鑫元中证A500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：宁波银行股份有限公司

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。

基金托管人宁波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 4 月 17 日（基金合同生效日）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 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遵规守信情况的说明 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 13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
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 13
§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 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 17
§7 投资组合报告 44
7.1 期末基金资产组合情况 44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 44
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 46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 59
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 59
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 59
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 60

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 60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 60
7.12 投资组合报告附注 60

§8 基金份额持有人信息 62

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 62
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 62

§9 开放式基金份额变动 63

§10 重大事件揭示 64

10.1 基金份额持有人大会决议 64
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 64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 64
10.4 基金投资策略的改变 64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 64
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 64
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 64
10.8 其他重大事件 65

§11 影响投资者决策的其他重要信息 67

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 67
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 67

§12 备查文件目录 68

12.1 备查文件目录 68
12.2 存放地点 68
12.3 查阅方式 68

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金	
基金简称	鑫元中证 A500 指数	
基金主代码	026542	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2026 年 4 月 17 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	宁波银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	200,681,925.90 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 A500 指数 A	鑫元中证 A500 指数 C
下属分级基金的交易代码	026542	026543
报告期末下属分级基金的份额总额	164,218,406.19 份	36,463,519.71 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。特殊情形包括但不限于：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股长期停牌；（4）标的指数成份股进行配股、增发或被吸收合并；（5）标的指数成份股派发现金股息；（6）标的指数成份股定期或临时调整；（7）标的指数编制方法发生变化；（8）其他基金管理人认定不适合投资标的指数成份股的情形或可能严重限制本基金跟踪标的指数的合理原因等。 在特殊情况下，本基金将少量投资于港股通标的股票以进行替代复制。对于同时有 A 股、H 股的指数成份公司，如果该公司 A 股长期停牌，组合无法买入该股票时，可以买入该公司 H 股进行替代。 在正常市场情况下，本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证 A500 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，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	宁波银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	柴飞犇
	联系电话	021-20892000 转	0574-81851181
	电子邮箱	service@xyamc.com	custody-audit@nbcb.cn
客户服务电话		4006066188	0574-83895886
传真		021-20892111	0574-89103213
注册地址		上海市静安区中山北路 909 号 12 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
办公地址		上海市静安区中山北路 909 号 12 层	中国浙江宁波市鄞州区宁东路 345 号
邮政编码		200070	315100
法定代表人		龙艺	庄灵君

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
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	2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日） - 2026 年 6 月 30 日	
	鑫元中证 A500 指数 A	鑫元中证 A500 指数 C
本期已实现收益	1,569,525.62	343,209.62
本期利润	7,772,743.30	1,828,223.47
加权平均基金份额本期利润	0.0431	0.0397
本期加权平均净值利润率	4.28%	3.94%
本期基金份额净值增长率	4.44%	4.39%
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	1,561,716.82	330,866.11
期末可供分配基金份额利润	0.0095	0.0091
期末基金资产净值	171,507,235.11	38,065,590.67
期末基金份额净值	1.0444	1.0439
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	4.44%	4.39%

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。

（4）本基金合同于 2026 年 4 月 17 日生效，截止 2026 年 6 月 30 日不满半年。

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 A500 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
自基金合同生效	4.44%	1.23%	6.46%	1.31%	-2.02%	-0.08%

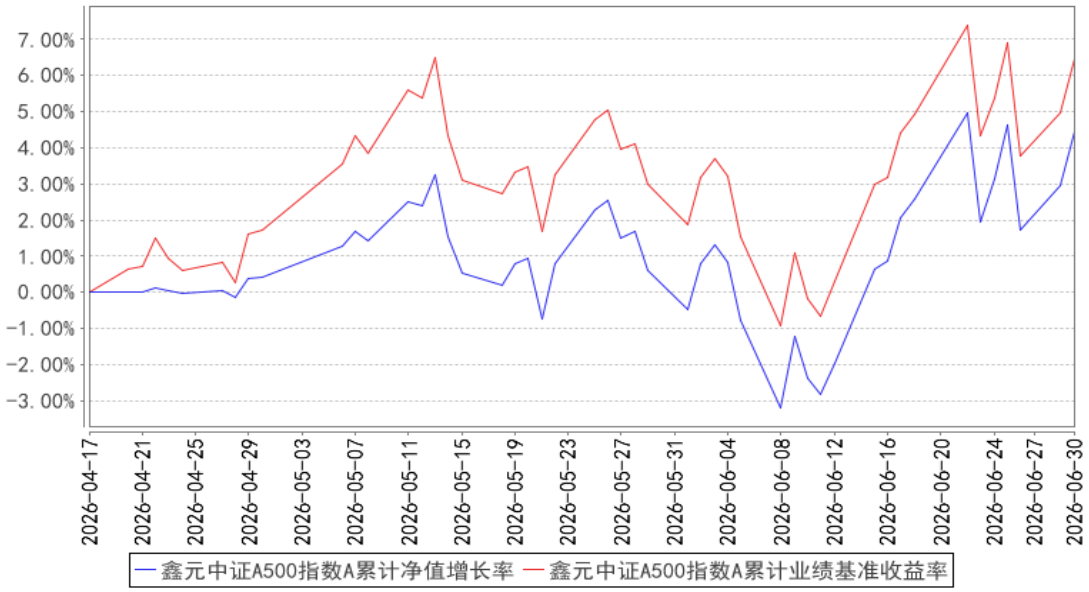
起至今						

鑫元中证 A500 指数 C

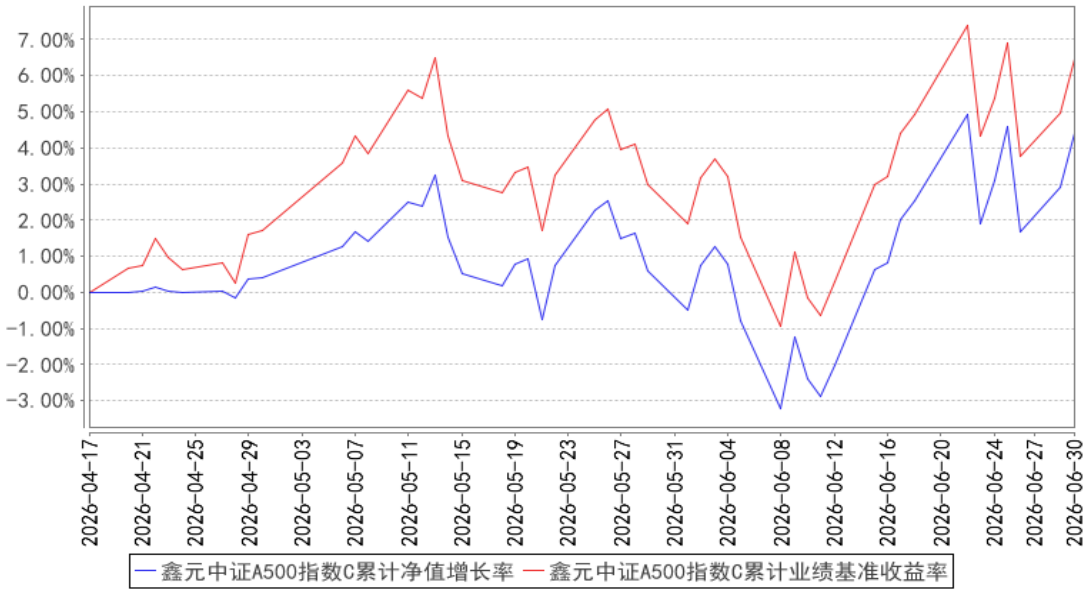
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
自基金合同生效起至今	4.39%	1.23%	6.46%	1.31%	-2.07%	-0.08%

