

金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 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：交通银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

§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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	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	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	11
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
§5 托管人报告	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
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	40
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	42
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 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	43
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	43
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	43

7.12 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	46
§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	47
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	50
§11 影响投资者决策的其他重要信息	52
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	52
§12 备查文件目录	53
12.1 备查文件目录	53
12.2 存放地点	53
12.3 查阅方式	53

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰红利价值混合	
基金主代码	210002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008 年 12 月 4 日	
基金管理人	金鹰基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,029,156,265.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
下属分级基金的交易代码	210002	016563
报告期末下属分级基金的份额总额	843,240,926.10 份	185,915,339.29 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对分红能力良好且长期投资价值突出的优质股票投资，为基金资产获取稳定的当期收益和长期增值。
投资策略	本基金采取积极主动式投资管理，通过积极的资产配置策略，深入研究、调研基础上的主动性证券选择和市场时机选择，在合理控制投资风险的前提下，最大限度地获取投资收益。
业绩比较基准	中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金风险收益特征从长期来看，其风险与预期收益高于债券型基金，低于股票型基金。

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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	方圆
	联系电话	020-83936180	95559
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4006135888	95559
传真		020-83282856	021-62701216
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街	中国（上海）自由贸易试验区

	2号3212房	银城中路188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	中国（上海）长宁区仙霞路18号
邮政编码	510623	200336
法定代表人	姚文强	任德奇

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（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）	
	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
本期已实现收益	-101,142,503.27	-56,349,490.85
本期利润	-185,494,195.37	-148,778,309.06
加权平均基金份额本期利润	-0.1889	-0.3583
本期加权平均净值利润率	-11.32%	-21.66%
本期基金份额净值增长率	-9.31%	-9.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	
	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
期末可供分配利润	412,183,359.46	87,999,947.97
期末可供分配基金份额利润	0.4888	0.4733
期末基金资产净值	1,399,034,781.43	305,520,130.54
期末基金份额净值	1.6591	1.6433
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)	

	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
基金份额累计净值增长率	433.32%	10.39%

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

金鹰红利价值混合 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	-2.57%	1.33%	-3.09%	0.46%	0.52%	0.87%
过去三个月	-2.95%	1.34%	0.52%	0.49%	-3.47%	0.85%
过去六个月	-9.31%	1.67%	6.34%	0.57%	-15.65%	1.10%
过去一年	-10.99%	1.39%	5.78%	0.48%	-16.77%	0.91%
过去三年	47.86%	1.29%	9.09%	0.62%	38.77%	0.67%
自基金合同生效起至今	433.32%	1.23%	169.93%	0.85%	263.39%	0.38%

金鹰红利价值混合 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	-2.61%	1.33%	-3.09%	0.46%	0.48%	0.87%
过去三个月	-3.10%	1.34%	0.52%	0.49%	-3.62%	0.85%
过去六个月	-9.58%	1.67%	6.34%	0.57%	-15.92%	1.10%
过去一年	-11.52%	1.39%	5.78%	0.48%	-17.30%	0.91%
自基金合同生效起至今	10.39%	1.36%	7.12%	0.51%	3.27%	0.85%

注：本基金自 2022 年 8 月 24 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2022 年 8 月 25 日。

本基金原业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

自 2013 年 6 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收

益率×40%。

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

金鹰红利价值灵活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

(2008 年 12 月 4 日至 2024 年 6 月 30 日)

金鹰红利价值混合 A



金鹰红利价值混合 C



注：1、本基金原业绩比较基准为富时中国 A 股红利 150 指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。自 2013 年 6 月 29 日起，本基金的业绩比较基准变更为中证红利指数收益率×60%+上证国债指数收益率×40%。

2、本基金自 2022 年 8 月 24 日起增设 C 类基金份额，C 类基金份额首次确认日为 2022 年 8 月 25 日。

§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 68 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
陈颖	本基金的基金经理，公司首席投资官、成长投资部总经理	2020-04-28	-	14	陈颖先生，北京大学学士，中山大学工商管理硕士。曾任职于广东省电信规划设计院、中国惠普有限公司，历任深圳市瀚信资产管理有限公司研究主管等职，2012 年 9 月加入金鹰基金管理有限公司，先后任研究员、研究小组组长、基金经理助理等。现任首席投资官、成长投资部总经理、基金经理。
张展华	本基金的基金经理助理	2023-07-05	-	9	张展华先生，曾任金鹰基金管理有限公司研究员、中信资本(深圳)投资管理有限公司研究员、华美国际投资集团有限公司研究副总监兼投资经理、远信（珠海）私募基金管理有限公司研究员。2023 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任权益研究部基金经理助理，现任成长投资部基金经理。

