金鹰研究驱动混合型证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：上海浦东发展银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人上海浦东发展银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 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。

本报告期自 2024 年 1 月 16 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 11
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
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 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明 15
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 16
§6 审计报告 16
6.1 审计意见 16
6.2 形成审计意见的基础 17
6.3 其他信息 17
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任 17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任 17
§7 年度财务报表 18
7.1 资产负债表 18
7.2 利润表 20
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 22
§8 投资组合报告 50
8.1 期末基金资产组合情况 50

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 58
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 58
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 59
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 59
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 59
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 59
8.11 投资组合报告附注 59
§9 基金份额持有人信息 60
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
9.2 期末上市基金前十名持有人 60
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 61
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 61
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 61
§10 开放式基金份额变动 61
§11 重大事件揭示 62
11.1 基金份额持有人大会决议 62
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 62
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 62
11.4 基金投资策略的改变 62
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 62
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 62
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 62
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 63
11.9 其他重大事件 64
§12 影响投资者决策的其他重要信息 66
12.1 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 66
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 67
§13 备查文件目录 67
13.1 备查文件目录 67
13.2 存放地点 68
13.3 查阅方式 68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰研究驱动混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰研究驱动混合	
基金主代码	018549	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2024 年 1 月 16 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	5,041,812.41 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C
下属分级基金的交易代码	018549	018550
报告期末下属分级基金的份额总额	1,675,275.05 份	3,366,537.36 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在严格控制风险和保持资产流动性的前提下，通过深入的基本面研究精选具有长期增长潜力的行业和个股，追求超越业绩比较基准的投资回报，力争实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金以基金资产的长期稳定增值为目标，秉持以基本面研究为本的投资理念，深度挖掘基本面优秀、兼具长期增长潜力的股票。依托于基金管理人完备的研究体系，在公司研究平台长期跟踪宏观经济和市场环境指标、研究员深入研究各行业个股基金面和发展潜力的基础上，基金经理自上而下与自下而上相结合，研判行业景气度和趋势变化，精选优质个股，对组合进行动态优化。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×15%+中证综合债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。

	本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	凡湘平	朱萍
	联系电话	020-83936180	021-31888888
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zhup02@spdb.com.cn
客户服务电话		4006135888	95528
传真		020-83282856	021-63602540
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房	上海市中山东一路12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	上海市博成路1388号浦银中心A栋
邮政编码		510623	200126
法定代表人		姚文强	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路

		28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日	
	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C
本期已实现收益	271,195.70	875,966.77
本期利润	273,940.00	859,546.45
加权平均基金份额本期利润	0.0756	0.0165
本期加权平均净值利润率	7.49%	1.65%
本期基金份额净值增长率	8.92%	8.27%
3.1.2 期末数据和指标	**2024 年末**	
	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C
期末可供分配利润	149,435.51	278,538.10
期末可供分配基金份额利润	0.0892	0.0827
期末基金资产净值	1,824,710.56	3,645,075.46
期末基金份额净值	1.0892	1.0827
3.1.3 累计期末指标	**2024 年末**	
	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C
基金份额累计净值增长率	8.92%	8.27%

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰研究驱动混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.09%	1.57%	-1.07%	1.33%	2.16%	0.24%
过去六个月	12.21%	1.56%	12.21%	1.30%	0.00%	0.26%
自基金合同生效起至今	8.92%	1.28%	18.99%	1.08%	-10.07%	0.20%

金鹰研究驱动混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.92%	1.57%	-1.07%	1.33%	1.99%	0.24%
过去六个月	11.86%	1.56%	12.21%	1.30%	-0.35%	0.26%
自基金合同生效起至今	8.27%	1.28%	18.99%	1.08%	-10.72%	0.20%

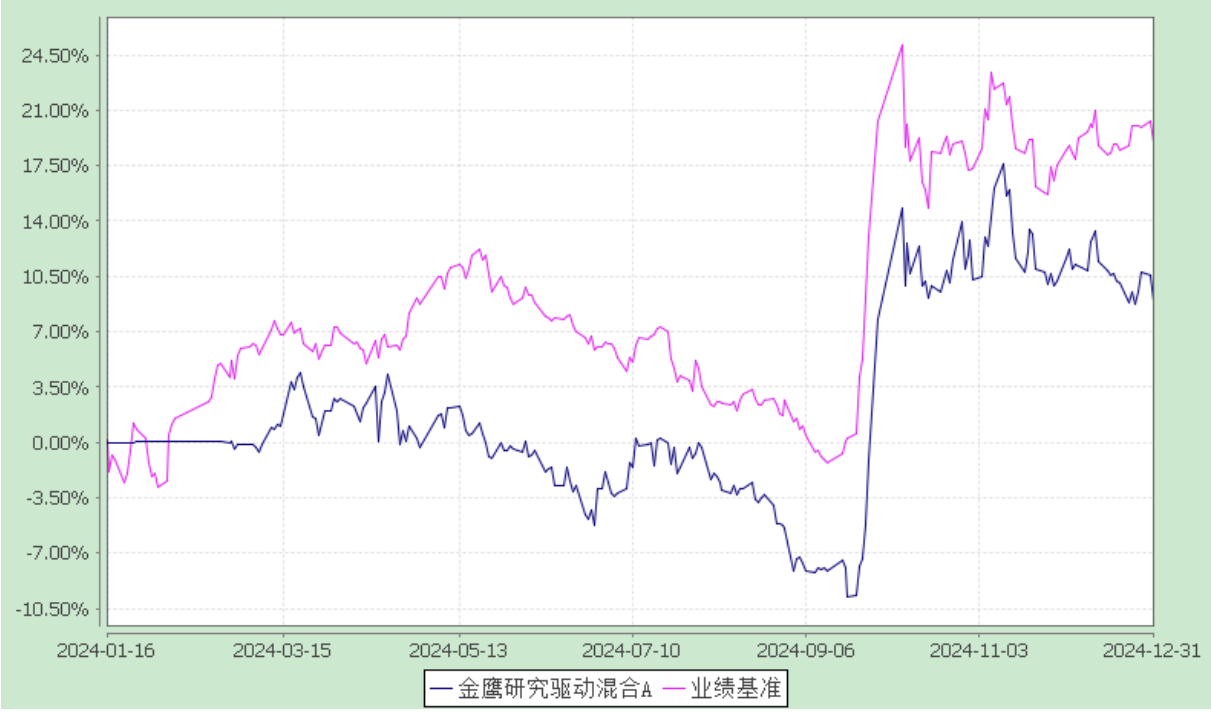
3.2.2 自基金合同生效以来**基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较**

