

鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资  
基金  
2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 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 3 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。本年度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 2026 年 3 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。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况</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
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	10
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>11</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	11
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 .....	13
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 .....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	16
4.9 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 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>17</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	17
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 .....	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 .....	17
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>18</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	18
6.2 审计报告的基本内容 .....	18
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>20</b>
7.1 资产负债表 .....	20
7.2 利润表 .....	21
7.3 净资产变动表 .....	22
7.4 报表附注 .....	24
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>59</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	59
8.3 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 .....	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	107
8.6 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 .....	107
8.7 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 .....	107
8.8 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 .....	107
8.9 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 .....	107
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	107
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	107
8.12 投资组合报告附注 .....	108
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>109</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	109
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	109
9.3 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 .....	109
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况 .....	110
9.5 发起式基金发起资金持有份额情况 .....	110
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>111</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>112</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	112
11.2 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 .....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	112
11.4 基金投资策略的改变 .....	112
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	112
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	112
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	113
11.8 其他重大事件 .....	114
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>116</b>
12.1 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 .....	116
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	116
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>117</b>
13.1 备查文件目录 .....	117
13.2 存放地点 .....	117
13.3 查阅方式 .....	117

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金	
基金简称	鑫元中证 1000 指数增强发起式	
基金主代码	017190	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 11 月 28 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	206,219,552.55 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
下属分级基金的交易代码	017190	017191
报告期末下属分级基金的份额总额	114,332,736.99 份	91,886,815.56 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，在力求对中证 1000 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	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。 本基金可投资港股通标的股票，需承担港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	鑫元基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	李晓燕
	联系电话	021-20892000 转
	电子邮箱	service@xyamc.com
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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.xyamc.com">http://www.xyamc.com</a>
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
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、基金净值表现及利润分配情况

#### 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	2025 年		2024 年		2023 年	
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
	本期已实现收益	13,787,271.33	6,987,462.31	2,667,952.06	-1,062,820.81	-611,077.09
本期利润	17,036,765.15	8,120,719.91	1,286,232.52	-1,799,879.99	-353,312.18	-1,300,478.80
加权平均基金份额本期利润	0.2792	0.1811	0.0365	-0.0682	-0.0111	-0.0319
本期加权平均净值利润率	22.70%	14.40%	3.91%	-7.44%	-1.08%	-3.11%
本期基金份额净值增长率	26.71%	26.19%	9.16%	8.72%	-2.62%	-3.01%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	32,806,981.21	24,884,831.76	2,243,727.94	931,018.94	-1,102,961.41	-1,361,035.37
期末可供分配基金份额利润	0.2869	0.2708	0.0579	0.0491	-0.0251	-0.0294
期末基金资产净值	154,166,092.67	122,360,172.44	41,231,864.42	20,028,146.76	42,794,327.51	44,931,564.64
期末基金份额净值	1.3484	1.3316	1.0642	1.0552	0.9749	0.9706
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	34.84%	33.16%	6.42%	5.52%	-2.51%	-2.94%

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

鑫元中证 1000 指数增强发起式 A

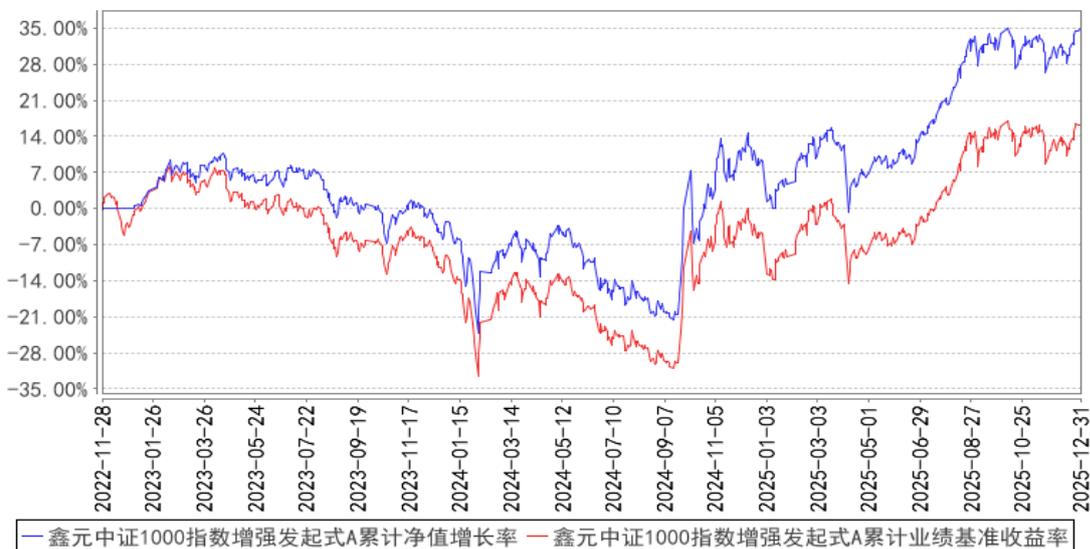
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.75%	0.95%	0.28%	1.07%	0.47%	-0.12%
过去六个月	17.81%	0.92%	18.49%	1.06%	-0.68%	-0.14%
过去一年	26.71%	1.20%	26.12%	1.32%	0.59%	-0.12%
过去三年	34.69%	1.41%	20.34%	1.48%	14.35%	-0.07%
自基金合同生效起至今	34.84%	1.38%	16.30%	1.47%	18.54%	-0.09%

鑫元中证 1000 指数增强发起式 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	0.65%	0.95%	0.28%	1.07%	0.37%	-0.12%
过去六个月	17.56%	0.92%	18.49%	1.06%	-0.93%	-0.14%
过去一年	26.19%	1.20%	26.12%	1.32%	0.07%	-0.12%
过去三年	33.07%	1.41%	20.34%	1.48%	12.73%	-0.07%
自基金合同生效起至今	33.16%	1.38%	16.30%	1.47%	16.86%	-0.09%

### 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

鑫元中证1000指数增强发起式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



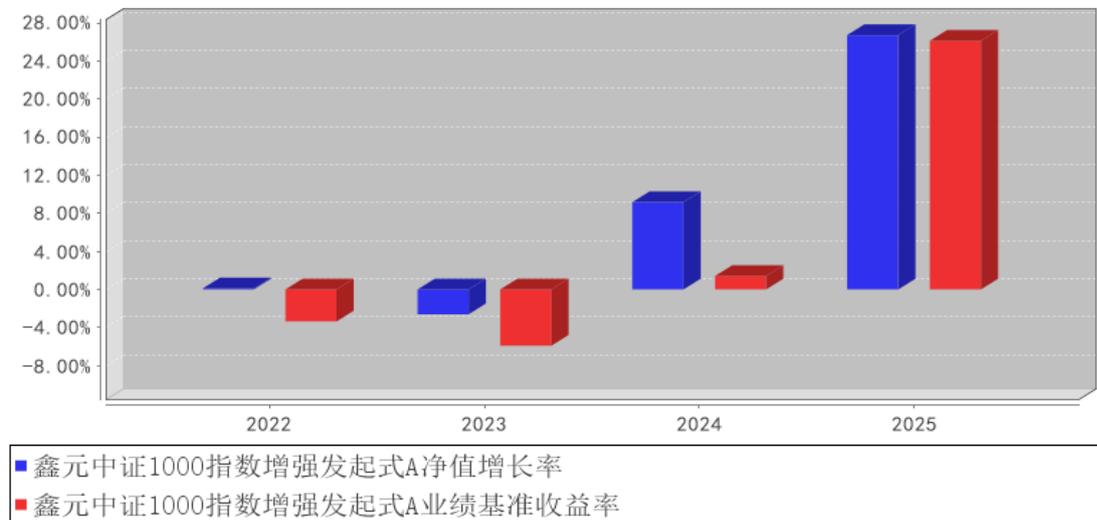
鑫元中证1000指数增强发起式C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



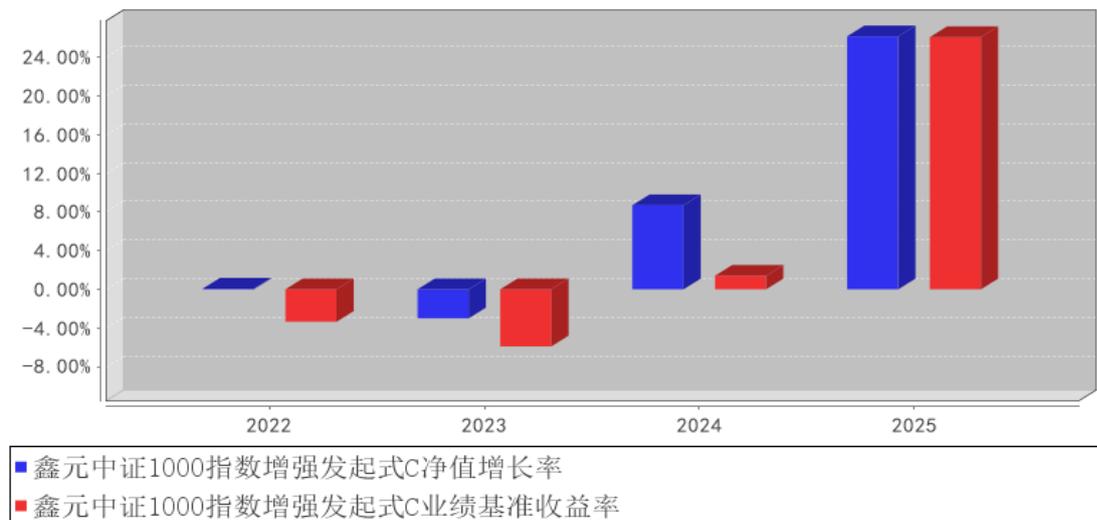
注：本基金的合同生效日为 2022 年 11 月 28 日。根据基金合同约定，本基金建仓期为 6 个月，建仓期结束时本基金各项资产配置比例符合合同约定。

### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

鑫元中证1000指数增强发起式A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



鑫元中证1000指数增强发起式C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：合同生效当年的本基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年未实施利润分配。

## § 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	2022年11月28日	-	10年	学历：工学博士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任申万菱信基金管理有限公司助理金融工程师、太平基金管理有限公司量化分析师、华宸未来基金管理有限公司投资经理。2021年6月加入鑫元基金，历任权益投资经理，现任基金经理。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元中证1000指数增强型发起式证券投资基金、鑫元国证2000指数增强型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利50指数型证券投资基金、鑫元中证800红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、鑫元中证A100指数型证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元创业板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元中证800自由现金流指数型证券投资基金、鑫元诚鑫添益债券型证券投资基金、鑫元锦鑫回报混合型证券投资基金、鑫元中证800红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的基金

					经理。
方仁杰	本基金的基金经理助理	2025 年 3 月 17 日	-	7 年	学历：金融数学与金融工程硕士研究生。相关业务资格：证券投资基金从业资格。历任嘉合基金管理有限公司分析师，山西证券股份有限公司研究员，山证（上海）资产管理有限公司研究员。2025 年 1 月加入鑫元基金管理有限公司，现任基金经理助理。现任鑫元鑫趋势灵活配置混合型证券投资基金、鑫元浩鑫增强债券型证券投资基金、鑫元华证沪深港红利 50 指数型证券投资基金、鑫元致远量化选股混合型证券投资基金、鑫元中证 800 红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、鑫元中证港股通创新药指数型发起式证券投资基金、鑫元中证 A100 指数型证券投资基金、鑫元上证科创板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元创业板人工智能指数型发起式证券投资基金、鑫元中证 800 自由现金流指数型证券投资基金、鑫元诚鑫添益债券型证券投资基金、鑫元锦鑫回报混合型证券投资基金、鑫元上证科创板综合价格指数增强型证券投资基金的基金经理助理。
陈宇翔	本基金的基金经理助理	2023 年 5 月 26 日	2025 年 3 月 21 日	2 年	金融数学硕士，历任中石化森美（福建）石油有限公司投资管理岗，华福证券管理培训生，兴银基金管理有限责任公司量化研究员。2022 年 10 月加入鑫元基金，历任研究员、基金经理助理，现任投资经理。

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

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

3. 证券从业的含义遵从中国证监会及行业协会相关规定。

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

注：本报告期末本基金的基金经理无兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.1.4 基金经理薪酬机制

本期报告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 公平交易制度和控制方法

本公司按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法律法规，制定并不断完善公司内部关于公平交易管理的各项制度和要求，规范公司所管理的所有投资组合的股票、债券等投资品种的投资管理活动，同时涵盖授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，以确保本公司管理的不同投资组合均得到公平对待。

在研究工作层面，公司已建立客观的研究方法，严禁利用内幕信息作为投资依据，各投资组合享有公平的投资决策机会。在投资决策层面，公司执行自上而下的分级投资权限管理体系，依次为投资决策委员会、投资分管领导、投资组合经理，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和投资分管领导等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行不合理干预。投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易执行层面，公司建立集中交易制度，执行公平交易分配。不同投资组合下达同一证券的同向交易指令时，按照“价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡”的原则在各投资组合间公平分配交易机会；对于银行间市场投资活动，通过交易对手库控制和交易部询价机制，严格防范交易对手风险并审查价格公允性；对于一级市场申购投资行为，遵循价格优先、比例分配的原则，根据事前独立申报的价格和数量对交易结果进行公平分配。在事后分析层面，公司分别于每季度和每年度对公司管理的不同投资组合的收益率差异及不同时间窗下同向交易的交易价差进行分析，并留存报告备查。

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司整体公平交易制度执行情况良好，通过对不同投资组合之间同向交易和反向交易的交易价格和交易时机进行监控分析，未发现违反公平交易要求的情况。

#### 4.3.3 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

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 2 次，均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

本报告期内鑫元中证 1000 指数增强发起式 A 的基金份额净值增长率为 26.71%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。本报告期内鑫元中证 1000 指数增强发起式 C 的基金份额净值增长率为 26.19%，同期业绩比较基准收益率为 26.12%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

权益市场自 2024 年 9 月底以来走过了估值修复和估值扩张两个阶段，沪深 300、中证 500 和中证 1000 等宽基指数市净率已经超过近五年历史分位数 90% 水平，估值进一步扩张的压力增大。在当前阶段，精选个股的重要性愈发突出，一方面是绝对低估但基本面有所改善的股票，另一方面是估值相对合理但业绩持续且确定性较强的个股，这两类股票将是 2026 年权益市场获取超额收益的关键。

分行业板块来看。科技板块将迎来业绩兑现压力，除了业绩确定性较强的海外算力，国产算

力、半导体设备材料、创新药及商业航天等板块若能实现订单加速落地与现金流加速上涨，这些板块有望从主题走向核心资产。周期行业将迎来供需再平衡，在 PPI 温和回升、全球再工业化和供给端持续出清的推动下，铜、铝等关键资源品及化工龙头盈利拐点显现。制造业永远不缺少投资机会，尤其是电力设备和智能汽车相关产业链凭借技术突破与全球竞争力，将成为新质生产力的主阵地。消费板块虽具备防御价值，但整体弹性有限，投资需精耕细作，从估值修复和新消费细分赛道两个角度着手挖掘个股机会。

全年维度看，主题性机会大概会减少，回归盈利本质，聚焦基本面有望是今年投资的主旋律。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人在监察稽核工作中一方面将坚持投资者利益至上、坚持违法违规零容忍、严防触犯三条底线作为公司的最高经营宗旨和全体员工的根本行为准则，为全面风险管理、全程风险管理与全员风险管理相关内部控制管理规范的推行提供相对有利的内部控制环境；另一方面依据不断发展变化的外部经营环境、监管环境与业务实践对于公司内部控制与风险管理持续进行动态的调整与修正。监察稽核工作致力于保障本基金运作合法合规，切实维护基金份额持有人利益；致力于保障各项法律法规和内部管理制度贯彻执行，推动各项内部控制与风险管理机制的逐步优化与完善，促进公司各项业务合法合规运作。

本报告期内完成的监察稽核工作主要包括：一是密切关注法律法规与监管规范性文件的更新情况，及时进行内部传达以及组织员工学习理解；二是协调内部管理制度体系的修订和完善，推动公司各业务部门持续完善管理制度和业务流程建设，防范日常运作中发生违法违规行为与风险事件；三是从投资决策、研究支持、交易执行、投资监督与风险管理、关联交易管理、公平交易与异常交易监控、内幕交易防控等各方面持续加强对于投资管理业务的内部控制，保障基金投资运作合法合规；四是通过外部和内部培训、日常投资申报管理、员工行为规范管理等方式不断强化员工的合规意识，规范员工行为操守，严格防范利益冲突；五是对基金运作过程中的营销与销售、会计核算估值、信息技术支持等方面进行内部控制与合规管理；六是执行基金运作过程中的临时公告、定期报告、招募说明书更新等相关信息披露工作；七是通过独立开展定期或不定期内部审计，监督检查各业务条线相关内部控制措施设计的合理性以及执行的有效性，针对发现的问题相应提出改进建议并督促相关业务部门及时落实改进措施。

#### 4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2025 年年度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 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70074312_B58 号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实

任	<p>现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金不能持续经营。</p> <p>（5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	许培菁   李莉
会计师事务所的地址	中国北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 16 层
审计报告日期	2026 年 3 月 27 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	10,018,489.60	1,882,796.56
结算备付金		80.07	57,500.01
存出保证金		-	142,939.20
交易性金融资产	7.4.7.2	276,622,306.81	59,473,675.51
其中：股票投资		261,896,019.80	56,030,720.00
基金投资		-	-
债券投资		14,726,287.01	3,442,955.51
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		23,161.44	35,712.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		286,664,037.92	61,592,623.63
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		9,650,600.83	131,747.54
应付管理人报酬		249,055.24	55,190.53
应付托管费		37,358.28	8,278.59
应付销售服务费		44,758.46	7,395.79
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	156,000.00	130,000.00
负债合计		10,137,772.81	332,612.45
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	206,219,552.55	57,726,446.28
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	70,306,712.56	3,533,564.90
净资产合计		276,526,265.11	61,260,011.18
负债和净资产总计		286,664,037.92	61,592,623.63

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 206,219,552.55 份，其中下属 A 类基金份额净值 1.3484 元，份额总额 114,332,736.99 份；下属 C 类基金份额净值 1.3316 元，份额总额 91,886,815.56 份。

## 7.2 利润表

会计主体：鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		27,056,534.17	366,013.41
1. 利息收入		24,945.82	16,394.97
其中：存款利息收入	7.4.7.13	24,945.82	12,157.51
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		-	4,237.46
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		22,322,709.82	2,330,706.24
其中：股票投资收益	7.4.7.14	21,044,754.60	1,867,414.33
基金投资收益		-	-

债券投资收益	7.4.7.15	86,016.30	75,719.67
资产支持证券投资 收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	459,709.61	-156,691.92
股利收益	7.4.7.19	732,229.31	544,264.16
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）	7.4.7.20	4,382,751.42	-2,118,778.72
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.21	326,127.11	137,690.92
<b>减：二、营业总支出</b>		1,899,049.11	879,660.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,316,184.22	568,029.65
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	197,427.61	85,204.48
3. 销售服务费		227,317.50	96,426.75
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		1,719.78	-
8. 其他费用	7.4.7.23	156,400.00	130,000.00
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		25,157,485.06	-513,647.47
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		25,157,485.06	-513,647.47
<b>五、其他综合收益的税后 净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		25,157,485.06	-513,647.47

