

# 鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 30 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 2024 年 8 月 28 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 2024 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	12
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	13
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内容的真实、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	19
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>45</b>
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	45
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	54

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 .....	54
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 .....	54
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 .....	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	55
7.12 投资组合报告附注 .....	55
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>57</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	57
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>58</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>59</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	59
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 .....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	59
10.4 基金投资策略的改变 .....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	59
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 .....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	59
10.8 其他重大事件 .....	60
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>62</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 .....	62
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	62
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>63</b>
12.1 备查文件目录 .....	63
12.2 存放地点 .....	63
12.3 查阅方式 .....	63

## § 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	165,871,001.40 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	73,344,281.51 份	92,526,719.89 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	李双均
	联系电话	021-20892000 转	025-83389842
	电子邮箱	service@xyamc.com	lishuangjun@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(2024年1月1日-2024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	-10,092,614.78	-15,877,513.09
本期利润	-12,688,659.72	-19,343,742.32
加权平均基金份额本期利润	-0.1646	-0.1727
本期加权平均净值利润率	-19.20%	-20.23%
本期基金份额净值增长率	-15.01%	-15.18%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利润	-14,426,005.75	-18,466,845.54
期末可供分配基金份额利润	-0.1967	-0.1996
期末基金资产净值	58,918,275.76	74,059,874.35
期末基金份额净值	0.8033	0.8004
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	-19.67%	-19.96%

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

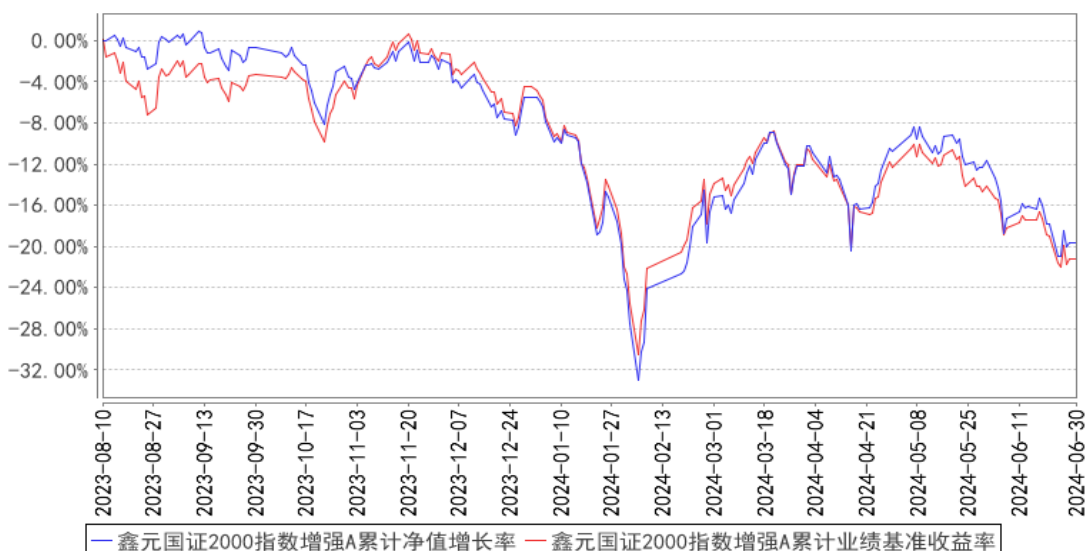
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-9.06%	1.74%	-8.18%	1.42%	-0.88%	0.32%
过去三个月	-8.54%	1.75%	-10.38%	1.53%	1.84%	0.22%
过去六个月	-15.01%	2.17%	-17.53%	1.94%	2.52%	0.23%
自基金合同生效起至今	-19.67%	1.71%	-21.21%	1.59%	1.54%	0.12%

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	-9.09%	1.73%	-8.18%	1.42%	-0.91%	0.31%
过去三个月	-8.63%	1.75%	-10.38%	1.53%	1.75%	0.22%
过去六个月	-15.18%	2.17%	-17.53%	1.94%	2.35%	0.23%
自基金合同生效起至今	-19.96%	1.71%	-21.21%	1.59%	1.25%	0.12%

