

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2026 年 3 月 30 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2025 年 4 月 25 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	10
3.3 过去三年基金的利润分配情况	15
§ 4 管理人报告	16
4.1 基金管理人及基金经理情况	16
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	17
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	17
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	18
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	19
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	20
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	21
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	21
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	21
4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	21
§ 5 托管人报告	21
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	21
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	22
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	22
§ 6 审计报告	22
6.1 审计意见	22
6.2 形成审计意见的基础	22
6.3 其他信息	23
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	23
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	23
§ 7 年度财务报表	24
7.1 资产负债表	24
7.2 利润表	26
7.3 净资产变动表	27
7.4 报表附注	28
§ 8 投资组合报告	60
8.1 期末基金资产组合情况	60
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	75
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	75
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	75
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§ 9 基金份额持有人信息	77
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
9.2 期末上市基金前十名持有人	78
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	78
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况	79
§ 10 开放式基金份额变动	79
§ 11 重大事件揭示	80
11.1 基金份额持有人大会决议	80
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	81
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	81
11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	81
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
11.9 其他重大事件	82
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	86
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§ 13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金			
基金简称	金鹰中证 A500 指数发起			
基金主代码	023333			
交易代码	023333			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2025 年 4 月 25 日			
基金管理人	金鹰基金管理有限公司			
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	205,296,566.72 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	金鹰中证 A500 指数发起 A	金鹰中证 A500 指数发起 C	金鹰中证 A500 指数发起 B	金鹰中证 A500 指数发起 D
下属分级基金的交易代码	023333	023334	025125	025126
报告期末下属分级基金的份 额总额	28,777,909.73 份	14,038,761.38 份	162,413,081.04 份	66,814.57 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金采用指数化投资策略，紧密跟踪中证 A500 指数，追求跟踪偏离度与跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、港股通标的股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生品投资策略、参与转融通业务的投资策略和参与融资业务的投资策略。

业绩比较基准	中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	<p>本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金资产可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。</p>

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		金鹰基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	张立学
	联系电话	020-83936180	010-68858113
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	zhanglixue@psbcoa.com.cn
客户服务电话		4006135888	95580
传真		020-83282856	010-86353609
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街2号3212房	北京市西城区金融大街3号
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越秀金融大厦30层	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		510623	100808
法定代表人		姚文强	郑国雨

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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金年度报告备置地点	广东省广州市天河区珠江东路 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
----	----	------

会计师事务所	立信会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	金鹰中证 A500 指数发起 A	
本期已实现收益		5,136,424.60
本期利润		7,797,783.68
加权平均基金份额本期利润		0.0544
本期加权平均净值利润率		5.39%
本期基金份额净值增长率		9.54%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	
	金鹰中证 A500 指数发起 A	
期末可供分配利润		2,746,059.20
期末可供分配基金份额利润		0.0954
期末基金资产净值		31,523,968.93
期末基金份额净值		1.0954
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	
	金鹰中证 A500 指数发起 A	
基金份额累计净值增长率		9.54%

金鹰中证 A500 指数发起 C

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日	
	金鹰中证 A500 指数发起 C	

本期已实现收益	770,529.71
本期利润	900,383.62
加权平均基金份额本期利润	0.0739
本期加权平均净值利润率	7.24%
本期基金份额净值增长率	9.38%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 C
期末可供分配利润	1,317,246.68
期末可供分配基金份额利润	0.0938
期末基金资产净值	15,356,008.06
期末基金份额净值	1.0938
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 C
基金份额累计净值增长率	9.38%

金鹰中证 A500 指数发起 B

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
	金鹰中证 A500 指数发起 B
本期已实现收益	430,545.29
本期利润	4,764,763.70
加权平均基金份额本期利润	0.0893
本期加权平均净值利润率	8.36%
本期基金份额净值增长率	8.84%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 B
期末可供分配利润	15,259,488.36
期末可供分配基金份额利润	0.0940

期末基金资产净值	177,672,569.40
期末基金份额净值	1.0940
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 B
基金份额累计净值增长率	8.84%

金鹰中证 A500 指数发起 D

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
	金鹰中证 A500 指数发起 D
本期已实现收益	15,002.18
本期利润	147,188.14
加权平均基金份额本期利润	0.4750
本期加权平均净值利润率	44.66%
本期基金份额净值增长率	7.29%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 D
期末可供分配利润	5,235.62
期末可供分配基金份额利润	0.0784
期末基金资产净值	72,050.19
期末基金份额净值	1.0784
3.1.3 累计期末指标	2025 年末
	金鹰中证 A500 指数发起 D
基金份额累计净值增长率	7.29%

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，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、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、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、本基金合同生效日为 2025 年 4 月 25 日，无上年度及上上年度可比期间数据（下同）；

5、本基金自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额，B 类、D 类基金份额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日。

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

金鹰中证 A500 指数发起 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	-0.03%	0.97%	0.43%	1.00%	-0.46%	-0.03%
过去六个月	9.29%	0.85%	20.71%	0.95%	-11.42%	-0.10%
自基金合同生效起至今	9.54%	0.73%	25.76%	0.87%	-16.22%	-0.14%

金鹰中证 A500 指数发起 C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.08%	0.97%	0.43%	1.00%	-0.51%	-0.03%
过去六个月	9.17%	0.85%	20.71%	0.95%	-11.54%	-0.10%
自基金合同生效起至今	9.38%	0.73%	25.76%	0.87%	-16.38%	-0.14%

金鹰中证 A500 指数发起 B

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.10%	0.97%	0.43%	1.00%	-0.53%	-0.03%
自基金合同生效起至今	8.84%	0.95%	16.33%	1.02%	-7.49%	-0.07%

金鹰中证 A500 指数发起 D

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	-1.61%	0.96%	0.43%	1.00%	-2.04%	-0.04%
自基金合同生效起至今	7.29%	0.94%	16.33%	1.02%	-9.04%	-0.08%

注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

4.本基金自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额，B 类、D 类基金份额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日。

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

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

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

(2025 年 4 月 25 日至 2025 年 12 月 31 日)

金鹰中证 A500 指数发起 A



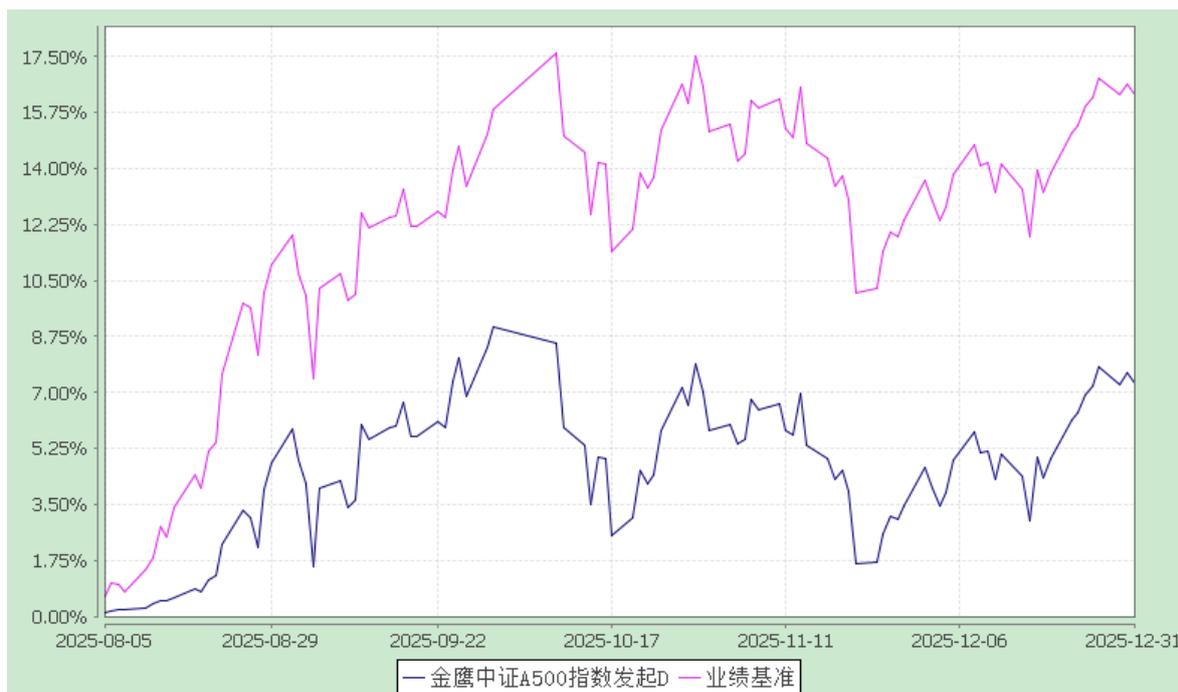
金鹰中证 A500 指数发起 C



金鹰中证 A500 指数发起 B



金鹰中证 A500 指数发起 D



注：1.本基金合同于 2025 年 4 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

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

3.本基金业绩比较基准为：中证 A500 指数收益率 $\times 95\%$ + 银行活期存款利率（税后） $\times 5\%$ 。

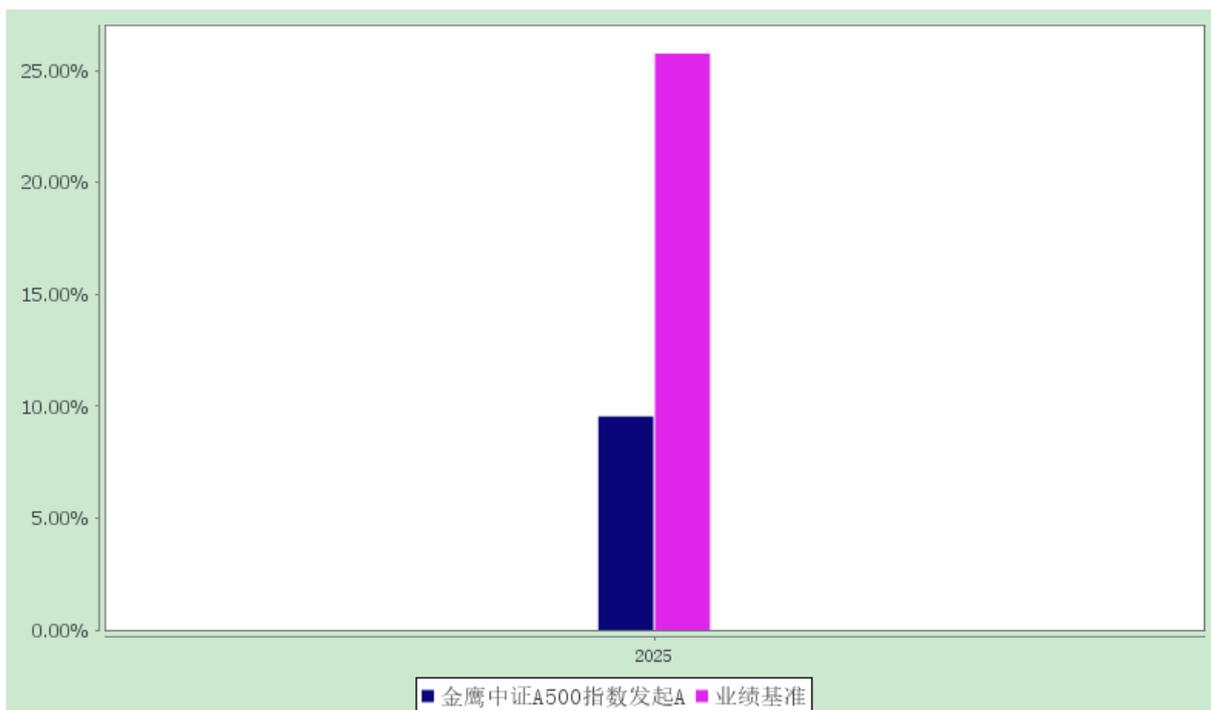
4.本基金自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额，B 类、D 类基金份额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日。

