

鑫元中证 A100 指数型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：交通银行股份有限公司

送出日期：2026 年 8 月 31 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。

基金托管人交通银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 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	5
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	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§ 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）	15
6.1 资产负债表	15
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	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	45
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
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	46
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	46
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	46

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	47
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	47
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	47
7.12 投资组合报告附注	47
§ 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情况	49
§ 9 开放式基金份额变动	50
§ 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	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	51
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	51
10.7 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	51
10.8 其他重大事件	52
§ 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	54
§ 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	55

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金	
基金简称	鑫元中证 A100 指数	
基金主代码	023630	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025 年 7 月 22 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份 额总额	37,413,914.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基 金简称	鑫元中证 A100 指数 A	鑫元中证 A100 指数 C
下属分级基金的交 易代码	023630	023631
报告期末下属分级 基金的份额总额	10,782,969.81 份	26,630,944.41 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过指数化投资，争取在扣除各项费用之前获得与标的指数相似的总回报，追求跟踪偏离度及跟踪误差的最小化。
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。
业绩比较基准	中证 A100 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，其预期风险与预期收益理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数基金，主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。本基金如果投资港股通标的股票，需承担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		鑫元基金管理有限公司	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李晓燕	方圆
	联系电话	021-20892000 转	95559
	电子邮箱	service@xyamc.com	fangy_20@bankcomm.com
客户服务电话		4006066188	95559
传真		021-20892111	021-62701216
注册地址		上海市静安区中山北路 909 号	中国（上海）自由贸易试验区

	12 层	银城中路 188 号
办公地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	中国（上海）长宁区仙霞路 18 号
邮政编码	200070	200336
法定代表人	龙艺	任德奇

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券日报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.xyamc.com
基金中期报告置备地点	上海市静安区中山北路 909 号 12 层 鑫元基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 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 - 2026 年 6 月 30 日)	
	鑫元中证 A100 指数 A	鑫元中证 A100 指数 C
本期已实现收益	967,200.66	1,777,466.14
本期利润	1,477,780.87	2,840,723.91
加权平均基金份额本期利润	0.0921	0.0885
本期加权平均净值利润率	8.41%	8.10%
本期基金份额净值增长率	8.24%	8.02%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	1,412,472.89	3,373,472.12
期末可供分配基金份额利润	0.1310	0.1267
期末基金资产净值	12,447,888.25	30,625,976.74
期末基金份额净值	1.1544	1.1500
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	15.44%	15.00%

注：（1）所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。

（2）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。

（3）期末可供分配利润为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。

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

鑫元中证 A100 指数 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	12.76%	1.32%	11.76%	1.30%	1.00%	0.02%
过去六个月	8.24%	1.20%	8.08%	1.16%	0.16%	0.04%

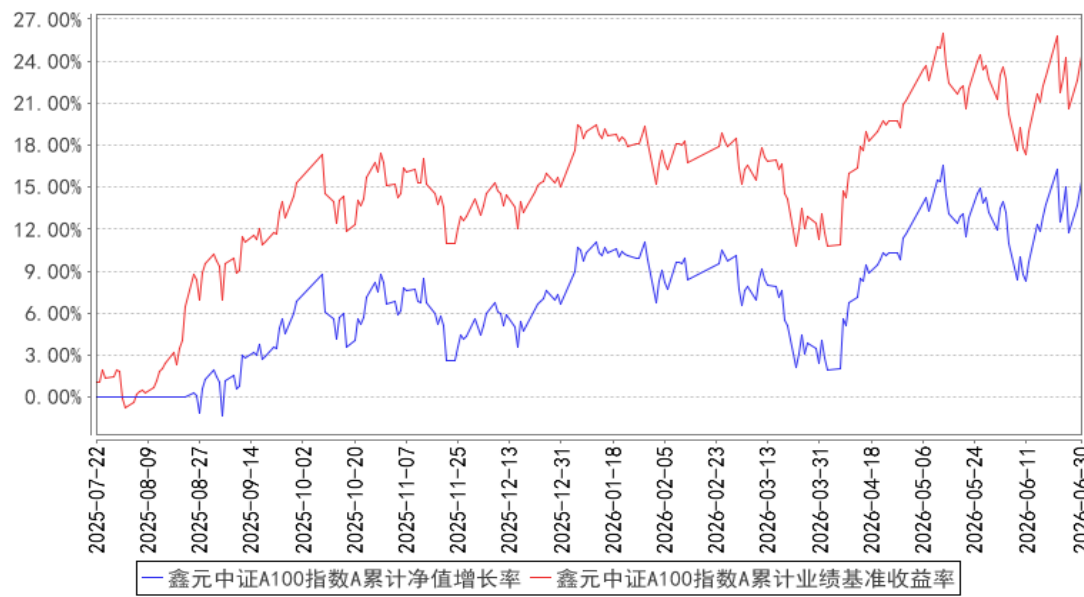
自基金合同生效 起至今	15.44%	1.07%	24.32%	1.08%	-8.88%	-0.01%
----------------	--------	-------	--------	-------	--------	--------