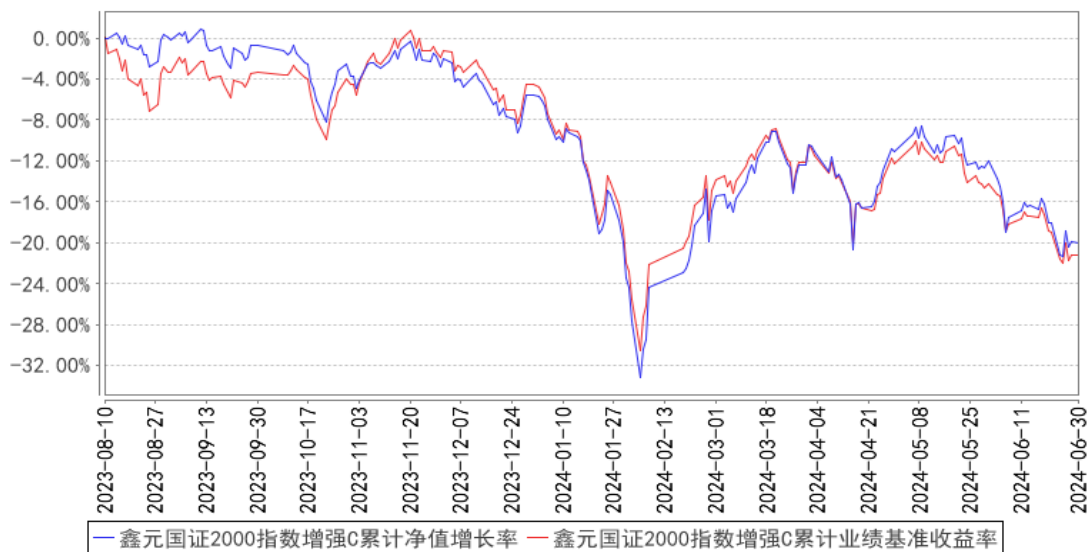
#### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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，截止 2024 年 6 月 30 日不满一年。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，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 2024 年 6 月 30 日，公司旗下管理 73 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、鑫元健康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。

#### 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	-	8 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的基金经理。
陈宇翔	本基金的基金经理助理	2023 年 8 月 10 日	-	5 年	学历：金融数学硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。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，兴银基金管理有限公司量化研究员。2022 年 10 月加入鑫元基金，历任研究员，现任基金经理助理。现任鑫元聚鑫收益增强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、鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理助

					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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

在本报告期内，基金管理人勤勉尽责地为基金份额持有人谋求利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。本基金管理人遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、本基金基金合同的规定，基金投资比例符合法律法规和基金合同的要求。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，本公司继续严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规和公司内部关于公平交易流程的各项制度规范，进一步完善境内上市股票、债券的一级市场申购和二级市场交易活动。本公司通过系统控制和人工控制等各种方式，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动的相关环节均得到公平对待。

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现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%以上权重为中证 1000 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-15.01%，同期业绩比较基准收益率为-17.53%。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-15.18%，同期业绩比较基准收益率为-17.53%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，国内方面，宏观经济复苏和居民资产负债表修复都可能是一个比较缓慢的过程，流动性宽松和长久期债券利率中枢下移都可能持续，同时需要特别关注财政发力的方向，比如央国企业的设备更新、汽车家电等耐用消费品补贴等，可能在内需领域率先企稳好转。海外方面，美联储降息的确定性在增强，但是大选年和地缘政治的不确定性，仍然给出口型企业的估值提升施加了不小的压力。产业方面，在总量经济向上空间有限的背景下，我们也将密切关注以 AI 为代表的海外科技股对国内 TMT 相关行业的映射，把握相关科技行业的轮动机会。中期来看，高分红和新成长仍然有望成为市场具有超额收益的方向，我们也将在这两个方向上结合量化选股策略进行重点配置。对国内外的宏观环境总体以应对为主，对国内经济复苏状况和相关政策措施保持密切关注。

#### 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。成员包括公司总经理、基金运营部分管领导、投研条线分管领导、交易部分管领导、督察长、固定收益部负责人、权益投资部负责人、市场研究部负责人、风险管理部负责人、法律合规部负责人、交易部负责人、基金运营部负责人等。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 2024 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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,364,320.08	1,034,956.74
结算备付金		300,040.55	-
存出保证金		233,184.00	-
交易性金融资产	6.4.7.2	128,545,270.38	229,963,650.52
其中：股票投资		119,607,857.78	217,096,669.70
基金投资		-	-
债券投资		8,937,412.60	12,866,980.82
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		89,316.98	419,031.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		133,532,131.99	231,417,639.02
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 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		313,423.19	8,706,035.52
应付管理人报酬		114,087.44	198,848.82
应付托管费		11,408.73	19,884.86
应付销售服务费		25,554.92	45,659.10
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	17.91
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	89,507.60	170,000.00
负债合计		553,981.88	9,140,446.21
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.10	165,871,001.40	235,377,009.94
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	-32,892,851.29	-13,099,817.13
净资产合计		132,978,150.11	222,277,192.81
负债和净资产总计		133,532,131.99	231,417,639.02