金鹰研究驱动混合型证券投资基金

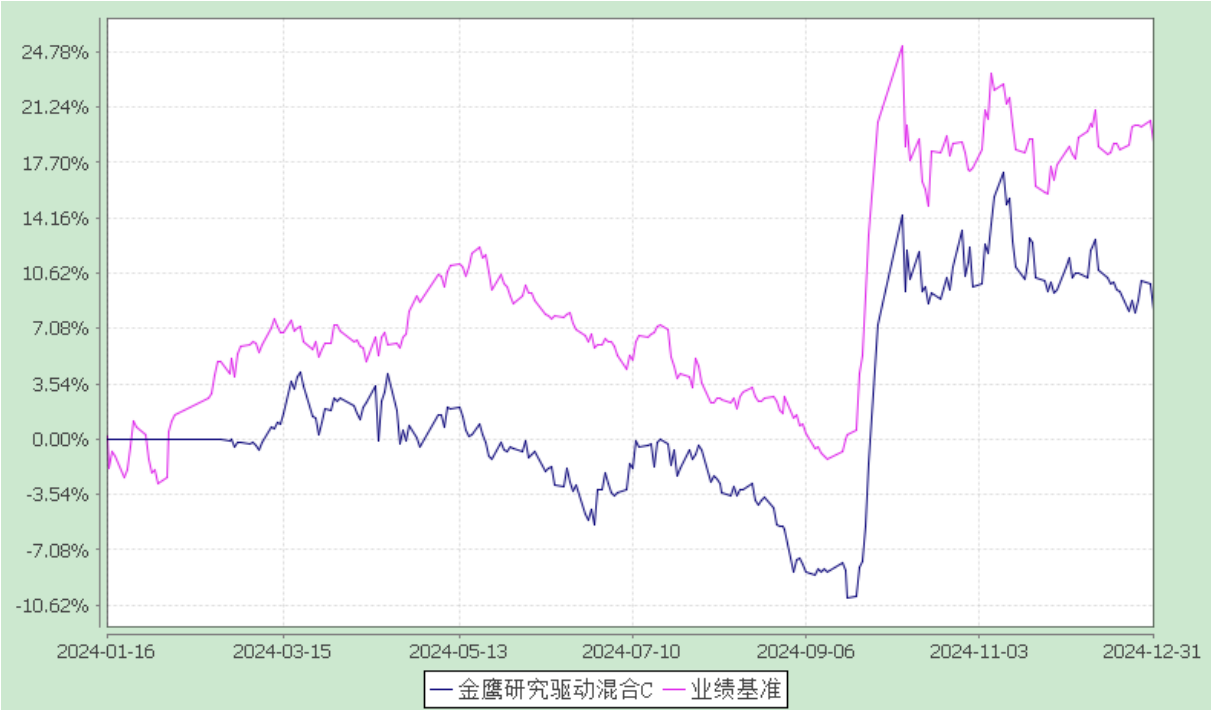
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2024 年 1 月 16 日至 2024 年 12 月 31 日）

金鹰研究驱动混合 A



金鹰研究驱动混合 C



注：1.本基金合同于 2024 年 1 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

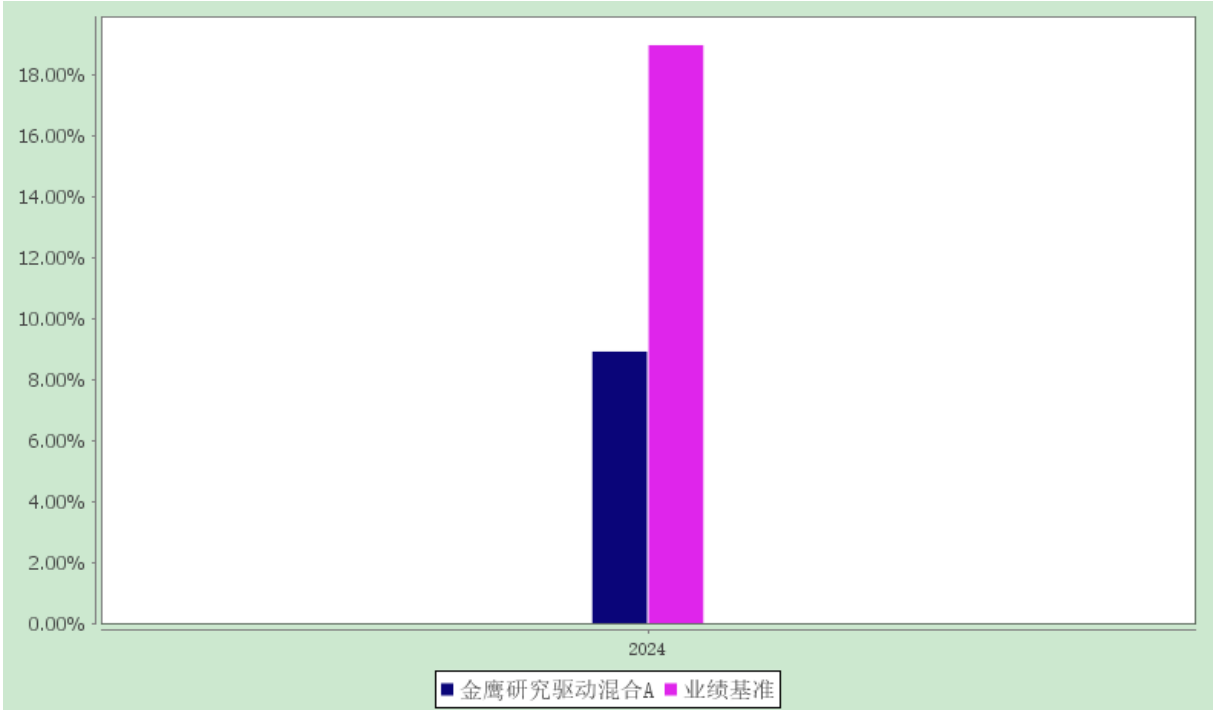
3.本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×15%+中证综合债指数收益率×15%。