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

2、证券从业的含义遵从《证券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。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
陈颖	公募基金	5.00	4,818,213,172.70	2019-01-26
	私募资产管理计划	3.00	107,156,104.64	2023-07-04
	其他组合	1.00	1,335,099,058.66	2023-08-30
	合计	9.00	6,260,468,336.00	

注：“任职时间”为首次开始管理上表中本类产品的时间。

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、《金鹰红利价值灵活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，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无出现重大违法违规或违反基金合同的行为，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。公司通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现。同时通过投资交易系统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，部分欧美国家进入了降息通道，但美联储在较强的就业和通胀数据支撑下，仍处于鹰派，市场大幅下调了本年度降息的次数和幅度。美元依然处于强势状态，美国科技巨头加大 AI 开支，并得到市场的认可，股价趋势性上涨，带动美国股市呈现持续上涨。目前市场部分预期在 9 月可能有一次降息窗口，但全年降息次数仅有 1-2 次。我们认为 9 月可能是美联储年内唯一的降息窗口期。

上半年国内经济刺激政策频出，房地产政策出现趋势性反转，但货币政策上仍以稳为主，并未出现大水漫灌的情况。经济复苏力度虽然低于市场预期，但仍呈现温和复苏态势，部分前瞻性经济

数据表现较好。1 月 A 股大部分个股出现较大幅度下跌，监管机构针对性出台部分政策，试图加强对市场的监管力度，以使市场回归正常状态。上半年指数整体出现一定幅度回调，红利类的蓝筹涨幅较大。

回顾上半年，本基金保持了较高仓位，重点配置了消费、贵金属、核电和科技板块，具体基金投资方面，3 月份本基金重点增持了黄金、白银等贵金属，并在 5 月份将贵金属、消费等相关仓位置换为消费电子和 IC 设计，我们重点关注相关板块在未来 1-2 年的投资机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.6591 元，本报告期份额净值增长率为-9.31%，同期业绩比较基准增长率为 6.34%；C 类基金份额净值为 1.6433 元，本报告期份额净值增长率为-9.58%，同期业绩比较基准增长率为 6.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为随着 7 月三中全会的召开以及上半年经济刺激政策的发力，下半年国内经济复苏趋势将更为明晰，市场风险偏好有望见底回升。

上半年走势较为强势的高股息品种，以大市值的蓝筹为主，稳定了指数的表现，预计在下半年仍将得到资金的追捧，但随着股价的上涨，高股息的性价比逐步走弱，交易拥挤度逐步上升，相关股票持续上涨压力也将增大。预计下半年指数整体仍处于箱体震荡阶段。

而大部分科技股由于市值原因，在上半年受到错杀，随着国家对科技行业支持力度的加强以及海外科技巨头创新周期的支撑下，有望在下半年走出反弹行情。

我们认为随着人工智能行业的发展，下半年将进入端侧爆发期，AI PC 和 AI 手机的新产品逐步推出，渗透率缓慢提高，同时各种可穿戴智能产品以及家用智能终端的创新仍在继续。我们关注相关板块的发展前景，并将在相关受益板块精耕细作，努力自下而上寻找其中具有较强成长性或处于严重低估状态的公司。同时我们也关注终端产品渗透率提升带来的相关 2C 应用的投资机会。

同时我们认为随着经济的复苏，国内也将逐步呈现温和通胀，消费板块也值得重点关注，尤其部分完成供给侧改革的细分行业是我们未来 2-3 年重点关注的领域。

预计下半年本基金仍将维持高仓位策略，在选股上仍将兼顾成长与价值，在重点关注电子、计算机、高端装备制造等板块的同时，也会增加对低估值顺周期板块和个股的关注，如金属、金融、消费等。

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

本基金报告期内未进行利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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，金鹰基金管理有限公司在金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由金鹰基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	177,553,005.56	521,271,117.85
结算备付金		2,309,635.53	3,150,758.07
存出保证金		741,019.26	823,912.92
交易性金融资产	6.4.7.2	1,567,297,466.26	2,804,852,139.51
其中：股票投资		1,324,116,775.41	2,609,933,144.63
基金投资		-	-
债券投资		243,180,690.85	194,918,994.88
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	-	270,000,000.00
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,527,142.88	20,685,870.65

