

金鹰策略配置混合型证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

送出日期：二〇二五年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 5 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| §4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 9 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 9 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 10 |
| 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 | 10 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 11 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 11 |
| 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 | 11 |
| §5 托管人报告 | 12 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 12 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 12 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 12 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 12 |
| 6.1 资产负债表 | 12 |
| 6.2 利润表 | 14 |
| 6.3 净资产变动表 | 15 |
| 6.4 报表附注 | 16 |
| §7 投资组合报告 | 36 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 36 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 36 |
| 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 | 37 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 39 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 42 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 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 | 43 |
| 7.9 本基金投资股指期货的投资政策 | 43 |
| 7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 43 |
| 7.11 投资组合报告附注 | 43 |

| | |
|-----------------------------------|----|
| §8 基金份额持有人信息 | 44 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 44 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 45 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 | 45 |
| 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况 | 45 |
| 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 | 45 |
| §9 开放式基金份额变动 | 45 |
| §10 重大事件揭示 | 46 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议 | 46 |
| 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 | 46 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 | 46 |
| 10.4 基金投资策略的改变 | 46 |
| 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 | 46 |
| 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 | 46 |
| 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 | 46 |
| 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 | 47 |
| 10.9 其他重大事件 | 48 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| 11.1 影响投资者决策的其他重要信息 | 49 |
| §12 备查文件目录 | 49 |
| 12.1 备查文件目录 | 49 |
| 12.2 存放地点 | 50 |
| 12.3 查阅方式 | 50 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|------------------|
| 基金名称 | 金鹰策略配置混合型证券投资基金 |
| 基金简称 | 金鹰策略配置混合 |
| 基金主代码 | 210008 |
| 交易代码 | 210008 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2011 年 9 月 1 日 |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 230,701,523.87 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 在对基本面进行深入分析的基础上，制定适当的投资策略，以策略指导投资运作，在充分控制风险的前提下，分享中国经济快速发展的成果以及企业经营绩效提升所带来的股权溢价，力争实现基金资产的长期可持续稳健增值。 |
| 投资策略 | “防御”与“进取”的权衡与取舍是本基金进行大类资产配置、行业配置过程中的重要决策依据。通过对宏观经济所处投资时钟象限的判断、对股票市场与资金市场之间套利空间的测度，综合考察国内外宏观经济、财政政策与货币政策新动向、资本市场运行状况，对“防御”与“进取”目标适时、适度地有所侧重，将是本基金在投资策略上的现实选择。 |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数增长率×75%+中证全债指数增长率×25% |
| 风险收益特征 | 本基金为主动管理的混合型证券投资基金，属于证券投资基金中预期收益与风险较高的品种。一般情形下，其风险和预期收益均高于货币型基金、债券型基金。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|-------------|------|----------------------|--------------------------|
| 名称 | | 金鹰基金管理有限公司 | 中信银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 凡湘平 | 滕菲菲 |
| | 联系电话 | 020-83936180 | 4006800000 |
| | 电子邮箱 | csmail@gefund.com.cn | tengfeifei@citicbank.com |
| 客户服务电话 | | 4006135888 | 95558 |

| | | |
|-------|------------------------|------------------------------|
| 传真 | 020-83282856 | 010-85230024 |
| 注册地址 | 广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 办公地址 | 广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层 | 北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层 |
| 邮政编码 | 510623 | 100020 |
| 法定代表人 | 姚文强 | 方合英 |

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.gefund.com.cn |
| 基金中期报告备置地点 | 广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层 |

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日） |
|---------------|--------------------------------------|
| 本期已实现收益 | -56,832,766.21 |
| 本期利润 | -31,436,698.82 |
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1303 |
| 本期加权平均净值利润率 | -8.98% |
| 本期基金份额净值增长率 | -9.11% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -130,114,009.76 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.5640 |
| 期末基金资产净值 | 315,855,563.81 |
| 期末基金份额净值 | 1.3691 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2025 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | 96.49% |

- 注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额；
- 2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；
- 3、期末可供分配利润，指期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）；
- 4、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①－③ | ②－④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|---------|-------|
| 过去一个月 | 3.72% | 1.08% | 2.02% | 0.43% | 1.70% | 0.65% |
| 过去三个月 | -6.40% | 1.82% | 1.51% | 0.80% | -7.91% | 1.02% |
| 过去六个月 | -9.11% | 1.79% | 0.44% | 0.75% | -9.55% | 1.04% |
| 过去一年 | -8.28% | 2.15% | 12.12% | 1.03% | -20.40% | 1.12% |
| 过去三年 | -53.40% | 1.98% | -4.74% | 0.82% | -48.66% | 1.16% |
| 自基金合同生效起至今 | 96.49% | 1.95% | 56.44% | 1.02% | 40.05% | 0.93% |

注：本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率×75%＋中证全债指数增长率×25%。

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

金鹰策略配置混合型证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2011 年 9 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）



- 注：1、本基金合同于 2011 年 9 月 1 日正式生效；
- 2、本报告期末，本基金的各项投资比例符合基金合同约定；
- 3、本基金业绩比较基准为：沪深 300 指数增长率 \times 75%+中证全债指数增长率 \times 25%。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 72 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 | | |
| 韩广哲 | 本基金的基金经理，公司权益投研总监、权益投资部总经理 | 2019-10-30 | - | 18 | 韩广哲先生，吉林大学经济学博士。历任华夏基金管理有限公司组合经理、博士后工作站任博士后研究员、银华基金管理股份有限公司基金经理、信达证券管理股份有限公司投资业务总监等职务。2019 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投研总监、权益投资部总经理、基金经理兼投资经理。 |

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》和其他有关法律法规及其各项实施准则、《金鹰策略配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

报告期，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同

投资组合合同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，A 股市场整体震荡上行，在经历二季度初的关税冲击后，逐步回升并录得上涨。从风格方面看，微盘股指数领先，主题轮动特征明显；从行业方面看，有色金属、通信、银行等行业涨幅靠前，煤炭、食品饮料、地产等行业落后。年初以来，人形机器人、DeepSeek、新消费、海外算力链、创新药、固态电池、AI 智能体、军工贸易等多个板块阶段性表现强势，体现资金博弈下的市场活跃度较高；同时，在金融主管部门积极表态下，保险等多种类型资金持续关注权重板块，尤其是银行行业持续有资金流入，存在赚钱效应。