### 7.3 净资产变动表

会计主体：鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	57,726,446.28	3,533,564.90	61,260,011.18
二、本期期初净资产	57,726,446.28	3,533,564.90	61,260,011.18
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	148,493,106.27	66,773,147.66	215,266,253.93
（一）、综合收益总额	-	25,157,485.06	25,157,485.06
（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）	148,493,106.27	41,615,662.60	190,108,768.87
其中：1. 基金申购款	289,573,864.29	79,615,473.74	369,189,338.03
2. 基金赎回款	-141,080,758.02	-37,999,811.14	-179,080,569.16
（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	206,219,552.55	70,306,712.56	276,526,265.11
项目	上年度可比期间		
	2024年1月1日至2024年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	90,189,888.93	-2,463,996.78	87,725,892.15
二、本期期初净资产	90,189,888.93	-2,463,996.78	87,725,892.15
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,463,442.65	5,997,561.68	-26,465,880.97
（一）、综合收益总额	-	-513,647.47	-513,647.47
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-32,463,442.65	6,511,209.15	-25,952,233.50
其中：1. 基金申购款	43,230,071.51	-385,371.64	42,844,699.87
2. 基金赎回	-75,693,514.16	6,896,580.79	-68,796,933.37

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	57,726,446.28	3,533,564.90	61,260,011.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>于景亮</u>	<u>杨晓宇</u>	<u>包颖</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]2562 号文《关于准予鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由鑫元基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型、开放式，存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 169,504,967.32 元，已经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2022）验字第 61444343\_B22 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2022 年 11 月 28 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 169,525,725.31 份基金份额，其中有效认购资金在初始募集期内产生利息 20,757.99 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《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（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：中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或

权益工具的合同。

#### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变

化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重

新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现

利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直

线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可分配收益将有所不同；本基金同一类别每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规的规定、《基金合同》的约定以及对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，不需召开基金份额持有人大会。

#### 7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 7.4.5.3 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。

#### 7.4.6 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‰；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。

## 2、增值税

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局公告[2025]4 号文《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，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 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

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

#### 5、个人所得税

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

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

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

#### 6、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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

## 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末		上年度末	
	2025 年 12 月 31 日		2024 年 12 月 31 日	
活期存款	9,229,956.19		120,966.46	
等于：本金	9,228,732.87		120,769.79	
加：应计利息	1,223.32		196.67	
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	788,533.41		1,761,830.10	
等于：本金	788,449.80		1,761,798.49	
加：应计利息	83.61		31.61	
减：坏账准备	-		-	
合计	10,018,489.60		1,882,796.56	

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。

## 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2025 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	259,566,530.14	-	261,896,019.80	2,329,489.66	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,592,041.81	124,187.01	14,726,287.01	10,058.19
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,592,041.81	124,187.01	14,726,287.01	10,058.19
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	274,158,571.95	124,187.01	276,622,306.81	2,339,547.85	
项目	上年度末				
	2024 年 12 月 31 日				

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	58,030,145.00	-	56,030,720.00	-1,999,425.00
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	3,403,958.57	3,442,955.51	1,821.43
	银行间市场	-	-	-
	合计	3,403,958.57	3,442,955.51	1,821.43
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	61,434,103.57	37,175.51	59,473,675.51	-1,997,603.57

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2024年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,236,760.00	-	-	-
其中：股指期货投资	1,236,760.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,236,760.00	-	-	-

**7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

注：无。

**7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况**

注：无。

**7.4.7.4 买入返售金融资产**

**7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额**

注：无。

**7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

注：无。

**7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明**

无。
----

**7.4.7.5 债权投资**

**7.4.7.5.1 债权投资情况**

注：无。

**7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**7.4.7.6 其他债权投资**

**7.4.7.6.1 其他债权投资情况**

注：无。

**7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况**

注：无。

**7.4.7.7 其他权益工具投资**

**7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况**

注：无。

**7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况**

注：无。

**7.4.7.8 其他资产**

注：无。

## 7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 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	156,000.00	130,000.00
合计	156,000.00	130,000.00

## 7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

鑫元中证 1000 指数增强发起式 A		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	38,745,777.54	38,745,777.54
本期申购	135,464,972.91	135,464,972.91
本期赎回（以“-”号填列）	-59,878,013.46	-59,878,013.46
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	114,332,736.99	114,332,736.99

金额单位：人民币元

鑫元中证 1000 指数增强发起式 C		
项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,980,668.74	18,980,668.74
本期申购	154,108,891.38	154,108,891.38
本期赎回（以“-”号填列）	-81,202,744.56	-81,202,744.56
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	91,886,815.56	91,886,815.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 7.4.7.11 其他综合收益

注：无。

## 7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

鑫元中证 1000 指数增强发起式 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,243,727.94	242,358.94	2,486,086.88
本期期初	2,243,727.94	242,358.94	2,486,086.88
本期利润	13,787,271.33	3,249,493.82	17,036,765.15
本期基金份额交易产生的变动数	16,775,981.94	3,534,521.71	20,310,503.65
其中：基金申购款	30,256,420.95	7,065,238.76	37,321,659.71
基金赎回款	-13,480,439.01	-3,530,717.05	-17,011,156.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	32,806,981.21	7,026,374.47	39,833,355.68

鑫元中证 1000 指数增强发起式 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	931,018.94	116,459.08	1,047,478.02
本期期初	931,018.94	116,459.08	1,047,478.02
本期利润	6,987,462.31	1,133,257.60	8,120,719.91
本期基金份额交易产生的变动数	16,966,350.51	4,338,808.44	21,305,158.95
其中：基金申购款	33,681,102.04	8,612,711.99	42,293,814.03
基金赎回款	-16,714,751.53	-4,273,903.55	-20,988,655.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,884,831.76	5,588,525.12	30,473,356.88

## 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	21,200.16	9,261.19
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	1,571.53	2,896.32
结算备付金利息收入	-	-
其他	2,174.13	-
合计	24,945.82	12,157.51

## 7.4.7.14 股票投资收益

## 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	21,044,754.60	1,867,414.33
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	21,044,754.60	1,867,414.33

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	3,136,664,540.83	1,053,511,865.83
减：卖出股票成本总额	3,112,375,231.63	1,050,464,751.66
减：交易费用	3,244,554.60	1,179,699.84
买卖股票差价收入	21,044,754.60	1,867,414.33

#### 7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：无。

#### 7.4.7.15 债券投资收益

##### 7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	88,677.32	54,576.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,661.02	21,143.57
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	86,016.30	75,719.67

## 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,569,559.15	5,773,943.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,502,372.76	5,678,966.43
减：应计利息总额	69,624.15	73,732.94
减：交易费用	223.26	101.00
买卖债券差价收入	-2,661.02	21,143.57

## 7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.16 资产支持证券投资收益

## 7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：无。

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

注：无。

## 7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.17 贵金属投资收益

## 7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

## 7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

## 7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

## 7.4.7.18 衍生工具收益

## 7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

## 7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	459,709.61	-156,691.92

## 7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	732,229.31	544,264.16
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	732,229.31	544,264.16

## 7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,337,151.42	-2,100,618.72
——股票投资	4,328,914.66	-2,090,440.15
——债券投资	8,236.76	-10,178.57
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	45,600.00	-18,160.00
——权证投资	-	-
——期货投资	45,600.00	-18,160.00
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	4,382,751.42	-2,118,778.72

#### 7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	326,064.10	136,712.39
基金转换费收入	63.01	978.53
合计	326,127.11	137,690.92

#### 7.4.7.22 信用减值损失

注：无。

#### 7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	36,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
开户费	400.00	-
合计	156,400.00	130,000.00

#### 7.4.7.24 分部报告

无。

### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 7.4.8.1 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。

#### 7.4.8.2 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。

### 7.4.9 关联方关系

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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	6,331,537,310.78	98.17	2,081,125,661.32	100.00

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	22,190,391.00	100.00	10,004,736.00	100.00

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)
华泰证券	-	-	46,270,000.00	100.00

##### 7.4.10.1.4 权证交易

注：无。

##### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31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	1,240,760.95	98.26	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31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	519,613.79	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）。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,316,184.22	568,029.65
其中：应支付销售机构的客户维护费	427,844.51	205,290.05
应支付基金管理人的净管理费	888,339.71	362,739.60

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

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	197,427.61	85,204.48

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 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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

## 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	合计
鑫元基金	-	74,378.11	74,378.11
南京银行	-	21,480.73	21,480.73
华泰证券	-	53,232.16	53,232.16
合计	-	149,091.00	149,091.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	合计
鑫元基金	-	5,759.46	5,759.46
南京银行	-	8,107.95	8,107.95
华泰证券	-	42,860.95	42,860.95
合计	-	56,728.36	56,728.36

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

## 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：无。

## 7.4.10.4 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

## 7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,666.83	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,001,666.83	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.8500%	-
项目	上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日（2022 年 11 月 28 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	10,001,666.83	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的	10,001,666.83	-

基金份额		
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	17.3260%	-

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

（2）本基金管理人运用固有资金投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 7.4.10.5.2 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

##### 鑫元中证 1000 指数增强发起式 A

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
鑫沅资产	19,479,930.73	9.4462	19,479,930.73	33.7452

份额单位：份

##### 鑫元中证 1000 指数增强发起式 C

关联方名称	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)
-	-	-	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金所采用的费率适用招募说明书以及管理人发布的最新公告规定的费率结构。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 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	345,725.77	1,534.72	1,761,830.10	2,896.32

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。

#### 7.4.10.7 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。

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

注：无。

## 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

## 7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688809	强一股份	2025年12月23日	6个月	新股流通受限	85.09	203.31	89	7,573.01	18,094.59	-
301638	南网数字	2025年11月11日	6个月	新股流通受限	5.69	14.21	1,025	5,832.25	14,565.25	-
688727	恒坤新材	2025年11月11日	6个月	新股流通受限	14.99	34.87	412	6,175.88	14,366.44	-
688807	优迅股份	2025年12月10日	6个月	新股流通受限	51.66	135.56	105	5,424.30	14,233.80	-
688795	摩尔线程	2025年11月26日	6个月	新股流通受限	114.28	416.18	30	3,428.40	12,485.40	-
301687	新广益	2025年12月24日	6个月	新股流通受限	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
688796	百奥赛图	2025年12月2日	6个月	新股流通受限	26.68	42.25	237	6,323.16	10,013.25	-
001386	马可	2025年10月	6个月	新股流通	13.75	18.53	510	7,012.50	9,450.30	-

	波罗	月 15 日		受限						
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	新股流通受限	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	新股流通受限	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	新股流通受限	48.00	51.88	162	7,776.00	8,404.56	-
301449	天溯计量	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	36.80	65.23	112	4,121.60	7,305.76	-
688802	沐曦股份	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	104.66	399.31	18	1,883.88	7,187.58	-
688783	西安奕材	2025 年 10 月 20 日	6 个月	新股流通受限	8.62	18.36	373	3,215.26	6,848.28	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	6.85	12.89	476	3,260.60	6,135.64	-
688759	必贝特	2025 年 10 月 21 日	6 个月	新股流通受限	17.78	25.11	233	4,142.74	5,850.63	-
603175	超颖电子	2025 年 10 月 17 日	6 个月	新股流通受限	17.08	48.56	108	1,844.64	5,244.48	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
603092	德力	2025 年 10 月	6 个月	新股流通	46.68	55.66	70	3,267.60	3,896.20	-

	佳	月 30 日		受限						
688790	昂瑞微	2025 年 12 月 9 日	6 个月	新股流通受限	83.06	117.19	28	2,325.68	3,281.32	-
603376	大明电子	2025 年 10 月 28 日	6 个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025 年 10 月 29 日	6 个月	新股流通受限	24.49	32.82	88	2,155.12	2,888.16	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	新股流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

#### 7.4.12.2 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
603508	思维列控	2025 年 12 月 29 日	重大事项停牌	27.82	2026 年 1 月 7 日	27.83	24,500	687,626.15	681,590.00	-

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 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。

#### 7.4.13.2 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。

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
A-1	-	-

A-1 以下	-	-
未评级	14,726,287.01	3,442,955.51
合计	14,726,287.01	3,442,955.51

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。

#### 7.4.13.2.2 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。

#### 7.4.13.2.3 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。

#### 7.4.13.2.4 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。

#### 7.4.13.2.5 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。

#### 7.4.13.2.6 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。

### 7.4.13.3 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。

#### 7.4.13.3.1 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。

#### 7.4.13.4 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。

##### 7.4.13.4.1 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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	10,017,182.67	0.00	0.00	0.00	0.00	1,306.93	10,018,489.60
结算备付金	80.07	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	80.07
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	5,400,000.00	0.00	9,202,100.00	0.00	0.00	262,020,206.81	276,622,306.81
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	23,161.44	23,161.44
其他资产	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00
资产总计	15,417,262.77	0.00	9,202,100.00	0.00	0.00	262,044,676.81	286,664,037.57

	4					5.18	92
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	9,650,600.83	9,650,600.83
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	249,055.24	249,055.24
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	37,358.28	37,358.28
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	44,758.46	44,758.46
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	156,000.00	156,000.00
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	10,137,772.81	10,137,772.81
利率敏感度缺口	15,417,262.74	0.00	9,202,100.00	0.00	0.00	251,906,902.37	276,526,265.11
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	1,882,568.28	0.00	0.00	0.00	0.00	228.28	1,882,796.56
结算备付金	57,500.01	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	57,500.01
存出保证金	142,939.20	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	142,939.20
交易性金融资产	0.00	0.00	3,405,780.00	0.00	0.00	56,067,895.51	59,473,675.51
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	35,712.35	35,712.35

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	2,083,007.49	0.00	3,405,780.00	0.00	0.00	56,103,836.14	61,592,623.63
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	131,747.54	131,747.54
应付管理人报酬	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	55,190.53	55,190.53
应付托管费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	8,278.59	8,278.59
应付销售服务费	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	7,395.79	7,395.79
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	130,000.00	130,000.00
负债总计	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00	332,612.45	332,612.45
利率敏感度缺口	2,083,007.49	0.00	3,405,780.00	0.00	0.00	55,771,223.69	61,260,011.18

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2025年12月31日）	上年度末（2024年12月31日）
	1. 市场利率下降 25 个基点		11,768.82
2. 市场利率上升 25 个基点		-11,739.63	-2,703.18

	个基点		
--	-----	--	--

#### 7.4.13.4.2 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。

#### 7.4.13.4.3 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	261,896,019.80	94.71	56,030,720.00	91.46
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	261,896,019.80	94.71	56,030,720.00	91.46

## 7.4.13.4.3.2 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（2025 年 12 月 31 日）	上年度末（2024 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 1%	2,455,745.37	592,627.80
	业绩比较基准下降 1%	-2,455,745.37	-592,627.80

## 7.4.14 公允价值

## 7.4.14.1 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。

## 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

## 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	261,026,787.27	56,030,720.00
第二层次	15,407,877.01	3,442,955.51
第三层次	187,642.53	-
合计	276,622,306.81	59,473,675.51

#### 7.4.14.2.2 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业务等情况，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。

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	93,936.86	93,936.86
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	93,705.67	93,705.67
其中：计入损益的利得或损失	-	93,705.67	93,705.67
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	187,642.53	187,642.53
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	93,705.67	93,705.67
项目	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	187,642.53	市场法	股价波动率	82.85%-307.91%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.14.3 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。

#### 7.4.14.4 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。

#### 7.4.15 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。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	261,896,019.80	91.36
	其中：股票	261,896,019.80	91.36
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,726,287.01	5.14
	其中：债券	14,726,287.01	5.14
	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	10,018,569.67	3.49
8	其他各项资产	23,161.44	0.01
9	合计	286,664,037.92	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 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	1,374,279.00	0.50
B	采矿业	5,439,483.00	1.97
C	制造业	152,672,986.78	55.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,830,231.00	1.75
E	建筑业	960,027.00	0.35
F	批发和零售业	6,324,745.00	2.29
G	交通运输、仓储和邮政业	6,061,039.00	2.19
H	住宿和餐饮业	356,775.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	29,729,036.49	10.75
J	金融业	4,733,685.00	1.71
K	房地产业	4,382,326.00	1.58
L	租赁和商务服务业	3,621,839.04	1.31
M	科学研究和技术	3,066,864.76	1.11

	服务业		
N	水利、环境和公共设施管理业	2,405,353.00	0.87
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	349,210.00	0.13
Q	卫生和社会工作	330,288.00	0.12
R	文化、体育和娱乐业	3,426,078.00	1.24
S	综合	681,100.00	0.25
	合计	230,745,346.07	83.44

### 8.2.2 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	338,254.00	0.12
C	制造业	24,347,755.06	8.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	316,224.00	0.11
F	批发和零售业	674,032.00	0.24
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	4,147,084.75	1.50
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	19,760.92	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	638,508.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	355,789.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	313,266.00	0.11
S	综合	-	-
	合计	31,150,673.73	11.26

### 8.2.3 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。

### 8.3 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

#### 8.3.1 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	301171	易点天下	19,100	773,550.00	0.28
2	600266	城建发展	146,900	744,783.00	0.27
3	002897	意华股份	13,500	729,945.00	0.26
4	688097	博众精工	19,300	728,575.00	0.26
5	600552	凯盛科技	58,500	725,400.00	0.26
6	301571	国科天成	12,500	721,000.00	0.26
7	603039	泛微网络	13,400	717,436.00	0.26
8	688696	极米科技	6,400	713,472.00	0.26
9	603083	剑桥科技	5,300	712,214.00	0.26
10	002006	精工科技	30,600	708,696.00	0.26
11	301589	诺瓦星云	4,300	707,565.00	0.26
12	301000	肇民科技	17,900	704,723.00	0.25
13	300323	华灿光电	87,800	700,644.00	0.25
14	001339	智微智能	13,700	700,207.00	0.25
15	688789	宏华数科	8,548	697,260.36	0.25
16	301262	海看股份	28,000	696,920.00	0.25
17	605507	国邦医药	28,100	696,880.00	0.25
18	300634	彩讯股份	27,500	693,825.00	0.25
19	600986	浙文互联	88,700	693,634.00	0.25
20	600728	佳都科技	103,700	692,716.00	0.25
21	600075	新疆天业	139,900	692,505.00	0.25
22	003006	百亚股份	31,700	692,328.00	0.25
23	600933	爱柯迪	34,400	691,440.00	0.25
24	603267	鸿远电子	12,700	691,261.00	0.25
25	688208	道通科技	18,700	688,160.00	0.25
26	688088	虹软科技	13,900	688,050.00	0.25
27	688372	伟测科技	6,300	687,267.00	0.25
28	300047	天源迪科	54,700	686,485.00	0.25
29	300925	法本信息	32,300	686,052.00	0.25
30	300036	超图软件	37,700	684,632.00	0.25
31	002545	东方铁塔	37,100	684,495.00	0.25
32	600649	城投控股	153,800	684,410.00	0.25
33	300113	顺网科技	33,800	684,112.00	0.25
34	300678	中科信息	22,200	682,872.00	0.25
35	688522	纳睿雷达	17,100	682,803.00	0.25
36	301219	腾远钴业	10,000	682,800.00	0.25

