

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

2026 年第 1 季度报告

2026 年 3 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

报告送出日期：二〇二六年四月二十二日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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 4 月 21 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

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 3 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	金鹰中证 A500 指数发起
基金主代码	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
报告期末基金份额总额	679,910,310.75 份
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>			
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			
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	15,664,525.98 份	20,018,045.85 份	18,177,375.04 份	626,050,363.88 份

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2026 年 1 月 1 日-2026 年 3 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
1. 本期已实现 收益	2,237,284.75	1,587,268.55	8,029,114.98	-448,626.29
2. 本期利润	566,484.52	-203,257.90	5,688,565.71	-16,059,682. 27
3. 加权平均基 金份额本期利 润	0.0351	-0.0151	0.1550	-0.2227
4. 期末基金资 产净值	17,093,173.14	21,801,010.29	19,808,079.6 9	672,491,064. 11
5. 期末基金份 额净值	1.0912	1.0891	1.0897	1.0742

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、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 本报告期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	净值增长 率①	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	-0.38%	1.09%	-1.93%	1.08%	1.55%	0.01%
过去六个 月	-0.41%	1.03%	-1.51%	1.04%	1.10%	-0.01%
自基金合	9.12%	0.83%	23.33%	0.93%	-14.21%	-0.10%

同生效起至今						
--------	--	--	--	--	--	--

金鹰中证 A500 指数发起 C

阶段	净值增长率①	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	-0.43%	1.09%	-1.93%	1.08%	1.50%	0.01%
过去六个月	-0.51%	1.03%	-1.51%	1.04%	1.00%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.91%	0.83%	23.33%	0.93%	-14.42%	-0.10%

金鹰中证 A500 指数发起 B

阶段	净值增长率①	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	-0.39%	1.09%	-1.93%	1.08%	1.54%	0.01%
过去六个月	-0.49%	1.03%	-1.51%	1.04%	1.02%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.42%	1.00%	14.08%	1.05%	-5.66%	-0.05%

金鹰中证 A500 指数发起 D

阶段	净值增长率①	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	-0.39%	1.09%	-1.93%	1.08%	1.54%	0.01%
过去六个月	-1.99%	1.02%	-1.51%	1.04%	-0.48%	-0.02%
自基金合同生效起至今	6.87%	1.00%	14.08%	1.05%	-7.21%	-0.05%

注：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

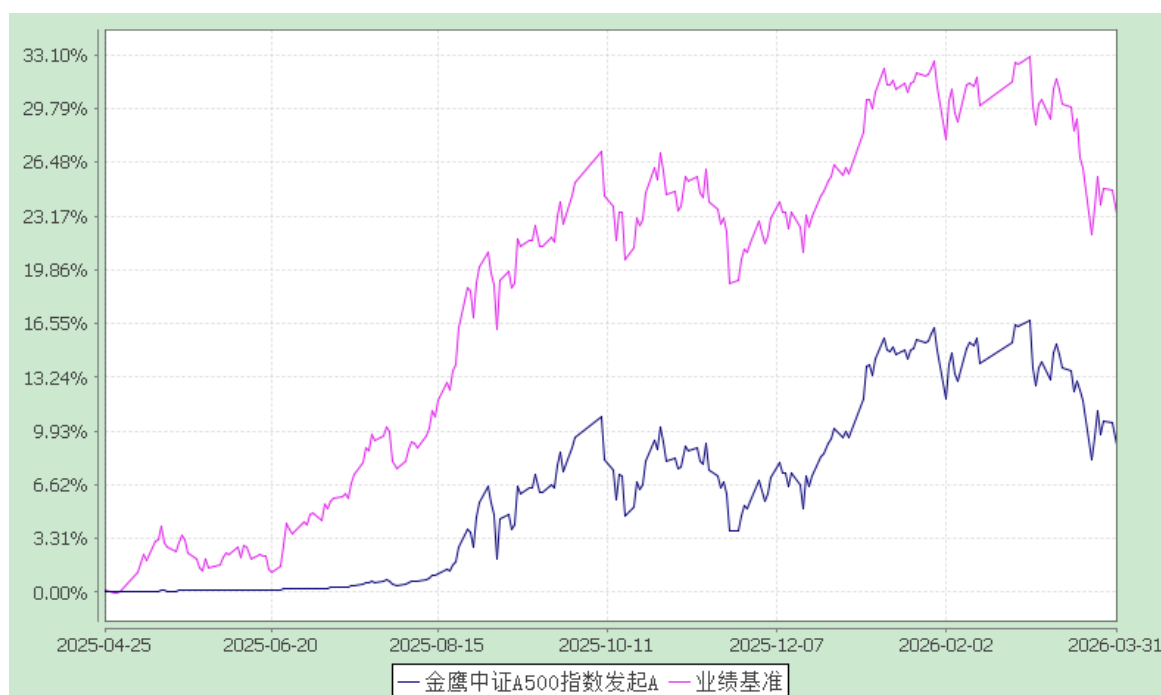
额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日。