注：报告截止日 2024 年 06 月 30 日，基金份额总额 165,871,001.40 份，其中下属 A 类基金份额净值 0.8033 元，份额总额 73,344,281.51 份；下属 C 类基金份额净值 0.8004 元，份额总额 92,526,719.89 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-30,871,347.18
1. 利息收入		22,725.73
其中：存款利息收入	6.4.7.13	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）		-24,835,737.58
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-25,754,453.36
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	97,883.36
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	-87,654.29
股利收益	6.4.7.19	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	-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	3,938.84
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,161,054.86</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	801,342.39
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	6.4.10.2.2	80,134.20
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	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		431.86
8. 其他费用	6.4.7.23	89,507.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-32,032,402.04</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-32,032,402.04</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-32,032,402.04</b>

### 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	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
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
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：

龙艺

杨晓宇

包颖

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

鑫元国证 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、应用指南、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 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年 1 月 1 日起至 2024 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；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 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）及地方教育费附加。

#### 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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

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[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	213,749.86
等于：本金	213,626.45
加：应计利息	123.41
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	4,150,570.22
等于：本金	4,150,391.21
加：应计利息	179.01
减：坏账准备	-
合计	4,364,320.08

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 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	129,109,941.24	-	119,607,857.78	-9,502,083.46	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	8,771,427.09	135,652.60	8,937,412.60	30,332.91
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,771,427.09	135,652.60	8,937,412.60	30,332.91
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	137,881,368.33	135,652.60	128,545,270.38	-9,471,750.55	

#### 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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,005,920.00	-	-	-
其中：股指期货	2,005,920.00	-	-	-



投资				
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,005,920.00	-	-	-

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2407	IM2407	2.00	1,943,200.00	-62,720.00
合计				-62,720.00
减：可抵销期货暂收款				-62,720.00
净额				0.00

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为 0。

**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 2024 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	89,507.60
合计	89,507.60

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	96,158,222.52	96,158,222.52
本期申购	748,827.23	748,827.23
本期赎回（以“-”号填列）	-23,562,768.24	-23,562,768.24
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	73,344,281.51	73,344,281.51

金额单位：人民币元

鑫元国证 2000 指数增强 C	
项目	本期

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额 (份)	账面金额
上年度末	139,218,787.42	139,218,787.42
本期申购	14,141,486.89	14,141,486.89
本期赎回 (以“-”号填列)	-60,833,554.42	-60,833,554.42
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	92,526,719.89	92,526,719.89

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	-3,952,419.32	-1,312,942.42	-5,265,361.74
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-3,952,419.32	-1,312,942.42	-5,265,361.74
本期利润	-10,092,614.78	-2,596,044.94	-12,688,659.72
本期基金份额交易产生的变动数	2,182,252.14	1,345,763.57	3,528,015.71
其中：基金申购款	-109,358.85	-21,721.31	-131,080.16
基金赎回款	2,291,610.99	1,367,484.88	3,659,095.87
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-11,862,781.96	-2,563,223.79	-14,426,005.75

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	-5,933,722.68	-1,900,732.71	-7,834,455.39
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-5,933,722.68	-1,900,732.71	-7,834,455.39
本期利润	-15,877,513.09	-3,466,229.23	-19,343,742.32
本期基金份额交易产生的变动数	6,569,771.70	2,141,580.47	8,711,352.17
其中：基金申购款	-2,100,756.08	62,724.89	-2,038,031.19

基金赎回款	8,670,527.78	2,078,855.58	10,749,383.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,241,464.07	-3,225,381.47	-18,466,845.54

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
活期存款利息收入		7,093.34
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		6,446.01
结算备付金利息收入		-
其他		-
合计		13,539.35

#### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-25,754,453.36
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		-25,754,453.36

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
卖出股票成交总额		1,190,150,118.83
减：卖出股票成本总额		1,214,533,426.28
减：交易费用		1,371,145.91
买卖股票差价收入		-25,754,453.36

##### 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	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
债券投资收益——利息收入		80,872.60

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	17,010.76
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	97,883.36

#### 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,847,985.83
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,782,774.66
减：应计利息总额	48,143.83
减：交易费用	56.58
买卖债券差价收入	17,010.76

#### 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-87,654.29

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	908,486.71
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	908,486.71

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	-5,999,554.17
——股票投资	-6,009,552.83
——债券投资	9,998.66
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-62,720.00
——权证投资	-
——期货投资	-62,720.00
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	-6,062,274.17

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	3,938.84
合计	3,938.84

## 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
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	89,507.60

## 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
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 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 (%)
华泰证券	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 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 (%)
华泰证券	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 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 (%)
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 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、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，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和市场信息服务等。

## 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	
	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	801,342.39	
其中：应支付销售机构的客户维护费	347,595.93	
应支付基金管理人的净管理费	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	
	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	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		
	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	鑫元国证 2000 指数增强	合计
	A	C	
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自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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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	30.1239	49,966,786.10	21.2284

份额单位：份

鑫元国证 2000 指数增强 C

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
华泰证券	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：本基金本报告期间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（2024 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。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关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，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。

