鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金
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：上海浦东发展银行股份有限公司

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。

基金托管人上海浦东发展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 10
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 12
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 18

§7 投资组合报告 43

7.1 期末基金资产组合情况 43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 57
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 58
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 58
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 58

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 58
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 58
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 58
7.12 投资组合报告附注 58
§8 基金份额持有人信息 60
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 60
8.2 盈利投资者数量占比 60
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 60
8.4 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 60
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况 60
§9 开放式基金份额变动 62
§10 重大事件揭示 63
10.1 基金份额持有人大会决议 63
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 63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 63
10.4 基金投资策略的改变 63
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 63
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 63
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 63
10.8 其他重大事件 64
§11 影响投资者决策的其他重要信息 66
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 66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 66
§12 备查文件目录 67
12.1 备查文件目录 67
12.2 存放地点 67
12.3 查阅方式 67

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	鑫元行业轮动	
基金主代码	005949	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018 年 5 月 31 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	377,717,848.01 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
下属分级基金的交易代码	005949	005950
报告期末下属分级基金的份额总额	10,101,880.82 份	367,615,967.19 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于中国大陆 A 股市场和法律法规或监管机构允许投资的特定范围内的港股市场，通过行业轮动策略和跨境资产配置，精选经济波动下强势行业中具备核心竞争力的上市公司，同时，在严格控制风险的前提下，力争获取超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金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，评估中国 A 股、港股、债券及货币市场工具等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。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×30%＋恒生指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×40%。
风险收益特征	本基金为混合型基金，在证券投资基金中属于预期风险收益水平中等的投资品种，预期收益和预期风险高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。本基金将投资港股通标的股票，需承担汇率风险以及境外市场的风险。

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	上海浦东发展银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕	汪小敏
	联系电话	021-20892000 转	021-31888888
	电子邮箱	service@xyamc.com	wangxm8@spdb.com.cn

客户服务电话	4006066188	95528
传真	021-20892111	021-63602540
注册地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	上海市中山东一路 12 号
办公地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	上海市博成路 1388 号浦银中心 A 栋
邮政编码	200070	200126
法定代表人	龙艺	张为忠

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.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)	
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
本期已实现收益	900,022.37	9,735,705.53
本期利润	880,048.76	12,144,644.76
加权平均基金份额本期利润	0.0880	0.0922
本期加权平均净值利润率	11.97%	12.63%
本期基金份额净值增长率	12.80%	12.64%
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	-6,834,046.71	-253,142,818.11
期末可供分配基金份额利润	-0.6765	-0.6886
期末基金资产净值	7,842,486.53	279,749,838.35
期末基金份额净值	0.7763	0.7610
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	-22.37%	-29.56%

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）鑫元行业轮动 C 类基金份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

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

鑫元行业轮动 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	12.31%	1.19%	1.60%	0.65%	10.71%	0.54%

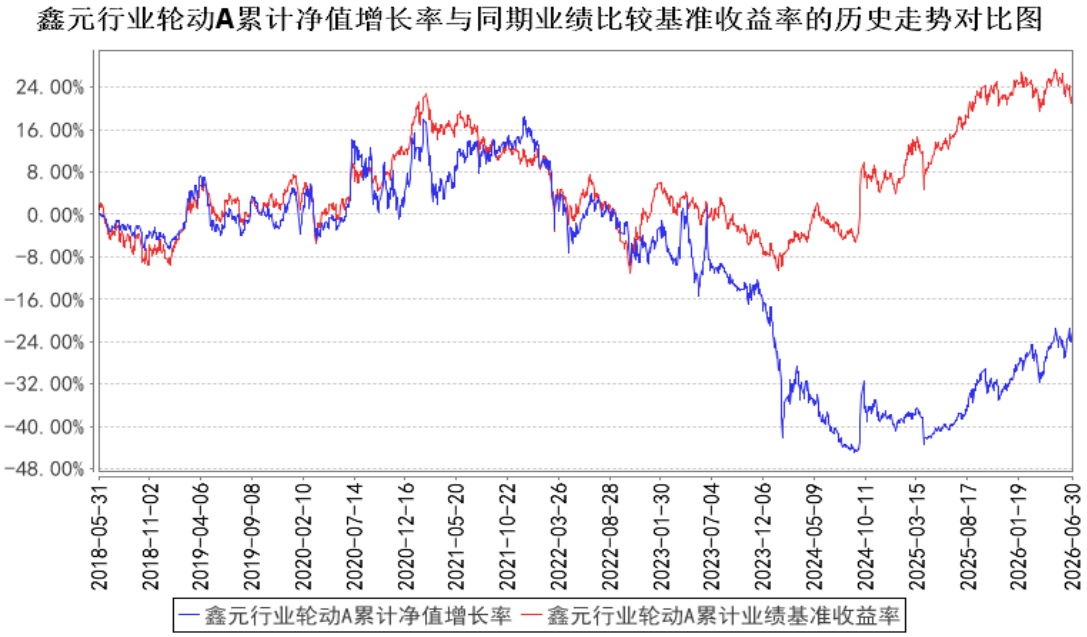
过去六个月	12.80%	1.16%	-0.17%	0.65%	12.97%	0.51%
过去一年	28.55%	1.04%	6.85%	0.59%	21.70%	0.45%
过去三年	-14.70%	1.25%	22.54%	0.68%	-37.24%	0.57%
过去五年	-31.69%	1.21%	3.62%	0.72%	-35.31%	0.49%
过去七年	-22.14%	1.17%	19.17%	0.72%	-41.31%	0.45%
自基金合同生效起至今	-22.37%	1.12%	22.26%	0.72%	-44.63%	0.40%

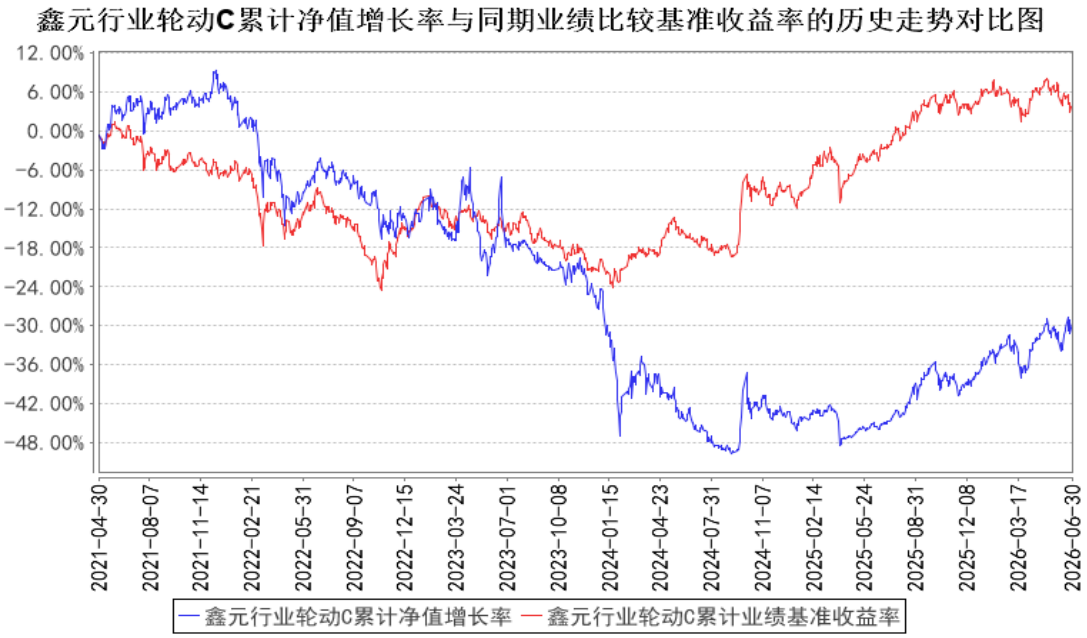
鑫元行业轮动 C

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	12.28%	1.19%	1.60%	0.65%	10.68%	0.54%
过去六个月	12.64%	1.16%	-0.17%	0.65%	12.81%	0.51%
过去一年	28.11%	1.04%	6.85%	0.59%	21.26%	0.45%
过去三年	-15.66%	1.25%	22.54%	0.68%	-38.20%	0.57%
过去五年	-33.02%	1.21%	3.62%	0.72%	-36.64%	0.49%
自基金合同生效起至今	-29.56%	1.20%	3.85%	0.72%	-33.41%	0.48%

