# 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金
# 2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：国投证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 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。

基金托管人国投证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§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 ..... 7
3.1 主要会计数据和财务指标 ..... 7
3.2 基金净值表现 ..... 8
§4 管理人报告 ..... 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 ..... 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 ..... 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 ..... 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 ..... 12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 ..... 13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 ..... 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遵规守信情况声明 ..... 14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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） ..... 15
6.1 资产负债表 ..... 15
6.2 利润表 ..... 16
6.3 净资产变动表 ..... 17
6.4 报表附注 ..... 19
§7 投资组合报告 ..... 46
7.1 期末基金资产组合情况 ..... 46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 ..... 46
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 ..... 47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 ..... 48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 ..... 50
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 ..... 51
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 ..... 51
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 ..... 51

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 ..... 51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 ..... 51
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 ..... 51
7.12 投资组合报告附注 ..... 51

**§8 基金份额持有人信息 ..... 53**

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 ..... 53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 ..... 53
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 ..... 53
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 ..... 53

**§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 为基金进行审计的会计师事务所情况 ..... 56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 ..... 56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 ..... 56
10.8 其他重大事件 ..... 57

**§11 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 59**

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 ..... 59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 ..... 59

**§12 备查文件目录 ..... 60**

12.1 备查文件目录 ..... 60
12.2 存放地点 ..... 60
12.3 查阅方式 ..... 60

# §2 基金简介

## 2.1 基金基本情况

| | | |
|---|---|---|
| 基金名称 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金 | |
| 基金简称 | 鑫元成长驱动股票发起式 | |
| 基金主代码 | 017726 | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | |
| 基金合同生效日 | 2023 年 4 月 27 日 | |
| 基金管理人 | 鑫元基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 国投证券股份有限公司 | |
| 报告期末基金份额总额 | 13,899,061.32 份 | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 017726 | 017727 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 10,439,945.12 份 | 3,459,116.20 份 |

## 2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 本基金在中国经济增长的大背景下，通过对企业基本面的深入研究，重点投资未来预期成长性良好的上市公司，同时严格控制投资组合风险，力争实现基金资产的长期稳健增值。 |
| 投资策略 | 本基金的投资策略主要包括资产配置策略和个股精选策略。其中，资产配置策略用于确定大类资产配置比例以有效规避系统性风险；个股精选策略主要用于挖掘股票市场中以成长为驱动的优质上市公司。 |
| 业绩比较基准 | 中证 500 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+银行活期存款利率（税后）*20% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。<br>本基金如果投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。 |

## 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 | | 鑫元基金管理有限公司 | 国投证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 李晓燕 | 郭刚 |
| | 联系电话 | 021-20892000 转 | 0755-81682162 |
| | 电子邮箱 | service@xyamc.com | tgfw@essence.com.cn |
| 客户服务电话 | | 4006066188 | - |
| 传真 | | 021-20892111 | - |
| 注册地址 | | 上海市静安区中山北路 909 号 | 深圳市福田区福华一路 119 号 |

| | | |
|---|---|---|
| | 12 层 | 安信金融大厦 |
| 办公地址 | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层 | 深圳市福田区福华一路 119 号安信金融大厦 15 层资产托管部 |
| 邮政编码 | 200070 | 518038 |
| 法定代表人 | 龙艺 | 段文务 |

## 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 | http://www.xyamc.com |
| 基金中期报告备置地点 | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层　鑫元基金管理有限公司 |

## 2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|---|---|---|
| 注册登记机构 | 鑫元基金管理有限公司 | 上海市静安区中山北路 909 号 12 层 |

# §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期(2024 年 1 月 1 日-2024 年 6 月 30 日) | |
|---|---|---|
| | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C |
| 本期已实现收益 | -962,844.64 | -304,906.10 |
| 本期利润 | -1,199,026.49 | -380,531.22 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1135 | -0.1153 |
| 本期加权平均净值利润率 | -14.19% | -14.48% |
| 本期基金份额净值增长率 | -13.27% | -13.44% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| 期末可供分配利润 | -2,696,875.87 | -906,025.94 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.2583 | -0.2619 |
| 期末基金资产净值 | 7,743,069.25 | 2,553,090.26 |
| 期末基金份额净值 | 0.7417 | 0.7381 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) | |
| 基金份额累计净值增长率 | -25.83% | -26.19% |

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（3）期末可供分配利润为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。

## 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

鑫元成长驱动股票发起式 A

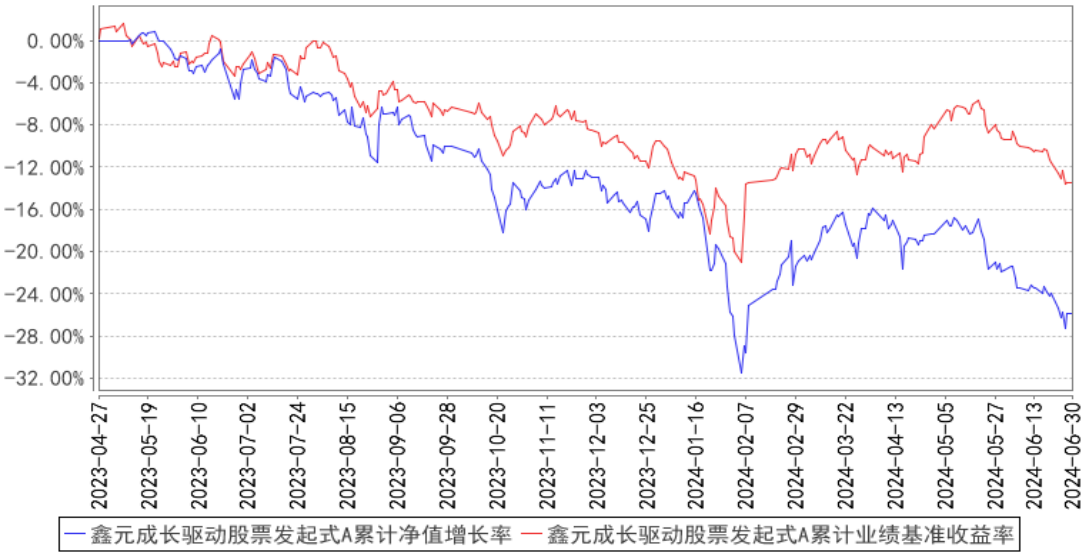
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -5.12% | 0.98% | -4.53% | 0.59% | -0.59% | 0.39% |
| 过去三个月 | -9.72% | 1.11% | -2.45% | 0.81% | -7.27% | 0.30% |
| 过去六个月 | -13.27% | 1.61% | -4.32% | 1.13% | -8.95% | 0.48% |
| 过去一年 | -23.76% | 1.33% | -11.52% | 0.93% | -12.24% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -25.83% | 1.27% | -13.46% | 0.90% | -12.37% | 0.37% |

