瑞医药	4,556,857.00	1.49
6	600104	上汽集团	3,838,025.00	1.25
7	600004	白云机场	3,655,700.75	1.19
8	600988	赤峰黄金	3,582,598.00	1.17
9	002990	盛视科技	3,332,547.00	1.09
10	300738	奥飞数据	3,138,889.40	1.03
11	688180	君实生物	3,068,424.69	1.00
12	600399	抚顺特钢	2,977,580.00	0.97
13	300979	华利集团	2,891,286.00	0.94
14	002607	中公教育	2,559,828.00	0.84
15	000425	徐工机械	2,516,933.00	0.82
16	600188	兖矿能源	2,473,699.00	0.81
17	000703	恒逸石化	2,377,449.00	0.78
18	002304	洋河股份	2,017,357.00	0.66
19	301050	雷电微力	1,940,376.00	0.63

20	603267	鸿远电子	1,787,846.00	0.58
----	--------	------	--------------	------

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	110,275,066.47
卖出股票收入（成交）总额	110,724,639.50

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

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,975.06
2	应收清算款	393,316.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	170,587.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	586,879.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构	
		机构投资者	个人投资者

		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
33,868	4,065.52	21,058,308.98	15.29%	116,632,778.40	84.71%

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	185,022.96	0.13%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	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

基金合同生效日（2010年12月20日）基金份额总额	2,051,271,200.80
本报告期期初基金份额总额	137,684,657.55

本报告期基金总申购份额	10,253,975.16
减：本报告期基金总赎回份额	10,247,545.33
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	137,691,087.38

§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

为进一步维护基金份额持有人的利益，促进会计师事务所提供更优质的服务，本基金于 2023 年 1 月 12 日将为基金提供审计服务的会计师事务所由中审众环会计师事务所（特殊普通合伙）变更为大华会计师事务所（特殊普通合伙），该变更事项已经履行了必要的程序。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券	3	55,513,203.28	25.76%	40,041.02	21.60%	-
兴业证券	1	52,734,770.63	24.47%	48,584.97	26.21%	-
天风证券	4	36,810,438.83	17.08%	33,913.79	18.30%	-
安信证券	2	31,564,386.08	14.65%	29,080.83	15.69%	-
粤开证券（联讯）	1	17,880,085.76	8.30%	16,472.96	8.89%	-
国联证券	1	8,275,905.51	3.84%	5,969.55	3.22%	-
长江证券	1	7,548,805.17	3.50%	6,954.52	3.75%	-
山西证券	1	2,331,573.57	1.08%	1,681.82	0.91%	-
国新证券（华融）	4	2,206,835.38	1.02%	2,032.64	1.10%	-
西南证券	2	659,655.81	0.31%	607.78	0.33%	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券（财富）	1	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-

东北证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	6	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	3	-	-	-	-	-
中泰证券（齐 鲁）	5	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富（中 投证券）	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	2	-	-	-	-	退租 1 个
大同证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券（上 海华信证券）	1	-	-	-	-	-

华福证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	6	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南 (广证)	3	-	-	-	-	-
五矿证券	4	-	-	-	-	-

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；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
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券（联讯）	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

山西证券	200,050.00	100.00%	-	-	-	-
国新证券（华融）	-	-	1,500,000.00	100.00%	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券（财富）	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐	-	-	-	-	-	-

鲁)						
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券（上海华信证券）	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告	证监会规定媒介	2023-01-14
2	金鹰主题优势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
3	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
4	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
5	金鹰主题优势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
6	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
7	金鹰主题优势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

8	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
9	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
10	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
11	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
12	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
13	金鹰主题优势混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2023-06-01
14	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
15	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
16	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

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准本基金发行及募集的文件。
2. 《金鹰主题优势混合型证券投资基金基金合同》。
3. 《金鹰主题优势混合型证券投资基金托管协议》。
4. 金鹰基金管理有限公司批准成立批件和营业执照。

- 5.基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6.本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日