

# 鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告

2025 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：华泰证券股份有限公司

送出日期：2025 年 8 月 29 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，并由董事长签发。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 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 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>10</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>15</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>16</b>
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>44</b>
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	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	65
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	65
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	65

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 .....	65
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	65
7.12 投资组合报告附注 .....	65
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>67</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	67
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 .....	67
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>68</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4 基金投资策略的改变 .....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8 其他重大事件 .....	70
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>72</b>
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 .....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	鑫元国证 2000 指数增强	
基金主代码	018579	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 8 月 10 日	
基金管理人	鑫元基金管理有限公司	
基金托管人	华泰证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	112,872,134.91 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鑫元国证 2000 指数增强 A	鑫元国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018579	018580
报告期末下属分级基金的份额总额	59,580,293.02 份	53,291,841.89 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对国证 2000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，追求超越标的指数的投资收益。
投资策略	本基金为股票指数增强型基金，股票资产投资比例不低于基金资产的 80%，一般情况下将保持各类资产配置的基本稳定。在具体大类资产配置过程中，本基金将使用定量与定性相结合的研究方法对宏观经济、国家政策、资金面和市场情绪等可能影响证券市场的重要因素进行研究和预测，综合分析比较不同金融资产的风险收益特征，确定合适的资产配置比例，动态优化投资组合。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率×90%+恒生指数收益率×5%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本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。本基金可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	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕
	联系电话	021-20892000 转
	电子邮箱	service@xyamc.com
		刘强
		025-83387812
		liuqiang023506@htsc.com

客户服务电话	4006066188	95597
传真	021-20892111	025-83387215
注册地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	江苏省南京市江东中路 228 号
办公地址	上海市静安区中山北路 909 号 12 层	江苏省南京市江东中路 228 号
邮政编码	200070	210009
法定代表人	龙艺	张伟

#### 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》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a>
基金中期报告备置地点	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(2025年1月1日-2025年6月30日)		
	鑫元国证 2000 指数增强 A	鑫元国证 2000 指数增强 C	
本期已实现收益	6,074,451.34	5,772,049.77	
本期利润	8,885,707.77	8,031,939.45	
加权平均基金份额本期利润	0.1481	0.1440	
本期加权平均净值利润率	13.77%	13.44%	
本期基金份额净值增长率	14.98%	14.76%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025年6月30日)		
	期末可供分配利润	8,876,870.93	7,475,416.79
	期末可供分配基金份额利润	0.1490	0.1403
	期末基金资产净值	68,864,923.34	61,129,728.88
	期末基金份额净值	1.1558	1.1471
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025年6月30日)		
	基金份额累计净值增长率	15.58%	14.71%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

（3）期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元国证 2000 指数增强 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
过去一个月	5.82%	1.06%	5.58%	0.98%	0.24%	0.08%
过去三个月	6.17%	1.87%	4.25%	1.89%	1.92%	-0.02%
过去六个月	14.98%	1.68%	10.76%	1.69%	4.22%	-0.01%
过去一年	43.88%	2.04%	35.23%	1.92%	8.65%	0.12%
自基金合同生效起至今	15.58%	1.89%	6.54%	1.78%	9.04%	0.11%

鑫元国证 2000 指数增强 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
过去一个月	5.79%	1.06%	5.58%	0.98%	0.21%	0.08%
过去三个月	6.07%	1.87%	4.25%	1.89%	1.82%	-0.02%
过去六个月	14.76%	1.68%	10.76%	1.69%	4.00%	-0.01%
过去一年	43.32%	2.04%	35.23%	1.92%	8.09%	0.12%
自基金合同生效起至今	14.71%	1.89%	6.54%	1.78%	8.17%	0.11%

### 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

鑫元国证2000指数增强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



鑫元国证2000指数增强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 2023 年 8 月 10 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；注册资本 17 亿元人民币，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（包括特定对象投资咨询）和中国证监会许可的其他业务。

截至 2025 年 6 月 30 日，公司旗下管理 80 只证券投资基金——鑫元货币市场基金、鑫元恒鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元稳利债券型证券投资基金、鑫元鸿利债券型证券投资基金、鑫元合享纯债债券型证券投资基金、鑫元聚鑫收益增强债券型发起式证券投资基金、鑫元合丰纯债债券型证券投资基金、鑫元安鑫宝货币市场基金、鑫元鑫新收益灵活配置混合型证券投资基金、鑫元兴利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元汇利债券型证券投资基金、鑫元双债增强债券型证券投资基金、鑫元聚利债券型证券投资基金、鑫元裕利债券型证券投资基金、鑫元得利债券型证券投资基金、鑫元招利债券型证券投资基金、鑫元瑞利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元添利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元广利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元欣享灵活配置混合型证券投资基金、鑫元价值精选灵活配置混合型证券投资基金、鑫元常利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元合利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元增利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元行业轮动灵活配置混合型发起式证券投资基金、鑫元淳利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元全利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元荣利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元臻利债券型证券投资基金、鑫元承利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元悦利定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元永利债券型证券投资基金、鑫元恒利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元安睿三年定期开放债券型证券投资基金、鑫元泽利债券型证券投资基金、鑫元富利三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中债 1-3 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元中债 3-5 年国开行债券指数证券投资基金、鑫元锦利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元一年定期开放中高等级债券型证券投资基金、鑫元中短债债券型证券投资基金、鑫元安硕两年定期开放债券型证券投资基金、鑫元安鑫回报混合型证券投资基金、鑫元乾利债券型证券投资基金、鑫元鑫动力混合型证券投资基金、鑫元金融债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、鑫元清洁能源产业混合型发起式证券投资基金、鑫元皓利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元长三角区域主题混合型证券投资基金、鑫元悦享 60 天滚动持

有中短债债券型证券投资基金、鑫元专精特新企业精选主题混合型证券投资基金、鑫元晟利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元裕丰债券型证券投资基金、鑫元惠丰纯债债券型证券投资基金、鑫元嘉利一年定期开放债券型发起式证券投资基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元璟丰债券型证券投资基金、鑫元欣悦混合型证券投资基金、鑫元添鑫回报 6 个月持有期混合型证券投资基金、鑫元消费甄选混合型发起式证券投资基金、鑫元成长驱动股票型发起式证券投资基金、鑫元数字经济混合型发起式证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元科技创新主题混合型证券投资基金、鑫元慧享纯债 3 个月定期开放债券型证券投资基金、鑫元乐享 90 天持有期债券型证券投资基金、鑫元稳丰利率债券型证券投资基金、鑫元鑫选稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、鑫元鑫选安悦 3 个月持有期债券型基金中基金（FOF）、鑫元启丰债券型证券投资基金、鑫元佳享 120 天持有期债券型证券投资基金、鑫元中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金、鑫元睿鑫添益债券型证券投资基金、鑫元中证 800 红利低波动指数型证券投资基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元鑫领航混合型证券投资基金、鑫元优享 30 天持有期债券型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宇涛	本基金的基金经理	2023 年 8 月 10 日	-	9 年	学历：工学博士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。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。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金、鑫元中证 800 红利低波动指数型证券投资基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金的基金经理。
方仁杰	本基金的基金经理助理	2025 年 3 月 17 日	-	7 年	学历：金融数学与金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。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。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金、鑫元中证 800 红利低波动指数型证券投资基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金的基金经理助理。
陈宇翔	本基金的基金经理助理	2023 年 8 月 10 日	2025 年 3 月 21 日	2 年	金融数学硕士，历任中石化森美（福建）石油有限公司投资管理岗，华福证券管理培训生，兴银基金管理有限责任公司量化研究员。2022 年 10 月加入鑫元基金，历任研究员、基金经理助理，现任投资经理。

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合规守信情况的说明

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，未发现违反公平交易要求的情况。

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本基金属于指数增强型股票基金。投资管理上主要采用量化多因子选股策略，精选一篮子股票组合，持股较为分散。同时，采用量化风险模型合理控制组合风险，控制风格和行业偏离，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 0.5%，年化跟踪误差不超 7.75%。在此基础上，实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金股票组合中 80% 以上权重为国证 2000 成分股，保持了跟标的指数的风格基本一致。

在报告期内，管理团队在高频和另类数据上投入了大量的精力。一方面，将高频因子低频化，把信息从高频数据中提炼出来，转化为更长周期的因子，以便在更宽的时间范围内进行有效的交易决策。另一方面，通过高频数据对低频因子进行实时监测和调整，更及时的捕捉市场的变化和机会，提高交易策略的灵活性和适应性。

具体到组合操作方面，我们严格按照量化选股模型运作，并不断挖掘表现较好的新因子，持续优化选股模型。后续投资运作继续坚持以量化多因子选股为策略基础，配合新股申购、股指期货仓位替代等策略，追求长期稳健的超额收益。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内鑫元国证 2000 指数增强 A 的基金份额净值增长率为 14.98%，同期业绩比较基准收益率为 10.76%。本报告期内鑫元国证 2000 指数增强 C 的基金份额净值增长率为 14.76%，同期业绩比较基准收益率为 10.76%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