港股市场表现较好，科技、医药板块领涨。美股经历关税冲击后，形成深“V”调整，主要股指较具韧性，AI 相关龙头公司涨幅可观。

操作方面，本基金保持了中高水平股票仓位，提高了组合 beta 水平，配置以成长风格为主，布局了 AI 应用，包括智能体、医疗等；主题方面，参与了固态电池、创新药等方向。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值为 1.3691 元，本报告期份额净值增长率为-9.11%，同期业绩比较基准增长率为 0.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内宏观经济方面，预计继续缓慢复苏，央行“促物价合理回升”的目标存在挑战，PPI 短期内或仍难以转正。我们观察到多个行业推出“反内卷”政策倡议，例如光伏、钢铁、生猪养殖等，这些措施或将有助于扭转通缩状态。

中期看，我们认为中国经济仍处于转型升级阶段，地产与债务问题的处理或仍表征为以时间换空间，新的经济增长引擎仍需较长时间确立。我们认为 A 股在出现扎实的基本面增长支撑之前，可能维持震荡与主题轮动，并面临内外部政策与市场情绪带来的较大波动。

短期看，科技与成长方向可能延续海内外重大叙事逻辑，例如创新药、算力、大模型与 AI 应用、可控核聚变等；同时，关注促内需、反内卷、十五五规划等政策带来的顺周期板块风险偏好提升机会。

风险方面，我们关注地缘政治、中美关税政策等。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对金鹰策略配置混合型证券投资基金 2025 年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，金鹰基金管理有限公司在金鹰策略配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，金鹰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2025 年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|-------|---------|------------------------|--------------------------|
| 资 产： | | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 17,646,558.57 | 21,550,115.87 |
| 结算备付金 | | 2,783,505.87 | 3,371,017.45 |

| | | | |
|---------------|------------|--------------------------------|----------------------------------|
| 存出保证金 | | 430,609.09 | 439,612.47 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 296,802,530.59 | 354,193,838.32 |
| 其中：股票投资 | | 296,499,838.64 | 353,079,060.95 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 302,691.95 | 1,114,777.37 |
| 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 | - | 5,748,000.00 |
| 应收清算款 | | 4,972,807.34 | 101.65 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 144,893.47 | 226,388.72 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | - | - |
| 资产总计 | | 322,780,904.93 | 385,529,074.48 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 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 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 3,601,664.14 | 1,013,352.31 |
| 应付赎回款 | | 2,050,220.04 | 1,575,484.46 |
| 应付管理人报酬 | | 308,842.24 | 411,886.80 |
| 应付托管费 | | 51,473.67 | 68,647.79 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 913,141.03 | 1,315,575.22 |
| 负债合计 | | 6,925,341.12 | 4,384,946.58 |
| 净资产： | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 230,701,523.87 | 253,038,788.66 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | 85,154,039.94 | 128,105,339.24 |
| 净资产合计 | | 315,855,563.81 | 381,144,127.90 |
| 负债和净资产总计 | | 322,780,904.93 | 385,529,074.48 |

注：截至本报告期末 2025 年 06 月 30 日，基金份额净值为 1.3691 元，基金份额总额为 230,701,523.87 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------------------|----------|--|---|
| 一、营业总收入 | | -28,897,018.28 | -48,131,346.35 |
| 1.利息收入 | | 95,501.96 | 214,049.51 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 38,463.24 | 91,004.69 |
| 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 | | 57,038.72 | 123,044.82 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -54,417,026.77 | -65,244,125.74 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -55,656,069.22 | -67,275,539.74 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | -1,127.99 | 11,405.48 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 1,240,170.44 | 2,020,008.52 |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | 25,396,067.39 | 16,847,158.18 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.17 | 28,439.14 | 51,571.70 |
| 减：二、营业总支出 | | 2,539,680.54 | 3,321,352.00 |
| 1. 管理人报酬 | | 2,084,017.18 | 2,777,976.59 |
| 其中：暂估管理人报酬（若有） | | - | - |
| 2. 托管费 | | 347,336.17 | 462,996.13 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | - | - |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 108,327.19 | 80,379.28 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -31,436,698.82 | -51,452,698.35 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -31,436,698.82 | -51,452,698.35 |

| | | | |
|---------------|--|----------------|----------------|
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | -31,436,698.82 | -51,452,698.35 |

6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰策略配置混合型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|--|--|----------------|----------------|----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 253,038,788.66 | - | 128,105,339.24 | 381,144,127.90 |
| 二、本期期初净资产 | 253,038,788.66 | - | 128,105,339.24 | 381,144,127.90 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -22,337,264.79 | - | -42,951,299.30 | -65,288,564.09 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -31,436,698.82 | -31,436,698.82 |
| （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） | -22,337,264.79 | - | -11,514,600.48 | -33,851,865.27 |
| 其中：1.基金申购款 | 20,252,509.53 | - | 8,936,194.99 | 29,188,704.52 |
| 2.基金赎回款 | -42,589,774.32 | - | -20,450,795.47 | -63,040,569.79 |
| （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 | 230,701,523.87 | - | 85,154,039.94 | 315,855,563.81 |
| 项目 | 上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | 309,040,942.37 | - | 204,645,796.71 | 513,686,739.0 |

| | | | | |
|--|----------------|---|----------------|----------------|
| 产 | | | | 8 |
| 二、本期期初净资产 | 309,040,942.37 | - | 204,645,796.71 | 513,686,739.08 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -21,101,482.04 | - | -62,776,964.04 | -83,878,446.08 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -51,452,698.35 | -51,452,698.35 |
| （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） | -21,101,482.04 | - | -11,324,265.69 | -32,425,747.73 |
| 其中：1.基金申购款 | 22,732,128.40 | - | 13,055,816.21 | 35,787,944.61 |
| 2.基金赎回款 | -43,833,610.44 | - | -24,380,081.90 | -68,213,692.34 |
| （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 | 287,939,460.33 | - | 141,868,832.67 | 429,808,293.00 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰策略配置混合型证券投资基金（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【2011】970 号《关于准予金鹰策略配置混合型证券投资基金注册的批复》的核准，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》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《金鹰策略配置混合型证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。基金合同于 2011 年 9 月 1 日正式生效。本基金为契约型，存续期限为不定期。基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金 2011 年 7 月 20 日至 2011 年 8 月 26 日期间向社会公开发行募集，首次设立募集资金为

人民币 805,601,019.15 元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《金鹰策略配置混合型证券投资基金合同》的有关规定，本基金投资于具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。股票资产占基金资产净值的比例为 60%~95%；债券、货币市场工具、现金、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具占基金资产净值的 5%~40%，其中，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等，权证投资的比例范围占基金资产净值的 0%~3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金以持续经营为基础编制财务报表。本基金的财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则(以下简称“企业会计准则”)要求，并按照中国证监会颁布的《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>》以及发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在会计核算和信息披露方面亦参考了中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及其发布的若干基金行业实务操作。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会及基金业协会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金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

