

金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金 中基金（FOF）

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：青岛银行股份有限公司

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。

基金托管人青岛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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	43
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	43
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	44
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	44
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	44
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	44
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	44
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44

7.12 本报告期投资基金情况	45
7.13 投资组合报告附注	48
§8 基金份额持有人信息	49
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	49
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	49
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	50
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	50
§9 开放式基金份额变动	51
§10 重大事件揭示	51
10.1 基金份额持有人大会决议	51
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	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	51
10.4 基金投资策略的改变	52
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	52
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	52
10.7 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	52
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	52
10.9 其他重大事件	53
§11 影响投资者决策的其他重要信息	54
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	54
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	55
§12 备查文件目录	55
12.1 备查文件目录	55
12.2 存放地点	55
12.3 查阅方式	56

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）			
基金简称	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）			
基金主代码	022199			
交易代码	022199			
基金运作方式	契约型开放式			
基金合同生效日	2025 年 1 月 14 日			
基金管理人	金鹰基金管理有限公司			
基金托管人	青岛银行股份有限公司			
报告期末基金份额总额	238,118,210.62 份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） A	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） C	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） B	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） D
下属分级基金的交易代码	022199	022200	024066	024067
报告期末下属分级基金的份额总额	233,798,377.97 份	2,966,911.48 份	114.01 份	1,352,807.16 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，通过稳定的资产配置和精细化优选基金，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金将综合分析宏观经济环境、货币财政政策、资本市场资金环境以及市场情绪等因素，判断各大类资产所处的运行周期，结合本基金以及各资产类别的风险收益特征，确定组合中各大类资产的配置比例。本基金将根据各类资产风险收益特征的相对变化，适时调整组合中各类资产的配置比例，实现投资组合的动态优化。本基金在大类资产配置的基础上，运用多维度的基金评价体系，结合定性调研和定量分析，优选各个资产类别下的基金产品。
业绩比较基准	中证综合债指数收益率×80%+银行六个月定期存款利率（税后）×20%
风险收益特征	本基金为债券型基金中基金（FOF），由于本基金主要投资于证券投资基金，持有基金的预期风险和预期收益间接成为本基金的预期风险和预期收益。本基金的预期风险与预期收益高于货币市场基金和货币型基金中基金（FOF），低于混合型基金、混合型基金中基金（FOF）、股票型基金和

	股票型基金中基金（FOF）。 本基金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	青岛银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	凡湘平	矫雅馨
	联系电话	020-83936180	0532-88251640
	电子邮箱	csmail@gefund.com.cn	jiaoyaxin@qdbankchina.com
客户服务电话		4006135888	4006696588
传真		020-83282856	0532-81758256
注册地址		广州市南沙区横沥镇汇通二街 2号3212房	山东省青岛市崂山区秦岭路6 号3号楼
办公地址		广州市天河区珠江东路28号越 秀金融大厦30层	山东省青岛市崂山区秦岭路6 号青银大厦
邮政编码		510623	266061
法定代表人		姚文强	景在伦

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）			
	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）A	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）C	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）B	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） D
本期已实现收益	1,275,644.69	115,305.90	12,407.27	3,558.48
本期利润	3,282,019.45	106,546.70	7,393.52	9,835.02
加权平均基金份额本期利 润	0.0417	0.0227	0.0159	0.0493
本期加权平均净值利润率	4.09%	2.24%	1.58%	4.74%
本期基金份额净值增长率	2.71%	2.59%	2.74%	3.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			
	金鹰稳利配置三个 月持有债券发起 （FOF）A	金鹰稳利配置三个 月持有债券发起 （FOF）C	金鹰稳利配置三个 月持有债券发起 （FOF）B	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）D
期末可供分配利润	8,143,785.44	91,877.17	3.01	70,721.25
期末可供分配基金份额利 润	0.0348	0.0310	0.0264	0.0523
期末基金资产净值	241,942,163.41	3,058,788.65	117.02	1,423,528.41
期末基金份额净值	1.0348	1.0310	1.0264	1.0523
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)			
	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）A	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）C	金鹰稳利配置三 个月持有债券发 起（FOF）B	金鹰稳利配置 三个月持有债 券发起（FOF） D
基金份额累计净值增长率	3.48%	3.10%	2.44%	5.02%

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

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A

阶段	份额净值增	份额净值增	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④
----	-------	-------	-------	-------	-----	-----

	长率①	长率标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	2.40%	0.16%	1.02%	0.04%	1.38%	0.12%
过去六个月	2.71%	0.13%	1.74%	0.04%	0.97%	0.09%
过去一年	2.92%	0.09%	1.57%	0.05%	1.35%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.48%	0.08%	2.35%	0.06%	1.13%	0.02%

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	2.34%	0.16%	1.02%	0.04%	1.32%	0.12%
过去六个月	2.59%	0.13%	1.74%	0.04%	0.85%	0.09%
过去一年	2.67%	0.09%	1.57%	0.05%	1.10%	0.04%
自基金合同生效起至今	3.10%	0.08%	2.35%	0.06%	0.75%	0.02%

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	2.44%	0.16%	1.02%	0.04%	1.42%	0.12%
过去六个月	2.74%	0.13%	1.74%	0.04%	1.00%	0.09%
过去一年	2.44%	0.10%	1.57%	0.05%	0.87%	0.05%
自基金合同生效起至今	2.44%	0.09%	2.23%	0.05%	0.21%	0.04%

