

金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 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：二〇二六年八月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	41
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	53
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	54
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	54
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	54
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	54
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54

7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 盈利投资者数量占比	56
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56
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	56
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	56
§9 开放式基金份额变动	57
§10 重大事件揭示	57
10.1 基金份额持有人大会决议	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	57
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	58
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	58
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.9 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录	60
12.2 存放地点	60
12.3 查阅方式	60

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	金鹰睿选成长六个月持有混合	
基金主代码	012905	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 6 月 9 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	5,041,937.52 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C
下属分级基金的交易代码	012905	012906
报告期末下属分级基金的份额总额	2,779,403.54 份	2,262,533.98 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金以经济发展新趋势为立足点，通过深入的基本面研究，挖掘成长性强或趋势向好的个股，在控制组合投资风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的长期回报。
投资策略	我国当前正处于经济结构转型与产业升级的新发展时期，本基金以经济发展新趋势为立足点，通过深入的基本面研究，挖掘成长性强或趋势向好的个股。 本基金将综合分析经济环境、货币财政政策、国家产业政策、资本市场资金环境以及市场情绪等因素，判断各类资产所处的运行周期，同时遵循逆向投资、分散投资的理念，通过比较各类资产的风险收益情况，确定组合中各类资产的配置比例，从而最大限度地控制组合风险、实现资产长期稳定增值。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×70%+中证港股通综合指数收益率×15%+中证综合债指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为混合型证券投资基金，预期风险和预期收益高于债券型基金和货币市场基金，低于股票型基金。 本基金资产投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	金鹰基金管理有限公司		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 2号3212房		中国（上海）自由贸易试验区 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	《中国证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）	
	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C
本期已实现收益	881,944.64	739,719.39
本期利润	781,904.62	679,500.11

加权平均基金份额本期利润	0.2465	0.2414
本期加权平均净值利润率	20.13%	20.14%
本期基金份额净值增长率	22.56%	22.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C
期末可供分配利润	1,004,398.94	759,928.44
期末可供分配基金份额利润	0.3614	0.3359
期末基金资产净值	3,787,172.79	3,023,590.83
期末基金份额净值	1.3626	1.3364
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C
基金份额累计净值增长率	36.26%	33.64%

- 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，采用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

金鹰睿选成长六个月持有混合 A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	20.53%	1.47%	6.97%	0.99%	13.56%	0.48%
过去六个月	22.56%	1.79%	3.23%	0.92%	19.33%	0.87%
过去一年	55.73%	1.70%	17.04%	0.83%	38.69%	0.87%
过去三年	36.33%	1.68%	25.76%	0.92%	10.57%	0.76%
自基金合同生效起至今	36.26%	1.67%	26.33%	0.92%	9.93%	0.75%

金鹰睿选成长六个月持有混合 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

过去三个月	20.35%	1.47%	6.97%	0.99%	13.38%	0.48%
过去六个月	22.18%	1.79%	3.23%	0.92%	18.95%	0.87%
过去一年	54.69%	1.70%	17.04%	0.83%	37.65%	0.87%
过去三年	33.75%	1.68%	25.76%	0.92%	7.99%	0.76%
自基金合同生效起至今	33.64%	1.67%	26.33%	0.92%	7.31%	0.75%

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

3.2.2 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

金鹰睿选成长六个月持有期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

（2023 年 6 月 9 日至 2026 年 6 月 30 日）

金鹰睿选成长六个月持有混合 A



金鹰睿选成长六个月持有混合 C



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

§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 75 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		
梁梓颖	本基金的基金经理，权益研究部副总经理	2025-01-11	-	10	梁梓颖女士，英国华威大学理学硕士。曾任职于广州越秀集团发展部。2015 年 8 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任研究员、基金经理助理，现任权益研究部副总经理、基金经理。
刘朝亮	本基金的基金经理助理	2026-03-11	-	9	刘朝亮先生，中国人民大学理学硕士。2016 年 10 月至 2019 年 7 月曾任创金合信基金管理有限公司研究员，2019 年 7 月至 2020 年 9 月曾任红土创新基金管理有限公司基金经理助理，2020 年 9 月至 2023 年 8 月曾任万联证券股份有限公司助理及投资经理，2023 年 8 月至 2026 年 1 月曾任万联证券资产管理（广东）有限公司投资经理。2026 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、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

2026 年上半年，全球经济呈现“K 型复苏”的不平衡态势。国际方面，中东地缘冲突阶段性升温推升油价波动，美联储政策路径反复，美债收益率高位震荡，外部环境的不确定性显著加大。国内方面，经济运行总体呈现“超预期开局、结构分化凸显”的特征——一季度 GDP 同比增长 5.0%，国民经济运行总体平稳、向新向好；进入二季度后，受地缘冲突外溢效应及政策力度边际调整等因素影响，经济增长动能有所放缓，修复斜率趋于平缓。

A 股市场在上述宏观背景下演绎了一轮罕见的“K 型”极端分化行情。AI 产业链持续上攻带动科技成长赛道走出独立行情，而传统蓝筹、内需消费板块则持续承压。

从风格维度看，小盘成长显著占优，大盘价值持续落后；从行业维度看，申万一级行业指数涨跌幅首尾差距超过 115 个百分点。电子（+86.29%）、通信（+73.59%）、建筑材料（+46.26%）、机械设备（+22.60%）领涨，而消费者服务（-31.9%）、综合金融（-29.6%）、农林牧渔（-24.8%）、美容护理、商贸零售等消费类行业大幅下跌。

市场活跃度方面，两市上半年总成交额突破 317 万亿元，创下历史新高。但资金高度集中于 AI 服务器、半导体设备、光模块、先进封装等细分赛道，赛道虹吸效应显著，市场资金分配严重失衡。

上半年偏股混合型基金平均净值增长率为 21.14%，主动权益基金整体平均收益率为 20.94%，65.04% 的主动偏股基金实现正收益，但同时有 1,598 只权益基金录得负收益，首尾业绩差值高达 217.95 个百分点。

二季度以来，本基金坚持采用量化多因子模型，模型融合基本面因子、技术面因子和机器学习因子三大类信号，通过因子合成、风险约束优化和组合构建。面对报告期内极致分化的市场环境，管理人对因子模型进行了动态调整与迭代，具体运作分析如下：