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008 年 9 月 18 日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

1. 证券投资基金(封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金)管理人运用基金买卖股票、债券免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。2018 年 1 月 1 日（含）以后，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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

3. 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位: 人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------------|------------------------|
| 活期存款 | 17,646,558.57 |
| 等于: 本金 | 17,645,247.05 |
| 加: 应计利息 | 1,311.52 |
| 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 | 17,646,558.57 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

| 项目 | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|-----|------------------------|----------|----------------|---------------|
| | | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | | 282,979,086.67 | - | 296,499,838.64 | 13,520,751.97 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所 | | 2,721.95 | | |
| | 市场 | 300,216.00 | | 302,691.95 | -246.00 |
| | 银行间 | | - | | |
| | 市场 | - | | - | - |
| | 合计 | 300,216.00 | 2,721.95 | 302,691.95 | -246.00 |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |

| | | | | |
|----|----------------|----------|----------------|---------------|
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 283,279,302.67 | 2,721.95 | 296,802,530.59 | 13,520,505.97 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | 5,209.49 |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 593,588.38 |
| 其中：交易所市场 | 593,588.38 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用-审计费 | 19,835.79 |
| 预提费用-信息披露费 | 219,507.37 |
| 应交税金-上交所债券 | 75,000.00 |
| 合计 | 913,141.03 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---------------------------------------|----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 253,038,788.66 | 253,038,788.66 |
| 本期申购 | 20,252,509.53 | 20,252,509.53 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -42,589,774.32 | -42,589,774.32 |
| 本期末 | 230,701,523.87 | 230,701,523.87 |

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|-----------------|----------------|----------------|
| 上年度末 | -81,636,388.60 | 209,741,727.84 | 128,105,339.24 |
| 本期期初 | -81,636,388.60 | 209,741,727.84 | 128,105,339.24 |
| 本期利润 | -56,832,766.21 | 25,396,067.39 | -31,436,698.82 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 8,355,145.05 | -19,869,745.53 | -11,514,600.48 |
| 其中：基金申购款 | -7,185,384.05 | 16,121,579.04 | 8,936,194.99 |
| 基金赎回款 | 15,540,529.10 | -35,991,324.57 | -20,450,795.47 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -130,114,009.76 | 215,268,049.70 | 85,154,039.94 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|-----------|---------------------------------------|
| 活期存款利息收入 | 32,777.33 |
| 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 | 4,724.13 |
| 其他 | 961.78 |
| 合计 | 38,463.24 |

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日 |
|------------|---------------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,425,000,649.30 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,478,477,088.23 |
| 减：交易费用 | 2,179,630.29 |
| 买卖股票差价收入 | -55,656,069.22 |

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|--------------------|----------------------------|
| 债券投资收益——利息收入 | 8,292.01 |
| 债券投资收益——买卖债券（债转股及债 | -9,420.00 |

| | |
|----------------|-----------|
| 券到期兑付) 差价收入 | |
| 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 | -1,127.99 |

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|------------------------|----------------------------|
| 卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额 | 1,523,850.00 |
| 减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额 | 1,509,420.00 |
| 减：应计利息总额 | 23,850.00 |
| 减：交易费用 | - |
| 买卖债券差价收入 | -9,420.00 |

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------------|----------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,240,170.44 |
| 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 | 1,240,170.44 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|-----------|----------------------------|
| 1.交易性金融资产 | 25,396,067.39 |
| ——股票投资 | 25,389,603.39 |
| ——债券投资 | 6,464.00 |

| | |
|----------------------------|---------------|
| ——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 | 25,396,067.39 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 基金赎回费收入 | 25,993.12 |
| 转换费收入 | 2,446.02 |
| 合计 | 28,439.14 |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 |
|---------|----------------------------|
| 审计费用 | 19,835.79 |
| 信息披露费 | 59,507.37 |
| 证券出借违约金 | - |
| 汇划手续费 | 1,984.03 |
| 账户维护费 | 27,000.00 |
| 合计 | 108,327.19 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|------------|-------------------|
| 金鹰基金管理有限公司 | 基金管理人、注册登记机构、销售机构 |
| 中信银行股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月 30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日 |
|------------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 2,084,017.18 | 2,777,976.59 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 883,199.04 | 1,187,705.48 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 1,200,818.14 | 1,590,271.11 |

注：1、基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.20% 的年费率计提，计算方法如下：

$$H=E\times 1.20\%/当年天数$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2025年1月1日至2025年6月 30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日 |
|----------------|--------------------------------|-------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 347,336.17 | 462,996.13 |

注：1、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：

$$H=E\times 0.20\%/ \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

2、基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2025年1月1日至2025年6月30日 | 上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日 |
|-------|----------------------------|---------------------------------|
| | | |

| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
|------------|---------------|-----------|---------------|-----------|
| 中信银行股份有限公司 | 17,646,558.57 | 32,777.33 | 23,663,060.01 | 56,447.97 |