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A500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A500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 2026 年 4 月 17 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，截止本报告期末，本基金尚处于建仓期内，将在 6 个月建仓期结束时，确保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		
肖涵	本基金的基金经理	2026 年 4 月 17 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	2026 年 4 月 17 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流程的各项制度规范，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进行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 A500 指数 A 的基金份额净值增长率为 4.44%，同期业绩比较基准收益率为 6.46%。本报告期内鑫元中证 A500 指数 C 的基金份额净值增长率为 4.39%，同期业绩比较基准收益率为 6.46%。

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

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§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，本托管人在鑫元中证 A500 指数型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《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的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：“财务会计报告”中的“各关联方投资本基金的情况”、“金融工具风险及管理”部分以及“基金份额持有人信息”部分均未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：鑫元中证 A500 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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	159,150.92
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	209,514,055.31
其中：股票投资		198,741,750.02
基金投资		-
债券投资		10,772,305.29
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	-
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		1,634,706.02
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		211,307,912.25
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 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		1,577,610.14

应付管理人报酬		82,794.28
应付托管费		16,558.86
应付销售服务费		6,358.50
应付投资顾问费		-
应交税费		347.19
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	51,417.50
负债合计		1,735,086.47
净资产：		
实收基金	6.4.7.10	200,681,925.90
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	8,890,899.88
净资产合计		209,572,825.78
负债和净资产总计		211,307,912.25

注：1、报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 200,681,925.90 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.0444 元，份额总额 164,218,406.19 份；下属 C 类基金份额净值 1.0439 元，份额总额 36,463,519.71 份。

2、本基金合同于 2026 年 4 月 17 日生效。

6.2 利润表

会计主体：鑫元中证 A500 指数型证券投资基金

本报告期：2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
一、营业总收入		9,944,669.39
1.利息收入		107,268.85
其中：存款利息收入	6.4.7.13	6,211.51
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		101,057.34
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		2,118,790.34
其中：股票投资收益	6.4.7.14	786,018.80
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	25,758.07
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	-
股利收益	6.4.7.19	1,307,013.47
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	7,688,231.53
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	30,378.67
减：二、营业总支出		343,702.62
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	232,252.51
其中：暂估管理人报酬		-
2．托管费	6.4.10.2.2	46,450.51
3．销售服务费		18,961.74
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		463.86
8．其他费用	6.4.7.23	45,574.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,600,966.77
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,600,966.77
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		9,600,966.77

6.3 净资产变动表

会计主体：鑫元中证A500指数型证券投资基金

本报告期：2026年4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月17日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	258,840,736.38	-	258,840,736.38
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-58,158,810.48	8,890,899.88	-49,267,910.60

（一）、综合收益总额	-	9,600,966.77	9,600,966.77
（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）	-58,158,810.48	-710,066.89	-58,868,877.37
其中：1.基金申购款	35,943,849.90	664,471.96	36,608,321.86
2.基金赎回款	-94,102,660.38	-1,374,538.85	-95,477,199.23
（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	200,681,925.90	8,890,899.88	209,572,825.78

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	杨晓宇	包颖
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	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 A500 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〕2854 号核准，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 A500 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 258,819,461.59 元，已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2026）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 A500 指数型证券投资基金基金合同》于 2026 年 4 月 17 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 258,840,736.38 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 21,274.79 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，基金托管人为宁波银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元中证 A500 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 A500 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 4 月 17 日（基金合同生效日）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 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间系自2026年4月17日（基金合同生效日）起至2026年6月30日止。

6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

(1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

(2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评

估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来12个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一

项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，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，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，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具，按照估值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作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2)不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3)如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4)如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列

示，不予相互抵销。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/(损失)占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1)存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2)交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3)股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4)处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5)买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6)公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7)转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费、销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金各基金份额类别的销售费用收取方式不同，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定、《基金合同》的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整。

6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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第 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	101,153.45
等于：本金	101,066.55
加：应计利息	86.90
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	57,997.47
等于：本金	57,978.60
加：应计利息	18.87
减：坏账准备	-
合计	159,150.92

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		191,050,782.10	-	198,741,750.02	7,690,967.92
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	10,711,066.39	63,975.29	10,772,305.29	-2,736.39
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	10,711,066.39	63,975.29	10,772,305.29	-2,736.39
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		201,761,848.49	63,975.29	209,514,055.31	7,688,231.53

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

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

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

注：无。

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	45,174.00
其他应付款	6,243.50
合计	51,417.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元中证 A500 指数 A		
项目	本期 2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	203,129,116.33	203,129,116.33
本期申购	31,562,900.53	31,562,900.53
本期赎回（以“-”号填列）	-70,473,610.67	-70,473,610.67
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	164,218,406.19	164,218,406.19

金额单位：人民币元

鑫元中证 A500 指数 C		
项目	本期 2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	55,711,620.05	55,711,620.05
本期申购	4,380,949.37	4,380,949.37
本期赎回（以“-”号填列）	-23,629,049.71	-23,629,049.71
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	36,463,519.71	36,463,519.71

注：（1）申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

（2)本基金合同于 2026 年 4 月 17 日生效。基金合同生效日的基金份额总额为 258,840,736.38 份基金份额，其中认购资金利息折合 21,274.79 份基金份额。

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 A500 指数 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	1,569,525.62	6,203,217.68	7,772,743.30
本期基金份额交易产生的变动数	-7,808.80	-476,105.58	-483,914.38
其中：基金申购款	167,802.58	418,080.35	585,882.93
基金赎回款	-175,611.38	-894,185.93	-1,069,797.31
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,561,716.82	5,727,112.10	7,288,828.92

鑫元中证 A500 指数 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	343,209.62	1,485,013.85	1,828,223.47
本期基金份额交易产生的变动数	-12,343.51	-213,809.00	-226,152.51
其中：基金申购款	29,359.44	49,229.59	78,589.03
基金赎回款	-41,702.95	-263,038.59	-304,741.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	330,866.11	1,271,204.85	1,602,070.96