鑫元成长驱动股票发起式 C

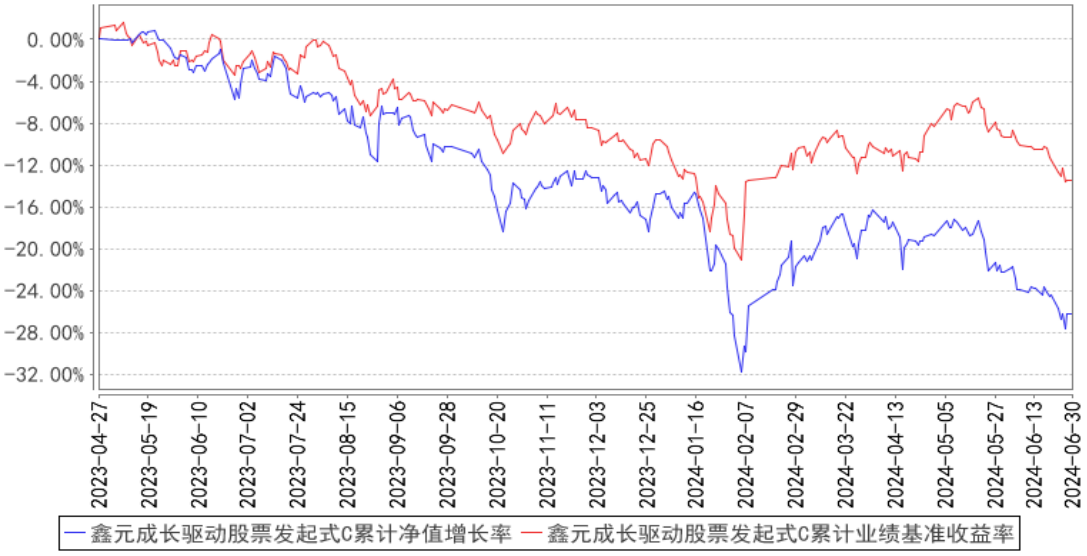
| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | -5.15% | 0.99% | -4.53% | 0.59% | -0.62% | 0.40% |
| 过去三个月 | -9.81% | 1.11% | -2.45% | 0.81% | -7.36% | 0.30% |
| 过去六个月 | -13.44% | 1.61% | -4.32% | 1.13% | -9.12% | 0.48% |
| 过去一年 | -24.07% | 1.33% | -11.52% | 0.93% | -12.55% | 0.40% |
| 自基金合同生效起至今 | -26.19% | 1.27% | -13.46% | 0.90% | -12.73% | 0.37% |

### 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

鑫元成长驱动股票发起式A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图




鑫元成长驱动股票发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图




注：本基金的合同生效日为 2023 年 4 月 27 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

# §4 管理人报告

## 4.1 基金管理人及基金经理情况

### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可[2013]1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建；注册资本金 17 亿元人民币，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 73 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金、鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金、鑫元泽利债券型证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元一年定期开放中高等级债券型证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安硕两年定期开放债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、鑫元鑫动力混合型证券投资基金、鑫元金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、鑫元清洁能源产业混合型发起式证券投资基金、鑫元健康产业混合型发起式证券投资基金、鑫元皓利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元长三角区域主题

混合型证券投资基金、鑫元悦享 60 天滚动持有中短债债券型证券投资基金、鑫元专精特新企业精选主题混合型证券投资基金、鑫元晟利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕丰债券型证券投资基金、鑫元惠丰纯债债券型证券投资基金、鑫元嘉利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元璟丰债券型证券投资基金、鑫元欣悦混合型证券投资基金、鑫元添鑫回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、鑫元消费甄选混合型发起式证券投资基金、鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金、鑫元数字经济混合型发起式证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元科技创新主题混合型证券投资基金、鑫元慧享纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、鑫元乐享 90 天持有期债券型证券投资基金、鑫元稳丰利率债债券型证券投资基金、鑫元鑫选稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、鑫元鑫选安悦 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、鑫元启丰债券型证券投资基金。

### 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 | | |
| 王夫伟 | 本基金的基金经理 | 2023 年 4 月 27 日 | - | 10 年 | 学历：金融学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。曾任宏源期货有限公司风控结算专员，2014 年 7 月加入鑫元基金担任研究员，现任基金经理。现任鑫元清洁能源产业混合型发起式证券投资基金、鑫元健康产业混合型发起式证券投资基金、鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金的基金经理。 |

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

## 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，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现有违公平交易要求的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司已制订并不断完善内部异常交易监控管理相关制度，通过系统和人工相结合的方式进行基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。

报告期内未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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 5%的情况。

## 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

上半年国内经济持续下行，复苏预期并没有兑现，利率持续下行，海外方面美国经济依然强劲，降息预期继续延后，在这种情况下，市场以防守为主，成长板块受到压制，红利资产表现较好。

从中期的维度看，目前大盘位置已经处于战略底部，尤其具备成长性的个股，中长期空间较大，可以战略布局。

本基金基于以下几个维度来精选成长性公司： 1、不过度依赖于资本开支、债务驱动能形成稳定现金流预期的企业，关注利基市场而非马太效应； 2、具有全球比较优势的产业链的一般制造业； 3、对内做 toc 拓展兼具品类升级、品牌降级的公司； 4、具有技术领先和技术突破的公司。

组合配置方面，除了成长板块，配置了一些红利资产降低组合的波动性，希望下半年可以取得较好的收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元成长驱动股票发起式 A 的基金份额净值增长率为-13.27%，同期业绩比较基准收益率为-4.32%。本报告期内鑫元成长驱动股票发起式 C 的基金份额净值增长率为-13.44%，同期