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

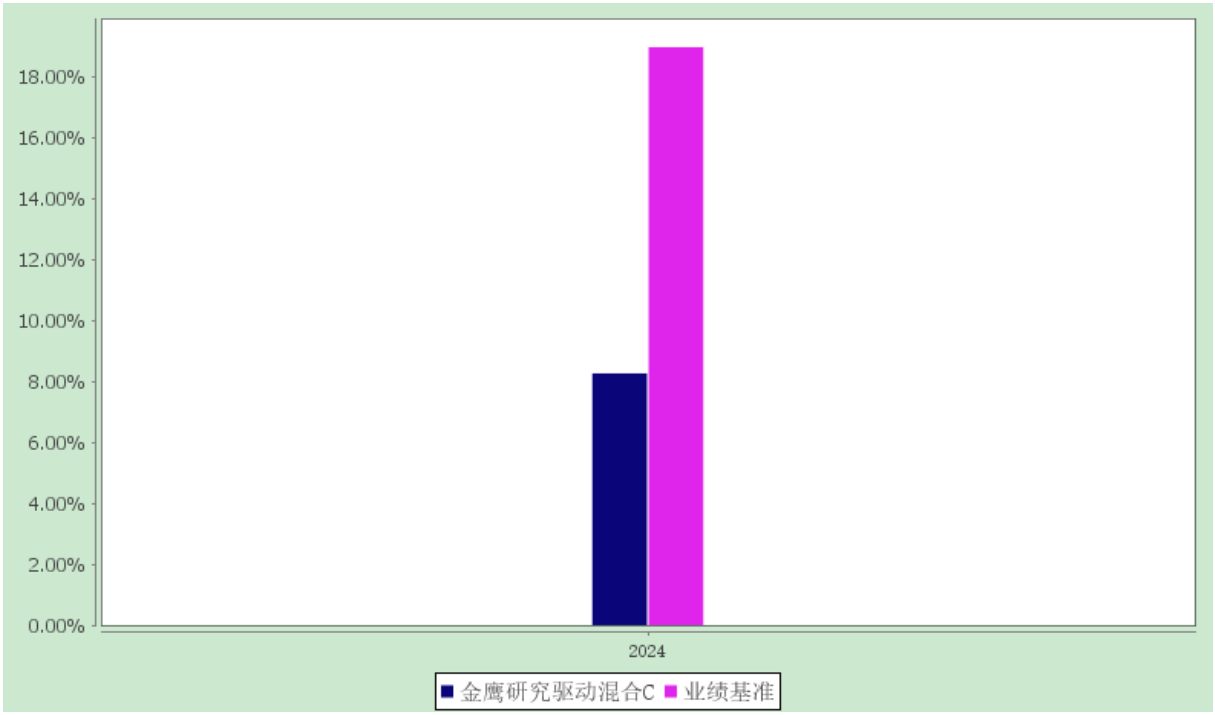
金鹰研究驱动混合型证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

金鹰研究驱动混合 A



金鹰研究驱动混合 C



注：1.本基金合同于 2024 年 1 月 16 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×15%+中证综合债指数收益率×15%。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基字[2002]97 号文批准，金鹰基金管理有限公司于 2002 年 12 月 25 日成立。2011 年 12 月公司获得特定客户资产管理计划业务资格，2013 年 7 月子公司——广州金鹰资产管理有限公司成立。2015 年 12 月，获得受托管理保险资金投资管理人资格。

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 68 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		
倪超	本基金的基金经理，公司权益研究部总经理	2024-01-16	-	15	倪超先生，厦门大学硕士研究生。2009 年 6 月加盟金鹰基金管理有限公司，先后任行业研究员，消费品研究小组组长、基金经理助理。现任权益研究部总经理、基金经理。
李	本基金的基金经理	2024-	-	7	李龙杰先生，西南财经大学经济学硕

龙杰		05-10			士，2017 年 7 月加入金鹰基金管理有限公司，担任研究员职务，现任权益研究部基金经理。

注：1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期；

2、证券从业的含义遵从《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定；

3、倪超先生于2025年3月26日离任本基金的基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施

投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统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。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未出现同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

国内方面，回望 2024 年，上半年国内市场保持政策定力，下半年以 9 月 24 日国新办“金融支持经济高质量发展”一系列重大利好政策出台作为重大拐点标志，政策强度超出市场预期。随后，一揽子增量政策加快落地，财政、货币等总量政策工具，配合扩内需、稳地产、稳外贸等结构性工具加码，推动市场情绪快速回暖。12 月份的政治局会议提出要实施适度宽松的货币政策。这是 2011 年以来，首次将货币政策定调为“适度宽松”。在 2024 年底的中央经济工作会议中，明确表述要在 2025 年提高财政赤字率。整体的宏观政策，迈向了更加明显的宽松。

国外方面，2024 年美国经济表现超出经济学家预期，答案或在于美国消费者。尽管劳动力市场的招聘步伐放缓，但美国薪资增长速度继续超过通货膨胀率，家庭财富也跟随屡创新高的美国股市创下新纪录，这支撑了美国家庭支出的持续强劲扩张。美联储官员们 2024 年选择将利率下调 1 个百分点，以缓解经济压力，但美联储主席杰罗姆•鲍威尔等官员近期表示，在 2025 年进一步降息之前，美联储的官员们需要看到抗击通胀方面取得更多积极进展。因此，降息周期节奏具有不确定性。而 2024 年内大选结果落定，特朗普再次担任美国总统，地缘政治格局持续博弈，其上任后的经济政策将显著加大未来市场不确定性。综上，2024 年海外的不确定因素远多于国内。

2024 年全年各指数涨跌幅层面：上证指数涨幅 12.67%，深证指数涨幅 9.34%，创业板指数涨幅 13.23%，科创 50 涨幅 21.07%，沪深 300 指数涨幅 14.68%。

过去的 2024 年，在综合考虑到宏观基本面的不确定性后，本基金的核心关注方向主要集中在核心资产，即在充分研究国内优势龙头企业的竞争优势后，我们在核心资产中重点关注有明显比较优

