

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

2026 年第 2 季度报告

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二六年七月二十一日

§ 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约定，于 2026 年 7 月 20 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 4 月 1 日起至 6 月 30 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	331,574,128.57 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	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。 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。			
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	17,489,325.48 份	25,675,323.44 份	5,135,169.51 份	283,274,310.14 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 4 月 1 日-2026 年 6 月 30 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	3,275,651.64	3,425,631.26	3,267,596.66	20,582,219.9 8
2. 本期利润	2,996,840.05	3,206,681.69	2,489,992.36	47,340,025.2 1
3. 加权平均基 金份额本期利 润	0.2065	0.2190	0.2487	0.3221
4. 期末基金资 产净值	21,487,839.61	31,464,527.44	6,300,131.78	342,378,469. 41
5. 期末基金份 额净值	1.2286	1.2255	1.2269	1.2086

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	18.28%	1.30%	13.54%	1.34%	4.74%	-0.04%
过去六个 月	17.83%	1.21%	11.34%	1.22%	6.49%	-0.01%
过去一年	28.77%	1.04%	34.41%	1.09%	-5.64%	-0.05%

自基金合同生效起至今	29.07%	0.96%	40.03%	1.03%	-10.96%	-0.07%
------------	--------	-------	--------	-------	---------	--------

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	18.23%	1.30%	13.54%	1.34%	4.69%	-0.04%
过去六个月	17.72%	1.21%	11.34%	1.22%	6.38%	-0.01%
过去一年	28.52%	1.04%	34.41%	1.09%	-5.89%	-0.05%
自基金合同生效起至今	28.76%	0.96%	40.03%	1.03%	-11.27%	-0.07%

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	18.29%	1.30%	13.54%	1.34%	4.75%	-0.04%
过去六个月	17.83%	1.21%	11.34%	1.22%	6.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	28.25%	1.09%	29.53%	1.13%	-1.28%	-0.04%

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	18.29%	1.30%	13.54%	1.34%	4.75%	-0.04%
过去六个月	17.83%	1.21%	11.34%	1.22%	6.49%	-0.01%
自基金合同生效起至今	26.43%	1.09%	29.53%	1.13%	-3.10%	-0.04%

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 6 月 30 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.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。

2.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%。

3.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

2026 年二季度，全球地缘局势动荡起伏，中东冲突更持续成为市场关注焦点。美以伊对峙反复，霍尔木兹海峡航运一度承压推升油价与通胀预期，但至 6 月底前，中东冲突出现戏剧性转圜继而快速提振全球市场风偏。此外，全球 AI 产业高歌猛进。北美云厂 2026 年 AI capex 合计达 8000 亿+美元量级，英伟达 Blackwell/Vera Rubin 量产、AI Agent 商业化落地确认算力超级周期，国内 DeepSeek、智谱 GLM-5 等大模型突破，国产 GPU 加速资本化，AI 应用端（短剧/工具）初现盈利拐点。

全球范围看：美国经济保持较强韧性，但通胀反弹令美联储释放偏鹰信号，市场一度交易再加息预期；欧洲增长偏弱，面临滞胀压力；全球资金继续向 AI 科技主线集中，地缘因素（中东局势、特朗普访华）阶段性扰动风险偏好。

国内情况看：二季度 GDP 同比增速预计将有所回落（一季度 5.0%），整体呈“稳中略降、K 型分化”特征：出口持续偏强尤其高技术制造高速增长；但内需（消费、地产等传统产业方向）相对疲弱，CPI 温和回升，PPI 在国际原油大涨及国内“反内卷”等因素推动下回升至 3% 以上，制造业 PMI 徘徊荣枯线。

股市层面观察：美股表现强势，纳斯达克二季度涨约+21.4%、标普 500 约+14.9%，AI 算力与半导体领涨，创近年最佳季度表现；港股承压，恒生指数 2 季度跌约-7.7%、恒生科技-3.8%，受外资流出及汇率预期拖累；A 股整体震荡上行、结构极度分化。从 A 股各大指数层面看，上证指数二季度+5.2%，沪深 300 指数 +11.9%，中证 500 指数+18.6%，创业板指 +36.4%，科创 50 飙升约+75.7%（AI 芯片/电子/通信为主线）。从行业及风格层面看，传统消费、金融地产、周期板块普遍调整，仅科技成长方向走出独立行情，市场呈现典型的“新旧动能切换”特征。

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%。二季度产品申赎较为活跃，申赎对跟踪基准指数产生较大扰动。为确保更精细化管理组合，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。

