金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金

2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 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：二〇二六年十月二十七日

§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 10 月 26 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 7 月 1 日起至 9 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	621,990,885.25 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	64,392,542.57 份	215,993,649.47 份	6,459,862.09 份	335,144,831.12 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 7 月 1 日-2026 年 9 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	165,789.84	170,536.66	8,528.63	508,846.10
2. 本期利润	-4,151,864.56	-16,367,319.37	-853,651.59	-52,552,109.13
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0768	-0.1061	-0.1715	-0.1565
4. 期末基金资产净值	68,564,422.69	229,302,167.01	6,868,627.19	351,059,679.04
5. 期末基金份额净值	1.0648	1.0616	1.0633	1.0475

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	-13.33%	1.48%	-14.23%	1.43%	0.90%	0.05%
过去六个月	2.51%	1.41%	-2.62%	1.40%	5.13%	0.01%
过去一年	2.09%	1.24%	-4.10%	1.24%	6.19%	0.00%

自基金合同生效起至今	11.86%	1.08%	20.10%	1.12%	-8.24%	-0.04%

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	-13.37%	1.48%	-14.23%	1.43%	0.86%	0.05%
过去六个月	2.41%	1.41%	-2.62%	1.40%	5.03%	0.01%
过去一年	1.89%	1.24%	-4.10%	1.24%	5.99%	0.00%
自基金合同生效起至今	11.54%	1.08%	20.10%	1.12%	-8.56%	-0.04%

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	-13.33%	1.48%	-14.23%	1.43%	0.90%	0.05%
过去六个月	2.52%	1.41%	-2.62%	1.40%	5.14%	0.01%
过去一年	2.01%	1.24%	-4.10%	1.24%	6.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	11.15%	1.20%	11.09%	1.21%	0.06%	-0.01%

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	-13.33%	1.48%	-14.23%	1.43%	0.90%	0.05%
过去六个月	2.53%	1.41%	-2.62%	1.40%	5.15%	0.01%
过去一年	0.49%	1.24%	-4.10%	1.24%	4.59%	0.00%
自基金合	9.57%	1.20%	11.09%	1.21%	-1.52%	-0.01%

同生效起至今						

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。

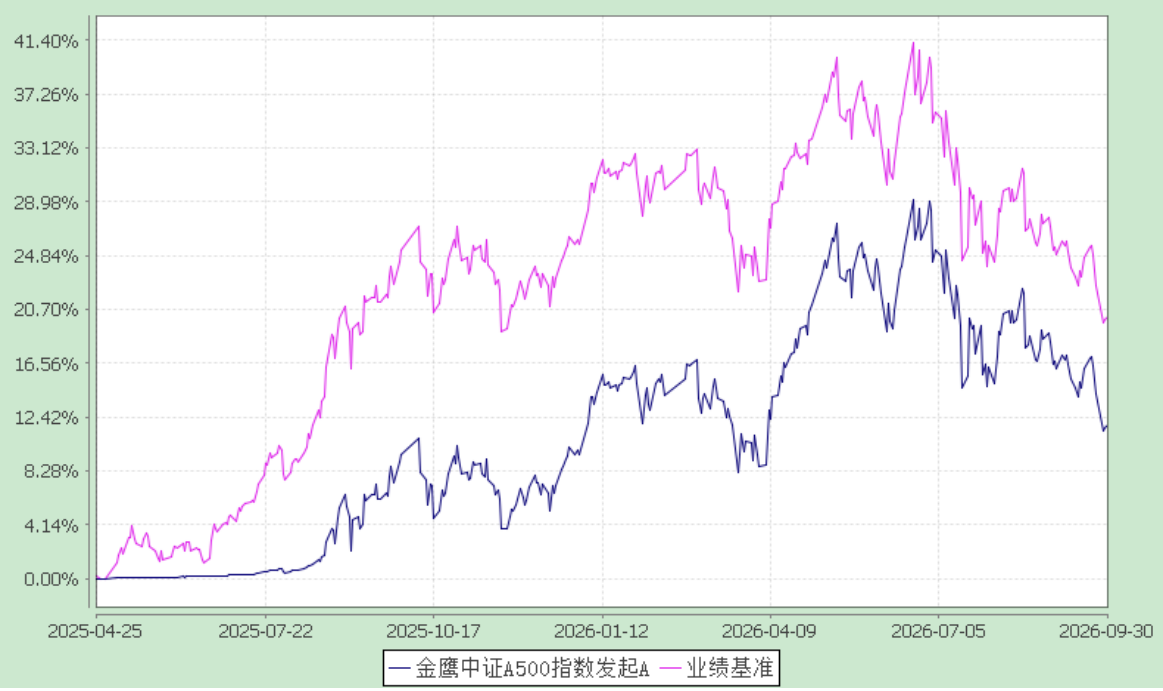
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 9 月 30 日）