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

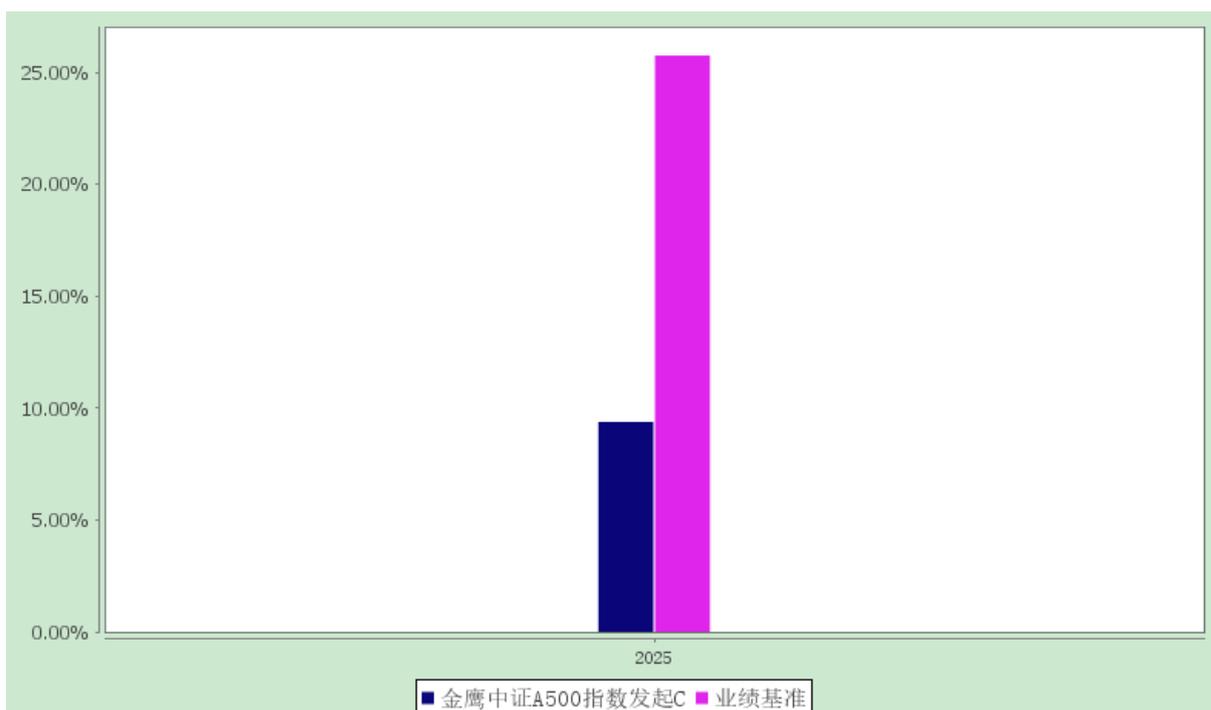
金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图

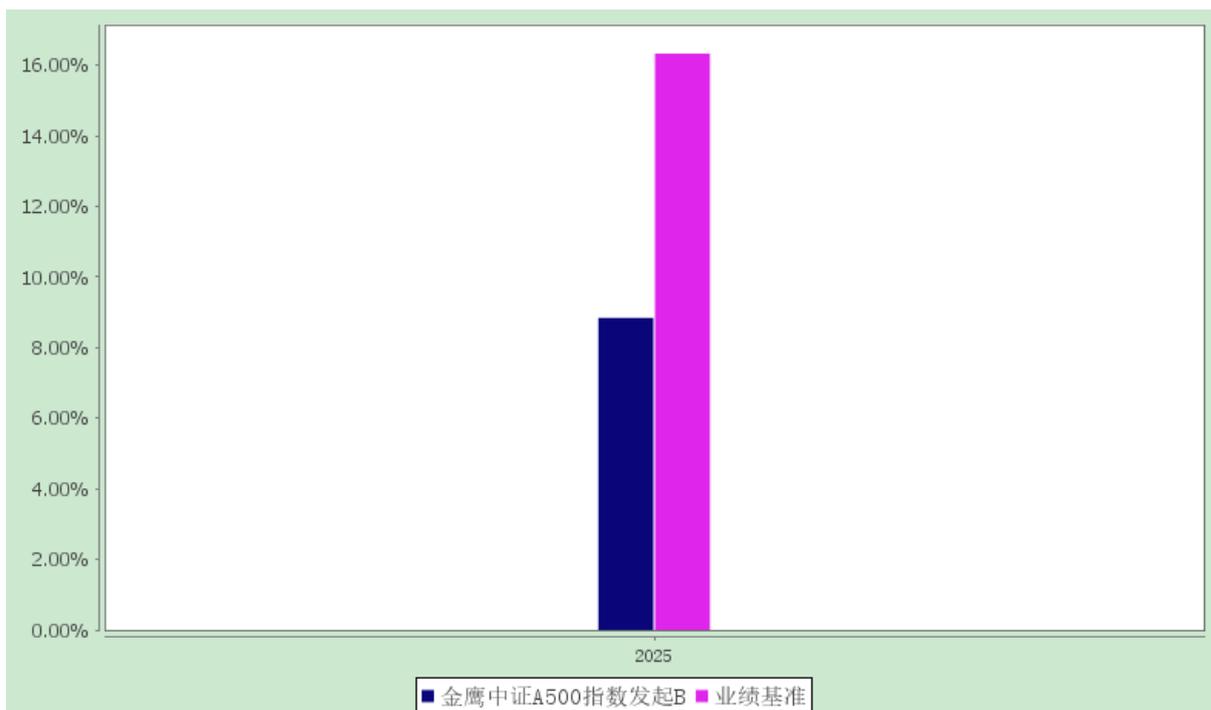
金鹰中证 A500 指数发起 A



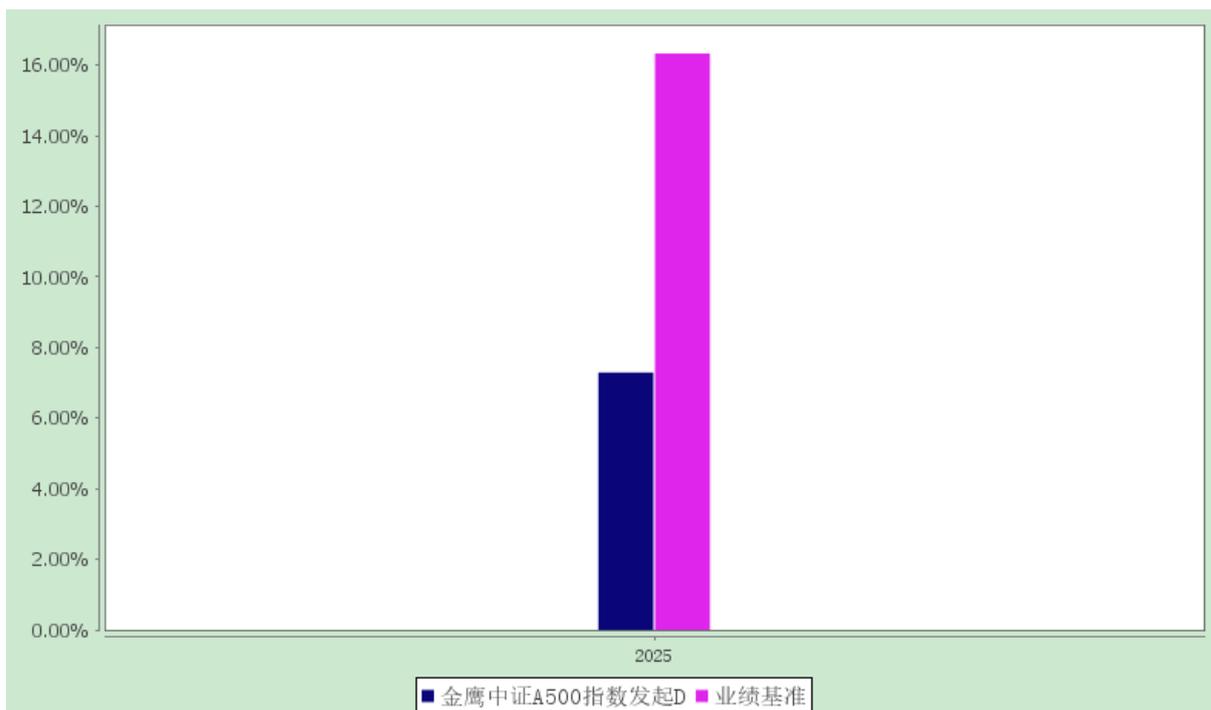
金鹰中证 A500 指数发起 C



金鹰中证 A500 指数发起 B



金鹰中证 A500 指数发起 D



注：本基金合同于 2025 年 4 月 25 日生效，自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额，B 类、D 类基金份额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日；截至报告期末未满一年，按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金成立于 2025 年 4 月 25 日，成立以来未进行利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 73 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
杨刚	本基金的基金经理，公司首席经济学家，权益研究部总经理	2025-04-25	-	29	杨刚先生，华中理工大学工学硕士。1996 年 7 月至 2001 年 5 月曾任大鹏证券有限责任公司综合研究所高级研究员和部门主管，2001 年 5 月至 2010 年 4 月曾任平安证券有限责任公司综合研究所高级研究员、部门主管和副所长，平安证券资产管理部执行总经理。2010 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，现任首席经济学家、权益研究部总经理、基金经理。
曾绍刚	本基金的基金经理助理	2025-05-15	-	3	曾绍刚先生，北京大学理学硕士，FRM。2013 年 8 月至 2018 年 3 月曾任中国海洋石油南海东部石油管理