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,749,428,269.49	3,620,783,799.00
负债和净资产	附注号	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		32,506,089.21	279,952,729.07
应付赎回款		7,671,338.10	14,050,795.93
应付管理人报酬		1,739,963.99	3,217,164.24
应付托管费		289,994.01	536,194.05
应付销售服务费		167,793.82	653,039.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,238.20	4,684.03
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,493,940.19	2,567,666.73
负债合计		44,873,357.52	300,982,273.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,029,156,265.39	1,819,810,542.68
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	675,398,646.58	1,499,990,982.47
净资产合计		1,704,554,911.97	3,319,801,525.15
负债和净资产总计		1,749,428,269.49	3,620,783,799.00

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，金鹰红利价值混合 A 类基金份额净值人民币 1.6591 元，A 类基金份额总额 843,240,926.10 份；金鹰红利价值混合 C 类基金份额净值人民币 1.6433 元，C 类基金份额总额 185,915,339.29 份；基金份额总额 1,029,156,265.39 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年1月1日至 2024年6月30日	上年度可比期间 2023年1月1日至 2023年6月30日
一、营业总收入		-315,956,428.71	104,675,915.93
1.利息收入		1,380,718.97	806,420.37

其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,219,486.82	806,420.37
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		161,232.15	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-141,995,663.07	63,775,633.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-155,473,076.79	55,891,260.32
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	2,676,920.24	4,654,036.37
资产支持证券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	10,800,493.48	3,230,337.16
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-176,780,510.31	38,540,680.97
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	1,439,025.70	1,553,180.74
减：二、营业总支出		18,316,075.72	8,522,955.77
1. 管理人报酬		13,853,984.01	6,461,617.06
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		2,308,997.34	1,076,936.20
3. 销售服务费		2,046,546.39	897,853.84
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		2,284.31	238.79
8. 其他费用	6.4.7.19	104,263.67	86,309.88
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-334,272,504.43	96,152,960.16
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-334,272,504.43	96,152,960.16
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-334,272,504.43	96,152,960.16

6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目		本期
----	--	----

	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	1,819,810,542.68	-	1,499,990,982.47	3,319,801,525.15
二、本期期初净资产	1,819,810,542.68	-	1,499,990,982.47	3,319,801,525.15
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-790,654,277.29	-	-824,592,335.89	-1,615,246,613.18
(一)、综合收益总额	-	-	-334,272,504.43	-334,272,504.43
(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)	-790,654,277.29	-	-490,319,831.46	-1,280,974,108.75
其中: 1.基金申购款	485,948,119.95	-	321,774,601.85	807,722,721.80
2.基金赎回款	-1,276,602,397.24	-	-812,094,433.31	-2,088,696,830.55
(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	1,029,156,265.39	-	675,398,646.58	1,704,554,911.97
项目	上年度可比期间 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	80,645,451.78	-	67,041,231.46	147,686,683.24
二、本期期初净资产	80,645,451.78	-	67,041,231.46	147,686,683.24
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	835,207,870.99	-	1,308,200,990.56	2,143,408,861.55
(一)、综合收益总额	-	-	96,152,960.16	96,152,960.16
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数 (净	835,207,870.99	-	1,212,048,030.40	2,047,255,901.39

资产减少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	1,171,078,817.71	-	1,706,574,728.43	2,877,653,546.14
2.基金赎回款	-335,870,946.72	-	-494,526,698.03	-830,397,644.75
(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	915,853,322.77	-	1,375,242,222.02	2,291,095,544.79

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

金鹰红利价值灵活配置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")证监许可[2008]521号文《关于核准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金募集的批复》、基金部函字[2008]509号文《关于金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金备案确认的函》批准，于2008年12月4日募集成立。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集规模为367,018,547.39份基金份额。本基金募集期间自2008年10月8日起至2008年11月29日止，认购金额为366,942,740.65元，认购资金在认购期间的银行利息75,806.74元折算成基金资产。上述资金已于2008年12月4日全额划入本基金在基金托管人交通银行开立的本基金托管专户。验资机构为立信羊城会计师事务所。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和基金合同等有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括投资于国内依法公开发行上市的股票、债券以及中国证监会允许基金投资的其它金融工具。本基金主要投资于分红能力良好且长期价值突出的优质企业，股票资产占基金资产净值比例为30%—80%；现金、债券资产、其他资产以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产净值的比例为20%—70%，其中现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%；权证投资占基金资产净值的比例不超

过 3%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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 2024年6月30日
----	-------------------

