

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：金鹰基金管理有限公司

基金托管人：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：二〇二六年八月三十一日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人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 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64

7.12 投资组合报告附注	65
§8 基金份额持有人信息	66
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	67
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	67
§9 开放式基金份额变动	67
§10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	68
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	69
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	69
10.9 其他重大事件	70
§11 影响投资者决策的其他重要信息	71
11.1 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	71
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点	73
12.3 查阅方式	73

§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	331,574,128.57 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	17,489,325.48 份	25,675,323.44 份	5,135,169.51 份	283,274,310.14 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	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。

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	010-68858126
	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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gefund.com.cn
基金中期报告置备地点	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	金鹰基金管理有限公司	广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）			
	金鹰中证 A500	金鹰中证 A500 指	金鹰中证 A500	金鹰中证 A500

	指数发起 A	数发起 C	指数发起 B	指数发起 D
本期已实现收益	5,512,936.39	5,012,899.81	11,296,711.64	20,133,593.69
本期利润	3,563,324.57	3,003,423.79	8,178,558.07	31,280,342.94
加权平均基金份额本期利润	0.2330	0.2131	0.3571	0.2822
本期加权平均净值利润率	20.13%	18.46%	31.27%	25.44%
本期基金份额净值增长率	17.83%	17.72%	17.83%	17.83%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(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
期末可供分配利润	3,998,514.13	5,789,204.00	1,164,962.27	59,104,159.27
期末可供分配基金份额利润	0.2286	0.2255	0.2269	0.2086
期末基金资产净值	21,487,839.61	31,464,527.44	6,300,131.78	342,378,469.41
期末基金份额净值	1.2286	1.2255	1.2269	1.2086
3.1.3 累计期末指标	报告期末(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
基金份额累计净值增长率	29.07%	28.76%	28.25%	26.43%

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）。

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	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	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	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	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	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	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	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：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。

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 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 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

公司秉承开放、包容、多元的投资文化，采取基金经理负责制，将产品契约与基金经理风格有机结合，鼓励基金经理个人风格的充分展现，强化产品投资风格的稳定性，逐步形成了风险收益特征多元，投资研究体系有机互补的整体投研平台和基金产品线。截至报告期末，合计管理公募基金 75 只。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的 基金经理（助 理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
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	-	4	曾绍刚先生，北京大学理学硕士，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，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，“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 公平交易制度的执行情况

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年上半年，无论是全球经济还是主要股市，均呈现出 K 型分化继续扩大的显著特征。A 股市场方面，大部分时间段内表现为极致演绎的“科技牛”行情。

具体而言，上半年 A 股呈“指数震荡抬升、结构极度分化”格局：上证综指+3.16%，深成指+19.82%，创业板指+35.58%，科创 50 飙涨 64.25%创历史新高；全市场成交 317.53 万亿元，刷新半年度纪录，日均 2.74 万亿元近翻倍。电子、通信等 AI 相关方向领涨，消费、金融等传统板块沉寂，首尾行业差超 115pct。半导体市值首超国有大行，市场呈现典型的“新旧动能切换”特征。

申万一级行业涨跌幅方面：电子、通信、建材名列前 3，上半年涨幅分别达到 86.29%、73.59% 和 46.26%；商贸、农业及美护排名落后，跌幅分别为 29.42%、25.26%和 24.86%。

市场驱动过程大致有三个阶段：一、1-2 月温和开局，人民币独立升值；二、3-5 月美以伊冲突推高油价与通胀预期，长久期资产承压，AI 硬科技成唯一主线；三、6 月世界杯召开前夕，中东地缘冲突出现阶段性转圜，但市场对美联储年内可能加息的担忧有所升温。此外，国内“十五五”开局定调 GDP 4.5%-5%，定向财政+结构性货币工具牵引资金流向半导体、AI 基建、新质生产力，呈现供强需弱及外需强于内需的非对称复苏态势。

特别地，从国内情况看，二季度 GDP 同比增速快速回落到 4.3%（一季度 5.0%，上半年 4.7%），整体呈“稳中略降、K 型分化”特征：出口持续偏强尤其先进技术制造业高增；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”等推动下回升至 3% 以上，制造业 PMI 徘徊荣枯线。

本基金产品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%。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。

上半年，本产品主要通过精细化的组合管理（期指套保、国债逆回购），及适度参与优质新股申购等，获得了较为显著的“ $\alpha+\beta$ ”型收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，A 类基金份额净值为 1.2286 元，本报告期份额净值增长率为 17.83%，

同期业绩比较基准增长率为 11.34%；C 类基金份额净值为 1.2255 元，本报告期份额净值增长率为 17.72%，同期业绩比较基准增长率为 11.34%；B 类基金份额净值为 1.2269 元，本报告期份额净值增长率为 17.83%，同期业绩比较基准增长率为 11.34%；D 类基金份额净值为 1.2086 元，本报告期份额净值增长率为 17.83%，同期业绩比较基准增长率为 11.34%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预期，2026 年下半年 A 股仍将延续上行格局，行情驱动力可能由上半年主要靠分母端估值扩张切换至分子端盈利兑现，业绩将成为重要筛选标尺。基准情景下，上证有望继续在 3800-4300 点的核心区间内维持高位震荡格局，极致科技行情继续向再平衡方向演进。我们预计，科技内部可能由核心算力向半导体材料、AI 软件、储能、有色等“高切低”方向扩散，传统板块方向如高股息资产、消费（含医药）、非银等也将有持续表现的机会。

比较而言，3 季度受旺季效应、政策加快落地、元首可能再度会晤等多个积极因素共振影响，指数支撑或优于 4 季度，而 4 季度受美国中期选举及全球流动性扰动加大等不确定性影响或更为显著。

整体预判，下半年 A 股市场有望逐步呈现出科技成长与传统价值“双轮驱动”的下半场新特征。科技方面，有全球竞争力与盈利验证的科技龙头相对占优，纯主题科技股或面临进一步出清过程。价值方向，有政策引领及具备更厚实安全边际的传统优势企业同样值得关注。

由于本基金产品对标的中证 A500 指数之相关样本股均为各细分行业的优质权重个股，预计在下半年新的市场环境下，A500 指数仍值得持续重视。

下半年，本基金将继续通过股指期货等管理工具，严格做好产品的申赎管理，并在审慎评估市场整体风险的前提下，继续适度参与优质新股的申购等，努力为投资者获取更稳定回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会由基金估值业务分管领导、督察长、基金估值核算负责人、基金会计、合规风控部人员及相关投研人员等组成。在特殊情况下，公司召集估值委员会会议，讨论和决策特殊估值事项，估值委员会集体决策，需到会的三分之二估值委员会成员表决通过。估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。以上所

有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理、投资经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行，一切以维护基金持有人利益为准则。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内共进行了 1 次利润分配。

权益登记日为 2026 年 5 月 15 日，A 类每 10 份分配 0.60 元，C 类每 10 份分配 0.60 元，B 类每 10 份分配 0.60 元，D 类每 10 份分配 0.60 元，本次利润分配总额 2,945,548.63 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内无应当说明的预警事项。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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遵规守信、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。报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	853,916.20	13,888,175.14
结算备付金		4,686,941.31	5,595,436.03
存出保证金		21,446,911.67	4,021,591.68
交易性金融资产	6.4.7.2	381,162,606.83	214,105,770.71
其中：股票投资		364,507,589.94	203,915,995.59
基金投资		-	-
债券投资		16,655,016.89	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		7,565,883.23	29,392.94
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		415,716,259.24	237,640,366.50
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		13,000,473.45	8,599,957.00
应付清算款		-	-
应付赎回款		948,102.99	4,246,108.02
应付管理人报酬		34,178.39	54,105.01
应付托管费		11,392.78	18,035.01
应付销售服务费		2,747.74	1,933.41
应付投资顾问费		-	-
应交税费		7,213.71	5,288.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	81,181.94	90,342.90
负债合计		14,085,291.00	13,015,769.92
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	331,574,128.57	205,296,566.72
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	70,056,839.67	19,328,029.86
净资产合计		401,630,968.24	224,624,596.58
负债和净资产总计		415,716,259.24	237,640,366.50