往回看，A 股已经走出了四个月的牛市行情，四月初到五月初市场迎来了贸易战缓和后的整体性估值修复，六月份海外算力、创新药等成长板块带领市场持续上行，七月份在重大工程以及“反内卷”政策的催化下，基建股和周期股接棒助攻。

展望未来，自上而下看不悲观。债券收益率下行而企业分红意愿提升，宏观经济平稳且行业亮点不断，海外关系缓和叠加出口数据较好，这些指数平稳上行的长期逻辑依然未见改变。自下而上看有机会。不可否认的是，当前 A 股估值的历史分位数水平已经处于较高位置，尤其是小微

盘和部分科技股，对于这部分股票，我们根据“低估低波进，高估高波出”的量化标准进行了回避。但是，还是有部分股票仍然处在历史估值较低的位置，这将是我们的投资策略关注的重点。分析下来，这部分股票分为两类：一类是传统消费，景气度低且市场预期低，但是它们的商业模式和盈利能力并没有发生颠覆性的变化，一旦宏观经济有所修复叠加经济刺激政策往居民端转移，这些传统消费公司仍具备较大的投资赔率。二类是与光伏、地产等周期下行行业相关的公司，25 年业绩面临较大下滑甚至亏损，我们也会挑选一些主业现金流有保障，第二成长曲线初见成效，估值低估的企业做长期左侧布局。

总结下来，在当前时点，我们还是看淡指数，注重结构，挖掘低估低位企业，用“好公司”和“好价格”去应对宏观层面的不确定性。

#### 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央国债登记结算有限责任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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支进行了复核，未发现基金管理人存在损害本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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2025 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等财务信息相关内容，相关内容真实、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：鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	8,362,323.04	4,240,630.46
结算备付金		502,562.79	122,100.74
存出保证金		-	285,878.40
交易性金融资产	6.4.7.2	126,362,735.90	95,664,253.85
其中：股票投资		119,131,002.64	89,993,503.60
基金投资		-	-
债券投资		7,231,733.26	5,670,750.25
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		421,339.46	191,405.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	20.00
资产总计		135,648,961.19	100,504,289.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		5,418,343.09	672,765.33

应付管理人报酬		109,477.38	95,129.58
应付托管费		10,947.73	9,512.95
应付销售服务费		21,900.00	15,930.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,144.21	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,496.56	170,000.00
负债合计		5,654,308.97	963,338.34
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	112,872,134.91	99,247,342.47
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	17,122,517.31	293,608.29
净资产合计		129,994,652.22	99,540,950.76
负债和净资产总计		135,648,961.19	100,504,289.10

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额总额 112,872,134.91 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.1558 元，份额总额 59,580,293.02 份；下属 C 类基金份额净值 1.1471 元，份额总额 53,291,841.89 份。

## 6.2 利润表

会计主体：鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		17,795,570.08	-30,871,347.18
1. 利息收入		27,202.34	22,725.73
其中：存款利息收入	6.4.7.13	27,202.34	13,539.35
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		-	9,186.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,657,703.73	-24,835,737.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,737,729.01	-25,754,453.36
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	37,947.53	97,883.36
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			

贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	289,743.26	-87,654.29
股利收益	6.4.7.19	592,283.93	908,486.71
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	5,071,146.11	-6,062,274.17
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	39,517.90	3,938.84
<b>减：二、营业总支出</b>		877,922.86	1,161,054.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	613,413.20	801,342.39
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	61,341.39	80,134.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	117,819.28	189,638.81
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,046.43	431.86
8. 其他费用	6.4.7.23	84,302.56	89,507.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		16,917,647.22	-32,032,402.04
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		16,917,647.22	-32,032,402.04
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		16,917,647.22	-32,032,402.04

### 6.3 净资产变动表

会计主体：鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 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	99,247,342.47	293,608.29	99,540,950.76

二、本期期初净资产	99,247,342.47	293,608.29	99,540,950.76
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	13,624,792.44	16,828,909.02	30,453,701.46
(一)、综合收益总额	-	16,917,647.22	16,917,647.22
(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)	13,624,792.44	-88,738.20	13,536,054.24
其中:1.基金申购款	191,537,498.43	14,150,843.45	205,688,341.88
2.基金赎回款	-177,912,705.99	-14,239,581.65	-192,152,287.64
(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	112,872,134.91	17,122,517.31	129,994,652.22
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024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	235,377,009.94	-13,099,817.13	222,277,192.81
二、本期期初净资产	235,377,009.94	-13,099,817.13	222,277,192.81
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	-69,506,008.54	-19,793,034.16	-89,299,042.70
(一)、综合收益总额	-	-32,032,402.04	-32,032,402.04
(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)	-69,506,008.54	12,239,367.88	-57,266,640.66
其中:1.基金申购款	14,890,314.12	-2,169,111.35	12,721,202.77
2.基金赎回款	-84,396,322.66	14,408,479.23	-69,987,843.43
(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	165,871,001.40	-32,892,851.29	132,978,150.11

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：

<u>于景亮</u>	<u>杨晓宇</u>	<u>包颖</u>
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

鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金（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[2023]1029 号文《关于准予鑫元国证 2000 指数增强型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《鑫元国证 2000 指数增强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人民币 418,233,691.62 元，已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2023）验字第 61444343\_B06 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 8 月 10 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 418,253,822.70 份基金份额，其中含认购资金在初始募集期产生的利息 20,131.08 元。本基金的基金管理人为鑫元基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元国证 2000 指数增强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：本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产

的 80%（其中投资于港股通标的股票的比例不超过股票资产的 50%）；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%；每个交易日日终在扣除股指期货合约、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：国证 2000 指数收益率×90%+恒生指数收益率×5%+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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 3 号《半年度报告的内容与格式》、《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》、《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 2025 年 6 月 30 日的财务状况以及 2025 年 1 月 1 日起至 2025 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

### 6.4.6.1 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‰；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；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，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。

### 6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。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、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 6.4.6.3 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。

#### 6.4.6.4 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《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 号文《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。

#### 6.4.6.5 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局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 号文《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 号文《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。

#### 6.4.6.6 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 2025 年 6 月 30 日
活期存款	3,915,312.63
等于：本金	3,913,903.17
加：应计利息	1,409.46
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	4,447,010.41
等于：本金	4,446,985.34
加：应计利息	25.07
减：坏账准备	-
合计	8,362,323.04

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 2025 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	117,558,032.67	-	119,131,002.64	1,572,969.97	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	7,186,069.00	38,213.26	7,231,733.26	7,451.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,186,069.00	38,213.26	7,231,733.26	7,451.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	124,744,101.67	38,213.26	126,362,735.90	1,580,420.97	

### 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 2025 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	84,302.56
其他应付款	5,194.00
合计	89,496.56

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元国证 2000 指数增强 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	59,757,238.20	59,757,238.20
本期申购	9,575,824.42	9,575,824.42
本期赎回（以“-”号填列）	-9,752,769.60	-9,752,769.60
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	59,580,293.02	59,580,293.02

金额单位：人民币元

鑫元国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,490,104.27	39,490,104.27
本期申购	181,961,674.01	181,961,674.01
本期赎回（以“-”号填列）	-168,159,936.39	-168,159,936.39
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	53,291,841.89	53,291,841.89
-----	---------------	---------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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

鑫元国证 2000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,800,771.37	-2,489,900.16	310,871.21
本期期初	2,800,771.37	-2,489,900.16	310,871.21
本期利润	6,074,451.34	2,811,256.43	8,885,707.77
本期基金份额交易产生的变动数	1,648.22	86,403.12	88,051.34
其中：基金申购款	804,478.87	16,743.58	821,222.45
基金赎回款	-802,830.65	69,659.54	-733,171.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,876,870.93	407,759.39	9,284,630.32

鑫元国证 2000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,618,399.21	-1,635,662.13	-17,262.92
本期期初	1,618,399.21	-1,635,662.13	-17,262.92
本期利润	5,772,049.77	2,259,889.68	8,031,939.45
本期基金份额交易产生的变动数	84,967.81	-261,757.35	-176,789.54
其中：基金申购款	13,705,242.58	-375,621.58	13,329,621.00
基金赎回款	-13,620,274.77	113,864.23	-13,506,410.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,475,416.79	362,470.20	7,837,886.99

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	26,473.94
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	728.40
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	27,202.34

## 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 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,737,729.01
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	11,737,729.01

## 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 2025年1月1日至2025年6月30日
卖出股票成交总额	1,627,325,776.64
减：卖出股票成本总额	1,613,925,143.54
减：交易费用	1,662,904.09
买卖股票差价收入	11,737,729.01

## 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 2025年1月1日至2025年6月30日
债券投资收益——利息收入	44,665.29
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,717.76
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	37,947.53

## 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 2025年1月1日至2025年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,121,558.39
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,006,809.82
减：应计利息总额	121,288.69
减：交易费用	177.64
买卖债券差价收入	-6,717.76

#### 6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

#### 6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.16 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.17 贵金属投资收益

##### 6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

##### 6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

##### 6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

#### 6.4.7.18 衍生工具收益

##### 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	289,743.26

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	592,283.93
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	592,283.93