					局物探技术研究岗，2018 年 4 月至 2022 年 4 月曾任招商银行总行产品研发与推广岗。2022 年 4 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任 FOF 投资与金融工程部产品研究员、专户资产管理部投资经理、权益研究部基金经理助理及基金经理，现任权益投资部基金经理。
--	--	--	--	--	---

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。

4.2 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，严格遵守本基金的基金合同、托管协议、招募说明书等法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年，在流动性、政策面及重要行业催化等的共同牵引下，A 股走出了以科技创新为最重要主线的“科技牛”行情，AI 更成为其中重要的投资主题之一。同时，在全球地缘形势及外部宽松条件影响下，上游强周期、海外与国产算力、电力设备及新能源等多个方向均表现出色。

国内宏观经济层面，2025 年，中国经济在复杂外部环境下仍保持足够韧性，持续顶压前行，主要经济指标实现预期目标：GDP 突破 140 万亿元，同比增长 5.0%，稳居世界第二大经济体地位；产业转型升级快速推进，高技术制造业增加值同比增长 9.4%，占规模以上工业比重提升至 17.1%，其中，新能源汽车产销连续 11 年居全球第一，工业机器人出口增长 48.7%；外贸方面，在美国高举关税大棒的突发形势下沉着应对，全年货物进出口总额仍超 45 万亿元，创出历史新高，出口更是顶住逆风，同步增长 6.1%，继续保持全球货物贸易第一大国地位。

海外市场方面，尽管有特朗普关税的重大扰动，但在美联储持续降息尤其全球人工智能引领的科技产业大力推动下，全球主要股市 2025 年继续有较佳表现。其中，道琼斯指数、纳斯达克指数及标普 500 指数分别上涨 12.97%、20.36% 及 16.39%。

A 股市场方面，2025 年，上证指数、沪深 300 指数及创业板指数年度涨幅分别为 18.41%、17.66% 及 49.57%。申万一级行业指数涨跌幅方面，有色、通信、电子、综合和电新涨幅居前（分别为 94.73%、84.75%、47.88%、43.55% 和 41.83%），食品饮料、煤炭、美护、公用和交运表现落后（分别为 -9.69%、

-5.27%、0.39%、1.03%及 1.13%)。

具体观察行业层面的表现，2025 年 A 股“新旧”阵营表现较为分化。从宽基指数看，代表市场风格活跃程度的万得微盘股指数与作为此轮全球股市风向标的科创类指数表现最为醒目，年度涨幅分别达到 70%+与 50%左右。

整体而言，自 2024 年 9 月 24 日以来的 A 股“非典型修复市”仍持续演进中。尽管国内经济基本面的修复仍相对温和，内循环尚待通畅，但海外美联储降息窗口打开，为包括 A 股在内的众多新兴市场提供了新一轮“美元外溢”带动风险资产提振的良好机会。此外，大国关系进入阶段缓和期，及国内呵护资本市场发展的政策延续等，都为 A 股市场的持续稳健前行提供了有力支持。

本基金采用被动投资的方法跟踪标的指数，争取跟踪误差保持在合理范围内，业绩比较基准为中证 A500 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。产品成立于 2025 年二季度，主要以安全垫思路稳健建仓。进入 2025 年 7 月后，权益市场风格显著上升，该阶段采取阶梯建仓策略。步入 2025 年四季度，产品已进入正常开放申赎期，但由于产品规模萎缩较快，产品申赎对跟踪基准指数产生较大扰动。为此，主要通过精细化组合管理，综合运用股指期货套保、国债正逆回购等工具，及时对冲并平滑大额申赎带来的冲击成本，有效抑制净值异常波动，确保跟踪误差始终控制在合同约定的阈值之内。整体来看，基金运行平稳，各项风控指标持续处于合理区间，指数复制效果良好，基本上完成了对基准的跟踪。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，本基金 A 类份额净值为 1.0954 元，本报告期份额净值增长率为 9.54%，同期业绩比较基准增长率为 25.76%；C 类基金份额净值为 1.0938 元，本报告期份额净值增长率为 9.38%，同期业绩比较基准增长率为 25.76%；本基金 B 类份额净值为 1.0940 元，本报告期份额净值增长率为 8.84%，同期业绩比较基准增长率为 16.33%；D 类基金份额净值为 1.0784 元，本报告期份额净值增长率为 7.29%，同期业绩比较基准增长率为 16.33%。

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 2026 年，预计全球经济保持温和修复。世界银行预测 2026 年全球经济增长 2.6%，主要受 AI 投资、供应链优化及金融环境改善支撑。国际货币基金组织（IMF）预测 2026 年全球经济增长 3.3%，新兴市场与发展中经济体增速达 4.0%以上，成为重要增长引擎。

中国经济方面，IMF 预测 2026 年中国 GDP 增长 4.5%，主要得益于消费（服务消费、新型消费）、投资（基建、制造业）及出口（高技术产品）的拉动。国内较一致的市场预期，是认为今年 GDP 增速在 4.5%-5.0%之间。

国内政策方向上，预计今年将延续“积极财政+适度宽松货币”的组合，赤字率维持在 4%左右，继续支持“两新”（新型基础设施、新型城镇化）建设；货币政策将适时降准降息，保持流动性充裕。

结构层面有望进一步优化，消费（尤其是服务消费）或将成为增长主动力，预计社会消费品零售总额增长 5%左右；制造业投资（高技术制造业）保持高增速，预计占比提升至 18%；出口（新能源汽车、工业机器人）继续引领全球市场。

股市层面，在过去 1 年多的国内“非典型修复市”演进过程中，由于基本面因子仍相对偏弱，股市主要围绕风险偏好、市场流动性及宏大叙事展开，相应地，坚持价值成长方向的基本面投资风格阶段性仍难免波折，但我们相信，股市的修复过程最终将切换到估值与业绩双轮驱动的下半场，估值驱动有望逐步走向业绩驱动，而以人工智能为代表的科技行业和主要依托经济修复所带动的传统行业之间的结构性分化态势有望趋于收敛，2026 年出现这样的重大切换的概率在显著上升。我们对 A 股市场中长期前景继续抱有谨慎乐观的态度和信心。

整体而言，我们认为 2026 年 A 股市场或将行进在盈利提升和估值扩张的双轮推动轨道之中，建议投资者持续保持定力，与优质企业共同成长。

2026 年，本产品将继续严格按照合同要求，根据每日申赎情况，并充分利用有效工具，做好对基准指数的复制和跟踪。由于 A500 指数权重股均为 A 股各细分行业的龙头公司，基于前述对年内 A 股市场的总体判断，我们对本指数产品的中期前景持相对谨慎乐观的积极态度。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

本报告期有关本基金的监察稽核内容包括投资、交易、研究、市场营销、信息披露等各项业务的每个环节以及信息技术、运营保障、行政管理等后台支持工作。监察结果显示，本报告期内公司对本基金的管理始终都能按照法律法规、基金合同、基金招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的投资决策、投资交易程序、投资权限等各方面均符合规定的要求；交易行为合法合规，未出现异常交易、操纵市场的现象；未发现内幕交易的情况；基金持有的证券符合规定的比例要求；基金专用交易席位年度交易量比例符合证监会的有关规定；相关的信息披露真实、完整、准确、及时；销售工作合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

本基金管理人承诺将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提

高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范和控制各种风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未进行利润分配。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

本报告期，会计师事务所未对本基金出具非标准审计报告。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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，中国邮政储蓄银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法

律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

本基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告，投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

信会师报字[2026]第 ZK30181 号

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金（以下简称“金鹰中证 A500 指数发起”）财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，自 2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照《企业会计准则》的规定编制，公允反映了金鹰中证 A500 指数发起 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》及中国注册会计师职业道德守则，我们独立于金鹰中证 A500 指数发起，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计

中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

金鹰中证 A500 管理人金鹰基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括金鹰中证 A5002025 年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估金鹰中证 A500 的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项，并运用持续经营假设，除非金鹰中证 A500 计划清算、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督金鹰中证 A500 的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

1. 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些

风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

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

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

4. 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对金鹰中证 A500 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报告使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致金鹰中证 A500 不能持续经营。

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

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

立信会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

李振 马睿

上海市南京东路 61 号 4 楼新黄浦金融大厦

2026 年 3 月 30 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	13,888,175.14

结算备付金		5,595,436.03
存出保证金		4,021,591.68
交易性金融资产	7.4.7.2	214,105,770.71
其中：股票投资		203,915,995.59
基金投资		-
债券投资		10,189,775.12
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		29,392.94
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		237,640,366.50
负债和净资产	附注号	本期末 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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		8,599,957.00
应付清算款		-
应付赎回款		4,246,108.02
应付管理人报酬		54,105.01
应付托管费		18,035.01
应付销售服务费		1,933.41
应付投资顾问费		-

应交税费		5,288.57
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	90,342.90
负债合计		13,015,769.92
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	205,296,566.72
未分配利润	7.4.7.8	19,328,029.86
净资产合计		224,624,596.58
负债和净资产总计		237,640,366.50

注：截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0954 元，A 类基金份额总额为 28,777,909.73 份；B 类基金份额净值为 1.0940 元，B 类基金份额总额为 162,413,081.04 份；C 类基金份额净值为 1.0938 元，C 类基金份额总额为 14,038,761.38 份；D 类基金份额净值为 1.0784 元，D 类基金份额总额为 66,814.57 份；基金份额总额为 205,296,566.72 份。

7.2 利润表

会计主体：金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日
一、营业总收入		14,176,209.10
1.利息收入		1,213,706.95
其中：存款利息收入	7.4.7.9	629,735.82
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		583,971.13
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		5,622,703.86

其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,796,511.10
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	15,249.92
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	197,381.30
股利收益	7.4.7.15	613,561.54
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	7,257,617.36
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	82,180.93
减：二、营业总支出		566,089.96
1. 管理人报酬		386,671.62
2. 托管费		128,890.60
3. 销售服务费		16,986.54
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		11,026.22
其中：卖出回购金融资产支出		11,026.22
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		714.98
8. 其他费用	7.4.7.19	21,800.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,610,119.14
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,610,119.14
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		13,610,119.14