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
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2025 年 4 月 25 日至 2026 年 3 月 31 日)

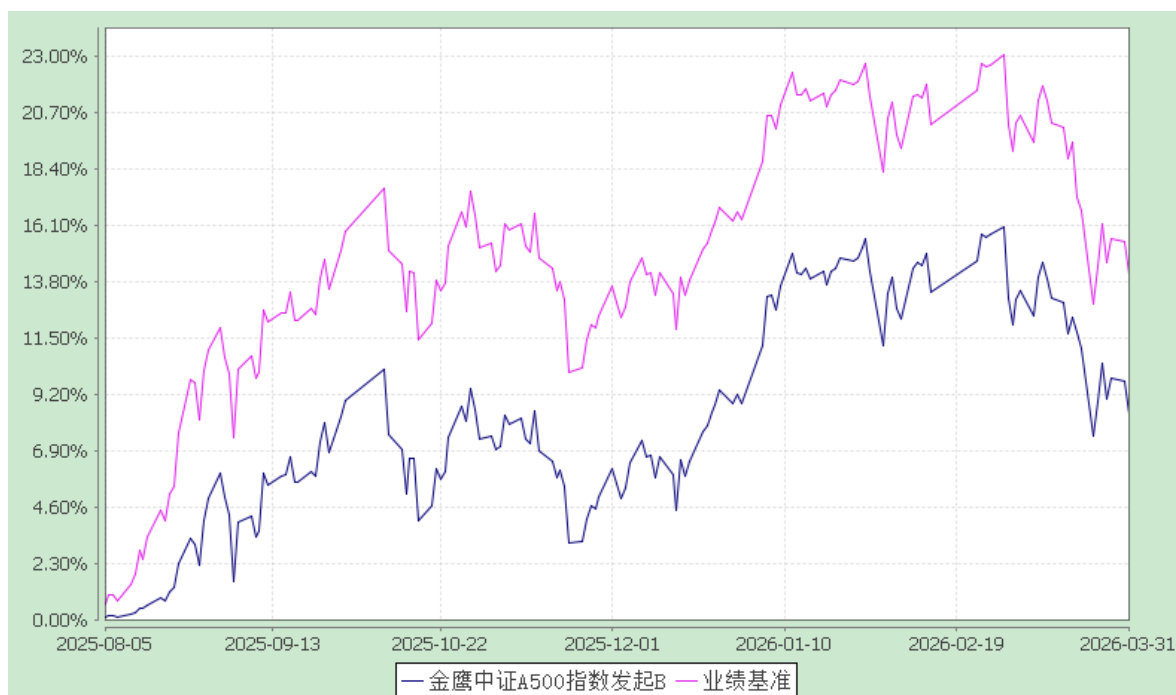
金鹰中证 A500 指数发起 A



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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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。
--	--	--	--	--	--

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，“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遵规守信情况的说明

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，严格遵守本基金基金合同等法律文件的规定，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 公平交易专项说明