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	2.41%	0.16%	1.02%	0.04%	1.39%	0.12%
过去六个月	3.00%	0.14%	1.74%	0.04%	1.26%	0.10%
过去一年	3.78%	0.10%	1.57%	0.05%	2.21%	0.05%
自基金合同生效起至今	5.02%	0.10%	2.23%	0.05%	2.79%	0.05%

注：1.本基金自 2025 年 4 月 21 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 4 月 22 日。

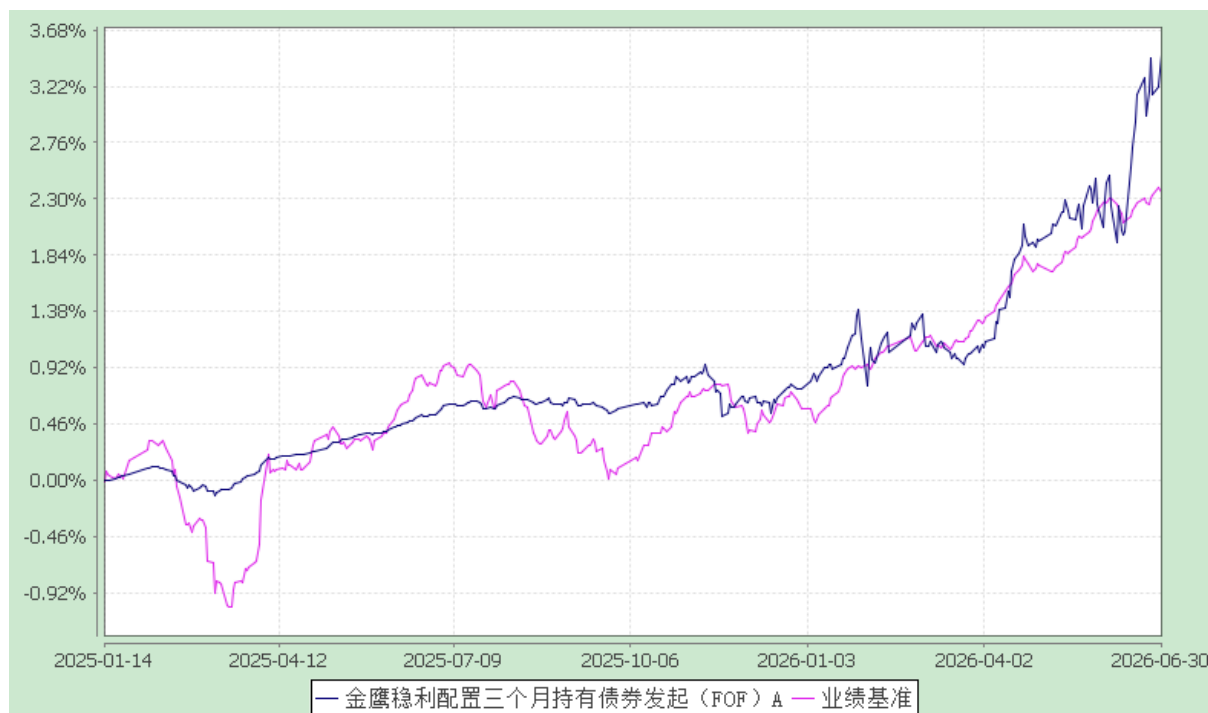
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

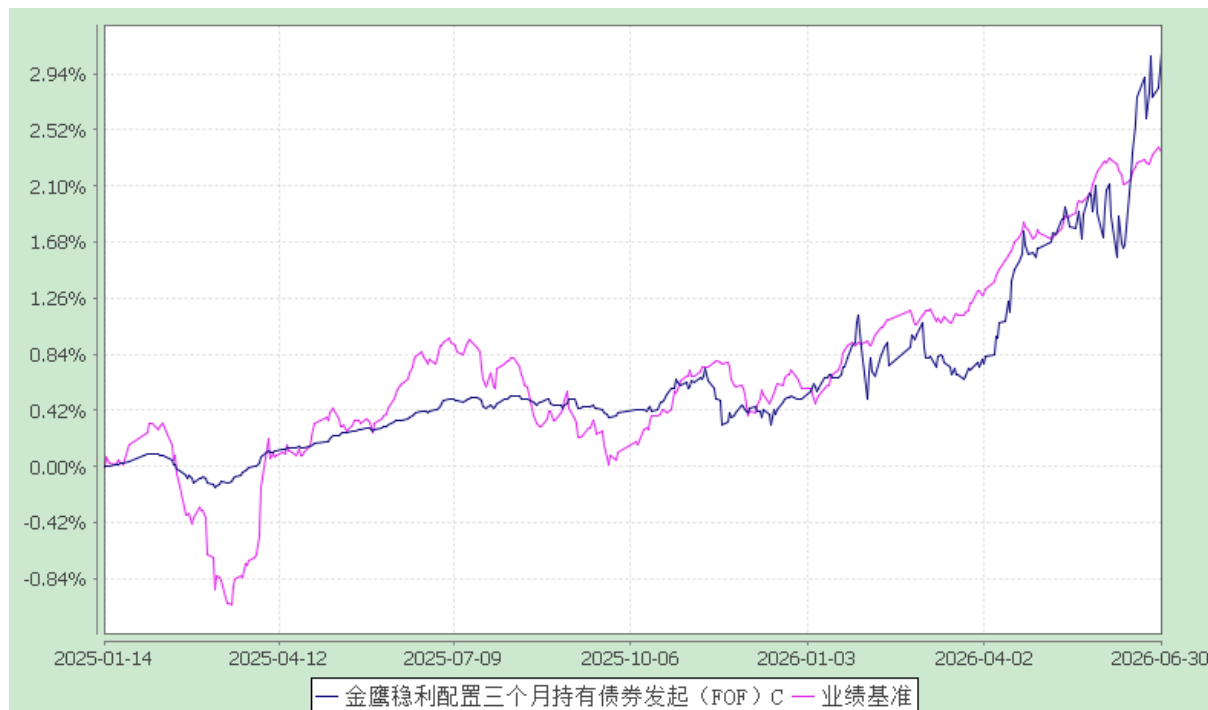
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