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；2025 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 2,783,505.87 元，清算备付金利息收入 4,724.13 元；2024 年 6 月 30 日清算备付金期末余额 4,134,907.85 元，结算备付金利息收入 30,726.86 元。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金报告期及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末进行利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|------|---------|-------|--------|----------|-----------|-----------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量(单位：股) | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 688411 | 海博思创 | 2025-01-20 | 6 个月 | 科创板打新限售 | 19.38 | 83.49 | 560.00 | 10,852.80 | 46,754.40 | - |
| 688775 | 影石创新 | 2025-06-04 | 6 个月 | 科创板打新限售 | 47.27 | 124.16 | 256.00 | 12,101.12 | 31,784.96 | - |
| 301458 | 钧崴电子 | 2025-01-02 | 6 个月 | 创业板打新限售 | 10.40 | 34.11 | 701.00 | 7,290.40 | 23,911.11 | - |
| 301602 | 超研股份 | 2025-01-15 | 6 个月 | 创业板打新限售 | 6.70 | 24.80 | 658.00 | 4,408.60 | 16,318.40 | - |
| 30150 | 恒鑫 | 2025-0 | 6 个月 | 创业 | 27.49 | 45.22 | 334.00 | 9,181. | 15,103 | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|----------------|------------|-----------------|-------|-------|--------|---------------|---------------|---|
| 1 | 生活 | 3-11 | | 板打 新限售 | | | | 60 | .48 | |
| 30153 5 | 浙江 华远 | 2025-0 3-18 | 6 个月 | 创业 板打 新限售 | 4.92 | 18.99 | 734.00 | 3,611. 28 | 13,938 .66 | - |
| 68875 7 | 胜科 纳米 | 2025-0 3-18 | 6 个月 | 科创 板打 新限售 | 9.08 | 25.94 | 536.00 | 4,866. 88 | 13,903 .84 | - |
| 00138 8 | 信通 电子 | 2025-0 6-24 | 5 个交 易日 | 新股 未上 市 | 16.42 | 16.42 | 843.00 | 13,842 .06 | 13,842 .06 | - |
| 60307 2 | 天和 磁材 | 2024-1 2-24 | 6 个月 | 新股 锁定 | 12.30 | 54.45 | 226.00 | 2,779. 80 | 12,305 .70 | - |
| 00135 6 | 富岭 股份 | 2025-0 1-16 | 6 个月 | 新股 锁定 | 5.30 | 14.44 | 709.00 | 3,757. 70 | 10,237 .96 | - |
| 30165 8 | 首航 新能 | 2025-0 3-26 | 6 个月 | 创业 板打 新限售 | 11.80 | 22.98 | 437.00 | 5,156. 60 | 10,042 .26 | - |
| 30166 5 | 泰禾 股份 | 2025-0 4-02 | 6 个月 | 创业 板打 新限售 | 10.27 | 22.39 | 393.00 | 4,036. 11 | 8,799. 27 | - |
| 00138 2 | 新亚 电缆 | 2025-0 3-13 | 6 个月 | 新股 锁定 | 7.40 | 20.21 | 366.00 | 2,708. 40 | 7,396. 86 | - |
| 30163 6 | 泽润 新能 | 2025-0 4-30 | 6 个月 | 创业 板打 新限售 | 33.06 | 47.46 | 128.00 | 4,231. 68 | 6,074. 88 | - |
| 60321 0 | 泰鸿 万立 | 2025-0 4-01 | 6 个月 | 新股 锁定 | 8.60 | 15.61 | 286.00 | 2,459. 60 | 4,464. 46 | - |
| 60327 1 | 永杰 新材 | 2025-0 3-04 | 6 个月 | 新股 锁定 | 20.60 | 35.08 | 126.00 | 2,595. 60 | 4,420. 08 | - |
| 60312 4 | 江南 新材 | 2025-0 3-12 | 6 个月 | 新股 锁定 | 10.54 | 46.31 | 88.00 | 927.52 | 4,075. 28 | - |
| 00139 5 | 亚联 机械 | 2025-0 1-20 | 6 个月 | 新股 锁定 | 19.08 | 47.25 | 80.00 | 1,526. 40 | 3,780. 00 | - |
| 60340 9 | 汇通 控股 | 2025-0 2-25 | 6 个月 | 新股 锁定 | 24.18 | 33.32 | 100.00 | 2,418. 00 | 3,332. 00 | - |
| 00139 0 | 古麒 绒材 | 2025-0 5-21 | 6 个月 | 新股 锁定 | 12.08 | 18.12 | 178.00 | 2,150. 24 | 3,225. 36 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|------|------|-------|-------|-------|----------|----------|---|
| 603257 | 中国瑞林 | 2025-03-28 | 6 个月 | 新股锁定 | 20.52 | 37.47 | 78.00 | 1,600.56 | 2,922.66 | - |
| 603400 | 华之杰 | 2025-06-12 | 6 个月 | 新股锁定 | 19.88 | 43.81 | 57.00 | 1,133.16 | 2,497.17 | - |
| 001335 | 信凯科技 | 2025-04-02 | 6 个月 | 新股锁定 | 12.80 | 28.05 | 80.00 | 1,024.00 | 2,244.00 | - |
| 001388 | 信通电子 | 2025-06-24 | - | 新股锁定 | 16.42 | 16.42 | 94.00 | 1,543.48 | 1,543.48 | - |

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 6 月 30 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

为保证公司规范化运作，有效地防范和化解经营风险，确保基金和公司财务和其他信息真实、准确、完整、及时，从而最大程度地保护基金持有人的合法权益，本基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了科学合理、控制严密、运行高效的各项管理制度：

1、风险管理控制制度

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

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

2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

3、监察稽核制度

监察稽核制度包括检查公司各业务部门和工作人员是否遵守法律、法规、规章的有关规定；检查公司各业务部门和工作人员对公司内部控制制度、各项管理制度、业务规章的执行情况；对公司各部门作业流程的遵守合规性和有效性的检查、监督、评价及建议等。

6.4.13.2 信用风险

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

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 2025年6月30日 | 上年度末 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。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| A-1 | - | - |
| A-1 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 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。

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 2025年6月30日 | 上年度末 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。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 2024年12月31日 |
|--------|-------------------|---------------------|
| | | |

| | | |
|--------|---|---|
| AAA | - | - |
| AAA 以下 | - | - |
| 未评级 | - | - |
| 合计 | - | - |

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末 2025年6月30日 | 上年度末 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。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

市场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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |
|------------------------|---------------|-------|-------|----------------|----------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 17,646,558.57 | - | - | - | 17,646,558.57 |
| 结算备付金 | 2,783,505.87 | - | - | - | 2,783,505.87 |
| 存出保证金 | 430,609.09 | - | - | - | 430,609.09 |
| 交易性金融资产 | 302,691.95 | - | - | 296,499,838.64 | 296,802,530.59 |
| 买入返售金融资产 | - | - | - | - | - |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 4,972,807.34 | 4,972,807.34 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 144,893.47 | 144,893.47 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 21,163,365.48 | - | - | 301,617,539.45 | 322,780,904.93 |
| 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 | - | - | - | 3,601,664.14 | 3,601,664.14 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 2,050,220.04 | 2,050,220.04 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 308,842.24 | 308,842.24 |
| 应付托管费 | - | - | - | 51,473.67 | 51,473.67 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 913,141.03 | 913,141.03 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,925,341.12 | 6,925,341.12 |
| 利率敏感度缺口 | 21,163,365.48 | - | - | 294,692,198.33 | 315,855,563.81 |
| 上年度末 | 1 年以内 | 1-5 年 | 5 年以上 | 不计息 | 合计 |