鑫元中证 A100 指数 C

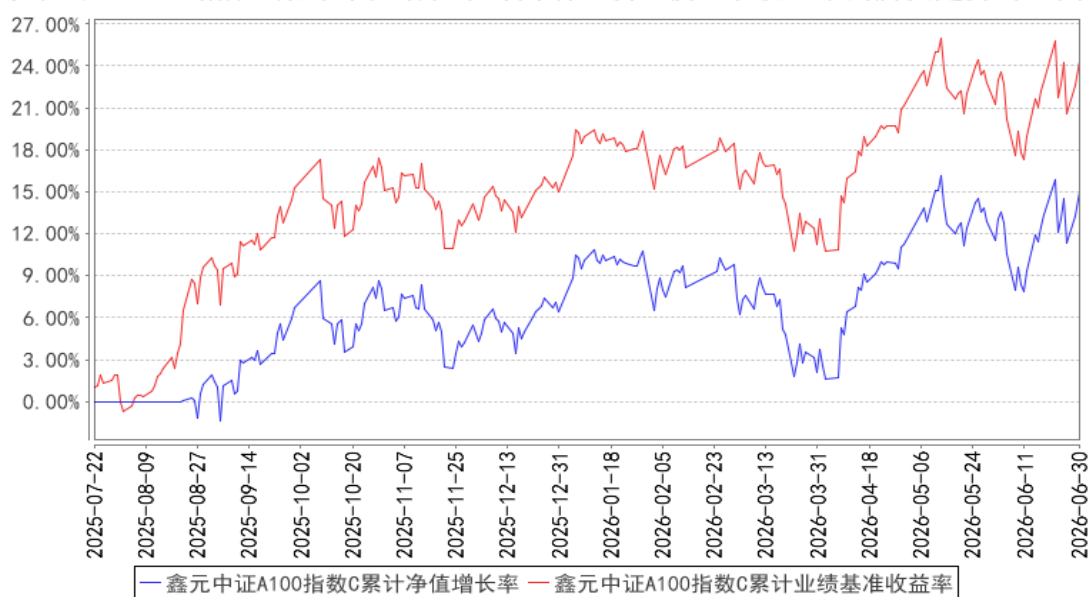
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准 差④	①—③	②—④
过去三个月	12.65%	1.32%	11.76%	1.30%	0.89%	0.02%
过去六个月	8.02%	1.20%	8.08%	1.16%	-0.06%	0.04%
自基金合同生效 起至今	15.00%	1.07%	24.32%	1.08%	-9.32%	-0.01%

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

鑫元中证A100指数A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



鑫元中证A100指数C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同生效日为 2025 年 7 月 22 日，截止 2026 年 6 月 30 日不满一年。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

§ 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

本基金管理人为鑫元基金管理有限公司，本公司经中国证监会证监许可〔2013〕1115 号文批准于 2013 年 8 月成立，由南京银行股份有限公司发起，与南京高科股份有限公司联合组建，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。基金管理人管理的公募基金覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、FOF 等不同类别。

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		
刘宇涛	本基金的基金经理	2025 年 7 月 22 日	-	10 年	学历：工学博士研究生。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021 年 6 月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。
肖涵	本基金的基金经理	2025 年 12 月 10 日	-	4 年	学历：金融学硕士研究生。历任上海智慧数投科技有限公司量化研究员。2021 年 9 月加入鑫元基金，历任交易员、研究员、投资经理助理，现任基金经理。
方仁杰	本基金的基金经理助理	2025 年 9 月 23 日	-	7 年	学历：金融数学与金融工程硕士研究生。历任嘉合基金管理有限公司分析师，山西证券股份有限公司研究员，山证（上海）资产管理有限公司研究员。2025 年 1 月加入鑫元基金管理有限公司，现任基金经理助理。

注：1. 基金的首任基金经理，任职日期为基金合同生效日，离职日期为根据公司决议确定的解聘日期；

2. 非首任基金经理，任职日期和离任日期分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持

有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

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，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易管理的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现有违公平交易要求的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司已制订并不断完善内部异常交易监控管理相关制度，通过系统和人工相结合的方式对基金投资交易行为的日常监督检查，执行异常交易行为的监控、分析与记录工作机制。

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，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 5% 的交易共 1 次，为量化策略投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

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

本基金属于被动指数型股票基金。投资管理上采用完全复制指数成分股和权重的方法。力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均偏离度绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超 4%。如因指数编制规则调整或大额申赎等其他因素导致日偏离度和跟踪误差超过上述范围，我们会采取合理措施避免日偏离度、跟踪误差进一步扩大。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元中证 A100 指数 A 的基金份额净值增长率为 8.24%，同期业绩比较基准收益率为 8.08%。本报告期内鑫元中证 A100 指数 C 的基金份额净值增长率为 8.02%，同期业绩比较基准收益率为 8.08%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对市场中期走势保持谨慎乐观。7 月中旬市场经历了一轮快速调整，触发了较