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。

公司通过规范的投资交易流程、完善的权限管理机制、有效的交易控制制度，确保公平交易的实施。同时通过投资交易系统内的公平交易功能执行交易，不断强化事后监控分析，以尽可能确保公平对待各投资组合。

报告期，公司对不同时间窗下（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 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年一季度，A 股市场整体表现为 3800-4200 点之间的区间震荡行情。其中：开年后，国内经济呈持续温和修复态势，市场风偏一度维持较高水平，流动性驱动下跨年行情及春季躁动延续，市场热点主要围绕各类主题展开并快速轮动；2 月底美以伊战事爆发后，全球风偏受到极大冲击，A 股市场逐级下台阶并最终将年初以来涨幅基本抹掉，投资者在观望中等待转机。

A 股市场主要指数层面看，上证指数、沪深 300 指数及创业板指数一季度涨幅分别为-1.94%、-3.89%和-0.757%。同期，恒生指数跌 3.29%。而申万一级行业方面，煤炭、有色、综合、公用和建材季度涨幅排名靠前，涨幅分别为 18.83%、15.36%、13.67%、9.21%和 8.18%，非银、商贸、美护、计算机和地产等季度跌幅居前，分别为-14.98%、-14.43%、-8.93%、-7.61%和-7.50%，行业间涨跌分化仍然较大。

海外层面，新年伊始美国跨境抓捕委内瑞拉总统的“黑天鹅”事件，暗示着地缘风险或已一跃成为今年最大的系统性风险，2 月底美以伊战争这只“灰犀牛”的骤然爆发，更令全球市场的风险偏好受到重大打击，全球多数重要市场也因此而遭遇较大的波动和挫折。一季度，布伦特原油上涨 79.25%并引领商品强势，与此同时，欧美股市大多表现不佳。美股方面，道琼斯指数跌 3.58%，纳斯达克指数跌 7.11%，标普 500 指数跌 4.63%。欧洲主要股指中，英国富时 100 指数涨 2.47%，法国 CAC40 指数跌 4.09%，德国 DAX 指数跌 7.39%。

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%。一季度，产品正常开放赎回，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。为精细化组合管理，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，完成了对基准的跟踪。

总体而言，尽管面对地缘冲突加剧导致的市场中短期较大波动，我们对今年中国经济的持续修复及权益市场的积极表现与中长期前景仍继续抱有信心，对代表 A 股各细分行业龙头方向的中证 A500 指数的投资前景同样抱有相对乐观预期。我们将继续以较为积极的心态和谨慎应对的操作来不断审视投资组合，力图通过紧密跟踪标的指数以获取相对稳定的投资收益。

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 1.0912 元，本报告期份额净值增长率为-0.38%，同期业绩比较基准增长率为-1.93%；C 类基金份额净值为 1.0891 元，本报告期份额净值增长率为-0.43%，同期业绩比较基准增长率为-1.93%；B 类份额净值为 1.0897 元，本报告期份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准增长率为-1.93%；D 类基金份额净值为 1.0742 元，本报告期份额净值增长率为-0.39%，同期业绩比较基准增长率为-1.93%。

4.5 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	688,546,304.78	91.86
	其中：股票	688,546,304.78	91.86
2	固定收益投资	37,599,010.28	5.02
	其中：债券	37,599,010.28	5.02
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-

	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	13,121,260.55	1.75
7	其他资产	10,253,775.99	1.37
8	合计	749,520,351.60	100.00

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

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 指数投资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	3,084,851.00	0.42
B	采矿业	43,341,546.00	5.93
C	制造业	439,669,027.94	60.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,526,480.00	2.40
E	建筑业	10,770,872.00	1.47
F	批发和零售业	4,147,812.00	0.57
G	交通运输、仓储和邮政业	19,028,159.00	2.60
H	住宿和餐饮业	548,114.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,881,072.00	5.45
J	金融业	83,440,395.40	11.41
K	房地产业	5,148,214.00	0.70
L	租赁和商务服务业	7,567,031.00	1.03
M	科学研究和技术服务业	8,223,677.00	1.12
N	水利、环境和公共设施管理业	1,526,221.00	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	317,806.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,847,295.00	0.25