注：鑫元行业轮动 C 类基金份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

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





注：（1）本基金的合同生效日为 2018 年 5 月 31 日。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。

（2）鑫元行业轮动 C 类基金份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

§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		
张汉毅	本基金的基金经理	2024 年 6 月 28 日	-	14 年	学历：信息与通信工程硕士。历任工业和信息化部电信研究院通信计量中心 FTA 部门测试工程师、光大证券股份有限公司研究员、光大证券资产管理有限公司研究员、国联安基金管理有限公司研究员、基金经理助理、基金经理、平安资产管理有限责任公司投资经理。2024 年 2 月加入鑫元基金管理有限公司，现任基金经理。

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

一季度市场波动剧烈，1-2 月延续了去年下半年的牛市行情，上证指数一度接近 4200 点，但在随后 3 月随着美以发动对伊朗军事打击，市场风险偏好快速下降，回调明显。整体一季度而言，受益战争方向的煤炭、石油石化等表现较好，而消费和部分 TMT 则跌幅较大，涨价线索成为资金追逐的热点。本基金去年底增加了化工行业的配置，在一季度取得一定效果，但与此同时组合中的港股标的无论是科技还是消费都出现大幅回调，造成了拖累。

二季度权益市场表现较好，经历了 3 月份美以伊冲突带来的冲击之后，市场迅速开始交易战争缓和，特别是在上涨中两极分化现象愈发明显，一方面 AI 相关的板块和个股高歌猛进，申万电子、通信指数分别上涨 90.9%和 63.8%，另一方面其他非 AI 板块在牛市中走熊，极端割裂。

本基金在 4 月份判断市场悲观预期已经比较充分，因此选择加仓来积极把握机会，取得了一定的效果，除此之外对于一些出现新变化的科技方向个股也积极尝试。进入 5 月下半月，本基金将持仓结构逐步向中证 A500 指数靠拢，以求在未来市场风格从极致向均衡回归的过程中，能够有提前的布局和准备。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元行业轮动 A 的基金份额净值增长率为 12.80%，同期业绩比较基准收益率为-0.17%。本报告期内鑫元行业轮动 C 的基金份额净值增长率为 12.64%，同期业绩比较基准收益率

为-0.17%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

7 月 A 股科技方向出现大幅回调，海外市场美国韩国 AI 产业链也都出现剧烈波动，各种对海外大厂资本开支的担忧开始发酵，行情把握难度大幅提升。对于 AI 叙事我们认为还未到全盘否定的阶段，更多是筹码因素导致的分歧，后续需要进一步跟踪海外巨头最新财报做出判断。与此同时之前那些受科技资金影响而下跌的板块中也存在不少错杀机会，下半年可能蕴含转机，这也是我们看好市场结构重回均衡的原因。

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，上海浦东发展银行股份有限公司（以下简称“本托管人”）在对鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的托管过程中，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、托管协议的规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本托管人依照《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、托管协议的规定，对鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金的投资运作进行了监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支以及利润分配等方面进行了认真的复核，未发现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

本报告期内，由鑫元基金管理有限公司编制本托管人复核的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：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	8,211,702.80	9,737,845.17
结算备付金		1,672,346.11	526,657.28
存出保证金		73,301.12	13,763.13
交易性金融资产	6.4.7.2	252,093,580.98	52,248,446.12
其中：股票投资		239,260,328.40	49,012,749.90
基金投资		-	-
债券投资		12,833,252.58	3,235,696.22
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		-	139,714.14
应收股利		-	3,904.00
应收申购款		30,010,409.64	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		292,061,340.65	62,670,329.84
负债和净资产	**附注号**	**本期末 2026 年 6 月 30 日**	**上年度末 2025 年 12 月 31 日**
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		4,148,460.71	501,313.28
应付赎回款		1,562.63	2,446.61

应付管理人报酬		113,382.90	31,110.05
应付托管费		18,897.15	5,185.01
应付销售服务费		1,827.33	18,444.36
应付投资顾问费		-	-
应交税费		440.55	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	184,444.50	102,836.53
负债合计		4,469,015.77	661,335.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	377,717,848.01	91,600,621.10
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-90,125,523.13	-29,591,627.10
净资产合计		287,592,324.88	62,008,994.00
负债和净资产总计		292,061,340.65	62,670,329.84

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 377,717,848.01 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.7763 元，份额总额 10,101,880.82 份；下属 C 类基金份额净值 0.7610 元，份额总额 367,615,967.19 份。

6.2 利润表

会计主体：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		13,518,250.44	-1,396,186.87
1.利息收入		21,138.38	19,351.25
其中：存款利息收入	6.4.7.13	21,138.38	19,351.25
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		11,107,501.39	-48,672.10
其中：股票投资收益	6.4.7.14	9,743,308.06	-617,722.20
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	43,475.63	4,290.20
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	1,320,717.70	564,759.90
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	2,388,965.62	-1,377,158.94
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	645.05	10,292.92
减：二、营业总支出		493,556.92	256,842.42
1．管理人报酬	6.4.10.2.1	301,775.09	140,022.46
其中：暂估管理人报酬		-	-
2．托管费	6.4.10.2.2	50,295.78	23,337.03
3．销售服务费		88,023.49	67,257.51
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		119.35	-
8．其他费用	6.4.7.23	53,343.21	26,225.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,024,693.52	-1,653,029.29
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,024,693.52	-1,653,029.29
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,024,693.52	-1,653,029.29

6.3 净资产变动表

会计主体：鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金

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	91,600,621.10	-29,591,627.10	62,008,994.00

二、本期期初净资产	91,600,621.10	-29,591,627.10	62,008,994.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	286,117,226.91	-60,533,896.03	225,583,330.88
（一）、综合收益总额	-	13,024,693.52	13,024,693.52
（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）	286,117,226.91	-73,558,589.55	212,558,637.36
其中：1.基金申购款	286,562,613.85	-73,684,083.35	212,878,530.50
2.基金赎回款	-445,386.94	125,493.80	-319,893.14
（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	377,717,848.01	-90,125,523.13	287,592,324.88

项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	59,331,214.19	-22,823,575.69	36,507,638.50
二、本期期初净资产	59,331,214.19	-22,823,575.69	36,507,638.50
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	32,156,655.44	-14,221,818.70	17,934,836.74
（一）、综合收益总额	-	-1,653,029.29	-1,653,029.29
（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）	32,156,655.44	-12,568,789.41	19,587,866.03
其中：1.基金申购款	64,952,879.71	-24,992,543.72	39,960,335.99
2.基金赎回款	-32,796,224.27	12,423,754.31	-20,372,469.96

（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	91,487,869.63	-37,045,394.39	54,442,475.24

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

鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（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[2017]2182 号文《关于准予鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》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《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式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 38,998,000.00 元，已经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2018）第 0140 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 5 月 31 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 39,007,134.69 份基金份额，其中认购资金利息折合 9,134.69 份基金份额。本基金的基金管理人及注册登记机构为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为上海浦东发展银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、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、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债、可转换债、可交换债、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、通知存款、定期存款及其他银行存款等）、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货、国债期货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）。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：股票资产占基金资产的 0%-95%（其中投资于国内依法发行上市的股票的比例占基金资产的 0%-95%，投资于港股通标的股票的比例占股票资产的 0-50%）；基金持有全部权证的市值不超过基金资产净值的 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货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、应收申购款等；权证、股指期货、国债期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如果法律法规对该比例要求有变更的，以变更后的比例为准，本基金的投资范围会做相应调整。本基金的业绩比较基准为：沪深 300 指数收益率×30%＋恒生指数收益率×30%+中证综合债券指数收益率×40%。