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	4,870.11
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,166.10
结算备付金利息收入	-
其他	175.30
合计	6,211.51

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4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	786,018.80
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	786,018.80

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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	54,146,850.85
减：卖出股票成本总额	53,259,128.14
减：交易费用	101,703.91
买卖股票差价收入	786,018.80

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4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日
债券投资收益——利息收入	27,790.68
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,032.61
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	25,758.07

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4月17日（基金合同生效日）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	3,528,952.34
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,505,022.61
减：应计利息总额	25,962.34
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,032.61

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

注：无。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,307,013.47
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	1,307,013.47

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4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日
1.交易性金融资产	7,688,231.53
——股票投资	7,690,967.92
——债券投资	-2,736.39
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——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	7,688,231.53

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日
基金赎回费收入	30,378.67
合计	30,378.67

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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	10,425.00
信息披露费	34,749.00
证券出借违约金	-
开户费	400.00
合计	45,574.00

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
宁波银行股份有限公司（“宁波银行”）	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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	232,252.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	110,242.38
应支付基金管理人的净管理费	122,010.13

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×0.50%÷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 4 月 17 日（基金合同生效日）至 2026 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	46,450.51

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×0.10%÷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 4 月 17 日（基金合同生效日）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 A500 指数 A	鑫元中证 A500 指数 C	合计
鑫元基金	-	-	-
南京银行	-	1,021.16	1,021.16
宁波银行	-	17,435.17	17,435.17
合计	-	18,456.33	18,456.33

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 0.20%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×0.20%÷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

份额单位：份

鑫元中证 A500 指数 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
鑫沅资产	10,000,361.11	4.9832

份额单位：份

鑫元中证A500指数C

关联方名称	本期 2026年6月30日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）
-	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

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4月17日（基金合同生效日）至2026年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
宁波银行	101,153.45	4,870.11

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688797	臻宝科技	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	79	3,520.24	37,024.93	-
001399	惠科股份	2026年6月16日	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,051	10,636.12	29,144.23	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026年6月29日	重大事项停牌	879.53	2026年7月13日	890.99	1,200	585,520.00	1,055,436.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	10,772,305.29
合计	10,772,305.29

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	159,045.15	-	-	-	-	105.77	159,150.92
交易性金融资产	-	-	10,708,330.00	-	-	198,805,725.31	209,514,055.31
应收申购款	0.00	-	-	-	-	1,634,706.02	1,634,706.02
其他资产	0.00	-	-	-	-	0.00	0.00
资产总计	159,045.15	-	10,708,330.00	-	-	200,440,537.10	211,307,912.25
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	1,577,610.14	1,577,610.14
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	82,794.28	82,794.28
应付托管费	-	-	-	-	-	16,558.86	16,558.86
应付销售服务费	-	-	-	-	-	6,358.50	6,358.50
应付税费	-	-	-	-	-	347.19	347.19
其他负债	-	-	-	-	-	51,417.50	51,417.50
负债总计	-	-	-	-	-	1,735,086.47	1,735,086.47
利率敏感度缺口	159,045.15	-	10,708,330.00	-	-	198,705,450.63	209,572,825.78

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）
	1.市场利率下降 25	14,013.78

	个基点	
	2.市场利率上升25个基点	-13,975.18

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	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产－股票投资	198,741,750.02	94.83
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	198,741,750.02	94.83

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）
	业绩比较基准上升1%	1,675,222.45
	业绩比较基准下降1%	-1,675,222.45

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
第一层次	197,620,144.86
第二层次	11,827,741.29
第三层次	66,169.16
合计	209,514,055.31

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	198,741,750.02	94.05
	其中：股票	198,741,750.02	94.05
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	10,772,305.29	5.10
	其中：债券	10,772,305.29	5.10
	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	159,150.92	0.08
8	其他各项资产	1,634,706.02	0.77
9	合计	211,307,912.25	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	626,616.00	0.30
B	采矿业	8,181,711.00	3.90
C	制造业	140,431,516.46	67.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,337,724.90	2.07
E	建筑业	2,424,661.00	1.16
F	批发和零售业	1,545,900.00	0.74
G	交通运输、仓储和邮政业	4,426,187.00	2.11
H	住宿和餐饮业	93,345.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,161,317.50	5.33
J	金融业	19,270,717.00	9.20
K	房地产业	1,062,422.00	0.51
L	租赁和商务服务业	1,434,694.00	0.68

M	科学研究和技术服务业	2,370,502.00	1.13
N	水利、环境和公共设施管理业	342,323.00	0.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	65,700.00	0.03
Q	卫生和社会工作	390,719.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	151,097.00	0.07
S	综合	358,428.00	0.17
	合计	198,675,580.86	94.80

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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	66,169.16	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-

S	综合	-	-
	合计	66,169.16	0.03

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	6,700	8,509,000.00	4.06
2	300750	宁德时代	15,900	6,248,859.00	2.98
3	300502	新易盛	8,380	5,086,660.00	2.43
4	600519	贵州茅台	3,700	4,386,313.00	2.09
5	603986	兆易创新	4,000	3,260,000.00	1.56
6	601318	中国平安	64,000	3,055,360.00	1.46
7	688256	寒武纪	1,890	3,015,589.50	1.44
8	600036	招商银行	74,200	2,634,100.00	1.26
9	601899	紫金矿业	98,900	2,486,346.00	1.19
10	002371	北方华创	2,600	2,299,856.00	1.10
11	000333	美的集团	29,200	2,205,476.00	1.05
12	002475	立讯精密	30,600	2,154,240.00	1.03
13	688012	中微公司	4,572	2,141,982.00	1.02
14	688008	澜起科技	6,800	2,107,320.00	1.01
15	688041	海光信息	5,582	2,067,014.60	0.99
16	002384	东山精密	7,700	2,020,095.00	0.96
17	600900	长江电力	73,400	1,942,898.00	0.93
18	688981	中芯国际	12,000	1,905,840.00	0.91
19	000725	京东方A	218,000	1,892,240.00	0.90
20	603259	药明康德	14,800	1,842,748.00	0.88
21	600030	中信证券	58,600	1,683,578.00	0.80
22	601166	兴业银行	101,600	1,682,496.00	0.80
23	300059	东方财富	75,900	1,546,842.00	0.74
24	600183	生益科技	8,700	1,508,580.00	0.72
25	600276	恒瑞医药	26,800	1,394,672.00	0.67
26	300274	阳光电源	8,700	1,383,474.00	0.66
27	601398	工商银行	193,900	1,370,873.00	0.65
28	300408	三环集团	8,000	1,335,200.00	0.64
29	002594	比亚迪	16,300	1,299,110.00	0.62
30	600487	亨通光电	11,800	1,290,212.00	0.62
31	300476	胜宏科技	3,700	1,281,791.00	0.61
32	002463	沪电股份	8,100	1,237,680.00	0.59

