鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
2026 年第 3 季度报告

2026 年 9 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：中信证券股份有限公司

报告送出日期：2026 年 10 月 27 日

§1 重要提示

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

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 10 月 23 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接
基金主代码	024409
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2025 年 8 月 12 日
报告期末基金份额总额	120,503,109.70 份
投资目标	本基金主要投资于目标 ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，以实现对标的指数的紧密跟踪。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。 本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市风险，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。
业绩比较基准	上证科创板人工智能指数收益率*95%+活期存款基准利率*5%
风险收益特征	本基金为 ETF 联接基金，目标 ETF 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。本基金主要投资于目标 ETF，以实现对标的指数的紧密跟踪，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。	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 A	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 C
下属分级基金的交易代码	024409	024410
报告期末下属分级基金的份额总额	38,211,620.55 份	82,291,489.15 份

注：根据《关于鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金变更为鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、调整收益分配原则并修改基金合同和托管协议的公告》，自 2026 年 7 月 7 日起，鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金变更为鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	589310
基金运作方式	交易型开放式（ETF）
基金合同生效日	2026 年 6 月 17 日
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2026 年 7 月 3 日
基金管理人名称	鑫元基金管理有限公司
基金托管人名称	中信证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，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 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。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	上证科创板人工智能指数收益率

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。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2026 年 7 月 1 日 - 2026 年 9 月 30 日）	
	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 A	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 C
1.本期已实现收益	5,521,145.34	9,439,382.54
2.本期利润	-14,806,356.77	-26,192,300.86
3.加权平均基金份额本期利润	-0.4062	-0.3727
4.期末基金资产净值	41,358,744.97	88,764,686.55
5.期末基金份额净值	1.0824	1.0787

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

（2）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。

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

鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	-28.10%	2.92%	-28.04%	2.94%	-0.06%	-0.02%
过去六个月	1.67%	2.85%	1.14%	2.85%	0.53%	0.00%
过去一年	-13.23%	2.53%	-14.53%	2.54%	1.30%	-0.01%
自基金合同生效起至今	8.24%	2.53%	15.97%	2.58%	-7.73%	-0.05%

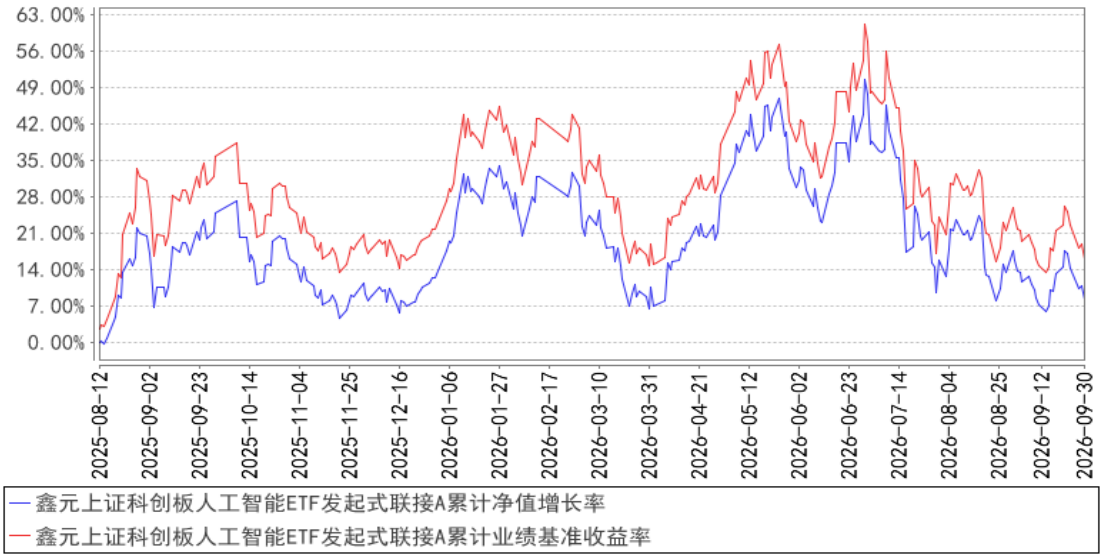
鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 C

阶段	净值增长率①	净值增长率	业绩比较基	业绩比较基	①－③	②－④

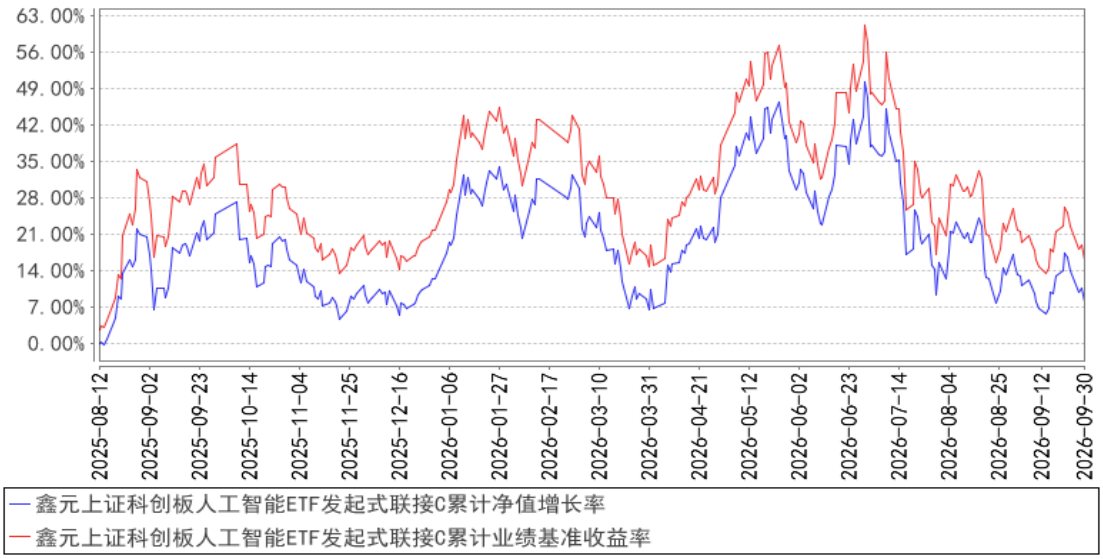
		标准差②	准收益率③	准收益率标准差④		
过去三个月	-28.15%	2.92%	-28.04%	2.94%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	1.52%	2.85%	1.14%	2.85%	0.38%	0.00%
过去一年	-13.50%	2.53%	-14.53%	2.54%	1.03%	-0.01%
自基金合同生效起至今	7.87%	2.53%	15.97%	2.58%	-8.10%	-0.05%

