

# 金鹰元禧混合型证券投资基金

## 2023 年中期报告

### 2023 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>§2 基金简介</b> .....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
<b>§3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
<b>§4 管理人报告</b> .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	13
<b>§5 托管人报告</b> .....	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
<b>§6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
<b>§7 投资组合报告</b> .....	44
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	45
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.....	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	48
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.....	48
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.....	49
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.....	49
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	49

7.12 投资组合报告附注 .....	49
<b>§8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>50</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	51
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	51
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 .....	51
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	51
§9 开放式基金份额变动 .....	51
<b>§10 重大事件揭示</b> .....	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
10.4 基金投资策略的改变 .....	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	52
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 .....	53
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	53
10.9 其他重大事件 .....	57
<b>§11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>59</b>
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况 .....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	59
<b>§12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	60
12.3 查阅方式 .....	60

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰元禧混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰元禧混合	
基金主代码	210006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017 年 6 月 27 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	14,571,990.64 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
下属分级基金的交易代码	210006	002425
报告期末下属分级基金的份额总额	11,816,406.81 份	2,755,583.83 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在有效控制风险的前提下,力争使基金份额持有人获得超额收益与长期资本增值。
投资策略	本基金在投资组合管理过程中采取主动投资方法,通过数量化方法严格控制风险,并通过有效的资产配置策略,动态调整安全资产和风险资产的投资比例,注重风险与收益的平衡,力争实现基金资产长期稳健增值。本基金采用固定比例组合保险策略(CPPI),该策略是国际通行的一种投资组合保险策略。其基本原理是将基金资产按一定比例划分为安全资产和风险资产,其中安全资产将投资于各类债券及银行存款,以保证投资本金的安全性;而除安全资产外的风险资产主要投资于股票、权证登权益类资产,以提升基金投资者的收益。本基金综合考虑国内外政治经济环境、资本市场运行状况、固定收益类与权益类风险资产收益特征、基金净资产和价值底线等因素,结合资产配置研究结果和市场运行状态,动态调整安全资产和风险资产的配置比例,力争在确保本金安全的前提下,稳健获取投资收益。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金,其预期收益和风险水平低于股票型基金,高于债券型基金和货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称		金鹰基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	郭明
	联系电话	020-83936180	010-66105799
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4006135888	95588
传真		020-83282856	010-66105798
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街 2号3212房	北京市西城区复兴门内大街55 号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	北京市西城区复兴门内大街55 号
邮政编码		510623	100140
法定代表人		姚文强	陈四清

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gefund.com.cn">http://www.gefund.com.cn</a>
基金中期报告备置地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）	
	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
本期已实现收益	970,568.16	111,261.62
本期利润	645,055.40	33,816.68
加权平均基金份额本期利润	0.0322	0.0111

本期加权平均净值利润率	2.27%	0.79%
本期基金份额净值增长率	0.62%	0.57%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
期末可供分配利润	5,899,287.62	1,094,127.92
期末可供分配基金份额利润	0.4992	0.3971
期末基金资产净值	16,553,540.63	3,849,711.75
期末基金份额净值	1.4009	1.3971
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>	
	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
基金份额累计净值增长率	25.30%	24.74%

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

2、本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

金鹰元禧混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.26%	0.22%	0.67%	0.16%	-0.41%	0.06%
过去三个月	-1.68%	0.23%	0.45%	0.16%	-2.13%	0.07%
过去六个月	0.62%	0.24%	1.95%	0.16%	-1.33%	0.08%
过去一年	-3.50%	0.32%	0.55%	0.19%	-4.05%	0.13%
过去三年	14.28%	0.33%	9.04%	0.24%	5.24%	0.09%
自基金合同生效起至今	25.30%	0.29%	27.98%	0.24%	-2.68%	0.05%

金鹰元禧混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.25%	0.22%	0.67%	0.16%	-0.42%	0.06%
过去三个月	-1.71%	0.23%	0.45%	0.16%	-2.16%	0.07%

过去六个月	0.57%	0.24%	1.95%	0.16%	-1.38%	0.08%
过去一年	-3.60%	0.32%	0.55%	0.19%	-4.15%	0.13%
过去三年	13.93%	0.33%	9.04%	0.24%	4.89%	0.09%
自基金合同生效起至今	24.74%	0.29%	27.98%	0.24%	-3.24%	0.05%