活期存款	177,553,005.56
等于：本金	177,518,376.88
加：应计利息	34,628.68
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	177,553,005.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,506,392,003.78	-	1,324,116,775.41	-182,275,228.37
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所	1,663,171.80		
	市场	238,320,472.45	243,180,690.85	3,197,046.60
	银行间	-	-	-
	市场	-	-	-
合计	238,320,472.45	1,663,171.80	243,180,690.85	3,197,046.60
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,744,712,476.23	1,663,171.80	1,567,297,466.26	-179,078,181.77

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

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 2024年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	9,649.04
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,947,741.91
其中：交易所市场	1,947,741.91
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	250,000.00
预提信息披露费	259,672.34
预提审计费用	22,376.90
预提中债登账户维护费	4,500.00
合计	2,493,940.19

6.4.7.7 实收基金

金鹰红利价值混合 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,038,531,027.06	1,038,531,027.06
本期申购	252,781,650.80	252,781,650.80
本期赎回（以“-”号填列）	-448,071,751.76	-448,071,751.76
本期末	843,240,926.10	843,240,926.10

金鹰红利价值混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年1月1日至2024年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	781,279,515.62	781,279,515.62
本期申购	233,166,469.15	233,166,469.15
本期赎回（以“-”号填列）	-828,530,645.48	-828,530,645.48
本期末	185,915,339.29	185,915,339.29

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

金鹰红利价值混合 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	611,882,967.12	249,427,783.76	861,310,750.88
本期期初	611,882,967.12	249,427,783.76	861,310,750.88
本期利润	-101,142,503.27	-84,351,692.10	-185,494,195.37
本期基金份额交易产生的变动数	-98,557,104.39	-21,465,595.79	-120,022,700.18
其中：基金申购款	131,916,633.66	37,710,580.11	169,627,213.77
基金赎回款	-230,473,738.05	-59,176,175.90	-289,649,913.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	412,183,359.46	143,610,495.87	555,793,855.33

金鹰红利价值混合 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	451,573,503.57	187,106,728.02	638,680,231.59
本期期初	451,573,503.57	187,106,728.02	638,680,231.59
本期利润	-56,349,490.85	-92,428,818.21	-148,778,309.06
本期基金份额交易产生的变动数	-307,224,064.75	-63,073,066.53	-370,297,131.28
其中：基金申购款	119,375,766.74	32,771,621.34	152,147,388.08
基金赎回款	-426,599,831.49	-95,844,687.87	-522,444,519.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	87,999,947.97	31,604,843.28	119,604,791.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	1,177,025.20
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	36,031.03
其他	6,430.59
合计	1,219,486.82

注：其他为结算保证金利息收入。

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	3,259,032,544.28
减：卖出股票成本总额	3,407,943,389.19
减：交易费用	6,562,231.88
买卖股票差价收入	-155,473,076.79

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 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,028,662.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	648,258.21
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	2,676,920.24

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 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	9,843,197.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,133,163.84
减：应计利息总额	59,605.16
减：交易费用	2,169.99
买卖债券差价收入	648,258.21

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

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 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	10,800,493.48
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	10,800,493.48

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-176,780,510.31
——股票投资	-179,850,696.82
——债券投资	3,070,186.51
——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	-176,780,510.31

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	1,420,918.88
转换费收入_金鹰红利 C	2,162.24
转换费收入_金鹰红利 A	15,944.58
合计	1,439,025.70

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 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	22,376.90
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	13,214.43
帐户维护费	9,000.00
合计	104,263.67

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
交通银行股份有限公司	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通过关联方交易单元进行股票交易。

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通过关联方交易单元进行权证交易。

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通过关联方交易单元进行债券交易。

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通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行任何交易，无应支付关联方交易佣金。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	13,853,984.01	6,461,617.06
其中：应支付销售机构的客户维护费	4,158,434.78	2,394,258.33
应支付基金管理人的净管理费	9,695,549.23	4,067,358.73

注：本基金于上年度可比期间，基金管理费按前一日基金资产净值 1.50% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$$

根据《金鹰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，基金管理费按前一日基金资产净值 1.20% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,308,997.34	1,076,936.20

注：本基金于上年度可比期间，基金托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.25\% / \text{当年天数}$$

根据《金鹰基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 21 日起，基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 的年费率每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

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 2024年1月1日至2024年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰红利价值混合A	金鹰红利价值混合C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	396,143.68	396,143.68
合计	-	396,143.68	396,143.68
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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		
	金鹰红利价值混合A	金鹰红利价值混合C	合计
金鹰基金管理有限公司	-	215,069.61	215,069.61
合计	-	215,069.61	215,069.61