业绩比较基准收益率为-4.32%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年国内经济持续下行，复苏预期并没有兑现，利率持续下行，海外方面美国经济依然强劲，降息预期继续延后，在这种情况下，市场以防守为主，成长板块受到压制，红利资产表现较好。

## 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。估值委员会对估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、投研条线分管领导、交易部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投资部负责人、市场研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等。本公司使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序；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。公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。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债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

## 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

## 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

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

# §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，国投证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职地履行了应尽的义务。

## 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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：鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|---|
| **资 产：** | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 720,607.93 | 494,045.64 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | - |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 9,596,568.76 | 11,612,753.23 |
| 其中：股票投资 | | 8,989,216.71 | 10,797,210.00 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 607,352.05 | 815,543.23 |
| 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 | - | - |
| 债权投资 | 6.4.7.5 | - | - |
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | 6.4.7.6 | - | - |
| 其他权益工具投资 | 6.4.7.7 | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | 6,325.69 | - |
| 应收申购款 | | 518.07 | 494.07 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.8 | - | - |
| 资产总计 | | 10,324,020.45 | 12,107,292.94 |
| **负债和净资产** | **附注号** | **本期末<br>2024 年 6 月 30 日** | **上年度末<br>2023 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 | | - | - |
| 应付赎回款 | | 103.61 | 278.22 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 应付管理人报酬 | | 10,299.03 | 12,140.78 |
| 应付托管费 | | 1,716.52 | 2,023.47 |
| 应付销售服务费 | | 823.24 | 980.77 |
| 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 | 6.4.7.9 | 14,918.54 | 140,000.00 |
| 负债合计 | | 27,860.94 | 155,423.24 |
| **净资产：** | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.10 | 13,899,061.32 | 13,985,772.61 |
| 其他综合收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.12 | -3,602,901.81 | -2,033,902.91 |
| 净资产合计 | | 10,296,159.51 | 11,951,869.70 |
| 负债和净资产总计 | | 10,324,020.45 | 12,107,292.94 |

注： 报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 13,899,061.32 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.7417 元，份额总额 10,439,945.12 份；下属 C 类基金份额净值 0.7381 元，份额总额 3,459,116.20 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|---|
| **一、营业总收入** | | -1,482,420.55 | -520,415.46 |
| 1.利息收入 | | 2,238.54 | 28,537.26 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.13 | 2,238.54 | 16,690.07 |
| 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 | | - | 11,847.19 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -1,173,637.31 | -601,986.52 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.14 | -1,274,436.93 | -693,888.01 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.15 | 6,779.53 | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.17 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.18 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.19 | 94,020.09 | 91,901.49 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.20 | -311,806.97 | 42,894.49 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.21 | 785.19 | 10,139.31 |
| **减：二、营业总支出** | | 97,137.16 | 124,088.73 |
| 1．管理人报酬 | 6.4.10.2.1 | 65,995.28 | 66,571.51 |
| 其中：暂估管理人报酬 | | - | - |
| 2．托管费 | 6.4.10.2.2 | 10,999.27 | 8,876.22 |
| 3．销售服务费 | 6.4.10.2.3 | 5,217.16 | 9,084.35 |
| 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 | 6.4.7.22 | - | - |
| 7．税金及附加 | | - | - |
| 8．其他费用 | 6.4.7.23 | 14,925.45 | 39,556.65 |
| **三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）** | | -1,579,557.71 | -644,504.19 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| **四、净利润（净亏损以“-”号填列）** | | -1,579,557.71 | -644,504.19 |
| **五、其他综合收益的税后净额** | | - | - |
| **六、综合收益总额** | | -1,579,557.71 | -644,504.19 |

## 6.3 净资产变动表

会计主体：鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 一、上期期末净资产 | 13,985,772.61 | - | -2,033,902.91 | 11,951,869.70 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 13,985,772.61 | - | -2,033,902.91 | 11,951,869.70 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -86,711.29 | - | -1,568,998.90 | -1,655,710.19 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -1,579,557.71 | -1,579,557.71 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -86,711.29 | - | 10,558.81 | -76,152.48 |
| 其中：1.基金申购款 | 428,219.99 | - | -92,470.84 | 335,749.15 |
| 2.基金赎回款 | -514,931.28 | - | 103,029.65 | -411,901.63 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 13,899,061.32 | - | -3,602,901.81 | 10,296,159.51 |

| 项目 | 上年度可比期间<br>2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | - | - | - | - |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 31,051,874.70 | - | - | 31,051,874.70 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | -12,722,696.19 | - | -503,862.56 | -13,226,558.75 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -644,504.19 | -644,504.19 |
| （二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列） | -12,722,696.19 | - | 140,641.63 | -12,582,054.56 |
| 其中：1.基金申购款 | 4,557.97 | - | -142.02 | 4,415.95 |
| 2.基金赎回款 | -12,727,254.16 | - | 140,783.65 | -12,586,470.51 |
| （三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列） | - | - | - | - |
| （四）、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产 | 18,329,178.51 | - | -503,862.56 | 17,825,315.95 |

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：

| 龙艺 | 杨晓宇 | 包颖 |
|---|---|---|
| 基金管理人负责人 | 主管会计工作负责人 | 会计机构负责人 |

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]3192 号文《关于准予鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》

和《鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 31,046,666.52 元，已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61444343_B02 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 31,051,874.70 份基金份额，其中有效认购资金在初始募集期内产生利息 5,208.18 元。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为安信证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册上市的股票）、存托凭证、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、证券公司短期公司债券、可转换债券（含交易分离可转债）、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款等）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持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%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率*60%+恒生指数收益率*20%+银行活期存款利率（税后）*20%。

### 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《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（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》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本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。

### 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

本基金本报告期无会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

### 6.4.6 税项

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，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试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债

利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（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、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，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，暂不征收企业所得税。

6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[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》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款 | 349,872.50 |
| 等于：本金 | 349,760.86 |
| 加：应计利息 | 111.64 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |

| | |
|---|---|
| 减：坏账准备 | - |
| 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 | 370,735.43 |
| 等于：本金 | 370,701.92 |
| 加：应计利息 | 33.51 |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 720,607.93 |