7.3 净资产变动表

会计主体：金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	310,960,667.59	-	310,960,667.59
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-105,664,100.87	19,328,029.86	-86,336,071.01
（一）、综合收益总额	-	13,610,119.14	13,610,119.14
（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）	-105,664,100.87	5,717,910.72	-99,946,190.15
其中：1.基金申购款	251,475,961.72	16,917,516.85	268,393,478.57
2.基金赎回款	-357,140,062.59	-11,199,606.13	-368,339,668.72
（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	205,296,566.72	19,328,029.86	224,624,596.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2025]50 号《关于准予金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由金鹰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管

理办法》等有关规定和《金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》(“基金合同”)发起,于 2025 年 4 月 7 日向社会公开发行人募集并于 2025 年 4 月 25 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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2025 年 4 月 7 日至 2025 年 4 月 23 日,为契约型开放式基金,存续期限不定,募集资金及其孳息总额为人民币 310,960,667.59 元,其中,A 类份额 287,209,243.92 元,C 类份额 23,751,423.67 元。总有效认购户数为 1737 户。本基金募集资金经大华会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金的投资范围包括标的指数成份股及备选成份股(含存托凭证)、除标的指数成份股及备选成份股以外的其他国内依法发行上市的股票(包括主板、创业板、科创板、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、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)。本基金自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本会计年度自 2025 年 4 月 25 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

（1）金融工具的初始确认

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

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

（2）金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

（3）金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

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

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

- 所转移金融资产的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

（4）金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

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

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致企业资产增加或者负债减少、且经济利益的流入

额能够可靠计量时确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、本基金每季度进行分红评估，在符合有关基金分红条件的前提下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准；

2、由于本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

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

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

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

7.4.4.12 外币交易

本基金本报告期内无外币交易。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》（财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号）、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充

通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、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》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。

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
活期存款	13,888,175.14
等于：本金	13,887,138.63
加：应计利息	1,036.51
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	13,888,175.14

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	196,697,948.91	-	203,915,995.59	7,218,046.68
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	87,045.12		
	银行间市场	-	-	-
	合计	10,101,019.00	87,045.12	10,189,775.12
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	206,798,967.91	87,045.12	214,105,770.71	7,219,757.68

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	6,889,800.00	-	-	-

--股指期货	6,889,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	6,889,800.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2603	沪深 300 股指期货 2603 合约	5.00	6,889,800.00	39,136.36
合计	-	-	-	39,136.36
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	39,136.36
净额	-	-	-	-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的利率/货币/权益/其他衍生工具为国债/外汇/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债/外汇/股指/商品期货投资合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债/外汇/股指/商品期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	68,382.90

应付证券出借违约金	
应付交易费用	
其中：交易所市场	
银行间市场	
应付利息	
预提费用-审计费	21,000.00
其他应付	960.00
合计	90,342.90

7.4.7.7 实收基金

金鹰中证 A500 指数发起 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	287,209,243.92	287,209,243.92
本期申购	34,621,471.13	34,621,471.13
本期赎回（以“-”号填列）	-293,052,805.32	-293,052,805.32
本期末	28,777,909.73	28,777,909.73

金鹰中证 A500 指数发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	23,751,423.67	23,751,423.67
本期申购	15,174,676.71	15,174,676.71
本期赎回（以“-”号填列）	-24,887,339.00	-24,887,339.00
本期末	14,038,761.38	14,038,761.38

金鹰中证 A500 指数发起 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
----	---------------------------------------	--

	基金份额（份）	账面金额
本期申购	197,776,957.17	197,776,957.17
本期赎回（以“-”号填列）	-35,363,876.13	-35,363,876.13
本期末	162,413,081.04	162,413,081.04

金鹰中证 A500 指数发起 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
本期申购	3,902,856.71	3,902,856.71
本期赎回（以“-”号填列）	-3,836,042.14	-3,836,042.14
本期末	66,814.57	66,814.57

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

金鹰中证 A500 指数发起 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	5,136,424.60	2,661,359.08	7,797,783.68
本期基金份额交易产生的变动数	-1,211,426.45	-3,840,298.03	-5,051,724.48
其中：基金申购款	3,112,528.53	-745,053.98	2,367,474.55
基金赎回款	-4,323,954.98	-3,095,244.05	-7,419,199.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,924,998.15	-1,178,938.95	2,746,059.20

金鹰中证 A500 指数发起 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	770,529.71	129,853.91	900,383.62
本期基金份额交易产生的	1,121,333.72	-704,470.66	416,863.06

变动数			
其中：基金申购款	1,775,133.68	-834,635.14	940,498.54
基金赎回款	-653,799.96	130,164.48	-523,635.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,891,863.43	-574,616.75	1,317,246.68

金鹰中证 A500 指数发起 B

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	430,545.29	4,334,218.41	4,764,763.70
本期基金份额交易产生的变动数	21,537,201.12	-11,042,476.46	10,494,724.66
其中：基金申购款	26,258,946.57	-12,829,870.60	13,429,075.97
基金赎回款	-4,721,745.45	1,787,394.14	-2,934,351.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	21,967,746.41	-6,708,258.05	15,259,488.36

金鹰中证 A500 指数发起 D

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	15,002.18	132,185.96	147,188.14
本期基金份额交易产生的变动数	-7,115.33	-134,837.19	-141,952.52
其中：基金申购款	373,152.39	-192,684.60	180,467.79
基金赎回款	-380,267.72	57,847.41	-322,420.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,886.85	-2,651.23	5,235.62

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	48,949.19
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	574,822.36
其他	5,964.27
合计	629,735.82

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	62,990,173.83
减：卖出股票成本总额	57,989,727.63
减：交易费用	203,935.10
买卖股票差价收入	4,796,511.10

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	17,284.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,034.16
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	15,249.92

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31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	2,034.16
买卖债券差价收入	-2,034.16

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金报告期无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
期货投资	197,381.30

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	613,561.54
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	613,561.54

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	7,219,757.68
——股票投资	7,218,046.68
——债券投资	1,711.00

——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	39,136.36
——权证投资	-
——期货投资	39,136.36
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	1,276.68
合计	7,257,617.36

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	82,180.93
合计	82,180.93

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	21,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
证券账户开户费	800.00
合计	21,800.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	386,671.62
其中：应支付销售机构的客户维护费	178,294.08
应支付基金管理人的净管理费	208,377.54

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.30% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.30\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	128,890.60

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

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，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	本期 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	金鹰中证 A500 指数发起 A	金鹰中证 A500 指数发起 C	金鹰中证 A500 指数发起 B	金鹰中证 A500 指数发起 D	合计
中国邮政储 蓄银行股份 有限公司	-	831.33	-	-	831.33
金鹰基金管 理有限公司	-	1,066.70	-	-	1,066.70
合计	-	1,898.03	-	-	1,898.03

注：本基金 A 类、B 类、D 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 0.20% 年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

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

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

基金销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月初 5 个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日或不可抗力等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期
----	----

	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日			
	金鹰中证A500指数发起A	金鹰中证A500指数发起C	金鹰中证A500指数发起B	金鹰中证A500指数发起D
基金合同生效日（2025年4月25日）持有的基金份额	10,000,000.00	-	-	-
报告期初持有的基金份额	-	-	-	-
报告期内申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000,000.00	-	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.75%	-	-	-

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰中证 A500 指数发起 A

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 C

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 B

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 D

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	13,888,175.14	48,949.19

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期无在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
002049	紫光国微	2025-12-30	刊登重要公告	78.81	2026-01-15	86.69	4,700.00	355,502.59	370,407.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	拟筹划重大资产重组	272.72	2026-01-05	278.00	3,058.00	872,514.72	833,977.76	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2025 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 8,599,957.00 元，于 2026 年 1 月 5 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

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

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

1、风险管理控制制度

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

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

2、投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

3、监察稽核制度

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

7.4.13.2 信用风险

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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、地方政府债和同业存单。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年12月31日
A-1	-
A-1 以下	-

未评级	-
合计	-

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 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。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 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、地方政府债和同业存单。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年12月31日
AAA	-
AAA 以下	-
未评级	-
合计	-

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末

	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。

7.4.13.3 流动性风险

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

7.4.13.4 市场风险

市场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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	13,888,175.14	-	-	-	13,888,175.14
结算备付金	5,595,436.03	-	-	-	5,595,436.03
存出保证金	4,021,591.68	-	-	-	4,021,591.68
交易性金融资产	10,189,775.12	-	-	203,915,995.59	214,105,770.71
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	29,392.94	29,392.94
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	33,694,977.97	-	-	203,945,388.53	237,640,366.50
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	8,599,957.00	-	-	-	8,599,957.00
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	4,246,108.02	4,246,108.02
应付管理人报酬	-	-	-	54,105.01	54,105.01
应付托管费	-	-	-	18,035.01	18,035.01
应付销售服务费	-	-	-	1,933.41	1,933.41
应交税费	-	-	-	5,288.57	5,288.57
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	90,342.90	90,342.90
负债总计	8,599,957.00	-	-	4,415,812.92	13,015,769.92
利率敏感度缺口	25,095,020.97	-	-	199,529,575.61	224,624,596.58

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-9,387.41
	利率下降 25 个基点	9,426.29

注：本基金于 2025 年 04 月 25 日成立，无上年度数据。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	203,915,995.59	90.78
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	203,915,995.59	90.78

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

金鹰中证 A500 指数发起 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

		2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,077,376.14
	业绩比较基准变动-5%	-1,077,376.14

注：本基金于 2025 年 04 月 25 日成立，无上年度数据。

金鹰中证 A500 指数发起 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 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	525,000.84
	业绩比较基准变动-5%	-525,000.84

注：本基金于 2025 年 04 月 25 日成立，无上年度数据。

金鹰中证 A500 指数发起 B

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	8,702,903.49
	业绩比较基准变动-5%	-8,702,903.49

注：本基金于 2025 年 08 月 5 日起增设 B 类份额，无上年度数据。

金鹰中证 A500 指数发起 D

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	3,351.46
	业绩比较基准变动-5%	-3,351.46

注：本基金于 2025 年 08 月 5 日起增设 D 类份额，无上年度数据。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	202,711,610.83
第二层次	11,394,159.88
第三层次	-
合计	214,105,770.71

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

本基金本报告期无第三层次公允价值余额及变动情况。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	203,915,995.59	85.81
	其中：股票	203,915,995.59	85.81
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,189,775.12	4.29
	其中：债券	10,189,775.12	4.29
	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	19,483,611.17	8.20
8	其他各项资产	4,050,984.62	1.70
9	合计	237,640,366.50	100.00