37	600100	同方股份	76,500	682,380.00	0.25
38	000758	中色股份	102,700	681,928.00	0.25
39	300573	兴齐眼药	9,700	681,813.00	0.25
40	002396	星网锐捷	22,500	681,750.00	0.25
41	603508	思维列控	24,500	681,590.00	0.25
42	600114	东睦股份	22,300	681,265.00	0.25
43	000833	粤桂股份	35,000	681,100.00	0.25
44	600640	国脉文化	54,200	680,752.00	0.25
45	603197	保隆科技	18,400	680,616.00	0.25
46	002588	史丹利	68,000	678,640.00	0.25
47	300079	数码视讯	125,900	678,601.00	0.25
48	000913	钱江摩托	44,000	678,480.00	0.25
49	002649	博彦科技	51,400	677,966.00	0.25
50	002434	万里扬	71,100	677,583.00	0.25
51	605118	力鼎光电	22,500	677,475.00	0.24
52	603236	移远通信	7,100	677,411.00	0.24
53	002675	东诚药业	49,300	677,382.00	0.24
54	300776	帝尔激光	10,900	677,326.00	0.24
55	600718	东软集团	67,200	676,704.00	0.24
56	300232	洲明科技	95,200	674,968.00	0.24
57	300415	伊之密	25,900	674,954.00	0.24
58	600866	星湖科技	97,100	674,845.00	0.24
59	301339	通行宝	46,400	674,656.00	0.24
60	002777	久远银海	37,600	674,544.00	0.24
61	002023	海特高新	49,800	674,292.00	0.24
62	688131	皓元医药	9,347	673,731.76	0.24
63	300088	长信科技	111,100	673,266.00	0.24
64	301031	中熔电气	6,000	673,140.00	0.24
65	300470	中密控股	17,900	673,040.00	0.24
66	601677	明泰铝业	45,500	672,945.00	0.24
67	688321	微芯生物	23,000	672,060.00	0.24
68	600301	华锡有色	17,500	671,300.00	0.24
69	603220	中贝通信	31,500	670,950.00	0.24
70	300183	东软载波	45,200	670,316.00	0.24
71	000581	威孚高科	32,500	670,150.00	0.24
72	688798	艾为电子	8,800	669,768.00	0.24
73	002237	恒邦股份	49,900	669,658.00	0.24
74	603613	国联股份	23,900	669,200.00	0.24
75	300618	寒锐钴业	14,800	669,108.00	0.24
76	002036	联创电子	60,700	668,914.00	0.24
77	601609	金田股份	61,800	667,440.00	0.24
78	002239	奥特佳	223,900	667,222.00	0.24
79	600908	无锡银行	112,500	667,125.00	0.24

80	600507	方大特钢	113,100	666,159.00	0.24
81	300226	上海钢联	26,517	666,107.04	0.24
82	600037	歌华有线	91,200	665,760.00	0.24
83	002079	苏州固锔	69,700	665,635.00	0.24
84	601811	新华文轩	49,600	665,632.00	0.24
85	600782	新钢股份	171,500	665,420.00	0.24
86	002075	沙钢股份	115,700	665,275.00	0.24
87	603218	日月股份	50,200	665,150.00	0.24
88	000498	山东路桥	110,300	665,109.00	0.24
89	603118	共进股份	57,800	664,700.00	0.24
90	002258	利尔化学	50,900	664,245.00	0.24
91	605020	永和股份	24,700	664,183.00	0.24
92	001287	中电港	29,300	663,938.00	0.24
93	301665	泰禾股份	23,500	663,640.00	0.24
94	002073	软控股份	81,400	663,410.00	0.24
95	300184	力源信息	66,400	663,336.00	0.24
96	301622	英思特	10,300	663,320.00	0.24
97	002077	大港股份	44,600	663,202.00	0.24
98	300702	天宇股份	28,100	663,160.00	0.24
99	000682	东方电子	55,900	662,974.00	0.24
100	688612	威迈斯	20,100	662,697.00	0.24
101	002170	芭田股份	54,400	662,592.00	0.24
102	601777	千里科技	62,300	662,249.00	0.24
103	000555	神州信息	40,000	662,000.00	0.24
104	300303	聚飞光电	96,700	661,428.00	0.24
105	603005	晶方科技	23,900	661,074.00	0.24
106	001301	尚太科技	7,700	660,737.00	0.24
107	688690	纳微科技	25,600	660,736.00	0.24
108	603323	苏农银行	130,800	660,540.00	0.24
109	002550	千红制药	84,000	660,240.00	0.24
109	600645	中源协和	26,200	660,240.00	0.24
110	688352	颀中科技	52,349	660,120.89	0.24
111	600125	铁龙物流	102,500	660,100.00	0.24
112	000719	中原传媒	56,100	659,736.00	0.24
113	600458	时代新材	49,700	659,519.00	0.24
114	002487	大金重工	12,700	659,511.00	0.24
115	688380	中微半导	20,500	659,075.00	0.24
116	300257	开山股份	46,900	658,945.00	0.24
117	600428	中远海特	92,800	658,880.00	0.24
118	603456	九洲药业	36,800	658,720.00	0.24
119	002815	崇达技术	48,200	658,412.00	0.24
120	688584	上海合晶	30,000	658,200.00	0.24
121	600662	外服控股	131,100	658,122.00	0.24

122	002755	奥赛康	40,300	658,099.00	0.24
123	002011	盾安环境	51,900	658,092.00	0.24
124	601020	华钰矿业	24,500	658,070.00	0.24
125	301606	绿联科技	11,200	657,888.00	0.24
126	000902	新洋丰	42,100	657,602.00	0.24
127	600675	中华企业	242,600	657,446.00	0.24
128	002859	洁美科技	23,800	656,880.00	0.24
129	301381	赛维时代	31,900	656,821.00	0.24
130	300409	道氏技术	29,200	656,708.00	0.24
131	600478	科力远	95,300	656,617.00	0.24
132	002745	木林森	68,600	656,502.00	0.24
133	300319	麦捷科技	56,100	655,809.00	0.24
134	601311	骆驼股份	71,500	655,655.00	0.24
135	002993	奥海科技	15,000	655,650.00	0.24
136	600269	赣粤高速	126,300	655,497.00	0.24
137	300185	通裕重工	230,800	655,472.00	0.24
138	603328	依顿电子	59,800	655,408.00	0.24
139	600323	瀚蓝环境	22,900	654,940.00	0.24
140	301602	超研股份	30,400	654,816.00	0.24
141	600490	鹏欣资源	84,700	654,731.00	0.24
142	301458	钧崑电子	20,400	654,636.00	0.24
143	002222	福晶科技	11,600	653,544.00	0.24
144	688331	荣昌生物	8,400	653,436.00	0.24
145	301345	涛涛车业	2,600	653,432.00	0.24
146	002004	华邦健康	136,700	653,426.00	0.24
147	601096	宏盛华源	157,300	652,795.00	0.24
148	688252	天德钰	30,835	652,776.95	0.24
149	000019	深粮控股	93,900	652,605.00	0.24
150	000597	东北制药	125,000	652,500.00	0.24
151	688029	南微医学	8,000	652,480.00	0.24
152	601326	秦港股份	186,900	652,281.00	0.24
153	002891	中宠股份	12,600	652,176.00	0.24
154	600210	紫江企业	88,700	651,945.00	0.24
155	002270	华明装备	26,000	651,040.00	0.24
156	000767	晋控电力	232,500	651,000.00	0.24
157	601069	西部黄金	24,400	650,992.00	0.24
158	600961	株冶集团	40,400	650,440.00	0.24
159	002518	科士达	13,400	650,168.00	0.24
160	603612	索通发展	27,600	648,600.00	0.23
161	688209	英集芯	32,500	648,050.00	0.23
162	000049	德赛电池	24,100	647,808.00	0.23
163	301376	致欧科技	35,600	643,292.00	0.23
164	000899	赣能股份	64,900	642,510.00	0.23

165	688591	泰凌微	15,086	642,060.16	0.23
166	300850	新强联	15,500	641,235.00	0.23
167	688123	聚辰股份	5,100	640,458.00	0.23
168	300770	新媒股份	15,100	640,391.00	0.23
169	002901	大博医疗	13,500	639,495.00	0.23
170	300693	盛弘股份	16,700	639,276.00	0.23
171	002215	诺普信	60,100	636,459.00	0.23
172	688063	派能科技	11,200	636,384.00	0.23
173	688515	裕太微	6,200	635,810.00	0.23
174	688200	华峰测控	3,331	633,556.20	0.23
175	300620	光库科技	4,300	632,315.00	0.23
176	000029	深深房 A	28,700	631,974.00	0.23
177	300083	创世纪	68,100	627,201.00	0.23
178	300438	鹏辉能源	11,600	617,352.00	0.22
179	600211	西藏药业	12,700	540,385.00	0.20
180	002354	天娱数科	80,200	510,874.00	0.18
181	688177	百奥泰	21,400	495,196.00	0.18
182	600259	中稀有色	8,000	450,080.00	0.16
183	688146	中船特气	10,378	419,271.20	0.15
184	000048	京基智农	23,800	418,880.00	0.15
185	300443	金雷股份	14,800	416,324.00	0.15
186	300953	震裕科技	2,400	403,248.00	0.15
187	300101	振芯科技	13,800	392,334.00	0.14
188	603009	北特科技	8,100	390,096.00	0.14
189	301153	中科江南	15,700	388,104.00	0.14
190	603171	税友股份	7,000	385,910.00	0.14
191	603888	新华网	19,700	382,771.00	0.14
192	603337	杰克科技	8,700	376,971.00	0.14
193	603103	横店影视	22,500	373,050.00	0.13
194	002315	焦点科技	8,100	370,656.00	0.13
195	603876	鼎胜新材	24,500	367,745.00	0.13
196	688536	思瑞浦	2,300	367,724.00	0.13
197	600776	东方通信	22,200	366,300.00	0.13
198	600273	嘉化能源	41,700	364,458.00	0.13
199	600623	华谊集团	47,000	362,370.00	0.13
200	000603	盛达资源	11,700	362,232.00	0.13
201	002544	普天科技	10,500	362,145.00	0.13
202	002612	朗姿股份	17,700	361,788.00	0.13
203	605198	安德利	9,600	361,152.00	0.13
204	002511	中顺洁柔	42,100	360,376.00	0.13
205	301061	匠心家居	3,800	360,240.00	0.13
206	688686	奥普特	2,900	359,977.00	0.13
207	600861	北京人力	19,600	359,464.00	0.13

208	601858	中国科传	19,800	359,370.00	0.13
209	301095	广立微	5,000	358,550.00	0.13
210	603588	高能环境	46,400	358,208.00	0.13
211	301029	怡合达	13,500	358,020.00	0.13
212	688127	蓝特光学	9,300	357,957.00	0.13
213	603025	大豪科技	19,900	357,404.00	0.13
214	300926	博俊科技	10,900	357,302.00	0.13
215	605099	共创草坪	10,000	356,900.00	0.13
216	600258	首旅酒店	21,300	356,775.00	0.13
217	002985	北摩高科	11,200	355,376.00	0.13
218	605599	菜百股份	21,700	355,229.00	0.13
219	688443	智翔金泰	13,037	355,127.88	0.13
220	300548	长芯博创	2,500	355,000.00	0.13
221	688327	云从科技	24,700	354,939.00	0.13
222	002913	奥士康	8,300	354,742.00	0.13
223	002928	华夏航空	32,100	354,705.00	0.13
224	301205	联特科技	2,100	353,871.00	0.13
225	688484	南芯科技	8,700	353,742.00	0.13
226	000589	贵州轮胎	68,200	353,276.00	0.13
227	605376	博迁新材	5,400	353,160.00	0.13
228	301316	慧博云通	7,900	352,972.00	0.13
229	301556	托普云农	3,600	352,944.00	0.13
230	603662	柯力传感	4,900	352,800.00	0.13
231	000612	焦作万方	32,000	352,640.00	0.13
232	601033	永兴股份	23,300	352,529.00	0.13
233	600710	苏美达	32,600	352,406.00	0.13
234	688552	航天南湖	9,700	352,304.00	0.13
235	600639	浦东金桥	34,300	352,261.00	0.13
236	601528	瑞丰银行	61,800	352,260.00	0.13
237	301631	壹连科技	3,400	352,070.00	0.13
238	600216	浙江医药	25,400	352,044.00	0.13
239	601801	皖新传媒	53,500	352,030.00	0.13
240	600338	西藏珠峰	23,400	351,936.00	0.13
241	300008	天海防务	44,600	351,894.00	0.13
242	002267	陕天然气	46,700	351,651.00	0.13
243	600757	长江传媒	39,600	351,648.00	0.13
244	603713	密尔克卫	6,300	351,351.00	0.13
245	002101	广东鸿图	28,500	351,120.00	0.13
246	002705	新宝股份	24,600	350,796.00	0.13
247	002488	金固股份	39,900	350,721.00	0.13
248	300772	运达股份	18,400	350,704.00	0.13
249	000778	新兴铸管	83,900	350,702.00	0.13
250	000058	深赛格	37,300	350,620.00	0.13

251	601003	柳钢股份	69,700	350,591.00	0.13
252	002063	远光软件	57,700	350,239.00	0.13
253	000030	富奥股份	61,000	350,140.00	0.13
253	300098	高新兴	57,400	350,140.00	0.13
254	301508	中机认检	11,200	350,112.00	0.13
255	300685	艾德生物	17,100	349,866.00	0.13
256	601963	重庆银行	32,300	349,809.00	0.13
257	002003	伟星股份	33,000	349,800.00	0.13
258	002839	张家港行	76,500	349,605.00	0.13
259	600335	国机汽车	53,700	349,587.00	0.13
260	301109	军信股份	23,300	349,500.00	0.13
261	300811	铂科新材	4,900	349,419.00	0.13
262	600629	华建集团	16,100	349,370.00	0.13
263	301177	迪阿股份	12,100	349,327.00	0.13
264	300492	华图山鼎	4,700	349,210.00	0.13
265	603202	天有为	3,800	348,878.00	0.13
266	002043	兔宝宝	24,200	348,722.00	0.13
267	601900	南方传媒	26,000	348,660.00	0.13
268	000885	城发环境	25,400	348,488.00	0.13
269	301087	可孚医疗	7,800	348,426.00	0.13
270	002895	川恒股份	9,500	348,270.00	0.13
271	300602	飞荣达	10,500	348,180.00	0.13
272	002096	易普力	26,100	347,652.00	0.13
273	600928	西安银行	93,900	347,430.00	0.13
274	000089	深圳机场	49,700	347,403.00	0.13
275	301297	富乐德	9,700	347,260.00	0.13
276	688403	汇成股份	21,200	347,256.00	0.13
277	600020	中原高速	81,500	347,190.00	0.13
278	603119	浙江荣泰	3,000	347,010.00	0.13
279	600572	康恩贝	77,800	346,988.00	0.13
280	300171	东富龙	22,100	346,970.00	0.13
281	301015	百洋医药	14,700	346,920.00	0.13
282	002233	塔牌集团	38,500	346,885.00	0.13
283	000848	承德露露	40,800	346,800.00	0.13
284	301047	义翘神州	5,130	346,788.00	0.13
285	000930	中粮科技	60,100	346,777.00	0.13
286	601022	宁波远洋	37,800	346,626.00	0.13
287	600022	山东钢铁	229,500	346,545.00	0.13
288	002946	新乳业	18,700	346,511.00	0.13
289	688141	杰华特	7,978	346,484.54	0.13
290	000828	东莞控股	32,200	346,472.00	0.13
291	300363	博腾股份	14,900	346,276.00	0.13
292	603072	天和磁材	8,500	345,865.00	0.13

293	600094	大名城	83,100	345,696.00	0.13
294	688726	拉普拉斯	9,600	345,600.00	0.12
295	002906	华阳集团	11,300	345,554.00	0.12
296	600717	天津港	77,300	345,531.00	0.12
297	002807	江阴银行	75,600	345,492.00	0.12
298	600771	广誉远	19,200	345,216.00	0.12
299	600201	生物股份	22,900	345,103.00	0.12
300	601375	中原证券	80,200	344,860.00	0.12
301	688206	概伦电子	9,900	344,817.00	0.12
302	603014	威高血净	8,700	344,781.00	0.12
303	600867	通化东宝	42,200	344,774.00	0.12
304	002399	海普瑞	29,240	344,739.60	0.12
305	600388	龙净环保	21,100	344,141.00	0.12
306	002275	桂林三金	24,400	344,040.00	0.12
307	002345	潮宏基	27,500	343,750.00	0.12
308	300428	立中集团	14,700	343,245.00	0.12
309	000686	东北证券	36,800	342,976.00	0.12
310	000650	仁和药业	60,700	342,955.00	0.12
311	002048	宁波华翔	10,900	342,914.00	0.12
312	001914	招商积余	32,100	342,828.00	0.12
313	300127	银河磁体	11,300	342,729.00	0.12
314	688700	东威科技	9,700	342,216.00	0.12
315	300348	长亮科技	22,100	342,108.00	0.12
316	000035	中国天楹	61,900	341,688.00	0.12
317	002847	盐津铺子	5,000	341,550.00	0.12
318	601083	锦江航运	30,600	341,496.00	0.12
319	002690	美亚光电	16,600	341,462.00	0.12
320	600508	上海能源	29,000	341,330.00	0.12
321	003012	东鹏控股	52,100	341,255.00	0.12
322	300134	大富科技	27,300	341,250.00	0.12
323	301291	明阳电气	8,200	341,202.00	0.12
324	603530	神马电力	8,300	340,964.00	0.12
325	603730	岱美股份	38,900	340,764.00	0.12
326	600729	重庆百货	13,100	340,600.00	0.12
327	601187	厦门银行	46,400	340,576.00	0.12
328	300666	江丰电子	3,700	340,400.00	0.12
329	688800	瑞可达	4,100	340,300.00	0.12
330	300357	我武生物	12,000	340,200.00	0.12
331	600315	上海家化	15,100	340,052.00	0.12
332	301035	润丰股份	5,000	340,050.00	0.12
333	300341	麦克奥迪	20,800	339,872.00	0.12
334	688185	康希诺	5,403	339,578.55	0.12
335	000600	建投能源	39,800	339,494.00	0.12

