

金鹰中证 A500 指数型发起式证券投资基金
2025 年第 3 季度报告

2025 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：二〇二五年十月二十八日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 10 月 27 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 2025 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 总额 | 34,890,362.13 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 |

| | | | | |
|-----------------|---|------------------|------------------|------------------|
| | 整体基金投资组合，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 \times 95% + 银行活期存款利率(税后) \times 5% | | | |
| 风险收益特征 | <p>本基金为股票型基金，预期风险和预期收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p> <p>本基金资产可投资于港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。</p> | | | |
| 基金管理人 | 金鹰基金管理有限公司 | | | |
| 基金托管人 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 金鹰中证 A500 指数发起 A | 金鹰中证 A500 指数发起 C | 金鹰中证 A500 指数发起 B | 金鹰中证 A500 指数发起 D |
| 下属分级基金的交易代码 | 023333 | 023334 | 025125 | 025126 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 30,189,104.06 份 | 3,284,837.38 份 | 19.88 份 | 1,416,400.81 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 | |
|--------|----------------------------------|--|
| | (2025 年 7 月 1 日-2025 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 | 3,550,540.52 | 549,887.14 | 1.77 | 10,282.71 |
| 2. 本期利润 | 7,070,029.64 | 546,840.10 | 1.77 | 33,754.59 |
| 3. 加权平均基 金份额本期利 润 | 0.0445 | 0.0559 | 0.0890 | 0.1187 |
| 4. 期末基金资 产净值 | 33,077,477.96 | 3,595,776.41 | 21.77 | 1,552,422.60 |
| 5. 期末基金份 额净值 | 1.0957 | 1.0947 | 1.0951 | 1.0960 |

- 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；
- 4、本基金合同于 2025 年 4 月 25 日生效。

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 | 9.32% | 0.72% | 20.20% | 0.89% | -10.88% | -0.17% |
| 自基金合 同生效起 至今 | 9.57% | 0.57% | 25.23% | 0.78% | -15.66% | -0.21% |

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 | 9.26% | 0.72% | 20.20% | 0.89% | -10.94% | -0.17% |
| 自基金合 同生效起 至今 | 9.47% | 0.57% | 25.23% | 0.78% | -15.76% | -0.21% |

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 |
|--------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 自基金合 同生效起 至今 | 8.95% | 0.92% | 15.83% | 1.03% | -6.88% | -0.11% |

金鹰中证 A500 指数发起 D

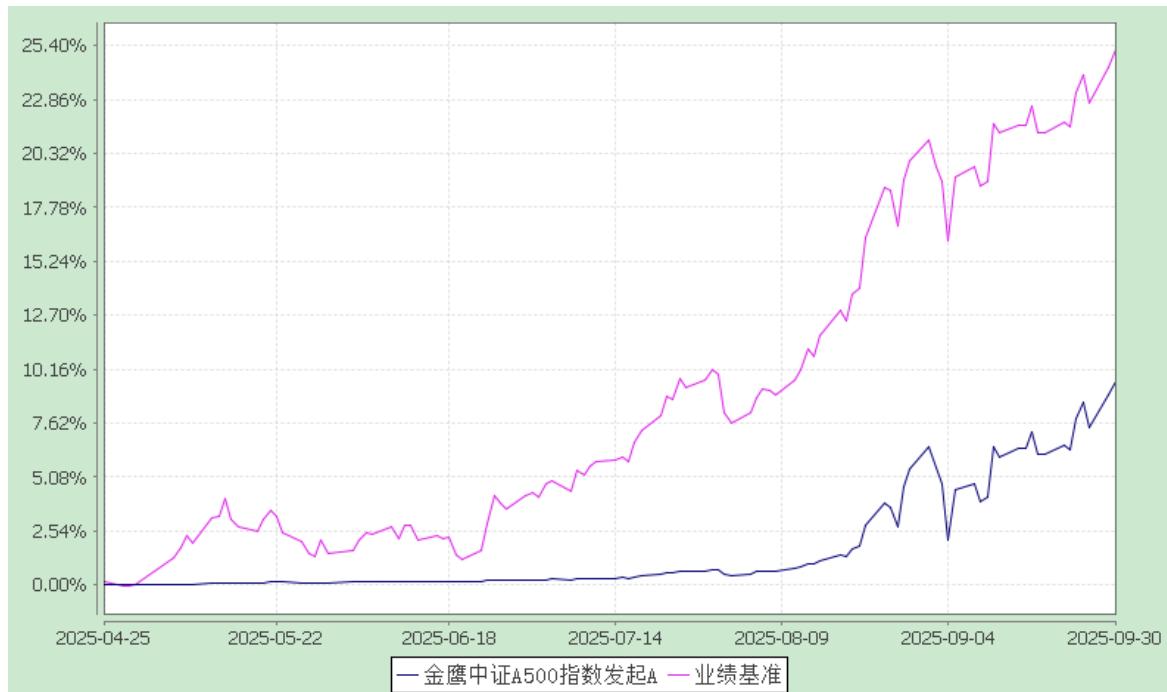
| 阶段 | 净值增长 率① | 净值增长 率标准差 ② | 业绩比较 基准收益 率③ | 业绩比较 基准收益 率标准差 ④ | ①-③ | ②-④ |
|--------------------|------------|-------------------|--------------------|---------------------------|--------|--------|
| 自基金合 同生效起 至今 | 9.04% | 0.91% | 15.83% | 1.03% | -6.79% | -0.12% |