势、不惧制裁或加关税、供需关系持续向好且景气度确定性较高的方向：机械制造、基础化工、轻工制造等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，A 类基金份额净值为 1.0892 元，本报告期份额净值增长率为 8.92%，同期业绩比较基准增长率为 18.99%；C 类基金份额净值为 1.0827 元，本报告期份额净值增长率为 8.27%，同期业绩比较基准增长率为 18.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

一方面，2025 年我们判断无论是全球还是国内的宏观经济，依然具有较大不确定性。针对这种不确定性，本基金将综合各个细分行业，充分结合其供需关系，挖掘景气度上行的行业及公司，以及能在行业景气度底部持续扩张的核心资产。

另一方面，经过过去 2 年产业发展，硬件端，人工智能在其涉及到的各个子行业与对应的公司开始逐步有收入与利润的兑现。而应用端，随着 Deepseek 的横空出世，越来越多的人工智能应用有望快速落地。因此，我们认为，人工智能相关的投资，已经逐步从主题投资转变为产业趋势投资与价值发现。

在未来的 10 年内，人工智能技术大概率会像 2000 年的互联网技术革命、2010 年的移动互联网技术革命一样，深刻地改变人类社会的生产关系并且渗透到人们生活的各个角落。在这个过程中，技术的不断迭代、应用的不断创新都将会带来非常多投资机会。

综上，2025 年，本基金除了聚焦核心资产外，还会重视人工智能相关的投资，深入跟踪与挖掘相关硬件技术、产业链认证、端侧与应用的变化。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，按照规定的权限和程序独立开展本基金运作的合规性监察，认真履行职责，通过材料审阅、监督监控、覆盖检查、重点抽查等多种方法开展工作，督促各项业务的合规运作，发现违规隐患及时与有关业务人员沟通并向管理层报告，定期向公司董事会出具监察稽核报告。

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未

出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对金鹰研究驱动混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，不存在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，本托管人依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议的规定，对金鹰研究驱动混合型证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由金鹰基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2501711 号

金鹰研究驱动混合型证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的金鹰研究驱动混合型证券投资基金 (以下简称“该基金”) 财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会 (以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

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

6.3 其他信息

该基金管理人金鹰基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

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

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

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

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

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

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）　　中国注册会计师

吴钟鸣　陈伟瑜

中国北京东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 26 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰研究驱动混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日

资 产：		
货币资金	7.4.7.1	106,949.42
结算备付金		957.32
存出保证金		253,036.32
交易性金融资产	7.4.7.2	5,163,652.12
其中：股票投资		5,163,652.12
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		13,847.29
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		**5,538,442.47**
负债和净资产	**附注号**	**本期末** **2024 年 12 月 31 日**
负 债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		50,327.84
应付管理人报酬		6,043.35

应付托管费		1,007.21
应付销售服务费		1,762.39
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	7.4.7.6	9,515.66
负债合计		**68,656.45**
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	5,041,812.41
未分配利润	7.4.7.8	427,973.61
净资产合计		**5,469,786.02**
负债和净资产总计		**5,538,442.47**

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0892 元，A 类基金份额总额为 1,675,275.05 份；C 类基金份额净值为 1.0827 元，C 类基金份额总额为 3,366,537.36 份；基金份额总额为 5,041,812.41 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰研究驱动混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		**2,329,890.53**
1.利息收入		1,024,162.33
其中：存款利息收入	7.4.7.9	650,008.40
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		374,153.93

其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,155,818.56
其中：股票投资收益	7.4.7.10	1,080,535.76
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	75,282.80
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-13,676.02
4.汇兑收益（损失以“一”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	163,585.66
减：二、营业总支出		**1,196,404.08**
1．管理人报酬		724,720.03
2．托管费		120,786.70
3．销售服务费		340,781.69
4．投资顾问费		-
5．利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-
7．税金及附加		-
8．其他费用	7.4.7.19	10,115.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		**1,133,486.45**
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		**1,133,486.45**
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		**1,133,486.45**

7.3 净资产变动表

会计主体：金鹰研究驱动混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	509,120,553.45	-	509,120,553.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-504,078,741.04	427,973.61	-503,650,767.43
（一）、综合收益总额	-	1,133,486.45	1,133,486.45
（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）	-504,078,741.04	-705,512.84	-504,784,253.88
其中：1.基金申购款	54,055,884.84	395,283.40	54,451,168.24
2.基金赎回款	-558,134,625.88	-1,100,796.24	-559,235,422.12
（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、本期期末净资产	5,041,812.41	427,973.61	5,469,786.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰研究驱动混合型证券投资基金(“本基金”)经中国证券监督管理委员会(“中国证监会”) 证监许可 [2023] 828 号《关于准予金鹰研究驱动混合型证券投资基金注册的批复》核准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起，于 2023 年 10 月 17 日起向社会公开发行募集并于 2024 年 1 月 16 日正式成立。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，募集资金净额及募集利息合计为人民币 509,120,553.45 元。其中，A 类基金为人民币 3,793,972.19 元，C 类基金为人民币 505,326,581.26 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围主要为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票，债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12

月 31 日的财务状况、自 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a)金融工具的初始确认

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

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

(b)金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意

义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金

份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

（3）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

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

（7）公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以

公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

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

4、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。基金管理人在履行适当程序后，可对上述基金收益分配原则进行调整。

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃 (包括涨跌停时的交易不活跃) 等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协 (AMAC) 基金行业股票估值指数的通知》

提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6 号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引 (试行) >的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所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) ，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于

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

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

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

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

2018 年 1 月 1 日 (含) 以后，管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，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附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	106,949.42
等于：本金	106,917.34
加：应计利息	32.08
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	106,949.42

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,177,328.14	-	5,163,652.12	-13,676.02
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		5,177,328.14	-	5,163,652.12	-13,676.02

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用-审计费	9,515.66
合计	9,515.66

7.4.7.7 实收基金

金鹰研究驱动混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	3,793,972.19	3,793,972.19
本期申购	12,045,864.52	12,045,864.52
本期赎回（以“-”号填列）	-14,164,561.66	-14,164,561.66
本期末	1,675,275.05	1,675,275.05