注：1、本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费。

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

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

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均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**金鹰红利价值混合 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。

金鹰红利价值混合 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日		2023年1月1日至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	177,553,005.56	1,177,025.20	607,672,391.87	788,011.40

注：本基金用于证券交易结算的资金通过“交通银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任公司，按银行同业利率计息，在资产负债表中的“结算备付金”科目中单独列示。该科目 2024 年 6 月 30 日余额 2,309,635.53 元，当期清算备付金利息收入为 36,031.03 元；2023 年 6 月 30 日余额 3,391,887.19 元，当期清算备付金利息收入为 16,848.98 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均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

本基金报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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。

6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**6.4.12.2.1 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。

6.4.12.2.2 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。

6.4.12.3 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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	27,025,560.82	25,702,121.92
AAA 以下	122,549,373.96	74,674,124.87
未评级	0.00	0.00
合计	149,574,934.78	100,376,246.79

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 2024年6月30日	上年度末 2023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 2024年6月30日	上年度末 2023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投资于品种流动性不足，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 2024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	177,553,005.56	-	-	-	177,553,005.56
结算备付金	2,309,635.53	-	-	-	2,309,635.53
存出保证金	741,019.26	-	-	-	741,019.26
交易性金融资产	16,575,551.75	132,999,383.03	93,605,756.07	1,324,116,775.41	1,567,297,466.26
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-

应收申购款	-	-	-	1,527,142.88	1,527,142.88
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	197,179,212.10	132,999,383.03	93,605,756.07	1,325,643,918.29	1,749,428,269.49
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	-	-	-	32,506,089.21	32,506,089.21
应付赎回款	-	-	-	7,671,338.10	7,671,338.10
应付管理人报酬	-	-	-	1,739,963.99	1,739,963.99
应付托管费	-	-	-	289,994.01	289,994.01
应付销售服务费	-	-	-	167,793.82	167,793.82
应交税费	-	-	-	4,238.20	4,238.20
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,493,940.19	2,493,940.19
负债总计	-	-	-	44,873,357.52	44,873,357.52
利率敏感度缺口	197,179,212.10	132,999,383.03	93,605,756.07	1,280,770,560.77	1,704,554,911.97
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	521,271,117.85	-	-	-	521,271,117.85
结算备付金	3,150,758.07	-	-	-	3,150,758.07
存出保证金	823,912.92	-	-	-	823,912.92
交易性金融资产	-	85,094,652.66	109,824,342.22	2,609,933,144.63	2,804,852,139.51
买入返售金融资产	270,000,000.00	-	-	-	270,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	20,685,870.65	20,685,870.65
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	795,245,788.84	85,094,652.66	109,824,342.22	2,630,619,015.28	3,620,783,799.79

					00
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	-	-	-	279,952,729.07	279,952,729.07
应付赎回款	-	-	-	14,050,795.93	14,050,795.93
应付管理人报酬	-	-	-	3,217,164.24	3,217,164.24
应付托管费	-	-	-	536,194.05	536,194.05
应付销售服务费	-	-	-	653,039.80	653,039.80
应交税费	-	-	-	4,684.03	4,684.03
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,567,666.73	2,567,666.73
负债总计	-	-	-	300,982,273.85	300,982,273.85
					5
利率敏感度缺口	795,245,788.84	85,094,652.66	109,824,342.22	2,329,636,741.43	3,319,801,525.15

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	上年度末
		2024年6月30日	2023年12月31日
	利率上升 25 个基点	-3,565,504.27	-3,587,269.47
	利率下降 25 个基点	3,940,273.28	3,968,823.32

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,324,116,775.41	77.68	2,609,933,144.63	78.62
交易性金融资产—债券投资	149,574,934.78	8.78	100,376,246.79	3.02
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	1,473,691,710.19	86.46	2,710,309,391.42	81.64

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

金鹰红利价值混合 A

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	81,373,332.94	93,350,246.96
	业绩比较基准变动-5%	-81,373,332.94	-93,350,246.96

金鹰红利价值混合 C

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	17,913,766.07	70,513,443.00
	业绩比较基准变动-5%	-17,913,766.07	-70,513,443.00

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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	1,473,691,710.19	2,710,309,391.42
第二层次	93,605,756.07	94,542,748.09
第三层次	-	-
合计	1,567,297,466.26	2,804,852,139.51