注：截至本报告期末 2026 年 06 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.2286 元，A 类基金份额总额为 17,489,325.48 份；C 类基金份额净值为 1.2255 元，C 类基金份额总额为 25,675,323.44 份；B 类基金份额净值为 1.2269 元，B 类基金份额总额为 5,135,169.51 份；D 类基金份额净值为 1.2086 元，D 类基金份额总额为 283,274,310.14 份；基金份额总额为 331,574,128.57 份。

6.2 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 4 月 25 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		46,493,935.05	934,023.49
1.利息收入		60,828.02	799,554.26
其中：存款利息收入	6.4.7.9	60,828.02	348,974.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	450,580.15
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		42,318,840.99	55,516.23

其中：股票投资收益	6.4.7.10	39,108,466.27	-2,053.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	45,051.99	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	2,217,125.33	-
股利收益	6.4.7.15	948,197.40	57,569.23
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	4,069,507.84	78,953.00
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	44,758.20	-
减：二、营业总支出		468,285.68	239,887.16
1. 管理人报酬		268,620.06	168,863.55
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		89,539.98	56,287.85
3. 销售服务费		16,125.09	8,597.20
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		15,959.46	-
其中：卖出回购金融资产支出		15,959.46	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		8,120.79	-
8. 其他费用	6.4.7.19	69,920.30	6,138.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,025,649.37	694,136.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,025,649.37	694,136.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,025,649.37	694,136.33

6.3 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	205,296,566.72	19,328,029.86	224,624,596.58
二、本期期初净资产	205,296,566.72	19,328,029.86	224,624,596.58

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	126,277,561.85	50,728,809.81	177,006,371.66
（一）、综合收益总额	-	46,025,649.37	46,025,649.37
（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）	126,277,561.85	7,648,709.07	133,926,270.92
其中：1.基金申购款	1,042,133,574.83	135,358,303.22	1,177,491,878.05
2.基金赎回款	-915,856,012.98	-127,709,594.15	-1,043,565,607.13
（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）	-	-2,945,548.63	-2,945,548.63
四、本期期末净资产	331,574,128.57	70,056,839.67	401,630,968.24
项目	上年度可比期间 2025 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
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）	-	694,136.33	694,136.33
（一）、综合收益总额	-	694,136.33	694,136.33
（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）	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
（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	310,960,667.59	694,136.33	311,654,803.92

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：周蔚，主管会计工作负责人：刘盛，会计机构负责人：董霞

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

金鹰中证 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）。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编

制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85 号文《财政部、国家税务总局、证监会关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《财政部、国家税务总局、证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16 号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1 号文《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36 号文《财政部、国家税务总局关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试

点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、国令第 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

（1）对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

（2）自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售

额。

(3) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(4) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入个人所得税应纳税所得额。对基金从全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息、红利所得，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，其股息红利所得暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。

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

(6) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(7) 对基金在 2018 年 1 月 1 日（含）以后运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	853,916.20
等于：本金	853,566.73
加：应计利息	349.47
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	853,916.20

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		353,153,629.22	-	364,507,589.94	11,353,960.72
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	16,602,715.52	50,116.89	16,655,016.89	2,184.48
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	16,602,715.52	50,116.89	16,655,016.89	2,184.48
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		369,756,344.74	50,116.89	381,162,606.83	11,356,145.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 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	33,961,800.00	-	-	-
--股指期货	33,961,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,961,800.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IF2607	沪深 300 股指期货 2607 合约	23.00	33,961,800.00	-29,020.00
合计	-	-	-	-29,020.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-29,020.00
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	18.14
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	10,412.93
预提费用-信息披露费	59,507.37
其他应付	11,243.50
合计	81,181.94

6.4.7.7 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
----	----

	2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	28,777,909.73	28,777,909.73
本期申购	9,611,368.84	9,611,368.84
本期赎回（以“-”号填列）	-20,899,953.09	-20,899,953.09
本期末	17,489,325.48	17,489,325.48

金鹰中证 A500 指数发起 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,038,761.38	14,038,761.38
本期申购	24,839,344.54	24,839,344.54
本期赎回（以“-”号填列）	-13,202,782.48	-13,202,782.48
本期末	25,675,323.44	25,675,323.44

金鹰中证 A500 指数发起 B

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	162,413,081.04	162,413,081.04
本期申购	22,235,014.44	22,235,014.44
本期赎回（以“-”号填列）	-179,512,925.97	-179,512,925.97
本期末	5,135,169.51	5,135,169.51

金鹰中证 A500 指数发起 D

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	66,814.57	66,814.57

本期申购	985,447,847.01	985,447,847.01
本期赎回（以“-”号填列）	-702,240,351.44	-702,240,351.44
本期末	283,274,310.14	283,274,310.14

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

6.4.7.8 未分配利润

金鹰中证 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
上年度末	3,924,998.15	-1,178,938.95	2,746,059.20
本期期初	3,924,998.15	-1,178,938.95	2,746,059.20
本期利润	5,512,936.39	-1,949,611.82	3,563,324.57
本期基金份额交易产生的变动数	-1,033,227.55	-456,671.33	-1,489,898.88
其中：基金申购款	3,499,303.51	-1,861,290.75	1,638,012.76
基金赎回款	-4,532,531.06	1,404,619.42	-3,127,911.64
本期已分配利润	-820,970.76	-	-820,970.76
本期末	7,583,736.23	-3,585,222.10	3,998,514.13

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
上年度末	1,891,863.43	-574,616.75	1,317,246.68
本期期初	1,891,863.43	-574,616.75	1,317,246.68
本期利润	5,012,899.81	-2,009,476.02	3,003,423.79
本期基金份额交易产生的变动数	4,918,345.21	-2,671,155.27	2,247,189.94
其中：基金申购款	9,094,260.51	-4,747,366.86	4,346,893.65
基金赎回款	-4,175,915.30	2,076,211.59	-2,099,703.71
本期已分配利润	-778,656.41	-	-778,656.41
本期末	11,044,452.04	-5,255,248.04	5,789,204.00

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
上年度末	21,967,746.41	-6,708,258.05	15,259,488.36
本期期初	21,967,746.41	-6,708,258.05	15,259,488.36
本期利润	11,296,711.64	-3,118,153.57	8,178,558.07
本期基金份额交易产生的变动数	-30,641,599.69	8,773,121.60	-21,868,478.09
其中：基金申购款	4,753,152.60	-1,776,327.11	2,976,825.49
基金赎回款	-35,394,752.29	10,549,448.71	-24,845,303.58
本期已分配利润	-404,606.07	-	-404,606.07

本期末	2,218,252.29	-1,053,290.02	1,164,962.27
-----	--------------	---------------	--------------

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
上年度末	7,886.85	-2,651.23	5,235.62
本期期初	7,886.85	-2,651.23	5,235.62
本期利润	20,133,593.69	11,146,749.25	31,280,342.94
本期基金份额交易产生的变动数	96,898,822.74	-68,138,926.64	28,759,896.10
其中：基金申购款	292,403,753.91	-166,007,182.59	126,396,571.32
基金赎回款	-195,504,931.17	97,868,255.95	-97,636,675.22
本期已分配利润	-941,315.39	-	-941,315.39
本期末	116,098,987.89	-56,994,828.62	59,104,159.27

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,291.94
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	24,544.96
其他	3,991.12
合计	60,828.02

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	889,648,778.64
减：卖出股票成本总额	848,923,917.63
减：交易费用	1,616,394.74
买卖股票差价收入	39,108,466.27

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	36,975.93
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,076.06

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	45,051.99

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	48,331,646.17
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	48,098,176.48
减：应计利息总额	204,782.17
减：交易费用	20,611.46
买卖债券差价收入	8,076.06

6.4.7.12 资产支持证券投资收益**6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
期货投资	2,217,125.33

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	948,197.40
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	948,197.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	4,136,387.52

——股票投资	4,135,914.04
——债券投资	473.48
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-68,156.36
——权证投资	-
——期货投资	-68,156.36
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	4,069,507.84

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	39,308.21
转换费收入	5,449.99
合计	44,758.20