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	4,975,026.11
——股票投资	4,971,519.29
——债券投资	3,506.82
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	96,120.00
——权证投资	-
——期货投资	96,120.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	5,071,146.11

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	33,100.15
基金转换费收入	6,417.75
合计	39,517.90

## 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
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
审计费用	24,795.19
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
合计	84,302.56

## 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
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

	成交金额	占当期股票 成交总额的 比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例 (%)
华泰证券	3,265,416,899.93	100.00	2,313,204,286.02	100.00

#### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	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 成交总额的比 例 (%)
华泰证券	17,587,572.70	100.00	5,599,978.00	100.00

#### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比 例 (%)
华泰证券	-	-	97,100,000.00	100.00

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	639,999.96	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	627,866.02	100.00	-	-

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该关联方的服务范围还包括为本基金提供的证券投资研究成果(被动股票型基金不适用)。

## 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	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	613,413.20	801,342.39
其中：应支付销售机构的客户维护费	234,718.19	347,595.93
应支付基金管理人的净管理费	378,695.01	453,746.46

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 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 1.00\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	61,341.39	80,134.20

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

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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		
	鑫元国证 2000 指数增强 A	鑫元国证 2000 指数增强 C	合计
鑫元基金	-	69.82	69.82
南京银行	-	2,053.24	2,053.24

华泰证券	-	36,379.89	36,379.89
合计	-	38,502.95	38,502.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元国证 2000 指数增强 A	鑫元国证 2000 指数增强 C	合计
鑫元基金	-	252.49	252.49
南京银行	-	2,633.54	2,633.54
华泰证券	-	164,303.82	164,303.82
合计	-	167,189.85	167,189.85

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

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

#### 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

鑫元国证 2000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 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	49,966,786.10	44.2685	49,966,786.10	50.3457

份额单位：份

## 鑫元国证 2000 指数增强 C

关联方名称	本期末 2025年6月30日		上年度末 2024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 (%)
-	-	-	-	-

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 2025年1月1日至2025年6月 30日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024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
华泰证券	4,447,010.41	728.40	4,150,570.22	6,446.01

注：本基金采用券商结算模式，上述款项为本基金存放于华泰证券专用证券资金账户中的交易结算资金，按协议约定利率计息。

## 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（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：无。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：无。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现基金合同中约定的投资目标。

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

### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	7,231,733.26	5,670,750.25
合计	7,231,733.26	5,670,750.25

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 2025年6月30	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

日							
资产							
货币资金	8,360,888.51	0.00	0.00	0.00	0.00	1,434.53	8,362,323.04
结算备付金	502,562.79	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	502,562.79
存出保证金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融资产	0.00	0.00	7,193,520.00	0.00	0.00	119,169,215.90	126,362,735.90
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
债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他权益工具投资	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
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	421,339.46	421,339.46
递延所得税资产	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	8,863,451.30	0.00	7,193,520.00	0.00	0.00	119,591,989.89	135,648,961.19
负债							
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
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,418,343.09	5,418,343.09
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	109,477.38	109,477.38
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	10,947.73	10,947.73
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	21,900.00	21,900.00
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	4,144.21	4,144.21
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
递延所得税负债	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	89,496.56	89,496.56
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	5,654,308.97	5,654,308.97
利率敏感度缺	8,863,451.30	0.00	7,193,520.00	0.00	0.00	113,937,680.92	129,994,652.22

口							
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,239,836.16	0.00	0.00	0.00	0.00	794.30	4,240,630.46
结算备付金	122,100.74	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	122,100.74
存出保证金	285,878.40	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	285,878.40
交易性金融资产	0.00	0.00	5,609,520.00	0.00	0.00	90,054,733.85	95,664,253.85
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
债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他债权投资	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他权益工具投资	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
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	191,405.65	191,405.65
递延所得税资产	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	20.00	20.00
资产总计	4,647,815.30	0.00	5,609,520.00	0.00	0.00	90,246,953.80	100,504,289.10
负债							
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
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	672,765.33	672,765.33
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	95,129.58	95,129.58
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	9,512.95	9,512.95
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15,930.48	15,930.48
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
递延所得税负债	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	170,000.00	170,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	963,338.34	963,338.34
利率敏感度缺口	4,647,815.30	0.00	5,609,520.00	0.00	0.00	89,283,615.46	99,540,950.76

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年6月30日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 市场利率下降25个基点	9,799.58	4,459.29
2. 市场利率上升25个基点	-9,773.10	-4,452.29	

#### 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 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 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	119,131,002.64	91.64	89,993,503.60	90.41
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	119,131,002.64	91.64	89,993,503.60	90.41

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	<p>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</p> <p>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</p>		
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（2025 年 6 月 30 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 1%	1,342,922.98	1,071,833.94
	业绩比较基准下降 1%	-1,342,922.98	-1,071,833.94

#### 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 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	119,131,002.64	89,993,503.60
第二层次	7,231,733.26	5,670,750.25
第三层次	-	-
合计	126,362,735.90	95,664,253.85

##### 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股票、债券等投资，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投资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，确定相关投资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

##### 6.4.15.1 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。

##### 6.4.15.2 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	119,131,002.64	87.82
	其中：股票	119,131,002.64	87.82
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,231,733.26	5.33
	其中：债券	7,231,733.26	5.33
	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	8,864,885.83	6.54
8	其他各项资产	421,339.46	0.31
9	合计	135,648,961.19	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	-	-
B	采矿业	722,732.00	0.56
C	制造业	81,438,812.64	62.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,466,694.00	1.13
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	2,545,413.00	1.96
G	交通运输、仓储和邮政业	1,391,477.00	1.07
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,540,115.00	13.49
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	897,615.00	0.69

M	科学研究和技术服务业	4,530,306.00	3.48
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	739,468.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	111,272,632.64	85.60

### 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	7,020,128.00	5.40
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	838,242.00	0.64
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	7,858,370.00	6.05

### 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	300648	星云股份	42,100	1,454,976.00	1.12
2	688595	芯海科技	34,700	1,297,433.00	1.00
3	002376	新北洋	162,600	1,263,402.00	0.97
4	300791	仙乐健康	52,000	1,238,120.00	0.95
5	300341	麦克奥迪	74,200	1,200,556.00	0.92
6	000657	中钨高新	95,300	1,130,258.00	0.87
7	688066	航天宏图	57,300	1,121,934.00	0.86
8	300656	民德电子	41,800	1,117,314.00	0.86
9	300331	苏大维格	49,100	1,111,133.00	0.85
10	300616	尚品宅配	79,400	1,045,698.00	0.80
11	300203	聚光科技	47,200	1,044,536.00	0.80
12	300709	精研科技	26,700	1,042,635.00	0.80
13	688488	艾迪药业	74,800	1,035,980.00	0.80
14	603969	银龙股份	140,700	1,031,331.00	0.79
15	688711	宏微科技	56,700	997,353.00	0.77
16	002284	亚太股份	89,200	985,660.00	0.76
17	300098	高新兴	186,000	967,200.00	0.74
18	300471	厚普股份	90,700	965,048.00	0.74
19	688207	格灵深瞳	62,900	949,790.00	0.73
20	002378	章源钨业	116,100	918,351.00	0.71
21	300206	理邦仪器	76,400	918,328.00	0.71
22	002036	联创电子	83,500	902,635.00	0.69
23	601208	东材科技	94,700	897,756.00	0.69
24	605168	三人行	30,500	897,615.00	0.69
25	300613	富瀚微	18,300	894,504.00	0.69
26	600336	澳柯玛	131,000	893,420.00	0.69
27	688001	华兴源创	34,800	879,396.00	0.68
28	688609	九联科技	83,700	876,339.00	0.67
29	300032	金龙机电	166,500	875,790.00	0.67
30	300228	富瑞特装	110,800	863,132.00	0.66
31	688400	凌云光	30,900	851,913.00	0.66
32	002658	雪迪龙	108,400	848,772.00	0.65