33	601211	国泰海通	67,800	1,233,960.00	0.59
34	300394	天孚通信	3,960	1,198,612.80	0.57
35	688498	源杰科技	600	1,131,600.00	0.54
36	688525	佰维存储	2,244	1,110,174.12	0.53
37	000988	华工科技	6,000	1,107,660.00	0.53
38	301308	江波龙	1,500	1,055,700.00	0.50
39	688072	拓荆科技	1,200	1,055,436.00	0.50
40	600176	中国巨石	14,400	1,049,472.00	0.50
41	601288	农业银行	172,500	1,047,075.00	0.50
42	601328	交通银行	160,100	1,029,443.00	0.49
43	000651	格力电器	26,900	1,008,750.00	0.48
44	600522	中天科技	16,400	995,152.00	0.47
45	688521	芯原股份	2,600	964,964.00	0.46
46	603019	中科曙光	8,800	943,624.00	0.45
47	300604	长川科技	2,700	921,834.00	0.44
48	603993	洛阳钼业	52,400	919,620.00	0.44
49	600150	中国船舶	27,100	915,709.00	0.44
50	600887	伊利股份	37,900	908,084.00	0.43
51	600584	长电科技	8,600	890,530.00	0.42
52	000338	潍柴动力	32,200	877,450.00	0.42
53	000858	五 粮 液	11,600	858,400.00	0.41
54	688347	华虹宏力	2,400	807,120.00	0.39
55	601816	京沪高铁	175,900	796,827.00	0.38
56	688120	华海清科	2,440	786,119.20	0.38
57	600309	万华化学	11,300	773,033.00	0.37
58	300124	汇川技术	11,400	756,162.00	0.36
59	002415	海康威视	22,000	752,400.00	0.36
60	002281	光迅科技	2,900	745,126.00	0.36
61	002008	大族激光	4,900	735,539.00	0.35
62	002916	深南电路	1,600	732,640.00	0.35
63	600111	北方稀土	15,200	730,360.00	0.35
64	000100	TCL科技	124,600	725,172.00	0.35
65	300857	协创数据	2,100	713,790.00	0.34
66	000063	中兴通讯	19,300	698,467.00	0.33
67	300136	信维通信	5,800	691,650.00	0.33
68	600000	浦发银行	79,900	687,939.00	0.33
69	600089	特变电工	30,300	681,750.00	0.33
70	601857	中国石油	77,800	675,304.00	0.32
71	601088	中国神华	16,500	644,160.00	0.31
72	002028	思源电气	3,700	640,100.00	0.31
73	300433	蓝思科技	11,900	638,554.00	0.30
74	600031	三一重工	35,500	613,440.00	0.29
75	300475	香农芯创	2,000	600,000.00	0.29

76	300014	亿纬锂能	9,100	591,773.00	0.28
77	002050	三花智控	13,400	587,322.00	0.28
78	000001	平安银行	58,200	584,910.00	0.28
79	601601	中国太保	20,500	584,660.00	0.28
80	000792	盐湖股份	19,100	576,629.00	0.28
81	002714	牧原股份	16,400	573,836.00	0.27
82	300223	北京君正	2,300	572,470.00	0.27
83	600549	厦门钨业	6,700	570,840.00	0.27
84	002353	杰瑞股份	3,700	564,250.00	0.27
85	002156	通富微电	7,300	553,851.00	0.26
86	600406	国电南瑞	24,100	550,685.00	0.26
87	601668	中国建筑	123,900	537,726.00	0.26
88	000657	中钨高新	5,500	526,460.00	0.25
89	002436	兴森科技	10,200	519,690.00	0.25
90	601919	中远海控	37,700	499,902.00	0.24
91	002602	世纪华通	35,400	499,140.00	0.24
92	601988	中国银行	86,000	491,920.00	0.23
93	300760	迈瑞医疗	3,600	488,988.00	0.23
94	300054	鼎龙股份	4,600	487,462.00	0.23
95	600660	福耀玻璃	9,600	484,224.00	0.23
96	603501	豪威集团	5,100	483,735.00	0.23
97	601728	中国电信	93,100	483,189.00	0.23
98	601012	隆基绿能	36,300	476,256.00	0.23
99	601225	陕西煤业	23,300	474,155.00	0.23
100	002230	科大讯飞	11,500	469,660.00	0.22
101	600941	中国移动	5,400	465,102.00	0.22
102	600690	海尔智家	22,500	459,225.00	0.22
103	002352	顺丰控股	14,400	450,144.00	0.21
104	688777	中控技术	3,800	446,500.00	0.21
105	601985	中国核电	49,430	446,352.90	0.21
106	002460	赣锋锂业	6,800	444,720.00	0.21
107	002938	鹏鼎控股	4,200	442,596.00	0.21
108	603799	华友钴业	9,100	439,166.00	0.21
109	002709	天赐材料	8,500	437,155.00	0.21
110	000977	浪潮信息	6,200	434,000.00	0.21
111	300033	同花顺	1,800	433,800.00	0.21
112	300757	罗博特科	700	433,300.00	0.21
113	600160	巨化股份	8,100	429,381.00	0.20
114	300442	润泽科技	4,900	407,043.00	0.19
115	002851	麦格米特	2,400	401,232.00	0.19
116	688126	沪硅产业	10,000	398,900.00	0.19
117	000425	徐工机械	49,200	398,028.00	0.19
118	002202	金风科技	16,600	396,740.00	0.19

119	000938	紫光股份	13,700	395,382.00	0.19
120	601600	中国铝业	47,700	392,094.00	0.19
121	600028	中国石化	87,300	389,358.00	0.19
122	600938	中国海油	14,300	388,245.00	0.19
123	600460	士兰微	7,000	382,620.00	0.18
124	300567	精测电子	1,200	381,120.00	0.18
125	002466	天齐锂业	6,200	380,184.00	0.18
126	300346	南大光电	4,100	379,865.00	0.18
127	002600	领益智造	21,900	379,746.00	0.18
128	601766	中国中车	73,000	379,600.00	0.18
129	600050	中国联通	93,600	374,400.00	0.18
130	300661	圣邦股份	2,600	373,048.00	0.18
131	002837	英维克	4,610	366,771.60	0.18
132	002049	紫光国微	4,100	363,875.00	0.17
133	002080	中材科技	4,000	360,000.00	0.17
134	002185	华天科技	15,900	354,729.00	0.17
135	601628	中国人寿	10,000	353,500.00	0.17
136	002407	多氟多	7,000	351,610.00	0.17
137	002179	中航光电	7,600	351,120.00	0.17
138	002138	顺络电子	4,800	350,880.00	0.17
139	601100	恒立液压	3,200	344,192.00	0.16
140	000568	泸州老窖	4,400	341,088.00	0.16
141	601872	招商轮船	19,400	340,858.00	0.16
142	688002	睿创微纳	2,200	340,318.00	0.16
143	600879	航天电子	15,800	336,382.00	0.16
144	002241	歌尔股份	14,900	335,697.00	0.16
145	300395	菲利华	2,500	334,325.00	0.16
146	688017	绿的谐波	800	334,288.00	0.16
147	603288	海天味业	10,040	332,926.40	0.16
148	601006	大秦铁路	71,400	329,154.00	0.16
149	300390	天华新能	3,500	327,285.00	0.16
150	000408	藏格矿业	4,700	325,804.00	0.16
151	601658	邮储银行	66,000	325,380.00	0.16
152	605117	德业股份	3,060	324,910.80	0.16
153	688469	芯联集成	30,200	320,422.00	0.15
154	600905	三峡能源	85,900	318,689.00	0.15
155	600489	中金黄金	17,400	314,070.00	0.15
156	002625	光启技术	10,300	312,296.00	0.15
157	688396	华润微	3,200	312,160.00	0.15
158	601888	中国中免	5,800	311,518.00	0.15
159	600893	航发动力	8,000	306,720.00	0.15
160	000630	铜陵有色	48,200	306,552.00	0.15
161	688271	联影医疗	3,000	303,690.00	0.14