（2025 年 1 月 14 日至 2026 年 6 月 30 日）

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A



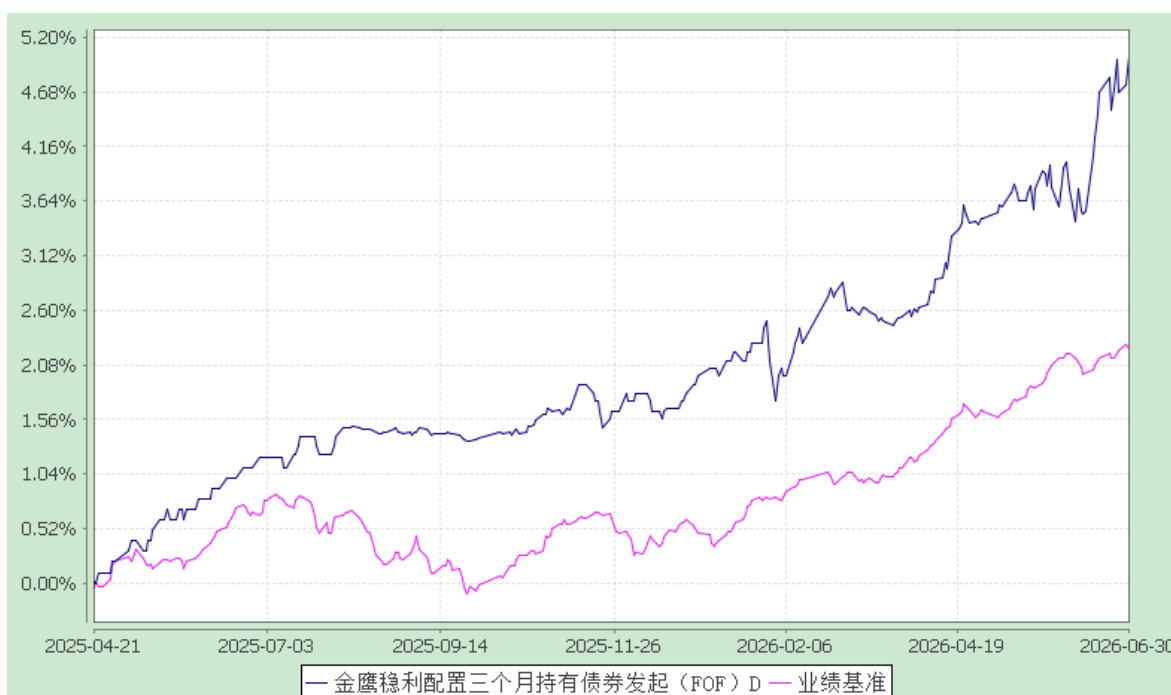
金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C



金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B



金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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：中证综合债指数收益率×80%+银行六个月定期存款利率（税后）×20%。

3.本基金自 2025 年 4 月 21 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 4 月 22 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		
李凯	本基金的基金经理，现任 FOF 投资与金融工程部总经理	2025-01-14	-	13	李凯先生，中山大学经济学博士。历任广发基金管理有限公司金融工程部产品经理、前海开源基金管理有限公司产品开发部副总监。2017 年 10 月加入金鹰基金管理有限公司，曾任产品研发部副总经理、总经理，现任 FOF 投资与金融工程部总经理、基金经理。
陈森	本基金的基金经理助理	2025-01-20	-	7	陈森先生，中国科学技术大学量化金融硕士。2019 年 6 月加入金鹰基金管理有限公司，曾担任产品研发部产品研究员，现任 FOF 投资与金融工程部基金经理助理。

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间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

作为一只追求中低波稳健产品定位的基金，本基金中长期投资策略主要通过优选中长期业绩及回撤控制优秀、胜率高的债券基金进行底仓资产构建，同时辅以一定仓位的权益基金增厚收益。

结合产品定位及市场走势，主要配置纯债基金、低波含权债基，并辅以一定仓位的均衡配置的

权益基金。上半年权益市场，尤其是科技板块震荡上行，本产品积极配置科技相关主动管理基金及二级债基。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2026 年 6 月 30 日，基金 A 类份额净值为 1.0348 元，本报告期份额净值增长为 2.71%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%；C 类份额净值为 1.0310 元，本报告期份额净值增长为 2.59%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%；B 类份额净值为 1.0264 元，本报告期份额净值增长为 2.74%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%；D 类份额净值为 1.0523 元，本报告期份额净值增长为 3.00%，同期业绩比较基准增长率为 1.74%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，国内外 AI 产业发展趋势未变，但围绕核心的 AI 基建资本开支的持续性争议仍较大；海外方面，战争的反复及美联储加息的政策博弈加剧了市场波动。国内权益资产在经历近 2 年上涨后，已从“估值提升”向“盈利驱动”转变，而债券市场大概率仍维持区间震荡状态。本基金坚守中低波稳健产品定位，以期为持有人带来良好的投资体验。