| | | | | | |
|------------------|---------------|---|---|----------------|----------------|
| 2024 年 12 月 31 日 | | | | | |
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 21,550,115.87 | - | - | - | 21,550,115.87 |
| 结算备付金 | 3,371,017.45 | - | - | - | 3,371,017.45 |
| 存出保证金 | 439,612.47 | - | - | - | 439,612.47 |
| 交易性金融资产 | 1,114,777.37 | - | - | 353,079,060.95 | 354,193,838.32 |
| 买入返售金融资产 | 5,748,000.00 | - | - | - | 5,748,000.00 |
| 应收证券清算款 | - | - | - | 101.65 | 101.65 |
| 应收股利 | - | - | - | - | - |
| 应收申购款 | - | - | - | 226,388.72 | 226,388.72 |
| 其他资产 | - | - | - | - | - |
| 资产总计 | 32,223,523.16 | - | - | 353,305,551.32 | 385,529,074.48 |
| 负债 | | | | | |
| 短期借款 | - | - | - | - | - |
| 交易性金融负债 | - | - | - | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | - | - | - | - | - |
| 应付证券清算款 | - | - | - | 1,013,352.31 | 1,013,352.31 |
| 应付赎回款 | - | - | - | 1,575,484.46 | 1,575,484.46 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 411,886.80 | 411,886.80 |
| 应付托管费 | - | - | - | 68,647.79 | 68,647.79 |
| 应付销售服务费 | - | - | - | - | - |
| 应交税费 | - | - | - | - | - |
| 应付利润 | - | - | - | - | - |
| 其他负债 | - | - | - | 1,315,575.22 | 1,315,575.22 |
| 负债总计 | - | - | - | 4,384,946.58 | 4,384,946.58 |
| 利率敏感度缺口 | 32,223,523.16 | - | - | 348,920,604.74 | 381,144,127.90 |

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
|----|-----------|-----------------------------|--------------------------|
| | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |

| | | | |
|--|-------------|---------|---------|
| | 利率上升 25 个基点 | -245.24 | -874.56 |
| | 利率下降 25 个基点 | 246.03 | 877.31 |

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | | 上年度末 2024 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 | 296,499,838.64 | 93.87 | 353,079,060.95 | 92.64 |
| 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 | 296,499,838.64 | 93.87 | 353,079,060.95 | 92.64 |

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

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元） | |
|----|-------------|---------------------------------|--------------------------|
| | | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
| | 业绩比较基准变动+5% | 29,405,456.26 | 33,111,054.76 |
| | 业绩比较基准变动-5% | -29,405,456.26 | -33,111,054.76 |

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2025 年 6 月 30 日 | 上年度末 2024 年 12 月 31 日 |
|---------------|------------------------|--------------------------|
| 第一层次 | 296,236,920.31 | 352,733,712.78 |
| 第二层次 | 318,077.49 | 1,142,513.87 |
| 第三层次 | 247,532.79 | 317,611.67 |
| 合计 | 296,802,530.59 | 354,193,838.32 |

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2025 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 296,499,838.64 | 91.86 |
| | 其中：股票 | 296,499,838.64 | 91.86 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 302,691.95 | 0.09 |
| | 其中：债券 | 302,691.95 | 0.09 |
| | 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 | 20,430,064.44 | 6.33 |
| 8 | 其他各项资产 | 5,548,309.90 | 1.72 |
| 9 | 合计 | 322,780,904.93 | 100.00 |

注：其他各项资产包括：交易保证金、应收利息、应收证券清算款、其他应收款、应收申购款、待摊费用。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------------------|----------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 258,389,873.81 | 81.81 |
| 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 | 2,244.00 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 22,484.93 | 0.01 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 23,989,185.40 | 7.59 |
| J | 金融业 | 11,424,584.00 | 3.62 |
| 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 | 16,826.50 | 0.01 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 2,654,640.00 | 0.84 |
| 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 | 296,499,838.64 | 93.87 |

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量（股） | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|------|-----------|---------------|--------------|
| 1 | 603659 | 璞泰来 | 1,150,175 | 21,600,286.50 | 6.84 |
| 2 | 688778 | 厦钨新能 | 361,109 | 20,193,215.28 | 6.39 |
| 3 | 300750 | 宁德时代 | 65,000 | 16,394,300.00 | 5.19 |
| 4 | 688500 | 慧辰股份 | 361,162 | 15,782,779.40 | 5.00 |
| 5 | 301325 | 曼恩斯特 | 192,628 | 12,000,724.40 | 3.80 |
| 6 | 603306 | 华懋科技 | 266,200 | 11,579,700.00 | 3.67 |
| 7 | 301662 | 宏工科技 | 107,300 | 11,354,486.00 | 3.59 |
| 8 | 688499 | 利元亨 | 266,592 | 11,092,893.12 | 3.51 |
| 9 | 688005 | 容百科技 | 458,457 | 10,232,760.24 | 3.24 |
| 10 | 688573 | 信宇人 | 285,307 | 9,871,622.20 | 3.13 |
| 11 | 002074 | 国轩高科 | 283,900 | 9,215,394.00 | 2.92 |
| 12 | 688116 | 天奈科技 | 198,988 | 9,107,680.76 | 2.88 |