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。

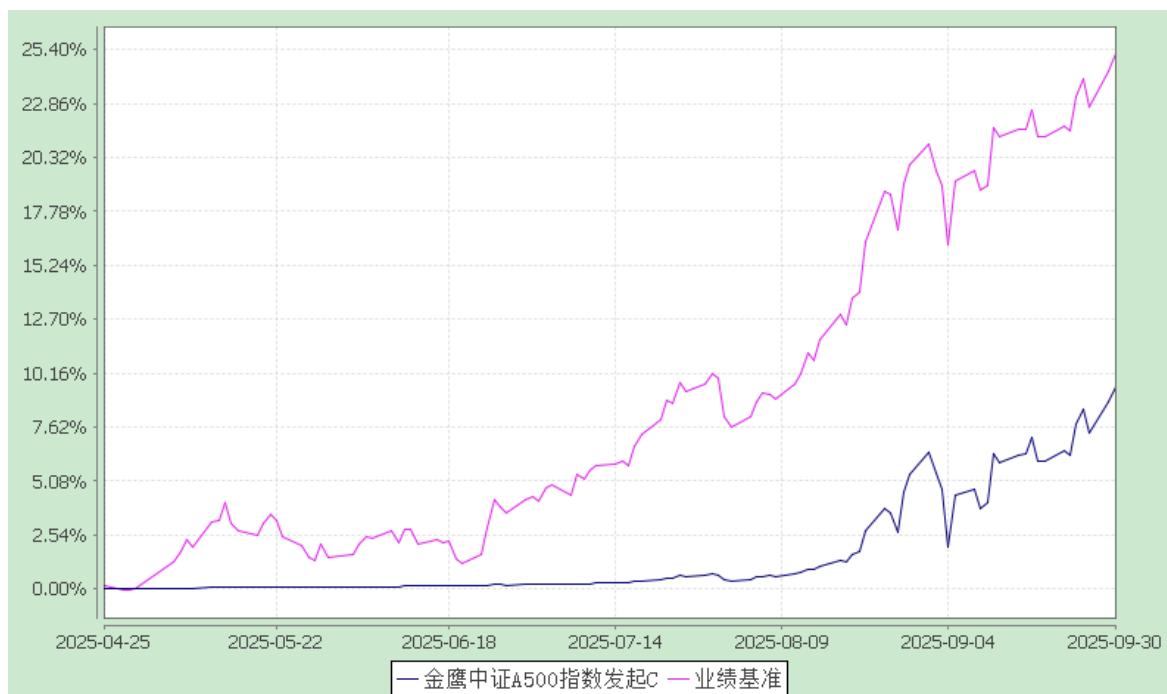
3.2.2 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变 动的比较

**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 2025 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.本基金合同于 2025 年 4 月 25 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2.按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定；本报告期本基金处于建仓期内。

3.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%。

4. 本基金自 2025 年 8 月 5 日起增设 B 类、D 类基金份额，B 类、D 类基金份额首次确认日为 2025 年 8 月 6 日。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|-------------------|-------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 杨刚 | 本基金的基金经理，公司首席经济学家 | 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、基金经理。 |