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	8,211,702.80
等于：本金	8,211,429.62
加：应计利息	273.18
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	8,211,702.80

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		231,206,109.50	-	239,260,328.40	8,054,218.90
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,712,554.00	124,362.58	12,833,252.58	-3,664.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,712,554.00	124,362.58	12,833,252.58	-3,664.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		243,918,663.50	124,362.58	252,093,580.98	8,050,554.90

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	131,880.29
其中：交易所市场	131,880.29
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	52,564.21
合计	184,444.50

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元行业轮动 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	9,975,067.11	9,975,067.11
本期申购	287,271.64	287,271.64
本期赎回（以“-”号填列）	-160,457.93	-160,457.93
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	10,101,880.82	10,101,880.82

金额单位：人民币元

鑫元行业轮动 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	81,625,553.99	81,625,553.99
本期申购	286,275,342.21	286,275,342.21
本期赎回（以“-”号填列）	-284,929.01	-284,929.01
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	367,615,967.19	367,615,967.19

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

鑫元行业轮动 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,642,805.15	4,532,606.64	-3,110,198.51
本期期初	-7,642,805.15	4,532,606.64	-3,110,198.51
本期利润	900,022.37	-19,973.61	880,048.76
本期基金份额交易产生的变动数	-91,263.93	62,019.39	-29,244.54
其中：基金申购款	-206,646.98	135,283.93	-71,363.05
基金赎回款	115,383.05	-73,264.54	42,118.51
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-6,834,046.71	4,574,652.42	-2,259,394.29

鑫元行业轮动 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-63,297,610.89	36,816,182.30	-26,481,428.59
本期期初	-63,297,610.89	36,816,182.30	-26,481,428.59
本期利润	9,735,705.53	2,408,939.23	12,144,644.76
本期基金份额交易产生的变动数	-199,580,912.75	126,051,567.74	-73,529,345.01
其中：基金申购款	-199,798,390.15	126,185,669.85	-73,612,720.30
基金赎回款	217,477.40	-134,102.11	83,375.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-253,142,818.11	165,276,689.27	-87,866,128.84

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	19,460.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	918.09
其他	760.06
合计	21,138.38

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	9,743,308.06
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	9,743,308.06

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	79,129,218.98
减：卖出股票成本总额	69,176,469.47
减：交易费用	209,441.45
买卖股票差价收入	9,743,308.06

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	34,592.79
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	8,882.84
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	43,475.63

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	3,237,120.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,190,990.03
减：应计利息总额	37,120.00
减：交易费用	127.13
买卖债券差价收入	8,882.84

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,320,717.70
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	1,320,717.70

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	2,388,965.62
——股票投资	2,401,639.59
——债券投资	-12,673.97
——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	2,388,965.62

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	645.05
合计	645.05

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	-
银行汇划费用	557.59
证券组合费	221.41
合计	53,343.21

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

上海浦东发展银行股份有限公司(“浦发银行”)	基金托管人
南京高科股份有限公司(“南京高科”)	基金管理人的股东
南京银行股份有限公司(“南京银行”)	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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	301,775.09	140,022.46
其中:应支付销售机构的客户维护费	41,543.32	16,139.23
应支付基金管理人的净管理费	260,231.77	123,883.23

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 0.60%的年费率计提。计算方法如下：

H=E×0.60%÷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	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	50,295.78	23,337.03

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 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		
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C	合计
鑫元基金	-	21,736.51	21,736.51
南京银行	-	-	-
浦发银行	-	-	-
合计	-	21,736.51	21,736.51
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C	合计
鑫元基金	-	23,582.99	23,582.99
南京银行	-	-	-
浦发银行	-	-	-
合计	-	23,582.99	23,582.99

注：2025 年 1 月 1 日至 2026 年 5 月 14 日，C 类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 0.4%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×0.4%÷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

根据《鑫元基金管理有限公司关于开展鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 C 类基金份额销售服务费优惠活动的公告》，自 2026 年 5 月 15 日起，C 类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 0.01%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×0.01%÷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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（ 2018 年 5 月 31 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	217,354.06	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-

报告期末持有的基金份额	217,354.06	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.0575%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（ 2018 年 5 月 31 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	217,354.06	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	217,354.06	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.2376%	-

注：（1）期间申购/买入总份额含红利再投、转换入份额。期间赎回/卖出总份额含转换出份额。

（2）本基金管理人运用固有资金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。

6.4.10.5.2 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

鑫元行业轮动 A

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
-	-	-	-	-

份额单位：份

鑫元行业轮动 C

关联方名称	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例（%）	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	89,056,928.47	23.5776	29,403,000.00	32.0991

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 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
浦发银行	8,211,702.80	19,460.23	11,704,386.54	19,112.51

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：本基金本报告期及上年度可比期间均未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

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	748,376.00	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	上年度末 2025 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	12,833,252.58	3,235,696.22
合计	12,833,252.58	3,235,696.22

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	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

30 日							
资产							
货币资金	8,211,429.62	0.00	0.00	0.00	0.00	273.18	8,211,702.80
结算备付金	1,672,199.77	0.00	0.00	0.00	0.00	146.34	1,672,346.11
存出保证金	73,294.73	0.00	0.00	0.00	0.00	6.39	73,301.12
交易性金融资产	0.00	0.00	12,708,890.00	0.00	0.00	239,384,690.98	252,093,580.98
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	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	30,010,409.64	30,010,409.64
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	9,956,924.12	0.00	12,708,890.00	0.00	0.00	269,395,526.53	292,061,340.65
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	4,148,460.71	4,148,460.71
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,562.63	1,562.63
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	113,382.90	113,382.90
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	18,897.15	18,897.15
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,827.33	1,827.33
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	440.55	440.55
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	184,444.50	184,444.50
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	4,469,015.77	4,469,015.77
利率敏感度缺口	9,956,924.12	0.00	12,708,890.00	0.00	0.00	264,926,510.76	287,592,324.88
上年度末 2025 年 12 月	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

31 日							
资产							
货币资金	9,737,111.00	0.00	0.00	0.00	0.00	734.17	9,737,845.17
结算备付金	526,633.58	0.00	0.00	0.00	0.00	23.70	526,657.28
存出保证金	13,749.24	0.00	0.00	0.00	0.00	13.89	13,763.13
交易性金融资产	3,200,000.00	0.00	0.00	0.00	0.00	49,048,446.12	52,248,446.12
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	139,714.14	139,714.14
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	3,904.00	3,904.00
应收申购款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	13,477,493.82	0.00	0.00	0.00	0.00	49,192,836.02	62,670,329.84
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	501,313.28	501,313.28
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,446.61	2,446.61
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	31,110.05	31,110.05
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,185.01	5,185.01
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	18,444.36	18,444.36
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	0.00	0.00
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	102,836.53	102,836.53
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	661,335.84	661,335.84
利率敏感度缺口	13,477,493.82	0.00	0.00	0.00	0.00	48,531,500.18	62,008,994.00

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	9,290.63	328.83
	2.市场利率上升 25 个基点	-9,277.06	-328.77

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。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
资产合计	-	-	-	-
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	-	-	-
项目	上年度末 2025 年 12 月 31 日			
	美元折合人民币	港币折合人民币	其他币种折合人民币	合计
以外币计价的资产				
交易性金融资产	-	7,745,296.66	-	7,745,296.66

应收股利	-	3,904.00	-	3,904.00
资产合计	-	7,749,200.66	-	7,749,200.66
以外币计价的负债				
负债合计	-	-	-	-
资产负债表外汇风险敞口净额	-	7,749,200.66	-	7,749,200.66

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	所有港币均相对人民币升值 5%	0.00	387,460.03
	所有港币均相对人民币贬值 5%	0.00	-387,460.03

