

鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 年 6 月 30 日

基金管理人：鑫元基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

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。

基金托管人华泰证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 8 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	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	13
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	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	74
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	74

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	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§ 8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	76
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	76
§ 9 开放式基金份额变动	77
§ 10 重大事件揭示	78
10.1 基金份额持有人大会决议	78
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	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	78
10.4 基金投资策略的改变	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	78
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	78
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	78
10.8 其他重大事件	79
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	81
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	81
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	81
§ 12 备查文件目录	82
12.1 备查文件目录	82
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 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	163,423,473.53 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	115,263,452.41 份	48,160,021.12 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 $\times$ 90% + 恒生指数收益率 $\times$ 5% + 银行活期存款利率（税后） $\times$ 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	刘强
	联系电话	021-20892000 转	025-83387812
	电子邮箱	service@xyamc.com	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	王会清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	鑫元基金管理有限公司	上海市静安区中山北路 909 号 12 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2026 年 1 月 1 日 - 2026 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	-6,276,233.95	389,404.96
本期利润	2,342,395.21	3,570,236.18
加权平均基金份额本期利润	0.0198	0.0396
本期加权平均净值利润率	1.34%	2.69%
本期基金份额净值增长率	5.94%	5.73%
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	45,181,035.29	18,104,761.94
期末可供分配基金份额利润	0.3920	0.3759
期末基金资产净值	168,457,380.22	69,573,846.78
期末基金份额净值	1.4615	1.4446
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	46.15%	44.46%

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
过去三个月	-0.25%	1.41%	11.35%	1.50%	-11.60%	-0.09%

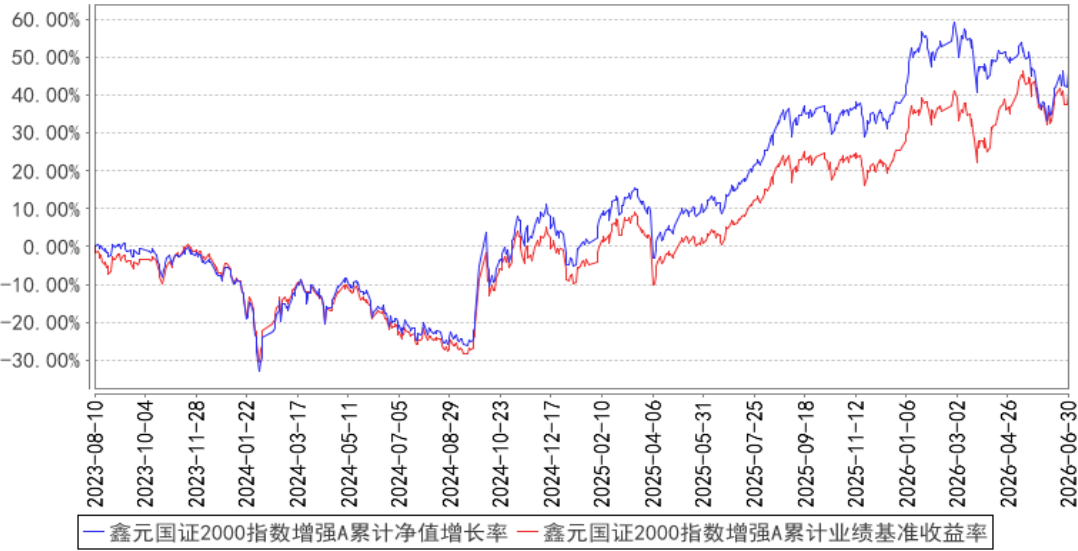
过去六个月	5.94%	1.47%	11.91%	1.54%	-5.97%	-0.07%
过去一年	26.45%	1.27%	31.77%	1.31%	-5.32%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	46.15%	1.70%	40.39%	1.63%	5.76%	0.07%

鑫元国证 2000 指数增强 C

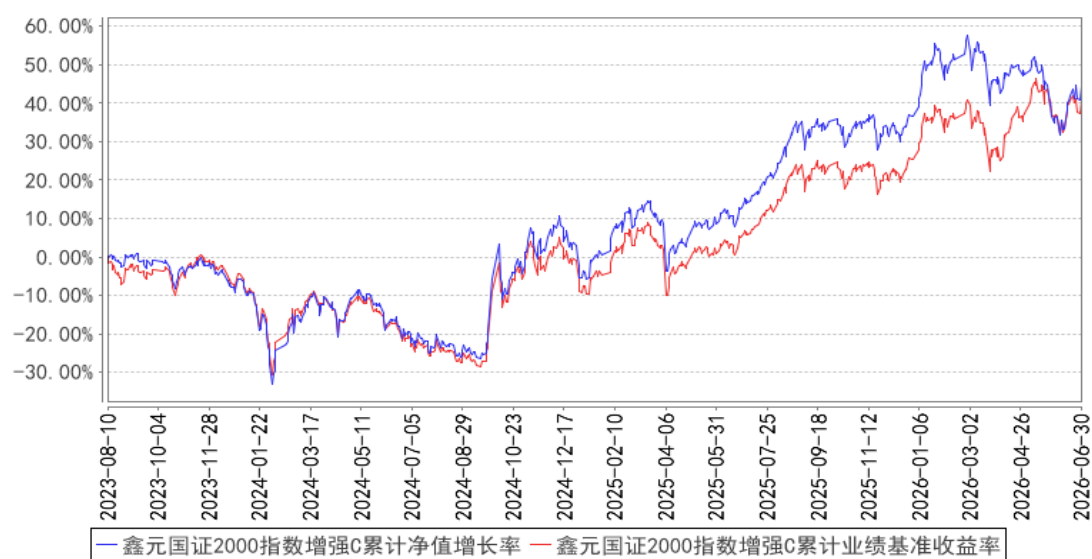
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①—③	②—④
过去三个月	-0.35%	1.41%	11.35%	1.50%	- 11.70%	-0.09%
过去六个月	5.73%	1.47%	11.91%	1.54%	-6.18%	-0.07%
过去一年	25.93%	1.27%	31.77%	1.31%	-5.84%	-0.04%
自基金合同生效 起至今	44.46%	1.70%	40.39%	1.63%	4.07%	0.07%

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，总部设在上海。经营范围包括基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。基金管理人管理的公募基金覆盖主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、FOF 等不同类别。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘宇涛	本基金的基金经理	2023 年 8 月 10 日	-	10 年	学历：工学博士研究生。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021 年 6 月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。
肖涵	本基金的基金经理	2026 年 3 月 20 日	-	4 年	学历：金融学硕士研究生。历任上海智慧数投科技有限公司量化研究员。2021 年 9 月加入鑫元基金，历任交易员、研究员、投资经理助理，现任基金经理。
方仁杰	本基金的基金经理助理	2025 年 3 月 17 日	-	7 年	学历：金融数学与金融工程硕士研究生。历任嘉合基金管理有限公司分析师，山西证券股份有限公司研究员，山证（上海）资产管理有限公司研究员。2025 年 1 月加入鑫元基金管理有限公司，现任基金经理助理。

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

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

3. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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，未发现有违公平交易要求的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的交易共 1 次，为量化策略投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

本报告期内，未发现本基金存在可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金属于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，管理团队严格按照量化选股模型运作，并不断挖掘表现较好的因子轮动策略，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 5.94%，同期业绩比较基准收

益率为 11.91%。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 5.73%，同期业绩比较基准收益率为 11.91%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，我们对市场中期走势保持谨慎乐观。7 月中旬市场经历了一轮快速调整，触发了较为罕见的超卖信号，从历史规律看，类似幅度的单日急跌之后，主要宽基指数短期修复的胜率相对较高；同时融资盘等资金面信号也显示，阶段性抛压已得到较为充分的释放，市场进一步大幅下探的空间或相对有限。

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

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本公司成立估值委员会，并制订有关工作规则。估值委员会对估值政策、估值方法和估值模型进行评估、研究、决策，确定估值业务的操作流程和风险控制，确保基金估值的公允、合理。估值委员会成员具有多年从业经验，具备投资、研究、交易、运营、风险管理、法律合规等方面的专业胜任能力。本公司使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序；基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。公司基金经理可参与讨论估值原则及方法，但不参与最终估值决策。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间债券市场及证券交易所上市流通或挂牌转让的固定收益品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在需要对基金持有人数或基金资产净值进行说明的情况。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、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 2026 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：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	2,870,727.74	8,812,746.16
结算备付金		-	844,991.62
存出保证金		-	363,820.80
交易性金融资产	6.4.7.2	235,734,727.07	202,534,853.81
其中：股票投资		223,421,585.43	191,240,577.58
基金投资		-	-
债券投资		12,313,141.64	11,294,276.23
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		20,650.56	151,762.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		238,626,105.37	212,708,174.79
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		-	-
应付赎回款		280,507.05	1,973,912.63

应付管理人报酬		193,363.61	150,609.00
应付托管费		19,336.35	15,060.90
应付销售服务费		23,780.98	29,604.20
应付投资顾问费		-	-
应交税费		354.19	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	77,536.19	146,000.00
负债合计		594,878.37	2,315,186.73
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	163,423,473.53	153,352,558.71
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	74,607,753.47	57,040,429.35
净资产合计		238,031,227.00	210,392,988.06
负债和净资产总计		238,626,105.37	212,708,174.79

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 163,423,473.53 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.4615 元，份额总额 115,263,452.41 份；下属 C 类基金份额净值 1.4446 元，份额总额 48,160,021.12 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：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		7,937,562.58	17,795,570.08
1. 利息收入		20,175.02	27,202.34
其中：存款利息收入	6.4.7.13	20,175.02	27,202.34
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）		-3,901,682.16	12,657,703.73
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,527,943.22	11,737,729.01
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	114,388.43	37,947.53
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	420,249.33	289,743.26
股利收益	6.4.7.19	1,091,623.30	592,283.93
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	11,799,460.38	5,071,146.11
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	19,609.34	39,517.90
减：二、营业总支出		2,024,931.19	877,922.86
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	1,533,579.45	613,413.20
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	153,358.01	61,341.39
3. 销售服务费		264,779.80	117,819.28
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		813.52	1,046.43
8. 其他费用	6.4.7.23	72,400.41	84,302.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		5,912,631.39	16,917,647.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		5,912,631.39	16,917,647.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		5,912,631.39	16,917,647.22

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：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	153,352,558.71	57,040,429.35	210,392,988.06

产			
二、本期期初净资产	153,352,558.71	57,040,429.35	210,392,988.06
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	10,070,914.82	17,567,324.12	27,638,238.94
（一）、综合收益总额	-	5,912,631.39	5,912,631.39
（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）	10,070,914.82	11,654,692.73	21,725,607.55
其中：1. 基金申购款	142,601,512.87	70,235,518.74	212,837,031.61
2. 基金赎回款	-132,530,598.05	-58,580,826.01	-191,111,424.06
（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	163,423,473.53	74,607,753.47	238,031,227.00
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	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	-177,912,705.99	-14,239,581.65	-192,152,287.64

款			
(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

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

于景亮

基金管理人负责人

杨晓宇

主管会计工作负责人

包颖

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

鑫元国证 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 $\times$ 90%+恒生指数收益率 $\times$ 5%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