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

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	1,064,934.00	0.47
B	采矿业	11,935,454.00	5.31
C	制造业	127,960,499.01	56.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,964,215.00	2.21

E	建筑业	3,051,412.00	1.36
F	批发和零售业	1,300,015.00	0.58
G	交通运输、仓储和邮政业	5,561,224.00	2.48
H	住宿和餐饮业	163,791.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,310,418.58	5.48
J	金融业	27,607,406.00	12.29
K	房地产业	1,715,732.00	0.76
L	租赁和商务服务业	2,275,483.00	1.01
M	科学研究和技术服务业	2,282,356.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	428,286.00	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	96,448.00	0.04
Q	卫生和社会工作	572,368.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	383,710.00	0.17
S	综合	242,244.00	0.11
	合计	203,915,995.59	90.78

8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资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	300750	宁德时代	18,900	6,941,214.00	3.09
2	600519	贵州茅台	4,500	6,197,310.00	2.76

3	601318	中国平安	76,100	5,205,240.00	2.32
4	300308	中际旭创	7,900	4,819,000.00	2.15
5	601899	紫金矿业	117,600	4,053,672.00	1.80
6	600036	招商银行	88,400	3,721,640.00	1.66
7	300502	新易盛	7,100	3,059,248.00	1.36
8	000333	美的集团	35,200	2,750,880.00	1.22
9	601166	兴业银行	120,900	2,546,154.00	1.13
10	600900	长江电力	87,400	2,376,406.00	1.06
11	300059	东方财富	90,300	2,093,154.00	0.93
12	002475	立讯精密	36,400	2,064,244.00	0.92
13	688256	寒武纪	1,488	2,017,058.40	0.90
14	600030	中信证券	69,700	2,001,087.00	0.89
15	600276	恒瑞医药	31,900	1,900,283.00	0.85
16	002594	比亚迪	19,400	1,895,768.00	0.84
17	601398	工商银行	231,100	1,832,623.00	0.82
18	300274	阳光电源	10,400	1,778,816.00	0.79
19	688981	中芯国际	14,299	1,756,346.17	0.78
20	601211	国泰海通	80,700	1,658,385.00	0.74
21	603259	药明康德	17,700	1,604,328.00	0.71
22	601288	农业银行	205,200	1,575,936.00	0.70
23	688041	海光信息	6,640	1,490,082.40	0.66
24	000858	五粮液	13,900	1,472,566.00	0.66
25	002371	北方华创	3,100	1,423,148.00	0.63
26	601328	交通银行	190,500	1,381,125.00	0.61
27	600887	伊利股份	45,200	1,292,720.00	0.58
28	000651	格力电器	32,000	1,287,040.00	0.57
29	300476	胜宏科技	4,400	1,265,352.00	0.56
30	603993	洛阳钼业	62,400	1,248,000.00	0.56
31	600000	浦发银行	95,100	1,183,044.00	0.53
32	000725	京东方 A	262,300	1,104,283.00	0.49
33	601816	京沪高铁	209,700	1,079,955.00	0.48
34	600150	中国船舶	32,200	1,070,972.00	0.48
35	603986	兆易创新	4,800	1,028,400.00	0.46
36	600309	万华化学	13,400	1,027,512.00	0.46
37	601601	中国太保	24,400	1,022,604.00	0.46
38	300124	汇川技术	13,500	1,016,955.00	0.45
39	002714	牧原股份	19,500	986,310.00	0.44
40	688008	澜起科技	8,140	958,892.00	0.43
41	601088	中国神华	23,600	955,800.00	0.43
42	600031	三一重工	42,400	895,912.00	0.40
43	603019	中科曙光	10,400	890,656.00	0.40
44	002050	三花智控	16,000	884,960.00	0.39
45	000063	中兴通讯	23,000	870,320.00	0.39
46	601857	中国石油	80,900	842,169.00	0.37

47	600111	北方稀土	18,100	834,772.00	0.37
48	688012	中微公司	3,058	833,977.76	0.37
49	002230	科大讯飞	16,500	829,785.00	0.37
50	300760	迈瑞医疗	4,300	818,935.00	0.36
51	600089	特变电工	36,100	802,142.00	0.36
52	000001	平安银行	69,300	790,713.00	0.35
53	601012	隆基绿能	43,300	788,060.00	0.35
54	002415	海康威视	26,200	781,808.00	0.35
55	002384	东山精密	9,200	778,780.00	0.35
56	000425	徐工机械	67,200	778,176.00	0.35
57	601668	中国建筑	147,600	757,188.00	0.34
58	603501	豪威集团	6,000	755,400.00	0.34
59	600660	福耀玻璃	11,400	738,378.00	0.33
60	603799	华友钴业	10,800	737,208.00	0.33
61	601127	赛力斯	5,800	701,568.00	0.31
62	002463	沪电股份	9,600	701,472.00	0.31
63	600690	海尔智家	26,800	699,212.00	0.31
64	601728	中国电信	110,900	698,670.00	0.31
65	601600	中国铝业	56,600	691,652.00	0.31
66	601919	中远海控	45,000	683,100.00	0.30
67	002028	思源电气	4,400	680,196.00	0.30
68	000100	TCL 科技	148,600	674,644.00	0.30
69	300394	天孚通信	3,300	669,999.00	0.30
70	000338	潍柴动力	38,700	665,640.00	0.30
71	601888	中国中免	7,000	661,920.00	0.29
72	002352	顺丰控股	17,100	655,272.00	0.29
73	600941	中国移动	6,400	646,720.00	0.29
74	600406	国电南瑞	28,700	645,176.00	0.29
75	600028	中国石化	104,100	643,338.00	0.29
76	000792	盐湖股份	22,700	639,232.00	0.28
77	600183	生益科技	8,700	621,267.00	0.28
78	600418	江淮汽车	12,500	618,750.00	0.28
79	000568	泸州老窖	5,300	615,966.00	0.27
80	601766	中国中车	86,900	592,658.00	0.26
81	601225	陕西煤业	27,700	590,564.00	0.26
82	601988	中国银行	102,200	585,606.00	0.26
83	300014	亿纬锂能	8,900	585,264.00	0.26
84	000988	华工科技	7,200	571,176.00	0.25
85	600050	中国联通	111,600	570,276.00	0.25
86	601628	中国人寿	11,900	541,450.00	0.24
87	002027	分众传媒	72,200	532,114.00	0.24
88	002625	光启技术	10,800	526,608.00	0.23
89	600938	中国海油	17,100	516,078.00	0.23
90	688111	金山办公	1,674	514,035.18	0.23

91	002460	赣锋锂业	8,100	509,409.00	0.23
92	601985	中国核电	58,800	508,620.00	0.23
93	002241	歌尔股份	17,700	508,521.00	0.23
94	600547	山东黄金	12,900	499,359.00	0.22
95	600104	上汽集团	32,800	499,216.00	0.22
96	000807	云铝股份	14,900	489,316.00	0.22
97	000977	浪潮信息	7,300	486,180.00	0.22
98	600489	中金黄金	20,800	485,888.00	0.22
99	300033	同花顺	1,500	483,270.00	0.22
100	601689	拓普集团	6,200	478,516.00	0.21
101	000408	藏格矿业	5,600	472,640.00	0.21
102	002709	天赐材料	10,200	472,566.00	0.21
103	600019	宝钢股份	62,200	463,390.00	0.21
104	002837	英维克	4,200	448,938.00	0.20
105	601006	大秦铁路	86,300	445,308.00	0.20
106	002916	深南电路	1,900	441,351.00	0.20
107	603288	海天味业	11,900	440,538.00	0.20
108	300408	三环集团	9,600	439,200.00	0.20
109	688271	联影医疗	3,488	437,744.00	0.19
110	300433	蓝思科技	14,200	429,834.00	0.19
111	300136	信维通信	6,900	427,800.00	0.19
112	002558	巨人网络	9,700	419,913.00	0.19
113	000625	长安汽车	35,400	419,844.00	0.19
114	601100	恒立液压	3,800	417,658.00	0.19
115	600905	三峡能源	102,100	417,589.00	0.19
116	002466	天齐锂业	7,400	409,812.00	0.18
117	002738	中矿资源	5,200	408,460.00	0.18
118	600362	江西铜业	7,400	406,408.00	0.18
119	605499	东鹏饮料	1,500	401,085.00	0.18
120	600438	通威股份	19,300	396,036.00	0.18
121	688072	拓荆科技	1,200	396,000.00	0.18
122	601390	中国中铁	73,100	395,471.00	0.18
123	300450	先导智能	7,800	389,844.00	0.17
124	600118	中国卫星	4,100	389,295.00	0.17
125	600580	卧龙电驱	7,900	387,890.00	0.17
126	601727	上海电气	45,000	387,450.00	0.17
127	600879	航天电子	18,100	385,892.00	0.17
128	600010	包钢股份	161,700	384,846.00	0.17
129	600893	航发动力	9,500	380,285.00	0.17
130	600584	长电科技	10,200	375,156.00	0.17
131	600585	海螺水泥	17,100	373,806.00	0.17
132	600988	赤峰黄金	11,900	371,756.00	0.17
133	002049	紫光国微	4,700	370,407.00	0.16
134	600160	巨化股份	9,600	368,832.00	0.16