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
审计费用	10,412.93
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	69,920.30

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
金鹰基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年4月25日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	268,620.06	168,863.55
其中：应支付销售机构的客户维护费	116,545.87	79,323.15
应支付基金管理人的净管理费	152,074.19	89,540.40

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年4月25日（基金合同 生效日）至2025年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	89,539.98	56,287.85

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务 费的各关联方 名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	金鹰中证 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	-	1,229.53	-	-	1,229.53
金鹰基金管理 有限公司	-	10,897.99	-	-	10,897.99
合计	-	12,127.52	-	-	12,127.52
获得销售服务 费的各关联方 名称	上年度可比期间 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025年6月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	金鹰中证 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	-	418.12	-	-	418.12
合计	-	418.12	-	-	418.12

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 类基金份额前一日的基金资产净值

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日				上年度可比期间 2025年4月25日（基金合同生效日）至2025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	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	-	-	-
期初持有的基金份额	10,000,000.00	-	-	-	-	-	-	-
期间申购/	-	-	-	-	-	-	-	-

买入总份 额								
期间因拆 分变动份 额	-	-	-	-	-	-	-	-
减：期间赎 回/卖出总 份额	-	-	-	-	-	-	-	-
期末持有 的基金份 额	10,000,00 0.00	-	-	-	10,000,000 .00	-	-	-
期末持有 的基金份 额占基金 总份额比 例	57.18%	-	-	-	3.48%	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2025 年 4 月 25 日。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

金鹰中证 A500 指数发起 A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 B

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

金鹰中证 A500 指数发起 D

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年4月25日（基金合同生效 日）至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有 限公司	853,916.20	32,291.94	449,349.27	18,929.78

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

金鹰中证 A500 指数发起 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-05-15	-	2026-05-15	0.600	805,092.57	15,878.19	820,970.76	-
合计				0.600	805,092.57	15,878.19	820,970.76	-

金鹰中证 A500 指数发起 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-05-15	-	2026-05-15	0.600	208,493.23	570,163.18	778,656.41	-
合计				0.600	208,493.23	570,163.18	778,656.41	-

金鹰中证 A500 指数发起 B

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					

1	2026-05-15	-	2026-05-15	0.600	403,916.14	689.93	404,606.07	-
合计				0.600	403,916.14	689.93	404,606.07	-

金鹰中证 A500 指数发起 D

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份 基金份额 分红数	现金形式 发放总额	再投资形 式发放总 额	利润分配合 计	备注
		场 内	场 外					
1	2026-05-15	-	2026-05-15	0.600	939,457.94	1,857.45	941,315.39	-
合计				0.600	939,457.94	1,857.45	941,315.39	-

6.4.12 期末（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688808	联讯仪器	2026-04-16	6 个月	科创板打新限售	81.88	1,584.33	163.00	13,346.44	258,245.79	-
301666	大普微	2026-04-08	6 个月	创业板打新限售	46.08	463.33	88.00	4,055.04	40,773.04	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6 个月	科创板打新限售	9.47	70.14	215.00	2,036.05	15,080.10	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6 个月	创业板打新限售	13.91	32.47	433.00	6,023.03	14,059.51	-
68882	盛合	2026-0	6 个月	科创	19.68	141.49	89.00	1,751.	12,592	-

0	晶微	4-13		板打 新限售				52	.61	
688712	北芯生命	2026-01-28	6 个月	科创板打 新限售	17.52	35.92	292.00	5,115.84	10,488.64	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6 个月	科创板打 新限售	92.18	463.15	21.00	1,935.78	9,726.15	-
688635	长进光子	2026-05-20	6 个月	科创板打 新限售	40.98	308.19	22.00	901.56	6,780.18	-
301531	春光集团	2026-04-28	6 个月	创业板打 新限售	13.30	51.56	80.00	1,064.00	4,124.80	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6 个月	创业板打 新限售	26.66	50.96	40.00	1,066.40	2,038.40	-
001365	天海电子	2026-05-11	6 个月	新股 锁定	27.19	31.31	62.00	1,685.78	1,941.22	-
001393	维通利	2026-05-08	6 个月	新股 锁定	30.38	38.99	42.00	1,275.96	1,637.58	-
601112	振石股份	2026-01-21	6 个月	新股 锁定	11.18	17.59	78.00	872.04	1,372.02	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6 个月	新股 锁定	15.76	46.71	23.00	362.48	1,074.33	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6 个月	新股 锁定	28.00	27.78	19.00	532.00	527.82	-
603284	林平发展	2026-02-03	6 个月	新股 锁定	37.88	34.87	14.00	530.32	488.18	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6 个月	新股 锁定	33.49	33.93	11.00	368.39	373.23	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6 个月	新股 锁定	18.38	16.78	22.00	404.36	369.16	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注

113704	春风转债	2026-06-11	17 个交易日	新债未上市	100.00	100.00	40.00	4,000.00	4,000.18	-
--------	------	------------	---------	-------	--------	--------	-------	----------	----------	---

6.4.12.2 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
688072	拓荆科技	2026-06-29	拟筹划重大资产重组	879.53	2026-07-13	890.99	900.00	551,054.73	791,577.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，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 13,000,473.45 元，于 2026 年 7 月 2 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或在新质押式回购下转入质押库的债券按照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金额。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

1.风险管理控制制度

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

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

2.投资管理制度

投资管理制度包括研究业务管理制度、投资决策管理制度、基金交易管理制度等。

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

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

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

3.监察稽核制度

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以

控制相应的信用风险。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估控制证券发行人的信用风险，建立了内部评级体系，通过内部评级与外部评级相结合的方法充分评估证券以及交易对手的信用风险。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

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

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年6月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	4,000.18	-
未评级	-	-
合计	4,000.18	-

注：本统计数据未包含国债、央行票据、政策性金融债、地方政府债、同业存单。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

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

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

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

注：以上数据按照最新发行人评级填列。

6.4.13.3 流动性风险

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	853,916.20	-	-	-	853,916.20
结算备付金	4,686,941.31	-	-	-	4,686,941.31
存出保证金	21,446,911.67	-	-	-	21,446,911.67
交易性金融资产	16,655,016.89	-	-	364,507,589.94	381,162,606.83
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	7,565,883.23	7,565,883.23
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	43,642,786.07	-	-	372,073,473.17	415,716,259.24
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	13,000,473.45	-	-	-	13,000,473.45
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	948,102.99	948,102.99
应付管理人报酬	-	-	-	34,178.39	34,178.39
应付托管费	-	-	-	11,392.78	11,392.78
应付销售服务费	-	-	-	2,747.74	2,747.74
应交税费	-	-	-	7,213.71	7,213.71
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	81,181.94	81,181.94
负债总计	13,000,473.45	-	-	1,084,817.55	14,085,291.00
利率敏感度缺口	30,642,312.62	-	-	370,988,655.62	401,630,968.2

					4
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
----	-----------	-----------------------------

		本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-30,434.71	-9,387.41
	利率下降 25 个基点	30,665.36	9,426.29

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	364,507,589.94	90.76	203,915,995.59	90.78
交易性金融资产—债券投资	4,000.18	0.00	-	-
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	364,511,590.12	90.76	203,915,995.59	90.78

6.4.13.4.3.2 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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,034,701.50	1,077,376.14

	业绩比较基准变动-5%	-1,034,701.50	-1,077,376.14
--	-------------	---------------	---------------

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	1,514,559.41	525,000.84
	业绩比较基准变动-5%	-1,514,559.41	-525,000.84

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	303,163.22	8,702,903.49
	业绩比较基准变动-5%	-303,163.22	-8,702,903.49

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准变动+5%	16,479,102.51	3,351.46
	业绩比较基准变动-5%	-16,479,102.51	-3,351.46

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

第二层次输入值是除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次输入值是相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层 次	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	363,334,320.18	202,711,610.83

第二层次	17,446,593.89	11,394,159.88
第三层次	381,692.76	-
合计	381,162,606.83	214,105,770.71

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期内无公允价值所属层级间的重大变动。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