33	002317	众生药业	56,500	848,065.00	0.65
34	300797	钢研纳克	61,100	846,846.00	0.65
35	688315	诺禾致源	58,800	830,256.00	0.64
36	000727	冠捷科技	341,000	828,630.00	0.64
37	688299	长阳科技	41,900	828,363.00	0.64
38	300043	星辉娱乐	171,000	827,640.00	0.64
39	002215	诺普信	80,100	827,433.00	0.64
40	300369	绿盟科技	106,000	823,620.00	0.63
41	688088	虹软科技	17,000	820,250.00	0.63
42	002434	万里扬	111,200	815,096.00	0.63
43	301260	格力博	41,300	814,436.00	0.63
44	300978	东箭科技	72,900	813,564.00	0.63
45	300873	海晨股份	40,000	807,600.00	0.62
46	000534	万泽股份	54,000	805,680.00	0.62
47	603583	捷昌驱动	22,000	803,440.00	0.62
48	300134	大富科技	65,400	799,842.00	0.62
49	300168	万达信息	104,100	798,447.00	0.61
50	002324	普利特	74,300	789,809.00	0.61
51	688147	微导纳米	26,100	787,698.00	0.61
52	688408	中信博	16,800	784,224.00	0.60
53	601599	浙文影业	209,500	783,530.00	0.60
54	688202	美迪西	21,800	783,274.00	0.60
55	688023	安恒信息	13,800	783,012.00	0.60
56	002716	湖南白银	199,000	776,100.00	0.60
57	300177	中海达	67,700	775,842.00	0.60
58	300598	诚迈科技	18,200	774,410.00	0.60
59	002609	捷顺科技	65,800	768,544.00	0.59
60	603197	保隆科技	19,600	765,772.00	0.59
61	600105	永鼎股份	94,000	760,460.00	0.58
62	002491	通鼎互联	133,700	759,416.00	0.58
63	000788	北大医药	119,200	756,920.00	0.58
64	000407	胜利股份	220,200	748,680.00	0.58
65	688351	微电生理	37,900	746,630.00	0.57
66	300900	广联航空	30,700	745,089.00	0.57
67	603855	华荣股份	33,600	743,568.00	0.57
68	300608	思特奇	63,800	742,632.00	0.57
69	301095	广立微	13,200	742,368.00	0.57
70	688553	汇宇制药	45,500	741,195.00	0.57
71	002237	恒邦股份	62,700	739,860.00	0.57
72	600551	时代出版	82,900	739,468.00	0.57
73	300222	科大智能	71,900	732,661.00	0.56
74	300479	神思电子	33,000	728,310.00	0.56
75	002996	顺博合金	98,400	724,224.00	0.56

76	688306	均普智能	73,500	723,240.00	0.56
77	002554	惠博普	257,200	722,732.00	0.56
78	603888	新华网	30,100	720,594.00	0.55
79	688222	成都先导	44,800	720,384.00	0.55
80	688690	纳微科技	31,500	719,145.00	0.55
81	300435	中泰股份	47,300	718,014.00	0.55
82	600180	瑞茂通	161,600	717,504.00	0.55
83	603867	新化股份	27,978	715,677.24	0.55
84	300942	易瑞生物	74,600	714,668.00	0.55
85	002212	天融信	92,800	714,560.00	0.55
86	300740	水羊股份	42,500	711,875.00	0.55
87	300128	锦富技术	127,100	709,218.00	0.55
88	301268	铭利达	38,100	706,755.00	0.54
89	603966	法兰泰克	76,100	706,208.00	0.54
90	300577	开润股份	34,100	698,709.00	0.54
91	301367	瑞迈特	8,200	689,620.00	0.53
92	688131	皓元医药	14,200	686,570.00	0.53
93	688176	亚虹医药	77,100	683,877.00	0.53
94	002801	微光股份	21,100	683,007.00	0.53
95	300236	上海新阳	17,600	682,880.00	0.53
96	000969	安泰科技	53,000	682,640.00	0.53
97	300048	合康新能	116,200	682,094.00	0.52
98	301510	固高科技	22,600	679,130.00	0.52
99	600567	山鹰国际	357,400	679,060.00	0.52
100	603995	甬金股份	38,200	675,376.00	0.52
101	688262	国芯科技	25,000	666,750.00	0.51
102	688208	道通科技	21,700	664,020.00	0.51
103	300811	铂科新材	14,300	663,663.00	0.51
104	002698	博实股份	42,700	663,558.00	0.51
105	688133	泰坦科技	28,800	662,976.00	0.51
106	603611	诺力股份	30,700	661,278.00	0.51
107	300687	赛意信息	23,800	661,164.00	0.51
108	300702	天宇股份	28,400	660,584.00	0.51
109	300806	斯迪克	39,700	655,050.00	0.50
110	002201	九鼎新材	98,900	647,795.00	0.50
111	688508	芯朋微	11,600	647,512.00	0.50
112	600458	时代新材	47,100	646,212.00	0.50
113	300602	飞荣达	30,300	642,663.00	0.49
114	600459	贵研铂业	41,300	640,563.00	0.49
115	300113	顺网科技	32,400	640,224.00	0.49
116	688588	凌志软件	43,900	639,623.00	0.49
117	002338	奥普光电	13,500	638,550.00	0.49
118	002615	哈尔斯	75,700	636,637.00	0.49

119	300272	开能健康	96,700	635,319.00	0.49
120	300972	万辰集团	3,500	630,840.00	0.49
121	603324	盛剑科技	24,700	627,380.00	0.48
122	000756	新华制药	42,000	626,640.00	0.48
123	300973	立高食品	12,820	625,231.40	0.48
124	002918	蒙娜丽莎	75,300	624,990.00	0.48
125	688327	云从科技	45,300	624,687.00	0.48
126	300667	必创科技	39,300	620,547.00	0.48
127	600869	远东股份	121,800	618,744.00	0.48
128	688687	凯因科技	23,100	614,229.00	0.47
129	688108	赛诺医疗	54,400	610,368.00	0.47
130	300119	瑞普生物	31,400	609,788.00	0.47
131	600728	佳都科技	111,700	608,765.00	0.47
132	301517	陕西华达	14,800	602,212.00	0.46
133	300624	万兴科技	9,700	601,885.00	0.46
134	002697	红旗连锁	112,300	600,805.00	0.46
135	000700	模塑科技	76,400	599,740.00	0.46
136	688443	智翔金泰	21,600	599,184.00	0.46
137	300620	光库科技	12,700	598,297.00	0.46
138	000829	天音控股	58,400	596,264.00	0.46
139	300693	盛弘股份	19,900	596,204.00	0.46
140	603112	华翔股份	36,000	595,440.00	0.46
141	000551	创元科技	45,800	588,530.00	0.45
142	301488	豪恩汽电	8,300	587,640.00	0.45
143	600575	淮河能源	167,300	583,877.00	0.45
144	002396	星网锐捷	25,900	581,455.00	0.45

### 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	001322	箭牌家居	150,500	1,271,725.00	0.98
2	002645	华宏科技	129,900	1,179,492.00	0.91
3	300732	设研院	116,100	838,242.00	0.64
4	002980	华盛昌	40,500	817,290.00	0.63
5	002790	瑞尔特	93,400	679,018.00	0.52
6	300432	富临精工	49,200	643,044.00	0.49
7	603848	好太太	40,300	620,620.00	0.48
8	603076	乐惠国际	19,700	614,837.00	0.47
9	601089	福元医药	36,400	607,152.00	0.47
10	002585	双星新材	107,500	586,950.00	0.45

## 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	688595	芯海科技	6,127,921.15	6.16
2	688687	凯因科技	6,112,322.10	6.14
3	600336	澳柯玛	6,056,913.00	6.08
4	002376	新北洋	5,682,425.00	5.71
5	603076	乐惠国际	5,644,125.00	5.67
6	002928	华夏航空	5,366,445.00	5.39
7	688066	航天宏图	5,307,929.64	5.33
8	688222	成都先导	5,071,278.99	5.09
9	300048	合康新能	5,004,115.00	5.03
10	300369	绿盟科技	4,863,460.00	4.89
11	300648	星云股份	4,819,005.00	4.84
12	300032	金龙机电	4,813,991.00	4.84
13	688609	九联科技	4,807,520.29	4.83
14	000969	安泰科技	4,799,844.00	4.82
15	002284	亚太股份	4,783,936.00	4.81
16	688133	泰坦科技	4,780,459.46	4.80
17	300978	东箭科技	4,634,742.00	4.66
18	300232	洲明科技	4,604,176.00	4.63
19	603588	高能环境	4,584,674.00	4.61
20	300206	理邦仪器	4,571,490.00	4.59
21	000551	创元科技	4,546,490.00	4.57
22	000657	中钨高新	4,479,786.00	4.50
23	300353	东土科技	4,472,389.00	4.49
24	300021	大禹节水	4,459,930.86	4.48
25	300168	万达信息	4,455,101.00	4.48
26	600575	淮河能源	4,450,552.00	4.47
27	000829	天音控股	4,420,611.00	4.44
28	600501	航天晨光	4,416,613.00	4.44
29	300203	聚光科技	4,382,448.00	4.40
30	300973	立高食品	4,366,609.60	4.39
31	603118	共进股份	4,351,623.00	4.37
32	300942	易瑞生物	4,326,863.00	4.35
33	603186	华正新材	4,326,129.00	4.35
34	300873	海晨股份	4,210,626.00	4.23
35	688121	卓然股份	4,206,321.01	4.23
36	603888	新华网	4,179,370.00	4.20
37	300702	天宇股份	4,174,870.00	4.19
38	002434	万里扬	4,160,686.00	4.18