R	文化、体育和娱乐业	1,209,417.00	0.17
S	综合	1,121,100.00	0.15
	合计	688,399,090.34	94.15

5.2.1.2 积极投资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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	146,599.22	0.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	615.22	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	147,214.44	0.02

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	65,000	26,110,500.00	3.57
2	600519	贵州茅台	15,400	22,330,000.00	3.05
3	300308	中际旭创	27,300	15,544,893.00	2.13
4	601318	中国平安	262,000	14,876,360.00	2.03
5	601899	紫金矿业	404,800	13,245,056.00	1.81
6	600036	招商银行	304,200	11,961,144.00	1.64
7	300502	新易盛	24,400	10,805,296.00	1.48
8	000333	美的集团	121,000	9,238,350.00	1.26
9	600900	长江电力	300,700	8,130,928.00	1.11
10	601166	兴业银行	416,100	7,831,002.00	1.07

5.3.2 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前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
1	688818	电科蓝天	2,146.00	126,325.39	0.02
2	688712	北芯生命	292.00	8,646.12	0.00
3	603284	林平发展	132.00	6,085.00	0.00
4	688785	恒运昌	21.00	4,327.47	0.00
5	601112	振石股份	78.00	1,215.24	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	37,599,010.28	5.14
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	37,599,010.28	5.14

5.5 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债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019827	26 国债 01	375,000.00	37,599,010.28	5.14

注：本基金本报告期末仅持有 1 只债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF2606	沪深 300 股指期货 2606 合约	24.00	31,530,240.00	-835,860.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-835,860.00
股指期货投资本期收益(元)					216,155.49
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-874,996.36

5.9.2 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、交易活跃的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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

无。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	10,150,100.12
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	103,675.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	10,253,775.99
---	----	---------------

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值 (元)	占基金资产 净值比例(%)	流通受限 情况说明
1	688818	电科蓝天	9,036.45	0.00	科创板打 新限售
2	688712	北芯生命	8,646.12	0.00	科创板打 新限售
3	688785	恒运昌	4,327.47	0.00	科创板打 新限售
4	601112	振石股份	1,215.24	0.00	新股锁定
5	603284	林平发展	580.30	0.00	新股锁定

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 6 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
本报告期期初基金 份额总额	28,777,909.7 3	14,038,761.38	162,413,081.0 4	66,814.57
报告期期间基金总 申购份额	3,274,739.17	8,579,099.68	19,475,177.30	626,925,173.8 7

减：报告期期间基金总赎回份额	16,388,122.92	2,599,815.21	163,710,883.30	941,624.56
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	15,664,525.98	20,018,045.85	18,177,375.04	626,050,363.88

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

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
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-	-	-
报告期期间买入/申购总份额	-	-	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00	-	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总额比例 (%)	63.84	-	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

无交易。

§ 8 报告期末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	1.47%	10,000,000.00	1.47%	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	1.47%	10,000,000.00	1.47%	-

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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	20260303-20260309	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	1.47%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内，存在报告期间单一投资者持有基金份额达到或超过20%的情形，可能会存在以下风险：</p> <p>1) 基金净值大幅波动的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，基金为支付赎回款项而卖出所持有的证券，可能造成证券价格波动，导致本基金的收益水平发生波动。同时，因巨额赎回、份额净值小数保留位数与方式、管理费及托管费等费用计提等原因，可能会导致基金份额净值出现大幅波动；</p> <p>2) 巨额赎回的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能触发本基金巨额赎回条款，基金份额持有人将可能无法及时赎回所持有的全部基金份额；</p> <p>3) 流动性风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致本基金的流动性风险；</p> <p>4) 基金提前终止、转型或与其他基金合并的风险：当持有基金份额占比较高的基金份额持有人大量赎回本基金时，可能导致在其赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值</p>							

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。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资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、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。

10.2 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

10.3 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
二〇二六年四月二十二日