1、印花税

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

2、增值税

根据中华人民共和国主席令第四十一号《中华人民共和国增值税法》、中华人民共和国国务院令 826 号《中华人民共和国增值税法实施条例》及财政部、税务总局公告 2026 年第 10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》的规定，资管产品运营过程中发生的应税交易，资管产品管理人为纳税人。自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，资管产品管理人运营契约制资管产品过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税；公募证券投资基金（封闭式证券投资基金、开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入及金融同业往来利息收入免征增值税；金融同业往来利息收入包括金融机构与人民银行所发生的资金往来业务、银行联行往来业务、金融机构间的资金往来业务，以及金融机构开展同业存款、同业借款、同业代付、买断式买入返售金融商品、质押式买入返售金融商品、同业存单，取得的利息收入。取得存款利息收入不属于应税交易，不征收增值税。

根据财政部、税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》的规定，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

3、城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

教育附加。

4、企业所得税

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

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

5、个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

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

6、境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
活期存款	198,152.97

等于：本金	198,055.96
加：应计利息	97.01
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	2,672,574.77
等于：本金	2,672,516.23
加：应计利息	58.54
减：坏账准备	-
合计	2,870,727.74

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

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		210,691,204.39	-	223,421,585.43	12,730,381.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,207,548.22	105,551.64	12,313,141.64	41.78
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,207,548.22	105,551.64	12,313,141.64	41.78
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		222,898,752.61	105,551.64	235,734,727.07	12,730,422.82

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：无。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：无。

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：无。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：无。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：无。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：无。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：无。

6.4.7.8 其他资产

注：无。

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—

应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	72,400.00
其他应付款	5,136.19
合计	77,536.19

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	
	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	65,715,435.99	65,715,435.99
本期申购	79,784,423.09	79,784,423.09
本期赎回（以“-”号填列）	-30,236,406.67	-30,236,406.67
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	115,263,452.41	115,263,452.41

金额单位：人民币元

鑫元国证 2000 指数增强 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	87,637,122.72	87,637,122.72
本期申购	62,817,089.78	62,817,089.78
本期赎回（以“-”号填列）	-102,294,191.38	-102,294,191.38
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	48,160,021.12	48,160,021.12

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	24,508,418.38	429,424.15	24,937,842.53
本期期初	24,508,418.38	429,424.15	24,937,842.53
本期利润	-6,276,233.95	8,618,629.16	2,342,395.21
本期基金份额交易产生的变动数	26,948,850.86	-1,035,160.79	25,913,690.07
其中：基金申购款	41,018,624.10	-1,471,372.59	39,547,251.51
基金赎回款	-14,069,773.24	436,211.80	-13,633,561.44
本期已分配利润	-	-	-
本期末	45,181,035.29	8,012,892.52	53,193,927.81

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	31,534,392.50	568,194.32	32,102,586.82
本期期初	31,534,392.50	568,194.32	32,102,586.82
本期利润	389,404.96	3,180,831.22	3,570,236.18
本期基金份额交易产生的变动数	-13,819,035.52	-439,961.82	-14,258,997.34
其中：基金申购款	33,455,551.15	-2,767,283.92	30,688,267.23
基金赎回款	-47,274,586.67	2,327,322.10	-44,947,264.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,104,761.94	3,309,063.72	21,413,825.66

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	14,376.74
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,442.44
结算备付金利息收入	-
其他	4,355.84
合计	20,175.02

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	-5,527,943.22
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	-5,527,943.22
----	---------------

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	2,697,751,621.45
减：卖出股票成本总额	2,700,533,197.35
减：交易费用	2,746,367.32
买卖股票差价收入	-5,527,943.22

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	104,418.98
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,969.45
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	114,388.43

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	18,977,824.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,800,391.50
减：应计利息总额	167,202.13
减：交易费用	261.05
买卖债券差价收入	9,969.45

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	420,249.33

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	1,091,623.30
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	1,091,623.30
----	--------------

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	11,917,140.38
——股票投资	11,925,950.88
——债券投资	-8,810.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-117,680.00
——权证投资	-
——期货投资	-117,680.00
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	11,799,460.38

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	19,604.30
基金转换费收入	5.04
合计	19,609.34

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	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	0.41
合计	72,400.41

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
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 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	
	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	4,273,065,286.90	78.88	3,265,416,899.93	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 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
-------	---------------------------------------	--

	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	25,916,937.00	67.10	17,587,572.70	100.00

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日			
	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	837,483.38	79.74	-	-
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	-	-

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 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	1,533,579.45	613,413.20
其中：应支付销售机构的客户维护费	346,402.38	234,718.19
应支付基金管理人的净管理费	1,187,177.07	378,695.01

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 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	153,358.01	61,341.39

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

$$H=E\times 0.10\%\div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元国证 2000 指数 增强 A	鑫元国证 2000 指数 增强 C	合计
鑫元基金	-	69,715.38	69,715.38
南京银行	-	4,276.37	4,276.37
华泰证券	-	20,200.17	20,200.17
合计	-	94,191.92	94,191.92
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

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

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

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

注：无。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：无。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

鑫元国证 2000 指数增强 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 (%)
鑫沅资产	38,966,786.10	23.8441	49,966,786.10	32.5829

份额单位：份

鑫元国证 2000 指数增强 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 （%）
—	—	—	—	—

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
华泰证券	13,037.20	1,113.36	4,447,010.41	728.40

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（2026 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证 券 名 称	成 功 认 购 日	受 限 期	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数 量 （ 单 位： 股）	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备 注
301666	大普微	2026 年 4 月 8 日	6 个月	新股 流通 受限	46.08	463.33	558	25,712.64	258,538.14	—
688808	联讯仪器	2026 年 4 月 16 日	6 个月	新股 流通 受限	81.88	1,584.33	98	8,024.24	155,264.34	—

688820	盛合晶微	2026 年 4 月 13 日	6 个月	新股流通受限	19.68	141.49	574	11,296.32	81,215.26	-
301682	宏明电子	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	69.66	160.06	325	22,639.50	52,019.50	-
688797	臻宝科技	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	95	4,233.20	44,523.65	-
688813	泰金新能	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026 年 5 月 20 日	6 个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001399	惠科股份	2026 年 6 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,252	12,670.24	34,717.96	-
001257	盛龙股份	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,450	11,339.00	30,073.00	-
688785	恒运昌	2026 年 1 月 20 日	6 个月	新股流通受限	92.18	463.15	54	4,977.72	25,010.10	-
603459	红板科技	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	17.70	84.32	246	4,354.20	20,742.72	-
688811	有研复材	2026 年 4 月 1 日	6 个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026 年 3 月 31 日	6 个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

301669	高特电子	2026 年 6 月 2 日	6 个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301531	春光集团	2026 年 4 月 28 日	6 个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026 年 4 月 22 日	6 个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
001365	天海电子	2026 年 5 月 11 日	6 个月	新股流通受限	27.19	31.31	412	11,202.28	12,899.72	-
001393	维通利	2026 年 5 月 8 日	6 个月	新股流通受限	30.38	38.99	289	8,779.82	11,268.11	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	新股流通受限	21.93	77.78	140	3,070.20	10,889.20	-
603407	长裕集团	2026 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
001237	惠康科技	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	53.26	58.74	168	8,947.68	9,868.32	-
301683	慧谷新材	2026 年 3 月 24 日	6 个月	新股流通受限	78.38	121.77	80	6,270.40	9,741.60	-
301680	固德电材	2026 年 2 月 27 日	6 个月	新股流通受限	58.00	112.16	76	4,408.00	8,524.16	-
301513	尚水智能	2026 年 4 月 10 日	6 个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

688816	易思维	2026 年 2 月 4 日	6 个月	新股流通受限	55.95	57.10	89	4,979.55	5,081.90	-
688781	视涯科技	2026 年 3 月 18 日	6 个月	新股流通受限	22.68	47.61	106	2,404.08	5,046.66	-
688712	北芯生命	2026 年 1 月 28 日	6 个月	新股流通受限	17.52	35.92	138	2,417.76	4,956.96	-
603435	嘉德利	2026 年 5 月 15 日	6 个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
601112	振石股份	2026 年 1 月 21 日	6 个月	新股流通受限	11.18	17.59	203	2,269.54	3,570.77	-
001312	福恩股份	2026 年 4 月 14 日	6 个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
001220	世盟股份	2026 年 1 月 27 日	6 个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
603284	林平发展	2026 年 2 月 3 日	6 个月	新股流通受限	37.88	34.87	43	1,628.84	1,499.41	-

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
000524	岭南控股	2026 年 6 月 24 日	重大事项停牌	8.95	2026 年 7 月 8 日	9.85	13,000	121,697.63	116,350.00	-
688121	卓然股份	2026 年 5 月	重大事项停牌	6.48	2026 年 7 月	5.18	15,800	100,037.99	102,384.00	-

		月 6 日			月 7 日					
--	--	----------	--	--	----------	--	--	--	--	--

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	12,313,141.64	11,294,276.23
合计	12,313,141.64	11,294,276.23

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	2,870,572.19	0.00	0.00	0.00	0.00	155.55	2,870,727.74
结算备付金	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
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	2,100,420.00	0.00	10,107,170.00	0.00	0.00	223,527,137.07	235,734,727.07
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	20,650.56	20,650.56
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	4,970,992.19	0.00	10,107,170.00	0.00	0.00	223,547,943.18	238,626,105.37
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	280,507.05	280,507.05
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	193,363.61	193,363.61
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	19,336.35	19,336.35
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	23,780.98	23,780.98
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	354.19	354.19
应付利润	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
其他负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	77,536.19	77,536.19
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	594,878.37	594,878.37
利率敏感度缺口	4,970,992.19	0.00	10,107,170.00	0.00	0.00	222,953,064.81	238,031,227.00
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	8,812,204.73	0.00	0.00	0.00	0.00	541.43	8,812,746.16

结算备付金	844,991.62	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	844,991.62
存出保证金	363,820.80	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	363,820.80
交易性金融资产	4,900,000.00	0.00	6,301,300.00	0.00	0.00	191,333,553.81	202,534,853.81
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	151,762.40	151,762.40
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	14,921,017.15	0.00	6,301,300.00	0.00	0.00	191,485,857.64	212,708,174.79
负债							
卖出回购金融资产款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付清算款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
应付赎回款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	1,973,912.63	1,973,912.63
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	150,609.00	150,609.00
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	15,060.90	15,060.90
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	29,604.20	29,604.20
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	146,000.00	146,000.00
短期借款	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
交易性金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
衍生金融负债	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	2,315,186.73	2,315,186.73
利率敏感度缺口	14,921,017.15	0.00	6,301,300.00	0.00	0.00	189,170,670.91	210,392,988.06

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	10,755.50	9,147.97
	2. 市场利率上升 25 个基点	-10,731.10	-9,123.84

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险，并且本基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	223,421,585.43	93.86	191,240,577.58	90.90
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	223,421,585.43	93.86	191,240,577.58	90.90

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%	2,187,505.95	2,041,442.99
	业绩比较基准下降 1%	-2,187,505.95	-2,041,442.99

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	222,228,504.72	191,009,738.66
第二层次	12,531,875.64	11,294,276.23
第三层次	974,346.71	230,838.92
合计	235,734,727.07	202,534,853.81