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

本基金本报告期内未进行利润分配。

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，青岛银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

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《中华人民共和国证券投资基金法》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。

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

本报告期内，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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：金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

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	29,878.51	323,876.56
结算备付金		-	1,444,528.74
存出保证金		85,207.79	-
交易性金融资产	6.4.7.2	240,666,130.72	83,525,843.89
其中：股票投资		-	-
基金投资		227,783,503.48	78,975,646.08
债券投资		12,882,627.24	4,550,197.81
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		3,100,000.00	237,271.76
应收股利		-	-
应收申购款		2,681,103.48	10.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	7,796.75	-
资产总计		246,570,117.25	85,531,530.95
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		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,632.60	1,662,994.02
应付管理人报酬		75,185.37	38,175.63
应付托管费		17,665.38	7,635.13
应付销售服务费		645.99	2,167.77
应付投资顾问费		-	-
应交税费		305.90	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		50,084.52	21,000.00
负债合计		145,519.76	1,731,972.55
净资产：			
实收基金		238,118,210.62	83,205,005.87

未分配利润		8,306,386.87	594,552.53
净资产合计		246,424,597.49	83,799,558.40
负债和净资产总计		246,570,117.25	85,531,530.95

注：截至本报告期末 2026 年 6 月 30 日，本基金 A 类基金份额净值为 1.0348 元，A 类基金份额总额为 233,798,377.97 份；B 类基金份额净值为 1.0264 元，B 类基金份额总额为 114.01 份；C 类基金份额净值为 1.0310 元，C 类基金份额总额为 2,966,911.48 份；D 类基金份额净值为 1.0523 元，D 类基金份额总额为 1,352,807.16 份；基金份额总额为 238,118,210.62 份。

6.2 利润表

会计主体：金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

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 1 月 14 日（基 金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,697,948.46	4,355,329.69
1.利息收入		845.56	1,341,306.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	845.56	31,884.81
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		-	1,309,421.76
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,689,486.89	1,076,287.99
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-	-
基金投资收益	6.4.7.11	1,583,040.28	477,051.67
债券投资收益	6.4.7.12	27,498.10	91,533.33
资产支持证券投资收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	78,948.51	507,702.99
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,998,878.35	1,936,676.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	8,737.66	1,058.57
减：二、营业总支出		292,153.77	1,855,030.02
1. 管理人报酬		193,473.34	1,319,076.74
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-

2. 托管费		41,695.49	278,352.43
3. 销售服务费		5,956.73	248,055.09
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		143.70	-
8. 其他费用	6.4.7.21	50,884.51	9,545.76
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,405,794.69	2,500,299.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,405,794.69	2,500,299.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,405,794.69	2,500,299.67

6.3 净资产变动表

会计主体：金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）

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	83,205,005.87	594,552.53	83,799,558.40
二、本期期初净资产	83,205,005.87	594,552.53	83,799,558.40
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	154,913,204.75	7,711,834.34	162,625,039.09
（一）、综合收益总额	-	3,405,794.69	3,405,794.69
（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）	154,913,204.75	4,306,039.65	159,219,244.40
其中：1.基金申购款	212,572,058.02	4,962,516.14	217,534,574.16
2.基金赎回款	-57,658,853.27	-656,476.49	-58,315,329.76

（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	238,118,210.62	8,306,386.87	246,424,597.49
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 14 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	824,313,614.53	-	824,313,614.53
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-576,632,134.89	1,269,162.09	-575,362,972.80
（一）、综合收益总额	-	2,500,299.67	2,500,299.67
（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）	-576,632,134.89	-1,231,137.58	-577,863,272.47
其中：1.基金申购款	8,178,343.84	8,597.30	8,186,941.14
2.基金赎回款	-584,810,478.73	-1,239,734.88	-586,050,213.61
（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	247,681,479.64	1,269,162.09	248,950,641.73

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

金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）（“本基金”）根据中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2024]1243 号《关于准予金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的批复》进行募集，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《金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》（“基金合同”）公开募集，并于 2025 年 1 月 14 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，基金托管人为青岛银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2024 年 12 月 23 日至 2025 年 1 月 10 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 824,313,614.53 元，其中，A 类份额 502,589,416.59 元，C 类份额 321,724,197.94 元。本基金募集资金经大华会计师事务所(特殊普通合伙)验资。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括经中国证监会依法核准或注册的公开募集证券投资基金（以下简称“证券投资基金”，含香港互认基金、QDII 基金、商品基金和公开募集基础设施证券投资基金(以下简称“公募 REITs”)等）、债券（含国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债、金融债、企业债、公司债、证券公司短期公司债、次级债、中期票据、短期融资券、超短期融资券、可转换债券、可交换债券等）、国内依法发行上市的股票（含主板、创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、内地与香港股票市场交易互联互通机制允许买卖的规定范围内的香港联合交易所上市的股票（以下简称“港股通标的股票”）、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

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	29,878.51
等于：本金	29,856.02
加：应计利息	22.49
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	29,878.51