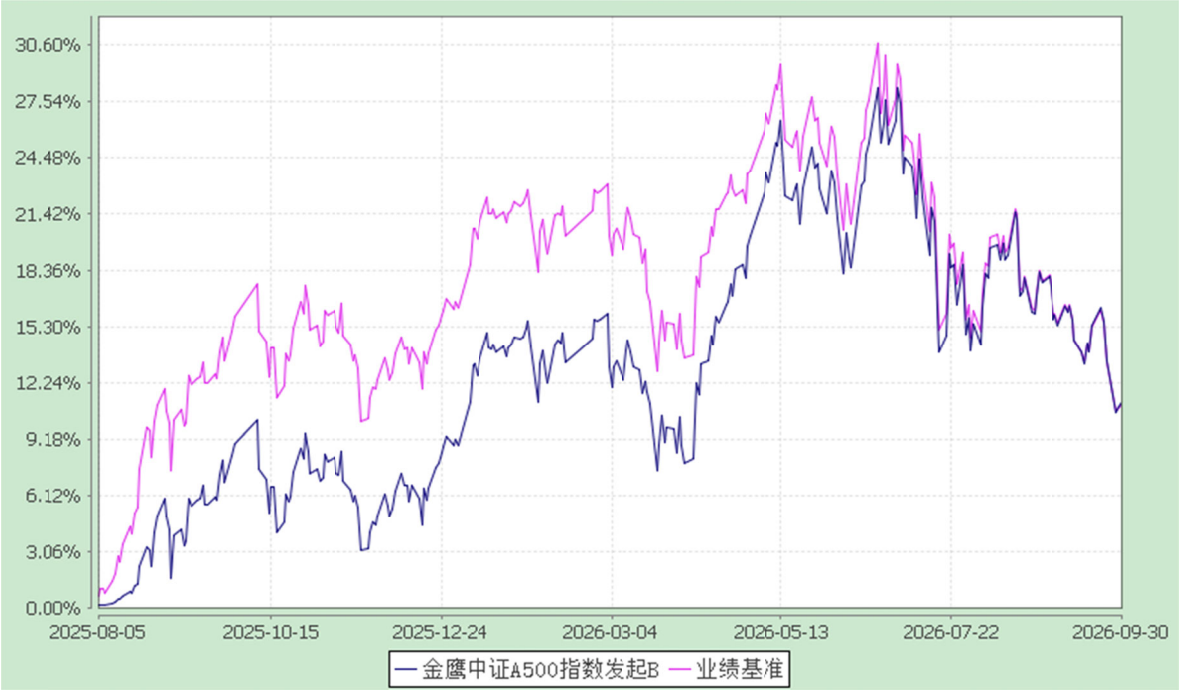
金鹰中证 A500 指数发起 A



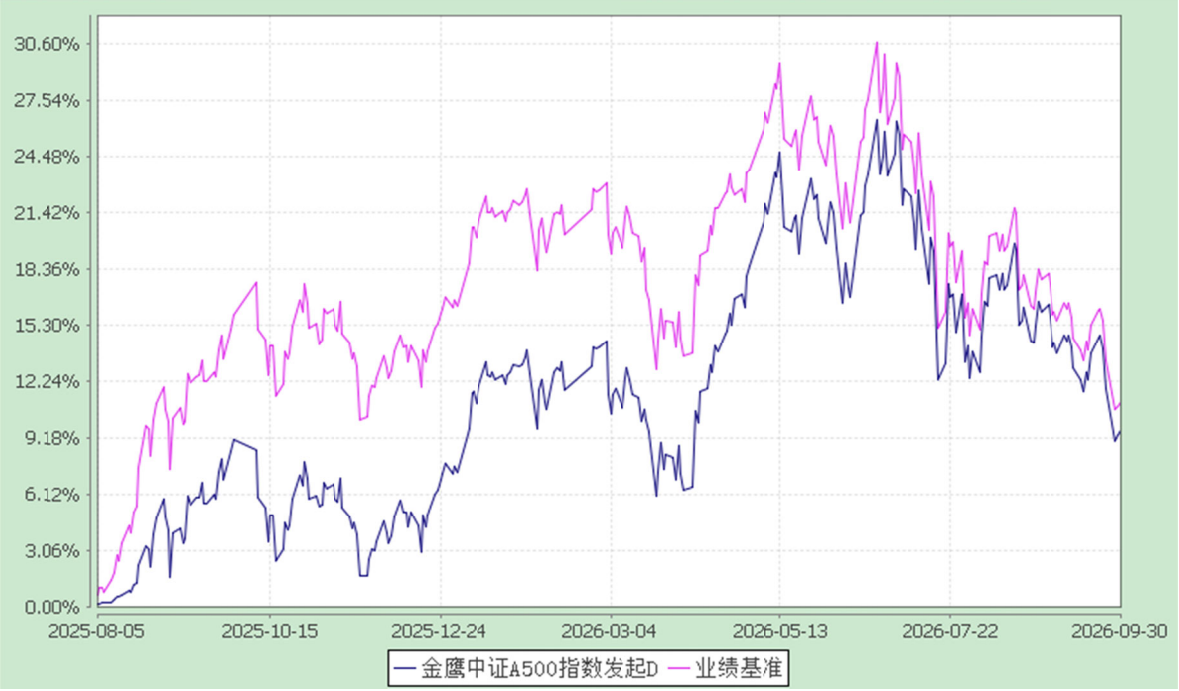
金鹰中证 A500 指数发起 C



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	-	30	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中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 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

回顾三季度，在中东地缘冲突持续发酵并推升全球通胀预期、美联储时隔近 3 年重启加息、以及 A 股上半年极致分化的科技主线进入拥挤交易消化期等多重因素叠加影响下，A 股市场终结了此前的单边上扬，走出一轮回撤幅度比较深、结构剧烈再平衡的调整行情，上证指数回落至 3900 点下方。前期领涨的科技成长方向回撤尤为剧烈，科创 50、创业板指单季跌幅分别达 30.70%和 27.80%，双双创下各自历史单季最大跌幅纪录。其它重要的 A 股指数具体涨跌幅层面，深证成指、中证 500、中证 1000、沪深 300、上证指数及上证 50 三季度涨跌幅分别为-20.47%、-17.67%、-17.15%、-12.49%、-6.16%和-5.56%，整体呈现”越大盘越抗跌、越高估值越承压”的鲜明特征。