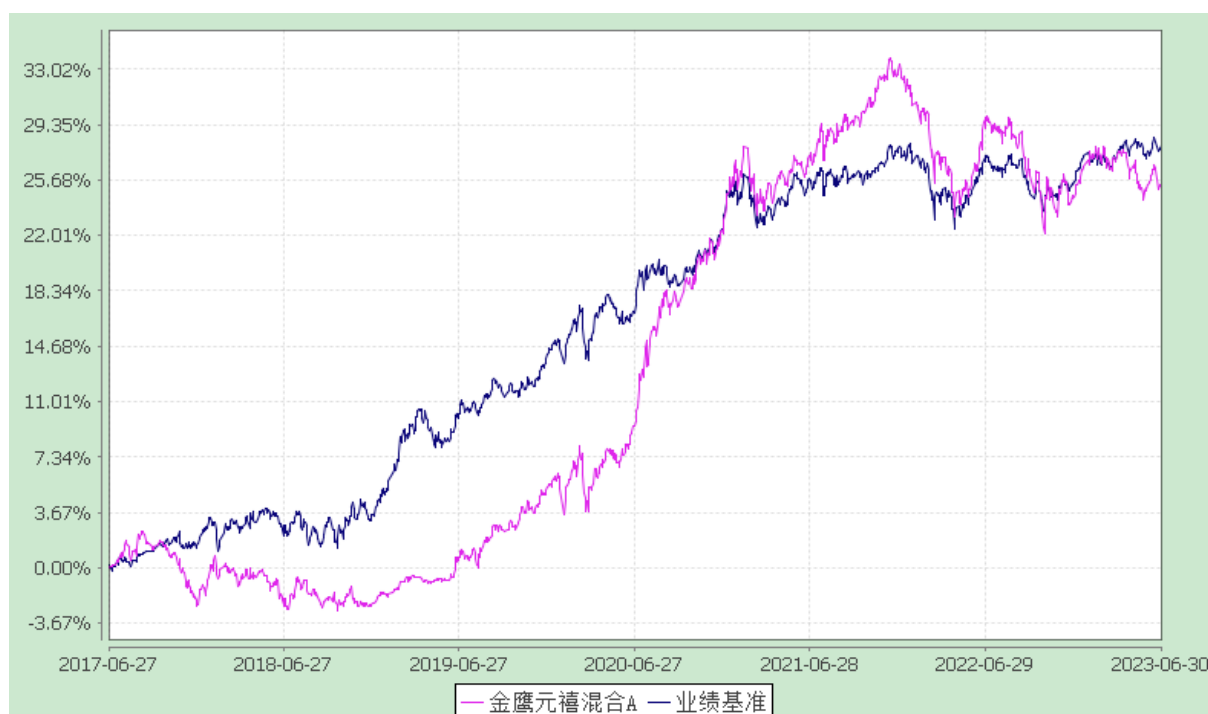
注：本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

### 3.2.2 自基金转型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

#### 金鹰元禧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

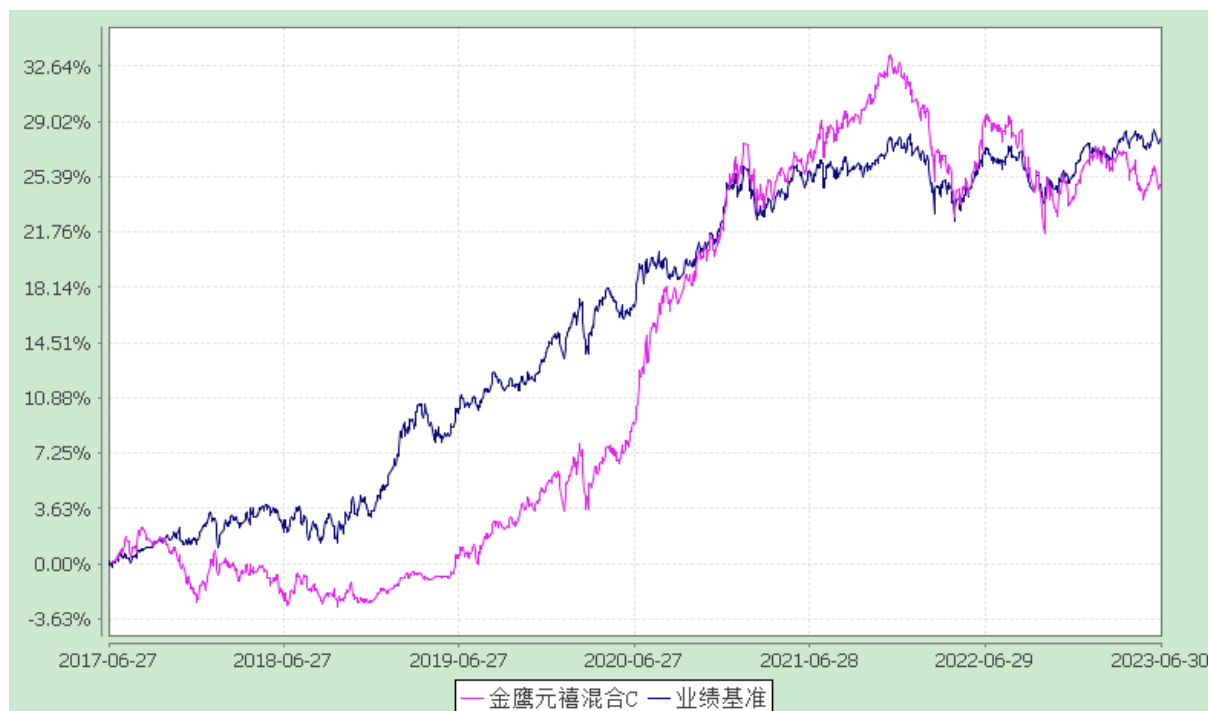
(2017 年 6 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日)