基本面因子方面，本基金持续维护估值（PE、PB、PS、PCF）、盈利质量（ROE、ROA、毛利率、经营性现金流比率）、成长性（营收增速、净利润增速、EG）和分析师预期（一致预期上调/下调）等因子库。二季度随着市场波动加剧，部分高估值赛道出现阶段性回调，基本面因子的区分度有所恢复。盈利质量因子在财报季前后表现突出，特别是经营性现金流和 ROE 稳定性因子在极端分化环境中仍展现出一定的选股能力。分析师情绪因子在 AI 产业链个股中信号密集，但对传统行业的前瞻性减弱。

技术面因子涵盖动量/反转、波动率、流动性、换手率、量价背离等维度。在 AI 主线持续强势的市场环境中，中期动量因子（20 日、60 日动量）表现突出，有效捕捉了电子、通信等行业的趋势性行情。但短期反转因子在赛道交易极度拥挤的阶段出现回撤，部分高换手率个股的日内反转特征被趋势资金掩盖。

机器学习因子是本基金在传统因子基础上的增量阿尔法来源，报告期内主要运用了以下模型：

深度学习因子：基于 LSTM 和 Transformer 架构的时序模型，对个股的量价序列、基本面变化序列进行特征提取，生成前瞻性收益预测信号。

集成学习因子：通过 LightGBM 此类提升树模型，对基本面、技术面和另类因子进行非线性集成，生成综合打分。该因子在报告期内表现稳健，作为因子合成的“顶层模型”有效提升了整体因子组合的预测能力。

管理人注意到，机器学习因子在报告期内整体贡献为正，但也存在过拟合风险和风格暴露偏移的问题。特别是在 AI 赛道交易拥挤度攀升至历史高位后，模型对高动量、高成长个股的偏好进一步增强，可能放大组合的风格偏离。管理人在二季度对模型进行了正则化加强和风格中性化处理，以控制机器学习因子的隐性风格暴露。

因子合成与组合构建方面，本基金采用 Barra 多因子风险模型进行风险约束下的因子合成与组合优化。报告期内的主要操作包括：

因子权重动态调整：根据因子多周期表现，对因子权重进行日度级别再平衡，去弱留强。

行业暴露管理：模型在中信一级行业上相对业绩基准的超欠配不超过 1%。

风格因子约束：采用动态风格约束方案，每日根据风格因子过往多周期综合表现进行不同程度的暴露度约束。

个股权重优化：在因子阿尔法、交易成本和风险约束之间寻求最优平衡。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.3626 元，本报告期份额净值增长率为 22.56%，同期业绩比较基准增长率为 3.23%；C 类基金份额净值为 1.3364 元，本报告期份额净值增长率为 22.18%，同期业绩比较基准增长率为 3.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

管理人预计下半年 A 股市场或将呈现"结构性行情延续、上涨斜率放缓、波动加大"的格局。资金面正从增量市转入存量市，两融动能放缓、外资受美债利率压制，指数层面难以系统性拔估值。但 A 股盈利改善有望逐步兑现，整体估值仍处合理水平，市场向好趋势仍有望延续。

风格展望：当前成长相对价值的估值偏离已接近 2015 年高位，市场风格再均衡正在进行中。管理人认为，AI 和非 AI 的业绩增速差短期内难以逆转，风格裂口很难出现真正的趋势性拐点，阶段性的收敛更多是技术性调整而非趋势反转。但一批相对低位的传统行业公司正在密集增持回购，产业资本信号值得关注，三季度可考虑逐步进行结构再平衡。

行业展望：AI 或仍然是最重要的投资主线，但行情驱动力可能将从估值炒作切换至业绩兑现。资金有望向兼具业绩兑现能力和长期产业逻辑的方向集中。

基于上述市场判断，管理人在下半年拟采取以下操作思路：

1. 因子模型迭代优化

基本面因子：维持当前权重不变。

技术面因子：积极推动技术面因子库的更新迭代，着重寻找最近三年表现优良的量价因子，控制单个技术面因子的权重占比。

机器学习因子：加强模型的正则化和交叉验证机制，控制过拟合风险。尝试引入基于强化学习的动态因子择时模型，根据市场状态自动调整各类因子的权重。

2. 持续优化提升基金持仓推算模型的精度和频度，对偏股混合型基金持仓进行更合理的推算。

3. 交易执行层面，继续优化算法交易策略，降低冲击成本和市场冲击。

管理人将密切关注宏观政策落地节奏、地缘政治风险演变、AI 产业链景气度变化以及市场风格再均衡的进程，及时调整因子模型参数和组合配置，力求在控制风险的前提下争取为持有人创造超额收益。

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。本基金在迷你基金期间，如涉及信息披露费、审计费、基金份额持有人大会费、银行间账户维护费、IOPV 计算与发布费（如有）、注册登记费（如有）等相关固定费用，由管理人承担，不再从基金资产中列支。

§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，基金托管人在金鹰睿选成长六个月持有期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遵规守信、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睿选成长六个月持有期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。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金的报告中财务指标、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：金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	8,001.08	282.23
结算备付金		-	-
存出保证金		308,193.01	681,104.13
交易性金融资产	6.4.7.2	6,704,626.30	9,130,466.85
其中：股票投资		6,401,448.60	9,130,466.85
基金投资		-	-
债券投资		303,177.70	-
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	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	2,894.00
应收申购款		369.45	500.99
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		7,021,189.84	9,815,248.20
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		-	27,322.10
应付赎回款		200,796.95	949,217.25
应付管理人报酬		6,756.01	10,675.26
应付托管费		1,126.01	1,779.21
应付销售服务费		1,538.16	2,843.44
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11.09	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	198.00	-
负债合计		210,426.22	991,837.26
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,041,937.52	8,006,149.24
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	1,768,826.10	817,261.70
净资产合计		6,810,763.62	8,823,410.94
负债和净资产总计		7,021,189.84	9,815,248.20

注：截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.3626 元，A 类基金份额总额为 2,779,403.54 份；C 类基金份额净值为 1.3364 元，C 类基金份额总额为 2,262,533.98 份；基金份额总额为 5,041,937.52 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
----	-----	----	---------

		2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		1,522,615.77	2,068,036.71
1.利息收入		113.56	1,134.87
其中：存款利息收入	6.4.7.9	113.56	996.11
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		-	138.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,682,761.51	1,678,095.95
其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,631,728.06	1,574,628.90
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	502.45	1,674.61
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	50,531.00	101,792.44
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-160,259.30	388,805.89
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	-	-
减：二、营业总支出		61,211.04	121,439.68
1. 管理人报酬		43,290.97	86,196.69
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		7,215.19	14,366.14
3. 销售服务费		10,071.22	20,061.39
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		1.86	-
8. 其他费用	6.4.7.19	631.80	815.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,461,404.73	1,946,597.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,461,404.73	1,946,597.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,461,404.73	1,946,597.03