336	300910	瑞丰新材	6,000	339,300.00	0.12
337	000791	甘肃能源	52,600	339,270.00	0.12
338	300580	贝斯特	12,900	339,141.00	0.12
339	002110	三钢闽光	77,200	338,908.00	0.12
340	600105	永鼎股份	13,500	338,850.00	0.12
341	688062	迈威生物	8,800	338,536.00	0.12
342	300130	新国都	12,200	338,306.00	0.12
343	600057	厦门象屿	39,700	338,244.00	0.12
344	002965	祥鑫科技	8,300	337,644.00	0.12
345	301600	慧翰股份	2,600	337,506.00	0.12
346	688313	仕佳光子	3,800	337,364.00	0.12
347	001337	四川黄金	12,100	337,106.00	0.12
348	301658	首航新能	11,800	337,008.00	0.12
349	002468	申通快递	25,100	336,842.00	0.12
350	600389	江山股份	13,300	336,224.00	0.12
351	002489	浙江永强	87,600	335,508.00	0.12
352	603583	捷昌驱动	8,800	335,016.00	0.12
353	301327	华宝新能	5,800	334,486.00	0.12
354	688182	灿勤科技	11,300	333,576.00	0.12
355	000690	宝新能源	79,400	332,686.00	0.12
356	600556	天下秀	54,800	332,636.00	0.12
357	002979	雷赛智能	7,900	332,353.00	0.12
358	600459	贵研铂业	17,800	331,258.00	0.12
359	002099	海翔药业	53,000	330,720.00	0.12
360	002896	中大力德	3,700	330,632.00	0.12
361	301293	三博脑科	5,600	330,288.00	0.12
362	603219	富佳股份	19,600	330,064.00	0.12
363	002779	中坚科技	2,900	329,324.00	0.12
364	603055	台华新材	34,800	328,512.00	0.12
365	300687	赛意信息	14,300	328,471.00	0.12
366	000059	华锦股份	61,300	327,955.00	0.12
367	601126	四方股份	10,900	327,872.00	0.12
368	002017	东信和平	14,700	327,810.00	0.12
369	688262	国芯科技	10,800	327,780.00	0.12
370	600810	神马股份	36,400	327,236.00	0.12
371	000837	秦川机床	25,400	327,152.00	0.12
372	688343	云天励飞	4,300	327,144.00	0.12
373	603690	至纯科技	10,400	327,080.00	0.12
374	603229	奥翔药业	32,900	326,368.00	0.12
375	600963	岳阳林纸	69,800	325,966.00	0.12
376	300457	赢合科技	11,700	325,845.00	0.12
377	603360	百傲化学	10,100	325,422.00	0.12
378	002892	科力尔	24,200	324,764.00	0.12

379	301263	泰恩康	11,200	324,688.00	0.12
380	002276	万马股份	19,200	324,672.00	0.12
381	600328	中盐化工	39,200	323,008.00	0.12
382	688630	芯碁微装	2,400	322,872.00	0.12
383	300672	国科微	3,000	322,860.00	0.12
384	300031	宝通科技	14,200	322,766.00	0.12
385	002254	泰和新材	32,200	322,644.00	0.12
386	300613	富瀚微	7,000	322,420.00	0.12
387	002617	露笑科技	39,800	322,380.00	0.12
388	603915	国茂股份	17,500	322,175.00	0.12
389	605555	德昌股份	17,600	322,080.00	0.12
390	603496	恒为科技	11,800	321,904.00	0.12
391	300761	立华股份	15,500	321,625.00	0.12
392	002097	山河智能	25,900	321,419.00	0.12
393	300087	荃银高科	27,500	321,200.00	0.12
394	688498	源杰科技	500	320,995.00	0.12
395	603299	苏盐井神	30,800	320,936.00	0.12
396	300296	利亚德	50,700	320,424.00	0.12
397	000810	创维数字	27,200	320,416.00	0.12
398	600446	金证股份	20,100	319,992.00	0.12
399	000156	华数传媒	42,200	319,454.00	0.12
400	600651	飞乐音响	43,800	319,302.00	0.12
401	600641	先导基电	18,100	319,284.00	0.12
402	001308	康冠科技	15,300	319,158.00	0.12
403	000065	北方国际	25,600	318,976.00	0.12
404	600633	浙数文化	24,800	318,928.00	0.12
405	002045	国光电器	22,500	318,825.00	0.12
406	300315	掌趣科技	64,500	318,630.00	0.12
407	600654	中安科	84,500	318,565.00	0.12
408	002681	奋达科技	47,900	318,535.00	0.12
409	002929	润建股份	8,000	318,480.00	0.12
410	002194	武汉凡谷	24,400	318,420.00	0.12
411	603983	丸美生物	9,600	318,240.00	0.12
412	603619	中曼石油	13,800	318,090.00	0.12
413	688003	天准科技	5,400	318,060.00	0.12
414	000935	四川双马	12,800	317,952.00	0.11
415	688400	凌云光	7,500	317,850.00	0.11
416	300401	花园生物	21,000	317,520.00	0.11
417	000636	风华高科	19,500	317,460.00	0.11
418	000795	英洛华	31,800	317,046.00	0.11
419	600621	华鑫股份	20,800	316,992.00	0.11
420	603871	嘉友国际	22,700	316,665.00	0.11
421	300747	锐科激光	11,700	316,251.00	0.11

422	605333	沪光股份	10,600	316,198.00	0.11
423	603638	艾迪精密	16,700	316,131.00	0.11
424	601860	紫金银行	114,500	316,020.00	0.11
425	300027	华谊兄弟	145,600	315,952.00	0.11
426	000970	中科三环	23,300	315,948.00	0.11
427	002368	太极股份	12,900	315,921.00	0.11
428	301155	海力风电	3,900	315,627.00	0.11
429	603317	天味食品	25,200	315,504.00	0.11
430	300224	正海磁材	20,400	315,384.00	0.11
431	600006	东风股份	43,900	315,202.00	0.11
432	301275	汉朔科技	5,900	315,178.00	0.11
433	300451	创业慧康	65,100	315,084.00	0.11
434	002531	天顺风能	45,900	314,874.00	0.11
434	601890	亚星锚链	30,600	314,874.00	0.11
435	688107	安路科技	11,583	314,825.94	0.11
436	603599	广信股份	27,400	314,552.00	0.11
437	688362	甬矽电子	9,700	314,377.00	0.11
438	603693	江苏新能	26,500	314,290.00	0.11
439	603383	顶点软件	8,700	314,157.00	0.11
440	002182	宝武镁业	20,500	313,650.00	0.11
441	688006	杭可科技	10,700	313,403.00	0.11
442	600217	中再资环	76,800	313,344.00	0.11
443	002010	传化智联	53,900	313,159.00	0.11
444	600206	有研新材	15,400	313,082.00	0.11
445	002516	旷达科技	47,500	313,025.00	0.11
446	688639	华恒生物	9,600	312,768.00	0.11
447	600285	羚锐制药	15,100	312,721.00	0.11
448	002911	佛燃能源	25,800	312,696.00	0.11
449	002458	益生股份	37,300	312,574.00	0.11
450	300725	药石科技	8,100	312,336.00	0.11
451	600635	大众公用	47,700	311,958.00	0.11
452	002484	江海股份	10,500	311,850.00	0.11
453	301071	力量钻石	8,700	311,808.00	0.11
454	688016	心脉医疗	3,400	311,644.00	0.11
455	600055	万东医疗	20,000	311,600.00	0.11
456	600252	中恒集团	113,700	311,538.00	0.11
457	688432	有研硅	25,100	311,491.00	0.11
458	300768	迪普科技	16,800	311,304.00	0.11
459	601718	际华集团	92,900	311,215.00	0.11
460	688116	天奈科技	6,600	311,190.00	0.11
461	688128	中国电研	10,700	311,156.00	0.11
462	002373	千方科技	26,400	310,728.00	0.11
463	600167	联美控股	44,200	310,726.00	0.11

464	000552	甘肃能化	134,500	310,695.00	0.11
465	600750	华润江中	13,400	310,478.00	0.11
466	600740	山西焦化	82,500	310,200.00	0.11
467	600452	涪陵电力	33,100	310,147.00	0.11
468	688549	中巨芯	34,000	310,080.00	0.11
469	601137	博威合金	14,500	309,865.00	0.11
470	603887	城地香江	22,900	309,608.00	0.11
471	002654	万润科技	22,000	309,540.00	0.11
472	688106	金宏气体	15,800	309,522.00	0.11
473	600353	旭光电子	19,200	309,504.00	0.11
474	300009	安科生物	32,300	309,111.00	0.11
475	300463	迈克生物	27,600	308,844.00	0.11
476	002145	钛能化学	63,000	308,700.00	0.11
477	300595	欧普康视	21,000	308,490.00	0.11
478	002243	力合科创	31,000	308,450.00	0.11
479	000503	国新健康	34,700	308,136.00	0.11
480	002127	南极电商	91,400	308,018.00	0.11
481	000813	德展健康	80,200	307,968.00	0.11
482	000766	通化金马	11,200	307,888.00	0.11
483	000727	冠捷科技	121,100	307,594.00	0.11
484	603283	赛腾股份	7,100	307,572.00	0.11
485	002015	协鑫能科	30,900	307,455.00	0.11
486	002091	江苏国泰	34,000	307,020.00	0.11
487	688567	孚能科技	19,600	306,740.00	0.11
488	600361	创新新材	72,300	306,552.00	0.11
489	600744	华银电力	52,100	306,348.00	0.11
490	300119	瑞普生物	16,300	305,951.00	0.11
491	600403	大有能源	43,800	305,724.00	0.11
492	600063	皖维高新	51,900	305,691.00	0.11
493	688091	上海谊众	6,500	305,500.00	0.11
494	002176	江特电机	31,300	304,862.00	0.11
495	000620	盈新发展	113,300	303,644.00	0.11
496	300841	康华生物	4,200	303,492.00	0.11
497	600664	哈药股份	87,900	303,255.00	0.11
498	601869	长飞光纤	2,600	302,536.00	0.11
499	301678	新恒汇	4,700	301,834.00	0.11
500	002020	京新药业	15,900	301,782.00	0.11
501	300726	宏达电子	5,800	295,278.00	0.11
502	600996	贵广网络	29,400	295,176.00	0.11
503	002061	浙江交科	74,100	294,918.00	0.11
504	688190	云路股份	3,000	292,200.00	0.11
505	603567	珍宝岛	32,500	290,225.00	0.10
506	603026	石大胜华	3,800	284,278.00	0.10

## 8.3.2 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	002161	远望谷	92,400	675,444.00	0.24
2	301107	瑜欣电子	23,900	674,936.00	0.24
3	301603	乔锋智能	8,900	673,730.00	0.24
4	688772	珠海冠宇	31,000	667,430.00	0.24
5	603045	福达合金	33,700	662,205.00	0.24
6	688004	博汇科技	28,625	662,096.25	0.24
7	300615	欣天科技	49,800	661,344.00	0.24
8	002696	百洋股份	73,700	521,059.00	0.19
9	301221	光庭信息	6,700	376,808.00	0.14
10	002246	北化股份	20,400	367,608.00	0.13
11	688175	高凌信息	11,400	367,194.00	0.13
12	301131	聚赛龙	7,600	366,852.00	0.13
13	001314	亿道信息	8,100	362,961.00	0.13
14	002912	中新赛克	12,000	361,680.00	0.13
15	300465	高伟达	17,900	360,327.00	0.13
16	688610	埃科光电	5,800	358,498.00	0.13
17	301283	聚胶股份	7,500	358,350.00	0.13
18	603082	北自科技	9,700	357,930.00	0.13
19	603172	万丰股份	20,000	356,000.00	0.13
20	600455	博通股份	13,700	355,789.00	0.13
21	300050	世纪鼎利	64,300	355,579.00	0.13
22	603500	祥和实业	29,600	354,608.00	0.13
23	002441	众业达	37,700	354,380.00	0.13
24	688479	友车科技	18,800	354,004.00	0.13
25	300389	艾比森	21,800	353,814.00	0.13
26	603075	热威股份	16,200	353,808.00	0.13
27	301318	维海德	12,800	353,792.00	0.13
28	301157	华塑科技	6,800	353,736.00	0.13
29	002380	科远智慧	13,000	353,600.00	0.13
30	300804	广康生化	10,100	353,500.00	0.13
31	003017	大洋生物	11,800	352,348.00	0.13
32	002921	联诚精密	20,700	352,314.00	0.13
33	300922	天秦装备	15,400	352,198.00	0.13
34	001389	广合科技	4,300	351,009.00	0.13
35	603029	天鹅股份	19,200	350,208.00	0.13
36	301503	智迪科技	9,700	349,782.00	0.13
37	301337	亚华电子	12,700	349,377.00	0.13
38	003015	日久光电	22,300	347,880.00	0.13
39	300756	金马游乐	6,100	346,968.00	0.13
40	002861	瀛通通讯	19,400	345,126.00	0.12

41	688496	清越科技	58,100	345,114.00	0.12
42	301202	朗威股份	8,500	343,400.00	0.12
43	001333	光华股份	15,900	341,850.00	0.12
44	300001	特锐德	13,300	341,544.00	0.12
45	603926	铁流股份	19,900	339,693.00	0.12
46	300329	海伦钢琴	20,900	338,371.00	0.12
47	000506	招金黄金	25,900	338,254.00	0.12
48	301607	富特科技	8,400	336,924.00	0.12
49	301251	威尔高	6,400	334,592.00	0.12
50	301168	通灵股份	7,000	326,900.00	0.12
51	300614	百川畅银	25,600	324,608.00	0.12
52	300126	锐奇股份	37,900	324,424.00	0.12
53	301178	天亿马	6,600	323,928.00	0.12
54	688377	迪威尔	8,800	322,960.00	0.12
55	300597	吉大通信	34,600	319,704.00	0.12
56	600539	狮头股份	31,400	319,652.00	0.12
57	301359	东南电子	16,700	319,304.00	0.12
58	688216	气派科技	14,322	319,094.16	0.12
59	688215	瑞晟智能	4,400	319,044.00	0.12
60	301037	保立佳	22,100	318,240.00	0.12
61	300715	凯伦股份	30,400	317,376.00	0.11
62	603139	康惠股份	15,500	317,285.00	0.11
63	603335	迪生力	56,300	316,969.00	0.11
64	002319	乐通股份	26,300	316,652.00	0.11
65	605287	德才股份	12,200	316,224.00	0.11
66	688021	奥福科技	17,200	315,620.00	0.11
67	688296	和达科技	23,805	315,416.25	0.11
68	301192	泰祥股份	10,600	314,714.00	0.11
69	300929	华骐环保	29,200	313,900.00	0.11
70	300998	宁波方正	14,300	313,313.00	0.11
71	600715	文投控股	143,700	313,266.00	0.11
72	300572	安车检测	11,000	312,730.00	0.11
73	300163	先锋新材	77,000	311,850.00	0.11
74	300931	通用电梯	28,100	311,067.00	0.11
75	002890	弘宇股份	21,300	310,980.00	0.11
76	603330	天洋新材	42,700	309,148.00	0.11
77	600543	莫高股份	58,200	309,042.00	0.11
78	000952	广济药业	43,900	308,617.00	0.11
79	300889	爱克股份	14,900	308,430.00	0.11
80	600303	曙光股份	94,600	308,396.00	0.11
81	301379	天山电子	11,900	307,615.00	0.11
82	605277	新亚电子	13,900	305,800.00	0.11
83	002443	金洲管道	37,300	304,368.00	0.11

84	603391	力聚热能	4,600	301,162.00	0.11
85	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.05
86	688805	健信超导	2,643	108,786.97	0.04
87	688802	沐曦股份	118	65,197.58	0.02
88	688790	昂瑞微	139	19,684.90	0.01
89	688809	强一股份	89	18,094.59	0.01
90	301638	南网数字	1,025	14,565.25	0.01
91	688727	恒坤新材	412	14,366.44	0.01
92	688807	优迅股份	105	14,233.80	0.01
93	688795	摩尔线程	30	12,485.40	0.00
94	688796	百奥赛图	237	10,013.25	0.00
95	001386	马可波罗	510	9,450.30	0.00
96	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00
97	001233	海安集团	162	8,404.56	0.00
98	301449	天溯计量	112	7,305.76	0.00
99	688783	西安奕材	373	6,848.28	0.00
100	001369	双欣环保	476	6,135.64	0.00
101	688759	必贝特	233	5,850.63	0.00
102	603175	超颖电子	108	5,244.48	0.00
103	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
104	603092	德力佳	70	3,896.20	0.00
105	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
106	603334	丰倍生物	88	2,888.16	0.00
107	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 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	300323	华灿光电	14,654,617.00	23.92
2	688432	有研硅	13,239,336.49	21.61
3	300747	锐科激光	13,169,885.14	21.50
4	300183	东软载波	12,789,535.00	20.88
5	605376	博迁新材	12,650,816.21	20.65
6	600100	同方股份	12,368,434.00	20.19
7	000899	赣能股份	11,570,861.00	18.89
8	603057	紫燕食品	11,444,133.00	18.68
9	603197	保隆科技	10,896,307.80	17.79
10	300088	长信科技	10,842,766.00	17.70
11	688321	微芯生物	10,812,302.50	17.65
12	688556	高测股份	10,809,806.60	17.65
13	301090	华润材料	10,559,062.00	17.24
14	688270	臻镭科技	10,293,297.17	16.80
15	688536	思瑞浦	10,175,630.70	16.61

16	688289	圣湘生物	9,955,067.46	16.25
17	002928	华夏航空	9,649,480.00	15.75
18	601778	晶科科技	9,482,621.00	15.48
19	600776	东方通信	9,472,287.66	15.46
20	301327	华宝新能	9,415,876.56	15.37
21	002706	良信股份	9,335,729.00	15.24
22	603612	索通发展	9,332,494.80	15.23
23	688739	成大生物	9,146,739.10	14.93
24	603008	喜临门	9,131,695.00	14.91
25	002913	奥士康	9,090,493.00	14.84
26	688146	中船特气	9,063,955.26	14.80
27	600557	康缘药业	9,032,628.00	14.74
28	002275	桂林三金	9,010,736.00	14.71
29	002020	京新药业	8,986,003.00	14.67
30	600335	国机汽车	8,821,824.32	14.40
31	300682	朗新科技	8,757,631.00	14.30
32	000552	甘肃能化	8,741,763.00	14.27
33	000686	东北证券	8,652,446.73	14.12
34	605020	永和股份	8,650,552.73	14.12
35	600478	科力远	8,628,454.00	14.08
36	600933	爱柯迪	8,590,763.00	14.02
37	688001	华兴源创	8,508,085.94	13.89
38	600812	华北制药	8,419,781.31	13.74
39	002643	万润股份	8,385,400.00	13.69
40	688063	派能科技	8,348,163.56	13.63
41	300232	洲明科技	8,327,074.00	13.59
42	300672	国科微	8,298,063.00	13.55
43	600572	康恩贝	8,284,236.00	13.52
44	600997	开滦股份	8,268,292.40	13.50
45	002315	焦点科技	8,264,959.00	13.49
46	301268	铭利达	8,225,848.00	13.43
47	300687	赛意信息	8,223,993.00	13.42
48	000766	通化金马	8,189,902.00	13.37
49	600389	江山股份	8,134,469.85	13.28
50	300315	掌趣科技	8,111,989.00	13.24
51	600151	航天机电	8,100,370.00	13.22
52	002911	佛燃能源	8,098,320.68	13.22
53	301376	致欧科技	8,079,100.00	13.19
54	300261	雅本化学	8,069,463.00	13.17
55	300393	中来股份	8,043,761.94	13.13
56	002239	奥特佳	7,921,222.00	12.93
57	300702	天宇股份	7,886,993.60	12.87
58	688206	概伦电子	7,872,087.64	12.85