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	223,421,585.43	93.63
	其中：股票	223,421,585.43	93.63
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,313,141.64	5.16
	其中：债券	12,313,141.64	5.16
	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	2,870,727.74	1.20
8	其他各项资产	20,650.56	0.01
9	合计	238,626,105.37	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	186,192.00	0.08
B	采矿业	3,114,016.00	1.31
C	制造业	146,280,401.55	61.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,174,748.00	1.33
E	建筑业	988,564.60	0.42
F	批发和零售业	3,895,318.00	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	1,850,279.00	0.78
H	住宿和餐饮业	187,792.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,681,907.78	8.27
J	金融业	2,163,166.00	0.91
K	房地产业	880,324.00	0.37
L	租赁和商务服务业	1,510,931.00	0.63

M	科学研究和技术服务业	3,510,319.98	1.47
N	水利、环境和公共设施管理业	1,371,700.00	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	96,444.00	0.04
Q	卫生和社会工作	325,600.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	1,292,945.00	0.54
S	综合	435,028.00	0.18
	合计	190,945,676.91	80.22

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	30,073.00	0.01
C	制造业	27,526,253.03	11.56
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	330,000.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,382,800.05	0.58
J	金融业	1,923,320.00	0.81
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	970,476.98	0.41
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	311,402.00	0.13
R	文化、体育和娱乐业	—	—

S	综合	-	-
	合计	32,475,908.52	13.64

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	002428	云南锗业	14,600	1,754,628.00	0.74
2	688146	中船特气	4,200	1,469,958.00	0.62
3	688627	精智达	2,000	1,430,000.00	0.60
4	688409	富创精密	4,600	1,408,750.00	0.59
5	688630	芯碁微装	2,400	1,318,536.00	0.55
6	605376	博迁新材	4,600	1,247,980.00	0.52
7	301511	德福科技	8,100	1,165,185.00	0.49
8	688141	杰华特	7,428	1,140,198.00	0.48
9	688167	炬光科技	3,011	1,066,526.31	0.45
10	600206	有研新材	16,000	1,065,600.00	0.45
11	688548	广钢气体	19,332	1,007,197.20	0.42
12	301396	宏景科技	3,000	994,800.00	0.42
13	688519	南亚新材	2,600	988,104.00	0.42
14	600869	远东股份	29,400	984,018.00	0.41
15	000811	冰轮环境	17,400	978,228.00	0.41
16	300806	斯迪克	7,900	884,800.00	0.37
17	600330	天通股份	27,900	860,436.00	0.36
18	688025	杰普特	1,800	846,000.00	0.36
19	002636	金安国纪	7,000	839,790.00	0.35
20	688403	汇成股份	20,892	829,412.40	0.35
21	688668	鼎通科技	2,200	821,260.00	0.35
22	688362	甬矽电子	8,282	798,384.80	0.34
23	300236	上海新阳	5,900	775,850.00	0.33
24	300398	飞凯材料	12,500	771,875.00	0.32
25	603306	华懋科技	7,400	767,306.00	0.32
26	000962	东方钨业	8,300	751,980.00	0.32
27	300170	汉得信息	48,800	743,712.00	0.31
28	300903	科翔股份	7,200	729,432.00	0.31
29	002245	蔚蓝锂芯	38,800	725,948.00	0.30
30	688123	聚辰股份	3,400	722,840.00	0.30
31	603629	利通电子	4,000	715,240.00	0.30
32	002491	通鼎互联	21,800	706,320.00	0.30

33	688503	聚和材料	5,200	690,040.00	0.29
34	300489	光智科技	2,200	686,290.00	0.29
35	603588	高能环境	35,100	673,920.00	0.28
36	688388	嘉元科技	15,287	672,628.00	0.28
37	300762	上海瀚讯	14,500	661,925.00	0.28
38	300456	赛微电子	15,500	658,285.00	0.28
39	603061	金海通	1,300	652,886.00	0.27
40	688300	联瑞新材	2,600	635,440.00	0.27
41	688372	伟测科技	3,400	632,400.00	0.27
42	603186	华正新材	2,800	630,840.00	0.27
43	603067	振华股份	13,600	629,544.00	0.26
44	600353	旭光电子	13,500	615,600.00	0.26
45	600552	凯盛科技	18,800	612,504.00	0.26
46	300811	铂科新材	6,200	588,318.00	0.25
47	688545	兴福电子	4,400	585,464.00	0.25
48	002859	洁美科技	5,300	580,403.00	0.24
49	688333	铂力特	5,646	578,150.40	0.24
50	301626	苏州天脉	1,500	575,940.00	0.24
51	001267	汇绿生态	10,700	572,450.00	0.24
52	600259	中稀有色	5,600	569,016.00	0.24
53	301205	联特科技	1,700	567,970.00	0.24
54	300655	晶瑞电材	26,515	567,951.30	0.24
55	600186	莲花控股	40,400	565,600.00	0.24
56	688652	京仪装备	2,800	560,476.00	0.24
57	300975	商络电子	10,800	558,900.00	0.23
58	688233	神工股份	2,600	557,492.00	0.23
59	300131	英唐智控	29,100	553,773.00	0.23
60	301018	申菱环境	4,780	552,615.80	0.23
61	002046	国机精工	7,500	552,375.00	0.23
62	688127	蓝特光学	5,643	550,756.80	0.23
63	603063	禾望电气	10,400	550,056.00	0.23
64	688308	欧科亿	3,000	545,430.00	0.23
65	300319	麦捷科技	18,400	545,192.00	0.23
66	688596	正帆科技	6,891	544,802.46	0.23
67	300083	创世纪	39,900	543,438.00	0.23
68	688531	日联科技	3,000	533,520.00	0.22
69	688549	中巨芯	14,261	524,947.41	0.22
70	300260	新莱应材	5,100	512,346.00	0.22
71	300179	四方达	8,500	505,155.00	0.21
72	603283	赛腾股份	6,220	503,695.60	0.21
73	300184	力源信息	28,700	503,685.00	0.21
74	688700	东威科技	5,620	502,428.00	0.21
75	002149	西部材料	9,300	502,293.00	0.21

76	002364	中恒电气	9,300	500,340.00	0.21
77	688390	固德威	4,600	499,146.00	0.21
78	300077	国民技术	15,900	498,465.00	0.21
79	600226	亨通股份	51,800	496,762.00	0.21
80	600114	东睦股份	13,100	494,656.00	0.21
81	603663	三祥新材	5,100	491,130.00	0.21
82	300835	龙磁科技	2,100	481,929.00	0.20
83	688268	华特气体	1,800	481,500.00	0.20
84	002536	飞龙股份	10,100	476,518.00	0.20
85	300201	海伦哲	22,600	476,182.00	0.20
86	603738	泰晶科技	7,900	474,395.00	0.20
87	002192	融捷股份	5,300	473,820.00	0.20
88	300657	弘信电子	10,700	471,014.00	0.20
89	300503	昊志机电	5,100	470,730.00	0.20
90	688484	南芯科技	8,254	466,268.46	0.20
91	688800	瑞可达	4,840	464,494.80	0.20
92	300747	锐科激光	8,700	461,883.00	0.19
93	002171	楚江新材	33,900	460,023.00	0.19
94	603618	杭电股份	9,200	458,896.00	0.19
95	000969	安泰科技	18,600	456,444.00	0.19
96	300323	华灿光电	22,300	454,920.00	0.19
97	688392	骄成超声	2,000	454,360.00	0.19
98	300005	探路者	19,900	449,740.00	0.19
99	300302	同有科技	8,700	445,179.00	0.19
100	688400	凌云光	6,701	443,606.20	0.19
101	002317	众生药业	18,000	442,260.00	0.19
102	002975	博杰股份	3,100	440,200.00	0.18
103	688559	海目星	5,245	440,160.40	0.18
104	300199	翰宇药业	19,800	437,184.00	0.18
105	300085	银之杰	12,400	433,628.00	0.18
106	603667	五洲新春	6,600	432,432.00	0.18
107	603127	昭衍新药	11,300	431,886.00	0.18
108	300814	中富电路	2,100	429,450.00	0.18
109	600961	株冶集团	13,200	427,548.00	0.18
110	002354	天娱数科	45,900	426,870.00	0.18
111	300602	飞荣达	8,300	424,960.00	0.18
112	600596	新安股份	26,600	424,536.00	0.18
113	000766	通化金马	21,800	422,920.00	0.18
114	601020	华钰矿业	17,500	419,825.00	0.18
115	300769	德方纳米	6,300	418,950.00	0.18
116	002611	东方精工	23,700	418,542.00	0.18
117	300342	天银机电	8,900	418,300.00	0.18
118	600888	新疆众和	25,900	411,551.00	0.17

119	688535	华海诚科	2,200	411,400.00	0.17
120	603124	江南新材	2,200	411,356.00	0.17
121	002655	共达电声	8,900	409,400.00	0.17
122	300166	东方国信	23,100	409,101.00	0.17
123	301171	易点天下	12,000	407,520.00	0.17
124	300738	奥飞数据	20,000	404,400.00	0.17
125	603026	石大胜华	4,500	402,165.00	0.17
126	002654	万润科技	18,000	400,680.00	0.17
127	688131	皓元医药	4,200	397,320.00	0.17
128	300065	海兰信	17,700	394,887.00	0.17
129	300331	苏大维格	5,500	391,105.00	0.16
130	001301	尚太科技	4,100	383,391.00	0.16
131	300263	隆华科技	23,500	383,050.00	0.16
132	688449	联芸科技	4,400	379,764.00	0.16
133	688507	索辰科技	1,400	377,552.00	0.16
134	600459	贵研铂业	13,000	375,440.00	0.16
135	688158	优刻得	10,166	373,702.16	0.16
136	300409	道氏技术	18,700	372,691.00	0.16
137	600367	红星发展	5,900	371,287.00	0.16
138	688106	金宏气体	8,937	370,706.76	0.16
139	300671	富满微	4,300	370,488.00	0.16
140	603876	鼎胜新材	14,200	369,342.00	0.16
141	300303	聚飞光电	32,800	362,768.00	0.15
142	600338	西藏珠峰	23,800	362,712.00	0.15
143	603002	宏昌电子	15,000	362,550.00	0.15
144	002297	博云新材	12,500	362,375.00	0.15
145	301071	力量钻石	3,900	360,750.00	0.15
146	688432	有研硅	8,967	358,410.99	0.15
147	002290	禾盛新材	3,900	358,293.00	0.15
148	300593	新雷能	11,900	357,714.00	0.15
149	688359	三孚新科	1,800	357,192.00	0.15
150	300607	拓斯达	8,600	354,578.00	0.15
151	301095	广立微	3,000	354,150.00	0.15
152	300693	盛弘股份	7,200	351,000.00	0.15
153	002947	恒铭达	4,600	349,830.00	0.15
154	002167	东方锆业	15,800	348,706.00	0.15
155	601778	晶科科技	80,800	347,440.00	0.15
156	688150	莱特光电	5,047	346,325.14	0.15
157	600388	龙净环保	23,700	344,835.00	0.14
158	301183	东田微	1,300	344,331.00	0.14
159	688319	欧林生物	7,826	344,187.48	0.14
160	603881	数据港	13,760	344,000.00	0.14
161	603031	安孚科技	6,400	340,800.00	0.14