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。本基金根据存款存放银行的资质，评估并控制银行存款的信用风险。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 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	8,937,412.60	12,866,980.82

合计	8,937,412.60	12,866,980.82
----	--------------	---------------

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。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 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本基金的组合资产持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标，对本基金的流动

性风险进行持续的监测和分析。同时，本基金的基金管理人在基金运作周期内的每个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，控制相关的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的 10%。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末(2024 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券”。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投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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 2024年6月30 日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	4,364,017.66	0.00	0.00	0.00	0.00	302.42	4,364,320.08
结算备付金	300,040.55	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	300,040.55
存出保证金	233,184.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	233,184.00
交易性金融资产	8,801,760.00	0.00	0.00	0.00	0.00	119,743,510.38	128,545,270.38
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	89,316.98	89,316.98
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	13,699,002.21	0.00	0.00	0.00	0.00	119,833,129.78	133,532,131.99
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	313,423.19	313,423.19
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	114,087.44	114,087.44
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	11,408.73	11,408.73
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	25,554.92	25,554.92
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	89,507.60	89,507.60
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	553,981.88	553,981.88
利率敏感度缺口	13,699,002.21	0.00	0.00	0.00	0.00	119,279,147.90	132,978,150.11
上年度末 2023 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	1,034,644.92	0.00	0.00	0.00	0.00	311.82	1,034,956.74
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	0.00	0.00	12,774,400.00	0.00	0.00	217,189,250.52	229,963,650.52
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	419,031.76	419,031.76
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	1,034,644.92	0.00	12,774,400.00	0.00	0.00	217,608,594.10	231,417,639.02
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	8,706,035.52	8,706,035.52
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	198,848.82	198,848.82
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	19,884.86	19,884.86
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	45,659.10	45,659.10



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	17.91	17.91
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	9,140,446.21	9,140,446.21
利率敏感度缺口	1,034,644.92	0.00	12,774,400.00	0.00	0.00	208,468,147.89	222,277,192.81

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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点	1,651.49	17,977.71
	2. 市场利率上升 25 个基点	-1,650.88	-17,927.60

#### 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。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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，基金保留的现金或者投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的 5%。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023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	119,607,857.78	89.95	217,096,669.70	97.67
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	119,607,857.78	89.95	217,096,669.70	97.67

#### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月31日）
	沪深 300 指数上升 1%	1,469,665.96	1,745,176.93
	沪深 300 指数下降 1%	-1,469,665.96	-1,745,176.93

## 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	119,607,857.78	217,096,669.70
第二层次	8,937,412.60	12,866,980.82
第三层次	-	-
合计	128,545,270.38	229,963,650.52

#### 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。

#### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2024 年 8 月 23 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	119,607,857.78	89.57
	其中：股票	119,607,857.78	89.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	8,937,412.60	6.69
	其中：债券	8,937,412.60	6.69
	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	4,664,360.63	3.49
8	其他各项资产	322,500.98	0.24
9	合计	133,532,131.99	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	881,093.00	0.66
B	采矿业	1,815,360.00	1.37
C	制造业	82,290,998.90	61.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,220,839.20	3.17
E	建筑业	1,742,577.00	1.31
F	批发和零售业	2,452,312.00	1.84
G	交通运输、仓储和邮政业	918,681.00	0.69
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,445,113.48	8.61
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,819,278.00	1.37
L	租赁和商务服务业	1,660,511.00	1.25
M	科学研究和技术	1,126,812.00	0.85

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	1,084,720.00	0.82
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	1,777,442.00	1.34
S	综合	-	-
	合计	113,235,737.58	85.15

### 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	5,766,960.20	4.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	605,160.00	0.46
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,372,120.20	4.79