| | | | | | |
|----|--------|-------|---------|--------------|------|
| 13 | 300568 | 星源材质 | 717,800 | 9,101,704.00 | 2.88 |
| 14 | 601211 | 国泰海通 | 472,700 | 9,056,932.00 | 2.87 |
| 15 | 002741 | 光华科技 | 428,700 | 9,036,996.00 | 2.86 |
| 16 | 301487 | 盟固利 | 411,100 | 8,974,313.00 | 2.84 |
| 17 | 688353 | 华盛锂电 | 269,228 | 8,906,062.24 | 2.82 |
| 18 | 688299 | 长阳科技 | 404,248 | 7,991,982.96 | 2.53 |
| 19 | 300450 | 先导智能 | 315,100 | 7,830,235.00 | 2.48 |
| 20 | 300587 | 天铁科技 | 960,600 | 6,925,926.00 | 2.19 |
| 21 | 300457 | 赢合科技 | 283,500 | 6,520,500.00 | 2.06 |
| 22 | 300409 | 道氏技术 | 378,600 | 6,413,484.00 | 2.03 |
| 23 | 688288 | 鸿泉物联 | 199,269 | 5,780,793.69 | 1.83 |
| 24 | 002846 | 英联股份 | 284,400 | 5,676,624.00 | 1.80 |
| 25 | 300395 | 菲利华 | 96,900 | 4,951,590.00 | 1.57 |
| 26 | 300014 | 亿纬锂能 | 104,600 | 4,791,726.00 | 1.52 |
| 27 | 301172 | 君逸数码 | 163,520 | 3,376,688.00 | 1.07 |
| 28 | 605088 | 冠盛股份 | 88,700 | 3,363,504.00 | 1.06 |
| 29 | 300674 | 宇信科技 | 109,200 | 3,307,668.00 | 1.05 |
| 30 | 300586 | 美联新材 | 305,390 | 3,258,511.30 | 1.03 |
| 31 | 300035 | 中科电气 | 191,900 | 3,239,272.00 | 1.03 |
| 32 | 688567 | 孚能科技 | 215,525 | 3,125,112.50 | 0.99 |
| 33 | 688559 | 海目星 | 93,463 | 3,074,932.70 | 0.97 |
| 34 | 605100 | 华丰股份 | 153,300 | 3,058,335.00 | 0.97 |
| 35 | 003043 | 华亚智能 | 37,200 | 1,623,780.00 | 0.51 |
| 36 | 002987 | 京北方 | 73,000 | 1,522,050.00 | 0.48 |
| 37 | 603199 | 九华旅游 | 38,800 | 1,406,112.00 | 0.45 |
| 38 | 000888 | 峨眉山 A | 88,800 | 1,248,528.00 | 0.40 |
| 39 | 300073 | 当升科技 | 26,700 | 1,171,329.00 | 0.37 |
| 40 | 600030 | 中信证券 | 36,600 | 1,010,892.00 | 0.32 |
| 41 | 300059 | 东方财富 | 29,700 | 686,961.00 | 0.22 |
| 42 | 601319 | 中国人保 | 76,900 | 669,799.00 | 0.21 |
| 43 | 605208 | 永茂泰 | 47,100 | 626,430.00 | 0.20 |
| 44 | 688411 | 海博思创 | 560 | 46,754.40 | 0.01 |
| 45 | 688605 | 先锋精科 | 744 | 46,611.60 | 0.01 |
| 46 | 688775 | 影石创新 | 256 | 31,784.96 | 0.01 |
| 47 | 301458 | 钧崴电子 | 701 | 23,911.11 | 0.01 |
| 48 | 001391 | 国货航 | 3,341 | 22,484.93 | 0.01 |
| 49 | 301602 | 超研股份 | 658 | 16,318.40 | 0.01 |
| 50 | 001388 | 信通电子 | 937 | 15,385.54 | 0.00 |
| 51 | 301501 | 恒鑫生活 | 334 | 15,103.48 | 0.00 |
| 52 | 301535 | 浙江华远 | 734 | 13,938.66 | 0.00 |
| 53 | 688757 | 胜科纳米 | 536 | 13,903.84 | 0.00 |
| 54 | 603194 | 中力股份 | 291 | 13,208.49 | 0.00 |
| 55 | 603072 | 天和磁材 | 226 | 12,305.70 | 0.00 |
| 56 | 001356 | 富岭股份 | 709 | 10,237.96 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 57 | 301658 | 首航新能 | 437 | 10,042.26 | 0.00 |
| 58 | 301665 | 泰禾股份 | 393 | 8,799.27 | 0.00 |
| 59 | 001382 | 新亚电缆 | 366 | 7,396.86 | 0.00 |
| 60 | 301636 | 泽润新能 | 128 | 6,074.88 | 0.00 |
| 61 | 603210 | 泰鸿万立 | 286 | 4,464.46 | 0.00 |
| 62 | 603271 | 永杰新材 | 126 | 4,420.08 | 0.00 |
| 63 | 603124 | 江南新材 | 88 | 4,075.28 | 0.00 |
| 64 | 001395 | 亚联机械 | 80 | 3,780.00 | 0.00 |
| 65 | 603409 | 汇通控股 | 100 | 3,332.00 | 0.00 |
| 66 | 001390 | 古麒绒材 | 178 | 3,225.36 | 0.00 |
| 67 | 603257 | 中国瑞林 | 78 | 2,922.66 | 0.00 |
| 68 | 603400 | 华之杰 | 57 | 2,497.17 | 0.00 |
| 69 | 001335 | 信凯科技 | 80 | 2,244.00 | 0.00 |

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|---------------|--------------------|
| 1 | 601899 | 紫金矿业 | 44,948,249.00 | 11.79 |
| 2 | 300253 | 卫宁健康 | 33,619,932.32 | 8.82 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 28,657,696.00 | 7.52 |
| 4 | 688246 | 嘉和美康 | 25,443,247.34 | 6.68 |
| 5 | 601127 | 赛力斯 | 23,227,283.00 | 6.09 |
| 6 | 300750 | 宁德时代 | 22,653,669.00 | 5.94 |
| 7 | 688288 | 鸿泉物联 | 21,799,890.64 | 5.72 |
| 8 | 000516 | 国际医学 | 21,654,445.00 | 5.68 |
| 9 | 002044 | 美年健康 | 21,373,979.00 | 5.61 |
| 10 | 603108 | 润达医疗 | 21,218,584.00 | 5.57 |
| 11 | 002050 | 三花智控 | 19,642,582.00 | 5.15 |
| 12 | 603659 | 璞泰来 | 19,570,052.40 | 5.13 |
| 13 | 688778 | 厦钨新能 | 19,417,716.10 | 5.09 |
| 14 | 601689 | 拓普集团 | 18,580,483.25 | 4.87 |
| 15 | 600519 | 贵州茅台 | 18,466,012.00 | 4.84 |
| 16 | 000503 | 国新健康 | 17,610,957.58 | 4.62 |
| 17 | 002475 | 立讯精密 | 17,329,023.30 | 4.55 |
| 18 | 603882 | 金域医学 | 16,715,582.00 | 4.39 |
| 19 | 000063 | 中兴通讯 | 15,656,639.00 | 4.11 |
| 20 | 601211 | 国泰海通 | 15,511,835.72 | 4.07 |
| 21 | 688500 | 慧辰股份 | 14,783,726.67 | 3.88 |