#### 金鹰元禧混合 A



#### 金鹰元禧混合 C





注：（1）截至本报告期末，各项投资比例符合基金合同的约定。

（2）本基金的业绩比较基准是：沪深 300 指数收益率×20%+中债总财富(总值)指数收益率×80%。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 63 只。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
杨晓斌	本基金的基金经理，公司权益投资部副总经理	2019-06-26	-	12	杨晓斌先生，曾任银华基金管理股份有限公司研究员、首席宏观分析师、投资经理等职务。2018年2月加入金鹰基金管理有限公司，现任权益投资部基金经理。
王怀震	本基金的基金经理，公司总经理助理、混合投资部总经理。	2022-11-05	-	19	王怀震先生，曾任新疆证券有限责任公司研究所行业研究员，浙商银行股份有限公司债券交易员，招商证券股份有限公司投资经理，银华基金管理股份有限公司基金经理，歌斐诺宝资产管理公司总经理助理，嘉实基金管理有限公司投资经理，招商信诺资产管理有限公司副总经理。2022年7月加入金鹰管理有限公司，现任混合投资部基金经理。
许浩琨	本基金的基金经理助理	2023-06-08	-	6	许浩琨先生，伊利诺伊大学香槟分校经济学硕士。曾任中国出口信用保险公司资产管理部研究分析处职员、天弘基金管理有限公司中央交易室债券研究员及固定收益部研究员、光大理财管理有限公司固定收益部职员。2023年5月加入金鹰基金管理有限公司，现任混合投资部基金经理助理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、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、《金鹰元禧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同向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年经济在疫情防控放松后自然修复，然而高度有限，并呈现边际走弱趋势。债券收益率和股市整体下行，但纺织服装、家电、工程机械、算力、数字资产和人形机器人等板块走出独立行情，收益明显。一方面地产销售下行，居民消费恢复斜率较低，出口压力增大。另一方面，市场参与者博弈经济刺激政策出台，市场受“弱现实”和“强预期”双重影响，债市收益率和股指震荡下行。

在此环境下，利率债和信用债收益率下行，信用利差受到压缩。权益市场方面，股指受到经济基本面压制，震荡下行，同时股票市场出现了快速的风格轮换。1 月份围绕着房地产复苏预期，房地产相关产业链表现突出，2 月开始，与经济增长相关的周期板块、消费板块逐渐出现了调整走势。与此同时，CHATGPT 和人形机器人快速发展使得资金转向。随着 AI 产业快速发展，对算力需求大幅提升，对应的服务器、光模块等领域走出独立行情，超额收益明显，同时部分公司积累的数据资产在 AI 产业催化下，应用价值扩展，资产价格得到显著提升；随着人形机器人产品不断进步，参与或潜在参与人形机器人供应链的部分公司取得明显收益，股价走出独立行情。回顾来看，上半

年基本面因素成为各类资产主要驱动因素，风险因素在部分涨幅较大的行业反向驱动作用明显。基本面方面，无论是经济走弱，还是后期刺激政策预期升温，都对股票与债券形成较大的影响；风险方面，股票与债券的风险都处于正常范围之内，债券收益率逐步靠近历史区间下沿，投资难度有所增加，AI 相关的行业在经历了短期过快上涨后，风险因素突出，并触发了后续的大幅震荡调整。

本基金债券投资以利率债与高等级信用债投资为主，在经济走弱背景下适度提升了债券久期。股票结构方面，本基金主要在低估值高分红行业、顺经济周期行业、TMT 行业之间进行动态优化配置，并精选竞争壁垒突出、估值匹配的个股。可转债方面，适度增持了转股溢价率与绝对价格偏低的品种。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.4009 元，本报告期份额净值增长率为 0.62%，同期业绩比较基准增长率为 1.95%；C 类基金份额净值为 1.3971 元，本报告期份额净值增长率为 0.57%，同期业绩比较基准增长率为 1.95%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，扩内需政策预期升温，国内经济下滑有望触底，但持续增长基础仍需巩固。短期国内产能周期与库存周期处于历史较低区域，伴随扩内需政策预期的升温，经济的周期性规律有望显现，下半年产能周期与库存周期触底的可能性上升。从经济结构来看，房地产供求关系发生重大改变，欧美所谓的“去风险”政策在客观上给我国出口增加了障碍，高质量发展经济占比仍然偏低，国内经济持续增长基础仍需巩固。

长期来看，资本回报率决定了上市公司的盈利回报，因此投资过剩、壁垒下降的行业经营风险值得关注，资本开支克制、壁垒较高的行业投资吸引力上升。对于中央“高质量”发展方向，基于安全发展的信创行业、强链补链行业、种子行业有较大的发展替代空间，以 AI、机器人为代表的人工智能行业同样具备广阔的发展空间。

从风险角度来看，股票资产风险收益性价比仍较突出，债券资产短期风险偏高。经过二季度调整，股票资产风险收益性价比出现明显上升，股票资产风险溢价处于历史均值之上。相反，经过上半年债市利率持续下行，债券风险调整后的历史收益处于较高水平，债券资产短期风险偏高。

对于未来，短期与中期走势可能分化。短期来看，未来股票资产的预期回报或将有所上升，与经济相关性强的行业估值有望修复，债券资产调整可能性增大。中期来看，经济转型仍在推进，股票资产盈利压力仍然存在，而利率回升后配置价值将有所上升。未来我们将继续根据大类资产配置研究，动态平衡债券类属资产配置，在控制好风险的前提下努力提升基金的投资收益。