金鹰研究驱动混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	505,326,581.26	505,326,581.26
本期申购	42,010,020.32	42,010,020.32
本期赎回（以“-”号填列）	-543,970,064.22	-543,970,064.22
本期末	3,366,537.36	3,366,537.36

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

金鹰研究驱动混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	271,195.70	2,744.30	273,940.00
本期基金份额交易产生的变动数	5,907.92	-130,412.41	-124,504.49
其中：基金申购款	158,420.65	-12,768.00	145,652.65
基金赎回款	-152,512.73	-117,644.41	-270,157.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	277,103.62	-127,668.11	149,435.51

金鹰研究驱动混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	875,966.77	-16,420.32	859,546.45
本期基金份额交易产生的变动数	-342,266.86	-238,741.49	-581,008.35
其中：基金申购款	375,601.55	-125,970.80	249,630.75
基金赎回款	-717,868.41	-112,770.69	-830,639.10
本期已分配利润	-	-	-
本期末	533,699.91	-255,161.81	278,538.10

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	22,718.83
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	-

其他	627,289.57
合计	650,008.40

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 16 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	69,847,807.29
减：卖出股票成本总额	68,632,496.76
减：交易费用	134,774.77
买卖股票差价收入	1,080,535.76

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	75,282.80
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	75,282.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
1.交易性金融资产	-13,676.02
——股票投资	-13,676.02
——债券投资	-
——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	-13,676.02

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
基金赎回费收入	163,582.38
转换费收入	3.28
合计	163,585.66

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期

	2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
审计费用	9,515.66
信息披露费	-
证券出借违约金	-
开户费	600.00
合计	10,115.66

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
上海浦东发展银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
广州金鹰资产管理有限公司	基金管理人子公司
广州白云山医药集团股份有限公司	基金管理人股东
广州越秀资本控股集团股份有限公司	基金管理人股东
东旭集团有限公司	基金管理人股东

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	724,720.03
其中：应支付销售机构的客户维护费	328,552.98
应支付基金管理人的净管理费	396,167.05

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.2%年费率计提。管理费的计算方法如下：

H＝E×1.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。如遇法定节假日、公休假，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	120,786.70

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.2%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

H＝E×0.2%÷当年天数

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。如遇法定节假日、公休假，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C	合计
上海浦东发展银行股份有限公司	-	240,570.41	240,570.41
金鹰基金管理有限公司	-	2.92	2.92
合计	-	240,573.33	240,573.33

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。

本基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.60%的年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

H＝E×0.60%÷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

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰研究驱动混合 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰研究驱动混合 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月16日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
上海浦东发展银行股份有限公司	106,949.42	22,718.83

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内未发生在承销期内参与关联方承销证券的情况。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

自 2024 年 7 月 1 日起，本基金在迷你基金期间，如涉及信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV 计算与发布费（如有）、注册登记费（如有）等相关固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。除前述事项外，本基金本报告期内无需作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

7.4.12 期末（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，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发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	-
合计	-

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。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	-
合计	-

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限资产投资比例等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。基金管理人通过久期、凸度等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	106,949.42	-	-	-	106,949.42
结算备付金	957.32	-	-	-	957.32
存出保证金	253,036.32	-	-	-	253,036.32
交易性金融资产	-	-	-	5,163,652.12	5,163,652.12

买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	13,847.29	13,847.29
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	360,943.06	-	-	5,177,499.41	5,538,442.47
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	-	-	-	50,327.84	50,327.84
应付管理人报酬	-	-	-	6,043.35	6,043.35
应付托管费	-	-	-	1,007.21	1,007.21
应付销售服务费	-	-	-	1,762.39	1,762.39
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	9,515.66	9,515.66
负债总计	-	-	-	68,656.45	68,656.45
利率敏感度缺口	360,943.06	-	-	5,108,842.96	5,469,786.02

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本期末未持有债券投资组合，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。本基金于 2024 年 01 月 16 日成立，无上年度数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，并且本基金基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末

	2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	5,163,652.12	94.40
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	5,163,652.12	94.40

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰研究驱动混合 A

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	62,535.85
	业绩比较基准变动-5%	-62,535.85

注：本基金于 2024 年 01 月 16 日成立，无上年度数据。

金鹰研究驱动混合 C

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	124,809.26
	业绩比较基准变动-5%	-124,809.26

注：本基金于 2024 年 01 月 16 日成立，无上年度数据。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	5,163,652.12
第二层次	-
第三层次	-
合计	5,163,652.12

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第二层级或第三层级，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层级。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	5,163,652.12	93.23
	其中：股票	5,163,652.12	93.23
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	107,906.74	1.95
8	其他各项资产	266,883.61	4.82
9	合计	5,538,442.47	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。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	362,260.00	6.62
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,666,693.12	67.04

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	224,667.00	4.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	910,032.00	16.64
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,163,652.12	94.40

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600309	万华化学	7,000	499,450.00	9.13
2	600150	中国船舶	11,700	420,732.00	7.69
3	301220	亚香股份	10,700	396,114.00	7.24
4	601989	中国重工	77,700	373,737.00	6.83
5	000059	华锦股份	77,700	372,183.00	6.80
6	300087	荃银高科	30,700	362,260.00	6.62

7	600685	中船防务	14,700	348,390.00	6.37
8	601398	工商银行	47,700	330,084.00	6.03
9	601939	建设银行	37,000	325,230.00	5.95
10	002601	龙佰集团	17,700	312,759.00	5.72
11	601288	农业银行	47,700	254,718.00	4.66
12	601000	唐山港	47,700	224,667.00	4.11
13	002283	天润工业	37,400	198,968.00	3.64
14	603095	越剑智能	7,700	169,477.00	3.10
15	688379	华光新材	7,700	157,234.00	2.87
16	002947	恒铭达	4,700	156,651.00	2.86
17	688035	德邦科技	4,137	152,034.75	2.78
18	688378	奥来德	4,777	108,963.37	1.99