注：无。

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	239,260,328.40	83.19	49,012,749.90	79.04
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	239,260,328.40	83.19	49,012,749.90	79.04

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%	4,234,035.86	701,439.05
	业绩比较基准下降 1%	-4,234,035.86	-701,439.05

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	238,204,892.40	49,012,749.90
第二层次	13,888,688.58	3,235,696.22
第三层次	-	-
合计	252,093,580.98	52,248,446.12

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	239,260,328.40	81.92
	其中：股票	239,260,328.40	81.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,833,252.58	4.39
	其中：债券	12,833,252.58	4.39
	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	9,884,048.91	3.38
8	其他各项资产	30,083,710.76	10.30
9	合计	292,061,340.65	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

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	740,616.16	0.26
B	采矿业	10,199,661.00	3.55
C	制造业	169,720,291.08	59.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,830,209.00	2.03
E	建筑业	3,101,235.00	1.08
F	批发和零售业	1,838,367.00	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	5,497,489.00	1.91
H	住宿和餐饮业	115,766.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,850,224.36	4.12
J	金融业	22,957,253.00	7.98
K	房地产业	1,238,423.00	0.43
L	租赁和商务服务业	1,726,622.00	0.60
M	科学研究和技术服务业	2,946,152.00	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	402,164.80	0.14

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	72,900.00	0.03
Q	卫生和社会工作	454,302.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	176,025.00	0.06
S	综合	392,628.00	0.14
	合计	239,260,328.40	83.19

7.2.2 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

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	9,000	11,430,000.00	3.97
2	300750	宁德时代	20,100	7,899,501.00	2.75
3	600519	贵州茅台	4,800	5,690,352.00	1.98
4	300502	新易盛	8,260	5,013,820.00	1.74
5	601318	中国平安	82,600	3,943,324.00	1.37
6	603986	兆易创新	4,800	3,912,000.00	1.36
7	600036	招商银行	102,500	3,638,750.00	1.27
8	688256	寒武纪	2,000	3,191,100.00	1.11
9	601899	紫金矿业	118,900	2,989,146.00	1.04
10	000333	美的集团	39,400	2,975,882.00	1.03
11	002371	北方华创	3,100	2,742,136.00	0.95
12	600900	长江电力	100,800	2,668,176.00	0.93
13	000725	京东方 A	298,500	2,590,980.00	0.90
14	600183	生益科技	14,700	2,548,980.00	0.89
15	002384	东山精密	9,600	2,518,560.00	0.88
16	002475	立讯精密	33,900	2,386,560.00	0.83
17	603259	药明康德	18,700	2,328,337.00	0.81
18	601166	兴业银行	138,900	2,300,184.00	0.80
19	600487	亨通光电	20,200	2,208,668.00	0.77
20	600030	中信证券	76,100	2,186,353.00	0.76
21	688041	海光信息	5,800	2,147,740.00	0.75
22	688008	澜起科技	6,800	2,107,320.00	0.73
23	688981	中芯国际	12,506	1,986,202.92	0.69
24	601398	工商银行	273,000	1,930,110.00	0.67
25	300408	三环集团	11,400	1,902,660.00	0.66
26	300059	东方财富	89,100	1,815,858.00	0.63
27	600276	恒瑞医药	34,100	1,774,564.00	0.62
28	002463	沪电股份	10,669	1,630,223.20	0.57
29	002594	比亚迪	20,100	1,601,970.00	0.56

30	688012	中微公司	3,400	1,592,900.00	0.55
31	300274	阳光电源	10,000	1,590,200.00	0.55
32	688498	源杰科技	800	1,508,800.00	0.52
33	600522	中天科技	24,000	1,456,320.00	0.51
34	601328	交通银行	224,000	1,440,320.00	0.50
35	600176	中国巨石	19,700	1,435,736.00	0.50
36	601288	农业银行	235,900	1,431,913.00	0.50
37	300476	胜宏科技	4,100	1,420,363.00	0.49
38	688525	佰维存储	2,800	1,385,244.00	0.48
39	000651	格力电器	34,800	1,305,000.00	0.45
40	000988	华工科技	6,800	1,255,348.00	0.44
41	301308	江波龙	1,700	1,196,460.00	0.42
42	603993	洛阳钼业	67,100	1,177,605.00	0.41
43	600887	伊利股份	48,100	1,152,476.00	0.40
44	600150	中国船舶	32,300	1,091,417.00	0.38
45	300394	天孚通信	3,600	1,089,648.00	0.38
46	601816	京沪高铁	236,000	1,069,080.00	0.37
47	300604	长川科技	3,100	1,058,402.00	0.37
48	000858	五 粮 液	14,300	1,058,200.00	0.37
49	688072	拓荆科技	1,200	1,055,436.00	0.37
50	603019	中科曙光	9,700	1,040,131.00	0.36
51	688347	华虹宏力	3,000	1,008,900.00	0.35
52	600584	长电科技	9,600	994,080.00	0.35
53	000100	TCL 科技	161,700	941,094.00	0.33
54	600309	万华化学	13,600	930,376.00	0.32
55	600549	厦门钨业	10,800	920,160.00	0.32
56	002415	海康威视	26,700	913,140.00	0.32
57	600111	北方稀土	19,000	912,950.00	0.32
58	000338	潍柴动力	33,400	910,150.00	0.32
59	000063	中兴通讯	25,100	908,369.00	0.32
60	002281	光迅科技	3,400	873,596.00	0.30
61	002916	深南电路	1,900	870,010.00	0.30
62	300433	蓝思科技	16,100	863,926.00	0.30
63	601088	中国神华	22,000	858,880.00	0.30
64	601857	中国石油	97,500	846,300.00	0.29
65	300124	汇川技术	12,600	835,758.00	0.29
66	000657	中钨高新	8,700	832,764.00	0.29
67	688521	芯原股份	2,224	825,415.36	0.29
68	002008	大族激光	5,400	810,594.00	0.28
69	600031	三一重工	46,300	800,064.00	0.28
70	000001	平安银行	79,300	796,965.00	0.28
71	002353	杰瑞股份	5,100	777,750.00	0.27
72	300223	北京君正	3,100	771,590.00	0.27

73	600089	特变电工	34,100	767,250.00	0.27
74	300857	协创数据	2,200	747,780.00	0.26
75	601601	中国太保	26,200	747,224.00	0.26
76	000792	盐湖股份	24,400	736,636.00	0.26
77	300136	信维通信	6,100	727,425.00	0.25
78	002028	思源电气	4,200	726,600.00	0.25
79	688777	中控技术	6,000	705,000.00	0.25
80	300014	亿纬锂能	10,800	702,324.00	0.24
81	601668	中国建筑	160,800	697,872.00	0.24
82	601225	陕西煤业	34,100	693,935.00	0.24
83	300475	香农芯创	2,300	690,000.00	0.24
84	601988	中国银行	118,600	678,392.00	0.24
85	600160	巨化股份	12,700	673,227.00	0.23
86	002714	牧原股份	19,184	671,248.16	0.23
87	002436	兴森科技	13,100	667,445.00	0.23
88	300054	鼎龙股份	6,100	646,417.00	0.22
89	688120	华海清科	2,000	644,360.00	0.22
90	601919	中远海控	48,500	643,110.00	0.22
91	300760	迈瑞医疗	4,700	638,401.00	0.22
92	002050	三花智控	14,400	631,152.00	0.22
93	600406	国电南瑞	27,600	630,660.00	0.22
94	600690	海尔智家	30,400	620,464.00	0.22
95	601728	中国电信	119,200	618,648.00	0.22
96	601985	中国核电	67,500	609,525.00	0.21
97	600660	福耀玻璃	12,000	605,280.00	0.21
98	600941	中国移动	6,900	594,297.00	0.21
99	002156	通富微电	7,700	584,199.00	0.20
100	002352	顺丰控股	18,000	562,680.00	0.20
101	601012	隆基绿能	42,700	560,224.00	0.19
102	002138	顺络电子	7,600	555,560.00	0.19
103	002460	赣锋锂业	8,400	549,360.00	0.19
104	002851	麦格米特	3,200	534,976.00	0.19
105	002709	天赐材料	10,400	534,872.00	0.19
106	688126	沪硅产业	13,123	523,476.47	0.18
107	600028	中国石化	113,600	506,656.00	0.18
108	002230	科大讯飞	12,400	506,416.00	0.18
109	300033	同花顺	2,100	506,100.00	0.18
110	002938	鹏鼎控股	4,800	505,824.00	0.18
111	603799	华友钴业	10,400	501,904.00	0.17
112	601600	中国铝业	60,500	497,310.00	0.17
113	300757	罗博特科	800	495,200.00	0.17
114	603501	豪威集团	5,200	493,220.00	0.17
115	601766	中国中车	94,600	491,920.00	0.17