#### 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

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

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

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

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：金鹰元禧混合型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	346,721.32	12,377.08
结算备付金		302,893.73	1,731,629.82
存出保证金		12,689.50	38,192.00
交易性金融资产	6.4.7.2	18,025,702.42	41,808,313.99
其中：股票投资		4,185,444.85	13,966,957.14
基金投资		-	-
债券投资		13,840,257.57	27,841,356.85
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	2,199,404.93	23,920,002.93
应收清算款		-	101,190.13
应收股利		-	-

应收申购款		809.32	791.06
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		20,888,221.22	67,612,497.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		38,827.74	-
应付赎回款		26,853.97	34,238.54
应付管理人报酬		10,182.63	34,317.66
应付托管费		3,394.22	11,439.24
应付销售服务费		327.21	402.06
应付投资顾问费		-	-
应交税费		31.93	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	405,351.14	530,130.24
负债合计		484,968.84	610,527.74
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	13,210,285.41	42,968,378.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	7,192,966.97	24,033,590.98
净资产合计		20,403,252.38	67,001,969.27
负债和净资产总计		20,888,221.22	67,612,497.01

注：截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日，本基金份额总额 14,571,990.64 份。其中：A 类份额净值为 1.4009 元，份额总额 11,816,406.81 份；C 类份额净值为 1.3971 元，份额总额 2,755,583.83 份；

## 6.2 利润表

会计主体：金鹰元禧混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年1月1日至 2023年6月30日	上年度可比期间 2022年1月1日至 2022年6月30日
一、营业总收入		890,661.92	-24,346,055.06
1.利息收入		98,099.55	93,173.18

其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,739.32	31,168.97
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		86,360.23	62,004.21
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,195,009.99	-3,735,565.51
其中：股票投资收益	6.4.7.10	942,310.33	-13,825,334.29
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	213,971.43	9,099,206.95
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	38,728.23	990,561.83
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-402,957.70	-20,727,672.47
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	510.08	24,009.74
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>211,789.84</b>	<b>3,371,549.66</b>
1. 管理人报酬		97,425.10	1,915,078.52
2. 托管费		32,475.04	638,359.54
3. 销售服务费		2,126.95	138,896.28
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	574,069.56
其中：卖出回购金融资产支出		-	574,069.56
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		13.24	458.00
8. 其他费用	6.4.7.19	79,749.51	104,687.76
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>678,872.08</b>	<b>-27,717,604.72</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>678,872.08</b>	<b>-27,717,604.72</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>678,872.08</b>	<b>-27,717,604.72</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：金鹰元禧混合型证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		本期
----	--	----



	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	42,968,378.29	-	24,033,590.98	67,001,969.27
二、本期期初净资产 (基金净值)	42,968,378.29	-	24,033,590.98	67,001,969.27
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-29,758,092.88	-	-16,840,624.01	-46,598,716.89
(一)、综合收益总额	-	-	678,872.08	678,872.08
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数 (净值减少以“-”号填列)	-29,758,092.88	-	-17,519,496.09	-47,277,588.97
其中：1.基金申购款	268,053.69	-	136,183.32	404,237.01
2.基金赎回款	-30,026,146.57	-	-17,655,679.41	-47,681,825.98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动 (净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产 (基金净值)	13,210,285.41	-	7,192,966.97	20,403,252.38
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益 (若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	498,618,343.58	-	299,011,903.89	797,630,247.47
二、本期期初净资产 (基金净值)	498,618,343.58	-	299,011,903.89	797,630,247.47
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-218,655,088.27	-	-151,418,891.47	-370,073,979.74
(一)、综合收益总额	-	-	-27,717,604.72	-27,717,604.72
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	-218,655,088.27	-	-123,701,286.75	-342,356,375.02

(净值减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	109,893,218.16	-	46,134,839.29	156,028,057.45
2.基金赎回款	-328,548,306.43	-	-169,836,126.04	-498,384,432.47
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	279,963,255.31	-	147,593,012.42	427,556,267.73

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：耿源，会计机构负责人：董霞

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

本基金由金鹰保本混合型证券投资基金第二个保本周期届满后转型而来。

金鹰保本混合型证券投资基金(简称“本基金”),经中国证券监督管理委员会(简称“中国证监会”)基金部函[2011]315号文《关于金鹰保本混合型证券投资基金备案确认的函》批准,于2011年5月17日募集成立。本基金为契约型开放式,存续期限不定,保本周期为3年,第一个保本周期自2011年5月17日起至2014年5月19日止,保证人为广州越秀金融控股集团有限公司;第二个保本周期为3年,起始日为2014年6月21日,到期日为2017年6月21日,第二个保本周期由广州越秀金融控股集团有限公司提供不可撤销的连带责任保证。基金首次设立募集规模为933,906,638.28份基金份额。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据本基金合同规定,本基金第二个保本周期到期日为2017年6月21日。因未能符合保本基金存续条件,按照《金鹰保本混合型证券投资基金基金合同》的约定转型为非保本的混合型基金,即“金鹰元禧混合型证券投资基金”。基金托管人及基金注册登记机构不变,基金代码亦保持不变为(A类份额代码:210006;C类份额代码:002425)。转型后基金的投资目标、投资范围、投资策略及基金费率等按照《金鹰元禧混合型证券投资基金基金合同》相关规定进行运作。转型过渡期为2017年6月22日至2017年6月26日,本基金于2017年6月27日转型为非保本的混合型基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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批准上市的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、可转换公司债券、可交换公司债券（含可分离交易可转债）、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券、中小企业私募债），以及权证、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货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）。