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	3,316,979.00	60.64
2	600685	中船防务	3,314,041.00	60.59
3	600150	中国船舶	3,286,460.00	60.08
4	002601	龙佰集团	2,555,359.00	46.72
5	600710	苏美达	2,532,910.00	46.31
6	600482	中国动力	2,418,295.00	44.21
7	000059	华锦股份	2,146,374.00	39.24
8	601288	农业银行	1,507,036.00	27.55
9	000858	五 粮 液	1,488,039.00	27.20
10	603288	海天味业	1,441,630.00	26.36
11	600309	万华化学	1,392,570.00	25.46
12	601939	建设银行	1,259,604.00	23.03
13	300783	三只松鼠	1,167,462.00	21.34
14	300723	一品红	1,124,780.00	20.56
15	688379	华光新材	1,031,916.96	18.87
16	688488	艾迪药业	1,020,995.45	18.67
17	601766	中国中车	968,222.00	17.70
18	600754	锦江酒店	962,271.00	17.59
19	601857	中国石油	961,473.00	17.58
20	603209	兴通股份	960,323.00	17.56

21	002739	万达电影	900,770.00	16.47
22	601456	国联证券	877,355.00	16.04
23	601899	紫金矿业	841,470.00	15.38
24	600057	厦门象屿	839,790.00	15.35
25	601398	工商银行	829,756.00	15.17
26	601006	大秦铁路	801,783.00	14.66
27	300395	菲利华	756,665.00	13.83
28	000630	铜陵有色	744,572.00	13.61
29	688235	百济神州	743,158.57	13.59
30	688163	赛伦生物	738,539.59	13.50
31	002073	软控股份	713,085.00	13.04
32	002006	精工科技	689,381.00	12.60
33	603095	越剑智能	676,705.00	12.37
34	600893	航发动力	675,672.00	12.35
35	002283	天润工业	675,076.00	12.34
36	300923	研奥股份	628,113.00	11.48
37	688095	福昕软件	625,926.65	11.44
38	000819	岳阳兴长	607,890.00	11.11
39	300087	荃银高科	595,893.00	10.89
40	002078	太阳纸业	595,420.00	10.89
41	000932	华菱钢铁	589,323.00	10.77
42	002655	共达电声	555,949.00	10.16
43	688187	时代电气	550,959.32	10.07
44	603758	秦安股份	543,606.00	9.94
45	688515	裕太微	536,506.83	9.81
46	002025	航天电器	533,400.00	9.75
47	600941	中国移动	518,682.00	9.48
48	300793	佳禾智能	514,203.00	9.40
49	601600	中国铝业	513,915.00	9.40
50	600809	山西汾酒	498,828.00	9.12
51	688378	奥来德	481,266.40	8.80
52	603086	先达股份	475,616.00	8.70
53	603916	苏博特	470,879.00	8.61
54	301220	亚香股份	452,882.00	8.28
55	603185	弘元绿能	442,800.00	8.10
56	601929	吉视传媒	435,840.00	7.97
57	605289	罗曼股份	428,840.00	7.84
58	688289	圣湘生物	422,789.00	7.73
59	301322	绿通科技	422,249.00	7.72
60	002436	兴森科技	385,805.00	7.05
61	002458	益生股份	374,881.00	6.85
62	600961	株冶集团	359,065.00	6.56
63	000975	山金国际	358,644.00	6.56

64	002357	富临运业	325,815.00	5.96
65	603968	醋化股份	325,573.00	5.95
66	688382	益方生物	320,980.76	5.87
67	002314	南山控股	316,046.00	5.78
68	600114	东睦股份	292,412.00	5.35
69	000807	云铝股份	284,425.00	5.20
70	000423	东阿阿胶	282,460.00	5.16
71	688270	臻镭科技	265,897.93	4.86
72	600989	宝丰能源	263,625.00	4.82
73	601668	中国建筑	262,530.00	4.80
74	600266	城建发展	257,570.00	4.71
75	002246	北化股份	256,230.00	4.68
76	300059	东方财富	252,280.00	4.61
77	688321	微芯生物	249,188.50	4.56
78	688631	莱斯信息	247,900.00	4.53
79	601888	中国中免	247,179.00	4.52
80	688363	华熙生物	246,403.20	4.50
81	300896	爱美客	245,667.00	4.49
82	300033	同花顺	237,739.00	4.35
83	603605	珀莱雅	233,400.00	4.27
84	300758	七彩化学	225,681.00	4.13
85	688318	财富趋势	225,360.00	4.12
86	603010	万盛股份	223,793.00	4.09
87	002672	东江环保	223,299.00	4.08
88	601000	唐山港	220,851.00	4.04
89	300596	利安隆	219,153.00	4.01
90	600426	华鲁恒升	218,272.00	3.99
91	688017	绿的谐波	211,534.00	3.87
92	688443	智翔金泰	209,316.01	3.83
93	300750	宁德时代	207,076.00	3.79
94	002398	垒知集团	204,288.00	3.73
95	688202	美迪西	199,524.00	3.65
96	688176	亚虹医药	196,222.28	3.59
97	688628	优利德	191,172.06	3.50
98	688197	首药控股	189,306.26	3.46
99	300558	贝达药业	183,777.00	3.36
100	688177	百奥泰	179,634.96	3.28
101	688293	奥浦迈	179,627.58	3.28
102	002475	立讯精密	178,350.00	3.26
103	600519	贵州茅台	175,399.00	3.21
104	002415	海康威视	174,641.00	3.19
105	600276	恒瑞医药	174,058.00	3.18
106	688302	海创药业	173,183.24	3.17

107	300803	指南针	172,852.00	3.16
108	600168	武汉控股	168,980.00	3.09
109	688319	欧林生物	168,441.01	3.08
110	002947	恒铭达	166,119.00	3.04
111	688035	德邦科技	165,480.00	3.03
112	600691	阳煤化工	163,100.00	2.98
113	600362	江西铜业	162,565.00	2.97
114	003816	中国广核	158,730.00	2.90
115	002594	比亚迪	158,679.00	2.90
116	000818	航锦科技	153,698.00	2.81
117	000637	茂化实华	149,989.00	2.74
118	300760	迈瑞医疗	123,904.00	2.27
119	688326	经纬恒润	116,852.34	2.14
120	300248	新开普	116,390.00	2.13
121	002817	黄山胶囊	115,885.00	2.12
122	605488	福莱新材	115,096.00	2.10
123	301059	金三江	114,913.00	2.10
124	300203	聚光科技	112,955.00	2.07
125	002848	高斯贝尔	112,671.00	2.06
126	603721	中广天择	112,595.00	2.06
127	300320	海达股份	112,424.00	2.06
128	688716	中研股份	110,754.00	2.02
129	002876	三利谱	110,278.00	2.02