59	300678	中科信息	7,798,793.78	12.73
60	002093	国脉科技	7,781,934.00	12.70
61	002215	诺普信	7,771,304.00	12.69
62	002815	崇达技术	7,770,333.00	12.68
63	002468	申通快递	7,728,770.00	12.62
64	000990	诚志股份	7,698,181.00	12.57
65	301095	广立微	7,689,610.00	12.55
66	002511	中顺洁柔	7,687,267.00	12.55
67	301031	中熔电气	7,677,617.76	12.53
68	603056	德邦股份	7,658,331.00	12.50
69	600252	中恒集团	7,623,396.89	12.44
70	600033	福建高速	7,595,698.00	12.40
71	301556	托普云农	7,590,484.53	12.39
72	000767	晋控电力	7,518,105.00	12.27
73	688696	极米科技	7,472,501.95	12.20
74	300596	利安隆	7,446,084.00	12.15
75	301511	德福科技	7,409,673.00	12.10
76	600604	市北高新	7,381,313.00	12.05
77	603297	永新光学	7,376,568.67	12.04
78	600211	西藏药业	7,364,699.70	12.02
79	688352	硕中科技	7,304,724.47	11.92
80	002212	天融信	7,289,152.00	11.90
81	600963	岳阳林纸	7,254,478.00	11.84
82	300493	润欣科技	7,248,058.00	11.83
83	688639	华恒生物	7,236,620.57	11.81
84	600366	宁波韵升	7,224,617.00	11.79
85	300036	超图软件	7,211,645.00	11.77
86	002544	普天科技	7,202,348.00	11.76
87	300119	瑞普生物	7,156,281.68	11.68
88	600185	珠兔集团	7,154,680.00	11.68
89	301262	海看股份	7,141,127.29	11.66
90	000676	智度股份	7,124,601.00	11.63
91	300348	长亮科技	7,066,648.00	11.54
92	300602	飞荣达	7,063,919.00	11.53
93	300077	国民技术	7,043,355.90	11.50
94	600864	哈投股份	7,036,297.55	11.49
95	301050	雷电微力	7,019,507.88	11.46
96	688503	聚和材料	7,002,398.67	11.43
97	002745	木林森	6,997,145.00	11.42
98	300926	博俊科技	6,990,331.49	11.41
99	301381	赛维时代	6,916,542.00	11.29
100	600125	铁龙物流	6,904,676.00	11.27
101	300821	东岳硅材	6,886,139.00	11.24

102	603505	金石资源	6,869,000.80	11.21
103	688337	普源精电	6,854,102.11	11.19
104	603128	华贸物流	6,845,859.00	11.18
105	605577	龙版传媒	6,834,099.00	11.16
106	300416	苏试试验	6,825,032.46	11.14
107	000935	四川双马	6,800,035.61	11.10
108	603919	金徽酒	6,791,916.86	11.09
109	001339	智微智能	6,784,578.00	11.08
110	002243	力合科创	6,736,878.00	11.00
111	605123	派克新材	6,718,095.00	10.97
112	688629	华丰科技	6,689,393.24	10.92
113	002421	达实智能	6,688,233.00	10.92
114	600057	厦门象屿	6,679,356.00	10.90
115	000927	中国铁物	6,679,235.00	10.90
116	300134	大富科技	6,636,138.00	10.83
117	603713	密尔克卫	6,632,874.00	10.83
118	301339	通行宝	6,632,612.20	10.83
119	688062	迈威生物	6,615,016.89	10.80
120	300443	金雷股份	6,581,068.63	10.74
121	002015	协鑫能科	6,575,403.20	10.73
122	600618	氯碱化工	6,575,175.00	10.73
123	300031	宝通科技	6,541,202.00	10.68
124	605333	沪光股份	6,528,895.45	10.66
125	600621	华鑫股份	6,503,443.76	10.62
126	002925	盈趣科技	6,475,013.80	10.57
127	603227	雪峰科技	6,472,422.73	10.57
128	601096	宏盛华源	6,460,917.00	10.55
129	002267	陕天然气	6,397,413.00	10.44
130	688372	伟测科技	6,394,407.50	10.44
131	002368	太极股份	6,390,794.00	10.43
132	301177	迪阿股份	6,383,281.00	10.42
133	300079	数码视讯	6,366,059.00	10.39
134	002987	京北方	6,345,197.00	10.36
135	600888	新疆众和	6,333,769.00	10.34
136	002405	四维图新	6,312,489.00	10.30
137	603730	岱美股份	6,269,044.90	10.23
138	688658	悦康药业	6,256,134.01	10.21
139	601609	金田股份	6,242,859.00	10.19
140	301526	国际复材	6,222,412.00	10.16
141	301297	富乐德	6,197,739.00	10.12
142	002100	天康生物	6,194,827.00	10.11
143	600120	浙江东方	6,185,598.00	10.10
144	002675	东诚药业	6,147,941.00	10.04

145	601375	中原证券	6,143,746.00	10.03
146	601369	陕鼓动力	6,100,610.00	9.96
147	002506	协鑫集成	6,094,370.00	9.95
148	002048	宁波华翔	6,075,198.00	9.92
149	600987	航民股份	6,071,073.00	9.91
150	603327	福蓉科技	6,031,262.90	9.85
151	000875	电投绿能	6,024,627.00	9.83
152	001356	富岭股份	6,018,632.04	9.82
153	002960	青鸟消防	6,008,490.64	9.81
154	603888	新华网	6,004,140.62	9.80
155	603690	至纯科技	5,996,963.00	9.79
156	300770	新媒股份	5,993,332.60	9.78
157	301500	飞南资源	5,981,093.45	9.76
158	603638	艾迪精密	5,971,398.30	9.75
159	301592	六九一二	5,941,407.98	9.70
160	688343	云天励飞	5,910,555.23	9.65
161	002434	万里扬	5,893,896.00	9.62
162	000544	中原环保	5,878,675.00	9.60
163	300861	美畅股份	5,841,603.40	9.54
164	600929	雪天盐业	5,816,587.00	9.49
165	688048	长光华芯	5,805,450.57	9.48
166	603220	中贝通信	5,780,388.00	9.44
167	300075	数字政通	5,757,064.80	9.40
168	601020	华钰矿业	5,748,628.00	9.38
169	688185	康希诺	5,723,742.55	9.34
170	002545	东方铁塔	5,721,289.00	9.34
171	600063	皖维高新	5,717,865.00	9.33
172	000030	富奥股份	5,689,972.80	9.29
173	688139	海尔生物	5,653,293.59	9.23
174	300820	英杰电气	5,653,034.00	9.23
175	002183	怡亚通	5,648,953.00	9.22
176	601326	秦港股份	5,630,446.00	9.19
177	300188	国投智能	5,626,422.00	9.18
178	002123	梦网科技	5,615,453.00	9.17
179	300856	科思股份	5,606,052.20	9.15
180	300113	顺网科技	5,601,346.00	9.14
181	002985	北摩高科	5,567,543.00	9.09
182	300224	正海磁材	5,553,367.40	9.07
183	300151	昌红科技	5,525,977.85	9.02
184	600782	新钢股份	5,516,102.59	9.00
185	300811	铂科新材	5,487,215.00	8.96
186	603588	高能环境	5,475,578.00	8.94
187	002151	北斗星通	5,436,420.33	8.87

188	301087	可孚医疗	5,395,874.40	8.81
189	002390	信邦制药	5,374,105.00	8.77
190	300337	银邦股份	5,369,354.00	8.76
191	601200	上海环境	5,362,249.54	8.75
192	600821	金开新能	5,353,758.00	8.74
193	002484	江海股份	5,344,651.00	8.72
194	300726	宏达电子	5,325,359.00	8.69
195	300768	迪普科技	5,319,350.50	8.68
196	600059	古越龙山	5,295,194.00	8.64
197	002079	苏州固锝	5,287,183.00	8.63
198	688575	亚辉龙	5,286,833.66	8.63
199	301522	上大股份	5,282,700.00	8.62
200	000758	中色股份	5,263,466.37	8.59
201	002807	江阴银行	5,254,535.00	8.58
202	002378	章源钨业	5,250,786.00	8.57
203	002399	海普瑞	5,248,173.80	8.57
204	000682	东方电子	5,195,241.00	8.48
205	002036	联创电子	5,194,800.00	8.48
206	600869	远东股份	5,189,077.89	8.47
207	600458	时代新材	5,186,347.00	8.47
208	688141	杰华特	5,168,686.41	8.44
209	300761	立华股份	5,160,890.00	8.42
210	688403	汇成股份	5,152,642.81	8.41
211	300101	振芯科技	5,149,189.00	8.41
212	002761	浙江建投	5,113,845.00	8.35
213	002626	金达威	5,107,131.62	8.34
214	000966	长源电力	5,106,170.00	8.34
215	688083	中望软件	5,084,958.95	8.30
216	002967	广电计量	5,051,480.00	8.25
217	601069	西部黄金	5,049,648.00	8.24
218	301363	美好医疗	5,033,651.02	8.22
219	301611	珂玛科技	5,030,294.00	8.21
220	688700	东威科技	5,016,013.07	8.19
221	688091	上海谊众	5,015,840.27	8.19
222	000672	上峰水泥	5,009,138.89	8.18
223	600550	保变电气	5,003,796.00	8.17
224	000089	深圳机场	5,002,288.71	8.17
225	688209	英集芯	4,999,490.62	8.16
226	300166	东方国信	4,992,866.00	8.15
227	688131	皓元医药	4,984,693.35	8.14
228	688351	微电生理	4,960,012.90	8.10
229	601208	东材科技	4,948,190.00	8.08
230	000058	深赛格	4,939,998.98	8.06

231	600664	哈药股份	4,915,259.00	8.02
232	688252	天德钰	4,913,504.61	8.02
233	600395	盘江股份	4,900,534.00	8.00
234	600746	江苏索普	4,889,288.00	7.98
235	600635	大众公用	4,881,152.00	7.97
236	600269	赣粤高速	4,862,456.00	7.94
237	688127	蓝特光学	4,848,152.68	7.91
238	002126	银轮股份	4,841,033.00	7.90
239	300409	道氏技术	4,815,774.23	7.86
240	603678	火炬电子	4,811,030.00	7.85
241	002537	海联金汇	4,805,907.00	7.85
242	600780	通宝能源	4,805,768.00	7.84
243	002158	汉钟精机	4,798,641.00	7.83
244	600850	电科数字	4,784,681.00	7.81
245	600577	精达股份	4,760,592.86	7.77
246	000603	盛达资源	4,757,966.00	7.77
247	603997	继峰股份	4,750,361.00	7.75
248	002947	恒铭达	4,731,493.00	7.72
249	002959	小熊电器	4,715,849.80	7.70
250	002204	大连重工	4,702,798.00	7.68
251	300618	寒锐钴业	4,694,659.00	7.66
252	002268	电科网安	4,688,595.96	7.65
253	688390	固德威	4,688,275.94	7.65
254	688003	天准科技	4,683,132.06	7.64
255	603218	日月股份	4,665,814.00	7.62
256	600645	中源协和	4,663,339.00	7.61
257	688105	诺唯赞	4,657,699.98	7.60
258	001236	弘业期货	4,654,356.00	7.60
259	300634	彩讯股份	4,653,280.00	7.60
260	688515	裕太微	4,650,463.26	7.59
261	002317	众生药业	4,619,399.00	7.54
262	600507	方大特钢	4,613,229.00	7.53
263	002489	浙江永强	4,598,402.00	7.51
264	600757	长江传媒	4,596,697.00	7.50
265	003012	东鹏控股	4,590,809.00	7.49
266	688400	凌云光	4,590,534.66	7.49
267	000517	荣安地产	4,583,196.00	7.48
268	600993	马应龙	4,551,065.00	7.43
269	688088	虹软科技	4,545,335.22	7.42
270	301217	铜冠铜箔	4,521,237.00	7.38
271	600480	凌云股份	4,518,613.54	7.38
272	600006	东风股份	4,515,083.00	7.37
273	600305	恒顺醋业	4,513,536.16	7.37

274	002154	报喜鸟	4,510,905.00	7.36
275	002901	大博医疗	4,483,832.00	7.32
276	601137	博威合金	4,477,674.36	7.31
277	300171	东富龙	4,465,918.00	7.29
278	601677	明泰铝业	4,457,722.00	7.28
279	603055	台华新材	4,452,398.00	7.27
280	603103	横店影视	4,437,992.00	7.24
281	002034	旺能环境	4,437,800.00	7.24
282	002233	塔牌集团	4,434,955.00	7.24
283	688586	江航装备	4,433,466.01	7.24
284	300773	拉卡拉	4,428,388.00	7.23
285	300776	帝尔激光	4,412,765.74	7.20
286	000503	国新健康	4,389,997.83	7.17
287	301622	英思特	4,367,265.76	7.13
288	301508	中机认检	4,361,515.97	7.12
289	600728	佳都科技	4,337,883.00	7.08
290	300613	富瀚微	4,319,372.90	7.05
291	601900	南方传媒	4,303,265.23	7.02
292	600037	歌华有线	4,299,928.98	7.02
293	688326	经纬恒润	4,254,022.17	6.94
294	600966	博汇纸业	4,251,844.00	6.94
295	300925	法本信息	4,245,833.00	6.93
296	000727	冠捷科技	4,237,793.00	6.92
297	688331	荣昌生物	4,237,765.25	6.92
298	002324	普利特	4,216,104.40	6.88
299	001301	尚太科技	4,215,996.00	6.88
300	002651	利君股份	4,209,865.00	6.87
301	301238	瑞泰新材	4,195,032.00	6.85
302	688362	甬矽电子	4,189,438.06	6.84
303	002859	洁美科技	4,184,917.00	6.83
304	300130	新国都	4,184,112.00	6.83
305	603299	苏盐井神	4,175,183.00	6.82
306	300685	艾德生物	4,149,501.00	6.77
307	300870	欧陆通	4,138,193.00	6.76
308	601107	四川成渝	4,128,433.00	6.74
309	600273	嘉化能源	4,128,174.00	6.74
310	688336	三生国健	4,123,142.83	6.73
311	688322	奥比中光	4,107,071.75	6.70
312	603026	石大胜华	4,094,158.00	6.68
313	600072	中船科技	4,084,798.00	6.67
314	603698	航天工程	4,078,523.00	6.66
315	300579	数字认证	4,077,554.00	6.66
316	300663	科蓝软件	4,072,253.00	6.65

317	002127	南极电商	4,066,524.00	6.64
318	605507	国邦医药	4,060,463.00	6.63
319	600320	振华重工	4,056,405.00	6.62
320	601038	一拖股份	4,056,037.00	6.62
321	002060	广东建工	4,041,339.00	6.60
322	002292	奥飞娱乐	4,037,358.00	6.59
323	002045	国光电器	4,029,728.79	6.58
324	603496	恒为科技	4,018,689.00	6.56
325	002302	西部建设	4,005,161.00	6.54
326	000885	城发环境	3,972,170.00	6.48
327	002171	楚江新材	3,969,120.69	6.48
328	603279	景津装备	3,948,580.80	6.45
329	688690	纳微科技	3,948,268.02	6.45
330	600775	南京熊猫	3,946,620.00	6.44
331	603733	仙鹤股份	3,935,401.49	6.42
332	000969	安泰科技	3,924,959.99	6.41
333	300226	上海钢联	3,921,958.41	6.40
334	600449	宁夏建材	3,916,684.99	6.39
335	688147	微导纳米	3,915,017.64	6.39
336	300257	开山股份	3,906,748.00	6.38
337	300034	钢研高纳	3,898,599.40	6.36
338	002237	恒邦股份	3,891,300.00	6.35
339	002777	久远银海	3,884,877.00	6.34
340	605168	三人行	3,873,678.00	6.32
341	301171	易点天下	3,872,262.00	6.32
342	002498	汉缆股份	3,868,591.00	6.32
343	603132	金徽股份	3,865,614.00	6.31
344	300428	立中集团	3,863,400.31	6.31
345	000810	创维数字	3,862,375.00	6.30
346	300406	九强生物	3,857,852.00	6.30
347	688029	南微医学	3,846,229.86	6.28
348	000881	中广核技	3,836,259.00	6.26
349	002270	华明装备	3,830,510.00	6.25
350	688389	普门科技	3,819,133.17	6.23
351	301316	慧博云通	3,813,769.00	6.23
352	002690	美亚光电	3,796,382.00	6.20
353	301571	国科天成	3,778,493.37	6.17
354	300180	华峰超纤	3,776,279.00	6.16
355	300463	迈克生物	3,772,636.00	6.16
356	300674	宇信科技	3,768,063.00	6.15
357	603009	北特科技	3,759,973.06	6.14
358	601952	苏垦农发	3,759,046.00	6.14
359	601702	华峰铝业	3,757,558.00	6.13

360	601595	上海电影	3,756,959.36	6.13
361	002216	三全食品	3,752,418.00	6.13
362	000612	焦作万方	3,744,905.00	6.11
363	600446	金证股份	3,737,774.00	6.10
364	000065	北方国际	3,737,277.00	6.10
365	688016	心脉医疗	3,723,496.70	6.08
366	601163	三角轮胎	3,723,371.00	6.08
367	300850	新强联	3,690,804.00	6.02
368	603915	国茂股份	3,678,671.00	6.01
369	603194	中力股份	3,669,309.71	5.99
370	300953	震裕科技	3,663,573.00	5.98
371	000048	京基智农	3,660,231.60	5.97
372	300327	中颖电子	3,658,721.00	5.97
373	688128	中国电研	3,655,702.10	5.97
374	688106	金宏气体	3,642,523.88	5.95
375	600452	涪陵电力	3,615,216.20	5.90
376	002043	兔宝宝	3,611,375.64	5.90
377	000019	深粮控股	3,610,364.00	5.89
378	600017	日照港	3,598,592.00	5.87
379	600301	华锡有色	3,593,191.00	5.87
380	002897	意华股份	3,592,358.75	5.86
381	300457	赢合科技	3,585,092.46	5.85
382	603337	杰克科技	3,578,834.00	5.84
383	600158	中体产业	3,577,804.00	5.84
384	600996	贵广网络	3,574,837.00	5.84
385	000917	电广传媒	3,565,279.00	5.82
386	002149	西部材料	3,558,047.00	5.81
387	000690	宝新能源	3,554,327.00	5.80
388	688596	正帆科技	3,551,334.42	5.80
389	001914	招商积余	3,538,858.00	5.78
390	003039	顺控发展	3,534,867.00	5.77
391	688123	聚辰股份	3,533,607.59	5.77
392	600133	东湖高新	3,524,962.00	5.75
393	601801	皖新传媒	3,515,944.00	5.74
394	002833	弘亚数控	3,506,199.20	5.72
395	002895	川恒股份	3,495,557.00	5.71
396	601528	瑞丰银行	3,492,183.00	5.70
397	002006	精工科技	3,490,870.00	5.70
398	688686	奥普特	3,479,587.64	5.68
399	600787	中储股份	3,478,638.00	5.68
400	000848	承德露露	3,475,236.00	5.67
401	002182	宝武镁业	3,473,217.00	5.67
402	002254	泰和新材	3,465,584.85	5.66