于 2026 年 6 月 30 日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	364,507,589.94	87.68
	其中：股票	364,507,589.94	87.68
2	基金投资	-	-
3	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	-	-
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	5,540,857.51	1.33
8	其他各项资产	29,012,794.90	6.98
9	合计	415,716,259.24	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。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

7.2.1.1 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	1,154,718.00	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
--	----	----------------	-------

7.2.1.2 积极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	-	-
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

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 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（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
11	000333	美的集团	53,700	4,055,961.00	1.01
12	002475	立讯精密	56,400	3,970,560.00	0.99
13	688008	澜起科技	12,640	3,917,136.00	0.98
14	688012	中微公司	8,327	3,901,199.50	0.97
15	688041	海光信息	10,312	3,818,533.60	0.95
16	002384	东山精密	14,200	3,725,370.00	0.93
17	688981	中芯国际	22,535	3,579,008.70	0.89
18	600900	长江电力	135,200	3,578,744.00	0.89
19	000725	京东方 A	401,700	3,486,756.00	0.87
20	603259	药明康德	27,300	3,399,123.00	0.85
21	600030	中信证券	107,900	3,099,967.00	0.77
22	601166	兴业银行	187,100	3,098,376.00	0.77
23	300059	东方财富	139,900	2,851,162.00	0.71
24	600183	生益科技	16,100	2,791,740.00	0.70
25	600276	恒瑞医药	49,300	2,565,572.00	0.64
26	300274	阳光电源	16,000	2,544,320.00	0.63
27	601398	工商银行	357,500	2,527,525.00	0.63
28	300408	三环集团	14,800	2,470,120.00	0.62
29	002594	比亚迪	30,000	2,391,000.00	0.60
30	600487	亨通光电	21,800	2,383,612.00	0.59
31	300476	胜宏科技	6,700	2,321,081.00	0.58
32	002463	沪电股份	14,900	2,276,720.00	0.57
33	601211	国泰海通	124,900	2,273,180.00	0.57
34	300394	天孚通信	7,260	2,197,456.80	0.55
35	688525	佰维存储	4,200	2,077,866.00	0.52
36	688498	源杰科技	1,100	2,074,600.00	0.52
37	000988	华工科技	11,100	2,049,171.00	0.51
38	301308	江波龙	2,800	1,970,640.00	0.49
39	600176	中国巨石	26,500	1,931,320.00	0.48
40	601288	农业银行	317,500	1,927,225.00	0.48
41	601328	交通银行	294,800	1,895,564.00	0.47

42	000651	格力电器	49,500	1,856,250.00	0.46
43	600522	中天科技	30,200	1,832,536.00	0.46
44	603019	中科曙光	16,200	1,737,126.00	0.43
45	688521	芯原股份	4,613	1,712,068.82	0.43
46	603993	洛阳钼业	96,500	1,693,575.00	0.42
47	600150	中国船舶	49,900	1,686,121.00	0.42
48	600887	伊利股份	69,900	1,674,804.00	0.42
49	300604	长川科技	4,900	1,672,958.00	0.42
50	600584	长电科技	15,800	1,636,090.00	0.41
51	000338	潍柴动力	59,400	1,618,650.00	0.40
52	000858	五 粮 液	21,400	1,583,600.00	0.39
53	688347	华虹公司	4,500	1,513,350.00	0.38
54	601816	京沪高铁	324,400	1,469,532.00	0.37
55	600309	万华化学	20,800	1,422,928.00	0.35
56	688120	华海清科	4,340	1,398,261.20	0.35
57	300124	汇川技术	20,900	1,386,297.00	0.35
58	002415	海康威视	40,500	1,385,100.00	0.34
59	002916	深南电路	3,000	1,373,700.00	0.34
60	002008	大族激光	9,100	1,366,001.00	0.34
61	002281	光迅科技	5,300	1,361,782.00	0.34
62	600111	北方稀土	28,000	1,345,400.00	0.33
63	000100	TCL 科技	226,500	1,318,230.00	0.33
64	300857	协创数据	3,800	1,291,620.00	0.32
65	000063	中兴通讯	35,600	1,288,364.00	0.32
66	300136	信维通信	10,700	1,275,975.00	0.32
67	600000	浦发银行	147,200	1,267,392.00	0.32
68	600089	特变电工	55,800	1,255,500.00	0.31
69	601857	中国石油	143,100	1,242,108.00	0.31
70	002028	思源电气	6,900	1,193,700.00	0.30
71	601088	中国神华	30,400	1,186,816.00	0.30
72	300433	蓝思科技	22,000	1,180,520.00	0.29
73	600031	三一重工	65,600	1,133,568.00	0.28
74	300014	亿纬锂能	16,800	1,092,504.00	0.27
75	002050	三花智控	24,731	1,083,959.73	0.27
76	300475	香农芯创	3,600	1,080,000.00	0.27
77	601601	中国太保	37,800	1,078,056.00	0.27
78	000001	平安银行	107,200	1,077,360.00	0.27
79	300223	北京君正	4,300	1,070,270.00	0.27
80	000792	盐湖股份	35,100	1,059,669.00	0.26
81	002714	牧原股份	30,200	1,056,698.00	0.26
82	600549	厦门钨业	12,300	1,047,960.00	0.26
83	002353	杰瑞股份	6,800	1,037,000.00	0.26
84	002156	通富微电	13,400	1,016,658.00	0.25
85	600406	国电南瑞	43,700	998,545.00	0.25

86	601668	中国建筑	228,300	990,822.00	0.25
87	000657	中钨高新	10,100	966,772.00	0.24
88	002436	兴森科技	18,800	957,860.00	0.24
89	600660	福耀玻璃	18,300	923,052.00	0.23
90	601919	中远海控	69,400	920,244.00	0.23
91	002602	ST 华通	65,200	919,320.00	0.23
92	300760	迈瑞医疗	6,700	910,061.00	0.23
93	601988	中国银行	158,200	904,904.00	0.23
94	603501	豪威集团	9,400	891,590.00	0.22
95	601728	中国电信	171,600	890,604.00	0.22
96	300054	鼎龙股份	8,400	890,148.00	0.22
97	601012	隆基绿能	67,000	879,040.00	0.22
98	601225	陕西煤业	42,900	873,015.00	0.22
99	002230	科大讯飞	21,200	865,808.00	0.22
100	600941	中国移动	10,000	861,300.00	0.21
101	600690	海尔智家	41,500	847,015.00	0.21
102	002352	顺丰控股	26,500	828,390.00	0.21
103	688777	中控技术	7,000	822,500.00	0.20
104	601985	中国核电	90,900	820,827.00	0.20
105	002460	赣锋锂业	12,500	817,500.00	0.20
106	002709	天赐材料	15,800	812,594.00	0.20
107	002938	鹏鼎控股	7,700	811,426.00	0.20
108	603799	华友钴业	16,800	810,768.00	0.20
109	300033	同花顺	3,340	804,940.00	0.20
110	300757	罗博特科	1,300	804,700.00	0.20
111	000977	浪潮信息	11,400	798,000.00	0.20
112	688072	拓荆科技	900	791,577.00	0.20
113	600160	巨化股份	14,900	789,849.00	0.20
114	300442	润泽科技	9,100	755,937.00	0.19
115	002851	麦格米特	4,500	752,310.00	0.19
116	000425	徐工机械	90,551	732,557.59	0.18
117	688126	沪硅产业	18,300	729,987.00	0.18
118	601600	中国铝业	87,600	720,072.00	0.18
119	002202	金风科技	30,100	719,390.00	0.18
120	000938	紫光股份	24,900	718,614.00	0.18
121	600028	中国石化	161,000	718,060.00	0.18
122	600938	中国海油	26,400	716,760.00	0.18
123	600460	士兰微	12,900	705,114.00	0.18
124	300346	南大光电	7,600	704,140.00	0.18
125	002466	天齐锂业	11,400	699,048.00	0.17
126	601766	中国中车	134,400	698,880.00	0.17
127	300567	精测电子	2,200	698,720.00	0.17
128	600050	中国联通	172,700	690,800.00	0.17
129	002600	领益智造	39,800	690,132.00	0.17