162	688097	博众精工	5,400	340,470.00	0.14
163	600531	豫光金铅	23,000	339,480.00	0.14
164	601678	滨化股份	51,500	339,385.00	0.14
165	301093	华兰股份	2,500	339,075.00	0.14
166	605020	永和股份	8,300	337,976.00	0.14
167	601137	博威合金	15,100	337,183.00	0.14
168	600877	电科芯片	19,600	335,748.00	0.14
169	301486	致尚科技	1,600	333,312.00	0.14
170	002237	恒邦股份	22,600	331,994.00	0.14
171	300821	东岳硅材	16,000	328,960.00	0.14
172	688116	天奈科技	8,561	327,030.20	0.14
173	688401	路维光电	3,400	326,332.00	0.14
174	300790	宇瞳光学	12,380	323,241.80	0.14
175	300042	朗科科技	4,200	319,914.00	0.13
176	688059	华锐精密	1,600	319,536.00	0.13
177	605289	罗曼股份	2,200	319,000.00	0.13
178	688661	和林微纳	2,000	317,960.00	0.13
179	688726	拉普拉斯	6,014	317,839.90	0.13
180	603267	鸿远电子	4,100	317,668.00	0.13
181	002745	木林森	25,300	317,515.00	0.13
182	301392	汇成真空	1,100	317,504.00	0.13
183	600201	生物股份	27,200	316,880.00	0.13
184	002119	康强电子	7,900	315,368.00	0.13
185	688332	中科蓝讯	2,000	315,000.00	0.13
186	002645	华宏科技	11,440	314,714.40	0.13
187	301489	思泉新材	1,900	312,702.00	0.13
188	300257	开山股份	10,900	312,612.00	0.13
189	300843	胜蓝股份	2,000	312,500.00	0.13
190	000620	盈新发展	88,900	311,150.00	0.13
191	000823	超声电子	12,100	310,365.00	0.13
192	301005	超捷股份	2,780	310,136.80	0.13
193	600155	华创云信	55,800	308,016.00	0.13
194	300576	容大感光	6,010	307,832.20	0.13
195	000762	西藏矿业	11,500	307,050.00	0.13
196	688003	天准科技	2,400	305,520.00	0.13
197	300353	东土科技	14,700	305,466.00	0.13
198	301021	英诺激光	2,500	304,750.00	0.13
199	002842	翔鹭钨业	6,300	303,660.00	0.13
200	688380	中微半导	4,600	303,186.00	0.13
201	603078	江化微	6,100	301,462.00	0.13
202	301031	中熔电气	2,520	301,014.00	0.13
203	688208	道通科技	11,907	299,937.33	0.13
204	300469	信息发展	5,700	299,877.00	0.13

205	000592	平潭发展	44,800	299,712.00	0.13
206	688020	方邦股份	1,200	299,520.00	0.13
207	600366	宁波韵升	20,400	299,472.00	0.13
208	001287	中电港	9,600	299,040.00	0.13
209	300684	中石科技	4,900	298,900.00	0.13
210	688515	裕太微	1,200	298,512.00	0.13
211	002361	神剑股份	19,800	297,990.00	0.13
212	688378	奥来德	4,800	297,600.00	0.13
213	688262	国芯科技	6,874	297,163.02	0.12
214	603281	江瀚新材	7,300	296,599.00	0.12
215	301128	强瑞技术	1,900	296,210.00	0.12
216	001339	智微智能	2,890	295,589.20	0.12
217	002815	崇达技术	17,800	295,302.00	0.12
218	601375	中原证券	74,000	295,260.00	0.12
219	600063	皖维高新	38,800	294,880.00	0.12
220	300842	帝科股份	3,300	294,261.00	0.12
221	603115	海星股份	2,400	293,928.00	0.12
222	688206	概伦电子	6,615	293,507.55	0.12
223	688381	帝奥微	5,486	293,501.00	0.12
224	301150	中一科技	4,620	291,568.20	0.12
225	688327	云从科技	23,369	291,177.74	0.12
226	600872	中炬高新	16,700	289,912.00	0.12
227	301123	奕东电子	2,400	289,728.00	0.12
228	002565	顺灏股份	22,800	288,876.00	0.12
229	000422	湖北宜化	20,500	288,025.00	0.12
230	002048	宁波华翔	12,500	287,500.00	0.12
231	300499	高澜股份	7,400	286,380.00	0.12
232	002396	星网锐捷	14,900	285,633.00	0.12
233	000973	佛塑科技	19,900	285,565.00	0.12
234	000534	万泽股份	10,400	284,544.00	0.12
235	300938	信测标准	5,700	284,316.00	0.12
236	002174	游族网络	22,500	283,725.00	0.12
237	002643	万润股份	13,500	282,825.00	0.12
238	688690	纳微科技	6,401	282,284.10	0.12
239	300277	汽轮科技	18,700	281,248.00	0.12
240	600179	安通控股	63,900	281,160.00	0.12
241	688275	万润新能	2,200	280,610.00	0.12
242	000682	东方电子	22,200	280,386.00	0.12
243	300613	富瀚微	3,500	280,280.00	0.12
244	688416	恒烁股份	2,000	280,000.00	0.12
245	002957	科瑞技术	5,100	279,684.00	0.12
246	300315	掌趣科技	71,600	279,240.00	0.12
247	000681	视觉中国	14,000	279,160.00	0.12

248	688508	芯朋微	3,000	278,880.00	0.12
249	002515	金字火腿	27,800	278,278.00	0.12
250	688502	茂莱光学	400	277,440.00	0.12
251	600529	山东药玻	15,000	276,750.00	0.12
252	002254	泰和新材	15,200	276,488.00	0.12
253	688516	奥特维	4,800	275,472.00	0.12
254	300007	汉威科技	7,200	275,040.00	0.12
255	300031	宝通科技	9,600	274,272.00	0.12
256	688001	华兴源创	3,200	274,240.00	0.12
257	688166	博瑞医药	7,825	273,953.25	0.12
258	002792	通宇通讯	7,700	273,889.00	0.12
259	603009	北特科技	5,700	273,429.00	0.11
260	600602	云赛智联	17,000	273,360.00	0.11
261	600550	保变电气	23,300	273,309.00	0.11
262	603690	至纯科技	7,700	272,580.00	0.11
263	001896	豫能控股	16,400	272,404.00	0.11
264	002139	拓邦股份	28,600	272,272.00	0.11
265	301086	鸿富瀚	1,300	272,064.00	0.11
266	603662	柯力传感	3,800	270,446.00	0.11
267	300382	斯莱克	11,700	270,387.00	0.11
268	301369	联动科技	1,100	269,500.00	0.11
269	688279	峰昭科技	1,200	269,328.00	0.11
270	000612	焦作万方	25,400	268,986.00	0.11
271	300480	光力科技	6,300	268,884.00	0.11
272	300827	上能电气	8,700	267,873.00	0.11
273	300900	广联航空	6,900	266,133.00	0.11
274	002807	江阴银行	71,700	266,007.00	0.11
275	301219	腾远钴业	4,830	264,684.00	0.11
276	002183	怡亚通	49,600	264,368.00	0.11
277	002897	意华股份	3,000	263,940.00	0.11
278	002079	苏州固锝	17,500	263,025.00	0.11
279	002895	川恒股份	9,000	262,800.00	0.11
280	002979	雷赛智能	4,700	262,166.00	0.11
281	603301	振德医疗	3,000	261,480.00	0.11
282	300229	拓尔思	18,900	261,198.00	0.11
283	688258	卓易信息	2,200	260,788.00	0.11
284	002948	青岛银行	51,200	260,096.00	0.11
285	688368	晶丰明源	1,200	259,824.00	0.11
286	002706	良信股份	23,800	259,658.00	0.11
287	002922	伊戈尔	7,900	259,120.00	0.11
288	000672	上峰材料	10,900	258,112.00	0.11
289	300377	赢时胜	15,900	256,626.00	0.11
290	300053	航宇微	15,600	256,620.00	0.11

291	601609	金田股份	23,700	255,960.00	0.11
292	002647	仁东控股	24,500	255,780.00	0.11
293	002250	联化科技	18,700	255,629.00	0.11
294	600345	长江通信	3,900	255,489.00	0.11
295	603601	再升科技	20,800	255,424.00	0.11
296	688518	联赢激光	8,263	255,326.70	0.11
297	688063	派能科技	4,793	255,323.11	0.11
298	000680	山推股份	25,400	255,270.00	0.11
299	300322	硕贝德	10,100	254,520.00	0.11
300	300468	四方精创	12,100	254,221.00	0.11
301	002929	润建股份	3,800	254,144.00	0.11
302	300133	华策影视	35,800	253,464.00	0.11
303	688031	星环科技	2,200	253,396.00	0.11
304	600986	浙文互联	36,300	253,374.00	0.11
305	688625	呈和科技	3,000	253,230.00	0.11
306	688593	新相微	6,503	253,096.76	0.11
307	600428	中远海特	32,400	253,044.00	0.11
308	603800	洪田股份	3,100	251,999.00	0.11
309	600821	金开新能	40,300	251,875.00	0.11
310	002768	国恩股份	4,832	251,553.92	0.11
311	688239	航宇科技	4,200	251,286.00	0.11
312	603938	三孚股份	3,500	250,775.00	0.11
313	300497	富祥股份	11,300	250,408.00	0.11
314	600490	鹏欣资源	43,000	250,260.00	0.11
315	002965	祥鑫科技	4,900	249,655.00	0.10
316	688605	先锋精科	2,400	249,648.00	0.10
317	688603	天承科技	1,200	249,540.00	0.10
318	300304	云意电气	13,900	248,115.00	0.10
319	002400	省广集团	39,300	247,983.00	0.10
320	300436	广生堂	2,300	247,572.00	0.10
321	688779	五矿新能	30,511	247,444.21	0.10
322	688598	金博股份	5,000	247,250.00	0.10
323	300687	赛意信息	7,900	244,900.00	0.10
324	603997	继峰股份	20,700	244,881.00	0.10
325	603859	能科科技	5,100	244,698.00	0.10
326	002182	宝武镁业	15,700	244,449.00	0.10
327	300008	天海防务	40,300	244,218.00	0.10
328	301316	慧博云通	6,200	244,156.00	0.10
329	300185	通裕重工	89,300	243,789.00	0.10
330	000833	粤桂股份	10,400	243,568.00	0.10
331	002579	中京电子	11,200	242,816.00	0.10
332	301285	鸿日达	2,200	242,726.00	0.10
333	603319	美湖股份	7,300	242,433.00	0.10