135	300015	爱尔眼科	33,300	365,634.00	0.16
136	600115	中国东航	60,800	364,800.00	0.16
137	000538	云南白药	6,340	359,858.40	0.16
138	000426	兴业银锡	10,100	359,560.00	0.16
139	688521	芯原股份	2,600	356,122.00	0.16
140	600436	片仔癀	2,100	354,438.00	0.16
141	600522	中天科技	19,500	353,340.00	0.16
142	002202	金风科技	17,300	352,920.00	0.16
143	000938	紫光股份	14,300	351,780.00	0.16
144	600487	亨通光电	14,100	348,693.00	0.16
145	000630	铜陵有色	57,500	345,575.00	0.15
146	600760	中航沈飞	6,100	342,515.00	0.15
147	300803	指南针	2,600	340,262.00	0.15
148	600346	恒力石化	15,100	340,203.00	0.15
149	600426	华鲁恒升	10,600	333,158.00	0.15
150	601168	西部矿业	11,900	328,916.00	0.15
151	002156	通富微电	8,700	327,990.00	0.15
152	600570	恒生电子	10,800	325,620.00	0.14
153	600549	厦门钨业	7,900	324,374.00	0.14
154	300604	长川科技	3,200	324,192.00	0.14
155	002179	中航光电	9,100	322,504.00	0.14
156	002532	天山铝业	19,900	321,982.00	0.14
157	600795	国电电力	63,700	321,048.00	0.14
158	601669	中国电建	61,500	319,800.00	0.14
159	600048	保利发展	51,300	312,930.00	0.14
160	600415	小商品城	19,600	312,620.00	0.14
161	002353	杰瑞股份	4,400	311,652.00	0.14
162	600066	宇通客车	9,500	310,650.00	0.14
163	600029	南方航空	38,500	308,385.00	0.14
164	600989	宝丰能源	15,700	308,191.00	0.14
165	000933	神火股份	11,200	307,664.00	0.14
166	000157	中联重科	35,500	306,365.00	0.14
167	300442	润泽科技	5,800	306,240.00	0.14
168	002340	格林美	36,500	305,140.00	0.14
169	601058	赛轮轮胎	18,800	304,184.00	0.14
170	600096	云天化	9,100	304,031.00	0.14
171	002074	国轩高科	7,700	301,147.00	0.13
172	300395	菲利华	3,000	300,900.00	0.13
173	000547	航天发展	9,100	300,391.00	0.13
174	688126	沪硅产业	13,700	296,468.00	0.13
175	600143	金发科技	15,100	295,054.00	0.13
176	600176	中国巨石	17,200	294,120.00	0.13
177	600009	上海机场	8,900	291,564.00	0.13
178	000975	山金国际	11,900	289,527.00	0.13

179	002407	多氟多	8,500	288,235.00	0.13
180	002195	岩山科技	40,500	287,145.00	0.13
181	300058	蓝色光标	24,700	284,544.00	0.13
182	300339	润和软件	5,700	282,150.00	0.13
183	601360	三六零	25,000	279,250.00	0.12
184	002851	麦格米特	3,100	279,217.00	0.12
185	300207	欣旺达	10,600	277,190.00	0.12
186	002001	新 和 成	11,000	277,090.00	0.12
187	688036	传音控股	4,076	269,668.16	0.12
188	600219	南山铝业	49,800	267,924.00	0.12
189	600885	宏发股份	8,800	267,520.00	0.12
190	002236	大华股份	14,100	267,054.00	0.12
191	002517	恺英网络	12,200	266,814.00	0.12
192	688120	华海清科	1,772	265,941.76	0.12
193	300418	昆仑万维	6,300	262,710.00	0.12
194	002131	利欧股份	46,500	262,260.00	0.12
195	688002	睿创微纳	2,600	262,080.00	0.12
196	002555	三七互娱	11,100	261,960.00	0.12
197	002436	兴森科技	12,100	256,157.00	0.11
198	002456	欧菲光	24,000	254,880.00	0.11
199	300223	北京君正	2,400	254,496.00	0.11
200	002938	鹏鼎控股	5,000	252,900.00	0.11
201	002920	德赛西威	2,100	252,630.00	0.11
202	601186	中国铁建	32,900	252,343.00	0.11
203	000768	中航西飞	9,900	251,262.00	0.11
204	601111	中国国航	26,800	251,116.00	0.11
205	002493	荣盛石化	21,400	250,594.00	0.11
206	002273	水晶光电	9,900	248,688.00	0.11
207	000963	华东医药	6,300	248,535.00	0.11
208	300751	迈为股份	1,200	247,188.00	0.11
209	000831	中国稀土	5,300	246,132.00	0.11
210	002595	豪迈科技	2,900	245,079.00	0.11
211	002281	光迅科技	3,500	244,825.00	0.11
212	600157	永泰能源	155,800	244,606.00	0.11
213	002008	大族激光	5,900	243,021.00	0.11
214	600673	东阳光	10,800	242,244.00	0.11
215	600895	张江高科	5,500	241,450.00	0.11
216	600196	复星医药	9,100	241,059.00	0.11
217	002252	上海莱士	37,900	240,286.00	0.11
218	600839	四川长虹	26,400	240,240.00	0.11
219	688122	西部超导	3,200	238,656.00	0.11
220	002812	恩捷股份	4,200	237,888.00	0.11
221	002130	沃尔核材	9,000	236,880.00	0.11
222	600460	士兰微	8,300	235,803.00	0.10

223	002422	科伦药业	8,000	234,800.00	0.10
224	600011	华能国际	31,400	234,244.00	0.10
225	002601	龙佰集团	11,900	233,002.00	0.10
226	002472	双环传动	4,900	232,309.00	0.10
227	600372	中航机载	17,300	232,166.00	0.10
228	600745	闻泰科技	6,200	231,136.00	0.10
229	300390	天华新能	4,200	229,362.00	0.10
230	688169	石头科技	1,500	228,090.00	0.10
231	301236	软通动力	4,800	227,664.00	0.10
232	600741	华域汽车	11,300	226,000.00	0.10
233	000002	万 科 A	48,600	225,990.00	0.10
234	600886	国投电力	17,200	225,664.00	0.10
235	605117	德业股份	2,600	224,120.00	0.10
236	002465	海格通信	14,200	223,650.00	0.10
237	002128	电投能源	8,000	223,280.00	0.10
238	603129	春风动力	800	222,944.00	0.10
239	001979	招商蛇口	25,800	222,912.00	0.10
240	688777	中控技术	4,500	222,030.00	0.10
241	300782	卓胜微	2,700	219,996.00	0.10
242	600699	均胜电子	7,000	219,520.00	0.10
243	601868	中国能建	92,600	217,610.00	0.10
244	600515	海南机场	40,800	217,464.00	0.10
245	600392	盛和资源	10,000	215,300.00	0.10
246	688235	百济神州	800	214,880.00	0.10
247	601877	正泰电器	7,700	214,753.00	0.10
248	301358	湖南裕能	3,300	213,378.00	0.09
249	000661	长春高新	2,300	212,865.00	0.09
250	300661	圣邦股份	3,100	212,784.00	0.09
251	002648	卫星化学	12,000	212,160.00	0.09
252	003816	中国广核	56,200	211,312.00	0.09
253	300759	康龙化成	7,400	210,382.00	0.09
254	300346	南大光电	4,900	210,210.00	0.09
255	300347	泰格医药	3,700	209,790.00	0.09
256	688099	晶晨股份	2,400	209,352.00	0.09
257	601800	中国交建	25,400	209,296.00	0.09
258	601021	春秋航空	3,500	208,250.00	0.09
259	603659	璞泰来	7,600	207,784.00	0.09
260	601872	招商轮船	23,100	207,438.00	0.09
261	300454	深信服	1,800	207,288.00	0.09
262	002138	顺络电子	5,800	206,074.00	0.09
263	000301	东方盛虹	18,900	205,821.00	0.09
264	603979	金诚信	2,700	205,605.00	0.09
265	000878	云南铜业	10,000	205,100.00	0.09
266	601319	中国人保	22,800	204,060.00	0.09

267	300054	鼎龙股份	5,400	203,040.00	0.09
268	002497	雅化集团	8,200	202,950.00	0.09
269	601633	长城汽车	8,900	201,407.00	0.09
270	688396	华润微	3,800	200,868.00	0.09
271	002185	华天科技	18,300	200,751.00	0.09
272	600233	圆通速递	12,200	200,324.00	0.09
273	000066	中国长城	13,800	198,858.00	0.09
274	600352	浙江龙盛	18,600	198,276.00	0.09
275	002294	信立泰	4,000	198,200.00	0.09
276	002129	TCL 中环	23,100	197,967.00	0.09
277	000960	锡业股份	7,100	197,948.00	0.09
278	688578	艾力斯	1,900	197,885.00	0.09
279	601117	中国化学	26,200	197,286.00	0.09
280	300037	新宙邦	3,700	193,880.00	0.09
281	688506	百利天恒	600	193,860.00	0.09
282	600588	用友网络	14,600	193,596.00	0.09
283	600674	川投能源	13,900	193,210.00	0.09
284	300724	捷佳伟创	2,000	191,200.00	0.09
285	600141	兴发集团	5,500	190,190.00	0.08
286	688213	思特威	2,000	190,180.00	0.08
287	002078	太阳纸业	12,000	189,000.00	0.08
288	300474	景嘉微	2,600	186,862.00	0.08
289	601615	明阳智能	12,900	186,792.00	0.08
290	600039	四川路桥	18,600	185,070.00	0.08
291	688047	龙芯中科	1,400	184,954.00	0.08
292	002271	东方雨虹	13,600	184,824.00	0.08
293	000786	北新建材	7,300	182,281.00	0.08
294	688608	恒玄科技	800	181,552.00	0.08
295	300017	网宿科技	17,600	180,400.00	0.08
296	600498	烽火通信	5,600	179,648.00	0.08
297	300073	当升科技	3,100	179,180.00	0.08
298	002414	高德红外	12,200	178,974.00	0.08
299	601233	桐昆股份	10,300	177,263.00	0.08
300	603087	甘李药业	2,600	176,982.00	0.08
301	300496	中科创达	2,600	175,500.00	0.08
302	000617	中油资本	18,100	173,760.00	0.08
303	002444	巨星科技	5,100	173,502.00	0.08
304	603606	东方电缆	2,900	173,275.00	0.08
305	688017	绿的谐波	900	172,890.00	0.08
306	300316	晶盛机电	4,700	172,725.00	0.08
307	300251	光线传媒	10,500	171,990.00	0.08
308	300866	安克创新	1,500	171,585.00	0.08
309	002085	万丰奥威	10,600	169,706.00	0.08
310	300748	金力永磁	4,900	167,139.00	0.07