116	300346	南大光电	5,300	491,045.00	0.17
117	600938	中国海油	17,900	485,985.00	0.17
118	601628	中国人寿	13,700	484,295.00	0.17
119	000425	徐工机械	59,500	481,355.00	0.17
120	600050	中国联通	118,900	475,600.00	0.17
121	002407	多氟多	9,400	472,162.00	0.16
122	000977	浪潮信息	6,700	469,000.00	0.16
123	600460	士兰微	8,500	464,610.00	0.16
124	601100	恒立液压	4,300	462,508.00	0.16
125	002466	天齐锂业	7,500	459,900.00	0.16
126	300661	圣邦股份	3,200	459,136.00	0.16
127	300390	天华新能	4,800	448,848.00	0.16
128	601658	邮储银行	89,500	441,235.00	0.15
129	002185	华天科技	19,500	435,045.00	0.15
130	688002	睿创微纳	2,800	433,132.00	0.15
131	002202	金风科技	18,060	431,634.00	0.15
132	605589	圣泉集团	6,700	425,919.00	0.15
133	000408	藏格矿业	6,100	422,852.00	0.15
134	603288	海天味业	12,700	421,132.00	0.15
135	000630	铜陵有色	66,100	420,396.00	0.15
136	601888	中国中免	7,800	418,938.00	0.15
137	600905	三峡能源	112,800	418,488.00	0.15
138	002600	领益智造	24,100	417,894.00	0.15
139	300037	新宙邦	4,500	417,825.00	0.15
140	300442	润泽科技	5,000	415,350.00	0.14
141	300567	精测电子	1,300	412,880.00	0.14
142	000568	泸州老窖	5,300	410,856.00	0.14
143	600667	太极实业	14,000	408,520.00	0.14
144	000938	紫光股份	14,100	406,926.00	0.14
145	601006	大秦铁路	87,700	404,297.00	0.14
146	002179	中航光电	8,700	401,940.00	0.14
147	002049	紫光国微	4,500	399,375.00	0.14
148	002080	中材科技	4,400	396,000.00	0.14
149	002241	歌尔股份	17,500	394,275.00	0.14
150	600879	航天电子	18,500	393,865.00	0.14
151	601872	招商轮船	22,100	388,297.00	0.14
152	002625	光启技术	12,800	388,096.00	0.13
153	688271	联影医疗	3,800	384,674.00	0.13
154	002027	分众传媒	77,800	376,552.00	0.13
155	600019	宝钢股份	68,700	373,041.00	0.13
156	600010	包钢股份	166,400	371,072.00	0.13
157	688396	华润微	3,800	370,690.00	0.13
158	600489	中金黄金	20,500	370,025.00	0.13

159	600760	中航沈飞	9,000	369,900.00	0.13
160	688469	芯联集成	34,654	367,678.94	0.13
161	002422	科伦药业	9,400	362,088.00	0.13
162	605117	德业股份	3,400	361,012.00	0.13
163	600392	盛和资源	11,900	354,263.00	0.12
164	000831	中国稀土	6,300	349,587.00	0.12
165	300395	菲利华	2,600	347,698.00	0.12
166	600893	航发动力	9,000	345,060.00	0.12
167	000807	云铝股份	15,400	340,956.00	0.12
168	688111	金山办公	1,600	340,880.00	0.12
169	601168	西部矿业	12,400	336,536.00	0.12
170	600118	中国卫星	4,100	336,405.00	0.12
171	000538	云南白药	7,100	336,327.00	0.12
172	688017	绿的谐波	800	334,288.00	0.12
173	002001	新 和 成	11,700	332,514.00	0.12
174	600362	江西铜业	7,600	329,080.00	0.11
175	300058	蓝色光标	23,900	328,864.00	0.11
176	002129	TCL 中环	27,300	328,146.00	0.11
177	600795	国电电力	70,100	327,367.00	0.11
178	601127	赛力斯	5,300	324,625.00	0.11
179	600141	兴发集团	6,900	324,093.00	0.11
180	600673	东阳光	9,600	322,368.00	0.11
181	601689	拓普集团	5,700	321,594.00	0.11
182	600989	宝丰能源	15,800	321,214.00	0.11
183	601390	中国中铁	76,700	319,839.00	0.11
184	000426	兴业银锡	9,700	319,712.00	0.11
185	002648	卫星化学	13,200	310,068.00	0.11
186	600104	上汽集团	31,600	308,416.00	0.11
187	000960	锡业股份	7,200	307,368.00	0.11
188	002273	水晶光电	8,600	305,128.00	0.11
189	600585	海螺水泥	18,000	305,100.00	0.11
190	600885	宏发股份	8,800	303,512.00	0.11
191	002812	恩捷股份	4,500	301,095.00	0.10
192	002738	中矿资源	5,100	300,849.00	0.10
193	600547	山东黄金	13,000	300,170.00	0.10
194	002837	英维克	3,640	289,598.40	0.10
195	600096	云天化	9,500	288,800.00	0.10
196	600988	赤峰黄金	10,900	286,888.00	0.10
197	300450	先导智能	7,000	285,040.00	0.10
198	300751	迈为股份	1,000	282,460.00	0.10
199	600011	华能国际	37,000	280,830.00	0.10
200	600875	东方电气	9,700	279,069.00	0.10
201	601727	上海电气	39,800	278,600.00	0.10

202	601233	桐昆股份	12,800	277,120.00	0.10
203	600711	盛屯矿业	25,200	276,444.00	0.10
204	601669	中国电建	58,100	273,070.00	0.09
205	600346	恒力石化	15,400	272,734.00	0.09
206	600221	海航控股	201,900	272,565.00	0.09
207	300015	爱尔眼科	32,900	271,754.00	0.09
208	002126	银轮股份	5,400	268,920.00	0.09
209	688099	晶晨股份	2,600	267,540.00	0.09
210	000157	中联重科	37,900	264,163.00	0.09
211	600157	永泰能源	162,800	262,108.00	0.09
212	600497	驰宏锌锗	21,600	261,576.00	0.09
213	600426	华鲁恒升	10,900	260,728.00	0.09
214	300316	晶盛机电	4,300	259,720.00	0.09
215	600886	国投电力	19,300	256,883.00	0.09
216	002558	巨人网络	9,200	253,552.00	0.09
217	601868	中国能建	94,500	252,315.00	0.09
218	600436	片仔癀	2,300	251,344.00	0.09
219	600066	宇通客车	9,300	249,333.00	0.09
220	000625	长安汽车	34,700	248,799.00	0.09
221	600352	浙江龙盛	20,500	248,255.00	0.09
222	002493	荣盛石化	22,900	246,175.00	0.09
223	600482	中国动力	7,500	246,000.00	0.09
224	002195	岩山科技	37,600	245,904.00	0.09
225	002821	凯莱英	1,500	243,000.00	0.08
226	301358	湖南裕能	3,200	242,784.00	0.08
227	601179	中国西电	16,100	240,212.00	0.08
228	002340	格林美	36,100	238,621.00	0.08
229	002532	天山铝业	22,000	236,060.00	0.08
230	600418	江淮汽车	9,100	235,053.00	0.08
231	605499	东鹏饮料	1,900	234,517.00	0.08
232	002456	欧菲光	24,700	233,662.00	0.08
233	600143	金发科技	15,100	233,295.00	0.08
234	000933	神火股份	11,000	233,200.00	0.08
235	000768	中航西飞	11,300	231,424.00	0.08
236	600048	保利发展	49,500	229,185.00	0.08
237	003816	中国广核	58,400	228,344.00	0.08
238	600895	张江高科	6,100	227,225.00	0.08
239	000301	东方盛虹	19,700	225,565.00	0.08
240	600580	卧龙电驱	6,800	225,080.00	0.08
241	600115	中国东航	58,900	224,409.00	0.08
242	600438	通威股份	18,500	224,035.00	0.08
243	688036	传音控股	3,800	224,010.00	0.08
244	600674	川投能源	15,800	223,886.00	0.08