### 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	603906	龙蟠科技	119,900	934,021.00	0.70
2	603103	横店影视	65,600	907,904.00	0.68
3	300409	道氏技术	89,900	769,544.00	0.58
4	300369	绿盟科技	147,700	754,747.00	0.57
5	300492	华图山鼎	7,700	725,340.00	0.55
6	300439	美康生物	78,500	719,060.00	0.54
7	300659	中孚信息	55,100	714,647.00	0.54
8	300657	弘信电子	46,600	699,932.00	0.53
9	002036	联创电子	102,600	692,550.00	0.52
10	300441	鲍斯股份	114,100	676,613.00	0.51
11	300504	天邑股份	55,400	675,326.00	0.51
12	300587	天铁股份	165,400	668,216.00	0.50
13	603618	杭电股份	152,300	667,074.00	0.50
14	002878	元隆雅图	52,700	662,439.00	0.50
15	600990	四创电子	37,600	659,880.00	0.50
16	002106	莱宝高科	60,500	659,450.00	0.50
17	603489	八方股份	24,440	659,391.20	0.50
18	002876	三利谱	27,300	658,476.00	0.50
19	300307	慈星股份	109,800	653,310.00	0.49
20	300145	中金环境	257,100	642,750.00	0.48
21	688022	瀚川智能	46,600	638,886.00	0.48
22	002083	孚日股份	150,600	637,038.00	0.48
23	002534	西子洁能	63,600	636,636.00	0.48
24	002975	博杰股份	21,000	627,480.00	0.47
25	300607	拓斯达	45,700	622,434.00	0.47
26	002376	新北洋	113,700	612,843.00	0.46
27	300981	中红医疗	63,500	607,695.00	0.46
28	300985	致远新能	37,800	605,556.00	0.46
29	000524	岭南控股	75,000	604,500.00	0.45
30	300005	探路者	120,200	602,202.00	0.45
31	002146	荣盛发展	402,000	598,980.00	0.45
32	300578	会畅通讯	40,400	597,920.00	0.45
33	603348	文灿股份	21,500	595,335.00	0.45
34	000931	中关村	168,000	593,040.00	0.45
35	300841	康华生物	11,600	587,424.00	0.44
36	300323	华灿光电	135,000	587,250.00	0.44
37	002946	新乳业	67,000	586,920.00	0.44
38	002212	天融信	120,400	586,348.00	0.44
39	002741	光华科技	65,200	585,496.00	0.44

40	300113	顺网科技	57,000	583,680.00	0.44
41	300565	科信技术	57,900	581,895.00	0.44
42	601609	金田股份	102,700	581,282.00	0.44
43	600301	华锡有色	28,600	578,292.00	0.43
44	300048	合康新能	124,900	578,287.00	0.43
45	002140	东华科技	74,600	578,150.00	0.43
46	603112	华翔股份	54,900	576,999.00	0.43
47	603808	歌力思	90,900	575,397.00	0.43
48	688148	芳源股份	136,500	574,665.00	0.43
49	300194	福安药业	153,500	574,090.00	0.43
50	300396	迪瑞医疗	28,200	572,742.00	0.43
51	688158	优刻得	55,800	570,834.00	0.43
52	002111	威海广泰	54,700	569,974.00	0.43
53	002838	道恩股份	62,700	568,062.00	0.43
54	300318	博晖创新	116,300	567,544.00	0.43
55	600429	三元股份	152,100	567,333.00	0.43
56	002845	同兴达	42,600	563,172.00	0.42
57	600105	永鼎股份	151,200	562,464.00	0.42
58	300687	赛意信息	40,400	562,368.00	0.42
59	300233	金城医药	37,600	560,992.00	0.42
60	603590	康辰药业	21,900	559,326.00	0.42
61	300011	鼎汉技术	111,400	555,886.00	0.42
62	603990	麦迪科技	63,800	555,698.00	0.42
63	002215	诺普信	74,500	555,025.00	0.42
64	300436	广生堂	35,200	552,992.00	0.42
65	688798	艾为电子	9,700	549,214.00	0.41
66	002082	万邦德	129,600	545,616.00	0.41
67	300490	华自科技	75,700	542,012.00	0.41
68	300566	激智科技	38,600	540,014.00	0.41
69	002980	华盛昌	24,600	538,494.00	0.40
70	300072	海新能科	299,000	538,200.00	0.40
71	300857	协创数据	9,400	535,800.00	0.40
72	300379	东方通	66,300	535,704.00	0.40
73	002955	鸿合科技	22,900	535,402.00	0.40
74	600787	中储股份	111,300	535,353.00	0.40
75	000727	冠捷科技	258,100	531,686.00	0.40
76	300972	万辰集团	25,100	530,363.00	0.40
77	000534	万泽股份	53,300	529,269.00	0.40
78	002292	奥飞娱乐	88,500	529,230.00	0.40
79	603520	司太立	55,300	527,562.00	0.40
80	002583	海能达	129,600	527,472.00	0.40
81	300428	立中集团	28,300	526,097.00	0.40
82	300978	东箭科技	56,900	525,187.00	0.39