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 2024 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 2024 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	1,324,116,775.41	75.69
	其中：股票	1,324,116,775.41	75.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	243,180,690.85	13.90
	其中：债券	243,180,690.85	13.90
	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	179,862,641.09	10.28
8	其他各项资产	2,268,162.14	0.13
9	合计	1,749,428,269.49	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	13,959,269.87	0.82
C	制造业	788,695,869.57	46.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,770,698.56	3.57
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	32,961,155.40	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	13,098,600.00	0.77
I	信息传输、软件和信息技术服务业	334,447,155.74	19.62
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	12,230,810.00	0.72
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	67,953,216.27	3.99
S	综合	-	-
	合计	1,324,116,775.41	77.68

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	300115	长盈精密	5,970,093	71,581,415.07	4.20
2	002384	东山精密	2,970,000	61,479,000.00	3.61
3	688608	恒玄科技	417,090	61,053,634.20	3.58
4	601985	中国核电	5,700,816	60,770,698.56	3.57
5	688088	虹软科技	1,970,000	56,854,200.00	3.34
6	688018	乐鑫科技	517,017	51,019,237.56	2.99
7	002241	歌尔股份	2,570,000	50,140,700.00	2.94
8	002597	金禾实业	2,384,600	47,429,694.00	2.78
9	002635	安洁科技	2,970,000	45,856,800.00	2.69
10	003021	兆威机电	970,072	44,768,822.80	2.63
11	002045	国光电器	2,970,000	40,481,100.00	2.37
12	000066	中国长城	3,970,028	34,737,745.00	2.04
13	603002	宏昌电子	7,170,000	33,627,300.00	1.97
14	603081	大丰实业	3,570,000	33,272,400.00	1.95
15	603236	移远通信	661,080	30,892,268.40	1.81
16	300426	唐德影视	4,170,000	28,272,600.00	1.66
17	300133	华策影视	4,570,216	28,061,126.24	1.65
18	002970	锐明技术	670,000	24,140,100.00	1.42
19	300908	仲景食品	863,882	23,998,641.96	1.41
20	603005	晶方科技	1,170,000	23,844,600.00	1.40
21	688661	和林微纳	776,100	23,787,465.00	1.40

22	300785	值得买	1,393,527	23,564,541.57	1.38
23	688058	宝兰德	1,031,800	21,492,394.00	1.26
24	300081	恒信东方	4,570,050	20,199,621.00	1.19
25	002439	启明星辰	1,170,000	20,194,200.00	1.18
26	003000	劲仔食品	1,654,072	19,931,567.60	1.17
27	688039	当虹科技	770,189	19,863,174.31	1.17
28	300592	华凯易佰	1,724,780	19,714,235.40	1.16
29	002568	百润股份	1,170,117	19,693,069.11	1.16
30	002558	巨人网络	1,970,087	18,597,621.28	1.09
31	688579	山大地纬	2,170,080	17,035,128.00	1.00
32	301312	智立方	415,870	15,994,360.20	0.94
33	603057	紫燕食品	997,080	15,275,265.60	0.90
34	688025	杰普特	377,000	15,227,030.00	0.89
35	000603	盛达资源	1,179,989	13,959,269.87	0.82
36	002605	姚记科技	670,000	13,681,400.00	0.80
37	603000	人民网	670,000	13,393,300.00	0.79
38	601933	永辉超市	5,341,500	13,246,920.00	0.78
39	600754	锦江酒店	570,000	13,098,600.00	0.77
40	300556	丝路视觉	770,074	12,883,338.02	0.76
41	300192	科德教育	1,245,500	12,230,810.00	0.72
42	301338	凯格精机	376,960	12,111,724.80	0.71
43	002507	涪陵榨菜	979,991	12,004,889.75	0.70
44	300413	芒果超媒	570,000	11,913,000.00	0.70
45	600158	中体产业	1,510,987	11,619,490.03	0.68
46	600131	国网信通	570,000	9,615,900.00	0.56
47	300246	宝莱特	1,569,950	9,498,197.50	0.56
48	002237	恒邦股份	770,000	8,862,700.00	0.52
49	688696	极米科技	105,832	8,174,463.68	0.48
50	600600	青岛啤酒	110,200	8,019,254.00	0.47
51	300718	长盛轴承	570,000	7,877,400.00	0.46
52	688312	燕麦科技	297,000	7,202,250.00	0.42
53	300866	安克创新	26,290	1,872,110.90	0.11

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	601985	中国核电	86,215,991.02	2.60
2	688608	恒玄科技	79,785,824.42	2.40