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 9,189,548.81 | - | 8,989,216.71 | -200,332.10 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所市场 | 603,516.00 | 4,172.05 | 607,352.05 | -336.00 |
| | 银行间市场 | - | - | - | - |
| | 合计 | 603,516.00 | 4,172.05 | 607,352.05 | -336.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | | 9,793,064.81 | 4,172.05 | 9,596,568.76 | -200,668.10 |

### 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

注：无。

#### 6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

#### 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

### 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

注：无。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

#### 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

| |
|---|
| 无。 |

### 6.4.7.5 债权投资

#### 6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.6 其他债权投资

#### 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

#### 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

### 6.4.7.7 其他权益工具投资

#### 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

#### 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

### 6.4.7.8 其他资产

注：无。

### 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | - |
| 其中：交易所市场 | - |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 14,918.54 |
| 合计 | 14,918.54 |

### 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

| 鑫元成长驱动股票发起式 A | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 10,596,705.42 | 10,596,705.42 |
| 本期申购 | 134,747.33 | 134,747.33 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -291,507.63 | -291,507.63 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 10,439,945.12 | 10,439,945.12 |

金额单位：人民币元

| 鑫元成长驱动股票发起式 C | | |
|---|---|---|
| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 3,389,067.19 | 3,389,067.19 |
| 本期申购 | 293,472.66 | 293,472.66 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -223,423.65 | -223,423.65 |
| 基金拆分/份额折算前 | - | - |
| 基金拆分/份额折算调整 | - | - |
| 本期申购 | - | - |
| 本期赎回（以“-”号填列） | - | - |
| 本期末 | 3,459,116.20 | 3,459,116.20 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

### 6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

### 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鑫元成长驱动股票发起式 A

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | -1,670,779.98 | 136,072.14 | -1,534,707.84 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -1,670,779.98 | 136,072.14 | -1,534,707.84 |
| 本期利润 | -962,844.64 | -236,181.85 | -1,199,026.49 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 34,646.44 | 2,212.02 | 36,858.46 |
| 其中：基金申购款 | -26,286.07 | 2,138.75 | -24,147.32 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 基金赎回款 | 60,932.51 | 73.27 | 61,005.78 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -2,598,978.18 | -97,897.69 | -2,696,875.87 |

鑫元成长驱动股票发起式 C

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|---|---|---|---|
| 上年度末 | -542,459.24 | 43,264.17 | -499,195.07 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - |
| 其他 | - | - | - |
| 本期期初 | -542,459.24 | 43,264.17 | -499,195.07 |
| 本期利润 | -304,906.10 | -75,625.12 | -380,531.22 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -26,129.93 | -169.72 | -26,299.65 |
| 其中：基金申购款 | -66,025.04 | -2,298.48 | -68,323.52 |
| 基金赎回款 | 39,895.11 | 2,128.76 | 42,023.87 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -873,495.27 | -32,530.67 | -906,025.94 |

### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 活期存款利息收入 | 1,691.91 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | 546.63 |
| 结算备付金利息收入 | - |
| 其他 | - |
| 合计 | 2,238.54 |

### 6.4.7.14 股票投资收益

#### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -1,274,436.93 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | - |
| 股票投资收益——申购差价收入 | - |
| 股票投资收益——证券出借差价收入 | - |
| 合计 | -1,274,436.93 |

### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 卖出股票成交总额 | 22,388,333.74 |
| 减：卖出股票成本总额 | 23,607,528.28 |
| 减：交易费用 | 55,242.39 |
| 买卖股票差价收入 | -1,274,436.93 |

### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

## 6.4.7.15 债券投资收益

### 6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---|---|
| 债券投资收益——利息收入 | 7,097.17 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入 | -317.64 |
| 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 | 6,779.53 |

### 6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 |
|---|---|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,530,332.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,500,212.00 |
| 减：应计利息总额 | 30,430.00 |
| 减：交易费用 | 7.64 |
| 买卖债券差价收入 | -317.64 |

### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

#### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

#### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.17 贵金属投资收益

#### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

#### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

### 6.4.7.18 衍生工具收益

#### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：无。

### 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 股票投资产生的股利收益 | 94,020.09 |
| 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 | 94,020.09 |

### 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 1.交易性金融资产 | -311,806.97 |
| ——股票投资 | -311,269.97 |
| ——债券投资 | -537.00 |
| ——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 | -311,806.97 |

### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 基金赎回费收入 | 785.19 |
| 合计 | 785.19 |

### 6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|---|---|
| 审计费用 | 14,918.54 |
| 信息披露费 | - |
| 证券出借违约金 | - |
| 证券组合费 | 6.91 |
| 合计 | 14,925.45 |

### 6.4.7.24 分部报告

无。

## 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本报告期内不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。

### 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 |
|---|---|
| 鑫元基金管理有限公司(“鑫元基金”) | 基金管理人、注册登记机构、基金销售机构 |
| 国投证券股份有限公司(“国投证券”) | 基金托管人、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 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

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2023年4月27日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例（%） |
| 国投证券 | 44,499,138.70 | 100.00 | 52,557,603.07 | 100.00 |

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2023年4月27日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例（%） |
| 国投证券 | 2,003,751.00 | 100.00 | - | - |

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2023年4月27日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例（%） |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 国投证券 | - | - | 22,000,000.00 | 100.00 |

### 6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期<br>2024年1月1日至2024年6月30日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 当期<br>佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 国投证券 | 38,248.05 | 100.00 | - | - |
| 关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023年4月27日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | | | |
| | 当期<br>佣金 | 占当期佣金总量的比例（%） | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣金总额的比例（%） |
| 国投证券 | 43,624.96 | 100.00 | - | - |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该关联方的服务范围还包括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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 65,995.28 | 66,571.51 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 23,413.61 | 20,160.33 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 42,581.67 | 46,411.18 |

注：基金管理费每日计提，按月支付。2023 年 4 月 27 日至 2023 年 8 月 13 日，基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.50%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×1.50%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

根据 2023 年 8 月 12 日《鑫元基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 14 日起支付基金管理人的管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率

计提，每日计提，按月支付，计算方法如下：

H=E×1.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间<br>2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 10,999.27 | 8,876.22 |

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.20%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.20%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