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	-	-	-	-
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所		77,437.24		
	市场	12,804,329.00		12,882,627.24	861.00
	银行间		-		
	市场	-		-	-
	合计	12,804,329.00	77,437.24	12,882,627.24	861.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		224,804,681.00	-	227,783,503.48	2,978,822.48
其他		-	-	-	-
合计		237,609,010.00	77,437.24	240,666,130.72	2,979,683.48

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	7,796.75
待摊费用	-
合计	7,796.75

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	0.01
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	39,671.58
合计	50,084.52

6.4.7.7 实收基金

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	73,581,080.55	73,581,080.55
本期申购	211,087,303.27	211,087,303.27
本期赎回（以“-”号填列）	-50,870,005.85	-50,870,005.85
本期末	233,798,377.97	233,798,377.97

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	8,798,580.79	8,798,580.79
本期申购	131,956.57	131,956.57
本期赎回（以“-”号填列）	-5,963,625.88	-5,963,625.88
本期末	2,966,911.48	2,966,911.48

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	825,331.61	825,331.61
本期申购	1.00	1.00
本期赎回（以“-”号填列）	-825,218.60	-825,218.60

本期末	114.01	114.01
-----	--------	--------

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	12.92	12.92
本期申购	1,352,797.18	1,352,797.18
本期赎回（以“-”号填列）	-2.94	-2.94
本期末	1,352,807.16	1,352,807.16

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

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	859,445.02	-308,247.34	551,197.68
本期期初	859,445.02	-308,247.34	551,197.68
本期利润	1,275,644.69	2,006,374.76	3,282,019.45
本期基金份额交易产生的变动数	6,426,274.60	-2,115,706.29	4,310,568.31
其中：基金申购款	7,412,987.81	-2,513,804.97	4,899,182.84
基金赎回款	-986,713.21	398,098.68	-588,614.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,561,364.31	-417,578.87	8,143,785.44

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	80,957.68	-36,780.92	44,176.76
本期期初	80,957.68	-36,780.92	44,176.76
本期利润	115,305.90	-8,759.20	106,546.70
本期基金份额交易产生的变动数	-99,067.37	40,221.08	-58,846.29
其中：基金申购款	3,528.75	-1,081.51	2,447.24
基金赎回款	-102,596.12	41,302.59	-61,293.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	97,196.21	-5,319.04	91,877.17

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	4,859.23	-5,681.42	-822.19
本期期初	4,859.23	-5,681.42	-822.19
本期利润	12,407.27	-5,013.75	7,393.52
本期基金份额交易产生的变动数	-17,262.99	10,694.67	-6,568.32
其中：基金申购款	0.01	-0.01	0.00
基金赎回款	-17,263.00	10,694.68	-6,568.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3.51	-0.50	3.01

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	0.32	-0.04	0.28
本期期初	0.32	-0.04	0.28
本期利润	3,558.48	6,276.54	9,835.02
本期基金份额交易产生的变动数	72,949.18	-12,063.23	60,885.95
其中：基金申购款	72,949.34	-12,063.28	60,886.06
基金赎回款	-0.16	0.05	-0.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,507.98	-5,786.73	70,721.25

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	493.59
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	-
其他	351.97
合计	845.56

6.4.7.10 股票投资收益

本基金本报告期内无股票投资收益。

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出/赎回基金成交总额	122,192,924.09
减：卖出/赎回基金成本总额	120,587,729.02

减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	845.50
减：交易费用	21,309.29
基金投资收益	1,583,040.28

6.4.7.12 债券投资收益**6.4.7.12.1 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	28,201.24
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-703.14
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	27,498.10

6.4.7.12.2 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	6,670,780.93
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,598,298.56
减：应计利息总额	69,766.93
减：交易费用	3,418.58
买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-703.14

6.4.7.13 资产支持证券投资收益**6.4.7.13.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入**

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.16 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	-
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	78,948.51
合计	78,948.51

6.4.7.17 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	1,998,878.35
——股票投资	-
——债券投资	-2,310.44
——资产支持证券投资	-
——基金投资	2,001,188.79
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	1,998,878.35

6.4.7.18 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	-
其他	8,737.66
合计	8,737.66

6.4.7.19 持有基金产生的费用

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
当期持有基金产生的应支付销售服务 费（元）	47,098.90
当期持有基金产生的应支付管理费 （元）	138,238.45
当期持有基金产生的应支付托管费	35,369.08

（元）	
-----	--

注：当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.21 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	39,671.58
证券出借违约金	-
其他项目	800.00
合计	50,884.51

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
青岛银行股份有限公司	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 基金交易

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基金交易。

6.4.10.1.6 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1月14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	193,473.34	1,319,076.74
其中：应支付销售机构的客户维护费	84,526.59	647,543.39
应支付基金管理人的净管理费	108,946.75	671,533.35

注：本基金基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金的部分不收取管理费。本基金的管理费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金部分所对应资产后剩余部分的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

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扣除基金财产中持有的基金管理人自身管理的基金部分所对应资产净值后剩余部分，若为负数，则 E 取 0

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，自动在次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、公休假等，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1月14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	41,695.49	278,352.43

注：本基金基金财产中持有的本基金托管人自身托管的基金的部分不收取托管费。本基金的托管费按前一日基金资产净值扣除基金财产中持有的基金托管人自身托管的基金部分所对应资产后剩余部分的 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扣除基金财产中持有的基金托管人自身托管的基金部分所对应资产后剩余部分，若为负数，则 E 取 0