245	601058	赛轮轮胎	19,400	223,682.00	0.08
246	002236	大华股份	13,500	222,615.00	0.08
247	300803	指南针	2,400	220,008.00	0.08
248	603659	璞泰来	7,600	219,868.00	0.08
249	688578	艾力斯	2,000	218,400.00	0.08
250	300418	昆仑万维	5,400	217,944.00	0.08
251	688047	龙芯中科	1,400	216,538.00	0.08
252	002601	龙佰集团	13,100	215,888.00	0.08
253	300339	润和软件	5,600	215,656.00	0.07
254	300438	鹏辉能源	2,600	215,410.00	0.07
255	601186	中国铁建	36,200	215,390.00	0.07
256	000066	中国长城	11,300	215,265.00	0.07
257	600196	复星医药	9,500	213,465.00	0.07
258	600009	上海机场	9,200	212,520.00	0.07
259	300017	网宿科技	16,300	212,063.00	0.07
260	002555	三七互娱	11,200	211,344.00	0.07
261	300782	卓胜微	1,900	208,202.00	0.07
262	300001	特锐德	5,500	208,065.00	0.07
263	301236	软通动力	4,900	208,005.00	0.07
264	600570	恒生电子	9,800	207,662.00	0.07
265	300568	星源材质	11,000	205,920.00	0.07
266	002131	利欧股份	43,300	205,675.00	0.07
267	600029	南方航空	39,700	205,646.00	0.07
268	603129	春风动力	800	204,640.00	0.07
269	688235	百济神州	800	203,688.00	0.07
270	002472	双环传动	4,900	203,399.00	0.07
271	601360	三六零	23,100	200,739.00	0.07
272	002517	恺英网络	12,300	199,875.00	0.07
273	300759	康龙化成	6,900	199,617.00	0.07
274	601117	中国化学	27,100	199,185.00	0.07
275	002128	电投能源	8,600	198,832.00	0.07
276	601111	中国国航	32,800	198,440.00	0.07
277	600219	南山铝业	48,600	193,914.00	0.07
278	600233	圆通速递	12,300	193,725.00	0.07
279	600372	中航机载	17,800	193,130.00	0.07
280	688213	思特威	1,800	192,726.00	0.07
281	002074	国轩高科	7,000	192,570.00	0.07
282	000963	华东医药	6,800	191,216.00	0.07
283	002155	湖南黄金	8,000	190,960.00	0.07
284	000975	山金国际	11,200	190,400.00	0.07
285	601877	正泰电器	7,500	188,025.00	0.07
286	600026	中远海能	10,400	186,576.00	0.06
287	600741	华域汽车	11,900	184,688.00	0.06

288	300207	欣旺达	9,700	184,203.00	0.06
289	688331	荣昌生物	1,400	182,364.00	0.06
290	002595	豪迈科技	3,900	181,740.00	0.06
291	600415	小商品城	17,800	180,848.00	0.06
292	300347	泰格医药	3,700	177,600.00	0.06
293	600226	亨通股份	18,500	177,415.00	0.06
294	688506	百利天恒	600	176,418.00	0.06
295	603650	彤程新材	1,800	176,364.00	0.06
296	000878	云南铜业	10,800	171,504.00	0.06
297	603979	金诚信	2,900	171,187.00	0.06
298	001979	招商蛇口	26,600	171,038.00	0.06
299	300012	华测检测	12,300	170,478.00	0.06
300	300083	创世纪	12,500	170,250.00	0.06
301	002078	太阳纸业	13,600	169,864.00	0.06
302	300458	全志科技	4,300	169,678.00	0.06
303	002497	雅化集团	8,300	169,071.00	0.06
304	000547	航天发展	8,800	168,520.00	0.06
305	601319	中国人保	24,900	168,324.00	0.06
306	300024	机器人	8,600	166,238.00	0.06
307	600839	四川长虹	23,700	165,426.00	0.06
308	002130	沃尔核材	8,700	164,952.00	0.06
309	300115	长盈精密	5,900	164,846.00	0.06
310	603087	甘李药业	2,900	164,604.00	0.06
311	002414	高德红外	12,400	164,424.00	0.06
312	002756	永兴材料	2,900	164,256.00	0.06
313	601021	春秋航空	3,600	164,088.00	0.06
314	300454	深信服	1,700	163,540.00	0.06
315	688266	泽璟制药	1,400	163,324.00	0.06
316	688122	西部超导	2,600	163,306.00	0.06
317	000423	东阿阿胶	3,600	163,296.00	0.06
318	002444	巨星科技	5,100	158,610.00	0.06
319	601800	中国交建	27,700	158,167.00	0.05
320	600039	四川路桥	20,100	157,182.00	0.05
321	300866	安克创新	1,500	156,750.00	0.05
322	002271	东方雨虹	13,100	155,497.00	0.05
323	002920	德赛西威	1,900	154,850.00	0.05
324	002465	海格通信	12,000	153,240.00	0.05
325	000733	振华科技	2,700	152,928.00	0.05
326	688676	金盘科技	1,800	152,352.00	0.05
327	600516	方大炭素	24,500	151,165.00	0.05
328	002252	上海莱士	34,400	149,296.00	0.05
329	300432	富临精工	7,400	148,666.00	0.05
330	300496	中科创达	2,400	148,296.00	0.05

331	601633	长城汽车	9,800	147,882.00	0.05
332	603260	合盛硅业	3,000	144,780.00	0.05
333	300763	锦浪科技	1,600	144,560.00	0.05
334	002064	华峰化学	15,200	144,248.00	0.05
335	688065	凯赛生物	3,000	143,550.00	0.05
336	300558	贝达药业	2,200	143,154.00	0.05
337	601677	明泰铝业	8,600	142,760.00	0.05
338	300748	金力永磁	4,600	141,910.00	0.05
339	000002	万　科 A	47,800	141,488.00	0.05
340	001965	招商公路	15,300	140,148.00	0.05
341	300919	中伟新材	3,200	140,000.00	0.05
342	000661	长春高新	2,100	139,860.00	0.05
343	300073	当升科技	2,900	139,316.00	0.05
344	002025	航天电器	1,800	137,196.00	0.05
345	600177	雅戈尔	18,200	137,046.00	0.05
346	000519	中兵红箭	6,500	136,955.00	0.05
347	002085	万丰奥威	12,300	136,407.00	0.05
348	688599	天合光能	9,635	136,046.20	0.05
349	601607	上海医药	8,800	135,520.00	0.05
350	302132	中航成飞	2,300	134,136.00	0.05
351	600588	用友网络	14,600	134,028.00	0.05
352	688608	恒玄科技	800	133,752.00	0.05
353	000034	神州数码	4,800	133,200.00	0.05
354	300677	英科医疗	3,400	133,178.00	0.05
355	300474	景嘉微	2,200	133,056.00	0.05
356	688169	石头科技	1,400	132,958.00	0.05
357	300142	沃森生物	10,000	129,900.00	0.05
358	000623	吉林敖东	7,300	129,429.00	0.05
359	601618	中国中冶	53,000	129,320.00	0.04
360	002432	九安医疗	1,800	127,224.00	0.04
361	000786	北新建材	7,000	126,630.00	0.04
362	603605	珀莱雅	2,100	125,832.00	0.04
363	002294	信立泰	3,900	124,371.00	0.04
364	688223	晶科能源	25,833	122,706.75	0.04
365	600085	同仁堂	5,300	122,483.00	0.04
366	688180	君实生物	3,600	121,752.00	0.04
367	300972	万辰集团	700	121,387.00	0.04
368	002176	江特电机	12,100	121,121.00	0.04
369	600699	均胜电子	5,600	121,016.00	0.04
370	300724	捷佳伟创	1,700	120,020.00	0.04
371	000032	深桑达 A	4,800	119,760.00	0.04
372	688188	柏楚电子	1,120	119,504.00	0.04
373	000999	华润三九	5,300	119,197.00	0.04