83	600391	航发科技	34,000	518,500.00	0.39
84	601566	九牧王	61,300	516,146.00	0.39
85	603800	道森股份	25,800	516,000.00	0.39
86	300091	金通灵	440,600	515,502.00	0.39
87	300679	电连技术	12,700	510,921.00	0.38
88	300986	志特新材	75,400	510,458.00	0.38
89	688313	仕佳光子	53,600	510,272.00	0.38
90	688183	生益电子	26,200	507,756.00	0.38
91	000045	深纺织 A	63,100	506,062.00	0.38
92	603186	华正新材	21,100	501,758.00	0.38
93	300031	宝通科技	34,900	501,513.00	0.38
94	603595	东尼电子	24,300	500,337.00	0.38
95	300378	鼎捷软件	30,700	499,489.00	0.38
96	300134	大富科技	72,700	495,814.00	0.37
97	002437	誉衡药业	290,900	494,530.00	0.37
98	002988	豪美新材	32,200	494,270.00	0.37
99	000544	中原环保	62,000	487,940.00	0.37
100	300709	精研科技	19,200	485,376.00	0.37
101	300683	海特生物	22,900	484,564.00	0.36
102	000501	武商集团	72,600	484,242.00	0.36
103	600433	冠豪高新	180,500	478,325.00	0.36
104	002765	蓝黛科技	101,100	475,170.00	0.36
105	002933	新兴装备	20,700	474,237.00	0.36
106	300331	苏大维格	29,300	471,144.00	0.35
107	300752	隆利科技	34,600	469,868.00	0.35
108	301051	信濠光电	17,900	469,517.00	0.35
109	600810	神马股份	75,700	469,340.00	0.35
110	002488	金固股份	106,300	466,657.00	0.35
111	300170	汉得信息	75,800	465,412.00	0.35
112	002646	天佑德酒	45,460	465,055.80	0.35
113	603053	成都燃气	48,000	463,680.00	0.35
114	002237	恒邦股份	40,200	462,702.00	0.35
115	000065	北方国际	44,000	456,280.00	0.34
116	002911	佛燃能源	49,780	454,989.20	0.34
117	300049	福瑞股份	9,000	453,060.00	0.34
118	603727	博迈科	34,300	451,388.00	0.34
119	000923	河钢资源	26,200	451,164.00	0.34
120	002768	国恩股份	24,100	450,670.00	0.34
121	300291	百纳千成	105,600	449,856.00	0.34
122	601616	广电电气	154,500	449,595.00	0.34
123	300596	利安隆	16,500	447,645.00	0.34
124	300737	科顺股份	103,300	444,190.00	0.33
125	601700	风范股份	100,800	442,512.00	0.33

126	605007	五洲特纸	35,000	442,050.00	0.33
127	600618	氯碱化工	50,300	441,634.00	0.33
128	000797	中国武夷	189,500	441,535.00	0.33
129	688138	清溢光电	20,500	440,750.00	0.33
130	000600	建投能源	69,800	439,740.00	0.33
131	002449	国星光电	61,500	437,880.00	0.33
132	605068	明新旭腾	33,100	436,258.00	0.33
133	603113	金能科技	79,300	433,771.00	0.33
134	301071	力量钻石	15,600	432,276.00	0.33
135	300463	迈克生物	37,800	430,164.00	0.32
136	603567	珍宝岛	40,800	429,624.00	0.32
137	300772	运达股份	44,700	429,120.00	0.32
138	002454	松芝股份	76,300	426,517.00	0.32
139	002046	国机精工	41,900	426,123.00	0.32
140	002061	浙江交科	116,300	424,495.00	0.32
141	688088	虹软科技	14,700	424,242.00	0.32
142	600903	贵州燃气	67,800	423,072.00	0.32
143	000543	皖能电力	47,800	423,030.00	0.32
144	603239	浙江仙通	30,800	422,268.00	0.32
145	600966	博汇纸业	88,000	420,640.00	0.32
146	300426	唐德影视	61,900	419,682.00	0.32
147	002073	软控股份	56,700	419,013.00	0.32
148	000407	胜利股份	160,300	418,383.00	0.31
149	300790	宇瞳光学	30,800	415,800.00	0.31
150	000030	富奥股份	84,300	413,913.00	0.31
151	300802	矩子科技	26,100	411,597.00	0.31
152	688365	光云科技	68,100	409,962.00	0.31
153	603393	新天然气	11,800	409,932.00	0.31
154	002093	国脉科技	67,000	406,690.00	0.31
155	002688	金河生物	111,700	405,471.00	0.30
156	603367	辰欣药业	28,900	402,866.00	0.30
157	300384	三联虹普	30,600	401,472.00	0.30
158	600366	宁波韵升	76,600	399,852.00	0.30
159	300940	南极光	31,300	398,762.00	0.30
160	000059	华锦股份	94,900	397,631.00	0.30
161	688311	盟升电子	19,400	397,506.00	0.30
162	002935	天奥电子	32,880	397,190.40	0.30
163	002139	拓邦股份	37,400	397,188.00	0.30
164	600184	光电股份	46,600	396,566.00	0.30
165	603711	香飘飘	28,600	396,110.00	0.30
166	600067	冠城大通	225,100	393,925.00	0.30
167	000788	北大医药	78,900	393,711.00	0.30
168	300662	科锐国际	24,400	393,572.00	0.30