申万一级行业中，31 个行业 12 涨 19 跌，且强弱格局跟上半年情形几乎是完全倒转：三季度涨幅排名前 5 的分别为煤炭(19.29%)、石化(15.32%)、农业(15.10%)、银行(14.56%)和医药(10.12%)，季度排名后 5 的分别为机械(-21.11%)、电新(-23.73%)、建材(-26.10%)、通信(-28.72%)和电子(-32.65%)。整体看，上半年风偏最高、涨幅最大的 AI 硬件产业链(电子、通信)出现集体“回吐”，而资源红利、金融地产及部分内需方向(医药、地产)重新跑出正收益，“高低切换”与“新旧动能再平衡”成为三季度市场运行的主线索。

海外方面，三季度全球资产定价的主线由“宽松交易”逆转为“再通胀与再紧缩交易”。中东局势成为最大的边际变量，布伦特原油一度冲高至 110 美元/桶附近，三季度布油、WTI 累计涨幅分别达约 41.98%和 30.10%。油价上行叠加美国 8 月 CPI 同比 3.4%、核心 PCE 同比 3.0%的粘性通胀，最终推动美联储在 9 月加息 25 个基点，为 2024 年 9 月转入降息周期以来政策方向的首次逆转，预计联储年内或还有一次加息。美国债市反应剧烈，10 年期美债收益率于 9 月中旬首度突破 5%，迄今已创出 2007 年以来新高，30 年期一度触及 5.73%，为 2002 年 6 月以来最高，全球风险资产分母端压力显著上升。欧洲央行亦于 9 月加息 25 个基点，日本、英国央行同步转鹰。不过，美国经济基本面仍具韧性，9 月综合 PMI 升至 58.4，AI 资本开支持续演绎，美

股三季度整体仍录得正收益，纳指涨 2.47%、标普 500 涨 2.03%，但道指跌 2.70%，能源、信息技术、医疗保健、通信服务等少数板块收涨，市场宽度明显收敛。