### 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | |
|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C | 合计 |
| 鑫元基金 | - | 1.57 | 1.57 |
| 南京银行 | - | - | - |
| 国投证券 | - | 5,043.69 | 5,043.69 |
| 合计 | - | 5,045.26 | 5,045.26 |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | | |
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | |
| | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C | 合计 |
| 鑫元基金 | - | 0.50 | 0.50 |
| 南京银行 | - | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 国投证券 | - | 8,977.53 | 8,977.53 |
| 合计 | - | 8,978.03 | 8,978.03 |

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下:

H=E×0.40%÷当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

### 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

注：无。

### 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

注：无。

#### 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

注：无。

### 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C |
| 基金合同生效日（ 2023 年 4 月 27 日）持有的基金份额 | - | - |
| 报告期初持有的基金份额 | 10,002,889.18 | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,002,889.18 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 71.9681% | - |
| 项目 | 上年度可比期间 | |

| | 2023 年 4 月 27 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日 | |
|---|---|---|
| | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C |
| 基金合同生效日（ 2023 年 4 月 27 日）持有的基金份额 | 10,002,889.18 | - |
| 报告期初持有的基金份额 | - | - |
| 报告期间申购/买入总份额 | - | - |
| 报告期间因拆分变动份额 | - | - |
| 减：报告期间赎回/卖出总份额 | - | - |
| 报告期末持有的基金份额 | 10,002,889.18 | - |
| 报告期末持有的基金份额占基金总份额比例 | 54.5736% | - |

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

### 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

注：无。

### 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<br>2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | 上年度可比期间<br>2023年4月27日（基金合同生效日）至2023年6月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 国投证券 | 370,735.43 | 546.63 | 1,382,575.57 | 1,627.74 |

注：本基金采用券商结算模式，上述款项为本基金存放于国投证券专用证券资金账户中的交易结算资金，按协议约定利率计息。

### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

### 6.4.11 利润分配情况

注：无。

### 6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

#### 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

注：无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其预期收益和预期风险高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本部门发生风险事

件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

### 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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金根据存款存放银行的资质，评估并控制银行存款的信用风险。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | 815,543.23 |
| 合计 | - | 815,543.23 |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

#### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | 607,352.05 | - |
| 合计 | 607,352.05 | - |

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、中期票据。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控本基金的组合资产持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标，对本基金的流动性风险进行持续的监测和分析。同时，本基金的基金管理人在基金运作周期内的每个开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制相关的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末(2024 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券”。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金开展银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等各类计息业务，因此存在相应的利率风险。

#### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 720,462.78 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 145.15 | 720,607.93 |
| 结算备付金 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 交易性金融资产 | 0.00 | 0.00 | 603,180.00 | 0.00 | 0.00 | 8,993,388.76 | 9,596,568.76 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 债权投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他债权投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他权益工具投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应收清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 6,325.69 | 6,325.69 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 518.07 | 518.07 |
| 递延所得税资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 720,462.78 | 0.00 | 603,180.00 | 0.00 | 0.00 | 9,000,377.67 | 10,324,020.45 |
| 负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 103.61 | 103.61 |
| 应付管理人报酬 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 10,299.03 | 10,299.03 |
| 应付托管费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 1,716.52 | 1,716.52 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 823.24 | 823.24 |
| 应付投资顾问费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 14,918.54 | 14,918.54 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 27,860.94 | 27,860.94 |
| 利率敏感度缺口 | 720,462.78 | 0.00 | 603,180.00 | 0.00 | 0.00 | 8,972,516.73 | 10,296,159.51 |
| 上年度末 2023 年 12 月 31 日 | 1 个月以内 | 1-3 个月 | 3 个月-1 年 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
| 资产 | | | | | | | |
| 货币资金 | 494,008.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 37.14 | 494,045.64 |
| 结算备付金 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 存出保证金 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融资产 | 800,080.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 10,812,673.23 | 11,612,753.23 |
| 衍生金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 买入返售金融资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 债权投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他债权投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他权益工具投资 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应收清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |

| | | | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| 应收股利 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应收申购款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 494.07 | 494.07 |
| 递延所得税资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他资产 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 资产总计 | 1,294,088.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 10,813,204.44 | 12,107,292.94 |
| 负债 | | | | | | | |
| 短期借款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 交易性金融负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 衍生金融负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 卖出回购金融资产款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付清算款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付赎回款 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 278.22 | 278.22 |
| 应付管理人报酬 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 12,140.78 | 12,140.78 |
| 应付托管费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 2,023.47 | 2,023.47 |
| 应付销售服务费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 980.77 | 980.77 |
| 应付投资顾问费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应交税费 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 应付利润 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 递延所得税负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 |
| 其他负债 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 140,000.00 | 140,000.00 |
| 负债总计 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 155,423.24 | 155,423.24 |
| 利率敏感度缺口 | 1,294,088.50 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 0.00 | 10,657,781.20 | 11,951,869.70 |

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 假设 | 除市场利率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ） |
| | 1.市场利率下降 25 个基点 | 1,079.81 | 83.81 |
| | 2.市场利率上升 25 个基点 | -1,075.99 | -83.79 |

### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有港股通标的的股票，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进

行监控。

### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

| 项目 | 本期末<br>2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---|---|---|---|---|
| | 美元<br>折合人民币元 | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 交易性金融资产 | - | 833,550.65 | - | 833,550.65 |
| 应收股利 | - | 6,325.69 | - | 6,325.69 |
| 资产合计 | - | 839,876.34 | - | 839,876.34 |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | 839,876.34 | - | 839,876.34 |
| 项目 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 | | | |
| | 美元<br>折合人民币元 | 港币<br>折合人民币元 | 其他币种<br>折合人民币元 | 合计 |
| 以外币计价的资产 | | | | |
| 资产合计 | - | - | - | - |
| 以外币计价的负债 | | | | |
| 负债合计 | - | - | - | - |
| 资产负债表外汇风险敞口净额 | - | - | - | - |

### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

| 假设 | 除汇率以外的其他市场变量保持不变 | | |
|---|---|---|---|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2023 年 12 月 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | | | 31 日 ） |
| | 所有港币均相对人民币升值 5% | 41,993.82 | - |
| | 所有港币均相对人民币贬值 5% | -41,993.82 | - |