6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	8,006,149.24	817,261.70	8,823,410.94
二、本期期初净资产	8,006,149.24	817,261.70	8,823,410.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-2,964,211.72	951,564.40	-2,012,647.32
（一）、综合收益总额	-	1,461,404.73	1,461,404.73
（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）	-2,964,211.72	-509,840.33	-3,474,052.05
其中：1.基金申购款	875,027.43	213,288.15	1,088,315.58
2.基金赎回款	-3,839,239.15	-723,128.48	-4,562,367.63
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	5,041,937.52	1,768,826.10	6,810,763.62
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	21,488,784.89	-5,005,337.54	16,483,447.35
二、本期期初净资产	21,488,784.89	-5,005,337.54	16,483,447.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-5,469,654.73	2,916,395.78	-2,553,258.95
（一）、综合收益总额	-	1,946,597.03	1,946,597.03
（二）、本期基金	-5,469,654.73	969,798.75	-4,499,855.98

份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	219,361.35	-36,714.24	182,647.11
2.基金赎回款	-5,689,016.08	1,006,512.99	-4,682,503.09
（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	16,019,130.16	-2,088,941.76	13,930,188.40

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

金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金（“本基金”）由金鹰鑫澄量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金（“原基金”）变更注册而来，经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]2123 号《关于准予金鹰鑫澄量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》及证监许可[2022]2451 号《关于准予金鹰鑫澄量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金变更注册的批复》核准，由原基金变更注册为“金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金”进行募集。由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》等有关规定和《金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2023 年 4 月 10 日向社会公开发行募集并于 2023 年 6 月 9 日正式成立。本基金的基金管理人为金鹰基金管理有限公司，基金托管人为交通银行股份有限公司。

本基金为契约型开放式基金，存续期限不定。本基金于 2023 年 4 月 10 日至 2023 年 6 月 7 日止期间募集资金净额及募集利息合计为人民币 201,215,871.51 元，其中，A 类基金为人民币 113,101,842.65 元，C 类基金为人民币 88,114,028.86 元，经毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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（包括主板、

创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（含协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货、股票期权以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资业务。

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、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集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的要求，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[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》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延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》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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：

（1）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。

（2）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。

本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3%

的规定征收率计算缴纳增值税。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、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

（3）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。

（4）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。

（5）证券（股票）交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

（6）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。

（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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	8,001.08
等于：本金	8,000.90
加：应计利息	0.18
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	8,001.08

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,111,320.21	-	6,401,448.60	290,128.39
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	300,309.00	2,937.70	303,177.70	-69.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	300,309.00	2,937.70	303,177.70	-69.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,411,629.21	2,937.70	6,704,626.30	290,059.39

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产**6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
其他应付款	198.00
合计	198.00

6.4.7.7 实收基金**金鹰睿选成长六个月持有混合 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	3,687,588.55	3,687,588.55
本期申购	525,530.56	525,530.56
本期赎回（以“-”号填列）	-1,433,715.57	-1,433,715.57
本期末	2,779,403.54	2,779,403.54

金鹰睿选成长六个月持有混合 C

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,318,560.69	4,318,560.69
本期申购	349,496.87	349,496.87
本期赎回（以“-”号填列）	-2,405,523.58	-2,405,523.58
本期末	2,262,533.98	2,262,533.98

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

金鹰睿选成长六个月持有混合 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	345,530.38	66,841.62	412,372.00
本期期初	345,530.38	66,841.62	412,372.00
本期利润	881,944.64	-100,040.02	781,904.62
本期基金份额交易产生的变动数	-223,076.08	36,568.71	-186,507.37
其中：基金申购款	122,695.43	10,681.40	133,376.83
基金赎回款	-345,771.51	25,887.31	-319,884.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,004,398.94	3,370.31	1,007,769.25

金鹰睿选成长六个月持有混合 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	330,339.86	74,549.84	404,889.70
本期期初	330,339.86	74,549.84	404,889.70
本期利润	739,719.39	-60,219.28	679,500.11
本期基金份额交易产生的变动数	-310,130.81	-13,202.15	-323,332.96
其中：基金申购款	76,647.96	3,263.36	79,911.32
基金赎回款	-386,778.77	-16,465.51	-403,244.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	759,928.44	1,128.41	761,056.85

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	12.75
定期存款利息收入	-

其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	-
其他	100.81
合计	113.56

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	79,607,458.43
减：卖出股票成本总额	77,849,870.93
减：交易费用	125,859.44
买卖股票差价收入	1,631,728.06

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 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	517.59
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-15.14
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	502.45

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 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	-
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	-
减：应计利息总额	-
减：交易费用	15.14
买卖债券差价收入	-15.14

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	50,531.00
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	50,531.00

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-160,259.30
——股票投资	-160,190.30
——债券投资	-69.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-160,259.30

6.4.7.17 其他收入

本基金本报告期无其他收入。

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 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	602.98
证券组合费	28.67
存托服务费	0.15
合计	631.80

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

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系**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发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	43,290.97	86,196.69
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,001.96	30,991.11
应支付基金管理人的净管理费	27,289.01	55,205.58

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.20%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 1.20\% \div \text{当年天数}$$

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,215.19	14,366.14

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.20%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.20\% \div \text{当年天数}$$

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前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
----------------	----------------------------

	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C	合计
交通银行股份有限公司	-	6,368.37	6,368.37
金鹰基金管理有限公司	-	2.82	2.82
合计	-	6,371.19	6,371.19
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	金鹰睿选成长六个月持有混合A	金鹰睿选成长六个月持有混合C	合计
交通银行股份有限公司	-	12,544.68	12,544.68
金鹰基金管理有限公司	-	34.75	34.75
合计	-	12,579.43	12,579.43

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

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固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

金鹰睿选成长六个月持有混合 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。

金鹰睿选成长六个月持有混合 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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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	8,001.08	12.75	1,828.76	19.81

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

无。

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（2026 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

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本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；检查公司业务部门和工作人员对内部控制制度、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。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-

合计	-	-
----	---	---

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	-

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指因金融资产的流动性不足，无法在合理价格变现资产。本基金的流动性风险主要来自于投资品种流动性不足，导致金融资产不能在合理价格变现。本基金采用分散投资、监控流

通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时基金管理人通过分析持有人结构、申购赎回行为分析、变现比例、压力测试等方法评估组合的流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 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	8,001.08	-	-	-	8,001.08
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	308,193.01	-	-	-	308,193.01
交易性金融资产	303,177.70	-	-	6,401,448.60	6,704,626.30
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	369.45	369.45
其他资产	-	-	-	-	-