403	002053	云南能投	3,459,577.00	5.65
404	688208	道通科技	3,457,388.09	5.64
405	600055	万东医疗	3,443,457.37	5.62
406	000012	南玻A	3,440,144.98	5.62
407	000735	罗牛山	3,438,813.00	5.61
408	600717	天津港	3,424,476.00	5.59
409	688443	智翔金泰	3,423,146.71	5.59
410	300598	诚迈科技	3,408,123.00	5.56
411	600789	鲁抗医药	3,405,850.00	5.56
412	000685	中山公用	3,395,237.00	5.54
413	300638	广和通	3,393,003.00	5.54
414	001287	中电港	3,379,513.00	5.52
415	300593	新雷能	3,369,415.64	5.50
416	000581	威孚高科	3,357,992.00	5.48
417	301035	润丰股份	3,334,401.00	5.44
418	600331	宏达股份	3,328,801.00	5.43
419	600490	鹏欣资源	3,310,807.00	5.40
420	688333	铂力特	3,303,535.72	5.39
421	002004	华邦健康	3,257,695.00	5.32
422	688050	爱博医疗	3,237,591.62	5.29
423	001311	多利科技	3,235,445.60	5.28
424	300009	安科生物	3,232,204.00	5.28
425	301215	中汽股份	3,212,171.00	5.24
426	688798	艾为电子	3,210,761.26	5.24
427	003006	百亚股份	3,210,252.33	5.24
428	600477	杭萧钢构	3,200,759.00	5.22
429	300236	上海新阳	3,190,180.00	5.21
430	000828	东莞控股	3,186,187.00	5.20
431	300827	上能电气	3,146,376.59	5.14
432	002096	易普力	3,140,414.00	5.13
433	300475	香农芯创	3,116,646.00	5.09
434	002605	姚记科技	3,105,469.00	5.07
435	603300	海南华铁	3,084,786.00	5.04
436	301153	中科江南	3,070,099.00	5.01
437	002400	省广集团	3,067,118.00	5.01
438	601068	中铝国际	3,051,147.00	4.98
439	300296	利亚德	3,050,159.00	4.98
440	600961	株冶集团	3,048,287.00	4.98
441	002531	天顺风能	3,039,649.00	4.96
442	600531	豫光金铅	3,028,234.00	4.94
443	600201	生物股份	3,027,909.80	4.94
444	603093	南华期货	3,021,978.00	4.93
445	600967	内蒙一机	3,018,338.00	4.93

446	301109	军信股份	3,017,534.70	4.93
447	300772	运达股份	2,988,262.00	4.88
448	002697	红旗连锁	2,981,750.05	4.87
449	688006	杭可科技	2,980,730.21	4.87
450	603305	旭升集团	2,979,579.19	4.86
451	002265	建设工业	2,978,774.00	4.86
452	600179	安通控股	2,976,137.00	4.86
453	301510	固高科技	2,973,556.00	4.85
454	300185	通裕重工	2,966,380.00	4.84
455	300855	图南股份	2,952,750.00	4.82
456	301029	怡合达	2,951,836.66	4.82
457	001258	立新能源	2,943,784.00	4.81
458	600601	方正科技	2,931,585.00	4.79
459	002219	新里程	2,930,427.00	4.78
460	688150	莱特光电	2,929,863.02	4.78
461	603636	南威软件	2,915,703.00	4.76
462	605090	九丰能源	2,907,947.00	4.75
463	000650	仁和药业	2,902,885.00	4.74
464	688380	中微半导	2,882,755.56	4.71
465	000025	特力A	2,877,416.00	4.70
466	002258	利尔化学	2,859,480.69	4.67
467	002274	华昌化工	2,858,088.97	4.67
468	600266	城建发展	2,850,568.00	4.65
469	002091	江苏国泰	2,821,865.00	4.61
470	603613	国联股份	2,820,350.00	4.60
471	688631	莱斯信息	2,819,125.75	4.60
472	002416	爱施德	2,818,074.00	4.60
473	600259	中稀有金	2,816,328.00	4.60
474	603766	隆鑫通用	2,815,225.00	4.60
475	601101	昊华能源	2,812,224.00	4.59
476	603619	中曼石油	2,811,529.83	4.59
477	300456	赛微电子	2,807,477.00	4.58
478	300576	容大感光	2,787,301.00	4.55
479	603267	鸿远电子	2,783,241.00	4.54
480	600073	光明肉业	2,776,676.00	4.53
481	002061	浙江交科	2,770,952.60	4.52
482	605116	奥锐特	2,764,142.00	4.51
483	300482	万孚生物	2,764,024.32	4.51
484	603236	移远通信	2,740,907.00	4.47
485	001337	四川黄金	2,740,193.00	4.47
486	000968	蓝焰控股	2,738,674.56	4.47
487	002550	千红制药	2,731,545.00	4.46
488	002063	远光软件	2,729,519.65	4.46

489	688543	国科军工	2,724,735.74	4.45
490	688548	广钢气体	2,718,513.34	4.44
491	002011	盾安环境	2,692,729.00	4.40
492	600020	中原高速	2,678,214.00	4.37
493	000600	建投能源	2,669,981.00	4.36
494	300083	创世纪	2,664,329.00	4.35
495	600586	金晶科技	2,655,387.00	4.33
496	002612	朗姿股份	2,651,732.00	4.33
497	688166	博瑞医药	2,635,948.06	4.30
498	300284	苏交科	2,630,076.00	4.29
499	688523	航天环宇	2,626,896.63	4.29
500	600916	中国黄金	2,615,169.00	4.27
501	688276	百克生物	2,588,682.34	4.23
502	600575	淮河能源	2,585,567.00	4.22
503	601311	骆驼股份	2,585,467.70	4.22
504	600976	健民集团	2,563,532.00	4.18
505	002936	郑州银行	2,556,719.00	4.17
506	300363	博腾股份	2,542,456.00	4.15
507	300470	中密控股	2,510,583.00	4.10
508	603348	文灿股份	2,498,585.00	4.08
509	300401	花园生物	2,489,050.00	4.06
510	601126	四方股份	2,477,322.00	4.04
511	600313	农发种业	2,459,410.00	4.01
512	600216	浙江医药	2,455,098.77	4.01
513	300917	特发服务	2,449,927.00	4.00
514	603306	华懋科技	2,444,994.00	3.99
515	002840	华统股份	2,427,783.00	3.96
516	600729	重庆百货	2,422,895.00	3.96
517	002705	新宝股份	2,409,747.55	3.93
518	600552	凯盛科技	2,394,018.00	3.91
519	300570	太辰光	2,371,764.00	3.87
520	002396	星网锐捷	2,363,280.00	3.86
521	002023	海特高新	2,339,072.00	3.82
522	600874	创业环保	2,333,469.00	3.81
523	688262	国芯科技	2,303,408.54	3.76
524	603508	思维列控	2,301,946.00	3.76
525	688327	云从科技	2,300,832.31	3.76
526	600338	西藏珠峰	2,294,757.00	3.75
527	300620	光库科技	2,289,348.00	3.74
528	000498	山东路桥	2,260,341.00	3.69
529	300085	银之杰	2,257,373.00	3.68
530	002516	旷达科技	2,256,606.00	3.68
531	300705	九典制药	2,253,141.00	3.68

532	688007	光峰科技	2,249,596.24	3.67
533	301606	绿联科技	2,243,684.00	3.66
534	688522	纳睿雷达	2,223,232.75	3.63
535	002497	雅化集团	2,213,659.00	3.61
536	688717	艾罗能源	2,203,626.56	3.60
537	000930	中粮科技	2,185,617.98	3.57
538	605009	豪悦护理	2,175,847.25	3.55
539	300319	麦捷科技	2,152,958.00	3.51
540	000059	华锦股份	2,137,922.00	3.49
541	601969	海南矿业	2,126,108.00	3.47
542	000915	华特达因	2,121,998.00	3.46
543	002779	中坚科技	2,119,832.00	3.46
544	600075	新疆天业	2,106,725.00	3.44
545	600640	国脉文化	2,094,594.00	3.42
546	301155	海力风电	2,085,401.00	3.40
547	688652	京仪装备	2,072,868.23	3.38
548	600662	外服控股	2,072,324.00	3.38
549	000049	德赛电池	2,057,056.00	3.36
550	603533	掌阅科技	2,033,658.00	3.32
551	600633	浙数文化	2,012,193.00	3.28
552	300548	长芯博创	2,011,994.00	3.28
553	600210	紫江企业	2,004,923.00	3.27
554	600882	妙可蓝多	1,993,368.00	3.25
555	300303	聚飞光电	1,987,366.00	3.24
556	000680	山推股份	1,986,314.00	3.24
557	002354	天娱数科	1,970,987.00	3.22
558	603118	共进股份	1,933,214.55	3.16
559	603876	鼎胜新材	1,929,296.20	3.15
560	002993	奥海科技	1,923,874.00	3.14
561	300415	伊之密	1,918,599.00	3.13
562	601777	千里科技	1,912,277.00	3.12
563	600169	ST 太重	1,904,265.00	3.11
564	600675	中华企业	1,886,306.00	3.08
565	002249	大洋电机	1,885,748.00	3.08
566	688612	威迈斯	1,881,094.77	3.07
567	600206	有研新材	1,866,930.00	3.05
568	002588	史丹利	1,854,143.00	3.03
569	000550	江铃汽车	1,849,393.50	3.02
570	688027	国盾量子	1,845,371.84	3.01
571	300080	易成新能	1,842,003.00	3.01
572	603013	亚普股份	1,834,999.00	3.00
573	603301	振德医疗	1,833,206.00	2.99
574	688584	上海合晶	1,830,243.63	2.99

575	300666	江丰电子	1,825,086.00	2.98
576	600641	先导基电	1,823,970.00	2.98
577	300657	弘信电子	1,822,009.00	2.97
578	600459	贵研铂业	1,814,208.95	2.96
579	603609	禾丰股份	1,795,140.00	2.93
580	688097	博众精工	1,775,090.09	2.90
581	000090	天健集团	1,769,081.30	2.89
582	600114	东睦股份	1,752,782.00	2.86
583	002245	蔚蓝锂芯	1,745,426.00	2.85
584	002075	沙钢股份	1,740,547.42	2.84
585	688300	联瑞新材	1,731,390.72	2.83
586	600388	龙净环保	1,723,424.00	2.81
587	688789	宏华数科	1,714,307.16	2.80
588	600718	东软集团	1,713,317.00	2.80
589	601811	新华文轩	1,700,199.00	2.78
590	002488	金固股份	1,696,614.00	2.77
591	002891	中宠股份	1,672,131.00	2.73
592	603039	泛微网络	1,670,215.00	2.73
593	300777	中简科技	1,667,323.00	2.72
594	600649	城投控股	1,665,583.00	2.72
595	603328	依顿电子	1,661,766.00	2.71
596	603219	富佳股份	1,659,589.00	2.71
597	600428	中远海特	1,657,784.00	2.71
598	600195	中牧股份	1,651,402.43	2.70
599	000950	重药控股	1,650,839.00	2.69
600	600773	西藏城投	1,644,906.00	2.69
601	603920	世运电路	1,634,816.00	2.67
602	002716	湖南白银	1,627,829.00	2.66
603	002585	双星新材	1,624,359.87	2.65
604	002906	华阳集团	1,620,162.00	2.64
605	002221	东华能源	1,617,190.00	2.64
606	688177	百奥泰	1,610,595.91	2.63
607	002649	博彦科技	1,600,944.00	2.61
608	002101	广东鸿图	1,600,577.00	2.61
609	603393	新天然气	1,594,258.00	2.60
610	688298	东方生物	1,580,470.21	2.58
611	600986	浙文互联	1,577,895.00	2.58
612	002654	万润科技	1,567,818.00	2.56
613	000737	北方铜业	1,562,348.02	2.55
614	600750	华润江中	1,557,699.00	2.54
615	002332	仙琚制药	1,552,716.00	2.53
616	603530	神马电力	1,551,196.00	2.53
617	603043	广州酒家	1,548,708.00	2.53

618	601827	三峰环境	1,543,800.00	2.52
619	002226	江南化工	1,542,182.60	2.52
620	002174	游族网络	1,539,457.00	2.51
621	002755	奥赛康	1,538,443.00	2.51
622	600502	安徽建工	1,529,403.40	2.50
623	301239	普瑞眼科	1,526,012.00	2.49
624	000555	神州信息	1,521,692.00	2.48
625	603583	捷昌驱动	1,494,911.00	2.44
626	300357	我武生物	1,493,745.00	2.44
627	600330	天通股份	1,490,495.63	2.43
628	002326	永太科技	1,489,433.00	2.43
629	605222	起帆电缆	1,469,564.00	2.40
630	600710	苏美达	1,468,058.00	2.40
631	603699	纽威股份	1,467,924.00	2.40
632	301039	中集车辆	1,466,336.00	2.39
633	300693	盛弘股份	1,461,823.00	2.39
634	600422	昆药集团	1,445,155.00	2.36
635	688018	乐鑫科技	1,442,186.23	2.35
636	600866	星湖科技	1,442,117.00	2.35
637	601886	江河集团	1,432,883.00	2.34
638	002847	盐津铺子	1,426,839.00	2.33
639	002701	奥瑞金	1,423,746.00	2.32
640	002176	江特电机	1,423,137.00	2.32
641	600094	大名城	1,422,627.00	2.32
642	600058	五矿发展	1,417,035.00	2.31
643	688392	骄成超声	1,394,773.03	2.28
644	688315	诺禾致源	1,389,391.96	2.27
645	688766	普冉股份	1,388,805.63	2.27
646	300398	飞凯材料	1,384,885.00	2.26
647	300102	乾照光电	1,382,608.00	2.26
648	301589	诺瓦星云	1,380,654.00	2.25
649	301291	明阳电气	1,378,384.00	2.25
650	603075	热威股份	1,377,714.00	2.25
651	000829	天音控股	1,376,205.00	2.25
652	300035	中科电气	1,374,097.00	2.24
653	300049	福瑞医科	1,372,409.00	2.24
654	300869	康泰医学	1,372,162.00	2.24
655	688200	华峰测控	1,364,113.44	2.23
656	000719	中原传媒	1,358,668.00	2.22
657	000902	新洋丰	1,358,317.00	2.22
658	002194	武汉凡谷	1,354,734.80	2.21
659	001322	箭牌家居	1,346,194.00	2.20
660	300432	富临精工	1,345,664.00	2.20

661	300438	鹏辉能源	1,337,743.00	2.18
662	002335	科华数据	1,321,104.00	2.16
663	600771	广誉远	1,318,918.00	2.15
664	601515	衢州东峰	1,318,426.00	2.15
665	688019	安集科技	1,313,829.98	2.14
666	000657	中钨高新	1,312,986.00	2.14
667	600496	精工钢构	1,309,003.00	2.14
668	002139	拓邦股份	1,307,007.00	2.13
669	002222	福晶科技	1,304,809.00	2.13
670	600217	中再资环	1,300,208.00	2.12
671	002518	科士达	1,287,017.93	2.10
672	002635	安洁科技	1,286,204.00	2.10
673	002191	劲嘉股份	1,275,301.00	2.08
674	300184	力源信息	1,262,299.00	2.06
675	600751	海航科技	1,248,707.00	2.04
676	603063	禾望电气	1,248,592.00	2.04
677	301180	万祥科技	1,247,524.00	2.04
678	603989	艾华集团	1,237,682.00	2.02
679	605599	菜百股份	1,234,269.00	2.01
680	605589	圣泉集团	1,226,097.00	2.00
681	000791	甘肃能源	1,225,751.00	2.00
682	688116	天奈科技	1,225,261.85	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。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	300323	华灿光电	14,081,993.37	22.99
2	688432	有研硅	13,224,615.82	21.59
3	605376	博迁新材	12,761,602.00	20.83
4	300747	锐科激光	12,632,732.68	20.62
5	600100	同方股份	12,125,019.00	19.79
6	300183	东软载波	11,813,689.66	19.28
7	000899	赣能股份	11,688,676.00	19.08
8	603057	紫燕食品	11,217,409.00	18.31
9	688556	高测股份	11,196,259.03	18.28
10	301090	华润材料	10,941,973.00	17.86
11	688270	臻镭科技	10,647,837.23	17.38
12	300088	长信科技	10,370,145.00	16.93
13	603197	保隆科技	10,361,628.00	16.91
14	002928	华夏航空	10,191,461.00	16.64
15	688321	微芯生物	10,048,576.87	16.40
16	688536	思瑞浦	9,995,030.17	16.32
17	688289	圣湘生物	9,894,989.49	16.15

18	002706	良信股份	9,838,482.00	16.06
19	301327	华宝新能	9,642,191.89	15.74
20	603612	索通发展	9,438,190.87	15.41
21	601778	晶科科技	9,279,431.00	15.15
22	688739	成大生物	9,160,198.49	14.95
23	002020	京新药业	9,125,417.80	14.90
24	603008	喜临门	9,082,793.00	14.83
25	600776	东方通信	9,028,230.00	14.74
26	688146	中船特气	8,983,879.54	14.67
27	002913	奥士康	8,973,578.48	14.65
28	600812	华北制药	8,857,613.00	14.46
29	600478	科力远	8,752,315.19	14.29
30	600557	康缘药业	8,750,101.13	14.28
31	600335	国机汽车	8,648,100.34	14.12
32	300682	朗新科技	8,604,565.00	14.05
33	002275	桂林三金	8,585,893.05	14.02
34	002643	万润股份	8,554,858.91	13.96
35	000686	东北证券	8,458,015.40	13.81
36	600151	航天机电	8,428,216.07	13.76
37	300393	中来股份	8,418,120.99	13.74
38	300261	雅本化学	8,404,544.00	13.72
39	600997	开滦股份	8,401,141.90	13.71
40	000552	甘肃能化	8,400,643.00	13.71
41	301511	德福科技	8,390,397.60	13.70
42	000766	通化金马	8,367,393.00	13.66
43	688001	华兴源创	8,261,693.61	13.49
44	300672	国科微	8,245,259.00	13.46
45	600389	江山股份	8,212,917.60	13.41
46	301268	铭利达	8,125,821.00	13.26
47	688063	派能科技	8,095,403.88	13.21
48	300821	东岳硅材	8,053,192.00	13.15
49	300232	洲明科技	8,039,397.00	13.12
50	600572	康恩贝	8,029,132.88	13.11
51	605020	永和股份	7,994,097.08	13.05
52	688206	概伦电子	7,977,176.69	13.02
53	002315	焦点科技	7,975,745.44	13.02
54	600033	福建高速	7,968,583.00	13.01
55	600933	爱柯迪	7,948,090.00	12.97
56	600366	宁波韵升	7,869,050.00	12.85
57	002212	天融信	7,868,076.47	12.84
58	600604	市北高新	7,862,852.00	12.84
59	300702	天宇股份	7,826,081.00	12.78
60	300596	利安隆	7,791,637.00	12.72