注：1、基金的首位基金经理，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；对此后的非首位基金经理，“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，在美联储降息预期升温、中美关系进入阶段缓和期及场外资金加快入市等多重利多因素共振下，A 股市场走出了月线三连阳的强劲走势，上证指数“兵临”3900 点且创出 10 年内新高。科创板表现出色，科创 50 单季涨幅 49%。

其它重要的 A 股指数具体涨幅层面，上证指数、沪深 300 指数及创业板指三季度涨幅分别为 12.73%、17.90% 和 50.40%。

而在申万一级行业中，三季度涨幅排名前 5 的分别为通信（48.65%）、电子（47.60%）、电新（44.67%）、有色（41.82%）和综合（32.77%），季度排名后 5 的分别为饮食（2.44%）、公用（2.15%）、石化（1.76%）、交运（0.61%）和银行（-10.19%）。整体看，行业风偏较高的 TMT、新能源、有色金属等涨幅领先，而传统的蓝筹防御型板块排名显著落后。

国内经济形势方面，客观讲，基本面修复仍待继续加力。在经历上半年相对较好

的总量数据表现（25 年 1 季度的 GDP 增速 5.4%、2 季度为 5.2%，上半年 5.3%，阶段性超越全年 5% 的 GDP 增速目标）之后，下半年的经济增长降速在市场的普遍预期之中。不过，3 季度持续下行的较多重要总量数据指标仍引发市场的较多关注。结构上看，工增、消费、投资等数据均表现较弱，明显体现“抢出口”弱化、补贴退坡及反内卷等诸多因素的影响。此外，固投保持加速下行，地产量价仍未企稳。生产法下，预计 25 年 3 季度的 GDP 增速大致在 4.7%-4.8%。经济下行过程中，基本面仍将对大多数顺周期方向产生拖累（需求端数据更弱），基本面相对较好的是反内卷相关的上游行业（供给侧逻辑）。

9 月底出台的 5000 亿创新型金融工具，预计将对国内经济中短期的持续修复带来一定催化。此外，将于 4 季度召开的四中全会（研究制定“十五五”规划建议）、美联储的持续降息及大国关系的可能演进等，预计也将从相关产业、进出口、市场利率、投资者情绪等多个层次对经济基本面及股市产生新的重要影响。

具体到 A 股市场方面，考虑到股指在半年左右时间內已涨逾 800 点（最大累计涨幅 28%+），投资者乐观情绪与 A 股走势期待相左、股市良好表现与经济基本面走势有一定“温差”，以及全球地缘政经仍存在较多不确定性等因素，不排除此轮“非典型修复”的股市有可能进入阶段震荡期以消化近期较大涨幅并等待基本面修复的进一步跟随。

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 股仍持续行进在修复性上涨的途中，短期波动不改变中期趋势；投资者可利用震荡期，积极选择优质方向逢低布局价值成长。

三季度，考虑到 A 股市场层面较大的积极变化，本基金的权益仓位快速提升，净值开始出现较快上涨。

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 1.0957 元，本报告期份额净值增长率为 9.32%，同期业绩比较基准增长率为 20.20%；C 类基金份额净值为 1.0947 元，本报告期份额净值增长率为 9.26%，同期业绩比较基准增长率为 20.20%；本基金 B 类基金份额净值为 1.0951 元，本报告期份额净值增长率为 8.95%，同期业绩比较基准增长率为 15.83%；D 类基金份额净值为 1.0960 元，本报告期份额净值增长率为 9.04%，同

期业绩比较基准增长率为 15.83%。

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 | 30,681,849.98 | 79.91 |
| | 其中：股票 | 30,681,849.98 | 79.91 |
| 2 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 1,165,095.57 | 3.03 |
| 7 | 其他资产 | 6,548,511.06 | 17.06 |
| 8 | 合计 | 38,395,456.61 | 100.00 |