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，自动在次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、公休假等，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				
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	合计
金鹰基金管理有限公司	-	0.17	-	-	0.17
合计	-	0.17	-	-	0.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年1月14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				
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	合计
金鹰基金管理有限公司	-	3.16	-	-	3.16
合计	-	3.16	-	-	3.16

注：本基金 A、B、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 0.25%年费率计提。销售服务费的计算方法如下：

$H=E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$

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，自动在次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径进行支付。若遇法定节假日、公休假等，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1月14日（基金合同生效日）至2025年6月30日			
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D
基金合同生效日（2025 年 1 月 14 日）持有的基金份额	-	-	-	-	10,000,416.71	-	-	-
期初持有的基金份额	10,000,416.71	-	-	-	-	-	-	-
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	10,000,416.71	-	-	-	10,000,416.71	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.28%	-	-	-	5.15%	-	-	-

注：本基金合同生效日为 2025 年 1 月 14 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

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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。

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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。

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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。

金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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1月14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
青岛银行股份有限公司	29,878.51	493.59	3,654,573.14	14,839.06

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

本报告期末（2026 年 6 月 30 日），本基金持有基金管理人金鹰基金管理有限公司所管理的基金合计 43,948,044.73 元，占本基金资产净值的比例为 17.83%。

6.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

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 1 月 14 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日
当期交易基金产生的申购费（元）	-	-
当期交易基金产生的赎回费（元）	-	-
当期持有基金产生的应支付销售服务费（元）	8,728.05	1,058.57
当期持有基金产生的应支付管理费（元）	12,214.92	48,244.97
当期持有基金产生的应支付托管费（元）	3,536.23	12,419.82

注：1.当期持有基金产生的应支付销售服务费、应支付管理费、应支付托管费按照被投资基金基金合同约定已作为费用计入被投资基金的基金份额净值，上表列示金额为按照本基金对被投资基金的实际持仓情况根据被投资基金基金合同约定的相应费率计算得出。

2.根据相关法律法规及本基金合同的约定，基金管理人不得对基金中基金财产中持有的自身管理的基金部分收取基金中基金的管理费，基金托管人不得对基金中基金财产中持有的自身托管的基金部分收取基金中基金的托管费。基金管理人运用本基金财产申购自身管理的其他基金的（ETF 除外），应当通过直销渠道申购且不收取申购费、赎回费（按照相关法规、基金招募说明书约定应当收取，并计入基金资产的赎回费用除外）、销售服务等销售费用，其中申购费、赎回费在实际申购、赎回时按上述规定执行，销售服务费由本基金管理人从被投资基金收取后返还至本基金基金资产。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

本基金本报告期末无因认购新发/增发而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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 日止，本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本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	上年度末

	2026年6月30日	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	-	-
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。

6.4.13.2.5 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	29,878.51	-	-	-	29,878.51
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	85,207.79	-	-	-	85,207.79
交易性金融资产	12,882,627.24	-	-	227,783,503.48	240,666,130.72
买入返售金融资	-	-	-	-	-

产					
应收证券清算款	-	-	-	3,100,000.00	3,100,000.00
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	2,681,103.48	2,681,103.48
其他资产	-	-	-	7,796.75	7,796.75
资产总计	12,997,713.54	-	-	233,572,403.71	246,570,117.25
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,632.60	1,632.60
应付管理人报酬	-	-	-	75,185.37	75,185.37
应付托管费	-	-	-	17,665.38	17,665.38
应付销售服务费	-	-	-	645.99	645.99
应交税费	-	-	-	305.90	305.90
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	50,084.52	50,084.52
负债总计	-	-	-	145,519.76	145,519.76
利率敏感度缺口	12,997,713.54	-	-	233,426,883.95	246,424,597.49
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	1,768,405.30	-	-	-	1,768,405.30
结算备付金	-	-	-	-	-
存出保证金	-	-	-	-	-
交易性金融资产	4,550,197.81	-	-	78,975,646.08	83,525,843.89
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	237,271.76	237,271.76
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	10.00	10.00
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	6,318,603.11	-	-	79,212,927.84	85,531,530.95

负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	1,662,994.02	1,662,994.02
应付管理人报酬	-	-	-	38,175.63	38,175.63
应付托管费	-	-	-	7,635.13	7,635.13
应付销售服务费	-	-	-	2,167.77	2,167.77
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	21,000.00	21,000.00
负债总计	-	-	-	1,731,972.55	1,731,972.55
利率敏感度缺口	6,318,603.11	-	-	77,480,955.29	83,799,558.40

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	上年度末
		2026 年 6 月 30 日	2025 年 12 月 31 日
	利率上升 25 个基点	-16,798.62	-467.44
	利率下降 25 个基点	16,907.22	467.63

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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净	公允价值	占基金资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	-	-	-	-
交易性金融资产—基金投资	227,783,503.48	92.44	78,975,646.08	94.24
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	227,783,503.48	92.44	78,975,646.08	94.24

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	227,783,503.48	78,975,646.08
第二层次	12,882,627.24	4,550,197.81
第三层次	-	-
合计	240,666,130.72	83,525,843.89

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股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会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股票的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

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	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	227,783,503.48	92.38
3	固定收益投资	12,882,627.24	5.22
	其中：债券	12,882,627.24	5.22
	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	29,878.51	0.01
8	其他各项资产	5,874,108.02	2.38
9	合计	246,570,117.25	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