为罕见的超卖信号，从历史规律看，类似幅度的单日急跌之后，主要宽基指数短期修复的胜率相对较高；同时融资盘等资金面信号也显示，阶段性抛压已得到较为充分的释放，市场进一步大幅下探的空间或相对有限。

结构层面，我们倾向于认为三季度市场风格将逐步走向均衡。前期表现分化较大的科技与红利、成长与微盘等风格之间有望趋于收敛。对于双创板块而言，即便出现技术性反弹，短期内或难以重现此前的单边行情，更可能以宽幅震荡、波动逐步收敛的方式演绎。一方面，当前正值中报业绩披露期，部分成长板块前期估值抬升较快，需要经过业绩披露的对齐与校准，这一过程往往伴随多空双方的反复博弈；另一方面，从波动率的维度观察，部分科技板块已连续数月处于历史较高波动区间，参考过往经验，持续的高波动之后通常需要一段蓄势整固的过程，才有望酝酿下一波趋势性机会。

行业层面，近期某存储芯片龙头企业的上市值得重点关注。作为该细分领域的核心标的，其体量在板块内占据相当比重，有望成为产业估值的重要参照，推动相关板块内部“去伪存真”。参考历史同类案例，板块内部未来或呈现一定分化：具备持续订单支撑和业绩兑现能力的公司仍有望获得市场认可，而更多依赖题材概念的公司则可能面临估值回归。配置上，建议以均衡思路应对市场波动，在控制整体风险敞口的前提下，关注业绩确定性较强的方向。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。估值委员会对估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理。估值委员会成员具有多年从业经验，具备投资、研究、交易、运营、风险管理、法律合规等方面的专业胜任能力。本公司使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序；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。公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。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债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内，本基金未进行利润分配。截止报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值低于五千万的情形，出现该情形时

间范围为 2026 年 4 月 21 日至 2026 年 6 月 30 日。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在鑫元中证 A100 指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，鑫元基金管理有限公司在鑫元中证 A100 指数型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关鑫元中证 A100 指数型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、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：鑫元中证 A100 指数型证券投资基金

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	500,401.58	4,794,503.08
结算备付金		1,158,512.52	1,471,699.60
存出保证金		391,468.80	332,524.80
交易性金融资产	6.4.7.2	41,157,512.57	71,175,178.98
其中：股票投资		38,932,677.55	66,748,646.38
基金投资		-	-
债券投资		2,224,835.02	4,426,532.60
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	-	-1,004.09
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		10,256.96	163,844.78
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	582.13	4,460.80
资产总计		43,218,734.56	77,941,207.95
负债和净资产			
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		-	1,625.82
应付赎回款		61,561.27	3,724,873.21

应付管理人报酬		17,515.16	34,308.32
应付托管费		3,503.06	6,861.68
应付销售服务费		9,713.44	17,535.97
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12.43	8.19
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	52,564.21	141,000.00
负债合计		144,869.57	3,926,213.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	37,413,914.22	69,477,651.05
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	5,659,950.77	4,537,343.71
净资产合计		43,073,864.99	74,014,994.76
负债和净资产总计		43,218,734.56	77,941,207.95

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 37,413,914.22 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1544 元，份额总额 10,782,969.81 份；下属 C 类基金份额净值 1.1500 元，份额总额 26,630,944.41 份。

6.2 利润表

会计主体：鑫元中证 A100 指数型证券投资基金

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
一、营业总收入		4,600,216.30
1. 利息收入		9,363.74
其中：存款利息收入	6.4.7.13	8,388.89
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		974.85
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,016,738.56
其中：股票投资收益	6.4.7.14	2,258,601.73
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	18,357.82
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	348,545.52
股利收益	6.4.7.19	391,233.49

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6. 4. 7. 20	1, 573, 837. 98
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. 21	276. 02
减：二、营业总支出		281, 711. 52
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	131, 387. 97
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	26, 277. 59
3. 销售服务费		70, 090. 26
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. 22	-
7. 税金及附加		1, 391. 49
8. 其他费用	6. 4. 7. 23	52, 564. 21
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4, 318, 504. 78
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4, 318, 504. 78
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		4, 318, 504. 78

6.3 净资产变动表

会计主体：鑫元中证 A100 指数型证券投资基金

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	69, 477, 651. 05	4, 537, 343. 71	74, 014, 994. 76
二、本期期初净资产	69, 477, 651. 05	4, 537, 343. 71	74, 014, 994. 76
三、本期增减变动额 （减少以“-”号填列）	-32, 063, 736. 83	1, 122, 607. 06	-30, 941, 129. 77
（一）、综合收益总额	-	4, 318, 504. 78	4, 318, 504. 78

(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）	-32,063,736.83	-3,195,897.72	-35,259,634.55
其中：1. 基金申购款	4,844,655.70	510,008.48	5,354,664.18
2. 基金赎回款	-36,908,392.53	-3,705,906.20	-40,614,298.73
(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	37,413,914.22	5,659,950.77	43,073,864.99