3	002558	巨人网络	74,284,239.66	2.24
4	000001	平安银行	65,079,183.00	1.96
5	002475	立讯精密	60,102,195.47	1.81
6	603081	大丰实业	57,074,294.76	1.72
7	000603	盛达资源	56,585,501.38	1.70
8	600862	中航高科	54,318,887.48	1.64
9	002273	水晶光电	48,612,678.81	1.46
10	000997	新大陆	47,065,145.48	1.42
11	600519	贵州茅台	46,234,070.80	1.39
12	002568	百润股份	45,774,444.36	1.38
13	002241	歌尔股份	45,739,666.00	1.38
14	600754	锦江酒店	42,562,891.98	1.28
15	000066	中国长城	42,350,722.17	1.28
16	600362	江西铜业	41,397,820.10	1.25
17	688018	乐鑫科技	39,855,886.55	1.20
18	300592	华凯易佰	38,544,783.63	1.16
19	000063	中兴通讯	37,443,396.25	1.13
20	300133	华策影视	37,263,353.08	1.12

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

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	601985	中国核电	155,541,714.03	4.69
2	600547	山东黄金	138,590,973.82	4.17
3	600489	中金黄金	122,055,226.65	3.68
4	000997	新大陆	119,307,059.92	3.59
5	002475	立讯精密	100,910,335.60	3.04
6	300036	超图软件	83,933,497.42	2.53
7	002465	海格通信	81,931,302.79	2.47
8	000066	中国长城	75,979,317.96	2.29
9	600699	均胜电子	75,898,289.87	2.29
10	603501	韦尔股份	73,837,654.00	2.22
11	300133	华策影视	73,084,781.74	2.20
12	300782	卓胜微	72,394,111.91	2.18
13	300709	精研科技	71,087,794.31	2.14
14	000603	盛达资源	70,567,508.47	2.13
15	000001	平安银行	64,690,114.00	1.95
16	300413	芒果超媒	63,364,724.28	1.91
17	300182	捷成股份	59,374,831.48	1.79
18	000630	铜陵有色	57,681,623.21	1.74

19	002273	水晶光电	55,113,207.38	1.66
20	601069	西部黄金	53,175,457.69	1.60

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

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	2,301,977,716.79
卖出股票收入（成交）总额	3,259,032,544.28

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	93,605,756.07	5.49
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）	149,574,934.78	8.78
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	243,180,690.85	14.27

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	019547	16 国债 19	810,610.00	93,605,756.07	5.49
2	118003	华兴转债	241,680.00	29,470,227.45	1.73
3	127086	恒邦转债	237,009.00	29,433,355.51	1.73
4	110062	烽火转债	230,000.00	27,025,560.82	1.59
5	128136	立讯转债	232,976.00	26,605,635.80	1.56

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投资。

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

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 本基金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	741,019.26
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,527,142.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,268,162.14

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	110062	烽火转债	27,025,560.82	1.59
2	113530	大丰转债	16,575,551.75	0.97
3	113616	韦尔转债	11,117,921.75	0.65
4	118003	华兴转债	29,470,227.45	1.73
5	123065	宝莱转债	3,604,524.03	0.21
6	127086	恒邦转债	29,433,355.51	1.73
7	128083	新北转债	5,742,157.67	0.34
8	128136	立讯转债	26,605,635.80	1.56

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
金鹰红利价值混合 A	121,630	6,932.84	310,209,583.06	36.79%	533,031,343.04	63.21%
金鹰红利价值混合 C	63,384	2,933.16	88,506,569.96	47.61%	97,408,769.33	52.39%
合计	185,014	5,562.59	398,716,153.02	38.74%	630,440,112.37	61.26%

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	金鹰红利价值混合 A	337,200.52	0.04%
	金鹰红利价值混合 C	261,683.21	0.14%
	合计	598,883.73	0.06%

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	金鹰红利价值混合 A	10~50
	金鹰红利价值混合 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰红利价值混合 A	0~10
	金鹰红利价值混合 C	0
	合计	0~10

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	金鹰红利价值混合 A	金鹰红利价值混合 C
基金合同生效日（2008 年 12 月 4 日）基金份额总额	367,018,547.39	-
本报告期期初基金份额总额	1,038,531,027.06	781,279,515.62
本报告期基金总申购份额	252,781,650.80	233,166,469.15
减：本报告期基金总赎回份额	448,071,751.76	828,530,645.48
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	843,240,926.10	185,915,339.29

§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，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事项。