169	600458	时代新材	38,600	389,860.00	0.29
170	300755	华致酒行	28,500	389,310.00	0.29
171	688369	致远互联	24,700	388,531.00	0.29
172	300348	长亮科技	56,800	387,376.00	0.29
173	000926	福星股份	121,400	384,838.00	0.29
174	300453	三鑫医疗	60,200	384,678.00	0.29
175	300102	乾照光电	59,900	384,558.00	0.29
176	000920	沃顿科技	52,400	384,092.00	0.29
177	600279	重庆港	105,600	383,328.00	0.29
178	300241	瑞丰光电	92,900	380,890.00	0.29
179	300878	维康药业	26,100	379,494.00	0.29
180	300349	金卡智能	31,800	379,056.00	0.29
181	600628	新世界	69,900	378,858.00	0.28
182	002375	亚厦股份	116,500	378,625.00	0.28
183	603355	莱克电气	17,500	378,000.00	0.28
184	600835	上海机电	32,800	377,528.00	0.28
185	600475	华光环能	43,300	377,143.00	0.28
186	002462	嘉事堂	34,300	375,242.00	0.28
187	002026	山东威达	45,200	375,160.00	0.28
188	300266	兴源环境	323,400	375,144.00	0.28
188	603612	索通发展	29,400	375,144.00	0.28
190	603859	能科科技	17,824	374,660.48	0.28
191	688007	光峰科技	23,243	374,212.30	0.28
192	603867	新化股份	16,000	373,280.00	0.28
193	600645	中源协和	23,100	371,910.00	0.28
194	002543	万和电气	37,000	368,520.00	0.28
195	000905	厦门港务	65,200	368,380.00	0.28
196	300250	初灵信息	33,300	362,970.00	0.27
197	600308	华泰股份	115,400	362,356.00	0.27
198	600846	同济科技	52,900	361,307.00	0.27
199	300768	迪普科技	30,400	360,240.00	0.27
200	000795	英洛华	65,000	360,100.00	0.27
201	603803	瑞斯康达	50,600	359,260.00	0.27
202	300435	中泰股份	30,500	358,985.00	0.27
203	300397	天和防务	39,000	358,800.00	0.27
204	301030	仕净科技	14,560	358,467.20	0.27
205	688127	蓝特光学	19,400	356,766.00	0.27
206	605376	博迁新材	15,800	356,606.00	0.27
207	002101	广东鸿图	33,700	354,861.00	0.27
208	002302	西部建设	68,000	353,600.00	0.27
209	000969	安泰科技	44,500	352,885.00	0.27
210	600237	铜峰电子	67,500	352,350.00	0.26
211	002567	唐人神	65,600	351,616.00	0.26

212	000505	京粮控股	64,600	351,424.00	0.26
213	600997	开滦股份	51,200	351,232.00	0.26
214	300188	国投智能	31,600	351,076.00	0.26
215	000735	罗牛山	81,000	350,730.00	0.26
216	000551	创元科技	39,800	347,454.00	0.26
217	300559	佳发教育	36,000	344,520.00	0.26
218	603158	腾龙股份	48,700	342,848.00	0.26
219	002011	盾安环境	34,800	342,084.00	0.26
220	002479	富春环保	96,900	341,088.00	0.26
221	300180	华峰超纤	96,600	340,998.00	0.26
222	002907	华森制药	27,000	340,740.00	0.26
223	688123	聚辰股份	5,600	340,648.00	0.26
224	000700	模塑科技	64,800	340,200.00	0.26
225	603630	拉芳家化	32,300	339,473.00	0.26
226	688595	芯海科技	11,300	339,000.00	0.25
227	600776	东方通信	34,400	338,152.00	0.25
228	605365	立达信	21,300	338,031.00	0.25
229	300582	英飞特	39,400	337,264.00	0.25
230	603081	大丰实业	36,100	336,452.00	0.25
231	002852	道道全	46,700	336,240.00	0.25
232	601101	昊华能源	36,400	334,516.00	0.25
233	002573	清新环境	85,900	332,433.00	0.25
234	600882	妙可蓝多	26,600	331,702.00	0.25
235	300522	世名科技	30,000	331,500.00	0.25
236	002022	科华生物	58,600	331,090.00	0.25
237	002150	通润装备	26,800	327,764.00	0.25
238	688588	凌志软件	47,800	327,430.00	0.25
239	688033	天宜上佳	49	294.00	0.00

### 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	000639	西王食品	346,400	824,432.00	0.62
2	002121	科陆电子	195,900	742,461.00	0.56
3	603681	永冠新材	56,800	724,200.00	0.54
4	002661	克明食品	88,800	663,336.00	0.50
5	002362	汉王科技	37,000	616,050.00	0.46
6	000601	韶能股份	164,000	605,160.00	0.46
7	603676	卫信康	75,000	600,750.00	0.45
8	300132	青松股份	154,100	536,268.00	0.40
9	603680	今创集团	81,092	535,207.20	0.40
10	600590	泰豪科技	137,600	524,256.00	0.39