本基金本报告期末未持有股票。

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所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期末未持有股票。

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	12,882,627.24	5.23
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	12,882,627.24	5.23
----	----	---------------	------

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	019827	26 国债 01	48,000.00	4,831,113.21	1.96
2	019835	26 国债 09	41,000.00	4,106,747.59	1.67
3	019792	25 国债 19	22,000.00	2,223,303.12	0.90
4	019785	25 国债 13	17,000.00	1,721,463.32	0.70

注：本基金本报告期末仅持有 4 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

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.12 本报告期投资基金情况

7.12.1 投资政策及风险说明

一、投资政策。

本基金在大类资产配置的基础上，运用多维度的基金评价体系，结合定性调研和定量分析，优选各个资产类别下的基金产品。

1、基金产品评价

（1）业绩评价：主要运用量化方法分析所有适选基金在不同市场下的历史业绩表现，具体指标如下：

1）收益指标：包括绝对收益、相对收益等指标；

2）风险指标：包括波动率、最大回撤等指标；

3）风险调整后收益指标：包括 Sharpe 比率、信息比率、Jensen 指数、Treynor 指数、Sortino 比率等指标。

（2）业绩归因：通过对基金在择时能力、资产配置能力、选券能力等多方面的归因分析，对其收益来源进行解释，评估其收益的可持续性和稳定性。

（3）风格识别：通过定量和定性分析相结合的方式，判断基金的投资风格，并持续考察基金风格是否清晰、稳定。

2、基金公司评价

本基金将结合各个渠道获取的信息对基金公司整体实力、整体投研能力和风险控制能力等方面进行综合评价。

3、子基金组合构建

本基金将依据产品评价结果，筛选各类型产品中表现优异的产品进入基础库，并在此基础上，结合基金公司评价结果、基金评价深度报告、调研报告等，进一步精选基金进入重点库。本基金将在基础库和重点库中优选标的，构建子基金组合，并定期不定期维护，动态调整子基金组合。

二、风险说明。

主要投资于基金所面临的特有风险。本基金是基金中基金，投资于其他基金的比例不低于本基金资产的 80%，被投资基金的净值变化将影响到本基金的业绩表现，被投资基金的相关风险会直接或间接成为本基金的风险。相关风险包括但不限于：

1、被投资基金的业绩风险。本基金投资于其他基金的比例不低于基金资产的 80%，因此本基金投资目标的实现建立在被投资基金本身投资目标实现的基础上。如果由于被投资基金未能实现投

资目标，则本基金存在达不成投资目标的风险。

2、赎回资金到账时间较晚的风险。基金赎回的资金交收效率慢于基础证券市场交易的证券，因此本基金赎回款实际到达投资者账户的时间可能晚于普通境内开放式基金，存在对投资者资金安排造成影响的风险。

3、双重收费风险。本基金的投资范围包含全市场基金，投资于非本基金管理人管理的其他基金时，存在本基金与被投资基金各类基金费用的双重收取情况，相较于其他基金产品存在额外增加投资者投资成本的风险。

4、可上市交易基金的二级市场投资风险。本基金可通过二级市场进行 ETF、LOF、封闭式基金的买卖交易，由此可能面临交易量不足所引起的流动性风险、交易价格与基金份额净值之间的折溢价风险以及被投资基金暂停交易或退市的风险等。

5、被投资基金的运作风险。具体包括基金投资风格漂移风险、基金经理变更风险、基金实际运作风险以及基金产品设计开发创新风险等。此外，封闭式基金到期转开放、基金清算、基金合并等事件也会带来风险。虽然本基金管理人将会从基金风格、投资能力、管理团队、实际运作情况等多方面精选基金投资品种，但无法完全规避基金运作风险。

6、被投资基金的相关政策风险。本基金主要投资于各类其他基金，如遇国家金融政策发生重大调整，导致被投资基金的基金管理人、基金投资操作、基金运作方式发生较大变化，可能影响本基金的收益水平。

7.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有基金投资明细

序号	基金代码	基金名称	运作方式	持有份额 (份)	公允价值 (元)	占基金资 产净值比 例(%)	是否属于基金 管理人及管理 人关联方所管 理的基金
1	005011	金鹰添瑞 中短债债 券 C	契约型开 放式	17,113,92 8.46	18,012,40 9.70	7.31	是
2	013863	财通多利 纯债债券 C	契约型开 放式	14,698,65 3.44	16,754,99 5.06	6.80	否
3	018445	东财瑞利 债券 C	契约型开 放式	14,718,98 4.07	16,218,84 8.55	6.58	否
4	020636	鹏华丰恒 债券 C	契约型开 放式	15,017,56 6.99	15,510,14 3.19	6.29	否
5	020089	广发纯债 债券 E	契约型开 放式	11,859,18 2.49	14,820,42 0.36	6.01	否
6	015932	金鹰恒润	契约型开	12,345,26	14,592,10	5.92	是