资产总计	619,371.79	-	-	6,401,818.05	7,021,189.84
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	-	-	-	200,796.95	200,796.95
应付管理人报酬	-	-	-	6,756.01	6,756.01
应付托管费	-	-	-	1,126.01	1,126.01
应付销售服务费	-	-	-	1,538.16	1,538.16
应交税费	-	-	-	11.09	11.09
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	198.00	198.00
负债总计	-	-	-	210,426.22	210,426.22
利率敏感度缺口	619,371.79	-	-	6,191,391.83	6,810,763.62
上年度末 2025 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	282.23	-	-	-	282.23
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	681,104.13	-	-	-	681,104.13
交易性金融资产	-	-	-	9,130,466.85	9,130,466.85
买入返售金融资 产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	2,894.00	2,894.00
应收申购款	-	-	-	500.99	500.99
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	681,386.36	-	-	9,133,861.84	9,815,248.20
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	-	-	-	27,322.10	27,322.10
应付赎回款	-	-	-	949,217.25	949,217.25
应付管理人报酬	-	-	-	10,675.26	10,675.26

应付托管费	-	-	-	1,779.21	1,779.21
应付销售服务费	-	-	-	2,843.44	2,843.44
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-
负债总计	-	-	-	991,837.26	991,837.26
利率敏感度缺口	681,386.36	-	-	8,142,024.58	8,823,410.94

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
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-221.15	-
	利率下降 25 个基点	221.79	-

注：本基金上年度末未持有债券投资组合（不含可转债、可交换债）。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的投资范围包括内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的香港证券市场股票，如果港币资产相对于人民币贬值，将对基金收益产生不利影响；港币对人民币的汇率大幅波动也将加大基金净值波动的幅度。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	上年度末		
	2025年12月31日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,868,468.64	1,868,468.64
应收股利	-	2,894.00	2,894.00
资产合计	-	1,871,362.64	1,871,362.64
以外币计价的负债			
负债合计	-	-	-
资产负债表外汇风险	-	1,871,362.64	1,871,362.64

敞口净额			
------	--	--	--

注：本基金本报告期末无外汇风险敞口。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

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
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	假设人民币对一揽子货币平均升值 5%	-	-93,568.13
	假设人民币对一揽子货币平均贬值 5%	-	93,568.13

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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	6,401,448.60	93.99	9,130,466.85	103.48
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	6,401,448.60	93.99	9,130,466.85	103.48

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰睿选成长六个月持有混合 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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	253,251.96	280,977.77
	业绩比较基准变动-5%	-253,251.96	-280,977.77

金鹰睿选成长六个月持有混合 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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	202,140.50	323,552.15
	业绩比较基准变动-5%	-202,140.50	-323,552.15

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	6,401,448.60	9,130,466.85
第二层次	303,177.70	-
第三层次	-	-
合计	6,704,626.30	9,130,466.85

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

截至本报告期末，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

截至资产负债表日，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	6,401,448.60	91.17
	其中：股票	6,401,448.60	91.17
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	303,177.70	4.32
	其中：债券	303,177.70	4.32
	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	8,001.08	0.11
8	其他各项资产	308,562.46	4.39
9	合计	7,021,189.84	100.00

注：其他资产包括：券商账户资金、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	7,508.00	0.11
B	采矿业	25,371.00	0.37
C	制造业	5,231,967.60	76.82
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	45,767.00	0.67
E	建筑业	19,211.00	0.28
F	批发和零售业	248,967.00	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	107,384.00	1.58
H	住宿和餐饮业	912.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	107,025.00	1.57
J	金融业	181,607.00	2.67
K	房地产业	3,933.00	0.06
L	租赁和商务服务业	114,286.00	1.68
M	科学研究和技术服务业	74,706.00	1.10
N	水利、环境和公共设施管理业	228,331.00	3.35
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	4,473.00	0.07
S	综合	-	-
	合计	6,401,448.60	93.99

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	688766	普冉股份	200	153,320.00	2.25

2	688627	精智达	200	143,000.00	2.10
3	002648	卫星化学	5,500	129,195.00	1.90
4	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	1.62
5	688308	欧科亿	600	109,086.00	1.60
6	002384	东山精密	400	104,940.00	1.54
7	300857	协创数据	300	101,970.00	1.50
8	688257	新锐股份	995	101,390.50	1.49
9	688559	海目星	1,200	100,704.00	1.48
10	688525	佰维存储	200	98,946.00	1.45
11	001309	德明利	100	94,290.00	1.38
12	688025	杰普特	200	94,000.00	1.38
13	688266	泽璟制药	800	93,328.00	1.37
14	301536	星辰科技	700	90,097.00	1.32
15	300475	香农芯创	300	90,000.00	1.32
16	301122	采纳股份	3,000	88,230.00	1.30
17	002557	洽洽食品	4,900	88,004.00	1.29
18	000657	中钨高新	900	86,148.00	1.26
19	002266	浙富控股	16,300	82,478.00	1.21
20	603986	兆易创新	100	81,500.00	1.20
21	688110	东芯股份	400	81,480.00	1.20
22	688059	华锐精密	400	79,884.00	1.17
23	603256	宏和科技	300	79,599.00	1.17
24	600549	厦门钨业	900	76,680.00	1.13
25	603259	药明康德	600	74,706.00	1.10
26	688378	奥来德	1,200	74,400.00	1.09
27	688309	恒誉环保	1,200	73,056.00	1.07
28	688090	瑞松科技	670	71,321.50	1.05
29	301308	江波龙	100	70,380.00	1.03
30	600104	上汽集团	7,000	68,320.00	1.00
31	001313	粤海饲料	9,600	68,064.00	1.00
32	601872	招商轮船	3,500	61,495.00	0.90
33	000703	恒逸石化	4,500	61,065.00	0.90
34	301358	湖南裕能	800	60,696.00	0.89
35	002027	分众传媒	12,000	58,080.00	0.85
36	600150	中国船舶	1,700	57,443.00	0.84
37	002709	天赐材料	1,100	56,573.00	0.83
38	603195	公牛集团	1,400	54,810.00	0.80
39	000848	承德露露	7,300	54,020.00	0.79
40	300395	菲利华	400	53,492.00	0.79
41	300823	建科智能	3,600	52,488.00	0.77
42	301526	国际复材	1,100	51,337.00	0.75
43	600601	方正科技	3,600	49,824.00	0.73
44	000338	潍柴动力	1,800	49,050.00	0.72
45	300613	富瀚微	600	48,048.00	0.71