## 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	300409	道氏技术	4,571,221.00	2.06
2	300441	鲍斯股份	4,179,583.00	1.88
3	688088	虹软科技	3,587,253.46	1.61
4	000639	西王食品	3,575,699.00	1.61
5	000901	航天科技	3,573,559.00	1.61
6	600459	贵研铂业	3,512,102.00	1.58
7	601107	四川成渝	3,491,278.00	1.57
8	603699	纽威股份	3,462,779.00	1.56
9	603680	今创集团	3,455,567.08	1.55
10	603590	康辰药业	3,436,824.00	1.55
11	300566	激智科技	3,388,992.00	1.52
12	300709	精研科技	3,347,559.60	1.51
13	000990	诚志股份	3,340,202.00	1.50
14	300132	青松股份	3,329,535.00	1.50
15	603583	捷昌驱动	3,314,405.00	1.49
16	603567	珍宝岛	3,297,577.00	1.48
17	000682	东方电子	3,277,674.00	1.47
18	603227	雪峰科技	3,265,182.87	1.47
19	300490	华自科技	3,225,587.00	1.45
20	002073	软控股份	3,204,714.00	1.44

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	603916	苏博特	5,475,865.00	2.46
2	603507	振江股份	4,730,173.00	2.13
3	300233	金城医药	4,506,058.20	2.03
4	300616	尚品宅配	4,342,600.00	1.95
5	688106	金宏气体	4,271,627.53	1.92
6	000910	大亚圣象	4,250,796.00	1.91
7	000900	现代投资	4,248,793.50	1.91
8	600876	凯盛新能	4,123,757.50	1.86
9	300596	利安隆	4,024,103.00	1.81
10	300870	欧陆通	3,979,823.18	1.79
11	603566	普莱柯	3,945,725.00	1.78
12	002913	奥士康	3,936,322.00	1.77

13	300145	中金环境	3,914,418.00	1.76
14	688222	成都先导	3,869,192.73	1.74
15	002641	公元股份	3,867,250.00	1.74
16	605116	奥锐特	3,787,029.00	1.70
17	300900	广联航空	3,764,128.95	1.69
18	300791	仙乐健康	3,736,189.81	1.68
19	603355	莱克电气	3,704,892.15	1.67
20	688003	天准科技	3,636,342.78	1.64

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	1,123,054,167.19
卖出股票收入（成交）总额	1,190,150,118.83

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	8,937,412.60	6.72
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	8,937,412.60	6.72

#### 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	019709	23 国债 16	88,000	8,937,412.60	6.72

#### 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	233,184.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	89,316.98
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	322,500.98

### 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的情况。

#### 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	587	124,947.67	49,966,786.10	68.1264	23,377,495.41	31.8736
鑫元国证 2000 指数增强 C	2,260	40,941.03	1,461,955.35	1.58	91,064,764.54	98.42
合计	2,847	58,261.68	51,428,741.45	31.0053	114,442,259.95	68.9947

### 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	130,761.01	0.1783
	鑫元国证 2000 指数增强 C	608,181.81	0.6573
	合计	738,942.82	0.4455

### 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	10~50
	合计	10~50
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	96,158,222.52	139,218,787.42
本报告期基金总申购份额	748,827.23	14,141,486.89
减：本报告期基金总赎回份额	23,562,768.24	60,833,554.42
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	73,344,281.51	92,526,719.89

## § 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 2024 年 5 月 30 日起张丽洁女士不再担任公司总经理、财务负责人；自 2024 年 5 月 31 日起，公司董事长龙艺女士代为履行公司总经理、财务负责人职责。

2、基金托管人：2024 年 3 月 26 日，本基金托管人发布公告，专门基金托管部门联席负责人冯伟到龄退休，变更后的部门负责人为卢小群。

### 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	2,313,204,286.02	100.00	627,866.02	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	5,599,978.00	100.00	97,100,000.00	100.00	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	公司网站	2024 年 1 月 22 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2023 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	2024 年 1 月 22 日
3	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	公司网站	2024 年 3 月 30 日
4	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2023 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2024 年 3 月 30 日
5	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	公司网站	2024 年 4 月 22 日
6	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金	公司网站、中国证券报、	2024 年 4 月 22 日

	2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报、证券时报、 证券日报	
7	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	2024 年 6 月 1 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	2024 年 6 月 29 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	2024 年 6 月 29 日
10	鑫元国证 2000 指数增强型证券投资 基金更新招募说明书(2024 年第 1 号)	公司网站	2024 年 6 月 29 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	20240101-20240630	49,966,786.10	-	-	49,966,786.10	30.1239
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

2024 年 8 月 30 日