本基金投资于股票资产的比例为基金资产的 0%-40%。每个交易日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金保留的现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，权证、股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

除下述变更后的其他重要的会计政策和会计估计，本基金本报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日至 12 月 31 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### （1）金融资产分类

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

#### （2）金融负债分类

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### （a）金融工具的初始确认

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

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

#### （b）金融工具的后续计量

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

##### - 以摊余成本计量的金融资产

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

##### - 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

##### - 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### （c）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

#### (d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

#### 预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

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

#### 预期信用损失准备的列报

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

#### 核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

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

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

关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

1. 在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 6 次，每次收益分配比例不得低于收益分配基准日可供分配利润的 20%，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2. 本基金收益分配方式：

基金收益分配方式分为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相应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；如投资者在不同销售机构选择的分红方式不同，基金注册登记机构将以投资者最后一次选择的分红方式为准；



3. 基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4. 由于本基金各类基金份额的费用不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### **6.4.4.12 外币交易**

本基金本报告期内无外币交易。

#### **6.4.4.13 分部报告**

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

#### **6.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计**

根据中国基金业协会中基协字 [2022] 566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》(以下简称“估值处理标准”)，在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值机构提供的价格数据进行估值。

### **6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明**

#### **6.4.5.1 会计政策变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

#### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

#### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

### **6.4.6 税项**

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号)、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税率相关工作的通知》

及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

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

(d)对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20%

的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(f) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	346,721.32
等于：本金	346,666.43
加：应计利息	54.89
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	346,721.32

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		4,277,140.68	-	4,185,444.85	-91,695.83
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,595,285.65	31,792.54	3,659,917.84	32,839.65
	银行间市场	10,056,980.00	121,339.73	10,180,339.73	2,020.00
	合计	13,652,265.65	153,132.27	13,840,257.57	34,859.65
	资产支持证券	-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		17,929,406.33	153,132.27	18,025,702.42	-56,836.18

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	2,200,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	2,200,000.00	-

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	22,100.53
其中：交易所市场	21,575.53
银行间市场	525.00
应付利息	-
应交税金-银行间债券	62,565.00
审计费用	10,412.93
预提信息披露费	159,671.58
预提中债登账户维护费	4,500.00
预提上清所账户维护费	4,800.00
应交税金-上交所债券	141,301.10
合计	405,351.14

**6.4.7.7 实收基金****金鹰元禧混合 A**

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	44,807,590.99	39,643,999.63
本期申购	148,865.18	131,707.46
本期赎回（以“-”号填列）	-33,140,049.36	-29,321,005.51
本期末	11,816,406.81	10,454,701.58

**金鹰元禧混合 C**

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,324,378.66	3,324,378.66
本期申购	136,346.23	136,346.23
本期赎回（以“-”号填列）	-705,141.06	-705,141.06
本期末	2,755,583.83	2,755,583.83

**6.4.7.8 未分配利润**

## 金鹰元禧混合 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	20,846,303.24	1,893,517.50	22,739,820.74
本期利润	970,568.16	-325,512.76	645,055.40
本期基金份额交易产生的变动数	-15,917,583.78	-1,368,453.31	-17,286,037.09
其中：基金申购款	75,325.51	4,535.22	79,860.73
基金赎回款	-15,992,909.29	-1,372,988.53	-17,365,897.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,899,287.62	199,551.43	6,098,839.05

## 金鹰元禧混合 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,377,908.50	-84,138.26	1,293,770.24
本期利润	111,261.62	-77,444.94	33,816.68
本期基金份额交易产生的变动数	-255,557.16	22,098.16	-233,459.00
其中：基金申购款	62,003.24	-5,680.65	56,322.59
基金赎回款	-317,560.40	27,778.81	-289,781.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,233,612.96	-139,485.04	1,094,127.92

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	3,320.17
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	8,218.14
其他	201.01
合计	11,739.32

## 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	46,311,374.31
减：卖出股票成本总额	45,241,473.09
减：交易费用	127,590.89
买卖股票差价收入	942,310.33

## 6.4.7.11 债券投资收益

**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	173,773.32
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	40,198.11
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	213,971.43

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	46,228,800.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	45,978,460.00
减：应计利息总额	209,000.00
减：交易费用	1,141.89
买卖债券差价收入	40,198.11

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益****6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期无贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期无衍生工具收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	38,728.23
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	38,728.23

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-402,957.70
——股票投资	-463,705.35
——债券投资	60,747.65
——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	-402,957.70

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	475.06
转换费收入	35.02
合计	510.08

**6.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	10,412.93
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,765.00
帐户维护费	27,900.00
合计	79,749.51



## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金无重大需披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