### 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票资产占基金资产的比例为 80%-95%，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

### 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<br>2024 年 6 月 30 日 | | 上年度末<br>2023年12月31日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产－股票投资 | 8,989,216.71 | 87.31 | 10,797,210.00 | 90.34 |
| 交易性金融资产－基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产－债券投资 | - | - | - | - |
| 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 | 8,989,216.71 | 87.31 | 10,797,210.00 | 90.34 |

### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| | | | |
|---|---|---|---|
| 假设 | 1.本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变<br>2.以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变 | | |
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末（2024 年 6 月 30 日） | 上年度末 （2023 年 12 月 31 日 ） |
| | 沪深 300 指数上升 1% | 78,525.56 | 77,069.72 |
| | 沪深 300 指数下降 1% | -78,525.56 | -77,069.72 |

## 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的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：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<br>2024 年 6 月 30 日 | 上年度末<br>2023 年 12 月 31 日 |
|---|---|---|
| 第一层次 | 8,989,216.71 | 10,797,210.00 |
| 第二层次 | 607,352.05 | 815,543.23 |
| 第三层次 | - | - |
| 合计 | 9,596,568.76 | 11,612,753.23 |

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

## 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

# §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 | 8,989,216.71 | 87.07 |
| | 其中：股票 | 8,989,216.71 | 87.07 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 607,352.05 | 5.88 |
| | 其中：债券 | 607,352.05 | 5.88 |
| | 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 | 720,607.93 | 6.98 |
| 8 | 其他各项资产 | 6,843.76 | 0.07 |
| 9 | 合计 | 10,324,020.45 | 100.00 |

注：本基金本报告期末通过港股通交易机制投资的港股公允价值为 833,550.65 元，占基金资产净值比例为 8.10%。

## 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

金额单位：人民币元

| 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 | 66,458.00 | 0.65 |
| B | 采矿业 | 634,638.00 | 6.16 |
| C | 制造业 | 3,665,730.80 | 35.60 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 2,231,815.00 | 21.68 |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 96,228.00 | 0.93 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 521,018.00 | 5.06 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 320,365.26 | 3.11 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| L | 租赁和商务服务业 | 299,763.00 | 2.91 |
| 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 | 319,650.00 | 3.10 |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 8,155,666.06 | 79.21 |

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

| 行业类别 | 公允价值（人民币） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|
| 原材料 | 280,484.82 | 2.72 |
| 非周期性消费品 | 172,879.85 | 1.68 |
| 周期性消费品 | - | - |
| 能源 | - | - |
| 金融 | - | - |
| 医疗 | - | - |
| 工业 | - | - |
| 信息科技 | - | - |
| 电信服务 | - | - |
| 公用事业 | 380,185.98 | 3.69 |
| 房地产 | - | - |
| 合计 | 833,550.65 | 8.10 |

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

## 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（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 600900 | 长江电力 | 28,100 | 812,652.00 | 7.89 |
| 2 | 002130 | 沃尔核材 | 47,300 | 667,876.00 | 6.49 |
| 3 | 300308 | 中际旭创 | 4,760 | 656,308.80 | 6.37 |
| 4 | 003816 | 中国广核 | 122,300 | 566,249.00 | 5.50 |
| 5 | 601985 | 中国核电 | 52,100 | 555,386.00 | 5.39 |
| 6 | 603228 | 景旺电子 | 16,700 | 531,060.00 | 5.16 |
| 7 | 300394 | 天孚通信 | 5,900 | 521,678.00 | 5.07 |
| 8 | 603009 | 北特科技 | 27,800 | 498,454.00 | 4.84 |
| 9 | 000426 | 兴业银锡 | 35,600 | 483,448.00 | 4.70 |
| 10 | 688052 | 纳芯微 | 3,117 | 320,365.26 | 3.11 |
| 11 | 605098 | 行动教育 | 7,500 | 319,650.00 | 3.10 |
| 12 | 001965 | 招商公路 | 26,300 | 311,918.00 | 3.03 |
| 13 | 300795 | 米奥会展 | 17,100 | 299,763.00 | 2.91 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 14 | 600025 | 华能水电 | 27,600 | 297,528.00 | 2.89 |
| 15 | 01378 | 中国宏桥 | 26,000 | 280,484.82 | 2.72 |
| 16 | 002125 | 湘潭电化 | 25,800 | 251,034.00 | 2.44 |
| 17 | 002884 | 凌霄泵业 | 10,600 | 203,520.00 | 1.98 |
| 18 | 00902 | 华能国际电力股份 | 36,000 | 190,239.02 | 1.85 |
| 19 | 01071 | 华电国际电力股份 | 44,000 | 189,946.96 | 1.84 |
| 20 | 603239 | 浙江仙通 | 13,500 | 185,085.00 | 1.80 |
| 21 | 00839 | 中教控股 | 42,000 | 172,879.85 | 1.68 |
| 22 | 601069 | 西部黄金 | 13,000 | 151,190.00 | 1.47 |
| 23 | 601000 | 唐山港 | 22,400 | 105,280.00 | 1.02 |
| 24 | 601006 | 大秦铁路 | 14,500 | 103,820.00 | 1.01 |
| 25 | 300783 | 三只松鼠 | 4,400 | 96,228.00 | 0.93 |
| 26 | 000807 | 云铝股份 | 6,100 | 82,411.00 | 0.80 |
| 27 | 600975 | 新五丰 | 9,400 | 66,458.00 | 0.65 |
| 28 | 603848 | 好太太 | 3,100 | 39,029.00 | 0.38 |
| 29 | 603699 | 纽威股份 | 1,000 | 17,120.00 | 0.17 |
| 30 | 301108 | 洁雅股份 | 500 | 12,155.00 | 0.12 |