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：

于景亮
基金管理人负责人

杨晓宇
主管会计工作负责人

包颖
会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鑫元中证 A100 指数型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2025]145 号文核准,由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元中证 A100 指数型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 461,210,468.01 元,已经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)安永华明(2025)验字第 70074312_B09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《鑫元中证 A100 指数型证券投资基金基金合同》于 2025 年 7 月 22 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 461,332,241.31 份基金份额,其中有效认购资金在初始募集期内产生的利息折合 121,773.30 份基金份额。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司,基金托管人为交通银行股份有限公司。根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元中证 A100 指数型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,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或上市的股票(包括主板、创业板及其他经中国证监会核准或注册

上市的股票)、存托凭证、港股通标的股票、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、次级债、可转换债券(含交易分离可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款等)、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相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人可在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票(含存托凭证)资产的比例不低于基金资产的 90%;投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%;投资港股通标的股票的比例不超过股票资产的 10%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人可在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证 A100 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2026 年 6 月 30 日的财务状况以及 2026 年 1 月 1 日起至 2026 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

2、增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 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》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品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；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，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。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 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。

3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号《财政部 国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税。

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号《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》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5、个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号《关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

6、境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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	277,659.67
等于：本金	277,609.62
加：应计利息	50.05
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
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	222,741.91
等于：本金	222,737.80
加：应计利息	4.11
减：坏账准备	-
合计	500,401.58

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

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		32,952,671.81	-	38,932,677.55	5,980,005.74
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,200,632.16	24,235.02	2,224,835.02	-32.16
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,200,632.16	24,235.02	2,224,835.02	-32.16
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		35,153,303.97	24,235.02	41,157,512.57	5,979,973.58

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	3,197,480.00	-	-	-
其中：股指期货投资	3,197,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	3,197,480.00	-	-	-

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
IC2607	IC2607	1.00	1,785,640.00	37,760.00
IF2607	IF2607	1.00	1,476,600.00	27,000.00
合计				64,760.00
减：可抵销期货暂收款				64,760.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

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

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 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	582.13
待摊费用	-
合计	582.13

6.4.7.9 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	-
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	52,564.21
合计	52,564.21

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元中证 A100 指数 A		
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	25,707,336.32	25,707,336.32
本期申购	1,754,317.77	1,754,317.77
本期赎回（以“-”号填列）	-16,678,684.28	-16,678,684.28
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	10,782,969.81	10,782,969.81

金额单位：人民币元

鑫元中证 A100 指数 C		
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	43,770,314.73	43,770,314.73
本期申购	3,090,337.93	3,090,337.93
本期赎回（以“-”号填列）	-20,229,708.25	-20,229,708.25
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	26,630,944.41	26,630,944.41

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

注：无。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鑫元中证 A100 指数 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,791,737.66	-81,297.21	1,710,440.45

本期期初	1,791,737.66	-81,297.21	1,710,440.45
本期利润	967,200.66	510,580.21	1,477,780.87
本期基金份额交易产生的变动数	-1,346,465.43	-176,837.45	-1,523,302.88
其中：基金申购款	180,543.54	37,136.40	217,679.94
基金赎回款	-1,527,008.97	-213,973.85	-1,740,982.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,412,472.89	252,445.55	1,664,918.44

鑫元中证 A100 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,964,510.92	-137,607.66	2,826,903.26
本期期初	2,964,510.92	-137,607.66	2,826,903.26
本期利润	1,777,466.14	1,063,257.77	2,840,723.91
本期基金份额交易产生的变动数	-1,368,504.94	-304,089.90	-1,672,594.84
其中：基金申购款	293,433.98	-1,105.44	292,328.54
基金赎回款	-1,661,938.92	-302,984.46	-1,964,923.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,373,472.12	621,560.21	3,995,032.33

6.4.7.13 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	1,214.14
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	97.91
结算备付金利息收入	7,076.84
其他	-
合计	8,388.89

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,258,601.73
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,258,601.73

6.4.7.14.2 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	41,270,250.25
减：卖出股票成本总额	38,978,416.20
减：交易费用	33,232.32
买卖股票差价收入	2,258,601.73

6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

6.4.7.15 债券投资收益**6.4.7.15.1 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	18,519.82
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-162.00
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	18,357.82

6.4.7.15.2 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	2,621,655.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,601,084.99
减：应计利息总额	20,729.80
减：交易费用	3.01
买卖债券差价收入	-162.00

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益**6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成**

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	348,545.52

6.4.7.19 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	391,233.49
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	391,233.49

6.4.7.20 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	1,535,237.98
——股票投资	1,534,313.99
——债券投资	923.99
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	38,600.00
——权证投资	—
——期货投资	38,600.00
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	1,573,837.98

6.4.7.21 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	276.02
合计	276.02

6.4.7.22 信用减值损失

注：无。

6.4.7.23 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	12,892.63
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	—
合计	52,564.21

6.4.7.24 分部报告

无。

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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