1. 本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。
2. 佣金按市场佣金率计算，以扣除中国证券登记结算公司收取的证管费、经手费和使用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。债券及权证交易不计佣金。

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

### 6.4.10.2 关联方报酬

#### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	97,425.10	1,915,078.52
其中：支付销售机构的客户维护费	29,579.80	233,177.62

注：基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.60% 年费率计提。计算方法如下：

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

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，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 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	32,475.04	638,359.54

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：

$$H = E \times 0.2\% \div \text{当年天数}$$

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，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、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023年1月1日至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	17.16	17.16
合计	-	17.16	17.16
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年6月30日		

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰元禧混合A	金鹰元禧混合C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	91,697.98	91,697.98
合计	-	91,697.98	91,697.98

注：基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.1%。在通常情况下，C 类基金份额的销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.1% 年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.1\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付，于次月前 2 个工作日内从基金财产中一次性划出，由基金管理人代收，基金管理人收到后按相关合同规定支付给基金销售机构等。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自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自有资金投资本基金。

##### 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

###### 金鹰元禧混合 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。

###### 金鹰元禧混合 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。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	346,721.32	3,320.17	1,934,576.55	18,037.99

注：本基金清算备付金通过托管银行备付金账户转存于中国证券登记结算公司等结算账户；本基金本报告期末的清算备付金余额 302,893.73 元，清算备付金利息收入 8,218.14 元。上年度可比期间清算备付金余额 3,330,896.45 元，清算备付金利息收入 12,806.94 元。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发而流通受限的证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险等。基金成立

以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 1、风险管理控制制度

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

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

##### 2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

##### 3、监察稽核制度

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	2,133,041.66	0.00
AAA 以下	203,503.60	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	2,336,545.26	0.00

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间市场进行交易，除本报告所列示的期末本基金持有的流通受限证券暂时不能自由转让外，

本基金持有的其余资产均能及时变现。评估结果显示本基金的组合持仓变现能力较好，流动性风险可控。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的最大市场价格风险由所持有的金融工具的公允价值决定。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。本基金持有的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	346,721.32	-	-	-	346,721.32
结算备付金	302,893.73	-	-	-	302,893.73
存出保证金	12,689.50	-	-	-	12,689.50
交易性金融资产	1,526,876.18	12,313,381.39	-	4,185,444.85	18,025,702.42
买入返售金融资产	2,199,404.93	-	-	-	2,199,404.93
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	809.32	809.32
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	4,388,585.66	12,313,381.39	-	4,186,254.17	20,888,221.22
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	-	-	-	38,827.74	38,827.74
应付赎回款	-	-	-	26,853.97	26,853.97
应付管理人报酬	-	-	-	10,182.63	10,182.63
应付托管费	-	-	-	3,394.22	3,394.22
应付销售服务费	-	-	-	327.21	327.21



应交税费	-	-	-	31.93	31.93
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	405,351.14	405,351.14
负债总计	-	-	-	484,968.84	484,968.84
利率敏感度缺口	4,388,585.66	12,313,381.39	-	3,701,285.33	20,403,252.38
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,377.08	-	-	-	12,377.08
结算备付金	1,731,629.82	-	-	-	1,731,629.82
存出保证金	38,192.00	-	-	-	38,192.00
交易性金融资产	27,841,356.85	-	-	13,966,957.14	41,808,313.99
买入返售金融资产	23,920,002.93	-	-	-	23,920,002.93
应收证券清算款	-	-	-	101,190.13	101,190.13
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	791.06	791.06
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	53,543,558.68	-	-	14,068,938.33	67,612,497.01
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	-	-	-	34,238.54	34,238.54
应付管理人报酬	-	-	-	34,317.66	34,317.66
应付托管费	-	-	-	11,439.24	11,439.24
应付销售服务费	-	-	-	402.06	402.06
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	530,130.24	530,130.24
负债总计	-	-	-	610,527.74	610,527.74
利率敏感度缺口	53,543,558.68	-	-	13,458,410.59	67,001,969.27

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的
----	-----------	----------------

	影响金额（单位：人民币元）	
	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
利率上升 25 个基点	-60,065.19	-14,593.12
利率下降 25 个基点	61,100.95	14,652.08

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	4,185,444.85	20.51	13,966,957.14	20.85
交易性金融资产—债券投资	13,840,257.57	67.83	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
<b>合计</b>	<b>18,025,702.42</b>	<b>88.35</b>	<b>13,966,957.14</b>	<b>20.85</b>

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

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰元禧混合 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	944,671.21	4,083,851.40
业绩比较基准变动-5%	-944,671.21	-4,083,851.40	

## 金鹰元禧混合 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 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	219,846.72	301,943.27
业绩比较基准变动-5%	-219,846.72	-301,943.27	

## 6.4.14 公允价值

## 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

## 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	6,521,990.11	13,831,318.50
第二层次	11,503,712.31	27,841,356.85
第三层次	-	135,638.64
合计	18,025,702.42	41,808,313.99

## 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

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

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

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

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于 2023 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§7 投资组合报告****7.1 期末基金资产组合情况**