## 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 | 300308 | 中际旭创 | 1,315,899.00 | 11.01 |
| 2 | 600900 | 长江电力 | 970,083.00 | 8.12 |
| 3 | 600547 | 山东黄金 | 793,945.00 | 6.64 |
| 4 | 605098 | 行动教育 | 668,542.00 | 5.59 |
| 5 | 300394 | 天孚通信 | 650,470.00 | 5.44 |
| 6 | 000603 | 盛达资源 | 638,357.00 | 5.34 |
| 7 | 002130 | 沃尔核材 | 618,026.00 | 5.17 |
| 8 | 601398 | 工商银行 | 545,260.00 | 4.56 |
| 9 | 00013 | 和黄医药 | 541,758.55 | 4.53 |
| 10 | 09926 | 康方生物 | 535,358.93 | 4.48 |
| 11 | 601985 | 中国核电 | 526,875.00 | 4.41 |
| 12 | 003816 | 中国广核 | 526,059.00 | 4.40 |
| 13 | 601988 | 中国银行 | 524,410.00 | 4.39 |
| 14 | 601328 | 交通银行 | 522,450.00 | 4.37 |
| 15 | 603228 | 景旺电子 | 509,309.00 | 4.26 |
| 16 | 01378 | 中国宏桥 | 506,947.76 | 4.24 |
| 17 | 000426 | 兴业银锡 | 506,581.00 | 4.24 |
| 18 | 601288 | 农业银行 | 489,500.00 | 4.10 |
| 19 | 002886 | 沃特股份 | 452,526.00 | 3.79 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 20 | 603009 | 北特科技 | 447,593.00 | 3.74 |
| 21 | 603668 | 天马科技 | 427,145.10 | 3.57 |
| 22 | 603728 | 鸣志电器 | 381,630.00 | 3.19 |
| 23 | 601069 | 西部黄金 | 371,862.00 | 3.11 |
| 24 | 002840 | 华统股份 | 367,946.00 | 3.08 |
| 25 | 603979 | 金诚信 | 366,301.00 | 3.06 |
| 26 | 601899 | 紫金矿业 | 340,732.00 | 2.85 |
| 27 | 600975 | 新五丰 | 339,172.00 | 2.84 |
| 28 | 002125 | 湘潭电化 | 332,676.00 | 2.78 |
| 29 | 002687 | 乔治白 | 330,991.00 | 2.77 |
| 30 | 601939 | 建设银行 | 326,613.00 | 2.73 |
| 31 | 301101 | 明月镜片 | 321,117.00 | 2.69 |
| 32 | 000807 | 云铝股份 | 316,828.00 | 2.65 |
| 33 | 603239 | 浙江仙通 | 311,967.00 | 2.61 |
| 34 | 002749 | 国光股份 | 311,481.00 | 2.61 |
| 35 | 688052 | 纳芯微 | 311,201.03 | 2.60 |
| 36 | 001965 | 招商公路 | 307,273.00 | 2.57 |
| 37 | 301035 | 润丰股份 | 296,812.00 | 2.48 |
| 38 | 600025 | 华能水电 | 292,079.00 | 2.44 |
| 39 | 300795 | 米奥会展 | 254,770.00 | 2.13 |

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

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 002749 | 国光股份 | 866,165.00 | 7.25 |
| 2 | 600547 | 山东黄金 | 805,520.00 | 6.74 |
| 3 | 605098 | 行动教育 | 738,467.20 | 6.18 |
| 4 | 300308 | 中际旭创 | 634,366.00 | 5.31 |
| 5 | 002840 | 华统股份 | 624,374.00 | 5.22 |
| 6 | 301004 | 嘉益股份 | 586,615.00 | 4.91 |
| 7 | 000603 | 盛达资源 | 582,887.00 | 4.88 |
| 8 | 601069 | 西部黄金 | 539,137.00 | 4.51 |
| 9 | 601398 | 工商银行 | 536,461.00 | 4.49 |
| 10 | 00013 | 和黄医药 | 526,554.67 | 4.41 |
| 11 | 601988 | 中国银行 | 519,019.00 | 4.34 |
| 12 | 601328 | 交通银行 | 515,484.00 | 4.31 |
| 13 | 601288 | 农业银行 | 482,145.00 | 4.03 |
| 14 | 002886 | 沃特股份 | 452,647.00 | 3.79 |
| 15 | 603699 | 纽威股份 | 438,429.00 | 3.67 |
| 16 | 300445 | 康斯特 | 409,857.00 | 3.43 |
| 17 | 002991 | 甘源食品 | 404,099.00 | 3.38 |
| 18 | 09926 | 康方生物 | 403,229.40 | 3.37 |

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 19 | 603668 | 天马科技 | 403,169.50 | 3.37 |
| 20 | 603979 | 金诚信 | 401,230.00 | 3.36 |
| 21 | 603728 | 鸣志电器 | 384,925.00 | 3.22 |
| 22 | 603848 | 好太太 | 383,367.00 | 3.21 |
| 23 | 603059 | 倍加洁 | 380,943.00 | 3.19 |
| 24 | 002687 | 乔治白 | 373,344.00 | 3.12 |
| 25 | 002790 | 瑞尔特 | 362,438.00 | 3.03 |
| 26 | 001380 | 华纬科技 | 361,075.00 | 3.02 |
| 27 | 301283 | 聚胶股份 | 360,695.00 | 3.02 |
| 28 | 603215 | 比依股份 | 357,032.00 | 2.99 |
| 29 | 601899 | 紫金矿业 | 356,650.00 | 2.98 |
| 30 | 603208 | 江山欧派 | 354,878.00 | 2.97 |
| 31 | 300938 | 信测标准 | 352,325.90 | 2.95 |
| 32 | 688633 | 星球石墨 | 351,316.74 | 2.94 |
| 33 | 603551 | 奥普科技 | 347,369.00 | 2.91 |
| 34 | 301108 | 洁雅股份 | 337,755.00 | 2.83 |
| 35 | 688618 | 三旺通信 | 332,277.64 | 2.78 |
| 36 | 605068 | 明新旭腾 | 328,771.00 | 2.75 |
| 37 | 603103 | 横店影视 | 326,674.00 | 2.73 |
| 38 | 601939 | 建设银行 | 321,946.00 | 2.69 |
| 39 | 688486 | 龙迅股份 | 317,972.20 | 2.66 |
| 40 | 301272 | 英华特 | 310,431.10 | 2.60 |
| 41 | 688580 | 伟思医疗 | 307,002.89 | 2.57 |
| 42 | 300873 | 海晨股份 | 305,194.00 | 2.55 |
| 43 | 000713 | 丰乐种业 | 293,688.00 | 2.46 |
| 44 | 301035 | 润丰股份 | 290,279.00 | 2.43 |
| 45 | 600371 | 万向德农 | 282,433.00 | 2.36 |
| 46 | 301101 | 明月镜片 | 265,083.00 | 2.22 |
| 47 | 688698 | 伟创电气 | 242,779.91 | 2.03 |