130	300661	圣邦股份	4,800	688,704.00	0.17
131	002837	英维克	8,490	675,464.40	0.17
132	002080	中材科技	7,400	666,000.00	0.17
133	002049	紫光国微	7,500	665,625.00	0.17
134	002185	华天科技	29,400	655,914.00	0.16
135	002138	顺络电子	8,900	650,590.00	0.16
136	601628	中国人寿	18,400	650,440.00	0.16
137	688002	睿创微纳	4,200	649,698.00	0.16
138	002179	中航光电	14,000	646,800.00	0.16
139	601100	恒立液压	5,900	634,604.00	0.16
140	000568	泸州老窖	8,100	627,912.00	0.16
141	601872	招商轮船	35,700	627,249.00	0.16
142	600879	航天电子	29,200	621,668.00	0.15
143	002241	歌尔股份	27,500	619,575.00	0.15
144	300395	菲利华	4,600	615,158.00	0.15
145	603288	海天味业	18,400	610,144.00	0.15
146	601006	大秦铁路	131,700	607,137.00	0.15
147	000408	藏格矿业	8,700	603,084.00	0.15
148	300390	天华新能	6,400	598,464.00	0.15
149	605117	德业股份	5,620	596,731.60	0.15
150	688469	芯联集成	55,600	589,916.00	0.15
151	600905	三峡能源	157,900	585,809.00	0.15
152	688017	绿的谐波	1,400	585,004.00	0.15
153	601888	中国中免	10,800	580,068.00	0.14
154	600489	中金黄金	32,100	579,405.00	0.14
155	002625	光启技术	19,000	576,080.00	0.14
156	688396	华润微	5,900	575,545.00	0.14
157	000630	铜陵有色	88,900	565,404.00	0.14
158	600893	航发动力	14,700	563,598.00	0.14
159	688271	联影医疗	5,513	558,080.99	0.14
160	600673	东阳光	16,600	557,428.00	0.14
161	600010	包钢股份	249,900	557,277.00	0.14
162	688111	金山办公	2,600	553,930.00	0.14
163	601127	赛力斯	9,000	551,250.00	0.14
164	300058	蓝色光标	39,700	546,272.00	0.14
165	601689	拓普集团	9,600	541,632.00	0.13
166	002027	分众传媒	111,700	540,628.00	0.13
167	300037	新宙邦	5,800	538,530.00	0.13
168	002273	水晶光电	15,100	535,748.00	0.13
169	600118	中国卫星	6,500	533,325.00	0.13
170	600019	宝钢股份	96,300	522,909.00	0.13
171	000426	兴业银锡	15,700	517,472.00	0.13
172	600760	中航沈飞	12,500	513,750.00	0.13
173	000807	云铝股份	23,000	509,220.00	0.13

174	300751	迈为股份	1,800	508,428.00	0.13
175	601168	西部矿业	18,400	499,376.00	0.12
176	600362	江西铜业	11,500	497,950.00	0.12
177	600104	上汽集团	50,800	495,808.00	0.12
178	600989	宝丰能源	24,300	494,019.00	0.12
179	300450	先导智能	12,000	488,640.00	0.12
180	601727	上海电气	69,700	487,900.00	0.12
181	600875	东方电气	16,900	486,213.00	0.12
182	600988	赤峰黄金	18,400	484,288.00	0.12
183	688099	晶晨股份	4,700	483,630.00	0.12
184	002001	新 和 成	17,000	483,140.00	0.12
185	605589	圣泉集团	7,500	476,775.00	0.12
186	002422	科伦药业	12,300	473,796.00	0.12
187	600885	宏发股份	13,700	472,513.00	0.12
188	601390	中国中铁	113,100	471,627.00	0.12
189	600667	太极实业	16,100	469,798.00	0.12
190	002126	银轮股份	9,400	468,120.00	0.12
191	000538	云南白药	9,840	466,120.80	0.12
192	002738	中矿资源	7,900	466,021.00	0.12
193	000960	锡业股份	10,900	465,321.00	0.12
194	600547	山东黄金	20,000	461,800.00	0.11
195	600392	盛和资源	15,500	461,435.00	0.11
196	600795	国电电力	98,500	459,995.00	0.11
197	000831	中国稀土	8,200	455,018.00	0.11
198	600418	江淮汽车	17,400	449,442.00	0.11
199	600585	海螺水泥	26,500	449,175.00	0.11
200	601669	中国电建	95,200	447,440.00	0.11
201	002407	多氟多	8,800	442,024.00	0.11
202	002648	卫星化学	18,600	436,914.00	0.11
203	600141	兴发集团	9,300	436,821.00	0.11
204	002812	恩捷股份	6,500	434,915.00	0.11
205	300316	晶盛机电	7,200	434,880.00	0.11
206	002129	TCL 中环	35,750	429,715.00	0.11
207	600096	云天化	14,097	428,548.80	0.11
208	300015	爱尔眼科	51,500	425,390.00	0.11
209	301358	湖南裕能	5,600	424,872.00	0.11
210	601179	中国西电	28,300	422,236.00	0.11
211	300782	卓胜微	3,800	416,404.00	0.10
212	601868	中国能建	154,600	412,782.00	0.10
213	600346	恒力石化	23,300	412,643.00	0.10
214	002195	岩山科技	62,700	410,058.00	0.10
215	600482	中国动力	12,500	410,000.00	0.10
216	000066	中国长城	21,400	407,670.00	0.10
217	002558	巨人网络	14,700	405,132.00	0.10

218	600497	驰宏锌锗	33,400	404,474.00	0.10
219	600580	卧龙电驱	12,100	400,510.00	0.10
220	300418	昆仑万维	9,900	399,564.00	0.10
221	600066	宇通客车	14,700	394,107.00	0.10
222	000625	长安汽车	54,800	392,916.00	0.10
223	600157	永泰能源	241,100	388,171.00	0.10
224	600426	华鲁恒升	16,200	387,504.00	0.10
225	002532	天山铝业	35,800	384,134.00	0.10
226	600895	张江高科	10,300	383,675.00	0.10
227	600221	海航控股	284,100	383,535.00	0.10
228	000157	中联重科	54,900	382,653.00	0.10
229	688036	传音控股	6,376	375,865.20	0.09
230	600711	盛屯矿业	34,200	375,174.00	0.09
231	002340	格林美	56,400	372,804.00	0.09
232	605499	东鹏饮料	2,990	369,055.70	0.09
233	000933	神火股份	17,400	368,880.00	0.09
234	600011	华能国际	48,600	368,874.00	0.09
235	300803	指南针	4,000	366,680.00	0.09
236	600048	保利发展	78,900	365,307.00	0.09
237	600143	金发科技	23,600	364,620.00	0.09
238	600438	通威股份	29,800	360,878.00	0.09
239	600436	片仔癀	3,300	360,624.00	0.09
240	300017	网宿科技	27,600	359,076.00	0.09
241	002236	大华股份	21,700	357,833.00	0.09
242	002821	凯莱英	2,200	356,400.00	0.09
243	002493	荣盛石化	33,100	355,825.00	0.09
244	002131	利欧股份	74,800	355,300.00	0.09
245	600570	恒生电子	16,700	353,873.00	0.09
246	600115	中国东航	92,700	353,187.00	0.09
247	600886	国投电力	26,500	352,715.00	0.09
248	002456	欧菲光	37,100	350,966.00	0.09
249	600352	浙江龙盛	28,800	348,768.00	0.09
250	601233	桐昆股份	15,800	342,070.00	0.09
251	603659	璞泰来	11,800	341,374.00	0.08
252	688047	龙芯中科	2,200	340,274.00	0.08
253	003816	中国广核	86,900	339,779.00	0.08
254	300339	润和软件	8,800	338,888.00	0.08
255	601360	三六零	38,700	336,303.00	0.08
256	601058	赛轮轮胎	29,100	335,523.00	0.08
257	000301	东方盛虹	29,200	334,340.00	0.08
258	688235	百济神州	1,300	330,993.00	0.08
259	688213	思特威	3,090	330,846.30	0.08
260	002074	国轩高科	12,000	330,120.00	0.08
261	600026	中远海能	18,400	330,096.00	0.08