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	4,185,444.85	20.04
	其中：股票	4,185,444.85	20.04
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	13,840,257.57	66.26
	其中：债券	13,840,257.57	66.26
	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	2,199,404.93	10.53
	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	649,615.05	3.11
8	其他各项资产	13,498.82	0.06
9	合计	20,888,221.22	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	513,972.00	2.52
C	制造业	2,183,759.82	10.70
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	202,978.00	0.99
H	住宿和餐饮业	100,435.00	0.49
I	信息传输、软件和信息技术服务业	454,397.03	2.23
J	金融业	319,679.00	1.57
K	房地产业	100,076.00	0.49
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	204,920.00	1.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	105,228.00	0.52
S	综合	-	-
	合计	4,185,444.85	20.51

### 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	601899	紫金矿业	30,600	347,922.00	1.71

2	000807	云铝股份	19,300	245,689.00	1.20
3	000333	美的集团	3,800	223,896.00	1.10
4	601328	交通银行	38,000	220,400.00	1.08
5	002607	中公教育	43,600	204,920.00	1.00
6	600276	恒瑞医药	4,200	201,180.00	0.99
7	600298	安琪酵母	4,600	166,566.00	0.82
8	601088	中国神华	5,400	166,050.00	0.81
9	600031	三一重工	6,400	106,432.00	0.52
10	600373	中文传媒	7,900	105,228.00	0.52
11	601865	福莱特	2,700	103,977.00	0.51
12	002384	东山精密	4,000	103,600.00	0.51
13	601000	唐山港	29,000	102,370.00	0.50
14	000938	紫光股份	3,200	101,920.00	0.50
15	300161	华中数控	1,900	101,688.00	0.50
16	688697	纽威数控	3,912	101,046.96	0.50
17	688223	晶科能源	7,181	100,964.86	0.49
18	600012	皖通高速	9,600	100,608.00	0.49
19	600258	首旅酒店	5,300	100,435.00	0.49
20	600266	城建发展	19,700	100,076.00	0.49
21	002050	三花智控	3,300	99,858.00	0.49
22	601336	新华保险	2,700	99,279.00	0.49
23	002558	巨人网络	5,500	98,615.00	0.48
24	688232	新点软件	1,813	97,557.53	0.48
25	300496	中科创达	1,000	96,350.00	0.47
26	002078	太阳纸业	8,900	95,141.00	0.47
27	301236	软通动力	3,450	93,874.50	0.46
28	600132	重庆啤酒	1,000	92,160.00	0.45
29	002865	钧达股份	600	91,518.00	0.45
30	002311	海大集团	1,900	88,996.00	0.44
31	000568	泸州老窖	400	83,828.00	0.41
32	300580	贝斯特	3,100	75,299.00	0.37
33	002315	焦点科技	1,700	68,000.00	0.33

#### 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	300229	拓尔思	884,868.00	1.32
2	600428	中远海特	744,514.00	1.11

3	002881	美格智能	740,933.00	1.11
4	601728	中国电信	733,519.00	1.09
5	600585	海螺水泥	674,281.00	1.01
6	603236	移远通信	670,687.00	1.00
7	600557	康缘药业	613,622.00	0.92
8	601012	隆基绿能	577,325.00	0.86
9	000516	国际医学	554,729.00	0.83
10	002372	伟星新材	552,270.00	0.82
11	600660	福耀玻璃	550,795.00	0.82
12	600633	浙数文化	550,116.00	0.82
13	601021	春秋航空	543,630.00	0.81
14	688052	纳芯微	543,038.26	0.81
15	002475	立讯精密	516,575.00	0.77
16	600309	万华化学	512,906.00	0.77
17	600276	恒瑞医药	405,625.00	0.61
18	603997	继峰股份	372,842.00	0.56
19	002180	纳思达	371,174.00	0.55
20	688112	鼎阳科技	370,421.36	0.55

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	600690	海尔智家	1,638,742.32	2.45
2	300229	拓尔思	1,403,418.50	2.09
3	600585	海螺水泥	1,299,643.00	1.94
4	600938	中国海油	1,258,075.00	1.88
5	000568	泸州老窖	1,186,529.77	1.77
6	600660	福耀玻璃	941,902.00	1.41
7	600519	贵州茅台	906,809.00	1.35
8	600309	万华化学	819,719.00	1.22
9	600428	中远海特	797,350.00	1.19
10	601728	中国电信	783,713.00	1.17
11	002881	美格智能	745,590.80	1.11
12	002142	宁波银行	722,515.00	1.08
13	603236	移远通信	714,442.00	1.07
14	603713	密尔克卫	664,118.00	0.99
15	600557	康缘药业	648,603.00	0.97
16	600132	重庆啤酒	631,466.00	0.94
17	601899	紫金矿业	611,505.00	0.91
18	600031	三一重工	604,195.00	0.90

19	600426	华鲁恒升	578,078.90	0.86
20	300418	昆仑万维	566,987.00	0.85

### 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	35,923,666.15
卖出股票收入（成交）总额	46,311,374.31

### 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	1,323,372.58	6.49
2	央行票据	-	-
3	金融债券	10,180,339.73	49.90
	其中：政策性金融债	10,180,339.73	49.90
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）	2,336,545.26	11.45
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	13,840,257.57	67.83