		债券 C	放式	9.19	8.18		
7	020286	中证兴业 中高等级 信用债指 数 C	契约型开 放式	10,770,35 8.76	12,965,35 7.88	5.26	否
8	019191	富国纯债 债券 E	契约型开 放式	10,676,78 3.08	11,983,62 1.33	4.86	否
9	020244	大摩优质 信价纯债 债券 E	契约型开 放式	10,475,00 6.42	11,972,93 2.34	4.86	否
10	006390	金鹰添祥 中短债债 券 C	契约型开 放式	10,161,71 8.94	11,343,52 6.85	4.60	是
11	202110	南方润元 纯债债券 C	契约型开 放式	8,379,478. 64	10,566,52 2.57	4.29	否
12	022229	富国兴利 增强债券 E	契约型开 放式	4,978,118. 28	9,616,231. 08	3.90	否
13	021798	财通稳裕 回报债券 C	契约型开 放式	8,028,032. 41	9,142,323. 31	3.71	否
14	013149	鹏华双债 加利债券 C	契约型开 放式	5,232,213. 97	7,128,891. 53	2.89	否
15	017623	同泰恒盛 债券 C	契约型开 放式	5,630,044. 81	6,262,298. 84	2.54	否
16	003429	中证兴业 中高等级 信用债指 数 A	契约型开 放式	5,206,808. 45	6,232,549. 71	2.53	否
17	018877	兴合先进 制造混合 C	契约型开 放式	1,638,166. 02	4,959,056. 18	2.01	否
18	050123	博时天颐 债券 C	契约型开 放式	2,757,061. 79	4,809,694. 29	1.95	否
19	015947	兴业研究 精选混合 C	契约型开 放式	1,743,745. 72	4,723,632. 78	1.92	否
20	270049	广发纯债 债券 C	契约型开 放式	3,452,436. 00	4,300,354. 28	1.75	否
21	202108	南方润元 纯债债券 A/B	契约型开 放式	2,873,426. 31	3,779,417. 63	1.53	否

22	003280	鹏华丰恒债券 A	契约型开放式	3,374,570.32	3,683,680.96	1.49	否
23	018444	东财瑞利债券 A	契约型开放式	2,587,104.30	2,868,322.54	1.16	否
24	000143	鹏华双债加利债券 A	契约型开放式	1,059,290.13	2,415,605.21	0.98	否
25	017622	同泰恒盛债券 A	契约型开放式	1,903,492.71	2,260,397.59	0.92	否
26	020709	同泰恒盛债券 D	契约型开放式	724,285.57	860,161.54	0.35	否

注：由于本基金投资的基金 T 日的基金份额净值在 T+1 或 T+2 工作日内公告，一般情况下，本基金 T 日的基金份额净值和基金份额累计净值在 T+3 工作日内公告（T 日为估值日）。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 本基金本报告期没有投资股票，因此不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况。

7.13.3 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	85,207.79
2	应收清算款	3,100,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,681,103.48
6	其他应收款	7,796.75
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,874,108.02

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.13.6 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
金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	2,629	88,930.54	10,000,417.70	4.28%	223,797,960.27	95.72%
金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	258	11,499.66	-	-	2,966,911.48	100.00%
金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	4	28.50	-	-	114.01	100.00%
金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	34	39,788.45	-	-	1,352,807.16	100.00%
合计	2,925	81,407.94	10,000,417.70	4.20%	228,117,792.92	95.80%

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	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	20.02	0.00%
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	10.01	0.00%
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	9.98	8.75%
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	9.98	0.00%
	合计	49.99	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	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	0
	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）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	10,000,416.71	4.20%	10,000,416.71	4.20%	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	10,000,416.71	4.20%	10,000,416.71	4.20%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）A	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）C	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）B	金鹰稳利配置三个月持有债券发起（FOF）D
基金合同生效日（2025 年 1 月 14 日）基金份额总额	502,589,416.59	321,724,197.94	-	-
本报告期期初基金份额总额	73,581,080.55	8,798,580.79	825,331.61	12.92
本报告期基金总申购份额	211,087,303.27	131,956.57	1.00	1,352,797.18
减：本报告期基金总赎回份额	50,870,005.85	5,963,625.88	825,218.60	2.94
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	233,798,377.97	2,966,911.48	114.01	1,352,807.16

§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

- 1.本报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

2.本报告期内无涉及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

本基金持有的基金在本报告期未发生重大影响事件。

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，基金托管人未受监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受监管部门调查或处罚。

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	
金融街证券	4	-	-	7,255.25	100.00%	-

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
金融街证券	17,006,813.00	100.00%	-	-	-	-	40,848,351.10	100.00%

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	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)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	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)2025 年年度报告	证监会规定媒介	2026-03-31
8	金鹰基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况(2025 年度)	证监会规定媒介	2026-03-31
9	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
10	金鹰基金管理有限公司关于网上交易、微信理	证监会规定媒介	2026-04-02

	财宝系统暂停服务的公告		
11	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)2026 年第 1 季度报告	证监会规定媒介	2026-04-22
12	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
13	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
14	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)(金鹰稳利配置三个月持有债券发起(FOF)A)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
15	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)(金鹰稳利配置三个月持有债券发起(FOF)C)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
16	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)(金鹰稳利配置三个月持有债券发起(FOF)B)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
17	金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金(FOF)(金鹰稳利配置三个月持有债券发起(FOF)D)基金产品资料概要更新	证监会规定媒介	2026-05-29
18	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
19	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	20260305-20260515	10,000,416.71	0.00	0.00	10,000,416.71	4.20%
个人	1	20260305-20260326	10,000,784.44	0.00	10,000,784.44	0.00	0.00%
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、中国证监会准予金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）注册的文件。
- 2、《金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）基金合同》。
- 3、《金鹰稳利配置三个月持有期债券型发起式基金中基金（FOF）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