262	300759	康龙化成	11,400	329,802.00	0.08
263	688578	艾力斯	3,000	327,600.00	0.08
264	300438	鹏辉能源	3,900	323,115.00	0.08
265	002555	三七互娱	17,100	322,677.00	0.08
266	600009	上海机场	13,700	316,470.00	0.08
267	000768	中航西飞	15,400	315,392.00	0.08
268	600196	复星医药	14,000	314,580.00	0.08
269	688122	西部超导	5,000	314,050.00	0.08
270	000975	山金国际	18,400	312,800.00	0.08
271	601111	中国国航	51,500	311,575.00	0.08
272	300001	特锐德	8,200	310,206.00	0.08
273	300207	欣旺达	16,300	309,537.00	0.08
274	600029	南方航空	59,600	308,728.00	0.08
275	600415	小商品城	30,300	307,848.00	0.08
276	002472	双环传动	7,400	307,174.00	0.08
277	002517	恺英网络	18,900	307,125.00	0.08
278	603129	春风动力	1,200	306,960.00	0.08
279	600674	川投能源	21,500	304,655.00	0.08
280	300458	全志科技	7,700	303,842.00	0.08
281	600219	南山铝业	76,100	303,639.00	0.08
282	002601	龙佰集团	18,400	303,232.00	0.08
283	002128	电投能源	13,100	302,872.00	0.08
284	601186	中国铁建	50,800	302,260.00	0.08
285	601877	正泰电器	11,900	298,333.00	0.07
286	601117	中国化学	40,500	297,675.00	0.07
286	600233	圆通速递	18,900	297,675.00	0.07
287	002595	豪迈科技	6,370	296,842.00	0.07
288	300115	长盈精密	10,500	293,370.00	0.07
289	301236	软通动力	6,900	292,905.00	0.07
290	600372	中航机载	26,780	290,563.00	0.07
291	002155	湖南黄金	12,100	288,827.00	0.07
292	600839	四川长虹	40,800	284,784.00	0.07
293	002465	海格通信	21,900	279,663.00	0.07
294	300454	深信服	2,900	278,980.00	0.07
295	300568	星源材质	14,900	278,928.00	0.07
296	300347	泰格医药	5,700	273,600.00	0.07
297	600741	华域汽车	17,600	273,152.00	0.07
298	000963	华东医药	9,700	272,764.00	0.07
299	000547	航天发展	14,100	270,015.00	0.07
300	002920	德赛西威	3,300	268,950.00	0.07
301	300024	机器人	13,800	266,754.00	0.07
302	688506	百利天恒	900	264,627.00	0.07
303	603650	彤程新材	2,700	264,546.00	0.07
304	002130	沃尔核材	13,900	263,544.00	0.07

305	688331	荣昌生物	2,000	260,520.00	0.06
306	002497	雅化集团	12,700	258,699.00	0.06
307	300012	华测检测	18,600	257,796.00	0.06
308	001979	招商蛇口	39,900	256,557.00	0.06
309	000878	云南铜业	16,100	255,668.00	0.06
310	002432	九安医疗	3,600	254,448.00	0.06
311	688676	金盘科技	3,000	253,920.00	0.06
312	300496	中科创达	4,100	253,339.00	0.06
313	300866	安克创新	2,400	250,800.00	0.06
314	002414	高德红外	18,900	250,614.00	0.06
315	300083	创世纪	18,400	250,608.00	0.06
316	002271	东方雨虹	21,100	250,457.00	0.06
317	000034	神州数码	8,980	249,195.00	0.06
318	601021	春秋航空	5,400	246,132.00	0.06
319	002444	巨星科技	7,900	245,690.00	0.06
320	000733	振华科技	4,300	243,552.00	0.06
321	603979	金诚信	4,100	242,023.00	0.06
322	300474	景嘉微	4,000	241,920.00	0.06
323	000661	长春高新	3,600	239,760.00	0.06
324	601319	中国人保	35,300	238,628.00	0.06
325	002756	永兴材料	4,200	237,888.00	0.06
326	300763	锦浪科技	2,600	234,910.00	0.06
327	300748	金力永磁	7,600	234,460.00	0.06
328	600699	均胜电子	10,800	233,388.00	0.06
329	688266	泽璟制药	2,000	233,320.00	0.06
330	601615	明阳智能	20,000	231,400.00	0.06
331	002078	太阳纸业	18,500	231,065.00	0.06
332	300073	当升科技	4,800	230,592.00	0.06
333	300142	沃森生物	17,700	229,923.00	0.06
334	002025	航天电器	3,000	228,660.00	0.06
335	300919	中伟股份	5,200	227,500.00	0.06
336	603606	东方电缆	5,480	227,474.80	0.06
337	601677	明泰铝业	13,700	227,420.00	0.06
338	603087	甘李药业	4,000	227,040.00	0.06
339	300432	富临精工	11,300	227,017.00	0.06
340	000423	东阿阿胶	5,000	226,800.00	0.06
341	600039	四川路桥	28,800	225,216.00	0.06
342	601800	中国交建	39,300	224,403.00	0.06
343	000002	万科 A	75,200	222,592.00	0.06
344	002252	上海莱士	51,000	221,340.00	0.06
345	600226	亨通股份	23,000	220,570.00	0.05
346	688599	天合光能	15,500	218,860.00	0.05
347	688169	石头科技	2,300	218,431.00	0.05
348	688608	恒玄科技	1,300	217,347.00	0.05

349	688223	晶科能源	45,418	215,735.50	0.05
350	300724	捷佳伟创	3,049	215,259.40	0.05
351	600588	用友网络	22,700	208,386.00	0.05
352	601633	长城汽车	13,800	208,242.00	0.05
353	002064	华峰化学	21,900	207,831.00	0.05
354	001965	招商公路	22,535	206,420.60	0.05
355	688390	固德威	1,900	206,169.00	0.05
356	000786	北新建材	11,300	204,417.00	0.05
357	002831	裕同科技	5,700	202,692.00	0.05
358	300677	英科医疗	5,100	199,767.00	0.05
359	688180	君实生物	5,900	199,538.00	0.05
360	002294	信立泰	6,200	197,718.00	0.05
361	600177	雅戈尔	25,900	195,027.00	0.05
362	000519	中兵红箭	9,221	194,286.47	0.05
363	603806	福斯特	11,500	193,085.00	0.05
364	601618	中国中冶	78,900	192,516.00	0.05
365	600516	方大炭素	31,100	191,887.00	0.05
366	688065	凯赛生物	4,000	191,400.00	0.05
367	300972	万辰集团	1,100	190,751.00	0.05
368	601607	上海医药	12,300	189,420.00	0.05
369	002176	江特电机	18,900	189,189.00	0.05
370	603260	合盛硅业	3,900	188,214.00	0.05
371	000623	吉林敖东	10,600	187,938.00	0.05
372	688188	柏楚电子	1,760	187,792.00	0.05
373	302132	中航成飞	3,200	186,624.00	0.05
374	300699	光威复材	6,460	185,079.00	0.05
375	000617	中油资本	27,900	183,861.00	0.05
376	300558	贝达药业	2,800	182,196.00	0.05
377	002085	万丰奥威	16,400	181,876.00	0.05
378	002318	久立特材	7,600	181,640.00	0.05
379	300832	新产业	4,300	180,600.00	0.04
380	300251	光线传媒	16,200	179,658.00	0.04
381	300342	天银机电	3,800	178,600.00	0.04
382	002459	晶澳科技	21,900	177,390.00	0.04
383	002065	东华软件	24,800	177,072.00	0.04
384	600085	同仁堂	7,600	175,636.00	0.04
385	600499	科达制造	12,700	175,260.00	0.04
386	002266	浙富控股	34,600	175,076.00	0.04
387	605090	九丰能源	4,700	174,699.00	0.04
388	688472	阿特斯	16,100	174,202.00	0.04
389	002044	美年健康	34,600	174,038.00	0.04
390	301550	斯菱股份	1,900	173,717.00	0.04
391	600515	海南机场	63,100	172,894.00	0.04
392	603596	伯特利	6,936	172,290.24	0.04