46	002460	赣锋锂业	700	45,780.00	0.67
47	300014	亿纬锂能	700	45,521.00	0.67
48	605117	德业股份	400	42,472.00	0.62
49	601009	南京银行	4,100	40,549.00	0.60
50	688155	先惠技术	500	40,445.00	0.59
51	603317	天味食品	3,100	40,331.00	0.59
52	688475	萤石网络	1,400	38,290.00	0.56
53	300428	立中集团	2,100	38,178.00	0.56
54	300867	圣元环保	2,100	38,052.00	0.56
55	603100	川仪股份	2,100	37,905.00	0.56
56	002154	报喜鸟	10,600	37,736.00	0.55
57	300681	英搏尔	1,300	37,206.00	0.55
58	002668	TCL 智家	3,300	36,564.00	0.54
59	301371	敷尔佳	1,400	36,400.00	0.53
60	603305	旭升集团	3,000	36,360.00	0.53
61	603508	思维列控	1,700	36,312.00	0.53
62	002414	高德红外	2,700	35,802.00	0.53
63	603045	福达合金	500	35,695.00	0.52
64	600262	北方股份	1,800	35,622.00	0.52
65	600415	小商品城	3,500	35,560.00	0.52
66	603198	迎驾贡酒	1,200	35,520.00	0.52
67	002780	三夫户外	2,900	35,206.00	0.52
68	000776	广发证券	1,500	35,100.00	0.52
69	002832	比音勒芬	1,700	35,088.00	0.52
70	300577	开润股份	2,400	35,064.00	0.51
71	603518	锦泓集团	4,900	35,035.00	0.51
72	301109	军信股份	2,800	34,888.00	0.51
73	000885	城发环境	2,900	34,887.00	0.51
74	600872	中炬高新	2,000	34,720.00	0.51
74	600559	老白干酒	3,100	34,720.00	0.51
75	600221	海航控股	25,700	34,695.00	0.51
76	300957	贝泰妮	1,100	34,661.00	0.51
77	688472	阿特斯	3,200	34,624.00	0.51
78	600499	科达制造	2,500	34,500.00	0.51
79	600885	宏发股份	1,000	34,490.00	0.51
80	601061	中信金属	3,200	34,464.00	0.51
81	601997	贵阳银行	6,700	34,371.00	0.50
82	300604	长川科技	100	34,142.00	0.50
83	603338	浙江鼎力	800	34,000.00	0.50
84	300406	九强生物	3,100	33,883.00	0.50
85	000651	格力电器	900	33,750.00	0.50
86	300832	新产业	800	33,600.00	0.49
87	002867	周大生	3,000	33,450.00	0.49
88	301031	中熔电气	280	33,446.00	0.49

89	301219	腾远钴业	600	32,880.00	0.48
90	688045	必易微	400	32,312.00	0.47
91	600030	中信证券	1,100	31,603.00	0.46
92	002752	昇兴股份	5,600	30,912.00	0.45
93	600019	宝钢股份	5,600	30,408.00	0.45
94	002079	苏州固锔	2,000	30,060.00	0.44
95	688328	深科达	300	28,710.00	0.42
96	300390	天华新能	300	28,053.00	0.41
97	600226	亨通股份	2,900	27,811.00	0.41
98	000951	中国重汽	1,400	27,314.00	0.40
99	300824	北鼎股份	3,700	26,566.00	0.39
100	000888	峨眉山 A	2,900	25,926.00	0.38
101	688275	万润新能	200	25,510.00	0.37
102	301295	美硕科技	600	25,308.00	0.37
103	300223	北京君正	100	24,890.00	0.37
104	002591	恒大高新	3,700	22,644.00	0.33
105	002111	威海广泰	2,500	22,500.00	0.33
106	600887	伊利股份	900	21,564.00	0.32
107	603719	良品铺子	2,300	19,895.00	0.29
108	688620	安凯微	1,200	19,440.00	0.29
109	301246	宏源药业	700	18,830.00	0.28
110	688203	海正生材	1,800	17,964.00	0.26
111	600148	长春一东	1,200	17,412.00	0.26
112	002105	信隆健康	3,500	17,290.00	0.25
113	002652	扬子新材	4,000	17,040.00	0.25
114	603600	永艺股份	1,900	16,853.00	0.25
115	000809	和展能源	5,200	16,484.00	0.24
116	000792	盐湖股份	500	15,095.00	0.22
117	300583	赛托生物	1,300	14,599.00	0.21
118	605289	罗曼股份	100	14,500.00	0.21
119	601601	中国太保	500	14,260.00	0.21
120	300817	双飞集团	900	14,040.00	0.21
121	002283	天润工业	1,400	13,510.00	0.20
122	301156	美农生物	1,200	13,044.00	0.19
123	300074	华平股份	3,600	12,240.00	0.18
124	688156	路德环境	400	12,100.00	0.18
125	002948	青岛银行	2,300	11,684.00	0.17
126	600928	西安银行	3,300	10,791.00	0.16
127	002563	森马服饰	2,100	10,584.00	0.16
128	300694	蠡湖股份	1,100	10,560.00	0.16
129	002972	科安达	500	9,780.00	0.14
130	603689	皖天然气	1,400	9,702.00	0.14
131	600233	圆通速递	600	9,450.00	0.14
132	300855	图南股份	300	9,378.00	0.14

133	002134	天津普林	300	9,126.00	0.13
134	002998	优彩资源	1,400	9,114.00	0.13
135	688609	九联科技	800	8,808.00	0.13
136	300184	力源信息	500	8,775.00	0.13
137	601225	陕西煤业	400	8,140.00	0.12
138	603345	安井食品	100	8,019.00	0.12
139	002582	好想你	900	7,605.00	0.11
140	600755	厦门国贸	1,400	7,588.00	0.11
141	600971	恒源煤电	1,000	6,900.00	0.10
142	600335	国机汽车	1,400	6,552.00	0.10
143	600037	歌华有线	1,000	6,270.00	0.09
144	001368	通达创智	300	6,171.00	0.09
145	000415	渤海租赁	1,500	6,105.00	0.09
146	002566	益盛药业	1,000	6,040.00	0.09
147	000680	山推股份	600	6,030.00	0.09
148	301189	奥尼电子	100	5,893.00	0.09
149	605266	健之佳	400	5,856.00	0.09
150	000100	TCL 科技	1,000	5,820.00	0.09
151	002833	弘亚数控	300	5,787.00	0.08
152	603187	海容冷链	500	5,745.00	0.08
153	002772	众兴菌业	500	5,680.00	0.08
154	002483	润邦股份	1,100	5,434.00	0.08
155	600361	创新新材	1,500	5,400.00	0.08
156	600320	振华重工	1,300	5,369.00	0.08
157	002532	天山铝业	500	5,365.00	0.08
158	000528	柳 工	700	5,285.00	0.08
159	000589	贵州轮胎	1,300	5,278.00	0.08
160	000975	山金国际	300	5,100.00	0.07
161	300619	金银河	160	4,977.60	0.07
162	600027	华电国际	1,100	4,895.00	0.07
163	600057	厦门象屿	900	4,878.00	0.07
164	603611	诺力股份	300	4,857.00	0.07
165	002322	理工能科	500	4,850.00	0.07
166	603970	中农立华	500	4,815.00	0.07
167	002727	一心堂	500	4,795.00	0.07
168	600801	华新水泥	300	4,680.00	0.07
169	600741	华域汽车	300	4,656.00	0.07
170	688395	正弦电气	200	4,420.00	0.06
171	600546	山煤国际	400	4,372.00	0.06
172	000933	神火股份	200	4,240.00	0.06
173	000036	华联控股	900	3,933.00	0.06
174	600502	安徽建工	900	3,915.00	0.06
175	000719	中原传媒	300	3,429.00	0.05
176	601677	明泰铝业	200	3,320.00	0.05