国内经济形势方面，总量数据边际走弱的特征较为清晰。在经历 GDP 一季度 5.0%、二季度 4.3%(上半年合计 4.7%)的逐季回落后，7 月工业增加值、消费、投资等数据同步低于市场预期，内需修复动能偏弱、地产量价仍在寻底、PPI 与 CPI 剪刀差仍大、输入型通胀向下游传导不畅等问题延续。生产法下，市场普遍预计 2026 年三季度的 GDP 增速大致在 4.3%-4.5%，全年增速可能落在年初目标 4.5%-5%的区间偏中下限。结构上看，外需与高技术制造是最为确定的亮点，出口持续偏强、几乎全线产品出口景气，中国继续扮演海外供应链“稳定器”的角色；而消费、地产投资等传统内需方向仍是主要拖累项，需求端修复仍需政策进一步加力。

政策层面的积极变化在季末集中出现。国务院常务会议推出重要增量政策，政策组合拳迅速落地。货币端：央行下调抵押补充贷款(PSL)，水网、新型电网、算力网、新一代通信网、城市地下管网、物流网等“六张网”纳入支持范围；科技创新和技术改造再贷款额度增至 1.4 万亿元、支持比例大幅上调；支农支小再贷款增加 5000 亿元，其中民营企业再贷款增至 1.3 万亿元。财政端：10 月起实施居民购房贷款贴息政策，对符合条件的首套住房商业贷款给予年化 1 个百分点、最长 5 年的财政贴息，单户贴息贷款规模上限 100 万元，这是中央财政首次对商业性个人住房贷款进行贴息；8000 亿元新型政策性金融工具已于 9 月“开闸”，新增地方政府专项债发行进度明显加快。整体看，本轮政策延续“总量克制、结构精准、财政货币协同”的取向，着力点集中于稳投资与稳地产，其对四季度固定资产投资与信贷增速的支撑作用值得观察。

与此同时，中美经贸关系在季度内取得实质性进展。9 月下旬，中美元首实现年内的第二次会晤。期间，中美经贸团队通过经贸磋商，就部分重要产品对等关税下降等达成共识，为四季度及后续的外贸预期注入了更多确定性。年内，预期中美元首还将有两次会晤。中美高层的持续密集沟通为稳定中美关系、降低重大不确定性提供了重要支撑。

从市场运行层面观察，三季度 A 股走出典型的从恐慌性急跌到反弹修复，再到二次缩量探底的三段式行情，交易热度逐月退潮：深沪两市日均成交额由 6 月的约 3.1 万亿元逐月回落，至 9 月到 1.8 万亿元，9 月 29 日单日成交 1.41 万亿元，刷新近 14 个月地量，较年初阶段天量萎缩超 6 成；杠杆资金同步大幅收缩，融资余额季度降幅

13.9%至 9 月末的约 25797 亿元，单季度下降逾 4100 亿元，缩量幅度仅次于 2015 年三季度。值得关注的是，在融资盘撤退的同时，股票 ETF 三季度累计净申购约 4000 亿元、为历史次高水平，资金呈现由高杠杆短线交易向低换手指数化配置的明显“挪移”，投资者结构正在发生边际变化。

具体到 A 股市场方面，考虑到上半年科技成长主线积累了较大涨幅并形成较为拥挤的交易结构，在全球利率中枢上移、国内基本面仍在磨底、增量资金阶段性断档的共同作用下，本轮调整更多是对前期过度集中交易的定价纠偏与情绪修正，而非产业趋势的根本逆转——AI 资本开支超级周期、国产算力商业化落地等中长期逻辑并未被证伪。客观看，在成交与杠杆同步退潮、市场主线尚不明朗的阶段，指数大概率仍将经历一段震荡磨底与筹码消化的过程，等待前期稳增长政策落地见效、企业盈利广谱性改善以及海外紧缩压力缓和等信号的进一步确认。

但从中期维度看，我们对 A 股市场前景继续抱有相对乐观的态度及秉持以下观点：A 股或仍持续行进在修复性上涨的途中，短期深调不改中期趋势；在风格由极致成长向均衡再平衡的过程中，中证 A500 这类兼顾行业均衡与龙头属性的宽基指数，其配置价值有望随市场主线的重新扩散而逐步显现，投资者可利用震荡期从容布局、等待均值回归的红利。