393	000400	许继电气	7,900	171,430.00	0.04
394	300409	道氏技术	8,600	171,398.00	0.04
395	002405	四维图新	26,200	169,514.00	0.04
396	300003	乐普医疗	14,300	169,455.00	0.04
397	002223	鱼跃医疗	6,600	169,356.00	0.04
398	688005	容百科技	5,500	168,300.00	0.04
399	000032	深桑达 A	6,700	167,165.00	0.04
400	600521	华海药业	11,600	167,040.00	0.04
401	000415	渤海租赁	41,000	166,870.00	0.04
402	000999	华润三九	7,400	166,426.00	0.04
403	601216	君正集团	37,300	166,358.00	0.04
404	000683	博源化工	28,800	165,888.00	0.04
405	600862	中航高科	9,200	165,876.00	0.04
406	000039	中集集团	20,400	165,444.00	0.04
407	688617	惠泰医疗	900	163,404.00	0.04
408	600803	新奥股份	10,300	162,740.00	0.04
409	603766	隆鑫通用	13,600	162,248.00	0.04
410	600704	物产中大	34,300	161,896.00	0.04
411	600312	平高电气	9,000	158,940.00	0.04
412	603605	珀莱雅	2,600	155,792.00	0.04
413	000887	中鼎股份	8,700	155,643.00	0.04
414	600765	中航重机	12,000	155,040.00	0.04
415	300122	智飞生物	13,200	154,308.00	0.04
416	000967	盈峰环境	14,600	153,738.00	0.04
417	688116	天奈科技	4,000	152,800.00	0.04
418	600166	福田汽车	52,500	152,775.00	0.04
419	600153	建发股份	19,200	152,256.00	0.04
420	000830	鲁西化工	12,600	151,200.00	0.04
421	002410	广联达	18,300	149,328.00	0.04
422	600323	瀚蓝环境	5,400	148,284.00	0.04
423	300896	爱美客	1,700	148,240.00	0.04
424	002007	华兰生物	12,100	147,499.00	0.04
425	601799	星宇股份	1,600	144,992.00	0.04
426	688114	华大智造	2,800	143,024.00	0.04
427	603568	伟明环保	9,036	138,973.68	0.03
428	600398	海澜之家	26,500	138,595.00	0.03
429	002603	以岭药业	9,200	138,000.00	0.03
430	600486	扬农化工	2,700	136,890.00	0.03
431	688009	中国通号	28,600	136,136.00	0.03
432	601000	唐山港	32,700	135,705.00	0.03
433	601018	宁波港	43,000	135,450.00	0.03
434	002389	航天彩虹	7,600	135,052.00	0.03
435	600529	山东药玻	7,300	134,685.00	0.03
436	600316	洪都航空	4,800	134,112.00	0.03

437	000738	航发控制	7,300	133,517.00	0.03
438	600208	衢州发展	47,000	133,010.00	0.03
439	600008	首创环保	48,700	132,464.00	0.03
440	603486	科沃斯	2,600	131,950.00	0.03
441	000932	华菱钢铁	37,900	131,513.00	0.03
442	600998	九州通	27,900	130,851.00	0.03
443	600170	上海建工	58,900	130,758.00	0.03
444	600820	隧道股份	24,300	126,603.00	0.03
445	600161	天坛生物	10,900	126,222.00	0.03
446	300118	东方日升	10,100	125,745.00	0.03
447	603885	吉祥航空	12,100	124,509.00	0.03
448	601238	广汽集团	24,500	124,460.00	0.03
449	688303	大全能源	7,132	124,310.76	0.03
450	002607	中公教育	68,200	122,760.00	0.03
451	603816	顾家家居	5,400	120,744.00	0.03
452	603939	益丰药房	6,700	120,466.00	0.03
453	688166	博瑞医药	3,400	119,034.00	0.03
454	600763	通策医疗	3,500	118,580.00	0.03
455	601567	三星医疗	7,800	116,532.00	0.03
456	600038	中直股份	4,500	113,805.00	0.03
457	300573	兴齐眼药	2,780	113,312.80	0.03
458	603392	万泰生物	4,200	113,274.00	0.03
459	300049	福瑞股份	2,900	112,752.00	0.03
460	601880	辽港股份	81,400	112,332.00	0.03
461	300676	华大基因	3,200	112,192.00	0.03
462	600535	天士力	8,300	109,809.00	0.03
463	600511	国药股份	4,200	109,368.00	0.03
464	600816	建元信托	43,500	106,140.00	0.03
465	300100	双林股份	3,800	105,564.00	0.03
466	002244	滨江集团	13,800	104,880.00	0.03
467	000833	粤桂股份	4,400	103,048.00	0.03
468	601155	新城控股	10,000	102,600.00	0.03
469	002120	韵达股份	16,000	101,760.00	0.03
470	688063	派能科技	1,900	101,213.00	0.03
471	300144	宋城演艺	17,400	101,094.00	0.03
472	000998	隆平高科	13,000	98,020.00	0.02
473	002544	普天科技	5,300	96,566.00	0.02
474	600064	南京高科	13,400	95,542.00	0.02
475	601866	中远海发	43,100	95,251.00	0.02
476	600635	大众公用	21,400	91,592.00	0.02
477	300457	赢合科技	4,300	90,644.00	0.02
478	600754	锦江酒店	5,000	89,950.00	0.02
479	000035	中国天楹	18,500	89,355.00	0.02
480	600655	豫园股份	21,500	88,365.00	0.02

481	300601	康泰生物	7,400	83,916.00	0.02
482	600004	白云机场	11,400	82,764.00	0.02
483	603899	晨光股份	4,000	82,520.00	0.02
484	600663	陆家嘴	13,000	81,640.00	0.02
485	600258	首旅酒店	7,400	80,808.00	0.02
486	600859	王府井	8,700	79,866.00	0.02
487	002091	江苏国泰	10,800	78,084.00	0.02
488	300070	碧水源	24,000	76,560.00	0.02
489	000069	华侨城 A	44,400	72,816.00	0.02
490	600864	哈投股份	13,800	71,622.00	0.02
491	301078	孩子王	9,800	66,248.00	0.02
492	002292	奥飞娱乐	9,800	64,288.00	0.02
493	603833	欧派家居	2,000	60,220.00	0.01
494	600325	华发股份	24,300	56,133.00	0.01
495	002891	中宠股份	2,100	56,112.00	0.01
496	002572	索菲亚	6,400	46,720.00	0.01

7.3.2 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

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（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
6	688712	北芯生命	292.00	10,488.64	0.00
7	688785	恒运昌	21.00	9,726.15	0.00
8	688635	长进光子	22.00	6,780.18	0.00
9	301531	春光集团	80.00	4,124.80	0.00
10	301513	尚水智能	40.00	2,038.40	0.00
11	001365	天海电子	62.00	1,941.22	0.00
12	001393	维通利	42.00	1,637.58	0.00
13	601112	振石股份	78.00	1,372.02	0.00
14	603435	嘉德利	23.00	1,074.33	0.00
15	001220	世盟股份	19.00	527.82	0.00
16	603284	林平发展	14.00	488.18	0.00
17	603293	埃泰克	11.00	373.23	0.00
18	001312	福恩股份	22.00	369.16	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	36,642,707.80	16.31
2	300308	中际旭创	29,439,151.00	13.11
3	600519	贵州茅台	29,229,302.00	13.01
4	601318	中国平安	20,739,708.15	9.23
5	300502	新易盛	18,616,645.00	8.29
6	601899	紫金矿业	18,163,240.25	8.09
7	600036	招商银行	16,068,869.00	7.15
8	000333	美的集团	12,496,703.00	5.56
9	600900	长江电力	11,092,837.00	4.94
10	601166	兴业银行	10,330,273.34	4.60
11	002475	立讯精密	9,632,866.59	4.29
12	688256	寒武纪	9,412,482.12	4.19
13	002594	比亚迪	9,235,739.00	4.11
14	603986	兆易创新	9,164,520.00	4.08
15	300059	东方财富	8,945,236.00	3.98
16	600030	中信证券	8,814,582.32	3.92
17	603259	药明康德	8,606,678.00	3.83
18	600276	恒瑞医药	8,371,831.00	3.73
19	688041	海光信息	8,301,562.52	3.70
20	601398	工商银行	7,995,373.00	3.56
21	002371	北方华创	7,913,408.00	3.52
22	300274	阳光电源	7,885,542.00	3.51
23	688981	中芯国际	7,671,509.32	3.42
24	688008	澜起科技	6,958,676.48	3.10
25	601211	国泰海通	6,895,670.00	3.07
26	002384	东山精密	6,561,430.00	2.92
27	601288	农业银行	6,302,251.00	2.81
28	688012	中微公司	6,123,187.82	2.73
29	000858	五 粮 液	6,113,891.28	2.72
30	000725	京东方 A	6,058,687.00	2.70
31	601328	交通银行	6,025,975.00	2.68
32	300476	胜宏科技	5,903,693.00	2.63
33	600887	伊利股份	5,800,801.00	2.58
34	300394	天孚通信	5,786,135.00	2.58
35	000651	格力电器	5,679,673.00	2.53