177	300518	新迅达	100	3,305.00	0.05
178	603507	振江股份	100	3,289.00	0.05
179	300424	航新科技	200	3,148.00	0.05
180	603233	大参林	200	3,006.00	0.04
181	002297	博云新材	100	2,899.00	0.04
182	000862	银星能源	600	2,892.00	0.04
183	605088	冠盛股份	100	2,818.00	0.04
184	002763	汇洁股份	400	2,716.00	0.04
185	300497	富祥药业	100	2,216.00	0.03
186	300201	海伦哲	100	2,107.00	0.03
187	002966	苏州银行	300	2,088.00	0.03
188	002712	思美传媒	500	2,075.00	0.03
189	300283	温州宏丰	100	2,055.00	0.03
190	300432	富临精工	100	2,009.00	0.03
191	600496	精工钢构	600	1,860.00	0.03
192	300970	华绿生物	100	1,828.00	0.03
193	002820	桂发祥	200	1,680.00	0.02
194	002236	大华股份	100	1,649.00	0.02
195	000404	长虹华意	200	1,572.00	0.02
196	600738	丽尚国潮	400	1,440.00	0.02
197	002120	韵达股份	200	1,272.00	0.02
198	601968	宝钢包装	300	1,176.00	0.02
199	603323	苏农银行	300	1,161.00	0.02
200	002376	新北洋	200	1,150.00	0.02
201	000802	北京文化	300	1,044.00	0.02
202	600425	青松建化	300	981.00	0.01
203	000428	华天酒店	300	912.00	0.01
204	601918	新集能源	100	859.00	0.01
205	002215	诺普信	100	823.00	0.01
206	603030	全筑股份	400	796.00	0.01
207	605136	丽人丽妆	100	713.00	0.01
208	605001	威奥股份	100	545.00	0.01
209	600018	上港集团	100	472.00	0.01
210	600795	国电电力	100	467.00	0.01
211	000619	海螺新材	100	440.00	0.01

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	688525	佰维存储	1,017,905.38	11.54
2	688766	普冉股份	854,080.03	9.68
3	688521	芯原股份	745,053.90	8.44
4	001309	德明利	556,977.00	6.31
5	000657	中钨高新	554,184.00	6.28
6	688472	阿特斯	548,993.97	6.22
7	002230	科大讯飞	533,492.00	6.05
8	600549	厦门钨业	474,050.00	5.37
9	603259	药明康德	446,904.00	5.06
10	688556	高测股份	441,103.31	5.00
11	605117	德业股份	432,962.00	4.91
12	300223	北京君正	431,987.00	4.90
13	300014	亿纬锂能	421,382.00	4.78
14	301536	星宸科技	418,052.00	4.74
15	002414	高德红外	415,846.00	4.71
16	603345	安井食品	401,953.00	4.56
17	000776	广发证券	394,618.00	4.47
18	300073	当升科技	394,247.00	4.47
19	002460	赣锋锂业	363,701.00	4.12
20	688155	先惠技术	344,409.74	3.90
21	300308	中际旭创	343,453.00	3.89
22	601872	招商轮船	339,952.00	3.85
23	603799	华友钴业	337,639.00	3.83
24	H06869	长飞光纤光缆	334,346.74	3.79
25	002558	巨人网络	331,679.00	3.76
26	600030	中信证券	329,657.00	3.74
27	301377	鼎泰高科	324,161.00	3.67
28	002384	东山精密	322,881.00	3.66
29	688630	芯碁微装	321,804.94	3.65
30	688503	聚和材料	319,349.85	3.62
31	300475	香农芯创	319,070.00	3.62
32	603198	迎驾贡酒	318,465.00	3.61
33	002948	青岛银行	312,351.00	3.54
34	603317	天味食品	311,380.00	3.53
35	603045	福达合金	305,314.00	3.46
36	603806	福斯特	304,155.00	3.45
37	002780	三夫户外	304,014.00	3.45
38	688111	金山办公	303,502.00	3.44
39	000333	美的集团	303,435.00	3.44
40	002709	天赐材料	302,103.00	3.42
41	300390	天华新能	300,911.00	3.41
42	688059	华锐精密	297,879.48	3.38
43	688498	源杰科技	295,562.00	3.35

44	688200	华峰测控	294,952.84	3.34
45	301031	中熔电气	291,057.00	3.30
46	301550	斯菱股份	285,356.00	3.23
47	301308	江波龙	281,808.00	3.19
48	002378	章源钨业	278,670.00	3.16
49	600741	华域汽车	277,831.00	3.15
50	300236	上海新阳	273,957.00	3.10
51	300395	菲利华	272,513.00	3.09
52	603986	兆易创新	270,715.00	3.07
53	688308	欧科亿	270,036.93	3.06
54	300857	协创数据	260,913.00	2.96
55	688627	精智达	256,644.64	2.91
56	603061	金海通	256,109.00	2.90
57	688002	睿创微纳	255,602.46	2.90
58	688331	荣昌生物	253,778.00	2.88
59	000792	盐湖股份	247,065.00	2.80
60	688257	新锐股份	243,950.82	2.76
61	600841	动力新科	241,915.00	2.74
62	300604	长川科技	241,213.00	2.73
63	688378	奥来德	240,224.22	2.72
64	H01347	华虹宏力	239,246.19	2.71
65	300432	富临精工	237,731.00	2.69
66	601997	贵阳银行	234,242.00	2.65
67	300438	鹏辉能源	233,781.00	2.65
68	688037	芯源微	233,318.17	2.64
69	600522	中天科技	232,810.00	2.64
70	688559	海目星	232,245.86	2.63
71	002653	海思科	227,016.00	2.57
72	300316	晶盛机电	226,957.00	2.57
73	300776	帝尔激光	225,439.00	2.56
74	H01024	快手—W	222,302.03	2.52
75	002266	浙富控股	222,202.00	2.52
76	600887	伊利股份	221,649.00	2.51
77	688266	泽璟制药	221,076.49	2.51
78	688028	沃尔德	219,643.29	2.49
79	603338	浙江鼎力	217,162.00	2.46
80	600919	江苏银行	217,117.00	2.46
81	300596	利安隆	216,464.00	2.45
82	002008	大族激光	214,648.00	2.43
83	001313	粤海饲料	211,550.00	2.40
84	603588	高能环境	211,435.00	2.40
85	688377	迪威尔	210,707.20	2.39
86	688275	万润新能	210,628.00	2.39
87	300750	宁德时代	205,154.00	2.33