311	601179	中国西电	18,300	166,530.00	0.07
312	302132	中航成飞	2,100	165,900.00	0.07
313	600482	中国动力	8,000	165,600.00	0.07
314	002155	湖南黄金	7,800	164,502.00	0.07
315	002223	鱼跃医疗	4,300	164,303.00	0.07
316	300699	光威复材	4,160	164,153.60	0.07
317	300757	罗博特科	700	163,310.00	0.07
318	300012	华测检测	12,000	162,600.00	0.07
319	002459	晶澳科技	14,200	162,590.00	0.07
320	300024	机器人	8,900	161,891.00	0.07
321	300002	神州泰岳	14,000	161,280.00	0.07
322	688223	晶科能源	28,551	161,027.64	0.07
323	002624	完美世界	9,800	160,622.00	0.07
324	300122	智飞生物	8,500	160,395.00	0.07
325	000034	神州数码	4,100	159,531.00	0.07
326	600085	同仁堂	4,900	158,074.00	0.07
327	688472	阿特斯	10,600	158,046.00	0.07
328	600497	驰宏锌锗	21,600	157,896.00	0.07
329	300832	新产业	2,800	157,500.00	0.07
330	600256	广汇能源	32,000	157,440.00	0.07
331	002064	华峰化学	14,300	157,300.00	0.07
332	000423	东阿阿胶	3,200	157,056.00	0.07
333	300285	国瓷材料	5,700	156,237.00	0.07
334	300896	爱美客	1,100	155,892.00	0.07
335	688599	天合光能	9,300	153,915.00	0.07
336	603596	伯特利	3,000	153,810.00	0.07
337	002405	四维图新	17,000	153,170.00	0.07
338	300919	中伟股份	3,300	152,889.00	0.07
339	601618	中国中冶	51,000	151,470.00	0.07
340	600765	中航重机	7,900	151,364.00	0.07
341	002410	广联达	11,800	148,444.00	0.07
342	002409	雅克科技	2,000	148,200.00	0.07
343	300568	星源材质	9,700	147,925.00	0.07
344	001965	招商公路	14,600	147,168.00	0.07
345	000733	振华科技	2,800	146,748.00	0.07
346	002756	永兴材料	2,700	146,475.00	0.07
347	002065	东华软件	16,000	146,400.00	0.07
348	688617	惠泰医疗	600	145,962.00	0.06
349	002245	蔚蓝锂芯	8,200	145,960.00	0.06
350	300003	乐普医疗	9,200	145,452.00	0.06
351	002180	纳思达	7,100	143,562.00	0.06
352	601607	上海医药	8,000	142,880.00	0.06
353	002318	久立特材	4,900	141,855.00	0.06
354	600637	东方明珠	14,400	141,840.00	0.06

355	600862	中航高科	6,000	141,780.00	0.06
356	300972	万辰集团	700	140,749.00	0.06
357	600026	中远海能	11,900	138,992.00	0.06
358	000932	华菱钢铁	24,700	138,814.00	0.06
359	000683	博源化工	18,600	138,384.00	0.06
360	600803	新奥股份	6,600	137,016.00	0.06
361	000999	华润三九	4,800	136,608.00	0.06
362	300627	华测导航	3,900	136,149.00	0.06
363	300001	特锐德	5,300	136,104.00	0.06
364	000830	鲁西化工	8,200	135,874.00	0.06
365	605589	圣泉集团	4,800	135,840.00	0.06
366	000039	中集集团	13,200	133,188.00	0.06
367	300438	鹏辉能源	2,500	133,050.00	0.06
368	000623	吉林敖东	6,800	132,804.00	0.06
369	300413	芒果超媒	5,400	131,868.00	0.06
370	603260	合盛硅业	2,500	131,750.00	0.06
371	601677	明泰铝业	8,900	131,631.00	0.06
372	000400	许继电气	5,100	131,121.00	0.06
373	002821	凯莱英	1,400	130,102.00	0.06
374	000887	中鼎股份	5,600	129,976.00	0.06
375	688266	泽璟制药	1,400	129,780.00	0.06
376	603486	科沃斯	1,600	129,088.00	0.06
377	601238	广汽集团	15,800	128,928.00	0.06
378	300383	光环新网	10,300	128,853.00	0.06
379	688180	君实生物	3,768	128,714.88	0.06
380	300628	亿联网络	3,600	128,340.00	0.06
381	300567	精测电子	1,400	127,680.00	0.06
382	600521	华海药业	7,500	127,275.00	0.06
383	000009	中国宝安	12,900	127,065.00	0.06
384	600845	宝信软件	6,100	126,331.00	0.06
385	300142	沃森生物	11,500	125,465.00	0.06
386	600177	雅戈尔	16,500	125,400.00	0.06
387	688065	凯赛生物	2,500	124,500.00	0.06
388	603568	伟明环保	4,900	124,362.00	0.06
389	688005	容百科技	3,500	123,900.00	0.06
390	600704	物产中大	22,200	123,654.00	0.06
391	601799	星宇股份	1,000	123,370.00	0.05
392	002152	广电运通	8,900	122,909.00	0.05
393	688303	大全能源	4,532	121,548.24	0.05
394	300763	锦浪科技	1,700	121,397.00	0.05
395	603392	万泰生物	2,700	121,338.00	0.05
396	002739	万达电影	10,600	119,992.00	0.05
397	000738	航发控制	5,600	119,336.00	0.05
398	002841	视源股份	3,000	118,890.00	0.05

399	002176	江特电机	12,200	118,828.00	0.05
400	002044	美年健康	22,400	118,272.00	0.05
401	002007	华兰生物	7,800	118,014.00	0.05
402	600486	扬农化工	1,700	117,963.00	0.05
403	000708	中信特钢	7,200	117,864.00	0.05
404	600208	衢州发展	30,400	117,648.00	0.05
405	002389	航天彩虹	4,900	117,502.00	0.05
406	603605	珀莱雅	1,700	116,416.00	0.05
407	601216	君正集团	24,100	116,162.00	0.05
408	600161	天坛生物	7,100	116,014.00	0.05
409	300459	汤姆猫	25,100	115,209.00	0.05
410	601567	三星医疗	5,000	115,100.00	0.05
411	600153	建发股份	12,400	114,700.00	0.05
412	600516	方大炭素	20,100	114,369.00	0.05
413	600499	科达制造	8,200	113,734.00	0.05
414	300253	卫宁健康	12,700	112,014.00	0.05
415	300083	创世纪	11,900	109,599.00	0.05
416	000519	中兵红箭	6,000	109,260.00	0.05
417	688188	柏楚电子	800	108,712.00	0.05
418	600316	洪都航空	3,100	108,221.00	0.05
419	300088	长信科技	17,800	107,868.00	0.05
420	603816	顾家家居	3,500	107,590.00	0.05
421	000415	渤海租赁	26,500	107,325.00	0.05
422	600563	法拉电子	1,000	104,950.00	0.05
423	600038	中直股份	2,900	104,777.00	0.05
424	603806	福斯特	7,500	104,700.00	0.05
425	600398	海澜之家	17,200	104,060.00	0.05
426	688166	博瑞医药	2,100	103,026.00	0.05
427	000629	钒钛股份	33,200	102,920.00	0.05
428	002603	以岭药业	6,000	102,420.00	0.05
429	600820	隧道股份	15,700	101,893.00	0.05
430	688009	中国通号	18,500	101,195.00	0.05
431	600170	上海建工	38,100	100,965.00	0.04
432	601018	宁波港	27,800	100,914.00	0.04
433	600312	平高电气	5,800	100,630.00	0.04
434	002025	航天电器	2,000	100,260.00	0.04
435	600323	瀚蓝环境	3,500	100,100.00	0.04
436	002544	普天科技	2,900	100,021.00	0.04
437	603077	和邦生物	44,200	99,892.00	0.04
438	300068	南都电源	6,400	99,456.00	0.04
439	600166	福田汽车	33,900	98,988.00	0.04
440	002607	中公教育	35,200	96,448.00	0.04
441	300118	东方日升	6,500	95,290.00	0.04
442	300676	华大基因	2,100	95,256.00	0.04

443	600008	首创环保	31,500	94,500.00	0.04
444	600529	山东药玻	4,700	93,671.00	0.04
445	603939	益丰药房	4,300	93,396.00	0.04
446	002145	钛能化学	19,000	93,100.00	0.04
447	603885	吉祥航空	6,200	92,256.00	0.04
448	600998	九州通	18,000	92,160.00	0.04
449	002432	九安医疗	2,300	92,092.00	0.04
450	300144	宋城演艺	11,200	91,728.00	0.04
451	601155	新城控股	6,500	90,675.00	0.04
452	002244	滨江集团	8,900	89,445.00	0.04
453	002312	川发龙蟒	8,100	88,533.00	0.04
454	600763	通策医疗	2,200	88,462.00	0.04
455	600859	王府井	5,600	86,968.00	0.04
456	300573	兴齐眼药	1,200	84,348.00	0.04
457	601880	辽港股份	52,600	84,160.00	0.04
458	300558	贝达药业	1,800	84,042.00	0.04
459	600667	太极实业	10,500	83,685.00	0.04
460	600754	锦江酒店	3,300	83,391.00	0.04
461	601000	唐山港	21,200	81,408.00	0.04
462	600816	建元信托	28,700	81,221.00	0.04
463	600004	白云机场	8,500	80,410.00	0.04
464	600258	首旅酒店	4,800	80,400.00	0.04
465	600535	天士力	5,300	79,871.00	0.04
466	603650	彤程新材	1,800	79,452.00	0.04
467	000032	深桑达 A	4,100	79,335.00	0.04
468	000998	隆平高科	8,400	78,624.00	0.04
469	300457	赢合科技	2,800	77,980.00	0.03
470	600511	国药股份	2,700	77,625.00	0.03
471	002266	浙富控股	18,600	77,376.00	0.03
472	002701	奥瑞金	12,800	76,160.00	0.03
473	601966	玲珑轮胎	5,200	75,556.00	0.03
474	688390	固德威	1,200	74,556.00	0.03
475	000818	航锦科技	3,800	73,340.00	0.03
476	600655	豫园股份	13,900	71,307.00	0.03
477	000069	华侨城 A	28,700	71,176.00	0.03
478	300601	康泰生物	4,800	70,896.00	0.03
479	603899	晨光股份	2,600	70,356.00	0.03
480	601866	中远海发	27,900	70,308.00	0.03
481	002120	韵达股份	10,400	70,096.00	0.03
482	600867	通化东宝	8,400	68,628.00	0.03
483	688063	派能科技	1,200	68,184.00	0.03
484	603833	欧派家居	1,300	67,717.00	0.03
485	300529	健帆生物	3,400	66,878.00	0.03
486	600325	华发股份	15,700	66,254.00	0.03

487	000967	盈峰环境	9,000	66,060.00	0.03
488	000035	中国天楹	11,900	65,688.00	0.03
489	002091	江苏国泰	7,000	63,210.00	0.03
490	300070	碧水源	15,500	60,760.00	0.03
491	600864	哈投股份	8,900	59,007.00	0.03
492	002891	中宠股份	1,100	56,936.00	0.03
493	002572	索菲亚	4,100	55,801.00	0.02
494	002292	奥飞娱乐	6,300	55,755.00	0.02
495	001914	招商积余	3,000	32,040.00	0.01
496	600007	中国国贸	1,400	27,748.00	0.01