162	600010	包钢股份	135,900	303,057.00	0.14
163	600673	东阳光	9,000	302,220.00	0.14
164	601127	赛力斯	4,900	300,125.00	0.14
165	688111	金山办公	1,400	298,270.00	0.14
166	002273	水晶光电	8,400	298,032.00	0.14
167	300037	新宙邦	3,200	297,120.00	0.14
168	300058	蓝色光标	21,500	295,840.00	0.14
169	600118	中国卫星	3,600	295,380.00	0.14
170	601689	拓普集团	5,200	293,384.00	0.14
171	002027	分众传媒	60,500	292,820.00	0.14
172	600019	宝钢股份	52,400	284,532.00	0.14
173	300751	迈为股份	1,000	282,460.00	0.13
174	000426	兴业银锡	8,500	280,160.00	0.13
175	600760	中航沈飞	6,800	279,480.00	0.13
176	000807	云铝股份	12,500	276,750.00	0.13
177	601168	西部矿业	10,000	271,400.00	0.13
178	600104	上汽集团	27,622	269,590.72	0.13
179	300450	先导智能	6,600	268,752.00	0.13
180	600362	江西铜业	6,200	268,460.00	0.13
181	600989	宝丰能源	13,200	268,356.00	0.13
182	688099	晶晨股份	2,600	267,540.00	0.13
183	601727	上海电气	37,900	265,300.00	0.13
184	600875	东方电气	9,200	264,684.00	0.13
185	600988	赤峰黄金	10,000	263,200.00	0.13
186	002001	新 和 成	9,200	261,464.00	0.12
187	605589	圣泉集团	4,100	260,637.00	0.12
188	600667	太极实业	8,800	256,784.00	0.12
189	601390	中国中铁	61,400	256,038.00	0.12
190	600885	宏发股份	7,400	255,226.00	0.12
191	002422	科伦药业	6,600	254,232.00	0.12
192	002126	银轮股份	5,100	253,980.00	0.12
193	002738	中矿资源	4,300	253,657.00	0.12
194	000960	锡业股份	5,900	251,871.00	0.12
195	000538	云南白药	5,300	251,061.00	0.12
196	600795	国电电力	53,600	250,312.00	0.12
197	600392	盛和资源	8,400	250,068.00	0.12
198	600547	山东黄金	10,800	249,372.00	0.12
199	000831	中国稀土	4,400	244,156.00	0.12
200	600585	海螺水泥	14,400	244,080.00	0.12
201	601669	中国电建	51,800	243,460.00	0.12
202	600418	江淮汽车	9,400	242,802.00	0.12
203	002648	卫星化学	10,100	237,249.00	0.11
204	300316	晶盛机电	3,900	235,560.00	0.11

205	600141	兴发集团	5,000	234,850.00	0.11
206	002812	恩捷股份	3,500	234,185.00	0.11
207	002129	TCL中环	19,400	233,188.00	0.11
208	300015	爱尔眼科	28,000	231,280.00	0.11
209	600096	云天化	7,600	231,040.00	0.11
210	300782	卓胜微	2,100	230,118.00	0.11
211	601179	中国西电	15,300	228,276.00	0.11
212	301358	湖南裕能	3,000	227,610.00	0.11
213	600346	恒力石化	12,700	224,917.00	0.11
214	601868	中国能建	83,900	224,013.00	0.11
215	600482	中国动力	6,800	223,040.00	0.11
216	002195	岩山科技	34,000	222,360.00	0.11
217	000066	中国长城	11,600	220,980.00	0.11
218	002558	巨人网络	8,000	220,480.00	0.11
219	600497	驰宏锌锗	18,200	220,402.00	0.11
220	600580	卧龙电驱	6,600	218,460.00	0.10
221	300418	昆仑万维	5,400	217,944.00	0.10
222	000625	长安汽车	29,900	214,383.00	0.10
223	600426	华鲁恒升	8,900	212,888.00	0.10
224	600066	宇通客车	7,900	211,799.00	0.10
225	600157	永泰能源	131,500	211,715.00	0.10
226	600895	张江高科	5,600	208,600.00	0.10
227	600221	海航控股	154,500	208,575.00	0.10
228	000157	中联重科	29,900	208,403.00	0.10
229	002532	天山铝业	19,400	208,162.00	0.10
230	605499	东鹏饮料	1,650	203,659.50	0.10
231	600711	盛屯矿业	18,500	202,945.00	0.10
232	002340	格林美	30,600	202,266.00	0.10
233	300803	指南针	2,200	201,674.00	0.10
234	000933	神火股份	9,500	201,400.00	0.10
235	600011	华能国际	26,500	201,135.00	0.10
236	688036	传音控股	3,400	200,430.00	0.10
237	600048	保利发展	43,200	200,016.00	0.10
238	600143	金发科技	12,800	197,760.00	0.09
239	600436	片仔癀	1,800	196,704.00	0.09
240	600438	通威股份	16,200	196,182.00	0.09
241	300017	网宿科技	15,000	195,150.00	0.09
242	600115	中国东航	51,100	194,691.00	0.09
243	002821	凯莱英	1,200	194,400.00	0.09
244	002493	荣盛石化	18,000	193,500.00	0.09
245	002236	大华股份	11,700	192,933.00	0.09
246	002131	利欧股份	40,600	192,850.00	0.09
247	600886	国投电力	14,400	191,664.00	0.09