88	601888	中国中免	204,943.00	2.32
89	688017	绿的谐波	204,472.85	2.32
90	688110	东芯股份	202,766.00	2.30
91	000651	格力电器	201,881.00	2.29
92	300763	锦浪科技	201,289.00	2.28
93	688239	航宇科技	200,656.00	2.27
94	688516	奥特维	200,651.86	2.27
95	688536	思瑞浦	200,600.00	2.27
96	002493	荣盛石化	200,158.00	2.27
97	001203	大中矿业	199,656.00	2.26
98	601009	南京银行	198,887.00	2.25
99	000800	一汽解放	195,779.00	2.22
100	688221	前沿生物	193,603.58	2.19
101	601688	华泰证券	193,490.00	2.19
102	000783	长江证券	192,285.00	2.18
103	688090	瑞松科技	191,823.97	2.17
104	600176	中国巨石	191,674.00	2.17
105	000807	云铝股份	191,579.00	2.17
106	300285	国瓷材料	191,028.00	2.17
107	603991	至正股份	189,333.00	2.15
108	300620	光库科技	188,694.00	2.14
109	002028	思源电气	188,654.00	2.14
110	300037	新宙邦	187,552.00	2.13
111	000703	恒逸石化	187,430.00	2.12
112	688012	中微公司	187,174.00	2.12
113	300012	华测检测	186,970.00	2.12
114	688428	诺诚健华	186,428.67	2.11
115	002532	天山铝业	186,017.00	2.11
116	600487	亨通光电	185,610.00	2.10
117	000688	国城矿业	184,719.00	2.09
118	002154	报喜鸟	184,129.00	2.09
119	601000	唐山港	183,761.00	2.08
120	688328	深科达	183,200.00	2.08
121	000848	承德露露	183,083.00	2.07
122	601061	中信金属	180,700.00	2.05
123	600601	方正科技	180,426.00	2.04
124	603179	新泉股份	180,231.00	2.04
125	601601	中国太保	180,112.00	2.04
126	002867	周大生	179,992.00	2.04
127	H01860	汇量科技	178,196.11	2.02
128	600104	上汽集团	178,064.00	2.02
129	600183	生益科技	176,914.00	2.01
130	300406	九强生物	176,538.00	2.00

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	688525	佰维存储	949,791.50	10.76
2	688766	普冉股份	815,596.40	9.24
3	688521	芯原股份	744,193.36	8.43
4	H06869	长飞光纤光缆	694,387.79	7.87
5	000657	中钨高新	570,209.00	6.46
6	600699	均胜电子	558,280.00	6.33
7	002230	科大讯飞	550,405.00	6.24
8	688556	高测股份	530,766.46	6.02
9	001309	德明利	524,239.00	5.94
10	688472	阿特斯	505,356.81	5.73
11	300308	中际旭创	478,559.00	5.42
12	300421	力星股份	466,348.00	5.29
13	603920	世运电路	464,698.00	5.27
14	300223	北京君正	456,900.00	5.18
15	603950	长源东谷	442,422.00	5.01
16	301550	斯菱股份	428,645.00	4.86
17	600549	厦门钨业	413,197.00	4.68
18	603259	药明康德	406,586.00	4.61
19	300115	长盈精密	406,013.00	4.60
20	688059	华锐精密	399,531.03	4.53
21	605117	德业股份	396,707.20	4.50
22	H00358	江西铜业股份	390,973.68	4.43
23	300073	当升科技	381,600.00	4.32
24	603345	安井食品	380,709.00	4.31
25	002414	高德红外	376,316.00	4.26
26	300014	亿纬锂能	372,208.00	4.22
27	688516	奥特维	366,660.03	4.16
28	H02628	中国人寿	363,494.62	4.12
29	301529	福赛科技	362,893.00	4.11
30	601100	恒立液压	361,750.00	4.10
31	000776	广发证券	359,686.00	4.08
32	688630	芯碁微装	355,541.92	4.03
33	301536	星宸科技	350,974.00	3.98
34	603799	华友钴业	336,398.00	3.81
35	688503	聚和材料	332,772.54	3.77
36	002558	巨人网络	327,133.00	3.71

37	688698	伟创电气	316,610.29	3.59
38	300136	信维通信	310,911.00	3.52
39	603806	福斯特	309,921.00	3.51
40	000333	美的集团	309,023.00	3.50
41	688111	金山办公	308,906.00	3.50
42	002460	赣锋锂业	307,084.00	3.48
43	603166	福达股份	304,138.00	3.45
44	600030	中信证券	303,814.00	3.44
45	688210	统联精密	303,332.66	3.44
46	002948	青岛银行	302,781.00	3.43
47	301308	江波龙	301,098.00	3.41
48	603061	金海通	293,258.00	3.32
49	688200	华峰测控	290,421.44	3.29
50	603045	福达合金	290,396.00	3.29
51	601872	招商轮船	289,526.00	3.28
52	603986	兆易创新	287,313.00	3.26
53	688002	睿创微纳	286,527.88	3.25
54	688498	源杰科技	285,596.00	3.24
55	002378	章源钨业	283,004.00	3.21
56	301377	鼎泰高科	279,741.00	3.17
57	688711	宏微科技	279,434.00	3.17
58	600741	华域汽车	274,728.00	3.11
59	300475	香农芯创	272,907.00	3.09
60	H02050	三花智控	271,540.86	3.08
61	300390	天华新能	271,277.00	3.07
62	002780	三夫户外	270,748.00	3.07
63	301031	中熔电气	270,698.00	3.07
64	002709	天赐材料	268,821.00	3.05
65	301413	安培龙	266,593.00	3.02
66	688331	荣昌生物	259,773.00	2.94
67	300285	国瓷材料	256,623.00	2.91
68	301021	英诺激光	256,622.00	2.91
69	603198	迎驾贡酒	255,187.00	2.89
70	688155	先惠技术	255,104.06	2.89
71	H00179	德昌电机控股	250,394.27	2.84
72	688377	迪威尔	248,818.81	2.82
73	300438	鹏辉能源	247,768.00	2.81
74	603317	天味食品	246,054.00	2.79
75	002957	科瑞技术	244,896.00	2.78
76	300236	上海新阳	243,755.00	2.76
77	002384	东山精密	242,451.00	2.75
78	688328	深科达	241,546.00	2.74
79	002653	海思科	238,429.00	2.70
80	001203	大中矿业	236,248.00	2.68