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例（%）
1	601989	中国重工	3,055,433.00	55.86
2	600150	中国船舶	2,932,115.00	53.61
3	600685	中船防务	2,892,458.00	52.88
4	600710	苏美达	2,574,580.00	47.07
5	600482	中国动力	2,569,102.00	46.97
6	002601	龙佰集团	2,423,329.00	44.30
7	000059	华锦股份	1,784,277.00	32.62
8	000858	五 粮 液	1,460,904.00	26.71
9	603288	海天味业	1,395,999.00	25.52
10	601288	农业银行	1,308,165.00	23.92

11	300783	三只松鼠	1,290,711.00	23.60
12	300723	一品红	1,099,846.00	20.11
13	601766	中国中车	1,069,161.00	19.55
14	600309	万华化学	991,649.00	18.13
15	601939	建设银行	988,586.00	18.07
16	603209	兴通股份	985,426.00	18.02
17	600754	锦江酒店	943,722.00	17.25
18	002739	万达电影	887,331.00	16.22
19	688379	华光新材	874,407.15	15.99
20	688488	艾迪药业	873,545.31	15.97
21	601857	中国石油	870,790.00	15.92
22	601456	国联证券	853,426.00	15.60
23	601899	紫金矿业	816,022.00	14.92
24	002073	软控股份	804,512.00	14.71
25	600057	厦门象屿	795,659.00	14.55
26	601006	大秦铁路	778,823.00	14.24
27	000630	铜陵有色	716,494.00	13.10
28	688163	赛伦生物	714,126.76	13.06
29	300395	菲利华	708,436.00	12.95
30	000932	华菱钢铁	704,529.00	12.88
31	002006	精工科技	702,495.00	12.84
32	688235	百济神州	688,382.37	12.59
33	688515	裕太微	668,829.47	12.23
34	002078	太阳纸业	652,229.00	11.92
35	600893	航发动力	638,231.00	11.67
36	688095	福昕软件	612,948.35	11.21
37	688187	时代电气	586,513.79	10.72
38	300923	研奥股份	570,600.00	10.43
39	000819	岳阳兴长	569,807.00	10.42
40	601398	工商银行	529,708.00	9.68
41	002655	共达电声	526,321.00	9.62
42	600809	山西汾酒	525,364.00	9.60
43	603758	秦安股份	503,504.00	9.21
44	002025	航天电器	496,848.00	9.08
45	603916	苏博特	494,546.00	9.04
46	601600	中国铝业	492,963.00	9.01
47	600941	中国移动	489,552.00	8.95
48	300793	佳禾智能	488,216.00	8.93
49	603086	先达股份	486,820.00	8.90
50	002283	天润工业	465,036.00	8.50
51	603095	越剑智能	461,724.00	8.44
52	605289	罗曼股份	446,960.00	8.17
53	301322	绿通科技	432,320.50	7.90

54	601929	吉视传媒	429,860.00	7.86
55	603185	弘元绿能	420,698.00	7.69
56	688289	圣湘生物	414,589.87	7.58
57	300059	东方财富	413,950.00	7.57
58	300896	爱美客	379,783.40	6.94
59	002458	益生股份	376,255.00	6.88
60	002436	兴森科技	374,282.00	6.84
61	300033	同花顺	370,650.00	6.78
62	688318	财富趋势	368,970.00	6.75
63	688378	奥来德	364,380.00	6.66
64	000975	山金国际	359,180.00	6.57
65	300803	指南针	358,900.00	6.56
66	600961	株冶集团	330,049.00	6.03
67	688382	益方生物	324,820.82	5.94
68	603968	醋化股份	321,173.00	5.87
69	688631	莱斯信息	314,023.52	5.74
70	002357	富临运业	311,057.00	5.69
71	601888	中国中免	307,100.00	5.61
72	002314	南山控股	303,033.00	5.54
73	688363	华熙生物	295,149.00	5.40
74	603605	珀莱雅	290,640.00	5.31
75	000807	云铝股份	282,127.00	5.16
76	600114	东睦股份	280,170.00	5.12
77	300087	荃银高科	277,011.00	5.06
78	002246	北化股份	270,000.00	4.94
79	000423	东阿阿胶	269,883.00	4.93
80	600266	城建发展	264,289.00	4.83
81	688270	臻镭科技	260,381.17	4.76
82	600989	宝丰能源	249,562.00	4.56
83	688321	微芯生物	245,241.38	4.48
84	601668	中国建筑	235,940.00	4.31
85	688443	智翔金泰	223,612.07	4.09
86	300758	七彩化学	218,865.00	4.00
87	300596	利安隆	215,688.00	3.94
88	002672	东江环保	214,104.00	3.91
89	688017	绿的谐波	214,073.18	3.91
90	600426	华鲁恒升	210,537.00	3.85
91	603010	万盛股份	206,314.00	3.77
92	688197	首药控股	203,909.99	3.73
93	002398	垒知集团	202,253.00	3.70
94	688319	欧林生物	198,558.36	3.63
95	300750	宁德时代	197,588.00	3.61
96	688202	美迪西	196,027.00	3.58

97	688176	亚虹医药	191,354.17	3.50
98	688302	海创药业	189,360.82	3.46
99	688628	优利德	188,802.00	3.45
100	002475	立讯精密	182,004.00	3.33
101	300558	贝达药业	181,017.00	3.31
102	600519	贵州茅台	170,306.00	3.11
103	002415	海康威视	170,196.00	3.11
104	688177	百奥泰	170,123.20	3.11
105	600691	阳煤化工	169,400.00	3.10
106	688293	奥浦迈	167,006.54	3.05
107	600276	恒瑞医药	162,023.00	2.96
108	600168	武汉控股	161,840.00	2.96
109	002594	比亚迪	157,500.00	2.88
110	600362	江西铜业	155,074.00	2.84
111	003816	中国广核	154,660.00	2.83
112	000637	茂化实华	145,899.00	2.67
113	000818	航锦科技	143,856.00	2.63
114	300760	迈瑞医疗	123,968.00	2.27
115	688716	中研股份	113,008.21	2.07
116	002817	黄山胶囊	109,917.00	2.01
117	002876	三利谱	109,814.00	2.01
118	300248	新开普	109,592.00	2.00