334	002539	云图控股	21,400	242,248.00	0.10
335	300420	五洋自控	25,500	241,230.00	0.10
336	300049	福瑞医科	6,200	241,056.00	0.10
337	002639	雪人集团	17,300	240,643.00	0.10
338	000700	模塑科技	16,300	240,588.00	0.10
339	600285	羚锐制药	12,400	240,312.00	0.10
340	605196	华通线缆	9,200	240,120.00	0.10
340	688757	胜科纳米	3,600	240,120.00	0.10
341	601963	重庆银行	23,800	239,904.00	0.10
342	603203	快克智能	3,100	238,018.00	0.10
343	688088	虹软科技	6,695	238,007.25	0.10
344	000603	盛达资源	10,300	237,930.00	0.10
345	002993	奥海科技	3,300	236,313.00	0.10
346	002446	盛路通信	22,000	236,280.00	0.10
347	002583	海能达	30,700	236,083.00	0.10
348	000758	中色股份	35,900	235,863.00	0.10
349	300222	科大智能	17,000	235,450.00	0.10
350	600452	涪陵电力	25,200	235,116.00	0.10
351	000690	宝新能源	50,000	235,000.00	0.10
352	300244	迪安诊断	12,500	234,250.00	0.10
353	300252	金信诺	13,500	232,875.00	0.10
354	688353	华盛锂电	2,000	232,140.00	0.10
355	002552	宝鼎科技	3,800	231,800.00	0.10
356	300113	顺网科技	12,700	231,267.00	0.10
357	601606	长城军工	8,400	230,916.00	0.10
358	300720	海川智能	2,400	230,880.00	0.10
359	688556	高测股份	17,218	228,655.04	0.10
360	300638	广和通	12,300	227,673.00	0.10
361	300139	晓程科技	6,200	226,610.00	0.10
362	603890	春秋电子	8,200	226,484.00	0.10
363	603358	华达科技	5,200	226,200.00	0.10
364	301566	达利凯普	6,100	226,188.00	0.10
365	300674	宇信科技	15,000	225,750.00	0.09
366	002507	涪陵榨菜	20,900	225,720.00	0.09
367	301216	万凯新材	9,800	225,302.00	0.09
368	002549	凯美特气	10,700	225,235.00	0.09
369	000917	电广传媒	33,500	224,115.00	0.09
370	000420	吉林化纤	55,200	223,560.00	0.09
371	300035	中科电气	15,500	223,510.00	0.09
372	600619	海立股份	14,100	223,485.00	0.09
373	002936	郑州银行	135,300	223,245.00	0.09
374	300327	中颖电子	6,900	221,145.00	0.09
375	600750	华润江中	10,000	220,700.00	0.09

376	002170	芭田股份	20,300	220,458.00	0.09
377	300174	元力股份	7,500	219,150.00	0.09
378	600908	无锡银行	43,100	218,948.00	0.09
379	300181	佐力药业	15,500	218,550.00	0.09
380	688711	宏微科技	4,800	218,160.00	0.09
381	300151	昌红科技	8,700	217,065.00	0.09
382	688029	南微医学	3,000	215,400.00	0.09
383	301629	矽电股份	500	215,200.00	0.09
384	300109	新开源	13,400	215,070.00	0.09
385	688717	艾罗能源	2,600	214,682.00	0.09
386	600559	老白干酒	19,100	213,920.00	0.09
387	002971	和远气体	3,300	204,600.00	0.09
388	002943	宇晶股份	4,620	204,342.60	0.09
389	301362	民爆光电	1,100	202,312.00	0.08
390	000524	岭南控股	13,000	116,350.00	0.05
391	688084	晶品特装	2,200	110,616.00	0.05
392	688648	中邮科技	3,000	109,650.00	0.05
393	300354	东华测试	3,200	108,416.00	0.05
394	603983	丸美生物	3,800	106,932.00	0.04
395	300752	隆利科技	7,900	106,413.00	0.04
396	002053	云南能投	10,700	105,181.00	0.04
397	002615	哈尔斯	15,200	104,880.00	0.04
398	603366	日出东方	14,400	104,688.00	0.04
399	605018	长华集团	7,000	104,370.00	0.04
400	688631	莱斯信息	2,200	103,202.00	0.04
401	301085	亚康股份	1,700	103,037.00	0.04
402	603219	富佳股份	6,600	102,828.00	0.04
403	688055	龙腾光电	17,831	102,706.56	0.04
404	301225	恒勃股份	1,300	102,427.00	0.04
405	301256	华融化学	7,900	102,384.00	0.04
406	688152	麒麟信安	3,719	102,198.12	0.04
407	605288	凯迪股份	1,200	101,820.00	0.04
408	301596	瑞迪智驱	2,020	101,808.00	0.04
409	300894	火星人	8,100	101,736.00	0.04
410	688259	创耀科技	2,600	101,712.00	0.04
411	688136	科兴制药	4,898	101,437.58	0.04
412	000045	深纺织 A	9,600	101,184.00	0.04
413	605118	力鼎光电	2,900	101,181.00	0.04
414	603266	天龙股份	6,000	100,980.00	0.04
415	300386	飞天诚信	9,100	100,919.00	0.04
416	603239	浙江仙通	6,800	100,708.00	0.04
417	300712	永福股份	4,700	100,627.00	0.04
418	603270	金帝股份	3,000	100,530.00	0.04

419	003041	真爱美家	2,300	100,395.00	0.04
420	301509	金凯生科	3,300	100,353.00	0.04
421	300722	新余国科	4,500	100,350.00	0.04
422	301221	光庭信息	3,400	100,334.00	0.04
423	300781	因赛集团	3,800	100,168.00	0.04
424	300711	广哈通信	6,100	100,040.00	0.04
425	300447	全信股份	6,700	100,031.00	0.04
426	300389	艾比森	7,800	99,996.00	0.04
427	002613	北玻股份	25,500	99,960.00	0.04
428	300434	金石亚药	8,900	99,947.00	0.04
429	301325	曼恩斯特	2,900	99,905.00	0.04
430	300911	亿田智能	4,700	99,875.00	0.04
431	688399	硕世生物	2,200	99,858.00	0.04
432	300860	锋尚文化	3,900	99,840.00	0.04
433	002983	芯瑞达	3,600	99,648.00	0.04
434	300940	南极光	6,600	99,528.00	0.04
435	688232	新点软件	5,592	99,425.76	0.04
436	301556	托普云农	1,700	99,382.00	0.04
436	605228	神通科技	7,400	99,382.00	0.04
437	603344	星德胜	4,100	99,302.00	0.04
438	003005	竞业达	7,500	99,300.00	0.04
439	300250	初灵信息	6,800	99,144.00	0.04
440	603275	众辰科技	2,600	98,982.00	0.04
441	300215	电科院	15,000	98,850.00	0.04
442	301168	通灵股份	2,200	98,802.00	0.04
443	605555	德昌股份	7,900	98,750.00	0.04
444	301172	君逸数码	3,800	98,610.00	0.04
445	603868	飞科电器	3,200	98,560.00	0.04
446	688151	华强科技	6,628	98,558.36	0.04
447	300946	恒而达	2,500	98,475.00	0.04
448	605399	晨光新材	6,700	98,423.00	0.04
449	301149	隆华新材	9,300	98,394.00	0.04
450	300504	天邑股份	6,100	98,393.00	0.04
451	002933	新兴装备	3,800	98,230.00	0.04
452	002882	金龙羽	5,200	98,228.00	0.04
453	001306	夏厦精密	1,800	98,226.00	0.04
454	688128	中国电研	4,136	98,188.64	0.04
455	300411	金盾股份	13,800	98,118.00	0.04
456	002676	顺威股份	19,700	98,106.00	0.04
457	688566	吉贝尔	3,833	98,086.47	0.04
458	605005	合兴股份	6,200	98,022.00	0.04
459	002658	雪迪龙	11,600	98,020.00	0.04
460	300698	万马科技	3,600	97,920.00	0.04

461	605365	立达信	6,800	97,784.00	0.04
462	300608	思特奇	9,500	97,755.00	0.04
462	301303	真兰仪表	5,700	97,755.00	0.04
463	301180	万祥科技	7,800	97,734.00	0.04
463	301330	熵基科技	3,900	97,734.00	0.04
464	601026	道生天合	6,700	97,686.00	0.04
465	300830	金现代	12,300	97,662.00	0.04
466	688767	博拓生物	3,000	97,530.00	0.04
467	300962	中金辐照	7,800	97,500.00	0.04
468	300523	辰安科技	5,300	97,414.00	0.04
469	688348	昱能科技	2,800	97,384.00	0.04
470	603633	徕木股份	14,300	97,383.00	0.04
471	300968	格林精密	10,100	97,364.00	0.04
472	300399	天利科技	5,100	97,308.00	0.04
473	003038	鑫铂股份	8,600	97,266.00	0.04
474	301508	中机认检	4,200	97,188.00	0.04
475	605333	沪光股份	5,700	97,185.00	0.04
476	603418	友升股份	2,200	97,174.00	0.04
477	603206	嘉环科技	6,100	97,173.00	0.04
478	603370	华新精科	2,700	97,146.00	0.04
479	300875	捷强装备	3,400	97,138.00	0.04
480	300822	贝仕达克	8,300	97,110.00	0.04
481	301658	首航新能	3,600	97,092.00	0.04
482	603381	永臻股份	6,300	97,083.00	0.04
483	301391	卡莱特	1,700	97,070.00	0.04
484	603098	森特股份	9,200	97,060.00	0.04
485	301215	中汽股份	18,700	97,053.00	0.04
486	001380	华纬科技	6,200	96,968.00	0.04
487	688533	上声电子	4,646	96,915.56	0.04
488	688073	毕得医药	1,800	96,876.00	0.04
489	605286	同力天启	3,800	96,862.00	0.04
490	300673	佩蒂股份	7,200	96,840.00	0.04
491	603135	中重科技	8,000	96,800.00	0.04
492	300797	钢研纳克	7,300	96,798.00	0.04
493	688656	浩欧博	1,000	96,770.00	0.04
494	603767	中马传动	6,800	96,696.00	0.04
495	300933	中辰股份	15,900	96,672.00	0.04
496	000532	华金资本	9,000	96,660.00	0.04
497	301202	朗威股份	2,900	96,657.00	0.04
498	605580	恒盛能源	3,500	96,635.00	0.04
499	002801	微光股份	3,500	96,600.00	0.04
500	000576	甘化科工	14,700	96,579.00	0.04
501	300978	东箭科技	11,900	96,509.00	0.04

502	301177	迪阿股份	3,500	96,495.00	0.04
503	002651	利君股份	13,200	96,492.00	0.04
504	002918	蒙娜丽莎	9,600	96,480.00	0.04
505	002866	传艺科技	5,900	96,465.00	0.04
505	300266	兴源环境	54,500	96,465.00	0.04
506	301268	铭利达	6,900	96,462.00	0.04
507	688579	地纬智能	12,709	96,461.31	0.04
508	300466	赛摩智能	13,700	96,448.00	0.04
509	000526	学大教育	3,800	96,444.00	0.04
510	301048	金鹰重工	11,200	96,432.00	0.04
511	002695	煌上煌	9,500	96,425.00	0.04
512	300847	中船汉光	7,450	96,403.00	0.04
513	000058	深赛格	15,700	96,398.00	0.04
514	300528	幸福蓝海	7,500	96,375.00	0.04
515	603004	鼎龙科技	4,000	96,360.00	0.04
516	300370	安控科技	47,700	96,354.00	0.04
517	301609	山大电力	2,900	96,309.00	0.04
518	301141	中科磁业	2,300	96,278.00	0.04
519	300848	美瑞新材	6,900	96,255.00	0.04
520	001221	悍高集团	2,393	96,246.46	0.04
521	000993	闽东电力	9,700	96,224.00	0.04
522	688588	凌志软件	10,585	96,217.65	0.04
523	300882	万胜智能	5,800	96,164.00	0.04
524	301266	宇邦新材	4,210	96,156.40	0.04
525	301311	昆船智能	7,400	96,126.00	0.04
526	300941	创识科技	7,000	96,110.00	0.04
527	300530	领湃科技	5,700	96,045.00	0.04
528	002724	海洋王	19,800	96,030.00	0.04
529	300719	安达维尔	8,200	96,022.00	0.04
530	688687	凯因科技	5,887	96,016.97	0.04
531	301632	广东建科	6,200	95,976.00	0.04
532	300659	中孚信息	10,100	95,950.00	0.04
533	002441	众业达	12,300	95,940.00	0.04
533	601512	中新集团	12,300	95,940.00	0.04
534	601566	九牧王	11,800	95,934.00	0.04
535	000862	银星能源	19,900	95,918.00	0.04
536	001236	弘业期货	13,800	95,910.00	0.04
537	301439	泓淋电力	6,100	95,892.00	0.04
538	002912	中新赛克	5,200	95,888.00	0.04
538	301381	赛维时代	5,200	95,888.00	0.04
539	301187	欧圣电气	6,700	95,877.00	0.04
540	300795	米奥会展	11,200	95,872.00	0.04
541	603630	拉芳家化	7,500	95,850.00	0.04