374	000617	中油资本	17,900	117,961.00	0.04
375	300832	新产业	2,800	117,600.00	0.04
376	300342	天银机电	2,500	117,500.00	0.04
377	600499	科达制造	8,500	117,300.00	0.04
378	600862	中航高科	6,500	117,195.00	0.04
379	605090	九丰能源	3,100	115,227.00	0.04
380	002318	久立特材	4,800	114,720.00	0.04
381	601216	君正集团	25,700	114,622.00	0.04
382	002459	晶澳科技	14,100	114,210.00	0.04
383	603606	东方电缆	2,720	112,907.20	0.04
384	002223	鱼跃医疗	4,400	112,904.00	0.04
385	601615	明阳智能	9,700	112,229.00	0.04
386	600515	海南机场	40,700	111,518.00	0.04
387	600704	物产中大	23,600	111,392.00	0.04
388	600332	白云山	5,500	110,220.00	0.04
389	688005	容百科技	3,600	110,160.00	0.04
390	600018	上港集团	23,300	109,976.00	0.04
391	300251	光线传媒	9,900	109,791.00	0.04
392	000415	渤海租赁	26,900	109,483.00	0.04
393	000683	博源化工	19,000	109,440.00	0.04
394	002266	浙富控股	21,600	109,296.00	0.04
395	603806	福斯特	6,500	109,135.00	0.04
396	300003	乐普医疗	9,200	109,020.00	0.04
396	600803	新奥股份	6,900	109,020.00	0.04
397	688617	惠泰医疗	600	108,936.00	0.04
398	688390	固德威	1,000	108,510.00	0.04
399	600521	华海药业	7,500	108,000.00	0.04
400	000887	中鼎股份	6,000	107,340.00	0.04
401	002065	东华软件	15,000	107,100.00	0.04
402	688116	天奈科技	2,800	106,960.00	0.04
403	600153	建发股份	13,400	106,262.00	0.04
404	600166	福田汽车	36,500	106,215.00	0.04
405	300699	光威复材	3,700	106,005.00	0.04
406	002044	美年健康	20,800	104,624.00	0.04
407	600323	瀚蓝环境	3,800	104,348.00	0.04
408	000830	鲁西化工	8,600	103,200.00	0.04
409	002831	裕同科技	2,900	103,124.00	0.04
410	000039	中集集团	12,700	102,997.00	0.04
411	603766	隆鑫通用	8,600	102,598.00	0.04
412	688114	华大智造	2,000	102,160.00	0.04
413	600765	中航重机	7,900	102,068.00	0.04
414	000400	许继电气	4,700	101,990.00	0.04
415	603596	伯特利	4,100	101,844.00	0.04

416	300409	道氏技术	5,100	101,643.00	0.04
417	600398	海澜之家	19,200	100,416.00	0.03
418	688472	阿特斯	9,226	99,825.32	0.03
419	300122	智飞生物	8,500	99,365.00	0.03
420	688009	中国通号	20,503	97,594.28	0.03
421	002007	华兰生物	7,900	96,301.00	0.03
422	600008	首创环保	35,300	96,016.00	0.03
423	002603	以岭药业	6,400	96,000.00	0.03
424	300896	爱美客	1,100	95,920.00	0.03
425	600312	平高电气	5,300	93,598.00	0.03
426	002410	广联达	11,400	93,024.00	0.03
427	600998	九州通	19,700	92,393.00	0.03
428	002405	四维图新	14,200	91,874.00	0.03
429	600486	扬农化工	1,800	91,260.00	0.03
430	688303	大全能源	5,200	90,636.00	0.03
431	600529	山东药玻	4,900	90,405.00	0.03
432	600208	衢州发展	31,900	90,277.00	0.03
433	601018	宁波港	28,400	89,460.00	0.03
434	603939	益丰药房	4,900	88,102.00	0.03
435	000932	华菱钢铁	25,100	87,097.00	0.03
436	002389	航天彩虹	4,900	87,073.00	0.03
437	000738	航发控制	4,700	85,963.00	0.03
438	600161	天坛生物	7,400	85,692.00	0.03
438	600170	上海建工	38,600	85,692.00	0.03
439	601000	唐山港	20,600	85,490.00	0.03
440	603885	吉祥航空	8,300	85,407.00	0.03
441	600820	隧道股份	16,300	84,923.00	0.03
442	600316	洪都航空	3,000	83,820.00	0.03
443	000967	盈峰环境	7,900	83,187.00	0.03
444	603568	伟明环保	5,360	82,436.80	0.03
445	601238	广汽集团	16,100	81,788.00	0.03
446	601799	星宇股份	900	81,558.00	0.03
447	600038	中直股份	3,200	80,928.00	0.03
448	603816	顾家家居	3,600	80,496.00	0.03
449	600535	天士力	6,000	79,380.00	0.03
450	600511	国药股份	3,000	78,120.00	0.03
451	600763	通策医疗	2,300	77,924.00	0.03
452	601880	辽港股份	55,300	76,314.00	0.03
453	603486	科沃斯	1,500	76,125.00	0.03
454	002607	中公教育	40,500	72,900.00	0.03
455	300118	东方日升	5,800	72,210.00	0.03
456	000833	粤桂股份	3,000	70,260.00	0.02
457	300676	华大基因	2,000	70,120.00	0.02

458	688166	博瑞医药	2,000	70,020.00	0.02
459	000998	隆平高科	9,200	69,368.00	0.02
460	603392	万泰生物	2,500	67,425.00	0.02
461	002120	韵达股份	10,600	67,416.00	0.02
462	601567	三星电气	4,500	67,230.00	0.02
463	300144	宋城演艺	11,400	66,234.00	0.02
464	300049	福瑞医科	1,700	66,096.00	0.02
465	300573	兴齐眼药	1,615	65,827.40	0.02
466	002244	滨江集团	8,600	65,360.00	0.02
467	301550	斯菱智驱	700	64,001.00	0.02
468	300100	双林股份	2,300	63,894.00	0.02
469	601155	新城控股	6,200	63,612.00	0.02
470	600816	建元信托	25,700	62,708.00	0.02
471	601866	中远海发	27,700	61,217.00	0.02
472	600754	锦江酒店	3,400	61,166.00	0.02
473	603899	晨光股份	2,900	59,827.00	0.02
474	600655	豫园股份	14,400	59,184.00	0.02
475	600635	大众公用	13,300	56,924.00	0.02
476	600004	白云机场	7,800	56,628.00	0.02
477	002544	普天科技	3,100	56,482.00	0.02
478	600258	首旅酒店	5,000	54,600.00	0.02
479	600663	陆家嘴	8,500	53,380.00	0.02
480	688063	派能科技	1,000	53,270.00	0.02
481	000035	中国天楹	11,000	53,130.00	0.02
482	300070	碧水源	16,600	52,954.00	0.02
483	300457	赢合科技	2,500	52,700.00	0.02
484	600859	王府井	5,700	52,326.00	0.02
485	300601	康泰生物	4,500	51,030.00	0.02
486	000069	华侨城 A	29,500	48,380.00	0.02
487	600864	哈投股份	9,100	47,229.00	0.02
488	002091	江苏国泰	6,500	46,995.00	0.02
489	002891	中宠股份	1,500	40,080.00	0.01
490	603833	欧派家居	1,300	39,143.00	0.01
491	002292	奥飞娱乐	5,900	38,704.00	0.01
492	301078	孩子王	5,700	38,532.00	0.01
493	600325	华发股份	16,000	36,960.00	0.01
494	002572	索菲亚	3,900	28,470.00	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	300308	中际旭创	9,691,408.00	15.63
2	300750	宁德时代	8,669,885.00	13.98