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

鑫元上证科创板人工智能ETF发起式联接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



鑫元上证科创板人工智能ETF发起式联接C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：本基金的合同生效日为 2025 年 8 月 12 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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
莫志刚	本基金的基金经理	2026 年 2 月 11 日	-	12 年	学历：计算机技术硕士研究生。历任万家基金管理有限公司量化研究员，南华基金管理有限公司基金经理助理、基金经理，西藏东财基金管理有限公司基金经理，华夏理财有限责任公司投资经理。2025 年 5 月加入鑫元基金管理有限公司，历任基金经理助理，现任基金经理。
刘宇涛	本基金的基金经理	2025 年 8 月 12 日	2026 年 8 月 31 日	11 年	学历：工学博士研究生。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021 年 6 月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。

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。

4.1.1 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 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，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，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，未出现涉及本基金的交易所公开竞价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%的情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金为 ETF 联接基金，主要投资于目标 ETF，以实现对标的指数的紧密跟踪，力争通过精细化投资管理使日均跟踪偏离度和年化跟踪误差处于较小水平。

报告期内基金的跟踪误差主要来源于：（1）基金申购赎回；（2）成分股定期调整。本基金将在量化分析的基础上，及时根据跟踪误差产生的原因调整投资组合，力求跟踪误差处于较小水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 A 基金份额净值为 1.0824 元，本报告期基金份额净值增长率为-28.10%，同期业绩比较基准收益率为-28.04%。截至本报告期末鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 C 基金份额净值为 1.0787 元，本报告期基金份额净值增长率为-28.15%，同期业绩比较基准收益率为-28.04%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内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 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	76,628.21	0.06
	其中：股票	76,628.21	0.06
2	基金投资	123,622,334.00	93.90

3	固定收益投资	6,933,300.74	5.27
	其中：债券	6,933,300.74	5.27
	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	320,252.93	0.24
8	其他资产	694,260.30	0.53
9	合计	131,646,776.18	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

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	76,628.21	0.06
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	76,628.21	0.06

5.2.2 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。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688813	泰金新能	149	19,085.41	0.01
2	688635	长进光子	79	18,226.88	0.01
3	688123	聚辰股份	82	13,093.76	0.01
4	603459	红板科技	126	9,732.24	0.01
5	603407	长裕集团	124	6,832.40	0.01
6	688802	沐曦股份	10	4,970.80	0.00
7	603435	嘉德利	86	3,544.92	0.00
8	603293	埃泰克	33	1,141.80	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	6,933,300.74	5.33
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	6,933,300.74	5.33

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	019835	26 国债 09	50,000	5,020,587.67	3.86
2	019827	26 国债 01	14,000	1,412,119.78	1.09
3	019846	26 国债 14	5,000	500,593.29	0.38

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	基金类型	运作方式	管理人	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式（ETF）	鑫元基金管理有限公司	123,622,334.00	95.00

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10.2 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。

5.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11.1 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。

5.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11.3 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 本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的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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	694,260.30
6	其他应收款	-

7	其他	-
8	合计	694,260.30

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	688813	泰金新能	19,085.41	0.01	新股流通受限
2	688635	长进光子	18,226.88	0.01	新股流通受限
3	603459	红板科技	9,732.24	0.01	新股流通受限
4	603407	长裕集团	6,832.40	0.01	新股流通受限
5	603435	嘉德利	3,544.92	0.00	新股流通受限
6	603293	埃泰克	1,141.80	0.00	新股流通受限

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 A	鑫元上证科创板人工智能 ETF 发起式联接 C
报告期期初基金份额总额	33,742,339.02	63,165,707.54
报告期期间基金总申购份额	12,452,046.65	67,653,892.61
减：报告期期间基金总赎回份额	7,982,765.12	48,528,111.00
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以"-"填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	38,211,620.55	82,291,489.15

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,388.93

报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,388.93
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	8.2989

注：申购份额包括红利再投、转换入份额、因份额拆分而增加的份额；赎回份额包括转换出份额、因份额合并而减少的份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

注：本报告期内，本基金的基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例(%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例(%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,388.93	8.2989	10,000,388.93	8.2989	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,388.93	8.2989	10,000,388.93	8.2989	3 年

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

注：无。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、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%。

2、本报告期内，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管

理办法》的相关规定和《基金合同》的相关约定，经与基金托管人协商一致，基金管理人决定于 2026 年 7 月 7 日起，将鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金变更为鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金，同时调整收益分配原则，并对本基金的《基金合同》、《托管协议》进行相应修改。具体可参见基金管理人于 2026 年 7 月 4 日发布的《鑫元基金管理有限公司关于鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金变更为鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、调整收益分配原则并修改基金合同和托管协议的公告》及修订后的基金合同、托管协议。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金设立的文件；

2、《鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金合同》；

3、《鑫元上证科创板人工智能交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议》；

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。

10.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

10.3 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 10 月 27 日