542	603273	天元智能	7,400	95,830.00	0.04
543	000779	甘咨询	12,300	95,817.00	0.04
544	001379	腾达科技	6,100	95,770.00	0.04
545	300107	建新股份	17,100	95,760.00	0.04
545	300384	三联虹普	8,400	95,760.00	0.04
546	301117	佳缘科技	4,100	95,735.00	0.04
547	000797	中国武夷	43,700	95,703.00	0.04
548	301058	中粮科工	12,300	95,694.00	0.04
549	002103	广博股份	16,300	95,681.00	0.04
550	001376	百通能源	9,200	95,680.00	0.04
551	300879	大叶股份	6,100	95,648.00	0.04
552	301558	三态股份	15,500	95,635.00	0.04
553	605378	野马电池	6,900	95,634.00	0.04
554	301383	天键股份	4,000	95,600.00	0.04
555	002666	德联集团	24,200	95,590.00	0.04
556	605009	豪悦护理	4,100	95,571.00	0.04
557	301608	博实结	1,900	95,494.00	0.04
558	300160	秀强股份	22,900	95,493.00	0.04
559	688334	西高院	5,264	95,488.96	0.04
560	601086	国芳集团	14,400	95,472.00	0.04
560	605050	福然德	10,200	95,472.00	0.04
561	601279	英利汽车	31,300	95,465.00	0.04
562	301315	威士顿	2,500	95,450.00	0.04
563	001382	新亚电缆	6,100	95,404.00	0.04
564	603396	金辰股份	3,600	95,400.00	0.04
565	300887	谱尼测试	13,700	95,352.00	0.04
566	301101	明月镜片	3,500	95,340.00	0.04
567	300423	昇辉科技	17,300	95,323.00	0.04
568	002889	东方嘉盛	9,200	95,312.00	0.04
569	002846	英联股份	9,000	95,310.00	0.04
569	601038	一拖股份	9,000	95,310.00	0.04
570	301090	华润材料	15,200	95,304.00	0.04
571	300542	新晨科技	8,600	95,288.00	0.04
572	002398	垒知集团	25,400	95,250.00	0.04
573	300288	朗玛信息	10,700	95,230.00	0.04
574	603209	兴通股份	7,600	95,228.00	0.04
575	300982	苏文电能	6,300	95,193.00	0.04
576	301017	漱玉平民	7,300	95,192.00	0.04
577	002869	金溢科技	5,800	95,178.00	0.04
578	001311	多利科技	5,900	95,167.00	0.04
579	002959	小熊电器	3,000	95,160.00	0.04
580	603680	今创集团	9,700	95,157.00	0.04
581	603081	大丰实业	11,000	95,150.00	0.04

582	603312	西典新能	2,800	95,144.00	0.04
583	301339	通行宝	9,300	95,139.00	0.04
584	688315	诺禾致源	7,602	95,101.02	0.04
585	300917	特发服务	3,900	95,082.00	0.04
585	301559	中集环科	7,800	95,082.00	0.04
586	603489	八方股份	3,400	95,064.00	0.04
587	601003	柳钢股份	28,200	95,034.00	0.04
588	603579	荣泰健康	5,600	95,032.00	0.04
589	688177	百奥泰	5,649	95,016.18	0.04
590	002187	广百股份	20,300	95,004.00	0.04
591	002996	顺博合金	16,100	94,990.00	0.04
591	603109	神驰机电	5,900	94,990.00	0.04
592	002766	索菱股份	26,900	94,957.00	0.04
593	002404	嘉欣丝绸	16,600	94,952.00	0.04
594	600526	菲达环保	23,100	94,941.00	0.04
595	603173	福斯达	2,800	94,920.00	0.04
596	301357	北方长龙	1,200	94,908.00	0.04
597	603291	联合水务	11,800	94,872.00	0.04
598	605338	巴比食品	5,300	94,870.00	0.04
599	301456	盘古智能	4,200	94,836.00	0.04
600	600603	广汇物流	21,800	94,830.00	0.04
601	688298	东方生物	5,309	94,818.74	0.04
602	600620	天宸股份	24,000	94,800.00	0.04
603	000096	广聚能源	13,600	94,792.00	0.04
604	300402	宝色股份	6,400	94,784.00	0.04
605	603758	秦安股份	10,600	94,764.00	0.04
606	601116	三江购物	9,600	94,752.00	0.04
607	603013	亚普股份	6,000	94,740.00	0.04
608	603258	电魂网络	7,900	94,721.00	0.04
609	301613	新铝时代	2,600	94,718.00	0.04
610	605188	国光连锁	8,100	94,689.00	0.04
611	603105	芯能科技	13,900	94,659.00	0.04
612	601801	皖新传媒	19,200	94,656.00	0.04
613	301073	君亭酒店	5,200	94,640.00	0.04
614	603216	梦天家居	4,600	94,622.00	0.04
615	603193	润本股份	5,100	94,605.00	0.04
616	300695	兆丰股份	1,900	94,601.00	0.04
617	001285	瑞立科密	2,300	94,599.00	0.04
618	002614	奥佳华	21,400	94,588.00	0.04
619	600218	全柴动力	13,100	94,582.00	0.04
620	688230	芯导科技	1,200	94,572.00	0.04
621	002641	公元股份	24,500	94,570.00	0.04
622	600604	市北高新	23,700	94,563.00	0.04

623	002543	万和电气	15,200	94,544.00	0.04
624	300755	华致酒行	8,300	94,537.00	0.04
625	603016	新宏泰	2,800	94,528.00	0.04
626	300791	仙乐健康	5,900	94,518.00	0.04
627	601022	宁波远洋	12,400	94,488.00	0.04
628	301153	中科江南	5,800	94,482.00	0.04
629	600650	锦江在线	9,800	94,472.00	0.04
630	601008	连云港	23,500	94,470.00	0.04
631	603053	成都燃气	11,300	94,468.00	0.04
632	002140	东华科技	10,300	94,451.00	0.04
633	603103	横店影视	6,600	94,446.00	0.04
634	603693	江苏新能	7,500	94,425.00	0.04
635	600626	申达股份	29,600	94,424.00	0.04
636	002116	中国海诚	13,960	94,369.60	0.04
637	002973	侨银股份	9,100	94,367.00	0.04
638	600794	保税科技	33,100	94,335.00	0.04
639	002791	坚朗五金	7,200	94,320.00	0.04
639	301665	泰禾股份	4,500	94,320.00	0.04
639	600738	丽尚国潮	26,200	94,320.00	0.04
640	002908	德生科技	14,900	94,317.00	0.04
641	605011	杭州热电	6,100	94,306.00	0.04
642	605577	龙版传媒	10,700	94,267.00	0.04
643	003037	三和管桩	17,200	94,256.00	0.04
644	301491	汉桑科技	2,400	94,248.00	0.04
645	000852	石化机械	19,000	94,240.00	0.04
646	002287	奇正藏药	5,000	94,200.00	0.04
647	002321	华英农业	56,400	94,188.00	0.04
648	002953	日丰股份	10,800	94,176.00	0.04
648	003012	东鹏控股	21,600	94,176.00	0.04
649	600746	江苏索普	18,000	94,140.00	0.04
650	000655	金岭矿业	14,800	94,128.00	0.04
651	603815	交建股份	18,100	94,120.00	0.04
652	601330	绿色动力	13,500	94,095.00	0.04
653	600278	东方创业	16,000	94,080.00	0.04
654	603988	中电电机	5,800	94,076.00	0.04
655	002160	常铝股份	25,700	94,062.00	0.04
655	603878	武进不锈	18,300	94,062.00	0.04
656	000505	京粮控股	18,700	94,061.00	0.04
657	603535	嘉诚国际	15,700	94,043.00	0.04
658	000030	富奥股份	24,300	94,041.00	0.04
658	002401	中远海科	8,100	94,041.00	0.04
659	002016	世荣兆业	23,500	94,000.00	0.04
659	603121	华培动力	8,000	94,000.00	0.04

659	603395	红四方	4,700	94,000.00	0.04
660	301535	浙江华远	7,000	93,940.00	0.04
661	300639	凯普生物	18,900	93,933.00	0.04
662	301025	读客文化	12,100	93,896.00	0.04
663	000631	顺发恒能	31,400	93,886.00	0.04
664	000885	城发环境	7,800	93,834.00	0.04
664	301507	民生健康	7,800	93,834.00	0.04
665	300652	雷迪克	2,800	93,828.00	0.04
666	002344	海宁皮城	26,800	93,800.00	0.04
667	601158	重庆水务	24,300	93,798.00	0.04
668	300388	节能国祯	15,200	93,784.00	0.04
669	600551	时代出版	14,100	93,765.00	0.04
670	601068	中铝国际	21,700	93,744.00	0.04
671	603567	珍宝岛	21,400	93,732.00	0.04
672	603348	文灿股份	7,000	93,730.00	0.04
673	301501	恒鑫生活	3,600	93,672.00	0.04
674	603615	茶花股份	5,800	93,670.00	0.04
675	002393	力生制药	6,600	93,654.00	0.04
675	600088	中视传媒	8,600	93,654.00	0.04
676	300272	开能健康	17,800	93,628.00	0.04
677	300881	盛德鑫泰	2,500	93,625.00	0.04
678	601121	宝地矿业	16,600	93,624.00	0.04
679	301371	敷尔佳	3,600	93,600.00	0.04
680	603257	中国瑞林	1,200	93,588.00	0.04
681	003039	顺控发展	8,500	93,585.00	0.04
682	002242	九阳股份	11,900	93,534.00	0.04
683	603708	家家悦	10,900	93,522.00	0.04
684	600548	深高速	11,500	93,495.00	0.04
685	600618	氯碱化工	9,300	93,465.00	0.04
685	601949	中国出版	20,100	93,465.00	0.04
686	600628	新世界	16,600	93,458.00	0.04
687	301262	海看股份	5,200	93,444.00	0.04
688	600279	重庆港	25,600	93,440.00	0.04
689	600121	郑州煤电	26,100	93,438.00	0.04
690	603406	天富龙	3,600	93,420.00	0.04
691	000544	中原环保	13,400	93,398.00	0.04
692	002646	天佑德酒	14,800	93,388.00	0.04
693	605099	共创草坪	2,900	93,380.00	0.04
694	603202	天有为	1,900	93,366.00	0.04
695	300904	威力传动	2,300	93,357.00	0.04
696	688196	卓越新能	2,600	93,340.00	0.04
697	600814	杭州解百	15,300	93,330.00	0.04
698	603711	香飘飘	8,400	93,324.00	0.04