61	000990	诚志股份	7,758,885.14	12.67
62	603056	德邦股份	7,754,334.00	12.66
63	002093	国脉科技	7,748,601.00	12.65
64	002239	奥特佳	7,677,858.77	12.53
65	688337	普源精电	7,655,067.82	12.50
66	301031	中熔电气	7,607,075.60	12.42
67	300315	掌趣科技	7,602,154.00	12.41
68	603297	永新光学	7,518,692.91	12.27
69	600185	珠免集团	7,483,236.00	12.22
70	300687	赛意信息	7,458,659.00	12.18
71	600618	氯碱化工	7,446,444.00	12.16
72	002215	诺普信	7,445,513.00	12.15
73	301376	致欧科技	7,377,734.65	12.04
74	301095	广立微	7,344,830.00	11.99
75	688629	华丰科技	7,324,750.88	11.96
76	600252	中恒集团	7,298,093.00	11.91
77	002911	佛燃能源	7,278,504.18	11.88
78	603505	金石资源	7,241,236.67	11.82
79	002815	崇达技术	7,234,109.00	11.81
80	000676	智度股份	7,228,958.00	11.80
81	002511	中顺洁柔	7,185,057.99	11.73
82	688503	聚和材料	7,068,675.57	11.54
83	600864	哈投股份	7,048,265.00	11.51
84	300678	中科信息	7,038,816.00	11.49
85	688352	颀中科技	7,034,154.09	11.48
86	301556	托普云农	6,992,679.26	11.41
87	000767	晋控电力	6,967,557.00	11.37
88	603128	华贸物流	6,932,625.10	11.32
89	300416	苏试试验	6,924,151.38	11.30
90	300602	飞荣达	6,892,463.23	11.25
91	002544	普天科技	6,888,579.00	11.24
92	600963	岳阳林纸	6,854,728.90	11.19
93	300119	瑞普生物	6,846,131.00	11.18
94	688639	华恒生物	6,831,074.48	11.15
95	600120	浙江东方	6,822,320.00	11.14
96	300493	润欣科技	6,785,344.00	11.08
97	605123	派克新材	6,783,106.00	11.07
98	300077	国民技术	6,782,226.00	11.07
99	301526	国际复材	6,771,649.00	11.05
100	688048	长光华芯	6,751,442.27	11.02
101	603919	金徽酒	6,750,689.00	11.02
102	300926	博俊科技	6,746,529.00	11.01
103	002468	申通快递	6,722,028.00	10.97

104	000935	四川双马	6,714,127.00	10.96
105	688658	悦康药业	6,702,444.77	10.94
106	688696	极米科技	6,674,843.72	10.90
107	300134	大富科技	6,662,981.28	10.88
108	605577	龙版传媒	6,638,210.00	10.84
109	600211	西藏药业	6,626,084.10	10.82
110	301050	雷电微力	6,589,271.00	10.76
111	300036	超图软件	6,578,193.27	10.74
112	603713	密尔克卫	6,545,462.00	10.68
113	000927	中国铁物	6,530,710.00	10.66
114	600057	厦门象屿	6,504,095.56	10.62
115	300348	长亮科技	6,502,802.00	10.62
116	603327	福蓉科技	6,501,932.50	10.61
117	002405	四维图新	6,481,239.00	10.58
118	002421	达实智能	6,438,233.00	10.51
119	002987	京北方	6,434,590.37	10.50
120	002243	力合科创	6,429,556.07	10.50
121	603227	雪峰科技	6,336,533.72	10.34
122	301262	海看股份	6,307,108.00	10.30
123	600125	铁龙物流	6,281,025.09	10.25
124	002925	盈趣科技	6,277,164.00	10.25
125	301381	赛维时代	6,276,730.00	10.25
126	600621	华鑫股份	6,253,181.00	10.21
127	688062	迈威生物	6,242,687.90	10.19
128	300820	英杰电气	6,201,407.00	10.12
129	300443	金雷股份	6,198,332.00	10.12
130	002745	木林森	6,196,770.00	10.12
131	301339	通行宝	6,173,238.20	10.08
132	601369	陕鼓动力	6,166,655.00	10.07
133	605333	沪光股份	6,147,975.00	10.04
134	002100	天康生物	6,115,021.00	9.98
135	002015	协鑫能科	6,095,984.07	9.95
136	603730	岱美股份	6,093,870.23	9.95
137	603690	至纯科技	6,093,343.00	9.95
138	002183	怡亚通	6,079,877.00	9.92
139	600987	航民股份	6,067,230.10	9.90
140	002506	协鑫集成	6,064,565.00	9.90
141	601096	宏盛华源	6,050,522.00	9.88
142	002267	陕天然气	6,046,037.00	9.87
143	300031	宝通科技	6,045,903.08	9.87
144	002368	太极股份	6,017,949.00	9.82
145	001339	智微智能	6,000,703.00	9.80
146	001356	富岭股份	5,998,336.04	9.79

147	600888	新疆众和	5,997,691.00	9.79
148	300861	美畅股份	5,929,145.60	9.68
149	301297	富乐德	5,922,116.00	9.67
150	000875	电投绿能	5,912,040.00	9.65
151	002960	青鸟消防	5,908,260.22	9.64
152	002434	万里扬	5,860,534.00	9.57
153	000544	中原环保	5,855,272.00	9.56
154	301592	六九一二	5,854,121.54	9.56
155	600577	精达股份	5,849,275.00	9.55
156	603638	艾迪精密	5,837,033.00	9.53
157	002378	章源钨业	5,834,886.70	9.52
158	600929	雪天盐业	5,766,005.00	9.41
159	300151	昌红科技	5,747,886.00	9.38
160	301500	飞南资源	5,736,996.31	9.36
161	688372	伟测科技	5,731,089.39	9.36
162	301177	迪阿股份	5,727,681.00	9.35
163	300075	数字政通	5,694,295.80	9.30
164	600550	保变电气	5,683,823.00	9.28
165	601069	西部黄金	5,679,821.00	9.27
166	688343	云天励飞	5,671,038.12	9.26
167	688139	海尔生物	5,642,668.41	9.21
168	002545	东方铁塔	5,636,798.00	9.20
169	601375	中原证券	5,584,434.00	9.12
170	002967	广电计量	5,578,693.00	9.11
171	300811	铂科新材	5,557,456.00	9.07
172	300079	数码视讯	5,532,867.00	9.03
173	002390	信邦制药	5,493,032.00	8.97
174	601609	金田股份	5,488,267.00	8.96
175	002048	宁波华翔	5,487,606.00	8.96
176	300770	新媒股份	5,483,458.00	8.95
177	601208	东材科技	5,475,458.00	8.94
178	002151	北斗星通	5,439,843.00	8.88
179	688185	康希诺	5,434,788.17	8.87
180	600664	哈药股份	5,426,385.00	8.86
181	002123	梦网科技	5,420,308.00	8.85
182	603888	新华网	5,403,485.43	8.82
183	300856	科思股份	5,403,104.60	8.82
184	002675	东诚药业	5,399,108.00	8.81
185	300188	国投智能	5,395,058.00	8.81
186	000672	上峰水泥	5,345,706.84	8.73
187	600063	皖维高新	5,345,032.00	8.73
188	002626	金达威	5,339,791.00	8.72
189	000030	富奥股份	5,328,023.00	8.70

190	601020	华钰矿业	5,312,061.00	8.67
191	600059	古越龙山	5,299,033.50	8.65
192	600869	远东股份	5,281,576.81	8.62
193	688575	亚辉龙	5,268,753.14	8.60
194	603588	高能环境	5,260,123.00	8.59
195	603220	中贝通信	5,259,578.00	8.59
196	601200	上海环境	5,255,034.60	8.58
197	300337	银邦股份	5,200,059.00	8.49
198	600635	大众公用	5,198,430.00	8.49
199	688403	汇成股份	5,196,042.15	8.48
200	301217	铜冠铜箔	5,175,282.00	8.45
201	002761	浙江建投	5,174,738.00	8.45
202	002985	北摩高科	5,160,039.00	8.42
203	002947	恒铭达	5,154,989.00	8.41
204	300726	宏达电子	5,143,683.00	8.40
205	600821	金开新能	5,122,749.00	8.36
206	688141	杰华特	5,097,831.54	8.32
207	300768	迪普科技	5,080,575.00	8.29
208	301087	可孚医疗	5,070,014.30	8.28
209	600993	马应龙	5,063,483.00	8.27
210	002484	江海股份	5,050,810.00	8.24
211	000966	长源电力	5,035,372.00	8.22
212	300224	正海磁材	5,018,138.00	8.19
213	300113	顺网科技	4,979,366.00	8.13
214	601326	秦港股份	4,976,114.00	8.12
215	000058	深赛格	4,972,890.00	8.12
216	002317	众生药业	4,956,132.00	8.09
217	301522	上大股份	4,955,861.00	8.09
218	600305	恒顺醋业	4,952,161.34	8.08
219	603678	火炬电子	4,938,742.00	8.06
220	300166	东方国信	4,925,881.00	8.04
221	000603	盛达资源	4,885,817.00	7.98
222	600395	盘江股份	4,858,193.00	7.93
223	002204	大连重工	4,856,006.00	7.93
224	600780	通宝能源	4,843,497.99	7.91
225	600850	电科数字	4,836,156.20	7.89
226	002807	江阴银行	4,830,873.26	7.89
227	002537	海联金汇	4,825,212.00	7.88
228	002399	海普瑞	4,814,882.40	7.86
229	603997	继峰股份	4,802,068.00	7.84
230	300101	振芯科技	4,788,628.00	7.82
231	688351	微电生理	4,785,591.60	7.81
232	600269	赣粤高速	4,778,235.00	7.80

233	688390	固德威	4,767,177.68	7.78
234	001236	弘业期货	4,765,892.00	7.78
235	600782	新钢股份	4,763,376.00	7.78
236	000758	中色股份	4,752,819.00	7.76
237	301363	美好医疗	4,734,261.00	7.73
238	002154	报喜鸟	4,728,644.00	7.72
239	600746	江苏索普	4,700,735.00	7.67
240	002036	联创电子	4,693,388.60	7.66
241	688105	诺唯赞	4,674,776.76	7.63
242	000517	荣安地产	4,671,506.00	7.63
243	600480	凌云股份	4,647,898.48	7.59
244	000682	东方电子	4,642,740.00	7.58
245	688700	东威科技	4,631,337.18	7.56
246	002268	电科网安	4,619,484.00	7.54
247	002079	苏州固锟	4,602,831.00	7.51
248	688326	经纬恒润	4,599,924.45	7.51
249	002158	汉钟精机	4,594,161.00	7.50
250	300870	欧陆通	4,590,884.00	7.49
251	000727	冠捷科技	4,578,727.00	7.47
252	688586	江航装备	4,573,195.99	7.47
253	002126	银轮股份	4,566,606.00	7.45
254	000089	深圳机场	4,561,980.19	7.45
255	688131	皓元医药	4,550,530.86	7.43
256	688127	蓝特光学	4,543,333.54	7.42
257	000503	国新健康	4,480,194.53	7.31
258	001301	尚太科技	4,475,958.00	7.31
259	603026	石大胜华	4,467,829.00	7.29
260	300761	立华股份	4,465,559.00	7.29
261	300618	寒锐钴业	4,464,789.00	7.29
262	688091	上海谊众	4,437,405.06	7.24
263	688083	中望软件	4,434,507.76	7.24
264	688336	三生国健	4,433,437.81	7.24
265	600458	时代新材	4,430,703.00	7.23
266	002959	小熊电器	4,424,207.00	7.22
267	688400	凌云光	4,420,347.11	7.22
268	603698	航天工程	4,413,232.00	7.20
269	301611	珂玛科技	4,403,957.84	7.19
270	002651	利君股份	4,383,528.00	7.16
271	301238	瑞泰新材	4,380,446.00	7.15
272	688322	奥比中光	4,360,268.00	7.12
273	688147	微导纳米	4,357,932.75	7.11
274	300409	道氏技术	4,353,551.00	7.11
275	688209	英集芯	4,325,178.50	7.06

276	600757	长江传媒	4,322,189.00	7.06
277	300579	数字认证	4,321,610.50	7.05
278	603103	横店影视	4,307,330.01	7.03
279	688515	裕太微	4,306,948.56	7.03
280	002489	浙江永强	4,302,202.00	7.02
281	300773	拉卡拉	4,273,895.00	6.98
282	300674	宇信科技	4,269,957.00	6.97
283	688003	天准科技	4,253,362.22	6.94
284	002324	普利特	4,249,257.24	6.94
285	600966	博汇纸业	4,237,659.00	6.92
286	603218	日月股份	4,234,562.00	6.91
287	002034	旺能环境	4,198,423.00	6.85
288	688128	中国电研	4,197,200.73	6.85
289	003012	东鹏控股	4,188,721.00	6.84
290	600006	东风股份	4,183,547.00	6.83
291	603055	台华新材	4,154,760.40	6.78
292	600775	南京熊猫	4,139,889.00	6.76
293	002171	楚江新材	4,137,705.37	6.75
294	300634	彩讯股份	4,136,247.00	6.75
295	300171	东富龙	4,124,665.00	6.73
296	601137	博威合金	4,121,209.64	6.73
297	002060	广东建工	4,119,397.00	6.72
298	600017	日照港	4,114,543.00	6.72
299	603733	仙鹤股份	4,098,835.50	6.69
300	002233	塔牌集团	4,081,321.00	6.66
301	000969	安泰科技	4,049,315.00	6.61
302	601107	四川成渝	4,044,097.00	6.60
303	600320	振华重工	4,018,529.00	6.56
304	000885	城发环境	4,017,628.90	6.56
305	688362	甬矽电子	4,004,391.68	6.54
306	600072	中船科技	4,001,214.00	6.53
307	002302	西部建设	3,983,828.70	6.50
308	300663	科蓝软件	3,980,143.46	6.50
309	002901	大博医疗	3,970,457.00	6.48
310	300327	中颖电子	3,957,722.00	6.46
311	600645	中源协和	3,957,546.00	6.46
312	002895	川恒股份	3,949,707.00	6.45
313	601038	一拖股份	3,947,720.00	6.44
314	688596	正帆科技	3,935,309.23	6.42
315	300598	诚迈科技	3,920,330.90	6.40
316	301508	中机认检	3,911,801.00	6.39
317	603132	金徽股份	3,904,179.00	6.37
318	603279	景津装备	3,903,577.00	6.37

319	300406	九强生物	3,858,492.00	6.30
320	601900	南方传媒	3,856,949.00	6.30
321	600507	方大特钢	3,848,552.00	6.28
322	002498	汉缆股份	3,848,476.00	6.28
323	600037	歌华有线	3,837,085.00	6.26
324	002292	奥飞娱乐	3,835,412.00	6.26
325	601702	华峰铝业	3,830,372.00	6.25
326	300776	帝尔激光	3,828,744.00	6.25
327	688088	虹软科技	3,827,181.18	6.25
328	600158	中体产业	3,822,740.00	6.24
329	601595	上海电影	3,815,010.20	6.23
330	605168	三人行	3,807,043.00	6.21
331	600449	宁夏建材	3,793,363.98	6.19
332	000881	中广核技	3,790,516.60	6.19
333	600273	嘉化能源	3,785,828.00	6.18
334	688252	天德钰	3,784,706.26	6.18
335	000685	中山公用	3,779,411.44	6.17
336	600728	佳都科技	3,772,030.00	6.16
337	000917	电广传媒	3,760,452.00	6.14
338	688150	莱特光电	3,755,565.55	6.13
339	300034	钢研高纳	3,753,126.00	6.13
340	300180	华峰超纤	3,737,973.00	6.10
341	300130	新国都	3,732,679.00	6.09
342	002216	三全食品	3,719,793.00	6.07
343	688389	普门科技	3,715,992.72	6.07
344	601952	苏垦农发	3,710,543.00	6.06
345	300638	广和通	3,708,618.07	6.05
346	300593	新雷能	3,703,693.00	6.05
347	300827	上能电气	3,702,135.40	6.04
348	603299	苏盐井神	3,696,055.00	6.03
349	603194	中力股份	3,693,459.00	6.03
350	603496	恒为科技	3,691,992.00	6.03
351	300236	上海新阳	3,667,359.00	5.99
352	601163	三角轮胎	3,660,544.50	5.98
353	002127	南极电商	3,658,991.00	5.97
354	300613	富瀚微	3,644,804.00	5.95
355	300685	艾德生物	3,638,956.00	5.94
356	601677	明泰铝业	3,633,091.99	5.93
357	603915	国茂股份	3,632,367.00	5.93
358	003039	顺控发展	3,623,218.00	5.91
359	002053	云南能投	3,618,104.00	5.91
360	000810	创维数字	3,592,187.00	5.86
361	300428	立中集团	3,577,916.42	5.84

362	002897	意华股份	3,547,622.00	5.79
363	000735	罗牛山	3,509,565.00	5.73
364	000012	南玻 A	3,508,187.74	5.73
365	002833	弘亚数控	3,499,745.00	5.71
366	000065	北方国际	3,482,444.00	5.68
367	688331	荣昌生物	3,480,883.82	5.68
368	002043	兔宝宝	3,474,629.00	5.67
369	002045	国光电器	3,457,090.00	5.64
370	002605	姚记科技	3,451,202.00	5.63
371	600787	中储股份	3,443,926.00	5.62
372	301622	英思特	3,431,460.00	5.60
373	300925	法本信息	3,421,185.90	5.58
374	000048	京基智农	3,406,136.00	5.56
375	600133	东湖高新	3,398,061.00	5.55
376	600789	鲁抗医药	3,397,014.00	5.55
377	300953	震裕科技	3,383,541.00	5.52
378	002690	美亚光电	3,379,132.00	5.52
379	002149	西部材料	3,365,275.00	5.49
380	688106	金宏气体	3,364,321.75	5.49
381	605507	国邦医药	3,350,216.00	5.47
382	600446	金证股份	3,346,379.00	5.46
383	688686	奥普特	3,342,679.25	5.46
384	300463	迈克生物	3,337,149.00	5.45
385	300226	上海钢联	3,331,188.00	5.44
386	000612	焦作万方	3,330,358.00	5.44
387	600331	宏达股份	3,330,342.00	5.44
388	688690	纳微科技	3,320,821.23	5.42
389	688333	铂力特	3,314,473.91	5.41
390	600452	涪陵电力	3,305,724.40	5.40
391	002859	洁美科技	3,303,682.00	5.39
392	001311	多利科技	3,295,981.30	5.38
393	688016	心脉医疗	3,292,429.93	5.37
394	301571	国科天成	3,284,812.02	5.36
395	000848	承德露露	3,279,879.17	5.35
396	601528	瑞丰银行	3,254,078.00	5.31
397	301035	润丰股份	3,247,928.00	5.30
398	002182	宝武镁业	3,242,879.20	5.29
399	000025	特力 A	3,241,488.00	5.29
400	300475	香农芯创	3,229,453.00	5.27
401	301316	慧博云通	3,216,454.00	5.25
402	600531	豫光金铅	3,209,939.00	5.24
403	688443	智翔金泰	3,201,678.99	5.23
404	000828	东莞控股	3,200,541.00	5.22