| | | | | |
|----|--------|-------|---------------|------|
| 22 | 302132 | 中航成飞 | 14,363,095.00 | 3.77 |
| 23 | 300451 | 创业慧康 | 13,605,635.00 | 3.57 |
| 24 | 301325 | 曼恩斯特 | 12,524,692.88 | 3.29 |
| 25 | 002292 | 奥飞娱乐 | 12,259,164.00 | 3.22 |
| 26 | 300033 | 同花顺 | 12,251,222.00 | 3.21 |
| 27 | 000858 | 五 粮 液 | 12,129,429.00 | 3.18 |
| 28 | 600809 | 山西汾酒 | 12,126,336.00 | 3.18 |
| 29 | 688256 | 寒武纪 | 12,108,277.14 | 3.18 |
| 30 | 002352 | 顺丰控股 | 11,141,299.00 | 2.92 |
| 31 | 002987 | 京北方 | 11,018,694.40 | 2.89 |
| 32 | 600988 | 赤峰黄金 | 10,963,892.00 | 2.88 |
| 33 | 301662 | 宏工科技 | 10,623,795.00 | 2.79 |
| 34 | 603306 | 华懋科技 | 10,375,638.00 | 2.72 |
| 35 | 688331 | 荣昌生物 | 9,790,183.09 | 2.57 |
| 36 | 688116 | 天奈科技 | 9,692,190.62 | 2.54 |
| 37 | 002065 | 东华软件 | 9,684,374.00 | 2.54 |
| 38 | 301487 | 盟固利 | 9,612,310.00 | 2.52 |
| 39 | 301230 | 泓博医药 | 9,605,125.40 | 2.52 |
| 40 | 000997 | 新 大 陆 | 9,496,317.00 | 2.49 |
| 41 | 688278 | 特宝生物 | 9,413,940.21 | 2.47 |
| 42 | 688192 | 迪哲医药 | 9,411,431.36 | 2.47 |
| 43 | 600760 | 中航沈飞 | 9,354,292.56 | 2.45 |
| 44 | 688005 | 容百科技 | 9,230,593.07 | 2.42 |
| 45 | 688353 | 华盛锂电 | 9,146,656.56 | 2.40 |
| 46 | 688499 | 利元亨 | 9,079,323.51 | 2.38 |
| 47 | 002384 | 东山精密 | 8,717,843.00 | 2.29 |
| 48 | 300568 | 星源材质 | 8,662,192.44 | 2.27 |
| 49 | 601398 | 工商银行 | 8,659,604.00 | 2.27 |
| 50 | 002074 | 国轩高科 | 8,571,564.59 | 2.25 |
| 51 | 688776 | 国光电气 | 8,471,606.17 | 2.22 |
| 52 | 002741 | 光华科技 | 8,392,574.00 | 2.20 |
| 53 | 300395 | 菲利华 | 8,272,795.00 | 2.17 |
| 54 | 603198 | 迎驾贡酒 | 8,086,639.00 | 2.12 |
| 55 | 603369 | 今世缘 | 8,086,601.00 | 2.12 |
| 56 | 000596 | 古井贡酒 | 8,076,210.00 | 2.12 |
| 57 | 000568 | 泸州老窖 | 8,074,947.00 | 2.12 |
| 58 | 688573 | 信宇人 | 7,962,699.35 | 2.09 |
| 59 | 688299 | 长阳科技 | 7,945,525.73 | 2.08 |
| 60 | 300803 | 指南针 | 7,910,711.00 | 2.08 |
| 61 | 688629 | 华丰科技 | 7,889,869.78 | 2.07 |

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

7.4.2 累计卖出金额超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 | 601899 | 紫金矿业 | 49,876,094.00 | 13.09 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 31,724,334.00 | 8.32 |
| 3 | 688111 | 金山办公 | 30,233,636.65 | 7.93 |
| 4 | 688981 | 中芯国际 | 29,945,242.35 | 7.86 |
| 5 | 002371 | 北方华创 | 27,031,228.94 | 7.09 |
| 6 | 002475 | 立讯精密 | 26,055,560.20 | 6.84 |
| 7 | 601127 | 赛力斯 | 24,671,520.00 | 6.47 |
| 8 | 300253 | 卫宁健康 | 24,669,784.70 | 6.47 |
| 9 | 002050 | 三花智控 | 23,943,304.84 | 6.28 |
| 10 | 601689 | 拓普集团 | 20,454,966.75 | 5.37 |
| 11 | 600519 | 贵州茅台 | 19,801,285.00 | 5.20 |
| 12 | 688246 | 嘉和美康 | 18,765,060.48 | 4.92 |
| 13 | 000516 | 国际医学 | 18,370,885.50 | 4.82 |
| 14 | 002594 | 比亚迪 | 18,195,547.00 | 4.77 |
| 15 | 603108 | 润达医疗 | 17,517,519.61 | 4.60 |
| 16 | 002044 | 美年健康 | 17,224,840.00 | 4.52 |
| 17 | 300033 | 同花顺 | 16,980,620.00 | 4.46 |
| 18 | 000063 | 中兴通讯 | 16,367,353.20 | 4.29 |
| 19 | 002384 | 东山精密 | 16,244,005.00 | 4.26 |
| 20 | 000503 | 国新健康 | 14,955,699.00 | 3.92 |
| 21 | 302132 | 中航成飞 | 14,481,054.00 | 3.80 |
| 22 | 600809 | 山西汾酒 | 14,120,286.00 | 3.70 |
| 23 | 000858 | 五 粮 液 | 13,695,733.00 | 3.59 |
| 24 | 601398 | 工商银行 | 13,072,196.99 | 3.43 |
| 25 | 603882 | 金域医学 | 13,034,259.00 | 3.42 |
| 26 | 002292 | 奥飞娱乐 | 12,605,369.00 | 3.31 |
| 27 | 688256 | 寒武纪 | 12,479,061.51 | 3.27 |
| 28 | 600036 | 招商银行 | 12,314,966.00 | 3.23 |
| 29 | 300750 | 宁德时代 | 12,152,198.80 | 3.19 |
| 30 | 688288 | 鸿泉物联 | 11,856,573.77 | 3.11 |
| 31 | 300308 | 中际旭创 | 10,941,209.00 | 2.87 |
| 32 | 688012 | 中微公司 | 10,878,214.56 | 2.85 |
| 33 | 002352 | 顺丰控股 | 10,815,802.00 | 2.84 |
| 34 | 688192 | 迪哲医药 | 10,573,858.77 | 2.77 |
| 35 | 300451 | 创业慧康 | 10,558,229.00 | 2.77 |
| 36 | 600988 | 赤峰黄金 | 10,507,849.00 | 2.76 |
| 37 | 688331 | 荣昌生物 | 10,411,672.64 | 2.73 |
| 38 | 301230 | 泓博医药 | 10,122,718.00 | 2.66 |
| 39 | 600760 | 中航沈飞 | 9,942,833.00 | 2.61 |
| 40 | 002987 | 京北方 | 9,838,922.48 | 2.58 |
| 41 | 688629 | 华丰科技 | 9,757,180.46 | 2.56 |