39	688097	博众精工	4,155,277.42	4.17
40	002212	天融信	4,140,382.00	4.16
41	300331	苏大维格	4,135,861.00	4.15
42	300241	瑞丰光电	4,131,281.00	4.15
43	002215	诺普信	4,122,419.00	4.14
44	300222	科大智能	4,069,775.00	4.09
45	300791	仙乐健康	4,058,062.27	4.08
46	300712	永福股份	4,001,567.00	4.02
47	002562	兄弟科技	3,994,062.00	4.01
48	002036	联创电子	3,982,655.00	4.00
49	300737	科顺股份	3,980,168.80	4.00
50	002303	美盈森	3,968,298.00	3.99
51	002378	章源钨业	3,907,769.70	3.93
52	688208	道通科技	3,898,945.38	3.92
53	300616	尚品宅配	3,894,245.00	3.91
54	300366	创意信息	3,875,191.00	3.89
55	600846	同济科技	3,873,131.99	3.89
56	600017	日照港	3,869,954.00	3.89
57	002688	金河生物	3,797,783.00	3.82
58	603533	掌阅科技	3,789,353.00	3.81
59	002970	锐明技术	3,761,633.00	3.78
60	300797	钢研纳克	3,751,853.00	3.77
61	688201	信安世纪	3,751,317.11	3.77
62	300475	香农芯创	3,679,841.00	3.70
63	300311	ST 任子行	3,678,958.00	3.70
64	688108	赛诺医疗	3,673,711.74	3.69
65	600480	凌云股份	3,655,350.00	3.67
66	688023	安恒信息	3,639,836.53	3.66
67	688499	利元亨	3,625,096.10	3.64
68	688233	神工股份	3,619,450.42	3.64
69	600391	航发科技	3,612,814.00	3.63
70	603111	康尼机电	3,597,156.00	3.61
71	600812	华北制药	3,577,919.00	3.59
72	603060	国检集团	3,576,808.48	3.59
73	600180	瑞茂通	3,570,711.00	3.59
74	002126	银轮股份	3,568,740.00	3.59
75	603197	保隆科技	3,563,220.00	3.58
76	603301	振德医疗	3,527,232.00	3.54
77	300691	联合光电	3,509,495.00	3.53
78	603611	诺力股份	3,506,841.00	3.52
79	300732	设研院	3,504,571.00	3.52
80	300248	新开普	3,464,214.00	3.48
81	688025	杰普特	3,461,867.73	3.48

82	002171	楚江新材	3,459,012.00	3.47
83	300113	顺网科技	3,435,669.00	3.45
84	601107	四川成渝	3,413,966.00	3.43
85	688088	虹软科技	3,412,385.47	3.43
86	002437	誉衡药业	3,389,131.00	3.40
87	000600	建投能源	3,372,929.00	3.39
88	600526	菲达环保	3,371,767.00	3.39
89	300400	劲拓股份	3,336,633.00	3.35
90	002375	亚厦股份	3,333,052.00	3.35
91	603609	禾丰股份	3,331,018.00	3.35
92	300398	飞凯材料	3,327,454.00	3.34
93	000713	丰乐种业	3,305,056.00	3.32
94	300102	乾照光电	3,301,140.00	3.32
95	603713	密尔克卫	3,263,034.00	3.28
96	600459	贵研铂业	3,260,461.99	3.28
97	002716	湖南白银	3,259,383.00	3.27
98	688076	诺泰生物	3,254,950.10	3.27
99	603566	普莱柯	3,252,828.39	3.27
100	002048	宁波华翔	3,243,982.00	3.26
101	002491	通鼎互联	3,220,148.00	3.23
102	688102	斯瑞新材	3,216,179.02	3.23
103	002605	姚记科技	3,215,101.00	3.23
104	600268	国电南自	3,207,174.03	3.22
105	300177	中海达	3,202,151.00	3.22
106	301058	中粮科工	3,200,985.00	3.22
107	300783	三只松鼠	3,193,214.00	3.21
108	300471	厚普股份	3,192,524.00	3.21
109	001322	箭牌家居	3,190,240.00	3.20
110	002957	科瑞技术	3,179,692.00	3.19
111	601208	东材科技	3,142,591.00	3.16
112	300479	神思电子	3,140,659.00	3.16
113	002913	奥士康	3,123,130.00	3.14
114	300520	科大国创	3,116,338.00	3.13
115	605077	华康股份	3,106,026.47	3.12
116	002741	光华科技	3,105,894.00	3.12
117	300806	斯迪克	3,100,905.00	3.12
118	300252	金信诺	3,086,244.00	3.10
119	600990	四创电子	3,081,916.00	3.10
120	002396	星网锐捷	3,074,086.00	3.09
121	300161	华中数控	3,066,290.00	3.08
122	300953	震裕科技	3,059,334.91	3.07
123	300272	开能健康	3,051,469.00	3.07
124	300608	思特奇	3,049,990.00	3.06

125	688148	芳源股份	3,049,434.71	3.06
126	601326	秦港股份	3,012,208.00	3.03
127	688269	凯立新材	3,011,001.54	3.02
128	300727	润禾材料	3,010,847.24	3.02
129	002803	吉宏股份	2,994,573.00	3.01
130	002315	焦点科技	2,987,603.00	3.00
131	300752	隆利科技	2,986,183.00	3.00
132	300842	帝科股份	2,985,002.00	3.00
133	603081	大丰实业	2,962,614.00	2.98
134	002573	清新环境	2,952,048.00	2.97
135	600420	国药现代	2,951,039.40	2.96
136	002626	金达威	2,949,431.50	2.96
137	600686	金龙汽车	2,942,986.00	2.96
138	300579	数字认证	2,939,376.00	2.95
139	603992	松霖科技	2,936,857.00	2.95
140	300523	辰安科技	2,925,890.00	2.94
141	002697	红旗连锁	2,919,221.85	2.93
142	603071	物产环能	2,905,311.00	2.92
143	603063	禾望电气	2,904,880.00	2.92
144	300525	博思软件	2,891,580.00	2.90
145	300659	中孚信息	2,888,939.64	2.90
146	688368	晶丰明源	2,879,033.51	2.89
147	600081	东风科技	2,877,904.10	2.89
148	300236	上海新阳	2,877,520.00	2.89
149	603969	银龙股份	2,876,161.00	2.89
150	603507	振江股份	2,874,964.00	2.89
151	002057	中钢天源	2,869,143.00	2.88
152	688103	国力股份	2,858,705.67	2.87
153	688711	宏微科技	2,856,708.51	2.87
154	600366	宁波韵升	2,856,253.00	2.87
155	002658	雪迪龙	2,844,044.00	2.86
156	600744	华银电力	2,829,594.24	2.84
157	688270	臻镭科技	2,825,552.10	2.84
158	000534	万泽股份	2,822,324.00	2.84
159	688315	诺禾致源	2,813,947.32	2.83
160	002090	金智科技	2,806,906.00	2.82
161	300602	飞荣达	2,797,712.00	2.81
162	000498	山东路桥	2,795,736.00	2.81
163	002170	芭田股份	2,794,631.00	2.81
164	300533	冰川网络	2,784,316.00	2.80
165	688510	航亚科技	2,784,284.07	2.80
166	300729	乐歌股份	2,779,958.40	2.79
167	300683	海特生物	2,778,022.00	2.79

168	002645	华宏科技	2,757,430.00	2.77
169	300772	运达股份	2,756,762.00	2.77
170	003020	立方制药	2,756,583.00	2.77
171	300138	晨光生物	2,744,880.00	2.76
172	300328	宜安科技	2,742,637.00	2.76
173	600869	远东股份	2,730,875.79	2.74
174	688089	嘉必优	2,729,803.66	2.74
175	688258	卓易信息	2,727,492.69	2.74
176	002544	普天科技	2,725,696.00	2.74
177	301260	格力博	2,721,682.00	2.73
178	688262	国芯科技	2,720,268.54	2.73
179	300656	民德电子	2,707,266.00	2.72
180	300552	万集科技	2,704,555.00	2.72
181	300358	楚天科技	2,702,684.44	2.72
182	600388	龙净环保	2,699,707.00	2.71
183	002139	拓邦股份	2,694,920.00	2.71
184	688277	天智航	2,679,533.17	2.69
185	600640	国脉文化	2,649,775.00	2.66
186	688513	苑东生物	2,645,398.40	2.66
187	002585	双星新材	2,640,726.00	2.65
188	600103	青山纸业	2,635,603.00	2.65
189	688351	微电生理	2,625,562.80	2.64
190	300527	中船应急	2,624,339.00	2.64
191	300811	铂科新材	2,620,326.64	2.63
192	300351	永贵电器	2,617,877.00	2.63
193	603355	莱克电气	2,592,034.00	2.60
194	601068	中铝国际	2,586,838.00	2.60
195	688690	纳微科技	2,575,650.60	2.59
196	300381	溢多利	2,565,035.00	2.58
197	688488	艾迪药业	2,562,905.35	2.57
198	002073	软控股份	2,550,813.00	2.56
199	688289	圣湘生物	2,545,655.92	2.56
200	000957	中通客车	2,535,515.00	2.55
201	300187	永清环保	2,535,232.00	2.55
202	688588	凌志软件	2,525,478.81	2.54
203	300620	光库科技	2,511,183.00	2.52
204	002440	闰土股份	2,509,710.00	2.52
205	600488	津药药业	2,501,625.50	2.51
206	688661	和林微纳	2,494,873.61	2.51
207	603855	华荣股份	2,489,195.00	2.50
208	300577	开润股份	2,473,404.00	2.48
209	300341	麦克奥迪	2,472,664.00	2.48
210	000823	超声电子	2,465,823.61	2.48