本报告期内不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。

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
鑫元基金管理有限公司（“鑫元基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
交通银行股份有限公司（“交通银行”）	基金托管人、基金销售机构
南京银行股份有限公司（“南京银行”）	基金管理人的股东、基金销售机构
南京高科股份有限公司（“南京高科”）	基金管理人的股东
上海鑫沅股权投资管理有限公司（“鑫沅股权”）	基金管理人的子公司
鑫沅资产管理有限公司（“鑫沅资产”）	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

注：无。

6.4.10.1.2 债券交易

注：无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

注：无。

6.4.10.1.4 权证交易

注：无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

注：无。

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
当期发生的基金应支付的管理费	131,387.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	65,434.47
应支付基金管理人的净管理费	65,953.50

注：基金管理费每日计提，按月支付。基金管理费按前一日的基金资产净值的 0.50% 的年费率计

提。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

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
当期发生的基金应支付的托管费	26,277.59

注：基金托管费每日计提，按月支付。基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.10%的年费率计提。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

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		
	鑫元中证 A100 指数 A	鑫元中证 A100 指数 C	合计
鑫元基金	-	3.29	3.29
南京银行	-	3,223.75	3,223.75
交通银行	-	48,048.31	48,048.31
合计	-	51,275.35	51,275.35

注：基金的销售服务费按前一日 C 类基金份额对应的基金资产净值 0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给基金管理人，再由基金管理人计算并支付给各基金销售机构。计算方法如下

$$H=E\times 0.40\%\div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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

注：无。

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	
	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
交通银行	277,659.67	1,214.14

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

注：无。

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

注：无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

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

注：无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

本基金的基金管理人实行全员风险管理，风险管理是公司所有部门、全体员工的应尽职责。公司建立董事会、经营管理层、独立风险管理部门、业务部门四级风险管理组织架构，并分别明确风险管理职能与责任。董事会对公司的风险管理负有最终责任，董事会下设风险控制与合规审计委员会，负责研究、确定公司风险管理理念，指导公司风险管理体系的建设；经营管理层负责组织、部署风险管理工作，经营管理层设风险控制委员会，负责确定风险管理理念、原则、目标和方法，促进风险管理环境、文化的形成，组织风险管理体系建设，审议风险管理制度和流程，审议重大风险事件；独立风险管理部门负责协同相关业务部门落实投资风险、操作风险、合规风险、道德风险等各类风险的控制和管理，督促、检查各业务部门、各业务环节的风险管理工作；各业务部门负责根据职能分工贯彻落实风险管理程序，执行风险管理措施。根据风险管理工作要求，各业务部门健全完善规章制度和操作流程，严格遵守风险管理制度、流程和限额，严格执行从风险识别、风险测量、风险控制、风险评价到风险报告的风险管理程序，对本部门发生风险事件承担直接责任，及时、准确、全面、客观地将本部门及本部门发现的风险信息向风险管理部门报告。

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同责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以

中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制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来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

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	2,224,835.02	4,426,532.60
合计	2,224,835.02	4,426,532.60

注：未评级债券一般为国债、政策性金融债、短期融资券、超短期融资券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按短期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按长期信用评级列示的债券资产。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金本报告期末和上年度末均未持有按长期信用评级列示的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可在基金运作周期内的每个开放日要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告持有的流通受限证券部分章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金开展银行存款、交易所及银行间市场交易的固定收益品种等各类计息业务，因此存在相应的利率风险。

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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	500,347.42	0.00	0.00	0.00	0.00	54.16	500,401.58
结算备付金	1,157,513.76	0.00	0.00	0.00	0.00	998.76	1,158,512.52
存出保证金	391,468.80	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	391,468.80
交易性金融资产	1,800,360.00	0.00	400,240.00	0.00	0.00	38,956,912.57	41,157,512.57
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,256.96	10,256.96
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	582.13	582.13
资产总计	3,849,689.98	0.00	400,240.00	0.00	0.00	38,968,804.58	43,218,734.56
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	61,561.27	61,561.27
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	17,515.16	17,515.16
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,503.06	3,503.06
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	9,713.44	9,713.44
应付投资顾问费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	12.43	12.43
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	52,564.21	52,564.21
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	144,869.57	144,869.57
利率敏感度缺口	3,849,689.98	0.00	400,240.00	0.00	0.00	38,823,935.01	43,073,864.99
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计

资产							
货币资金	4,794,309.97	0.00	0.00	0.00	0.00	193.11	4,794,503.08
结算备付金	1,470,697.40	0.00	0.00	0.00	0.00	1,002.20	1,471,699.60
存出保证金	332,524.80	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	332,524.80
交易性金融资产	0.00	0.00	4,400,880.00	0.00	0.00	66,774,298.98	71,175,178.98
衍生金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
买入返售金融资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	-1,004.09	-1,004.09
应收清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收股利	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	163,844.78	163,844.78
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	4,460.80	4,460.80
资产总计	6,597,532.17	0.00	4,400,880.00	0.00	0.00	66,942,795.78	77,941,207.95
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,625.82	1,625.82
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,724,873.21	3,724,873.21
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	34,308.32	34,308.32
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	6,861.68	6,861.68
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	17,535.97	17,535.97
应付投资顾问费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应交税费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	8.19	8.19
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	141,000.00	141,000.00
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	3,926,213.19	3,926,213.19
利率敏感度缺口	6,597,532.17	0.00	4,400,880.00	0.00	0.00	63,016,582.59	74,014,994.76