248	600570	恒生电子	9,000	190,710.00	0.09
249	002456	欧菲光	20,100	190,146.00	0.09
250	600352	浙江龙盛	15,600	188,916.00	0.09
251	601233	桐昆股份	8,600	186,190.00	0.09
252	688047	龙芯中科	1,200	185,604.00	0.09
253	603659	璞泰来	6,400	185,152.00	0.09
254	300339	润和软件	4,800	184,848.00	0.09
255	003816	中国广核	47,100	184,161.00	0.09
256	601360	三六零	21,000	182,490.00	0.09
257	601058	赛轮轮胎	15,800	182,174.00	0.09
258	000301	东方盛虹	15,800	180,910.00	0.09
259	600026	中远海能	10,000	179,400.00	0.09
260	300759	康龙化成	6,200	179,366.00	0.09
261	002074	国轩高科	6,500	178,815.00	0.09
262	688122	西部超导	2,800	175,868.00	0.08
263	688578	艾力斯	1,600	174,720.00	0.08
264	300438	鹏辉能源	2,100	173,985.00	0.08
265	002555	三七互娱	9,200	173,604.00	0.08
266	600009	上海机场	7,500	173,250.00	0.08
267	600196	复星医药	7,700	173,019.00	0.08
268	000768	中航西飞	8,400	172,032.00	0.08
269	688213	思特威	1,600	171,312.00	0.08
270	002472	双环传动	4,100	170,191.00	0.08
271	601111	中国国航	27,900	168,795.00	0.08
272	000975	山金国际	9,900	168,300.00	0.08
273	600415	小商品城	16,500	167,640.00	0.08
274	002517	恺英网络	10,300	167,375.00	0.08
275	600674	川投能源	11,800	167,206.00	0.08
276	300207	欣旺达	8,800	167,112.00	0.08
277	600029	南方航空	32,200	166,796.00	0.08
278	300001	特锐德	4,400	166,452.00	0.08
279	300458	全志科技	4,200	165,732.00	0.08
280	002601	龙佰集团	10,000	164,800.00	0.08
281	600219	南山铝业	41,200	164,388.00	0.08
282	601186	中国铁建	27,600	164,220.00	0.08
283	002128	电投能源	7,100	164,152.00	0.08
284	002595	豪迈科技	3,500	163,100.00	0.08
285	601877	正泰电器	6,500	162,955.00	0.08
286	601117	中国化学	21,900	160,965.00	0.08
287	600233	圆通速递	10,200	160,650.00	0.08
288	300115	长盈精密	5,700	159,258.00	0.08
289	301236	软通动力	3,700	157,065.00	0.07
290	600372	中航机载	14,400	156,240.00	0.07

291	002155	湖南黄金	6,500	155,155.00	0.07
292	600839	四川长虹	22,200	154,956.00	0.07
293	300454	深信服	1,600	153,920.00	0.07
294	603129	春风动力	600	153,480.00	0.07
295	002465	海格通信	12,000	153,240.00	0.07
296	688235	百济神州	600	152,766.00	0.07
297	300568	星源材质	8,000	149,760.00	0.07
298	000963	华东医药	5,300	149,036.00	0.07
299	300347	泰格医药	3,100	148,800.00	0.07
300	000547	航天发展	7,700	147,455.00	0.07
301	600741	华域汽车	9,500	147,440.00	0.07
302	603650	彤程新材	1,500	146,970.00	0.07
303	002920	德赛西威	1,800	146,700.00	0.07
304	300024	机器人	7,500	144,975.00	0.07
305	002130	沃尔核材	7,500	142,200.00	0.07
306	002497	雅化集团	6,900	140,553.00	0.07
307	688266	泽璟制药	1,200	139,992.00	0.07
308	300012	华测检测	10,100	139,986.00	0.07
309	000878	云南铜业	8,800	139,744.00	0.07
310	001979	招商蛇口	21,600	138,888.00	0.07
311	002414	高德红外	10,300	136,578.00	0.07
312	002271	东方雨虹	11,500	136,505.00	0.07
313	300083	创世纪	10,000	136,200.00	0.06
314	000034	神州数码	4,900	135,975.00	0.06
315	300496	中科创达	2,200	135,938.00	0.06
316	300866	安克创新	1,300	135,850.00	0.06
317	603979	金诚信	2,300	135,769.00	0.06
318	688676	金盘科技	1,600	135,424.00	0.06
319	002432	九安医疗	1,900	134,292.00	0.06
320	688608	恒玄科技	800	133,752.00	0.06
321	002444	巨星科技	4,300	133,730.00	0.06
322	000661	长春高新	2,000	133,200.00	0.06
323	300474	景嘉微	2,200	133,056.00	0.06
324	601021	春秋航空	2,900	132,182.00	0.06
325	000733	振华科技	2,300	130,272.00	0.06
325	002756	永兴材料	2,300	130,272.00	0.06
326	688331	荣昌生物	1,000	130,260.00	0.06
327	601319	中国人保	19,000	128,440.00	0.06
328	600699	均胜电子	5,900	127,499.00	0.06
329	300763	锦浪科技	1,400	126,490.00	0.06
330	300748	金力永磁	4,100	126,485.00	0.06
331	601615	明阳智能	10,900	126,113.00	0.06
332	300073	当升科技	2,600	124,904.00	0.06

333	002078	太阳纸业	10,000	124,900.00	0.06
334	603087	甘李药业	2,200	124,872.00	0.06
335	300142	沃森生物	9,600	124,704.00	0.06
336	300432	富临精工	6,200	124,558.00	0.06
337	603606	东方电缆	2,960	122,869.60	0.06
338	601677	明泰铝业	7,400	122,840.00	0.06
339	300919	中伟新材	2,800	122,500.00	0.06
340	000423	东阿阿胶	2,700	122,472.00	0.06
341	601800	中国交建	21,400	122,194.00	0.06
342	600039	四川路桥	15,600	121,992.00	0.06
343	002025	航天电器	1,600	121,952.00	0.06
344	000002	万　科A	41,100	121,656.00	0.06
345	002252	上海莱士	27,800	120,652.00	0.06
346	300724	捷佳伟创	1,700	120,020.00	0.06
347	600226	亨通股份	12,500	119,875.00	0.06
348	688599	天合光能	8,400	118,608.00	0.06
349	688506	百利天恒	400	117,612.00	0.06
350	688223	晶科能源	24,600	116,850.00	0.06
351	688169	石头科技	1,200	113,964.00	0.05
352	600588	用友网络	12,400	113,832.00	0.05
353	002064	华峰化学	11,900	112,931.00	0.05
354	001965	招商公路	12,200	111,752.00	0.05
355	601633	长城汽车	7,400	111,666.00	0.05
356	688188	柏楚电子	1,040	110,968.00	0.05
357	000786	北新建材	6,100	110,349.00	0.05
358	002831	裕同科技	3,100	110,236.00	0.05
359	688617	惠泰医疗	600	108,936.00	0.05
360	688390	固德威	1,000	108,510.00	0.05
361	688180	君实生物	3,200	108,224.00	0.05
362	300677	英科医疗	2,700	105,759.00	0.05
363	000519	中兵红箭	5,000	105,350.00	0.05
364	688065	凯赛生物	2,200	105,270.00	0.05
365	002294	信立泰	3,300	105,237.00	0.05
366	302132	中航成飞	1,800	104,976.00	0.05
367	601618	中国中冶	43,000	104,920.00	0.05
368	600516	方大炭素	17,000	104,890.00	0.05
369	603806	福斯特	6,200	104,098.00	0.05
370	300972	万辰集团	600	104,046.00	0.05
371	601607	上海医药	6,700	103,180.00	0.05
372	002176	江特电机	10,300	103,103.00	0.05
373	603260	合盛硅业	2,100	101,346.00	0.05
374	000623	吉林敖东	5,700	101,061.00	0.05
375	300832	新产业	2,400	100,800.00	0.05