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 1.2286 元，本报告期份额净值增长率为 18.28%，同期业绩比较基准增长率为 13.54%；C 类基金份额净值为 1.2255 元，本报告期份额净值增长率为 18.23%，同期业绩比较基准增长率为 13.54%；B 类份额净值为 1.2269 元，本报告期份额净值增长率为 18.29%，同期业绩比较基准增长率为 13.54%；D 类基金份额净值为 1.2086 元，本报告期份额净值增长率为 18.29%，同期业绩比较基准增长率为 13.54%。

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	364,507,589.94	87.68
	其中：股票	364,507,589.94	87.68
2	固定收益投资	16,655,016.89	4.01
	其中：债券	16,655,016.89	4.01
	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	5,540,857.51	1.33
7	其他资产	29,012,794.90	6.98
8	合计	415,716,259.24	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	1,154,718.00	0.29
B	采矿业	15,072,365.00	3.75
C	制造业	257,527,763.58	64.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,981,634.00	1.99
E	建筑业	4,459,065.00	1.11
F	批发和零售业	2,817,274.00	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	7,994,141.60	1.99
H	住宿和餐饮业	170,758.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,422,154.67	5.08
J	金融业	34,903,194.00	8.69
K	房地产业	2,047,646.00	0.51
L	租赁和商务服务业	2,649,242.00	0.66
M	科学研究和技术服务业	4,372,513.00	1.09
N	水利、环境和公共设施管理业	628,248.68	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	122,760.00	0.03
Q	卫生和社会工作	718,008.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	280,752.00	0.07
S	综合	660,476.00	0.16

	合计	363,982,713.53	90.63
--	----	----------------	-------

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	524,348.59	0.13
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	527.82	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	524,876.41	0.13

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	300308	中际旭创	12,300	15,621,000.00	3.89
2	300750	宁德时代	29,200	11,475,892.00	2.86
3	300502	新易盛	15,420	9,359,940.00	2.33
4	600519	贵州茅台	6,900	8,179,881.00	2.04
5	603986	兆易创新	7,400	6,031,000.00	1.50
6	601318	中国平安	117,800	5,623,772.00	1.40
7	688256	寒武纪	3,441	5,490,287.55	1.37
8	600036	招商银行	136,800	4,856,400.00	1.21
9	601899	紫金矿业	182,100	4,577,994.00	1.14
10	002371	北方华创	4,800	4,245,888.00	1.06

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	688808	联讯仪器	163.00	258,245.79	0.06
2	688818	电科蓝天	2,146.00	158,263.75	0.04
3	301666	大普微	88.00	40,773.04	0.01
4	301599	理奇智能	433.00	14,059.51	0.00
5	688820	盛合晶微	89.00	12,592.61	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	16,651,016.71	4.15
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）	4,000.18	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	16,655,016.89	4.15

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	019835	26 国债 09	117,000.00	11,719,255.31	2.92
2	019827	26 国债 01	49,000.00	4,931,761.40	1.23
3	113704	春风转债	40.00	4,000.18	0.00

注：本基金本报告期末仅持有 3 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
IF2607	沪深 300 股指期货 2607 合约	23.00	33,961,800.00	-29,020.00	-
公允价值变动总额合计(元)					-29,020.00
股指期货投资本期收益(元)					2,000,969.84
股指期货投资本期公允价值变动(元)					806,840.00

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 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约定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	21,446,911.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	7,565,883.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	29,012,794.90

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	688808	联讯仪器	258,245.79	0.06	科创板打 新限售
2	301666	大普微	40,773.04	0.01	创业板打 新限售
3	688818	电科蓝天	15,080.10	0.00	科创板打 新限售
4	301599	理奇智能	14,059.51	0.00	创业板打 新限售
5	688820	盛合晶微	12,592.61	0.00	科创板打 新限售

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	15,664,525.9 8	20,018,045.85	18,177,375.04	626,050,363.8 8
报告期期间基金总 申购份额	6,336,629.67	16,260,244.86	2,759,837.14	358,522,673.1 4
减：报告期期间基 金总赎回份额	4,511,830.17	10,602,967.27	15,802,042.67	701,298,726.8 8

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	17,489,325.48	25,675,323.44	5,135,169.51	283,274,310.14

§ 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份额比例 (%)	57.18	-	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额 (份)	交易金额 (元)	适用费率
1	现金分红	2026-05-15	-	-600,000.00	0.00%
合计			-	-600,000.00	

注：本次分红登记日为 2026 年 5 月 15 日，现金红利金额为 600,000.00 元。

§ 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	3.02%	10,000,000.00	3.02%	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	3.02%	10,000,000.00	3.02%	-

§ 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	20260430-20260515	10,000,000.00	0.00	0.00	10,000,000.00	3.02%
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。

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

二〇二六年七月二十一日