8.3.2 期末积极投资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

本基金本报告期内未进行股票的积极投资。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	8,807,024.03	3.92
2	600519	贵州茅台	8,442,576.00	3.76
3	601318	中国平安	5,876,308.00	2.62
4	600036	招商银行	4,900,903.00	2.18
5	300308	中际旭创	4,374,583.00	1.95
6	601899	紫金矿业	4,094,745.00	1.82
7	000333	美的集团	3,608,591.00	1.61
8	601166	兴业银行	3,226,370.00	1.44
9	600900	长江电力	3,072,939.00	1.37
10	300059	东方财富	2,872,584.01	1.28
11	300502	新易盛	2,684,378.00	1.20
12	600276	恒瑞医药	2,579,473.00	1.15
13	601398	工商银行	2,547,283.00	1.13
14	002475	立讯精密	2,508,602.00	1.12
15	600030	中信证券	2,499,020.00	1.11
16	002594	比亚迪	2,428,784.00	1.08
17	688256	寒武纪	2,333,751.40	1.04
18	688041	海光信息	2,221,438.21	0.99
19	601288	农业银行	2,194,698.00	0.98

20	600887	伊利股份	2,175,456.00	0.97
----	--------	------	--------------	------

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,002,467.00	0.89
2	600519	贵州茅台	1,873,102.00	0.83
3	601318	中国平安	1,387,742.00	0.62
4	600919	江苏银行	1,291,532.00	0.57
5	688041	海光信息	1,125,673.64	0.50
6	688256	寒武纪	1,120,350.24	0.50
7	600036	招商银行	1,072,713.00	0.48
8	601899	紫金矿业	913,258.00	0.41
9	600887	伊利股份	885,191.00	0.39
10	000333	美的集团	881,913.00	0.39
11	300308	中际旭创	757,131.00	0.34
12	002415	海康威视	708,028.00	0.32
13	600276	恒瑞医药	686,885.00	0.31
14	300059	东方财富	666,556.00	0.30
15	601398	工商银行	665,171.00	0.30
16	300124	汇川技术	652,160.00	0.29
17	002475	立讯精密	632,740.20	0.28
18	688981	中芯国际	620,936.24	0.28
19	601166	兴业银行	617,751.00	0.28
20	300502	新易盛	599,155.00	0.27

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	254,687,676.54
卖出股票收入（成交）总额	62,990,173.83

注：“买入股票成本”或“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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	10,189,775.12	4.54
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	10,189,775.12	4.54

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

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	019773	25 国债 08	71,000.00	7,171,684.71	3.19
2	019785	25 国债 13	30,000.00	3,018,090.41	1.34

注：本基金本报告期末仅持有 2 只债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃和金融衍生品合约进行交易，以对冲投资组合的风险、有效管理现金流量或降低建仓或调仓过程中的冲击成本等。本报告期内，本基金投资股指期货符合既定的投资政策和投资目的。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

无。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

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

8.12.2 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。

8.12.3 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	4,021,591.68
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	29,392.94

6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,050,984.62

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰中证 A500 指数发起 A	363	79,277.99	10,000,000.00	34.75%	18,777,909.73	65.25%
金鹰中证 A500 指数发起 C	203	69,156.46	9,396,342.07	66.93%	4,642,419.31	33.07%
金鹰中证 A500 指	1,495	108,637.51	-	-	162,413,081	100.00%

数发起 B					.04	
金鹰中证 A500 指数发起 D	28	2,386.23	-	-	66,814.57	100.00%
合计	2,089	98,275.04	19,396,342.07	9.45%	185,900,224.65	90.55%

9.2 期末上市基金前十名持有人

本基金非上市基金。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	金鹰中证 A500 指数发起 A	0.00	0.00%
	金鹰中证 A500 指数发起 C	98,261.49	0.70%
	金鹰中证 A500 指数发起 B	19.88	0.00%
	金鹰中证 A500 指数发起 D	19.88	0.03%
	合计	98,301.25	0.05%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰中证 A500 指数发起 A	0
	金鹰中证 A500 指数发起 C	0
	金鹰中证 A500 指数发起 B	0
	金鹰中证 A500 指数发起 D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰中证 A500 指数发起 A	0

	金鹰中证 A500 指数发起 C	0
	金鹰中证 A500 指数发起 B	0
	金鹰中证 A500 指数发起 D	0
	合计	0

9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	4.87%	10,000,000.00	4.87%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	4.87%	10,000,000.00	4.87%	-

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰中证 A500 指数发起 A	金鹰中证 A500 指数发起 C	金鹰中证 A500 指数发起 B	金鹰中证 A500 指数发起 D
基金合同生效日（2025 年 4 月 25 日）基金份额总额	287,209,243.92	23,751,423.67	-	-
基金合同生效日起至报告期末基	34,621,471.13	15,174,676.71	197,776,957.17	3,902,856.71

金总申购份 额				
减：基金合同 生效日起至 报告期期末 基金总赎回 份额	293,052,805.32	24,887,339.00	35,363,876.13	3,836,042.14
基金合同生 效日起至报 告期期末基 金拆分变动 份额	-	-	-	-
本报告期期 末基金份额 总额	28,777,909.73	14,038,761.38	162,413,081.04	66,814.57

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本基金报告期内无涉及基金管理人、基金财产。

本报告期内，无涉及本基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本基金报告期内没有改变基金投资策略。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金管理人于 2025 年 5 月 23 日改聘立信会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，大华会计师事务所（特殊普通合伙）不再为本基金提供审计服务。详情请查阅相关公告。

本报告期内实际应支付会计师事务所的审计费为 21000 元，该事务所已向本基金提供 1 年的审计服务。

11.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.7.1 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。

11.7.2 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。

11.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
山西证券	2	-	-	7,809.67	3.84%	-
浙商证券	2	210,573,951.54	66.29%	70,426.67	34.61%	-

中邮证券	2	107,103,898.83	33.71%	125,267.50	61.56%	-
------	---	----------------	--------	------------	--------	---

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。

11.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
山西证券	-	-	535,932,000.00	12.02%	-	-
浙商证券	-	-	2,951,300,000.00	66.19%	-	-
中邮证券	10,101,019.00	100.00%	971,790,000.00	21.79%	-	-

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	证监会规定媒介	2025-03-28
2	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金招募说明书	证监会规定媒介	2025-03-28
3	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 A)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-03-28
4	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 C)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-03-28
5	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金托管协议	证监会规定媒介	2025-03-28
6	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基	证监会规定媒介	2025-03-28

	金份额发售公告		
7	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同	证监会规定媒介	2025-03-28
8	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(2024 年下半年度)	证监会规定媒介	2025-03-31
9	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2025-04-07
10	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2025-04-08
11	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金新增代销机构的公告	证监会规定媒介	2025-04-10
12	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金提前结束募集的公告	证监会规定媒介	2025-04-21
13	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	证监会规定媒介	2025-04-26
14	金鹰基金管理有限公司基金改聘会计师事务所公告	证监会规定媒介	2025-05-24
15	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 A)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-05-30
16	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 C)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-05-30
17	金鹰基金管理有限公司关于终止民商基金销售(上海)有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2025-05-30
18	金鹰基金管理有限公司部分基金新增腾安基金销售(深圳)有限公司为代销机构并开通基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-06-11
19	金鹰基金管理有限公司金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金开放日常申购(赎回、转换、定期定额投资)业务公告	证监会规定媒介	2025-07-03
20	金鹰基金管理有限公司部分基金新增英大证券有限责任公司为代销机构开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-07-04
21	金鹰基金管理有限公司新增华宝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	2025-07-11
22	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第二季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2025-07-21

23	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 2025 年第二季度报告	证监会规定媒介	2025-07-21
24	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与浙江同花顺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	2025-07-21
25	金鹰基金管理有限公司部分基金新增广州经传多赢投资咨询有限公司为代销机构开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-07-29
26	关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金新增 B 类、D 类基金份额并修改基金合同及托管协议的公告	证监会规定媒介	2025-08-05
27	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金托管协议更新	证监会规定媒介	2025-08-05
28	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同更新	证监会规定媒介	2025-08-05
29	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2025-08-07
30	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 (金鹰中证 A500 指数发起 A)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-08-07
31	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 (金鹰中证 A500 指数发起 B)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-08-07
32	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 (金鹰中证 A500 指数发起 D)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-08-07
33	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 (金鹰中证 A500 指数发起 C)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-08-07
34	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2025-08-29
35	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 2025 年中期报告	证监会规定媒介	2025-08-30
36	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年中期报告提示性公告	证监会规定媒介	2025-08-30
37	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2025-09-03
38	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与泰信财富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	2025-09-09
39	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 D 类份额新增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	2025-09-12

40	金鹰基金管理有限公司关于金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 B、D 类份额新增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	2025-09-12
41	金鹰基金管理有限公司新增华龙证券股份有限公司为金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 B、D 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	2025-09-17
42	金鹰基金管理有限公司新增广州经传多赢投资咨询有限公司为金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 D 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	2025-09-24
43	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金招募说明书更新	证监会规定媒介	2025-09-26
44	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2025-09-26
45	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 B)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-09-26
46	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 D)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-09-26
47	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金(金鹰中证 A500 指数发起 C)基金产品资料概要	证监会规定媒介	2025-09-26
48	金鹰基金管理有限公司部分基金新增深圳腾元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	2025-10-24
49	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第三季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2025-10-28
50	金鹰基金管理有限公司部分基金新增北京广源达信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	2025-10-28
51	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 2025 年第三季度报告	证监会规定媒介	2025-10-28
52	金鹰基金管理有限公司关于“金鹰基金”APP 业务迁移的公告	证监会规定媒介	2025-11-03
53	金鹰基金管理有限公司部分基金新增上海长量基金销售有限公司为代销机构开通基金转换、基金定投业务及费率优惠的公告	证监会规定媒介	2025-11-10
54	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2025-11-27
55	金鹰基金管理有限公司关于终止北京微动利	证监会规定媒介	2025-11-28

	基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告		
56	金鹰基金管理有限公司关于终止方正中期期货有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2025-11-28
57	金鹰基金管理有限公司部分基金新增易方达财富管理基金销售(广州)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	2025-12-08

注：相关信息披露文件可登录本基金管理人网站查询。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250829-20251104	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	4.87%
个人	1	20251009-20251009	5,499,000.00	25,464,466.49	21,589,661.08	9,373,805.41	4.57%

产品特有风险

本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：

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

拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的 50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于 2025 年 8 月 5 日起增加 B 类、D 类基金份额，详情请查阅相关公告。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准基金发行及募集的文件。
- 2、《金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金基金合同》。
- 3、《金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金托管协议》。
- 4、金鹰基金管理有限公司批准成立批件和营业执照。
- 5、基金托管人业务资格批件和营业执照。
- 6、本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

13.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层。

13.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二六年三月三十一日