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
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）
	1. 市场利率下降 25 个基点	944.17	6,232.75
	2. 市场利率上升 25 个基点	-942.12	-6,215.14

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。于本报告期末，本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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证券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”为主的分析模式、定性分析和定量分析相结合的研究方式，跟踪宏观经济基本面、政策面和资金等多方面因素，评估符合基金合同约定范围的大类资产的估值水平和投资价值，并利用上述大类资产之间的相互关联性进行灵活的资产配置，制定本基金的大类资产配置比例，并适时进行调整。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本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	38,932,677.55	90.39	66,748,646.38	90.18
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	38,932,677.55	90.39	66,748,646.38	90.18

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变 2. 以下分析，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变		
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）
	业绩比较基准上升 1%	409,519.81	622,590.97
	业绩比较基准下降 1%	-409,519.81	-622,590.97

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：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：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	38,932,677.55	66,124,374.38
第二层次	2,224,835.02	5,050,804.60
第三层次	—	—
合计	41,157,512.57	71,175,178.98

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

1、承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大承诺事项。

2、其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的其他重要事项。

§ 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	38,932,677.55	90.08
	其中：股票	38,932,677.55	90.08
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,224,835.02	5.15
	其中：债券	2,224,835.02	5.15
	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	1,658,914.10	3.84
8	其他各项资产	402,307.89	0.93
9	合计	43,218,734.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

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	216,938.00	0.50
B	采矿业	2,186,018.00	5.08
C	制造业	27,679,476.25	64.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	907,374.00	2.11
E	建筑业	393,261.00	0.91
F	批发和零售业	56,240.00	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	784,631.00	1.82
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,274,340.30	5.28
J	金融业	3,261,666.00	7.57
K	房地产业	252,763.00	0.59
L	租赁和商务服务业	123,533.00	0.29

M	科学研究和技术服务业	709,707.00	1.65
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	86,730.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	38,932,677.55	90.39

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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	2,600	3,302,000.00	7.67
2	300750	宁德时代	6,000	2,358,060.00	5.47
3	300502	新易盛	3,100	1,881,700.00	4.37
4	600519	贵州茅台	1,400	1,659,686.00	3.85
5	688256	寒武纪	894	1,426,421.70	3.31
6	603986	兆易创新	1,600	1,304,000.00	3.03
7	601318	中国平安	24,200	1,155,308.00	2.68
8	600036	招商银行	28,200	1,001,100.00	2.32
9	601899	紫金矿业	37,500	942,750.00	2.19
10	002371	北方华创	1,000	884,560.00	2.05
11	000333	美的集团	11,100	838,383.00	1.95
12	002475	立讯精密	11,600	816,640.00	1.90
13	688008	澜起科技	2,600	805,740.00	1.87
14	688012	中微公司	1,690	791,765.00	1.84
15	688041	海光信息	2,068	765,780.40	1.78
16	600900	长江电力	27,900	738,513.00	1.71
17	000725	京东方 A	82,600	716,968.00	1.66
18	688981	中芯国际	4,500	714,690.00	1.66
19	603259	药明康德	5,700	709,707.00	1.65

20	300059	东方财富	28,700	584,906.00	1.36
21	600276	恒瑞医药	10,100	525,604.00	1.22
22	300274	阳光电源	3,300	524,766.00	1.22
23	601398	工商银行	73,600	520,352.00	1.21
24	002594	比亚迪	6,100	486,170.00	1.13
25	300476	胜宏科技	1,400	485,002.00	1.13
26	002463	沪电股份	3,100	473,680.00	1.10
27	000651	格力电器	10,200	382,500.00	0.89
28	603019	中科曙光	3,300	353,859.00	0.82
29	603993	洛阳钼业	19,900	349,245.00	0.81
30	600150	中国船舶	10,200	344,658.00	0.80
31	000338	潍柴动力	12,200	332,450.00	0.77
32	601816	京沪高铁	66,800	302,604.00	0.70
33	600309	万华化学	4,300	294,163.00	0.68
34	002415	海康威视	8,400	287,280.00	0.67
35	300124	汇川技术	4,300	285,219.00	0.66
36	000100	TCL 科技	47,200	274,704.00	0.64
37	600111	北方稀土	5,700	273,885.00	0.64
38	000063	中兴通讯	7,400	267,806.00	0.62
39	600089	特变电工	11,500	258,750.00	0.60
40	601857	中国石油	29,400	255,192.00	0.59
41	601088	中国神华	6,300	245,952.00	0.57
42	002028	思源电气	1,400	242,200.00	0.56
43	600031	三一重工	13,500	233,280.00	0.54
44	300014	亿纬锂能	3,400	221,102.00	0.51
45	000792	盐湖股份	7,200	217,368.00	0.50
46	002714	牧原股份	6,200	216,938.00	0.50
47	600406	国电南瑞	9,100	207,935.00	0.48
48	601668	中国建筑	47,000	203,980.00	0.47
49	300760	迈瑞医疗	1,400	190,162.00	0.44
50	603501	豪威集团	2,000	189,700.00	0.44
51	601919	中远海控	14,200	188,292.00	0.44
52	600660	福耀玻璃	3,700	186,628.00	0.43
53	601728	中国电信	35,300	183,207.00	0.43
54	601012	隆基绿能	13,800	181,056.00	0.42
55	002230	科大讯飞	4,400	179,696.00	0.42
56	601225	陕西煤业	8,800	179,080.00	0.42
57	600690	海尔智家	8,500	173,485.00	0.40
58	600941	中国移动	2,000	172,260.00	0.40
59	002460	赣锋锂业	2,600	170,040.00	0.39
60	601985	中国核电	18,700	168,861.00	0.39
61	002352	顺丰控股	5,400	168,804.00	0.39
62	600160	巨化股份	3,100	164,331.00	0.38