### 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	230202	23 国开 02	100,000.00	10,180,339.73	49.90
2	113044	大秦转债	14,820.00	1,711,949.56	8.39
3	019679	22 国债 14	13,000.00	1,323,372.58	6.49
4	113052	兴业转债	4,140.00	421,092.10	2.06



5	128034	江银转债	1,870.00	203,503.60	1.00
---	--------	------	----------	------------	------

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

#### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1** 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的兴业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国银行保险监督管理委员会的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

本基金投资的前十名证券的发行主体之一的中公教育科技有限公司在报告编制日前一年内曾受到深圳证券交易所的公开谴责。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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

**7.12.2** 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。

**7.12.3** 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	12,689.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	809.32
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	13,498.82

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113044	大秦转债	1,711,949.56	8.39
2	113052	兴业转债	421,092.10	2.06
3	128034	江银转债	203,503.60	1.00

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§8 基金份额持有人信息****8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

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

			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
金鹰元禧混合 A	650	18,179.09	17,855.71	0.15%	11,798,551.10	99.85%
金鹰元禧混合 C	1,635	1,685.37	0.00	0.00%	2,755,583.83	100.00 %
合计	2,285	6,377.24	17,855.71	0.12%	14,554,134.93	99.88%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰元禧混合 A	0.00	0.00%
	金鹰元禧混合 C	0.00	0.00%
	合计	0.00	0.00%

## 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金非发起式基金。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰元禧混合 A	金鹰元禧混合 C
----	----------	----------

基金合同生效日（2017 年 6 月 27 日）基金份额总额	33,950,677.01	29,104,831.53
本报告期期初基金份额总额	44,807,590.99	3,324,378.66
本报告期基金总申购份额	148,865.18	136,346.23
减：本报告期基金总赎回份额	33,140,049.36	705,141.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	11,816,406.81	2,755,583.83

## §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	
西南证券	2	33,001,732.51	40.17%	30,404.53	40.64%	-
天风证券	4	27,325,669.17	33.26%	25,175.19	33.65%	-
安信证券	2	9,259,877.86	11.27%	8,531.56	11.40%	-
华创证券	1	5,259,811.51	6.40%	4,845.95	6.48%	-
德邦证券	1	4,391,251.00	5.35%	3,167.51	4.23%	-
申万宏源证券	1	2,363,370.95	2.88%	2,177.35	2.91%	-
兴业证券	1	553,761.00	0.67%	510.16	0.68%	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	1	-	-	-	-	-
红塔证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券（齐 鲁）	5	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

新时代证券	3	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	3	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	退租 1 个
国新证券（华融）	4	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
甬兴证券（上海华信证券）	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	6	-	-	-	-	-
申港证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	2	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	1	-	-	-	-	-
五矿证券	4	-	-	-	-	-
民族证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券（联讯）	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	6	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
财信证券（财	1	-	-	-	-	-

富)						
财通证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-

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

- (1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析的报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

本基金专用交易单位的选择程序如下：

- (1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单位的证券经营机构。
- (2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单位租用协议。

#### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
西南证券	1,663,426.78	20.05%	576,950,000.00	82.18%	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	6,421,203.41	77.41%	110,400,000.00	15.73%	-	-
华创证券	210,562.00	2.54%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	14,700.00	2.09%	-	-

			0.00			
兴业证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
红塔证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
九州（天源） 证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐 鲁）	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中 投证券）	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
国新证券（华 融）	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
甬兴证券（上 海华信证券）	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南 （广证）	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
民族证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-



广发证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券（联讯）	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
财信证券（财富）	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-

## 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	金鹰元禧混合型证券投资基金 2022 年四季度报告	证监会规定媒介	2023-01-20
2	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-01-20
3	金鹰基金管理有限公司关于公司旗下基金固定收益品种估值方法调整的公告	证监会规定媒介	2023-01-31
4	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增兴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	2023-02-16

5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增平安银行股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2023-02-20
6	金鹰元禧混合型证券投资基金 2022 年年度报告	证监会规定媒介	2023-03-30
7	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-03-30
8	金鹰元禧混合型证券投资基金 2023 年一季度报告	证监会规定媒介	2023-04-21
9	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2023-04-21
10	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增博时财富基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2023-05-09
11	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2023-05-22
12	金鹰基金管理有限公司关于金鹰元禧混合型证券投资基金恢复大额申购（转换转入、定期定额投资）公告	证监会规定媒介	2023-05-23
13	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海长量基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2023-05-26
14	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海万得基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2023-06-01
15	金鹰元禧混合型证券投资基金（金鹰元禧混合 A）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2023-06-01
16	金鹰元禧混合型证券投资基金（金鹰元禧混合 C）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2023-06-01
17	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增众惠基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2023-06-12
18	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与中银国际证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2023-06-19
19	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增麦高证券有限责任公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2023-06-21

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

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

## 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023年1月3日至 2023年1月10日	21,712,444. 22	0.00	21,712,444. 22	0.00	0.00%
	2	2023年1月3日至 2023年4月21日	10,674,851. 30	0.00	10,674,851. 30	0.00	0.00%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>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。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1.中国证监会批准发行及募集的文件。
- 2.《金鹰元禧混合型证券投资基金基金合同》。
- 3.《金鹰元禧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东路 28 号越秀金融大厦 30 层

### 12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日