699	601968	宝钢包装	23,800	93,296.00	0.04
700	000755	山西高速	22,000	93,280.00	0.04
701	001328	登康口腔	3,600	93,276.00	0.04
702	300485	赛升药业	9,800	93,198.00	0.04
703	601188	龙江交通	34,000	93,160.00	0.04
703	603122	合富中国	8,500	93,160.00	0.04
704	605108	同庆楼	8,200	93,152.00	0.04
705	605339	南侨食品	7,800	93,132.00	0.04
706	001338	永顺泰	11,100	93,129.00	0.04
707	002612	朗姿股份	8,300	93,043.00	0.04
708	605179	一鸣食品	7,400	93,018.00	0.04
709	002911	佛燃能源	9,800	93,002.00	0.04
710	603043	广州酒家	7,500	93,000.00	0.04
711	601811	新华文轩	8,500	92,990.00	0.04
712	000019	深粮控股	16,400	92,988.00	0.04
713	605077	华康股份	8,600	92,966.00	0.04
714	002930	宏川智慧	10,100	92,920.00	0.04
715	600983	惠而浦	13,400	92,862.00	0.04
715	605183	确成股份	6,300	92,862.00	0.04
716	300404	博济医药	10,600	92,856.00	0.04
717	300981	中红医疗	9,700	92,829.00	0.04
718	688228	开普云	1,200	92,808.00	0.04
719	601089	福元医药	5,700	92,796.00	0.04
720	600724	宁波富达	18,300	92,781.00	0.04
721	301137	哈焊华通	2,700	92,772.00	0.04
722	300856	科思股份	8,700	92,742.00	0.04
723	002923	润都股份	9,800	92,708.00	0.04
723	605116	奥锐特	4,900	92,708.00	0.04
724	603055	台华新材	11,900	92,701.00	0.04
725	000919	金陵药业	15,900	92,697.00	0.04
726	600335	国机汽车	19,800	92,664.00	0.04
727	605337	李子园	11,300	92,660.00	0.04
728	300741	华宝股份	7,400	92,648.00	0.04
729	688161	威高骨科	4,414	92,605.72	0.04
730	600429	三元股份	22,900	92,516.00	0.04
731	601083	锦江航运	9,300	92,442.00	0.04
732	603058	永吉股份	10,600	92,326.00	0.04
733	002462	嘉事堂	8,600	92,278.00	0.04
734	603877	太平鸟	7,800	92,274.00	0.04
735	300788	中信出版	4,100	92,127.00	0.04
736	605255	天普股份	1,400	92,106.00	0.04
737	301590	优优绿能	700	92,015.00	0.04
738	605296	神农集团	3,300	92,004.00	0.04

739	003020	立方制药	6,200	91,822.00	0.04
740	002900	哈三联	10,000	91,800.00	0.04
741	301584	建发致新	4,600	91,724.00	0.04
742	688293	奥浦迈	2,200	91,718.00	0.04
743	301211	亨迪药业	8,100	91,692.00	0.04
744	300345	华民股份	15,700	91,688.00	0.04
745	603014	威高血净	2,800	91,644.00	0.04
746	002950	奥美医疗	10,300	91,567.00	0.04
747	603057	紫燕食品	4,100	91,430.00	0.04
748	688276	百克生物	6,555	91,376.70	0.04
749	301239	普瑞眼科	3,000	91,350.00	0.04
750	002427	尤夫股份	18,100	91,224.00	0.04
751	301565	中仑新材	4,000	91,160.00	0.04
752	603325	博隆技术	1,800	91,116.00	0.04
753	002991	甘源食品	2,300	90,873.00	0.04
754	301538	骏鼎达	1,800	90,666.00	0.04
755	300584	海辰药业	2,500	90,575.00	0.04
756	301333	诺思格	1,800	90,162.00	0.04
757	002644	佛慈制药	13,200	89,892.00	0.04
758	603697	有友食品	9,200	88,228.00	0.04
759	300997	欢乐家	6,300	85,365.00	0.04
760	601882	海天精工	2,500	50,575.00	0.02
761	600184	光电股份	1,000	32,010.00	0.01
762	603950	长源东谷	300	25,329.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量 (股)	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	5,300	3,217,100.00	1.35
2	300308	中际旭创	2,400	3,048,000.00	1.28
3	300750	宁德时代	7,300	2,868,973.00	1.21
4	300059	东方财富	79,000	1,610,020.00	0.68
5	300476	胜宏科技	4,600	1,593,578.00	0.67
6	300394	天孚通信	4,700	1,422,596.00	0.60
7	300408	三环集团	8,100	1,351,890.00	0.57
8	300124	汇川技术	15,300	1,014,849.00	0.43
9	301308	江波龙	1,300	914,940.00	0.38
10	300604	长川科技	2,500	853,550.00	0.36
11	300757	罗博特科	600	371,400.00	0.16
12	300037	新宙邦	3,900	362,115.00	0.15
13	300782	卓胜微	3,300	361,614.00	0.15
14	300548	长芯博创	1,300	361,400.00	0.15
15	300442	润泽科技	4,300	357,201.00	0.15

16	300390	天华新能	3,800	355,338.00	0.15
17	300316	晶盛机电	5,800	350,320.00	0.15
18	300567	精测电子	1,100	349,360.00	0.15
19	300496	中科创达	5,600	346,024.00	0.15
20	300373	扬杰科技	2,200	345,906.00	0.15
21	300073	当升科技	7,200	345,888.00	0.15
22	300661	圣邦股份	2,400	344,352.00	0.14
23	300115	长盈精密	12,300	343,662.00	0.14
24	300620	光库科技	900	340,380.00	0.14
25	300857	协创数据	1,000	339,900.00	0.14
26	300748	金力永磁	11,000	339,350.00	0.14
27	300751	迈为股份	1,200	338,952.00	0.14
28	300433	蓝思科技	6,300	338,058.00	0.14
29	300017	网宿科技	25,700	334,357.00	0.14
30	300274	阳光电源	2,100	333,942.00	0.14
31	300136	信维通信	2,800	333,900.00	0.14
32	301358	湖南裕能	4,400	333,828.00	0.14
33	300346	南大光电	3,600	333,540.00	0.14
34	302132	中航成飞	5,700	332,424.00	0.14
35	300475	香农芯创	1,100	330,000.00	0.14
36	300054	鼎龙股份	3,100	328,507.00	0.14
37	300919	中伟新材	7,500	328,125.00	0.14
38	300418	昆仑万维	8,100	326,916.00	0.14
39	300759	康龙化成	11,300	326,909.00	0.14
40	300014	亿纬锂能	5,000	325,150.00	0.14
41	300012	华测检测	23,400	324,324.00	0.14
42	300223	北京君正	1,300	323,570.00	0.14
43	300395	菲利华	2,400	320,952.00	0.13
44	300347	泰格医药	6,600	316,800.00	0.13
45	300866	安克创新	3,000	313,500.00	0.13
46	300033	同花顺	1,300	313,300.00	0.13
47	300760	迈瑞医疗	2,300	312,409.00	0.13
48	300015	爱尔眼科	37,700	311,402.00	0.13
49	300666	江丰电子	800	294,880.00	0.12
50	688785	恒运昌	539	259,764.65	0.11
51	301666	大普微	558	258,538.14	0.11
52	688808	联讯仪器	98	155,264.34	0.07
53	688121	卓然股份	15,800	102,384.00	0.04
54	688820	盛合晶微	574	81,215.26	0.03
55	301682	宏明电子	325	52,019.50	0.02
56	688797	臻宝科技	95	44,523.65	0.02
57	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.02
58	688635	长进光子	128	39,448.32	0.02

59	001399	惠科股份	1,252	34,717.96	0.01
60	688809	强一股份	52	32,396.00	0.01
61	001257	盛龙股份	1,450	30,073.00	0.01
62	688807	优迅股份	72	28,974.96	0.01
63	688727	恒坤新材	305	22,814.00	0.01
64	603459	红板科技	246	20,742.72	0.01
65	301656	联合动力	1,193	20,555.39	0.01
66	688811	有研复材	834	20,124.42	0.01
67	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.01
68	301638	南网数字	761	18,302.05	0.01
69	688795	摩尔线程	22	15,762.78	0.01
70	301669	高特电子	546	15,506.40	0.01
71	301531	春光集团	290	14,952.40	0.01
72	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.01
73	001365	天海电子	412	12,899.72	0.01
74	001393	维通利	289	11,268.11	0.00
75	301687	新广益	140	10,889.20	0.00
76	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
77	688802	沐曦股份	12	9,939.60	0.00
78	301667	纳百川	137	9,907.84	0.00
79	001237	惠康科技	168	9,868.32	0.00
80	301683	慧谷新材	80	9,741.60	0.00
81	301680	固德电材	76	8,524.16	0.00
82	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
83	688759	必贝特	189	6,044.22	0.00
84	001233	海安集团	118	5,274.60	0.00
85	688816	易思维	89	5,081.90	0.00
86	688781	视涯科技	106	5,046.66	0.00
87	688712	北芯生命	138	4,956.96	0.00
88	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
89	001369	双欣材料	287	3,880.24	0.00
90	601112	振石股份	203	3,570.77	0.00
91	688790	昂瑞微	20	2,676.60	0.00
92	001396	誉帆科技	69	2,443.98	0.00
93	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
94	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
95	603284	林平发展	43	1,499.41	0.00

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	601678	滨化股份	7,202,708.00	3.42
2	300750	宁德时代	6,801,306.00	3.23

3	002993	奥海科技	6,796,140.40	3.23
4	688133	泰坦科技	6,673,273.59	3.17
5	300659	中孚信息	6,635,075.00	3.15
6	002727	一心堂	6,489,657.00	3.08
7	002452	长高电气	6,443,653.00	3.06
8	002556	辉隆股份	6,437,667.80	3.06
9	688381	帝奥微	6,391,325.23	3.04
10	300973	立高食品	6,210,421.00	2.95
11	000899	赣能股份	6,181,576.00	2.94
12	603896	寿仙谷	6,130,314.00	2.91
13	300308	中际旭创	6,073,135.00	2.89
14	603496	恒为科技	5,939,843.00	2.82
15	300791	仙乐健康	5,817,153.70	2.76
16	600300	维维股份	5,734,442.99	2.73
17	600388	龙净环保	5,600,798.00	2.66
18	603313	梦百合	5,573,183.70	2.65
19	002614	奥佳华	5,481,465.80	2.61
20	301270	汉仪股份	5,437,988.00	2.58
21	300314	戴维医疗	5,373,976.00	2.55
22	002004	华邦健康	5,369,388.00	2.55
23	300739	明阳电路	5,326,683.46	2.53
24	603566	普莱柯	5,320,748.00	2.53
25	000919	金陵药业	5,311,886.00	2.52
26	605305	中际联合	5,310,442.00	2.52
27	003028	振邦智能	5,251,474.80	2.50
28	300502	新易盛	5,237,313.00	2.49
29	002296	辉煌科技	5,226,472.00	2.48
30	300510	金冠股份	5,202,726.00	2.47
31	688159	有方科技	5,172,852.81	2.46
32	601599	浙文影业	5,026,533.00	2.39
33	600552	凯盛科技	5,016,289.00	2.38
34	688590	新致软件	4,994,149.81	2.37
35	603386	骏亚科技	4,992,275.00	2.37
36	603588	高能环境	4,977,218.00	2.37
37	688001	华兴源创	4,969,281.41	2.36
38	300942	易瑞生物	4,959,009.00	2.36
39	300409	道氏技术	4,926,208.00	2.34
40	002258	利尔化学	4,897,869.64	2.33
41	002016	世荣兆业	4,892,581.00	2.33
42	688298	东方生物	4,884,849.01	2.32
43	301155	海力风电	4,849,553.00	2.30
44	000990	诚志股份	4,845,296.00	2.30
45	300796	贝斯美	4,825,638.80	2.29