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

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|---|---|
| 买入股票成本（成交）总额 | 22,110,804.96 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 22,388,333.74 |

注："买入股票成本"、"卖出股票收入"均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种 | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | 607,352.05 | 5.90 |
| 2 | 央行票据 | - | - |

| | | | |
|---|---|---|---|
| 3 | 金融债券 | - | - |
| | 其中：政策性金融债 | - | - |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | - | - |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 可转债（可交换债） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 607,352.05 | 5.90 |

## 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 | 019698 | 23 国债 05 | 6,000 | 607,352.05 | 5.90 |

## 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

注：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

注：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

注：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

本基金本报告期内未持有股指期货。

## 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

本基金本报告期内未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否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

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括深圳市景旺电子股份有限公司。国家外汇管理局深圳市分局于 2024 年 3 月 22 日对深圳市景旺电子股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日

前一年受到公开谴责、处罚的情况。

### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

### 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 | - |
| 2 | 应收清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 6,325.69 |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 518.07 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,843.76 |

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

# §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（%） |
| 鑫元成长驱动股票发起式 A | 58 | 179,999.05 | 10,002,889.18 | 95.8136 | 437,055.94 | 4.1864 |
| 鑫元成长驱动股票发起式 C | 120 | 28,825.97 | 262,295.08 | 7.5827 | 3,196,821.12 | 92.4173 |
| 合计 | 178 | 78,084.61 | 10,265,184.26 | 73.8552 | 3,633,877.06 | 26.1448 |

## 8.2 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 | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 1,157.80 | 0.0111 |
| | 鑫元成长驱动股票发起式 C | 1,703.53 | 0.0492 |
| | 合计 | 2,861.33 | 0.0206 |

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 0 |
| | 鑫元成长驱动股票发起式 C | 0 |
| | 合计 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 0 |
| | 鑫元成长驱动股票发起式 C | 0 |
| | 合计 | 0 |

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

| 项目 | 持有份额总数 | 持有份额占基金总份额比例(%) | 发起份额总数 | 发起份额占基金总份额比例(%) | 发起份额承诺持有期限 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人固有资金 | 10,002,889.18 | 71.9681 | 10,002,889.18 | 71.9681 | 3 年 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金管理人高级管理人员 | - | - | - | - | - |
| 基金经理等人员 | - | - | - | - | - |
| 基金管理人股东 | - | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - | - |
| 合计 | 10,002,889.18 | 71.9681 | 10,002,889.18 | 71.9681 | 3 年 |

# §9 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 鑫元成长驱动股票发起式 A | 鑫元成长驱动股票发起式 C |
|---|---|---|
| 基金合同生效日（2023 年 4 月 27 日）基金份额总额 | 13,771,250.77 | 17,280,623.93 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 10,596,705.42 | 3,389,067.19 |
| 本报告期基金总申购份额 | 134,747.33 | 293,472.66 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 291,507.63 | 223,423.65 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 10,439,945.12 | 3,459,116.20 |

# §10 重大事件揭示

## 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 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、基金管理人：本报告期内，基金管理人发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》。自 2024 年 5 月 30 日起张丽洁女士不再担任公司总经理、财务负责人；自 2024 年 5 月 31 日起，公司董事长龙艺女士代为履行公司总经理、财务负责人职责。

2、基金托管人：本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

## 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，托管人的托管业务部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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(%) | |
| 国投证券 | 3 | 44,499,138.70 | 100.00 | 38,248.05 | 100.00 | - |

注：（1）交易单元的主要选择标准：

1）财务状况良好，经营行为规范；

2）内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；

3）具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；

4）收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

1） 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；

2） 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

### 10.7.2 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(%) |
| 国投证券 | 2,003,751.00 | 100.00 | - | - | - | - |

## 10.8 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 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金 2023 年第 4 季度报告 | 公司网站 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 2 | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告 | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2024 年 1 月 22 日 |
| 3 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金 2023 年年度报告 | 公司网站 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 4 | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告 | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2024 年 3 月 30 日 |
| 5 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告 | 公司网站 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 6 | 鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告 | 公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报 | 2024 年 4 月 22 日 |
| 7 | 鑫元基金管理有限公司关于基金行 | 公司网站、中国证券 | 2024 年 6 月 1 日 |

| | | | |
|---|---|---|---|
| | 业高级管理人员变更的公告 | 报、上海证券报、证券时报、证券日报 | |
| 8 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金（鑫元成长驱动股票发起式 A）基金产品资料概要更新 | 公司网站 | 2024 年 6 月 29 日 |
| 9 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金（鑫元成长驱动股票发起式 C）基金产品资料概要更新 | 公司网站 | 2024 年 6 月 29 日 |
| 10 | 鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金更新招募说明书（2024 年第 1 号） | 公司网站 | 2024 年 6 月 29 日 |

# §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 | 20240101-20240630 | 10,002,889.18 | - | - | 10,002,889.18 | 71.9681 |
| 个人 | - | - | - | - | - | - | - |

| 产品特有风险 |
|---|
| 基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临以下风险：<br>（一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。<br>（二）基金净值大幅波动的风险单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。<br>（三）基金投资目标偏离的风险单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。<br>（四）基金合同提前终止或其它相关风险<br>根据《基金合同》的约定，基金合同生效满 3 年之日，若基金资产规模低于 2 亿元，无需召开持有人大会审议，基金合同应当终止，且不得通过召开基金持有人大会的方式延续。若届时的法律法规或中国证监会规定发生变化，上述终止规定被取消、更改或补充，则本基金可以参照届时有效的法律法规或中国证监会规定执行。《基金合同》生效满 3 年后继续存续的，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，如持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响。 |

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

| |
|---|
| 无。 |

# §12 备查文件目录

## 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金托管协议》；

4、基金管理人业务资格批复、营业执照；

5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

## 12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

**鑫元基金管理有限公司**

**2024 年 8 月 30 日**