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

本报告期末改聘会计师事务所。

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

本报告期内，托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国投证券（安信）	4	1,458,521,878.32	26.23%	1,186,737.87	25.93%	新增 1 个
国联证券	2	582,246,714.32	10.47%	544,920.48	11.91%	-
中信证券	2	554,359,770.86	9.97%	518,826.38	11.34%	-
华宝证券	1	484,889,922.59	8.72%	356,814.87	7.80%	-
华西证券	1	456,374,702.69	8.21%	335,845.54	7.34%	-
海通证券	2	388,950,395.70	6.99%	367,900.05	8.04%	-
万和证券	1	337,010,002.98	6.06%	248,004.93	5.42%	退租 1 个
财通证券	4	320,168,872.35	5.76%	235,613.31	5.15%	-
东方财富（西藏东财）	2	301,951,868.60	5.43%	222,205.96	4.86%	-
联储证券	1	165,778,809.03	2.98%	121,997.11	2.67%	-
财达证券	1	160,083,228.25	2.88%	151,415.41	3.31%	-
金元证券	2	116,033,415.46	2.09%	85,390.07	1.87%	-
国泰君安证券	1	101,569,646.59	1.83%	95,058.42	2.08%	-
广发证券	1	95,674,237.52	1.72%	70,402.59	1.54%	-
华创证券	2	37,396,795.81	0.67%	34,998.04	0.76%	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
江南证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-

湘财证券	3	-	-	-	-	-
兴安证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
中金财富（中投证券）	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
中银国际证券	1	-	-	-	-	-
国新证券（华融）	2	-	-	-	-	新增 2 个；退租 2 个
申港证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
国都证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	2	-	-	-	-	-
日信证券	2	-	-	-	-	-

注：1、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。

2、金鹰基金管理有限公司托管于交通银行的所有理财产品共用交易席位。

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
国投证券（安信）	18,417,533.10	29.71%	351,000,000.00	63.82%	-	-
国联证券	5,648,268.37	9.11%	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	4,839,747.62	7.81%	-	-	-	-
华西证券	8,961,315.35	14.46%	-	-	-	-
海通证券	-	-	199,000,000.00	36.18%	-	-
万和证券	9,482,871.26	15.30%	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
东方财富（西藏东财）	4,353,858.27	7.02%	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	2,533,234.09	4.09%	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	7,756,720.00	12.51%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
江南证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券（齐鲁）	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴安证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中金财富（中	-	-	-	-	-	-

投证券)						
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
中银国际证券	-	-	-	-	-	-
国新证券（华融）	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中信证券华南（广证）	-	-	-	-	-	-
日信证券	-	-	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司新增湘财证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-01-02
2	金鹰基金管理有限公司关于终止北京增财基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2024-01-11
3	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 2023 年四季度报告	证监会规定媒介	2024-01-22
4	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-01-22
5	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海攀赢基金销售有限公司为代销机构并开通	证监会规定媒介	2024-01-22

	基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告		
6	金鹰基金管理有限公司新增兴业银行股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-01-24
7	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增上海中正达广基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-01-25
8	金鹰基金管理有限公司关于调整旗下公募基金产品风险等级评级方式相关事项的公告	证监会规定媒介	2024-02-01
9	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增广州银行股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-02-21
10	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海大智慧基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-02-26
11	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增第一创业证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-13
12	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与玄元保险代理有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-03-14
13	金鹰基金管理有限公司新增东莞证券股份有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-15
14	金鹰基金管理有限公司旗下部分基金新增山西证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-19
15	金鹰基金管理有限公司新增泛华普益基金销售有限公司为金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 C 类份额代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-03-25
16	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-03-29
17	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会规定媒介	2024-03-29
18	金鹰基金管理有限公司部分基金新增西南证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-04-02
19	金鹰基金管理有限公司部分基金新增乾道基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-04-16

20	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金 2024 年一季度报告	证监会规定媒介	2024-04-22
21	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2024-04-22
22	金鹰基金管理有限公司部分基金新增甬兴证券有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-04-29
23	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海国信嘉利基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-05-16
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与国泰君安证券股份有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-05-31
25	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金（金鹰红利价值混合 A）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-31
26	金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金（金鹰红利价值混合 C）基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2024-05-31
27	金鹰基金管理有限公司部分基金新增国泰君安证券股份有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-06-05
28	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海云湾基金销售有限公司为代销机构并开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2024-06-13
29	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京新浪仓石基金销售有限公司代销机构费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2024-06-17

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.中国证监会批准金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2.《金鹰红利价值灵活配置混合型证券投资基金基金合同》。
- 3.《金鹰红利价值灵活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

二〇二四年八月三十日