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	73,809,824.90
卖出股票收入（成交）总额	69,847,807.29

注：“买入股票成本”或“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。

8.5 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。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中国建设银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.11.2 本基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.11.3 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	253,036.32
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,847.29
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	266,883.61

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰研究驱动混合 A	126	13,295.83	0.00	0.00%	1,675,275.05	100.00%
金鹰研究驱动混合 C	1,225	2,748.19	0.00	0.00%	3,366,537.36	100.00%
合计	1,351	3,731.91	0.00	0.00%	5,041,812.41	100.00%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰研究驱动混合 A	171,507.83	10.24%
	金鹰研究驱动混合 C	54,140.97	1.61%
	合计	225,648.80	4.48%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰研究驱动混合 A	10~50
	金鹰研究驱动混合 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰研究驱动混合 A	0
	金鹰研究驱动混合 C	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰研究驱动混合 A	金鹰研究驱动混合 C
基金合同生效日（2024 年 1 月 16 日）基金份额总额	3,793,972.19	505,326,581.26
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,045,864.52	42,010,020.32
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	14,164,561.66	543,970,064.22
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,675,275.05	3,366,537.36

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期，本基金以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议投票表决时间为 2024 年 11 月 21 日至 2024 年 12 月 20 日，会议期间审议了《关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金持续运作的议案》。出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额未达到权益登记日本基金总份额的 50%，因此未达到规定的有效开会条件。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、本报告期内，本基金管理人无重大人事变动。

2、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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

1、本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

2、报告期内，不涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙），已连续为本基金提供 1 年审计服务。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 20000 元。自 2024 年 7 月 1 日起，本基金在迷你基金期间的审计费由管理人承担，不再从基金资产中列支。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，未发生基金托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情形。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华西证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券（联讯）	2	143,657,632.19	100.00%	90,651.34	100.00%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。自 2024 年 7 月 1 日起，根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华西证券	-	-	305,000,000.00	99.32%	-	-
粤开证券（联讯）	-	-	2,095,000.00	0.68%	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2024-01-02
2	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增广州银行股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-01-02
3	金鹰基金管理有限公司关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2024-01-09
4	金鹰基金管理有限公司关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2024-01-11
5	金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金提前结束募集的公告	证监会规定媒介	2024-01-12
6	金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定媒介	2024-01-17
7	金鹰基金管理有限公司金鹰研究驱动混合型证券投资基金开放日常申购（赎回、转换、定期定额投资）业务公告	证监会规定媒介	2024-01-17
8	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级评级方式相关事项的公告	证监会规定媒介	2024-02-01
9	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海大智慧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	2024-02-26
10	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-13
11	金鹰研究驱动混合型证券投资基金 2024 年一季度报告	证监会规定媒介	2024-04-22
12	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-04-22
13	金鹰基金管理有限公司部分基金新增宁波银行股份有限公司同业易管家平台为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-04-26
14	金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定媒介	2024-05-10
15	金鹰研究驱动混合型证券投资基金(金鹰研究驱动混合 C)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-15
16	金鹰研究驱动混合型证券投资基金(金鹰研究驱动混合 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-15
17	金鹰研究驱动混合型证券投资基金更新的招募说明书	证监会规定媒介	2024-05-15
18	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海国	证监会规定媒介	2024-05-16

	信嘉利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		
19	金鹰研究驱动混合型证券投资基金（金鹰研究驱动混合 A）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-31
20	金鹰研究驱动混合型证券投资基金（金鹰研究驱动混合 C）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-31
21	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海云湾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	2024-06-13
22	金鹰研究驱动混合型证券投资基金 2024 年第二季度报告	证监会规定媒介	2024-07-19
23	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第二季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-07-19
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与嘉实财富管理有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-08-02
25	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海汇付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	2024-08-06
26	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证监会规定媒介	2024-08-13
27	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与广州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	2024-08-21
28	金鹰研究驱动混合型证券投资基金 2024 年中期报告	证监会规定媒介	2024-08-30
29	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年中期报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-08-30
30	金鹰基金管理有限公司关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2024-09-04
31	金鹰基金管理有限公司部分基金新增京东肯特瑞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	2024-09-09
32	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海中正达广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	2024-09-10
33	金鹰研究驱动混合型证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2024-09-27
34	金鹰基金管理有限公司关于金鹰研究驱动混合型证券投资基金暂停大额申购(含转换转入、定期定额投资)公告	证监会规定媒介	2024-10-09
35	金鹰基金管理有限公司关于深圳分公司注销	证监会规定媒介	2024-10-11

	的公告		
36	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与招商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	2024-10-15
37	金鹰研究驱动混合型证券投资基金 2024 年第三季度报告	证监会规定媒介	2024-10-25
38	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第三季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-10-25
39	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与恒泰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	2024-11-01
40	金鹰基金管理有限公司关于终止乾道基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2024-11-18
41	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	证监会规定媒介	2024-11-21
42	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	证监会规定媒介	2024-11-22
43	金鹰基金管理有限公司关于以通讯方式召开金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	证监会规定媒介	2024-11-23
44	金鹰基金管理有限公司关于海南分公司注销的公告	证监会规定媒介	2024-12-04
45	金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金份额持有人大会会议情况的公告	证监会规定媒介	2024-12-24
46	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海好买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	2024-12-31

注：相关信息披露文件可登录本基金管理人网站查询。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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
个人	1	20240220-20240220	50,006,750.00	0.00	50,006,750.00	0.00	0.00%

	2	20241024-20241112	0.00	788,098.53	788,098.53	0.00	0.00%
	3	20240424-20240521、20240806-20240903、20241008-20241023	0.00	2,000,000.00	2,000,000.00	0.00	0.00%

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准发行及募集的文件。

2、《金鹰研究驱动混合型证券投资基金基金合同》。

3、《金鹰研究驱动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。

13.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

13.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日