376	300699	光威复材	3,500	100,275.00	0.05
377	002085	万丰奥威	9,000	99,810.00	0.05
378	000617	中油资本	15,100	99,509.00	0.05
379	002318	久立特材	4,100	97,990.00	0.05
380	300558	贝达药业	1,500	97,605.00	0.05
381	002459	晶澳科技	12,000	97,200.00	0.05
382	300251	光线传媒	8,700	96,483.00	0.05
383	002065	东华软件	13,500	96,390.00	0.05
384	002266	浙富控股	18,900	95,634.00	0.05
385	600499	科达制造	6,900	95,220.00	0.05
386	002044	美年健康	18,900	95,067.00	0.05
387	600085	同仁堂	4,100	94,751.00	0.05
388	300342	天银机电	2,000	94,000.00	0.04
389	300409	道氏技术	4,700	93,671.00	0.04
390	600515	海南机场	34,100	93,434.00	0.04
391	000400	许继电气	4,300	93,310.00	0.04
392	688472	阿特斯	8,600	93,052.00	0.04
393	605090	九丰能源	2,500	92,925.00	0.04
394	300003	乐普医疗	7,800	92,430.00	0.04
395	002223	鱼跃医疗	3,600	92,376.00	0.04
396	000032	深桑达A	3,700	92,315.00	0.04
397	603596	伯特利	3,708	92,106.72	0.04
398	688005	容百科技	3,000	91,800.00	0.04
399	301550	斯菱智驱	1,000	91,430.00	0.04
400	002405	四维图新	14,100	91,227.00	0.04
401	000415	渤海租赁	22,300	90,761.00	0.04
402	600521	华海药业	6,300	90,720.00	0.04
403	601216	君正集团	20,300	90,538.00	0.04
404	000683	博源化工	15,700	90,432.00	0.04
405	600862	中航高科	5,000	90,150.00	0.04
406	000999	华润三九	4,000	89,960.00	0.04
407	000039	中集集团	11,000	89,210.00	0.04
408	600803	新奥股份	5,600	88,480.00	0.04
409	600704	物产中大	18,700	88,264.00	0.04
410	603766	隆鑫通用	7,300	87,089.00	0.04
411	600312	平高电气	4,900	86,534.00	0.04
412	600018	上港集团	18,300	86,376.00	0.04
413	000887	中鼎股份	4,800	85,872.00	0.04
414	000967	盈峰环境	8,000	84,240.00	0.04
415	600332	白云山	4,200	84,168.00	0.04
416	688116	天奈科技	2,200	84,040.00	0.04
417	603605	珀莱雅	1,400	83,888.00	0.04
418	600153	建发股份	10,500	83,265.00	0.04

419	300122	智飞生物	7,100	82,999.00	0.04
420	000830	鲁西化工	6,900	82,800.00	0.04
421	600765	中航重机	6,400	82,688.00	0.04
422	600166	福田汽车	28,300	82,353.00	0.04
423	002410	广联达	9,900	80,784.00	0.04
424	600323	瀚蓝环境	2,900	79,634.00	0.04
425	002007	华兰生物	6,500	79,235.00	0.04
426	300896	爱美客	900	78,480.00	0.04
427	603568	伟明环保	4,900	75,362.00	0.04
428	600398	海澜之家	14,400	75,312.00	0.04
429	002603	以岭药业	5,000	75,000.00	0.04
430	601000	唐山港	18,000	74,700.00	0.04
431	600529	山东药玻	4,000	73,800.00	0.04
432	688009	中国通号	15,400	73,304.00	0.03
433	601018	宁波港	23,200	73,080.00	0.03
434	600208	衢州发展	25,800	73,014.00	0.03
435	002389	航天彩虹	4,100	72,857.00	0.03
436	600316	洪都航空	2,600	72,644.00	0.03
437	601799	星宇股份	800	72,496.00	0.03
438	600008	首创环保	26,400	71,808.00	0.03
439	688114	华大智造	1,400	71,512.00	0.03
440	000738	航发控制	3,900	71,331.00	0.03
441	600170	上海建工	32,100	71,262.00	0.03
442	603486	科沃斯	1,400	71,050.00	0.03
443	600486	扬农化工	1,400	70,980.00	0.03
444	600998	九州通	15,100	70,819.00	0.03
445	000932	华菱钢铁	20,400	70,788.00	0.03
446	600820	隧道股份	13,200	68,772.00	0.03
447	300118	东方日升	5,500	68,475.00	0.03
448	600161	天坛生物	5,900	68,322.00	0.03
449	601238	广汽集团	13,400	68,072.00	0.03
450	603885	吉祥航空	6,500	66,885.00	0.03
451	688303	大全能源	3,800	66,234.00	0.03
452	002607	中公教育	36,500	65,700.00	0.03
453	603816	顾家家居	2,900	64,844.00	0.03
454	603939	益丰药房	3,600	64,728.00	0.03
455	600763	通策医疗	1,900	64,372.00	0.03
456	600038	中直股份	2,500	63,225.00	0.03
457	688166	博瑞医药	1,800	63,018.00	0.03
458	300573	兴齐眼药	1,540	62,770.40	0.03
459	601567	三星电气	4,200	62,748.00	0.03
460	300049	福瑞医科	1,600	62,208.00	0.03
461	603392	万泰生物	2,300	62,031.00	0.03