81	000792	盐湖股份	235,130.00	2.66
82	002008	大族激光	234,417.00	2.66
83	600522	中天科技	231,870.00	2.63
84	300395	菲利华	230,969.00	2.62
85	300432	富临精工	230,107.00	2.61
86	600841	动力新科	222,758.00	2.52
87	300604	长川科技	222,494.00	2.52
88	300596	利安隆	221,978.00	2.52
89	300750	宁德时代	220,716.00	2.50
90	300620	光库科技	220,503.00	2.50
91	H01347	华虹宏力	218,709.28	2.48
92	301538	骏鼎达	217,456.00	2.46
93	600919	江苏银行	217,377.00	2.46
94	688028	沃尔德	213,462.00	2.42
95	300763	锦浪科技	212,397.00	2.41
96	688627	精智达	211,462.16	2.40
97	600183	生益科技	211,433.00	2.40
98	600487	亨通光电	210,896.00	2.39
99	603588	高能环境	210,665.00	2.39
100	688257	新锐股份	209,383.02	2.37
101	688308	欧科亿	208,630.00	2.36
102	300433	蓝思科技	207,253.00	2.35
103	688017	绿的谐波	207,024.05	2.35
104	688536	思瑞浦	206,926.00	2.35
105	H06088	FIT HON TENG	204,887.95	2.32
106	601888	中国中免	203,756.00	2.31
107	300776	帝尔激光	201,112.00	2.28
108	688239	航宇科技	201,005.40	2.28
109	603991	至正股份	200,952.00	2.28
110	301338	凯格精机	200,498.00	2.27
111	301196	唯科科技	200,492.00	2.27
112	600176	中国巨石	200,237.00	2.27
113	600887	伊利股份	198,313.00	2.25
114	000783	长江证券	196,675.00	2.23
115	601997	贵阳银行	195,951.00	2.22
116	000688	国城矿业	195,838.00	2.22
117	000800	一汽解放	195,621.00	2.22
118	688322	奥比中光	194,879.38	2.21
119	688428	诺诚健华	194,131.04	2.20
120	002028	思源电气	192,376.00	2.18
121	601688	华泰证券	191,922.00	2.18
122	300037	新宙邦	191,207.00	2.17
123	300857	协创数据	190,155.00	2.16
124	000807	云铝股份	189,517.00	2.15

125	688012	中微公司	188,936.00	2.14
126	601000	唐山港	188,525.00	2.14
127	300012	华测检测	187,783.00	2.13
128	300969	恒帅股份	186,410.00	2.11
129	688378	奥来德	185,174.09	2.10
130	688221	前沿生物	184,163.31	2.09
131	300975	商络电子	182,727.00	2.07
132	688275	万润新能	182,458.00	2.07
133	603338	浙江鼎力	181,434.00	2.06
134	688037	芯源微	180,399.32	2.04

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	75,281,042.98
卖出股票收入（成交）总额	79,607,458.43

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	303,177.70	4.45
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	303,177.70	4.45

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	019792	25 国债 19	3,000.00	303,177.70	4.45

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 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 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约定的备选股票库。

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	308,193.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	369.45
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	308,562.46

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限的情况。

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
金鹰睿选成长六个月持有混合 A	179	15,527.39	-	-	2,779,403.54	100.00 %
金鹰睿选成长六	241	9,388.11	-	-	2,262,533.98	100.00

个月持有混合 C						%
合计	420	12,004.61	-	-	5,041,937.52	100.00 %

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年(2025 年 7 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日)
盈利投资者数量占比	97.93%

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	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	128,422.76	4.62%
	金鹰睿选成长六个月持有混合 C	20.06	0.00%
	合计	128,442.82	2.55%

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	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	0
	金鹰睿选成长六个月持有混合 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	0~10
	金鹰睿选成长六个月持有混合 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	金鹰睿选成长六个月持有混合 A	金鹰睿选成长六个月持有混合 C
基金合同生效日（2023 年 6 月 9 日）基金份额总额	113,101,842.65	88,114,028.86
本报告期期初基金份额总额	3,687,588.55	4,318,560.69
本报告期基金总申购份额	525,530.56	349,496.87
减：本报告期基金总赎回份额	1,433,715.57	2,405,523.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,779,403.54	2,262,533.98

§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

本报告期未改聘会计师事务所。

10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况**10.7.1 管理人受调查或处罚等情况**

本报告期，管理人未受到调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，管理人高级管理人员及相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.8.1 基金租用或者通过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	
国元证券	2	42,124,981.78	27.20%	20,340.55	28.39%	-
兴业证券	2	112,763,519.63	72.80%	51,299.21	71.61%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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

10.8.2 基金租用或者通过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
国元证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	300,309.00	100.00%	-	-	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-13
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-16
3	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定媒介	2026-01-22
4	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-01-22
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026-02-12
6	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定媒介	2026-03-31
7	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证监会规定媒介	2026-03-31
8	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-03-31
9	金鹰基金管理有限公司关于网上交易、微信理财宝系统暂停服务的公告	证监会规定媒介	2026-04-02
10	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会规定媒介	2026-04-22
11	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-04-22
12	金鹰基金管理有限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	证监会规定媒介	2026-04-30
13	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金(金鹰睿选成长六个月持有混合 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
14	金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资	证监会规定媒介	2026-05-29

	基金(金鹰睿选成长六个月持有混合 C)基金产品资料概要更新		
15	金鹰基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)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	2026-05-29
16	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-06-24

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它重大信息。

§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睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰睿选成长六个月持有期混合型证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰睿选成长六个月持有期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、营业执照、公司章程。
- 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

二〇二六年八月三十一日