63	603799	华友钴业	3,400	164,084.00	0.38
64	000425	徐工机械	18,600	150,474.00	0.35
65	601600	中国铝业	18,000	147,960.00	0.34
66	002466	天齐锂业	2,400	147,168.00	0.34
67	601766	中国中车	27,700	144,040.00	0.33
68	601100	恒立液压	1,300	139,828.00	0.32
69	002179	中航光电	2,900	133,980.00	0.31
70	601006	大秦铁路	27,100	124,931.00	0.29
71	601888	中国中免	2,300	123,533.00	0.29
72	002625	光启技术	4,000	121,280.00	0.28
73	688271	联影医疗	1,195	120,969.85	0.28
74	600489	中金黄金	6,600	119,130.00	0.28
75	601127	赛力斯	1,900	116,375.00	0.27
76	600893	航发动力	3,000	115,020.00	0.27
77	600010	包钢股份	51,500	114,845.00	0.27
78	600019	宝钢股份	19,800	107,514.00	0.25
79	600760	中航沈飞	2,600	106,860.00	0.25
80	688111	金山办公	492	104,820.60	0.24
81	000807	云铝股份	4,700	104,058.00	0.24
82	600989	宝丰能源	5,000	101,650.00	0.24
83	601727	上海电气	14,400	100,800.00	0.23
84	002422	科伦药业	2,600	100,152.00	0.23
85	002001	新 和 成	3,500	99,470.00	0.23
86	601390	中国中铁	23,300	97,161.00	0.23
87	000538	云南白药	2,000	94,740.00	0.22
88	600547	山东黄金	4,100	94,669.00	0.22
89	601669	中国电建	19,600	92,120.00	0.21
90	600585	海螺水泥	5,400	91,530.00	0.21
91	300015	爱尔眼科	10,500	86,730.00	0.20
92	600426	华鲁恒升	3,400	81,328.00	0.19
93	600895	张江高科	2,100	78,225.00	0.18
94	600436	片仔癀	700	76,496.00	0.18
95	600048	保利发展	16,400	75,932.00	0.18
96	600438	通威股份	6,100	73,871.00	0.17
97	600196	复星医药	2,900	65,163.00	0.15
98	000963	华东医药	2,000	56,240.00	0.13
99	001979	招商蛇口	8,200	52,726.00	0.12
100	000002	万 科 A	15,500	45,880.00	0.11

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300502	新易盛	1,692,803.00	2.29
2	600900	长江电力	761,026.00	1.03
3	002594	比亚迪	574,548.00	0.78
4	000651	格力电器	411,074.00	0.56
5	601816	京沪高铁	348,928.00	0.47
6	300760	迈瑞医疗	291,476.99	0.39
7	601225	陕西煤业	248,693.00	0.34
8	601668	中国建筑	237,586.00	0.32
9	601728	中国电信	216,505.00	0.29
10	600941	中国移动	216,300.00	0.29
11	600660	福耀玻璃	204,628.00	0.28
12	601127	赛力斯	187,786.00	0.25
13	002352	顺丰控股	184,131.00	0.25
14	601766	中国中车	168,873.00	0.23
15	601100	恒立液压	167,575.00	0.23
16	601985	中国核电	162,865.00	0.22
17	600050	中国联通	161,430.00	0.22
18	600436	片仔癀	157,680.00	0.21
19	300059	东方财富	152,748.00	0.21
20	601006	大秦铁路	139,771.00	0.19

注：买入金额按买入成交金额（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	2,354,182.00	3.18
2	600519	贵州茅台	1,924,607.00	2.60
3	300308	中际旭创	1,873,140.00	2.53
4	601318	中国平安	1,555,217.00	2.10
5	600900	长江电力	1,452,852.00	1.96
6	601899	紫金矿业	1,353,006.00	1.83
7	600036	招商银行	1,161,023.00	1.57
8	002594	比亚迪	1,087,827.00	1.47
9	000333	美的集团	921,306.00	1.24
10	000651	格力电器	787,072.50	1.06
11	300059	东方财富	770,708.57	1.04
12	002475	立讯精密	699,514.59	0.95
13	601816	京沪高铁	656,945.00	0.89
14	600276	恒瑞医药	610,679.00	0.83