462	601880	辽港股份	44,200	60,996.00	0.03
463	600511	国药股份	2,300	59,892.00	0.03
464	300676	华大基因	1,700	59,602.00	0.03
465	600535	天士力	4,500	59,535.00	0.03
466	300100	双林股份	2,100	58,338.00	0.03
467	002244	滨江集团	7,500	57,000.00	0.03
468	600816	建元信托	23,300	56,852.00	0.03
469	000833	粤桂股份	2,400	56,208.00	0.03
470	601155	新城控股	5,400	55,404.00	0.03
471	002120	韵达股份	8,700	55,332.00	0.03
472	300144	宋城演艺	9,400	54,614.00	0.03
473	688063	派能科技	1,000	53,270.00	0.03
474	002544	普天科技	2,900	52,838.00	0.03
475	000998	隆平高科	7,000	52,780.00	0.03
476	601866	中远海发	23,000	50,830.00	0.02
477	300457	赢合科技	2,400	50,592.00	0.02
478	600635	大众公用	11,800	50,504.00	0.02
479	000035	中国天楹	10,200	49,266.00	0.02
480	600754	锦江酒店	2,700	48,573.00	0.02
481	600655	豫园股份	11,700	48,087.00	0.02
482	300601	康泰生物	4,100	46,494.00	0.02
483	600004	白云机场	6,200	45,012.00	0.02
484	600258	首旅酒店	4,100	44,772.00	0.02
485	600663	陆家嘴	7,100	44,588.00	0.02
486	600859	王府井	4,800	44,064.00	0.02
487	603899	晨光股份	2,100	43,323.00	0.02
488	002091	江苏国泰	5,900	42,657.00	0.02
489	300070	碧水源	13,300	42,427.00	0.02
490	000069	华侨城A	23,700	38,868.00	0.02
491	600864	哈投股份	7,400	38,406.00	0.02
492	301078	孩子王	5,200	35,152.00	0.02
493	002292	奥飞娱乐	5,300	34,768.00	0.02
494	603833	欧派家居	1,100	33,121.00	0.02
495	002891	中宠股份	1,200	32,064.00	0.02
496	600325	华发股份	13,400	30,954.00	0.01
497	002572	索菲亚	3,400	24,820.00	0.01

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688797	臻宝科技	79	37,024.93	0.02
2	001399	惠科股份	1,051	29,144.23	0.01

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	8,635,058.00	4.12
2	300308	中际旭创	7,664,179.00	3.66
3	600519	贵州茅台	6,473,413.00	3.09
4	601318	中国平安	4,667,969.00	2.23
5	300502	新易盛	4,455,420.00	2.13
6	601899	紫金矿业	4,183,230.00	2.00
7	600036	招商银行	3,606,985.20	1.72
8	000333	美的集团	2,979,338.40	1.42
9	688256	寒武纪	2,713,589.42	1.29
10	002475	立讯精密	2,705,902.00	1.29
11	600900	长江电力	2,483,361.62	1.18
12	601166	兴业银行	2,284,655.40	1.09
13	688041	海光信息	2,071,675.90	0.99
14	002594	比亚迪	2,061,274.00	0.98
15	603259	药明康德	1,983,897.00	0.95
16	600030	中信证券	1,978,559.00	0.94
17	300059	东方财富	1,934,142.00	0.92
18	002384	东山精密	1,893,724.00	0.90
19	600276	恒瑞医药	1,839,310.00	0.88
20	601398	工商银行	1,817,765.00	0.87

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	1,835,213.00	0.88
2	300750	宁德时代	1,587,119.00	0.76
3	600519	贵州茅台	1,280,704.50	0.61
4	300502	新易盛	1,136,204.00	0.54
5	601318	中国平安	881,707.00	0.42
6	688256	寒武纪	843,540.64	0.40
7	601899	紫金矿业	766,537.00	0.37
8	600036	招商银行	723,794.00	0.35
9	300394	天孚通信	664,912.00	0.32
10	000333	美的集团	637,502.00	0.30
11	603986	兆易创新	568,689.00	0.27
12	002475	立讯精密	547,083.00	0.26
13	688008	澜起科技	522,176.00	0.25
14	600900	长江电力	510,571.00	0.24

15	601088	中国神华	464,303.00	0.22
16	601166	兴业银行	454,990.00	0.22
17	688012	中微公司	452,688.00	0.22
18	688981	中芯国际	441,614.00	0.21
19	002384	东山精密	436,724.00	0.21
20	002371	北方华创	413,880.00	0.20

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	244,309,910.24
卖出股票收入（成交）总额	54,146,850.85

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	10,772,305.29	5.14
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	10,772,305.29	5.14

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	55,000	5,535,650.55	2.64
2	102326	国债 2601	27,000	2,717,501.18	1.30
3	019792	25 国债 19	17,000	1,717,836.96	0.82
4	019835	26 国债 09	8,000	801,316.60	0.38

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,634,706.02
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,634,706.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688797	臻宝科技	37,024.93	0.02	新股流通受限
2	001399	惠科股份	29,144.23	0.01	新股流通受限

§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 A500 指数 A	1,188	138,230.98	20,752,646.98	12.6372	143,465,759.21	87.3628
鑫元中证 A500 指数 C	491	74,263.79	-	-	36,463,519.71	100.0000
合计	1,679	119,524.67	20,752,646.98	10.3411	179,929,278.92	89.6589

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 A500 指数 A	70,393.60	0.0429
	鑫元中证 A500 指数 C	5.00	0.0000
	合计	70,398.60	0.0351

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 A500 指数 A	0~10
	鑫元中证 A500 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 A500 指数 A	0
	鑫元中证 A500 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 A500 指数 A	鑫元中证 A500 指数 C
基金合同生效日（2026 年 4 月 17 日）基金份额总额	203,129,116.33	55,711,620.05
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	31,562,900.53	4,380,949.37
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	70,473,610.67	23,629,049.71
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	164,218,406.19	36,463,519.71

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，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，托管人未有受调查或处罚等情况。

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，托管人相关从业人员未有受调查或处罚等情况。

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(%)	
中信证券	3	298,395,062.5	100.00	55,465.00	100.00	-

（山东）		7				

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：相关券商交易单元均为报告期内新增租用。

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(%)
中信证券（山东）	17,719,079.00	100.00	1,889,060,000.00	100.00	-	-

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 A500 指数型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告	公司网站、证券时报	2026 年 3 月 11 日
2	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金（鑫元中证 A500 指数 C）基金产品资料概要	公司网站	2026 年 3 月 11 日
3	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金（鑫元中证 A500 指数 A）基金产品资料概要	公司网站	2026 年 3 月 11 日
4	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金招募说明书	公司网站	2026 年 3 月 11 日
5	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金托管协议	公司网站	2026 年 3 月 11 日

6	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金基金合同	公司网站	2026 年 3 月 11 日
7	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金基金份额发售公告	公司网站、证券时报	2026 年 3 月 11 日
8	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金基金合同生效公告	公司网站、证券时报	2026 年 4 月 18 日
9	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
10	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
11	鑫元基金管理有限公司关于鑫元中证 A500 指数型证券投资基金开放申购、赎回、转换、定期定额投资业务的公告	公司网站、证券时报	2026 年 5 月 14 日
12	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金（鑫元中证 A500 指数 A）基金产品资料概要更新	公司网站	2026 年 6 月 27 日
13	鑫元中证 A500 指数型证券投资基金（鑫元中证 A500 指数 C）基金产品资料概要更新	公司网站	2026 年 6 月 27 日
14	鑫元中证 A500 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

§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 A500 指数型证券投资基金设立的文件；

2、《鑫元中证 A500 指数型证券投资基金基金合同》；

3、《鑫元中证 A500 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