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%。三季度标的指数中证 A500 累计下跌 14.96%，市场整体回撤幅度较大，产品净值亦随之出现较快回落；同时，季度内产品申赎交易较为活跃，申赎行为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 1.0648 元，本报告期份额净值增长率为-13.33%，同期业绩比较基准增长率为-14.23%；C 类基金份额净值为 1.0616 元，本报告期份额净值增长率为-13.37%，同期业绩比较基准增长率为-14.23%；B 类份额净值为 1.0633 元，本报告期份额净值增长率为-13.33%，同期业绩比较基准增长率为

-14.23%；D 类基金份额净值为 1.0475 元，本报告期份额净值增长率为-13.33%，同期业绩比较基准增长率为-14.23%。

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	619,246,506.34	91.24
	其中：股票	619,246,506.34	91.24
2	固定收益投资	23,920,240.63	3.52
	其中：债券	23,920,240.63	3.52
	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	12,577,878.60	1.85
7	其他资产	22,953,717.92	3.38
8	合计	678,698,343.49	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	2,756,827.00	0.42
B	采矿业	35,287,468.00	5.38
C	制造业	397,774,901.13	60.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,465,288.00	2.51
E	建筑业	8,318,950.00	1.27
F	批发和零售业	4,579,477.80	0.70
G	交通运输、仓储和邮政业	16,675,888.75	2.54
H	住宿和餐饮业	342,347.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,599,822.19	5.12
J	金融业	74,149,486.00	11.31
K	房地产业	4,640,556.00	0.71
L	租赁和商务服务业	5,084,282.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	11,579,410.00	1.77
N	水利、环境和公共设施管理业	1,209,568.12	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	249,565.00	0.04
Q	卫生和社会工作	1,356,626.00	0.21
R	文化、体育和娱乐业	545,465.00	0.08
S	综合	1,175,517.00	0.18
	合计	615,791,444.99	93.90

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	3,390.75	0.00
C	制造业	3,084,243.40	0.47
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	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	367,427.20	0.06
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	3,455,061.35	0.53

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	24,500	19,806,780.00	3.02
2	600519	贵州茅台	13,800	17,368,956.00	2.65
3	300750	宁德时代	58,300	16,971,713.00	2.59
4	601318	中国平安	234,500	12,496,505.00	1.91
5	300502	新易盛	30,720	11,950,080.00	1.82
6	600036	招商银行	272,100	11,226,846.00	1.71
7	601899	紫金矿业	361,500	10,769,085.00	1.64
8	603259	药明康德	54,400	9,103,296.00	1.39
9	000333	美的集团	107,000	8,570,700.00	1.31
10	600900	长江电力	270,400	7,717,216.00	1.18

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	688825	长鑫科技	52,631.00	2,034,188.15	0.31
2	688801	燧原科技	1,120.00	367,427.20	0.06
3	688808	联讯仪器	241.00	360,866.17	0.06
4	301660	粤芯半导体	14,705.00	176,607.05	0.03
5	001246	C 力勤	1,190.00	59,607.10	0.01

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	23,920,240.63	3.65
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	23,920,240.63	3.65

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	189,000.00	18,977,821.40	2.89

2	019827	26 国债 01	49,000.00	4,942,419.23	0.75

注：本基金本报告期末仅持有 2 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
IF2610	沪深 300 股指期货 2610 合约	26.00	33,951,840.00	-902,416.67	-
公允价值变动总额合计(元)					-902,416.67
股指期货投资本期收益(元)					-3,595,067.03
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-873,396.67

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	21,776,768.90
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,176,949.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,953,717.92

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	688825	长鑫科技	2,034,188.15	0.31	科创板打新限售
2	688801	燧原科技	367,427.20	0.06	科创板打新限售
3	688808	联讯仪器	360,866.17	0.06	科创板打新限售
4	301660	粤芯半导体	176,607.05	0.03	新股未上市
5	001246	C 力勤	59,607.10	0.01	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	17,489,325.48	25,675,323.44	5,135,169.51	283,274,310.14
报告期期间基金总申购份额	48,686,379.56	208,248,284.46	2,662,730.55	117,723,343.63
减：报告期期间基金总赎回份额	1,783,162.47	17,929,958.43	1,338,037.97	65,852,822.65
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	64,392,542.57	215,993,649.47	6,459,862.09	335,144,831.12

§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（%）	15.53	-	-	-

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	1.61%	10,000,000.00	1.61%	不少于3年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	45,191.61	0.01%	-	-	-
基金管理人	-	-	-	-	-

股东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,045,191.61	1.62%	10,000,000.00	1.61%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

二〇二六年十月二十七日