211	300972	万辰集团	2,460,860.00	2.47
212	600216	浙江医药	2,455,607.00	2.47
213	600798	宁波海运	2,451,167.00	2.46
214	688699	明微电子	2,447,131.77	2.46
215	300145	南方泵业	2,442,213.00	2.45
216	601126	四方股份	2,439,817.00	2.45
217	300788	中信出版	2,430,501.00	2.44
218	688202	美迪西	2,429,515.38	2.44
219	688508	芯朋微	2,424,939.93	2.44
220	002707	众信旅游	2,424,681.00	2.44
221	300416	苏试试验	2,413,455.00	2.42
222	300940	南极光	2,408,349.00	2.42
223	600458	时代新材	2,406,191.00	2.42
224	300638	广和通	2,403,554.15	2.41
225	688660	电气风电	2,395,712.73	2.41
226	300634	彩讯股份	2,391,308.00	2.40
227	300740	水羊股份	2,389,042.00	2.40
228	688128	中国电研	2,388,691.16	2.40
229	002237	恒邦股份	2,388,399.00	2.40
230	600571	信雅达	2,387,679.00	2.40
231	603668	天马科技	2,366,160.60	2.38
232	300612	宣亚国际	2,357,822.00	2.37
233	600169	太原重工	2,355,770.00	2.37
234	688003	天准科技	2,352,555.64	2.36
235	300566	激智科技	2,343,569.00	2.35
236	300180	华峰超纤	2,340,351.00	2.35
237	688299	长阳科技	2,332,307.93	2.34
238	688733	壹石通	2,330,828.26	2.34
239	002335	科华数据	2,328,513.00	2.34
240	002004	华邦健康	2,326,751.00	2.34
241	000920	沃顿科技	2,325,109.00	2.34
242	688518	联赢激光	2,323,841.63	2.33
243	600736	苏州高新	2,309,312.00	2.32
244	002292	奥飞娱乐	2,307,986.00	2.32
245	002912	中新赛克	2,297,645.00	2.31
246	000727	冠捷科技	2,296,938.00	2.31
247	300435	中泰股份	2,292,391.00	2.30
248	300322	硕贝德	2,292,378.00	2.30
249	300598	诚迈科技	2,284,634.00	2.30
250	301116	益客食品	2,281,513.00	2.29
251	300320	海达股份	2,279,119.00	2.29
252	300384	三联虹普	2,269,986.00	2.28
253	300143	盈康生命	2,269,641.00	2.28

254	002533	金杯电工	2,259,474.00	2.27
255	002454	松芝股份	2,255,765.00	2.27
256	603378	亚士创能	2,254,304.25	2.26
257	000026	飞亚达	2,251,200.00	2.26
258	300326	ST 凯利	2,240,152.00	2.25
259	002967	广电计量	2,227,996.00	2.24
260	603337	杰克股份	2,226,091.00	2.24
261	600283	钱江水利	2,217,318.60	2.23
262	002479	富春环保	2,213,677.60	2.22
263	301129	瑞纳智能	2,211,401.00	2.22
264	603416	信捷电气	2,206,855.00	2.22
265	300613	富瀚微	2,203,582.00	2.21
266	300363	博腾股份	2,203,462.00	2.21
267	300790	宇瞳光学	2,197,397.00	2.21
268	603013	亚普股份	2,197,278.00	2.21
269	300769	德方纳米	2,195,428.00	2.21
270	688798	艾为电子	2,191,052.15	2.20
271	300314	戴维医疗	2,188,895.00	2.20
272	601609	金田股份	2,167,416.00	2.18
273	300951	博硕科技	2,163,789.20	2.17
274	300404	博济医药	2,160,670.00	2.17
275	600184	光电股份	2,157,588.00	2.17
276	600742	富维股份	2,157,019.00	2.17
277	300432	富临精工	2,148,479.00	2.16
278	002191	劲嘉股份	2,144,111.00	2.15
279	002380	科远智慧	2,143,953.00	2.15
280	000532	华金资本	2,132,642.00	2.14
281	000058	深赛格	2,131,905.00	2.14
282	002613	北玻股份	2,130,426.00	2.14
283	300354	东华测试	2,128,296.00	2.14
284	603639	海利尔	2,128,202.00	2.14
285	002641	公元股份	2,126,198.90	2.14
286	688621	阳光诺和	2,087,084.81	2.10
287	600551	时代出版	2,083,702.00	2.09
288	603680	今创集团	2,082,648.00	2.09
289	002637	赞宇科技	2,076,127.00	2.09
290	002838	道恩股份	2,074,793.13	2.08
291	300671	富满微	2,070,094.00	2.08
292	300219	鸿利智汇	2,068,236.00	2.08
293	600691	阳煤化工	2,062,510.00	2.07
294	002324	普利特	2,062,283.00	2.07
295	000680	山推股份	2,062,031.00	2.07
296	002554	惠博普	2,062,029.00	2.07

297	300587	天铁科技	2,061,243.00	2.07
298	002534	西子洁能	2,044,883.00	2.05
299	002515	金字火腿	2,044,208.00	2.05
300	300758	七彩化学	2,043,519.00	2.05
301	603055	台华新材	2,038,335.60	2.05
302	300409	道氏技术	2,026,046.00	2.04
303	300693	盛弘股份	2,019,564.00	2.03
304	301221	光庭信息	2,018,249.00	2.03
305	300119	瑞普生物	2,015,641.00	2.02
306	688150	莱特光电	2,014,047.87	2.02
307	603987	康德莱	2,009,202.00	2.02
308	001208	华菱线缆	2,007,718.00	2.02
309	300436	广生堂	1,998,390.00	2.01
310	600200	*ST 苏吴	1,994,228.00	2.00

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	688687	凯因科技	5,612,049.58	5.64
2	688595	芯海科技	5,496,572.16	5.52
3	603076	乐惠国际	5,348,753.00	5.37
4	002928	华夏航空	5,267,410.00	5.29
5	600336	澳柯玛	5,162,653.00	5.19
6	603588	高能环境	5,073,302.52	5.10
7	002376	新北洋	5,040,662.00	5.06
8	300232	洲明科技	5,032,376.00	5.06
9	603118	共进股份	5,013,956.00	5.04
10	300048	合康新能	4,991,515.00	5.01
11	300353	东土科技	4,964,243.00	4.99
12	688222	成都先导	4,876,962.44	4.90
13	300369	绿盟科技	4,691,667.00	4.71
14	603533	掌阅科技	4,687,459.00	4.71
15	300648	星云股份	4,655,279.00	4.68
16	300021	大禹节水	4,619,006.00	4.64
17	300203	聚光科技	4,594,496.00	4.62
18	300206	理邦仪器	4,545,128.00	4.57
19	300241	瑞丰光电	4,543,398.00	4.56
20	688066	航天宏图	4,510,496.14	4.53
21	603186	华正新材	4,498,249.00	4.52
22	002688	金河生物	4,459,074.00	4.48
23	300737	科顺股份	4,458,792.00	4.48
24	600501	航天晨光	4,388,574.00	4.41

25	600391	航发科技	4,356,969.00	4.38
26	002970	锐明技术	4,355,376.00	4.38
27	000551	创元科技	4,321,226.00	4.34
28	300702	天宇股份	4,261,835.00	4.28
29	000969	安泰科技	4,195,623.00	4.21
30	603111	康尼机电	4,161,000.00	4.18
31	688025	杰普特	4,153,568.03	4.17
32	300032	金龙机电	4,134,114.00	4.15
33	688121	卓然股份	4,121,711.76	4.14
34	688133	泰坦科技	4,084,562.56	4.10
35	002303	美盈森	4,073,314.00	4.09
36	002562	兄弟科技	4,063,707.00	4.08
37	300222	科大智能	4,050,278.75	4.07
38	300161	华中数控	4,042,928.00	4.06
39	601107	四川成渝	4,026,989.02	4.05
40	300248	新开普	4,014,813.50	4.03
41	688097	博众精工	4,007,969.29	4.03
42	688108	赛诺医疗	3,971,616.26	3.99
43	002284	亚太股份	3,969,742.00	3.99
44	688609	九联科技	3,968,492.39	3.99
45	300973	立高食品	3,938,754.00	3.96
46	600846	同济科技	3,937,994.00	3.96
47	688102	斯瑞新材	3,904,178.76	3.92
48	600268	国电南自	3,896,453.58	3.91
49	600017	日照港	3,879,892.00	3.90
50	002212	天融信	3,861,696.78	3.88
51	300712	永福股份	3,845,613.00	3.86
52	300475	香农芯创	3,827,010.00	3.84
53	300311	ST 任子行	3,824,123.59	3.84
54	600575	淮河能源	3,802,223.00	3.82
55	300797	钢研纳克	3,800,932.00	3.82
56	688201	信安世纪	3,799,832.53	3.82
57	002957	科瑞技术	3,791,490.00	3.81
58	600480	凌云股份	3,770,277.00	3.79
59	300978	东箭科技	3,735,058.00	3.75
60	688023	安恒信息	3,733,004.45	3.75
61	688499	利元亨	3,730,178.36	3.75
62	300942	易瑞生物	3,725,195.00	3.74
63	000829	天音控股	3,713,283.00	3.73
64	300579	数字认证	3,702,722.00	3.72
65	300659	中孚信息	3,692,440.00	3.71
66	300168	万达信息	3,659,650.00	3.68
67	300520	科大国创	3,655,409.00	3.67