| | | | | |
|----|--------|-------|--------------|------|
| 42 | 300442 | 润泽科技 | 9,613,260.00 | 2.52 |
| 43 | 603369 | 今世缘 | 9,198,960.00 | 2.41 |
| 44 | 688278 | 特宝生物 | 9,102,524.00 | 2.39 |
| 45 | 002938 | 鹏鼎控股 | 9,085,020.56 | 2.38 |
| 46 | 000997 | 新 大 陆 | 9,000,197.40 | 2.36 |
| 47 | 601166 | 兴业银行 | 8,634,349.00 | 2.27 |
| 48 | 300803 | 指南针 | 8,381,007.00 | 2.20 |
| 49 | 601211 | 国泰海通 | 8,294,981.00 | 2.18 |
| 50 | 000596 | 古井贡酒 | 8,286,206.00 | 2.17 |
| 51 | 000568 | 泸州老窖 | 8,099,810.28 | 2.13 |
| 52 | 300395 | 菲利华 | 7,864,434.00 | 2.06 |
| 53 | 603198 | 迎驾贡酒 | 7,757,599.00 | 2.04 |
| 54 | 601688 | 华泰证券 | 7,712,906.00 | 2.02 |
| 55 | 688776 | 国光电气 | 7,657,087.70 | 2.01 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,396,508,262.53 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,425,000,649.30 |

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。

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 | 302,691.95 | 0.10 |
| 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 | 302,691.95 | 0.10 |

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 | 019758 | 24 国债 21 | 3,000.00 | 302,691.95 | 0.10 |

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.10.1 本期国债期货投资政策

无。

7.10.2 本期国债期货投资评价

无。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一

年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.11.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.11.3 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 | 430,609.09 |
| 2 | 应收清算款 | 4,972,807.34 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 144,893.47 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 5,548,309.90 |

7.11.4 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。

7.11.5 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情况。

7.11.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 持有人户数(户) | 户均持有的 基金份额 | 持有人结构 | | | |
|----------|---------------|-------|------------|-------|------------|
| | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | 持有份额 | 占总份额 比例 | 持有份额 | 占总份额 比例 |

| | | | | | |
|--------|----------|------------|-------|----------------|--------|
| 33,265 | 6,935.26 | 435,188.16 | 0.19% | 230,266,335.71 | 99.81% |
|--------|----------|------------|-------|----------------|--------|

8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市交易型基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|------------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 103,271.82 | 0.04% |

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|-------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2011 年 9 月 1 日）基金份额总额 | 805,601,019.15 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 253,038,788.66 |
| 本报告期基金总申购份额 | 20,252,509.53 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 42,589,774.32 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |

| | |
|-------------|----------------|
| 本报告期末基金份额总额 | 230,701,523.87 |
|-------------|----------------|

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未发生重大变化。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，托管人托管业务部门及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 单元 数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------------|----------------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 东北证券 | 1 | 579,743,427.95 | 20.55% | 264,306.55 | 20.55% | - |
| 东方证券 | 1 | 347,853,951.11 | 12.33% | 158,588.39 | 12.33% | - |
| 东莞证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | 1 | 36,620,408.66 | 1.30% | 17,061.50 | 1.33% | - |
| 华泰证券 | 1 | 326,395,229.20 | 11.57% | 148,795.72 | 11.57% | - |
| 华西证券 | 1 | 734,657,825.53 | 26.05% | 334,925.92 | 26.04% | - |
| 江海证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | 1 | 62,088,608.91 | 2.20% | 28,305.85 | 2.20% | - |
| 中泰证券（齐鲁） | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南（广证） | 1 | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | 2 | 452,928,572.85 | 16.06% | 206,491.28 | 16.05% | - |
| 开源证券 | 2 | 280,326,441.74 | 9.94% | 127,797.65 | 9.94% | - |

注：本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的专用交易单元。本基金专用交易单元的选择标准如下：

- （1）财务状况良好；
- （2）经营行为规范，最近一年相关业务未发生重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- （3）具备较强的合规风控能力，包括具有较完备的内控制度、内部管理流程体系及信息系统建设等；
- （4）具备较强的交易能力或者研究服务能力，包括配备充足人员、交易系统稳定或能够提供具有针对性的较高质量研究成果等。

本基金专用交易单元的选择程序如下：

- （1）本基金管理人根据上述标准考察后初步确定选用交易单元的证券公司；
- （2）由研究部门统筹安排与提供证券交易服务的证券公司签订相关服务协议并发起相关流程；
- （3）经研究部门分管领导、合规风控部人员、督察长及总经理审批后予以执行。

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。2024 年 7 月 1 日前，该类佣

金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。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。

10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 债券回购交易 | | 权证交易 | |
|------------|------------|--------------|----------------|----------------|------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期债券成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期债券回购成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期权证成交总额的比例 |
| 东北证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东方证券 | - | - | - | - | - | - |
| 东莞证券 | - | - | - | - | - | - |
| 方正证券 | - | - | - | - | - | - |
| 国泰君安证券 | - | - | 81,654,000.00 | 10.42% | - | - |
| 华泰证券 | 300,216.00 | 42.88% | 212,721,000.00 | 27.14% | - | - |
| 华西证券 | - | - | 422,472,000.00 | 53.90% | - | - |
| 江海证券 | - | - | - | - | - | - |
| 西南证券 | - | - | - | - | - | - |
| 银河证券 | - | - | - | - | - | - |
| 中泰证券（齐鲁） | - | - | - | - | - | - |
| 中信证券华南（广证） | - | - | - | - | - | - |
| 广发证券 | - | - | - | - | - | - |
| 开源证券 | 399,960.00 | 57.12% | 66,899,000.00 | 8.54% | - | - |

10.9 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日 |
|----|------|--------|-------|
|----|------|--------|-------|

| | | | 期 |
|----|--|---------|------------|
| 1 | 金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告 | 证监会规定媒介 | 2025-01-04 |
| 2 | 金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第四季度报告提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2025-01-22 |
| 3 | 金鹰策略配置混合型证券投资基金 2024 年第四季度报告 | 证监会规定媒介 | 2025-01-22 |
| 4 | 金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年年度报告提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 5 | 金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况公告 | 证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 6 | 金鹰策略配置混合型证券投资基金 2024 年年度报告 | 证监会规定媒介 | 2025-03-31 |
| 7 | 金鹰策略配置混合型证券投资基金 2025 年第一季度报告 | 证监会规定媒介 | 2025-04-22 |
| 8 | 金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第一季度报告提示性公告 | 证监会规定媒介 | 2025-04-22 |
| 9 | 金鹰基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)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 | 2025-05-30 |
| 10 | 金鹰策略配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新 | 证监会规定媒介 | 2025-05-30 |

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

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日