15	601398	工商银行	576,783.00	0.78
16	688981	中芯国际	564,624.06	0.76
17	688041	海光信息	558,014.09	0.75
18	300274	阳光电源	555,079.00	0.75
19	603259	药明康德	554,597.00	0.75
20	300760	迈瑞医疗	548,984.00	0.74

注：卖出金额按卖出成交金额（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	9,628,133.38
卖出股票收入（成交）总额	41,270,250.25

注：“买入股票成本”、“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	2,224,835.02	5.17
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	2,224,835.02	5.17

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	019785	25 国债 13	18,000	1,822,725.86	4.23
2	019827	26 国债 01	3,000	301,944.58	0.70
3	019835	26 国债 09	1,000	100,164.58	0.23

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

注：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

注：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

注：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

本基金的股指期货投资主要以多头仓位替代策略为主，获取基差收敛和现金管理的超额收益。

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

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

本报告期内基金投资的前十名证券中的发行主体包括招商银行股份有限公司。国家金融监督管理总局于 2025 年 9 月 12 日对招商银行股份有限公司作出了处罚决定。但本基金投资相关证券的投资决策程序符合相关法律、法规的规定。

本报告期内基金投资的前十名证券的其余发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同约定的备选股票库

本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

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	391,468.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,256.96
6	其他应收款	582.13
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	402,307.89

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有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

注：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

注：本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§ 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 (%)
鑫元中证 A100 指 数 A	241	44,742.61	—	—	10,782,969.81	100.0000
鑫元中证 A100 指 数 C	348	76,525.70	—	—	26,630,944.41	100.0000
合计	589	63,521.08	—	—	37,413,914.22	100.0000

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	鑫元中证 A100 指数 A	49,485.75	0.4589
	鑫元中证 A100 指数 C	62,095.03	0.2332
	合计	111,580.78	0.2982

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	鑫元中证 A100 指数 A	0~10
	鑫元中证 A100 指数 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元中证 A100 指数 A	0
	鑫元中证 A100 指数 C	0
	合计	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元中证 A100 指数 A	鑫元中证 A100 指数 C
基金合同生效日 （2025 年 7 月 22 日）基金份额总额	163,199,094.60	298,133,146.71
本报告期期初基金 份额总额	25,707,336.32	43,770,314.73
本报告期基金总申 购份额	1,754,317.77	3,090,337.93
减：本报告期基金 总赎回份额	16,678,684.28	20,229,708.25
本报告期基金拆分 变动份额	—	—
本报告期期末基金 份额总额	10,782,969.81	26,630,944.41

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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、基金管理人：本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人：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，本基金未发生对基金份额持有人权益或者基金份额的价格产生重大影响的涉及基金财产、基金管理业务、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人未受到稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员未受到稽查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人的托管业务部门未受到调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内基金托管人相关从业人员未受到调查或处罚等情况。

10.7 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

10.7.1 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 (%)	
南京证券	2	37,555,577.99	73.79	7,360.27	74.79	-

华创证券	2	13,342,805.64	26.21	2,480.49	25.21	-
------	---	---------------	-------	----------	-------	---

注：（1）交易单元的主要选择标准：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范；
- 2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；
- 3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；
- 4) 收取的交易佣金费率合理。

（2）交易单元的选择程序：

- 1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；
- 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。

（3）报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

10.7.2 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(%)
南京证券	2,900,823.00	96.67	-	-	-	-
华创证券	99,984.00	3.33	-	-	-	-

10.8 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	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司网站	2026 年 1 月 22 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分基金所持有的停牌股票变更估值方法的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2026 年 1 月 24 日
4	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、上交所	2026 年 3 月 31 日
5	鑫元基金管理有限公司旗下公募基	公司网站、上交所	2026 年 3 月 31 日

	金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）		
6	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金 2025 年年度报告	公司网站	2026 年 3 月 31 日
7	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金 2026 年第一季度报告	公司网站	2026 年 4 月 22 日
8	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报、上交所	2026 年 4 月 22 日
9	2025 年度鑫元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	公司网站	2026 年 4 月 29 日
10	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金（鑫元中证 A100 指数 C）基金产品资料概要更新	公司网站	2026 年 6 月 27 日
11	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	公司网站	2026 年 6 月 27 日
12	鑫元中证 A100 指数型证券投资基金（鑫元中证 A100 指数 A）基金产品资料概要更新	公司网站	2026 年 6 月 27 日

§ 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

注：无。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告中部分比例指标以 0.00%、0.0000%、100.00%或 100.0000%列示，均系四舍五入保留小数位数所致，不代表实际值为零或精确为 100%。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元中证 A100 指数型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元中证 A100 指数型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元中证 A100 指数型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

鑫元基金管理有限公司

2026 年 8 月 31 日