68	688233	神工股份	3,650,001.28	3.67
69	002126	银轮股份	3,635,960.00	3.65
70	002036	联创电子	3,628,947.00	3.65
71	300533	冰川网络	3,596,743.00	3.61
72	300691	联合光电	3,569,851.00	3.59
73	300398	飞凯材料	3,564,536.57	3.58
74	603060	国检集团	3,556,397.00	3.57
75	000600	建投能源	3,549,198.00	3.57
76	600366	宁波韵升	3,544,780.00	3.56
77	300752	隆利科技	3,543,420.00	3.56
78	603301	振德医疗	3,538,238.00	3.55
79	600812	华北制药	3,535,908.75	3.55
80	603888	新华网	3,533,530.00	3.55
81	002171	楚江新材	3,530,955.00	3.55
82	002215	诺普信	3,522,973.00	3.54
83	300331	苏大维格	3,512,133.00	3.53
84	300366	创意信息	3,505,986.00	3.52
85	300400	劲拓股份	3,492,830.00	3.51
86	002437	誉衡药业	3,456,310.00	3.47
87	002073	软控股份	3,424,370.00	3.44
88	603609	禾丰股份	3,410,235.50	3.43
89	002605	姚记科技	3,392,589.00	3.41
90	000657	中钨高新	3,383,192.98	3.40
91	688368	晶丰明源	3,382,737.63	3.40
92	300102	乾照光电	3,379,212.00	3.39
93	600526	菲达环保	3,373,683.00	3.39
94	688208	道通科技	3,368,596.37	3.38
95	603197	保隆科技	3,357,044.00	3.37
96	002434	万里扬	3,330,932.00	3.35
97	300953	震裕科技	3,330,856.05	3.35
98	600459	贵研铂业	3,326,355.00	3.34
99	603713	密尔克卫	3,319,822.00	3.34
100	300616	尚品宅配	3,303,563.00	3.32
101	300873	海晨股份	3,300,668.00	3.32
102	600990	四创电子	3,289,497.00	3.30
103	688269	凯立新材	3,264,930.21	3.28
104	002913	奥士康	3,241,957.00	3.26
105	002048	宁波华翔	3,241,335.03	3.26
106	002375	亚厦股份	3,240,635.00	3.26
107	688128	中国电研	3,229,607.08	3.24
108	603063	禾望电气	3,228,659.00	3.24
109	300783	三只松鼠	3,228,417.00	3.24
110	301058	中粮科工	3,224,340.00	3.24

111	688076	诺泰生物	3,224,077.45	3.24
112	002378	章源钨业	3,215,634.70	3.23
113	688699	明微电子	3,208,193.77	3.22
114	300638	广和通	3,205,923.60	3.22
115	000713	丰乐种业	3,199,973.98	3.21
116	300187	永清环保	3,194,019.00	3.21
117	300252	金信诺	3,180,825.00	3.20
118	605077	华康股份	3,179,646.58	3.19
119	603566	普莱柯	3,177,477.00	3.19
120	300727	润禾材料	3,171,928.23	3.19
121	002741	光华科技	3,154,143.00	3.17
122	300842	帝科股份	3,100,917.40	3.12
123	002440	闰土股份	3,097,314.00	3.11
124	002626	金达威	3,093,718.50	3.11
125	300772	运达股份	3,084,633.10	3.10
126	002544	普天科技	3,068,048.00	3.08
127	688270	臻镭科技	3,062,140.86	3.08
128	300791	仙乐健康	3,058,624.00	3.07
129	300328	宜安科技	3,054,342.00	3.07
130	002803	吉宏股份	3,046,467.00	3.06
131	002315	焦点科技	3,032,335.00	3.05
132	600571	信雅达	3,030,617.00	3.04
133	300177	中海达	3,020,345.89	3.03
134	300322	硕贝德	3,003,849.00	3.02
135	002534	西子洁能	2,992,720.03	3.01
136	688798	艾为电子	2,984,984.44	3.00
137	002057	中钢天源	2,982,147.00	3.00
138	300806	斯迪克	2,972,897.00	2.99
139	002292	奥飞娱乐	2,964,843.00	2.98
140	600686	金龙汽车	2,963,761.00	2.98
141	600283	钱江水利	2,961,464.40	2.98
142	300523	辰安科技	2,941,547.00	2.96
143	688661	和林微纳	2,938,991.95	2.95
144	300972	万辰集团	2,935,095.00	2.95
145	688148	芳源股份	2,932,046.09	2.95
146	603507	振江股份	2,928,434.00	2.94
147	601326	秦港股份	2,911,771.00	2.93
148	002491	通鼎互联	2,908,759.00	2.92
149	603071	物产环能	2,901,851.00	2.92
150	300138	晨光生物	2,878,985.00	2.89
151	600081	东风科技	2,878,909.80	2.89
152	600420	国药现代	2,868,530.00	2.88
153	002170	芭田股份	2,858,120.00	2.87

154	688258	卓易信息	2,856,162.19	2.87
155	603081	大丰实业	2,846,976.72	2.86
156	603992	松霖科技	2,844,080.00	2.86
157	002573	清新环境	2,833,463.00	2.85
158	600744	华银电力	2,826,821.00	2.84
159	603611	诺力股份	2,824,857.00	2.84
160	300113	顺网科技	2,822,890.00	2.84
161	300525	博思软件	2,815,601.00	2.83
162	688103	国力股份	2,809,805.44	2.82
163	000498	山东路桥	2,793,959.66	2.81
164	002454	松芝股份	2,783,398.00	2.80
165	300683	海特生物	2,777,236.00	2.79
166	600180	瑞茂通	2,767,811.00	2.78
167	300729	乐歌股份	2,757,141.00	2.77
168	688621	阳光诺和	2,736,411.42	2.75
169	688513	苑东生物	2,735,793.16	2.75
170	600640	国脉文化	2,732,396.00	2.74
171	300552	万集科技	2,728,877.00	2.74
172	002139	拓邦股份	2,723,724.00	2.74
173	688510	航亚科技	2,714,211.67	2.73
174	300732	设研院	2,701,059.60	2.71
175	600388	龙净环保	2,695,246.97	2.71
176	601068	中铝国际	2,689,962.00	2.70
177	300358	楚天科技	2,683,293.00	2.70
178	002090	金智科技	2,678,118.61	2.69
179	688289	圣湘生物	2,667,854.93	2.68
180	003020	立方制药	2,655,014.00	2.67
181	603355	莱克电气	2,652,211.00	2.66
182	002967	广电计量	2,638,447.68	2.65
183	688089	嘉必优	2,630,527.55	2.64
184	688088	虹软科技	2,623,388.21	2.64
185	600103	青山纸业	2,606,000.00	2.62
186	688277	天智航	2,603,833.28	2.62
187	300381	溢多利	2,588,027.21	2.60
188	603612	索通发展	2,584,293.00	2.60
189	002396	星网锐捷	2,580,899.00	2.59
190	000957	中通客车	2,579,618.00	2.59
191	300326	ST凯利	2,575,696.00	2.59
192	300634	彩讯股份	2,574,801.00	2.59
193	300479	神思电子	2,549,812.00	2.56
194	300527	中船应急	2,549,741.00	2.56
195	002250	联化科技	2,542,951.00	2.55
196	600798	宁波海运	2,542,633.00	2.55

197	600488	津药药业	2,534,263.77	2.55
198	688313	仕佳光子	2,521,221.96	2.53
199	688319	欧林生物	2,511,529.32	2.52
200	688733	壹石通	2,497,594.03	2.51
201	002716	湖南白银	2,493,337.00	2.50
202	301116	益客食品	2,491,491.00	2.50
203	002707	众信旅游	2,490,906.00	2.50
204	688003	天准科技	2,489,292.85	2.50
205	000823	超声电子	2,486,183.00	2.50
206	300788	中信出版	2,483,814.00	2.50
207	600869	远东股份	2,479,603.00	2.49
208	000026	飞亚达	2,478,152.00	2.49
209	300940	南极光	2,475,503.60	2.49
210	300351	永贵电器	2,473,549.00	2.48
211	300145	南方泵业	2,472,218.00	2.48
212	601208	东材科技	2,469,966.30	2.48
213	688315	诺禾致源	2,458,899.83	2.47
214	603668	天马科技	2,457,025.20	2.47
215	688519	南亚新材	2,455,464.32	2.47
216	000920	沃顿科技	2,433,900.00	2.45
217	002912	中新赛克	2,416,495.00	2.43
218	688660	电气风电	2,398,131.89	2.41
219	300566	激智科技	2,391,588.00	2.40
220	688588	凌志软件	2,383,646.46	2.39
221	300612	宣亚国际	2,380,143.00	2.39
222	002950	奥美医疗	2,379,995.00	2.39
223	300180	华峰超纤	2,377,160.00	2.39
224	600269	赣粤高速	2,376,832.00	2.39
225	002335	科华数据	2,370,172.00	2.38
226	600216	浙江医药	2,367,901.00	2.38
227	601126	四方股份	2,366,230.00	2.38
228	688533	上声电子	2,362,417.54	2.37
229	301129	瑞纳智能	2,356,121.00	2.37
230	002004	华邦健康	2,350,976.00	2.36
231	300272	开能健康	2,350,438.00	2.36
232	001208	华菱线缆	2,346,864.00	2.36
233	688209	英集芯	2,346,751.23	2.36
234	300471	厚普股份	2,339,039.50	2.35
235	600169	太原重工	2,327,611.00	2.34
236	688351	微电生理	2,321,919.22	2.33
237	002279	久其软件	2,312,881.00	2.32
238	300416	苏试试验	2,311,564.00	2.32
239	600736	苏州高新	2,307,714.00	2.32