405	688050	爱博医疗	3,190,415.88	5.21
406	688029	南微医学	3,189,702.92	5.21
407	301215	中汽股份	3,188,257.69	5.20
408	301171	易点天下	3,176,930.00	5.19
409	002254	泰和新材	3,172,393.00	5.18
410	600490	鹏欣资源	3,164,102.00	5.17
411	001914	招商积余	3,141,532.71	5.13
412	600055	万东医疗	3,131,401.00	5.11
413	600477	杭萧钢构	3,121,464.00	5.10
414	002777	久远银海	3,120,860.29	5.09
415	002006	精工科技	3,111,771.00	5.08
416	300855	图南股份	3,110,359.00	5.08
417	600717	天津港	3,109,407.00	5.08
418	300850	新强联	3,100,506.52	5.06
419	601068	中铝国际	3,099,101.00	5.06
420	002550	千红制药	3,098,472.00	5.06
421	603337	杰克科技	3,088,739.11	5.04
422	601801	皖新传媒	3,083,583.00	5.03
423	603300	海南华铁	3,078,118.00	5.02
424	301510	固高科技	3,076,365.00	5.02
425	000690	宝新能源	3,074,918.00	5.02
426	002237	恒邦股份	3,073,514.00	5.02
427	688123	聚辰股份	3,066,542.46	5.01
428	001258	立新能源	3,064,559.00	5.00
429	300457	赢合科技	3,062,698.00	5.00
430	603009	北特科技	3,038,296.00	4.96
431	002219	新里程	3,025,814.00	4.94
432	002400	省广集团	3,018,668.00	4.93
433	002697	红旗连锁	2,994,200.00	4.89
434	300257	开山股份	2,990,728.00	4.88
435	600996	贵广网络	2,988,697.00	4.88
436	000019	深粮控股	2,985,222.00	4.87
437	002270	华明装备	2,976,271.00	4.86
438	688208	道通科技	2,966,359.09	4.84
439	300456	赛微电子	2,954,070.10	4.82
440	300009	安科生物	2,952,103.80	4.82
441	603093	南华期货	2,950,951.00	4.82
442	600967	内蒙一机	2,949,487.00	4.81
443	688631	莱斯信息	2,936,199.10	4.79
444	600179	安通控股	2,910,986.00	4.75
445	603636	南威软件	2,901,375.00	4.74
446	603305	旭升集团	2,892,476.16	4.72
447	600301	华锡有色	2,891,895.00	4.72

448	601101	昊华能源	2,858,146.00	4.67
449	002416	爱施德	2,856,221.00	4.66
450	002274	华昌化工	2,841,981.00	4.64
451	603766	隆鑫通用	2,841,462.00	4.64
452	688548	广钢气体	2,840,706.42	4.64
453	688543	国科军工	2,831,321.29	4.62
454	600201	生物股份	2,826,921.00	4.61
455	300482	万孚生物	2,806,796.00	4.58
456	688523	航天环宇	2,802,247.73	4.57
457	605116	奥锐特	2,788,694.00	4.55
458	002096	易普力	2,786,189.00	4.55
459	000581	威孚高科	2,786,055.01	4.55
460	603306	华懋科技	2,775,113.00	4.53
461	600073	光明肉业	2,760,727.00	4.51
462	605090	九丰能源	2,749,609.00	4.49
463	000968	蓝焰控股	2,722,448.00	4.44
464	001287	中电港	2,719,296.00	4.44
465	600601	方正科技	2,710,543.00	4.42
466	301109	军信股份	2,697,956.50	4.40
467	688006	杭可科技	2,684,913.20	4.38
468	300772	运达股份	2,677,403.00	4.37
469	600586	金晶科技	2,672,237.00	4.36
470	301153	中科江南	2,671,098.00	4.36
471	600552	凯盛科技	2,648,542.00	4.32
472	600916	中国黄金	2,645,430.00	4.32
473	002249	大洋电机	2,631,930.00	4.30
474	300284	苏交科	2,615,820.00	4.27
475	002531	天顺风能	2,613,224.00	4.27
476	301029	怡合达	2,609,148.00	4.26
477	603619	中曼石油	2,608,996.00	4.26
478	600575	淮河能源	2,597,577.00	4.24
479	002004	华邦健康	2,595,008.00	4.24
480	003006	百亚股份	2,574,060.00	4.20
481	300570	太辰光	2,573,878.00	4.20
482	002265	建设工业	2,570,072.99	4.20
483	002936	郑州银行	2,569,842.00	4.19
484	000650	仁和药业	2,557,574.00	4.17
485	001337	四川黄金	2,556,490.00	4.17
486	002091	江苏国泰	2,549,296.00	4.16
487	600976	健民集团	2,547,506.00	4.16
488	300296	利亚德	2,518,547.00	4.11
489	300576	容大感光	2,517,169.71	4.11
490	600961	株冶集团	2,507,887.00	4.09

491	002840	华统股份	2,496,143.00	4.07
492	603348	文灿股份	2,489,655.00	4.06
493	002061	浙江交科	2,486,292.00	4.06
494	688798	艾为电子	2,482,802.37	4.05
495	600313	农发种业	2,466,172.00	4.03
496	002396	星网锐捷	2,460,530.00	4.02
497	688717	艾罗能源	2,452,997.56	4.00
498	300917	特发服务	2,442,578.00	3.99
499	600259	中稀有色	2,440,315.00	3.98
500	002023	海特高新	2,432,440.00	3.97
501	688276	百克生物	2,431,202.43	3.97
502	300080	易成新能	2,412,239.00	3.94
503	603609	禾丰股份	2,408,838.00	3.93
504	300185	通裕重工	2,395,348.00	3.91
505	300085	银之杰	2,389,658.00	3.90
506	603613	国联股份	2,377,790.00	3.88
507	000600	建投能源	2,372,179.00	3.87
508	002612	朗姿股份	2,347,344.00	3.83
509	600020	中原高速	2,338,502.00	3.82
510	002063	远光软件	2,324,104.00	3.79
511	002497	雅化集团	2,319,170.00	3.79
512	600874	创业环保	2,304,476.00	3.76
513	688007	光峰科技	2,281,289.64	3.72
514	002258	利尔化学	2,275,780.97	3.71
515	300363	博腾股份	2,256,025.00	3.68
516	603267	鸿远电子	2,247,153.00	3.67
517	600266	城建发展	2,234,601.00	3.65
518	688380	中微半导	2,225,821.60	3.63
519	300705	九典制药	2,216,214.00	3.62
520	000915	华特达因	2,207,497.00	3.60
521	601969	海南矿业	2,187,369.00	3.57
522	300083	创世纪	2,182,236.00	3.56
523	601126	四方股份	2,181,751.00	3.56
524	605009	豪悦护理	2,179,268.00	3.56
525	603236	移远通信	2,133,824.00	3.48
526	002226	江南化工	2,114,120.00	3.45
527	300401	花园生物	2,110,115.98	3.44
528	002705	新宝股份	2,101,139.35	3.43
529	600216	浙江医药	2,095,908.00	3.42
530	600729	重庆百货	2,091,384.00	3.41
531	603533	掌阅科技	2,044,196.00	3.34
532	002011	盾安环境	2,010,493.00	3.28
533	603013	亚普股份	2,006,197.00	3.27

534	600338	西藏珠峰	1,992,755.00	3.25
535	688262	国芯科技	1,992,304.94	3.25
536	600882	妙可蓝多	1,984,019.00	3.24
537	002326	永太科技	1,982,793.00	3.24
538	300666	江丰电子	1,981,876.00	3.24
539	000680	山推股份	1,957,798.35	3.20
540	300398	飞凯材料	1,953,527.00	3.19
541	300035	中科电气	1,950,327.00	3.18
542	002516	旷达科技	1,949,240.00	3.18
543	688327	云从科技	1,945,983.04	3.18
544	605589	圣泉集团	1,945,946.00	3.18
545	300432	富临精工	1,929,170.80	3.15
546	600169	ST 太重	1,911,667.00	3.12
547	688652	京仪装备	1,910,120.33	3.12
548	601311	骆驼股份	1,909,845.90	3.12
549	300548	长芯博创	1,880,461.00	3.07
550	000930	中粮科技	1,875,877.00	3.06
551	300470	中密控股	1,867,680.00	3.05
552	301606	绿联科技	1,853,993.00	3.03
553	301155	海力风电	1,840,966.00	3.01
554	600058	五矿发展	1,821,336.00	2.97
555	300657	弘信电子	1,819,541.00	2.97
556	688027	国盾量子	1,817,162.87	2.97
557	000059	华锦股份	1,800,380.00	2.94
558	000550	江铃汽车	1,794,495.00	2.93
559	300777	中简科技	1,791,619.00	2.92
560	603301	振德医疗	1,789,666.00	2.92
561	002245	蔚蓝锂芯	1,788,518.00	2.92
562	603118	共进股份	1,779,568.00	2.90
563	600633	浙数文化	1,766,631.00	2.88
564	000737	北方铜业	1,765,000.00	2.88
565	000090	天健集团	1,739,961.00	2.84
566	688300	联瑞新材	1,737,405.79	2.84
567	603920	世运电路	1,720,452.00	2.81
568	600773	西藏城投	1,714,406.00	2.80
569	603876	鼎胜新材	1,692,667.87	2.76
570	000950	重药控股	1,688,131.00	2.76
571	300620	光库科技	1,686,009.55	2.75
572	002779	中坚科技	1,683,356.00	2.75
573	688298	东方生物	1,682,299.96	2.75
574	600195	中牧股份	1,681,253.61	2.74
575	600648	外高桥	1,669,342.00	2.73
576	688166	博瑞医药	1,643,897.89	2.68

577	002585	双星新材	1,638,956.05	2.68
578	600206	有研新材	1,634,081.00	2.67
579	000901	航天科技	1,628,365.00	2.66
580	300857	协创数据	1,613,419.00	2.63
581	002716	湖南白银	1,612,915.00	2.63
582	603393	新天然气	1,606,167.00	2.62
583	002221	东华能源	1,597,660.00	2.61
584	603368	柳药集团	1,592,461.90	2.60
585	603508	思维列控	1,592,169.00	2.60
586	000498	山东路桥	1,591,277.00	2.60
587	688522	纳睿雷达	1,581,869.18	2.58
588	002174	游族网络	1,576,956.00	2.57
589	600428	中远海特	1,563,449.00	2.55
590	600641	先导基电	1,563,219.00	2.55
591	002354	天娱数科	1,560,674.00	2.55
592	300357	我武生物	1,558,711.00	2.54
593	002332	仙琚制药	1,543,393.00	2.52
594	603043	广州酒家	1,540,948.06	2.52
595	600459	贵研铂业	1,538,637.00	2.51
596	601827	三峰环境	1,535,780.00	2.51
597	600502	安徽建工	1,532,586.00	2.50
598	688584	上海合晶	1,520,909.89	2.48
599	300102	乾照光电	1,515,546.00	2.47
600	605222	起帆电缆	1,509,128.03	2.46
601	600894	广日股份	1,505,414.00	2.46
602	600330	天通股份	1,503,504.68	2.45
603	300319	麦捷科技	1,499,984.00	2.45
604	600422	昆药集团	1,480,777.00	2.42
605	301239	普瑞眼科	1,477,138.00	2.41
606	002534	西子洁能	1,476,662.00	2.41
607	601886	江河集团	1,461,893.00	2.39
608	300049	福瑞医科	1,455,306.00	2.38
609	300527	ST 应急	1,436,935.00	2.35
610	603699	纽威股份	1,431,794.00	2.34
611	600075	新疆天业	1,429,502.00	2.33
612	688392	骄成超声	1,426,167.20	2.33
613	301039	中集车辆	1,423,012.00	2.32
614	688766	普冉股份	1,421,331.41	2.32
615	000049	德赛电池	1,413,836.50	2.31
616	688018	乐鑫科技	1,411,222.84	2.30
617	600388	龙净环保	1,400,304.00	2.29
618	600640	国脉文化	1,399,912.00	2.29
619	002701	奥瑞金	1,394,008.00	2.28

620	001389	广合科技	1,391,151.00	2.27
621	000657	中钨高新	1,381,910.00	2.26
622	600210	紫江企业	1,371,227.00	2.24
623	002335	科华数据	1,367,585.00	2.23
624	600248	陕建股份	1,364,975.00	2.23
625	001322	箭牌家居	1,361,466.03	2.22
626	600662	外服控股	1,355,349.00	2.21
627	688315	诺禾致源	1,349,007.61	2.20
628	300869	康泰医学	1,347,505.00	2.20
629	000829	天音控股	1,344,011.00	2.19
630	002191	劲嘉股份	1,331,957.00	2.17
631	000761	本钢板材	1,329,406.00	2.17
632	688019	安集科技	1,325,930.89	2.16
633	601515	衢州东峰	1,317,109.14	2.15
634	600496	精工钢构	1,315,900.00	2.15
635	603063	禾望电气	1,311,973.68	2.14
636	002488	金固股份	1,310,931.56	2.14
637	600751	海航科技	1,309,464.00	2.14
638	300415	伊之密	1,307,225.00	2.13
639	300973	立高食品	1,304,507.00	2.13
640	002654	万润科技	1,292,885.00	2.11
641	002139	拓邦股份	1,291,524.00	2.11
642	300303	聚飞光电	1,289,396.00	2.10
643	002993	奥海科技	1,283,540.00	2.10
644	002635	安洁科技	1,282,296.00	2.09
645	002101	广东鸿图	1,279,993.00	2.09
646	603219	富佳股份	1,275,321.00	2.08
647	301180	万祥科技	1,275,320.00	2.08
648	601777	千里科技	1,264,348.00	2.06
649	301377	鼎泰高科	1,260,301.00	2.06
650	600750	华润江中	1,255,529.00	2.05
651	603989	艾华集团	1,255,092.00	2.05
652	002906	华阳集团	1,249,673.00	2.04
653	688612	威迈斯	1,235,380.79	2.02
654	002192	融捷股份	1,231,223.00	2.01
655	002588	史丹利	1,228,926.96	2.01

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。

#### 8.4.3 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	3,313,911,616.77
卖出股票收入（成交）总额	3,136,664,540.83

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

考虑相关交易费用。

## 8.5 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	14,726,287.01	5.33
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,726,287.01	5.33

## 8.6 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	019785	25 国债 13	66,000	6,639,798.90	2.40
2	019766	25 国债 01	54,000	5,460,237.37	1.97
3	019773	25 国债 08	26,000	2,626,250.74	0.95

## 8.7 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。

## 8.8 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。

## 8.9 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。

## 8.10 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。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 8.11.1 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。

### 8.11.2 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。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1 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。

### 8.12.2 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。

### 8.12.3 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	23,161.44
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	23,161.44

### 8.12.4 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。

### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 8.12.5.1 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。

#### 8.12.5.2 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。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 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 (%)
鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	668	171,156.79	83,640,551.40	73.1554	30,692,185.59	26.8446
鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	1,375	66,826.77	60,808,609.44	66.1777	31,078,206.12	33.8223
合计	2,043	100,939.58	144,449,160.84	70.0463	61,770,391.71	29.9537

### 9.2 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	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	178,875.73	0.1565
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	83,903.61	0.0913
	合计	262,779.34	0.1274

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	10~50
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	0
	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C	0
	合计	0

#### 9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

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。

#### 9.5 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例 (%)	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例 (%)	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,666.83	4.8500	10,001,666.83	4.8500	3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,666.83	4.8500	10,001,666.83	4.8500	3 年

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	鑫元中证 1000 指数增强发起式 A	鑫元中证 1000 指数增强发起式 C
基金合同生效日 (2022 年 11 月 28 日) 基金份额总额	18,792,139.50	150,733,585.81
本报告期期初基金份 额总额	38,745,777.54	18,980,668.74
本报告期基金总申购 份额	135,464,972.91	154,108,891.38
减：本报告期基金总 赎回份额	59,878,013.46	81,202,744.56
本报告期基金拆分变 动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	114,332,736.99	91,886,815.56

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 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。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

1、基金管理人：本报告期内，基金管理人发布了《鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告》，自 2025 年 6 月 18 日起，张鹏飞先生任公司副总经理，杨晓宇先生任公司副总经理、首席信息官；自 2025 年 8 月 29 日起，王辉先生离任公司副总经理；自 2025 年 11 月 10 日起，王雁女士任公司副总经理。

2、基金托管人：报告期内，基金托管人的资产托管部无重大人事变动。

### 11.3 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。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略无改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内为本基金进行审计的会计师事务所为：安永华明会计师事务所（特殊普通合伙），未发生改聘。本报告期内应支付给会计师事务所的审计费用是人民币 36,000.00 元。目前的会计师事务所为本基金提供审计服务的年限为 4 年。

### 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

#### 11.6.1 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。

#### 11.6.2 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。

#### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

注：2025 年度，华泰证券股份有限公司不存在证监会、人行等外部监管机构出具的与资产托管业务相关的行政处罚、行政监管措施、纪律处分、调查等事项。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

注：华泰证券股份有限公司分管公募基金托管业务的高级管理人员不存在被调查、处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 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	4	6,331,537,310.78	98.17	1,240,760.95	98.26	-
金元证券	3	118,275,235.37	1.83	21,990.73	1.74	-

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。

#### 11.7.2 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	22,190,391.00	100.00	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金所持有股票因长期停牌变更估值方法的提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 1 月 15 日
2	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 1 月 22 日
3	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	公司网站	2025 年 1 月 22 日
4	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 3 月 31 日
5	鑫元基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司交易及佣金支付情况 (2024 年度)	公司网站	2025 年 3 月 31 日
6	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	公司网站	2025 年 3 月 31 日
7	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 4 月 22 日
8	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第一季度报告	公司网站	2025 年 4 月 22 日
9	鑫元基金关于直销柜台申购费率优惠的公告	公司网站、中国证券报、证券时报、上海证券报、证券日报	2025 年 5 月 6 日
10	鑫元基金管理有限公司关于基金行业高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 6 月 18 日
11	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 (鑫元中证 1000 指数增强发起式 C) 基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 6 月 28 日
12	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 (鑫元中证 1000 指数增强发起式 A) 基金产品资料概要更新	公司网站	2025 年 6 月 28 日
13	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金更新招募说明书 (2025 年第 1 号)	公司网站	2025 年 6 月 28 日
14	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金持有股票估值方法调整的公告	公司网站、中国证券报、上海证券报、证券时报、证券日报	2025 年 7 月 3 日
15	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金 2025 年第二季度报告	公司网站	2025 年 7 月 21 日
16	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、	2025 年 7 月 21 日

	2025 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报、上海证券报、 证券日报	
17	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证 券投资基金 2025 年中期报告	公司网站	2025 年 8 月 29 日
18	鑫元基金管理有限公司关于基金行业 高级管理人员变更的公告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 8 月 30 日
19	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年中期报告提示性公告	公司网站、中国证券报、 证券时报、上海证券报、 证券日报	2025 年 8 月 30 日
20	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 所持有的停牌股票变更估值方法的公 告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 9 月 3 日
21	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 所持有的停牌股票变更估值方法的公 告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 9 月 5 日
22	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 持有股票估值方法调整的公告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 9 月 30 日
23	鑫元基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	公司网站、中国证券报、 证券时报、上海证券报、 证券日报	2025 年 10 月 28 日
24	鑫元中证 1000 指数增强型发起式证 券投资基金 2025 年第 3 季度报告	公司网站	2025 年 10 月 28 日
25	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、上交所	2025 年 11 月 11 日
26	鑫元基金管理有限公司关于旗下部分 基金开展直销柜台申购费率优惠活 动的公告	公司网站、中国证券报、 证券时报、上海证券报、 证券日报	2025 年 12 月 23 日
27	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 持有的债券估值调整的公告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 12 月 24 日
28	鑫元基金管理有限公司关于旗下基金 所持有的停牌股票变更估值方法的公 告	公司网站、中国证券报、 上海证券报、证券时报、 证券日报	2025 年 12 月 26 日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 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	20250924-20251125;20251209-20251231	-	46,393,494.18	-	46,393,494.18	22.4971
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。

### 12.2 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%。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金设立的文件；
- 2、《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《鑫元中证 1000 指数增强型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批复、营业执照；
- 5、基金托管人业务资格批复、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人或基金托管人处。

### 13.3 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 3 月 31 日