3	600519	贵州茅台	5,715,450.00	9.22
4	601318	中国平安	4,467,102.00	7.20
5	300502	新易盛	4,275,137.00	6.89
6	601899	紫金矿业	3,961,535.62	6.39
7	600036	招商银行	3,843,747.00	6.20
8	000333	美的集团	3,324,496.00	5.36
9	002475	立讯精密	2,755,549.00	4.44
10	600900	长江电力	2,724,284.00	4.39
11	601166	兴业银行	2,442,314.00	3.94
12	603986	兆易创新	2,325,904.00	3.75
13	002384	东山精密	2,193,330.00	3.54
14	002371	北方华创	2,158,507.00	3.48
15	688008	澜起科技	2,146,406.36	3.46
16	688256	寒武纪	2,061,404.32	3.32
17	688041	海光信息	2,018,308.18	3.25
18	600030	中信证券	2,009,371.00	3.24
19	601398	工商银行	1,983,154.00	3.20
20	603259	药明康德	1,977,731.00	3.19
21	600183	生益科技	1,959,298.00	3.16
22	002594	比亚迪	1,944,377.00	3.14
23	300059	东方财富	1,942,839.00	3.13
24	688981	中芯国际	1,893,552.40	3.05
25	300274	阳光电源	1,813,323.00	2.92
26	600276	恒瑞医药	1,758,472.00	2.84
27	600487	亨通光电	1,695,908.00	2.73
28	300476	胜宏科技	1,612,756.00	2.60
29	688012	中微公司	1,591,017.48	2.57
30	000725	京东方 A	1,585,794.00	2.56
31	601288	农业银行	1,540,832.00	2.48
32	601328	交通银行	1,504,445.00	2.43
33	000338	潍柴动力	1,461,462.00	2.36
34	000651	格力电器	1,349,054.00	2.18
35	603993	洛阳钼业	1,324,593.00	2.14
36	600150	中国船舶	1,308,354.00	2.11
37	02643	曹操出行	1,304,827.22	2.10
38	300408	三环集团	1,297,326.00	2.09
39	01316	耐世特	1,285,869.35	2.07
40	600887	伊利股份	1,283,065.00	2.07
41	002463	沪电股份	1,245,257.06	2.01

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	002475	立讯精密	3,374,107.00	5.44
2	300750	宁德时代	3,161,488.00	5.10
3	688308	欧科亿	2,462,335.34	3.97
4	002831	裕同科技	2,038,602.00	3.29
5	000338	潍柴动力	2,032,926.00	3.28
6	002970	锐明技术	2,028,761.00	3.27
7	000333	美的集团	2,020,083.84	3.26
8	300285	国瓷材料	1,856,814.00	2.99
9	00700	腾讯控股	1,747,965.23	2.82
10	002273	水晶光电	1,596,680.00	2.57
11	300502	新易盛	1,581,847.20	2.55
12	002027	分众传媒	1,553,393.00	2.51
13	600309	万华化学	1,532,066.00	2.47
14	605090	九丰能源	1,300,031.00	2.10
15	603568	伟明环保	1,264,842.02	2.04
16	01316	耐世特	1,169,530.28	1.89
17	02643	曹操出行	1,158,751.52	1.87
18	600522	中天科技	1,147,161.00	1.85
19	688025	杰普特	1,136,087.96	1.83
20	00981	中芯国际	762,475.33	1.23
20	688981	中芯国际	255,832.34	0.41

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	257,022,408.38
卖出股票收入（成交）总额	79,129,218.98

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	12,833,252.58	4.46
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-

10	合计	12,833,252.58	4.46

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

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	019792	25 国债 19	127,000	12,833,252.58	4.46

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

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

本基金本报告期内未持有股指期货。

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	73,301.12
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	30,010,409.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,083,710.76

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

注：本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

§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（%）
鑫元行业轮动 A	121	83,486.62	9,719,846.40	96.2182	382,034.42	3.7818
鑫元行业轮动 C	254	1,447,306.96	367,424,544.01	99.9479	191,423.18	0.0521
合计	375	1,007,247.59	377,144,390.41	99.8482	573,457.60	0.1518

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 7 月 1 日-2026 年 6 月 30 日）
盈利投资者数量占比（%）	93.09

8.3 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	鑫元行业轮动 A	191,189.80	1.8926
	鑫元行业轮动 C	13,236.35	0.0036
	合计	204,426.15	0.0541

8.4 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	鑫元行业轮动 A	0
	鑫元行业轮动 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元行业轮动 A	10~50
	鑫元行业轮动 C	0
	合计	10~50

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限

基金管理人固有资金	10.00	0.0000	10.00	0.0000	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10.00	0.0000	10.00	0.0000	3 年

§9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元行业轮动 A	鑫元行业轮动 C
基金合同生效日（2018 年 5 月 31 日）基金份额总额	39,007,134.69	-
本报告期期初基金份额总额	9,975,067.11	81,625,553.99
本报告期基金总申购份额	287,271.64	286,275,342.21
减：本报告期基金总赎回份额	160,457.93	284,929.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	10,101,880.82	367,615,967.19

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）鑫元行业轮动 C 类基金份额实际存续从 2021 年 4 月 30 日开始。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本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：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

报告期内未发生基金投资策略改变。

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：报告期内，托管人无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：报告期内，托管人相关从业人员无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(%)	
天风证券	4	286,301,128.5	85.17	127,780.51	92.23	-

		4				
东方财富证券	2	48,625,815.86	14.47	10,156.12	7.33	-
国投证券	2	1,224,682.96	0.36	609.67	0.44	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-

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：新增中信证券 2 个交易单元，光大证券 1 个交易单元，天风证券 1 个交易单元。

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(%)
天风证券	7,807,954.00	61.42	-	-	-	-
东方财富证券	4,904,600.00	38.58	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

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	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报	公司网站	2026 年 1 月 22 日

	告		
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公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	公司网站、上交所	2026 年 3 月 31 日
5	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	公司网站	2026 年 3 月 31 日
6	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
7	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 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	鑫元基金管理有限公司关于开展鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金 C 类基金份额销售服务费优惠活动的公告	公司网站、上海证券报	2026 年 5 月 15 日
11	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式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	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 C）基金产品资料概要更新	公司网站	2026 年 6 月 27 日
13	鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金（鑫元行业轮动 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比（%）
机构	1	20260101-20260630	29,403,000.00	59,653,928.47	-	89,056,928.47	23.5776
	2	20260101-20260520	29,491,387.40	-	-	29,491,387.40	7.8078
	3	20260101-20260520	32,035,880.19	-	-	32,035,880.19	8.4814
个人	-	-	-	-	-	-	-
产品特有风险							
本基金已有单一投资者所持基金份额达到或超过本基金总份额的 20%，中小投资者在投资本基金时可能面临因单一投资者持有基金份额集中导致的巨额赎回风险、净值大幅波动风险，以及因单一投资者大量赎回可能造成基金规模持续低于必需水平而面临转换运作方式、与其他基金合并或终止基金合同的风险，详见本基金基金合同或招募说明书相关内容。							

注：申购和赎回包含基金认购、基金转换、分红再投资、非交易过户等导致投资者持有份额增加或减少的情形。

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行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金设立的文件；

2、《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；

3、《鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式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