36	601088	中国神华	5,294,603.16	2.36
37	603993	洛阳钼业	5,163,703.00	2.30
38	600150	中国船舶	5,060,039.29	2.25
39	601816	京沪高铁	4,842,352.00	2.16
40	600309	万华化学	4,815,273.00	2.14
41	000988	华工科技	4,748,144.00	2.11
42	000338	潍柴动力	4,584,036.00	2.04
43	603019	中科曙光	4,569,421.91	2.03
44	600487	亨通光电	4,540,265.00	2.02
45	002463	沪电股份	4,534,915.00	2.02
46	600089	特变电工	4,507,011.00	2.01

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	33,790,194.51	15.04
2	600519	贵州茅台	26,863,797.40	11.96
3	300308	中际旭创	25,341,653.00	11.28
4	601318	中国平安	19,664,535.24	8.75
5	601899	紫金矿业	18,340,441.00	8.16
6	300502	新易盛	15,682,182.00	6.98
7	600036	招商银行	14,579,408.56	6.49
8	000333	美的集团	11,345,391.68	5.05
9	600900	长江电力	9,651,331.00	4.30
10	601166	兴业银行	9,405,568.00	4.19
11	002475	立讯精密	9,256,073.82	4.12
12	002594	比亚迪	8,524,172.97	3.79
13	688256	寒武纪	8,041,946.22	3.58
14	300059	东方财富	8,027,626.00	3.57
15	600030	中信证券	7,971,281.00	3.55
16	600276	恒瑞医药	7,907,890.00	3.52
17	603259	药明康德	7,779,499.00	3.46
18	688041	海光信息	7,199,397.02	3.21
19	601398	工商银行	7,142,726.00	3.18
20	688981	中芯国际	6,331,886.08	2.82
21	601211	国泰海通	6,204,169.22	2.76
22	002371	北方华创	6,042,006.00	2.69
23	300274	阳光电源	5,992,794.00	2.67
24	601288	农业银行	5,908,349.00	2.63
25	000858	五粮液	5,864,346.00	2.61

26	300476	胜宏科技	5,618,096.00	2.50
27	603986	兆易创新	5,532,183.00	2.46
28	601328	交通银行	5,426,930.00	2.42
29	002384	东山精密	5,356,999.00	2.38
30	603993	洛阳钼业	5,197,500.00	2.31
31	600887	伊利股份	5,190,169.96	2.31
32	688008	澜起科技	5,020,674.72	2.24
33	000651	格力电器	4,968,355.00	2.21
34	300394	天孚通信	4,954,134.00	2.21
35	600309	万华化学	4,825,597.00	2.15
36	601088	中国神华	4,777,678.00	2.13

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,005,379,597.94
卖出股票收入（成交）总额	889,648,778.64

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	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
----	----	---------------	------

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	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。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同约定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	21,446,911.67
2	应收清算款	-
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

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末无处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	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

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
金鹰中证 A500 指数发起 A	392	44,615.63	10,000,000.00	57.18%	7,489,325.48	42.82%
金鹰中证 A500 指数发起 C	354	72,529.16	9,878,288.16	38.47%	15,797,035.28	61.53%
金鹰中证 A500 指数发起 B	271	18,948.96	-	-	5,135,169.51	100.00%
金鹰中证 A500 指数发起 D	1,926	147,079.08	-	-	283,274,310.14	100.00%
合计	2,943	112,665.35	19,878,288.16	6.00%	311,695,840.41	94.00%

8.2 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	0.00	0.00%
	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	0.00%
	合计	39.76	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	金鹰中证 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

8.4 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 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰中证 A500 指	金鹰中证 A500 指	金鹰中证 A500 指	金鹰中证 A500
----	-------------	-------------	-------------	-----------

	数发起 A	数发起 C	数发起 B	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	-	-
本报告期期初基金份额总额	28,777,909.73	14,038,761.38	162,413,081.04	66,814.57
本报告期基金总申购份额	9,611,368.84	24,839,344.54	22,235,014.44	985,447,847.01
减: 本报告期基金总赎回份额	20,899,953.09	13,202,782.48	179,512,925.97	702,240,351.44
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
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

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本基金本报告期内未召开基金份额持有人大会，无会议决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本基金报告期内未持有基金。

10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期未改聘会计师事务所。

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

本报告期，管理人未受到调查或处罚。

10.7.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，管理人高级管理人员及相关从业人员未受到调查或处罚。

10.7.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人托管业务部门未受到调查或处罚。

10.7.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚。

10.8 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况**10.8.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况**

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
浙商证券	2	118,375,973.45	6.25%	27,308.95	2.55%	-
中邮证券	2	1,776,305,944.11	93.75%	1,044,758.63	97.45%	-

注：本基金采用证券公司交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金的比例限制。

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

10.8.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易
------	------	--------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
浙商证券	17,599,395.00	17.13%	46,050,000.00	23.49%	-	-
中邮证券	85,123,342.00	82.87%	149,955,000.00	76.51%	-	-

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-13
2	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-01-16
3	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会规定媒介	2026-01-22
4	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年第四季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-01-22
5	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金参与北京汇成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	2026-01-29
6	金鹰基金管理有限公司关于旗下部分基金费率优惠活动的公告	证监会规定媒介	2026-02-12
7	金鹰基金管理有限公司部分基金新增福克斯(北京)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	2026-03-25
8	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	证监会规定媒介	2026-03-31
9	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证监会规定媒介	2026-03-31
10	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-03-31
11	金鹰基金管理有限公司关于网上交易、微信理财宝系统暂停服务的公告	证监会规定媒介	2026-04-02
12	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	证监会规定媒介	2026-04-22

13	金鹰基金管理有限公司旗下基金 2026 年第一季度报告提示性公告	证监会规定媒介	2026-04-22
14	金鹰基金管理有限公司以股东身份(通过公募基金持股)参与股东大会投票信息披露	证监会规定媒介	2026-04-30
15	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暂停机构客户大额申购(含转换转入、定期定额投资)的公告	证监会规定媒介	2026-05-12
16	金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金分红公告	证监会规定媒介	2026-05-14
17	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恢复机构客户大额申购(含转换转入、定期定额投资)的公告	证监会规定媒介	2026-05-18
18	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	2026-05-29
19	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)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
20	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)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
21	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)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
22	金鹰基金管理有限公司关于终止中证金牛(北京)基金销售有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定媒介	2026-05-29
23	金鹰基金管理有限公司关于旗下基金调整长期停牌股票估值方法的公告	证监会规定媒介	2026-06-24

注：相关信息披露文件请通过本基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站及规定报刊查询。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260303-20260309,2	10,000,000.	0.00	0.00	10,000,000.0	3.02%

		0260430-20260515	00			0	
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。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准金鹰中证 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。
- 6、本报告期内在规定媒介公开披露的公告。

12.2 存放地点

广东省广州市天河区珠江新城珠江东路 28 号越秀金融大厦 30 层。

12.3 查阅方式

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

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

金鹰基金管理有限公司

二〇二六年八月三十一日