注：其他资产包括：券商账户资金、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。

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 | 170,616.00 | 0.45 |
| B | 采矿业 | 1,603,265.00 | 4.19 |
| C | 制造业 | 19,367,571.98 | 50.67 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 743,670.00 | 1.95 |
| E | 建筑业 | 504,714.00 | 1.32 |
| F | 批发和零售业 | 197,997.00 | 0.52 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 843,913.00 | 2.21 |
| H | 住宿和餐饮业 | 23,269.00 | 0.06 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,992,891.00 | 5.21 |
| J | 金融业 | 3,882,939.00 | 10.16 |
| K | 房地产业 | 331,774.00 | 0.87 |
| L | 租赁和商务服务业 | 337,495.00 | 0.88 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 412,213.00 | 1.08 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 65,729.00 | 0.17 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 15,732.00 | 0.04 |
| Q | 卫生和社会工作 | 102,144.00 | 0.27 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 85,917.00 | 0.22 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 30,681,849.98 | 80.26 |

5.2.1.2 积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资 |
|----|------|------|-------|---------|------|
|----|------|------|-------|---------|------|

| | | | | | 产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|--------------|----------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 2,900 | 1,165,800.00 | 3.05 |
| 2 | 600519 | 贵州茅台 | 700 | 1,010,793.00 | 2.64 |
| 3 | 601318 | 中国平安 | 11,800 | 650,298.00 | 1.70 |
| 4 | 600036 | 招商银行 | 13,500 | 545,535.00 | 1.43 |
| 5 | 601899 | 紫金矿业 | 18,000 | 529,920.00 | 1.39 |
| 6 | 300308 | 中际旭创 | 1,000 | 403,680.00 | 1.06 |
| 7 | 300502 | 新易盛 | 1,100 | 402,347.00 | 1.05 |
| 8 | 000333 | 美的集团 | 5,400 | 392,364.00 | 1.03 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 13,800 | 374,256.00 | 0.98 |
| 10 | 600900 | 长江电力 | 13,400 | 365,150.00 | 0.96 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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 |
|----|----|-----|---------|-----------|------|
| - | - | - | - | - | - |

| | |
|-------------------|-----------|
| 公允价值变动总额合计(元) | - |
| 股指期货投资本期收益(元) | 79,112.53 |
| 股指期货投资本期公允价值变动(元) | - |

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

无。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体之一的招商银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚。该证券的投资符合本基金管理人内部投资决策。

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

5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 898,085.02 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 5,650,426.04 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | - |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 6,548,511.06 |

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

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 | 287,209,243. 92 | 23,751,423.67 | - | - |
| 报告期内期间基金总 申购份额 | 14,321,482.2 1 | 1,822,601.35 | 19.88 | 1,416,400.81 |
| 减：报告期内期间基 金总赎回份额 | 271,341,622. 07 | 22,289,187.64 | - | - |
| 报告期内期间基金拆 分变动份额 | - | - | - | - |
| 本报告期末基金 份额总额 | 30,189,104.0 6 | 3,284,837.38 | 19.88 | 1,416,400.81 |

§ 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 | - | - | - |
| 报告期内买入/申购总份 额 | - | - | - | - |
| 报告期内卖出/赎回总份 额 | - | - | - | - |
| 报告期末管理人持有的本 基金份额 | 10,000,000.00 | - | - | - |
| 报告期末持 有的本基金份 额占基金总份 额比例 (%) | 33.12 | - | - | - |

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 | 28.66% | 10,000,000.00 | 28.66% | 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 | 28.66% | 10,000,000.00 | 28.66% | - |

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|--------|----------------|------------------------|---------------|------|------|---------------|--------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 机构 | 1 | 20250829-20250930 | 10,000,000.00 | 0.00 | 0.00 | 10,000,000.00 | 28.66% |
| 产品特有风险 | | | | | | | |

本基金在报告期内，存在报告期内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，基金管理人将不再接受该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。在其他基金份额持有人赎回基金份额导致某一基金份额持

有人所持有的基金份额达到或超过本基金总份额50%的情况下，该基金份额持有人将面临所提出的对本基金基金份额的申购及转换转入申请被拒绝的风险。如果投资人某笔申购或转换转入申请导致其持有本基金基金份额达到或超过本基金规模的50%，该笔申购或转换转入申请可能被确认失败。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本基金于2025年8月5日起增加B类、D类基金份额，详情请查阅相关公告。

§ 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
二〇二五年十月二十八日