240	300769	德方纳米	2,305,297.00	2.32
241	300320	海达股份	2,301,041.00	2.31
242	300363	博腾股份	2,296,063.00	2.31
243	603408	建霖家居	2,292,836.00	2.30
244	600428	中远海特	2,288,788.00	2.30
245	600184	光电股份	2,288,670.00	2.30
246	300602	飞荣达	2,276,723.00	2.29
247	688518	联赢激光	2,276,282.86	2.29
248	603378	亚士创能	2,256,471.87	2.27
249	300951	博硕科技	2,253,302.60	2.26
250	300314	戴维医疗	2,248,164.00	2.26
251	002533	金杯电工	2,241,521.00	2.25
252	002613	北玻股份	2,238,841.00	2.25
253	002479	富春环保	2,234,059.38	2.24
254	002697	红旗连锁	2,232,166.00	2.24
255	300758	七彩化学	2,227,017.60	2.24
256	300143	盈康生命	2,221,604.00	2.23
257	002838	道恩股份	2,217,890.42	2.23
258	002658	雪迪龙	2,212,478.00	2.22
259	688559	海目星	2,210,925.47	2.22
260	000532	华金资本	2,209,988.00	2.22
261	601609	金田股份	2,205,707.00	2.22
262	000727	冠捷科技	2,204,696.00	2.21
263	300384	三联虹普	2,188,079.00	2.20
264	002191	劲嘉股份	2,187,874.00	2.20
265	688488	艾迪药业	2,184,326.38	2.19
266	002723	小崧股份	2,178,890.00	2.19
267	603416	信捷电气	2,175,696.00	2.19
268	603766	隆鑫通用	2,169,465.00	2.18
269	300236	上海新阳	2,168,388.00	2.18
270	688508	芯朋微	2,165,387.19	2.18
271	300587	天铁科技	2,151,153.00	2.16
272	300608	思特奇	2,146,037.00	2.16
273	603013	亚普股份	2,145,479.00	2.16
274	603639	海利尔	2,142,473.00	2.15
275	300354	东华测试	2,142,453.00	2.15
276	603337	杰克股份	2,127,100.00	2.14
277	000058	深赛格	2,126,087.00	2.14
278	002515	金字火腿	2,123,696.00	2.13
279	688262	国芯科技	2,111,904.82	2.12
280	600742	富维股份	2,104,277.00	2.11
281	688123	聚辰股份	2,104,043.63	2.11
282	300409	道氏技术	2,103,682.40	2.11

283	600691	阳煤化工	2,096,277.00	2.11
284	688150	莱特光电	2,092,906.07	2.10
285	002637	赞宇科技	2,087,457.00	2.10
286	300790	宇瞳光学	2,080,337.00	2.09
287	603855	华荣股份	2,074,465.00	2.08
288	688362	甬矽电子	2,070,490.06	2.08
289	300072	海新能科	2,070,051.00	2.08
290	300219	鸿利智汇	2,068,645.00	2.08
291	002641	公元股份	2,063,557.00	2.07
292	688326	经纬恒润	2,062,912.81	2.07
293	002380	科远智慧	2,060,704.00	2.07
294	688321	微芯生物	2,060,337.41	2.07
295	300447	全信股份	2,046,833.00	2.06
296	300404	博济医药	2,042,721.76	2.05
297	002585	双星新材	2,040,956.98	2.05
298	000042	中洲控股	2,035,881.00	2.05
299	300671	富满微	2,033,347.00	2.04
300	300620	光库科技	2,030,183.50	2.04
301	301221	光庭信息	2,020,229.00	2.03
302	000680	山推股份	2,015,669.00	2.02
303	300531	优博讯	1,996,736.00	2.01
304	002258	利尔化学	1,995,302.00	2.00

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	1,638,091,123.29
卖出股票收入（成交）总额	1,627,325,776.64

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	7,231,733.26	5.56
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	7,231,733.26	5.56

### 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	019766	25 国债 01	72,000	7,231,733.26	5.56

### 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。

#### 7.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	421,339.46
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	421,339.46

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五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 (%)
鑫元国证 2000 指数增强 A	615	96,878.53	49,966,786.10	83.8646	9,613,506.92	16.1354
鑫元国证 2000 指数增强 C	7,163	7,439.88	4,951,965.93	9.2922	48,339,875.96	90.7078
合计	7,778	14,511.72	54,918,752.03	48.6557	57,953,382.88	51.3443

### 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	鑫元国证 2000 指数增强 A	305,760.35	0.5132
	鑫元国证 2000 指数增强 C	157,096.61	0.2948
	合计	462,856.96	0.4101

### 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、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	鑫元国证 2000 指数增强 A	0~10
	鑫元国证 2000 指数增强 C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元国证 2000 指数增强 A	0
	鑫元国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元国证 2000 指数增强 A	鑫元国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 8 月 10 日) 基金份额总额	106,813,497.00	311,440,325.70
本报告期期初基金 份额总额	59,757,238.20	39,490,104.27
本报告期基金总申 购份额	9,575,824.42	181,961,674.01
减: 本报告期基金 总赎回份额	9,752,769.60	168,159,936.39
本报告期基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金 份额总额	59,580,293.02	53,291,841.89

## § 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，基金管理人发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2025 年 6 月 18 日起，张鹏飞先生任公司副总经理，杨晓宇先生任公司副总经理、首席信息官。

2、基金托管人：本报告期内，不存在基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内本基金托管人及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用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 (%)	
华泰证券	3	3,265,416,899.93	100.00	639,999.96	100.00	-

注：（1）交易单元的主要选择标准：

- 1) 财务状况良好，经营行为规范；
  - 2) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，具备投资运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要；
  - 3) 具备研究实力，能及时提供高质量的研究服务；
  - 4) 收取的交易佣金费率合理。
- (2) 交易单元的选择程序：
- 1) 市场研究部根据选择标准选取合作券商，发起签署研究服务协议；
  - 2) 交易部发起与合作券商签订交易单元租用协议，办理交易单元的相关开通手续，调整相关系统参数，基金运营部及时通知托管人。
- (3) 报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：无。

### 10.7.2 基金租用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 (%)
华泰证券	17,587,572.70	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	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 1 月 15 日
2	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司网站	2025 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 1 月 22 日
4	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	公司网站	2025 年 3 月 31 日
5	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2024 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	2025 年 3 月 31 日
6	鑫元基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况(2024 年度)	公司网站	2025 年 3 月 31 日

7	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 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	2025 年 4 月 22 日
8	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第一季度报告	公司网站	2025 年 4 月 22 日
9	鑫元基金关于直销柜台申购费率优惠的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 5 月 6 日
10	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 6 月 18 日
11	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金（鑫元国证 2000 指数增强 A）基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 6 月 28 日
12	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2025 年第 1 号）	公司网站	2025 年 6 月 28 日
13	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金（鑫元国证 2000 指数增强 C）基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 6 月 28 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	20250101-20250630	49,966,786.10	-	-	49,966,786.10	44.2685
个人	-	-	-	-	-	-	-

#### 产品特有风险

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以下风险：

（一）赎回申请延期办理或暂停赎回的风险单一投资者大额赎回时易触发本基金巨额赎回的条件，因此当发生巨额赎回时，中小投资者可能面临小额赎回申请也需要按同比例部分延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。

（二）基金净值大幅波动的风险单一投资者大额赎回时，基金管理人进行基金财产大量变现，会对基金资产净值产生影响；且如遇大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，都可能会造成基金资产净值的较大波动。

（三）基金投资目标偏离的风险单一投资者大额赎回后，很可能导致基金规模骤然缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。

（四）基金合同提前终止或其它相关风险

根据《基金合同》的约定，《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 60 个工作日出现前述情形的，基金管理人应当在 10 个工作日内向中国证监会报告并提出解决方案，解决方案包括持续运作、转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并在 6 个月内召集基金份额持有人大会进行表决。因此，在极端情况下，当单一投资者大量赎回本基金后，可能造成基金资产净值大幅缩减，对本基金的继续存续产生决定性影响。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 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国证 2000 指数增强型证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元国证 2000 指数增强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

2025 年 8 月 29 日