46	000690	宝新能源	4,820,571.13	2.29
47	300656	民德电子	4,815,585.00	2.29
48	688023	安恒信息	4,809,901.71	2.29
49	688207	格灵深瞳	4,801,331.10	2.28
50	002584	西陇科学	4,766,536.00	2.27
51	002170	芭田股份	4,722,592.00	2.24
52	300747	锐科激光	4,718,327.40	2.24
53	688410	山外山	4,709,735.15	2.24
54	688779	五矿新能	4,648,754.83	2.21
55	002398	垒知集团	4,645,538.00	2.21
56	002745	木林森	4,637,680.00	2.20
57	688327	云从科技	4,624,429.38	2.20
58	301302	华如科技	4,615,028.00	2.19
59	002454	松芝股份	4,604,590.00	2.19
60	600520	三佳科技	4,577,560.00	2.18
61	002446	盛路通信	4,559,012.90	2.17
62	300566	激智科技	4,539,415.00	2.16
63	002404	嘉欣丝绸	4,508,463.50	2.14
64	300244	迪安诊断	4,485,008.00	2.13
65	300423	昇辉科技	4,476,568.47	2.13
66	002666	德联集团	4,474,342.00	2.13
67	600738	丽尚国潮	4,463,841.00	2.12
68	300639	凯普生物	4,436,420.00	2.11
69	002895	川恒股份	4,434,454.96	2.11
70	300752	隆利科技	4,411,475.00	2.10
71	600782	新钢股份	4,405,639.00	2.09
72	600428	中远海特	4,382,272.00	2.08
73	300858	科拓生物	4,375,832.00	2.08
74	603043	广州酒家	4,364,683.00	2.07
75	300875	捷强装备	4,346,862.00	2.07
76	605507	国邦医药	4,339,811.00	2.06
77	603100	川仪股份	4,323,121.00	2.05
78	605077	华康股份	4,320,839.70	2.05
79	002321	华英农业	4,290,439.00	2.04
80	688128	中国电研	4,288,554.71	2.04
81	300381	溢多利	4,265,283.00	2.03
82	605399	晨光新材	4,261,799.00	2.03
83	300673	佩蒂股份	4,255,064.50	2.02
84	301129	瑞纳智能	4,252,001.20	2.02
85	600327	大东方	4,244,971.00	2.02
86	603628	清源股份	4,216,596.41	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	601678	滨化股份	7,194,531.00	3.42
2	600300	维维股份	6,828,947.00	3.25
3	300791	仙乐健康	6,788,862.72	3.23
4	000899	赣能股份	6,641,755.84	3.16
5	002556	辉隆股份	6,597,148.84	3.14
6	002452	长高电气	6,521,201.00	3.10
7	002727	一心堂	6,485,966.00	3.08
8	002993	奥海科技	6,471,902.00	3.08
9	603496	恒为科技	6,375,980.00	3.03
10	688133	泰坦科技	6,374,336.65	3.03
11	300656	民德电子	6,225,398.00	2.96
12	688381	帝奥微	6,190,544.63	2.94
13	300973	立高食品	6,171,927.00	2.93
14	300244	迪安诊断	6,168,542.00	2.93
15	300659	中孚信息	6,165,122.00	2.93
16	300739	明阳电路	5,920,734.70	2.81
17	002081	金螳螂	5,884,407.00	2.80
18	603896	寿仙谷	5,815,898.60	2.76
19	603628	清源股份	5,706,037.00	2.71
20	688001	华兴源创	5,695,796.91	2.71
21	300858	科拓生物	5,587,204.50	2.66
22	600388	龙净环保	5,525,602.72	2.63
23	605305	中际联合	5,512,671.50	2.62
24	688128	中国电研	5,465,497.12	2.60
25	688159	有方科技	5,458,292.03	2.59
26	002004	华邦健康	5,422,006.00	2.58
27	605319	无锡振华	5,268,921.32	2.50
28	603386	骏亚科技	5,239,512.00	2.49
29	300510	金冠股份	5,157,727.84	2.45
30	002758	浙农股份	5,155,551.00	2.45
31	603203	快克智能	5,122,126.00	2.43
32	003028	振邦智能	5,106,349.20	2.43
33	300314	戴维医疗	5,102,928.00	2.43
34	300101	振芯科技	5,098,781.00	2.42
35	603313	梦百合	5,066,831.00	2.41
36	002296	辉煌科技	5,051,298.00	2.40
37	002614	奥佳华	5,050,188.00	2.40
38	000919	金陵药业	5,035,121.70	2.39
39	603566	普莱柯	5,035,121.00	2.39
40	601599	浙文影业	5,032,579.00	2.39
41	301270	汉仪股份	5,020,835.00	2.39

42	000990	诚志股份	5,004,940.97	2.38
43	301302	华如科技	4,999,585.76	2.38
44	002454	松芝股份	4,981,863.00	2.37
45	600552	凯盛科技	4,945,698.00	2.35
46	002315	焦点科技	4,936,991.00	2.35
47	300875	捷强装备	4,935,515.00	2.35
48	688590	新致软件	4,911,341.22	2.33
49	002392	北京利尔	4,829,640.00	2.30
50	002258	利尔化学	4,801,233.00	2.28
51	603588	高能环境	4,795,013.84	2.28
52	688779	五矿新能	4,793,670.69	2.28
53	002584	西陇科学	4,749,462.00	2.26
54	000690	宝新能源	4,726,912.00	2.25
55	002170	芭田股份	4,723,319.00	2.24
56	688023	安恒信息	4,703,196.14	2.24
57	688410	山外山	4,647,606.65	2.21
58	688298	东方生物	4,637,830.52	2.20
59	301155	海力风电	4,631,798.00	2.20
60	301219	腾远钴业	4,617,546.00	2.19
61	688207	格灵深瞳	4,606,772.04	2.19
62	600520	三佳科技	4,596,187.00	2.18
63	300942	易瑞生物	4,577,250.00	2.18
64	300639	凯普生物	4,555,830.00	2.17
65	300566	激智科技	4,549,987.00	2.16
66	002016	世荣兆业	4,538,353.00	2.16
67	300747	锐科激光	4,515,912.00	2.15
68	002446	盛路通信	4,515,870.00	2.15
69	603890	春秋电子	4,514,836.00	2.15
70	301109	军信股份	4,501,011.60	2.14
71	000812	陕西金叶	4,497,423.17	2.14
72	300409	道氏技术	4,493,172.00	2.14
73	002745	木林森	4,471,991.00	2.13
74	300691	联合光电	4,447,952.20	2.11
75	300596	利安隆	4,441,086.00	2.11
76	300796	贝斯美	4,428,467.19	2.10
77	301110	青木科技	4,405,734.00	2.09
78	002897	意华股份	4,391,122.00	2.09
79	600428	中远海特	4,324,677.00	2.06
80	002560	通达股份	4,324,381.00	2.06
81	600459	贵研铂业	4,317,549.76	2.05
82	688700	东威科技	4,315,854.62	2.05
83	605077	华康股份	4,315,185.00	2.05
84	301039	中集车辆	4,314,680.00	2.05

85	301266	宇邦新材	4,286,792.50	2.04
86	300206	理邦仪器	4,283,754.00	2.04
87	300752	隆利科技	4,283,119.00	2.04
88	002895	川恒股份	4,277,915.00	2.03
89	688327	云从科技	4,260,540.20	2.03
90	603297	永新光学	4,245,378.00	2.02
91	002398	垒知集团	4,242,946.00	2.02
92	600782	新钢股份	4,237,069.00	2.01
93	600710	苏美达	4,234,005.00	2.01
94	600399	抚顺特钢	4,232,027.00	2.01
95	301221	光庭信息	4,228,499.00	2.01
96	003020	立方制药	4,221,685.20	2.01
97	301026	浩通科技	4,215,132.00	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	2,720,788,254.32
卖出股票收入（成交）总额	2,697,751,621.45

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	12,313,141.64	5.17
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,313,141.64	5.17

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019792	25 国债 19	60,000	6,062,953.97	2.55
2	019827	26 国债 01	35,000	3,522,686.71	1.48

3	019785	25 国债 13	21,000	2,126,513.51	0.89
4	019835	26 国债 09	6,000	600,987.45	0.25

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约定的备选股票库
本报告期内基金投资的前十名股票不存在超出基金合同规定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成
单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	20,650.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	20,650.56

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	517	222,946.72	105,886,321.88	91.8646	9,377,130.53	8.1354
鑫元国证 2000 指 数增强 C	4,179	11,524.29	27,796,339.10	57.7166	20,363,682.02	42.2834
合计	4,696	34,800.57	133,682,660.98	81.8014	29,740,812.55	18.1986

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	256,630.32	0.2226
	鑫元国证 2000 指数增强 C	3,783.20	0.0079
	合计	260,413.52	0.1593

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万 份）
本公司高级管理人员、基 金投资和研究部门负责人 持有本开放式基金	鑫元国证 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	65,715,435.99	87,637,122.72
本报告期基金总申购份额	79,784,423.09	62,817,089.78
减：本报告期基金总赎回份额	30,236,406.67	102,294,191.38
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	115,263,452.41	48,160,021.12

注：申购份额含红利再投、转换入份额，赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人未发生重大人事变动。

2、基金托管人：报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）不存在重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

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

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人未受到稽查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：本报告期内，基金管理人相关从业人员未受到稽查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：报告期内，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）及其该部门高级管理人员不存在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，本基金托管人的专门托管部门（即资产托管部）相关从业人员不存在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 (%)	
华泰证券	3	4,273,065,286.90	78.88	837,483.38	79.74	-
金元证券	3	1,144,140,939.39	21.12	212,762.13	20.26	-

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：新增金元证券 3 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 (%)
华泰证券	25,916,937.00	67.10	-	-	-	-
金元证券	12,709,177.00	32.90	-	-	-	-

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	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	公司网站	2026 年 1 月 22 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2026 年 1 月 22 日
3	鑫元基金管理有限公司关于旗下部	公司网站、中国证券	2026 年 1 月 24 日

	分基金所持有的停牌股票变更估值方法的公告	报、上海证券报、证券时报、证券日报	
4	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	公司网站、证券时报	2026 年 3 月 20 日
5	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
6	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 1 号）	公司网站	2026 年 3 月 31 日
7	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	公司网站	2026 年 3 月 31 日
8	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	2026 年 3 月 31 日
9	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	2026 年 3 月 31 日
10	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
11	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2026 年第一季度报告	公司网站	2026 年 4 月 22 日
12	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
13	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
14	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	2026 年 6 月 27 日
15	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2026 年第 2 号）	公司网站	2026 年 6 月 27 日
16	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	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	20260605-20260630	-	33,890,734.09	-	33,890,734.09	20.7380
	2	20260611-20260630	-	33,028,801.69	-	33,028,801.69	20.2106
	3	20260101-20260322;20260429-20260630	49,966,786.10	-	11,000,000.00	38,966,786.10	23.8441
	4	20260101-20260201	33,389,240.63	-	33,389,240.63	-	-
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

2026 年 8 月 31 日