

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基 金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

| | |
|---|----|
| § 1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| § 2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 6 |
| § 3 主要财务指标和基金净值表现 | 6 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 6 |
| 3.2 基金净值表现 | 7 |
| § 4 管理人报告 | 8 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 8 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 | 11 |
| 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 | 11 |
| 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 | 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 | 12 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 13 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| § 5 托管人报告 | 14 |
| 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 | 14 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 14 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| § 6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 15 |
| 6.3 净资产变动表 | 17 |
| 6.4 报表附注 | 18 |
| § 7 投资组合报告 | 42 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 42 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 43 |
| 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 44 |
| 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 44 |
| 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 | 55 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 55 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 73 |
| 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 | 74 |
| 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 | 74 |
| 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 | 74 |
| 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 | 74 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 74 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 74 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 74 |

| | |
|--|----|
| § 8 基金份额持有人信息 | 75 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构..... | 75 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人..... | 76 |
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 76 |
| 8.4 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的情况..... | 76 |
| § 9 开放式基金份额变动 | 76 |
| § 10 重大事件揭示 | 77 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 77 |
| 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动..... | 77 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 77 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 77 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 77 |
| 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况..... | 77 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 77 |
| 10.8 其他重大事件..... | 78 |
| § 11 影响投资者决策的其他重要信息 | 79 |
| § 12 备查文件目录 | 81 |
| 12.1 备查文件目录..... | 81 |
| 12.2 存放地点..... | 81 |
| 12.3 查阅方式..... | 81 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------------|
| 基金名称 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 海富通中证 2000 增强策略 ETF |
| 场内简称 | 2000ETF 增强 |
| 基金主代码 | 159553 |
| 交易代码 | 159553 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2024 年 3 月 27 日 |
| 基金管理人 | 海富通基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 招商银行股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 12,326,751.00 份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2024 年 4 月 15 日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|--------|--|
| 投资目标 | 本基金通过数量化投资分析及基本面研究等方法进行积极的组合管理与风险控制，力争控制本基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.50%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>本基金主要投资策略包括：</p> <p>（一）股票投资策略</p> <p>（1）标的指数。</p> <p>本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 2000 指数。</p> <p>（2）量化增强策略</p> <p>本基金一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金运用的量化投资模型借鉴国际一流定量分析的应用经验，利用多因子 alpha 模型预测股票超额回报，在有效风险控制及交易成本最低化的基础上优化投资组合。</p> <p>（二）债券投资策略；（三）可转换债券和可交换债券投资策略；（四）资产支持证券投资策略；（五）股指期货投资策略；（六）国债期货投资策略；（七）股票期权投资策略；（八）融资及转融通证券出借策略；（九）存托凭证投资策略。</p> |
| 业绩比较基准 | 中证 2000 指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，通过跟踪标的指数表现，具有与标的指数以及标的指数所代表的公司相似的风险收益特征。 |

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 | | 海富通基金管理有限公司 | 招商银行股份有限公司 |
| 信息披露 负责人 | 姓名 | 岳冲 | 张珊 |
| | 联系电话 | 021-38650788 | 400-61-95555 |
| | 电子邮箱 | chongyue@hftfund.com | zhangshan_1027@cmbchina.com |
| 客户服务电话 | | 40088-40099 | 400-61-95555 |
| 传真 | | 021-33830166 | 0755-83195201 |
| 注册地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 办公地址 | | 中国（上海）自由贸易试验区 陆家嘴环路479号18层 1802-1803室以及19层 1901-1908室 | 深圳市深南大道7088号招商银行大厦 |
| 邮政编码 | | 200120 | 518040 |
| 法定代表人 | | 杨仓兵 | 缪建民 |

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》 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网址 | http://www.hftfund.com |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的住所 |

2.5 其他相关资料

| 项目 | 名称 | 办公地址 |
|--------|----------------|------------------|
| 注册登记机构 | 中国证券登记结算有限责任公司 | 北京市西城区太平桥大街 17 号 |

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期（2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日） |
|---------------|---|
| 本期已实现收益 | -8,391,924.77 |
| 本期利润 | -8,959,597.14 |

| | |
|----------------------|------------------------------|
| 加权平均基金份额本期利润 | -0.1185 |
| 本期加权平均净值利润率 | -12.07% |
| 本期基金份额净值增长率 | -8.03% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) |
| 期末可供分配利润 | -989,551.87 |
| 期末可供分配基金份额利润 | -0.0803 |
| 期末基金资产净值 | 11,337,199.13 |
| 期末基金份额净值 | 0.9197 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末(2024 年 6 月 30 日) |
| 基金份额累计净值增长率 | -8.03% |

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

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

3、期末可供分配利润,采用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(为期末余额,不是当期发生数)。

4、本基金合同生效日为 2024 年 03 月 27 日,合同生效当年期间的数据和指标按实际存续期计算。

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

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | -6.95% | 1.86% | -9.15% | 1.85% | 2.20% | 0.01% |
| 过去三个月 | -8.04% | 1.96% | -13.75% | 2.01% | 5.71% | -0.05% |
| 自基金合同生效起至今 | -8.03% | 1.89% | -13.51% | 2.03% | 5.48% | -0.14% |

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

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2024 年 3 月 27 日至 2024 年 6 月 30 日)



注：1、本基金合同于 2024 年 3 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。

2、按基金合同和招募说明书的约定，自基金合同生效之日起六个月内使基金的投资组合比例符合本基金合同的有关约定。本报告期本基金处于建仓期内，在上市交易前已完成拟合标的指数。

§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

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证

券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通畅享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通添鑫收益债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一

年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

| 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 | | |
| 李自悟 | 本基金的基金经理；量化投资部副总监。 | 2024-03-27 | - | 16 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2008 年 4 月至 2010 年 1 月任 MNJ Capital Management 交易员，2010 年 7 月至 2011 年 6 月任 BlackRock 研究员，2011 年 7 月至 2016 年 3 月任国家外汇管理局中央外汇业务中心基金经理，2016 年 3 月至 2019 年 8 月任上海均直资产管理有限公司基金经理，2019 年 9 月至 2022 年 8 月任野村东方国际证券量化投资主管。2022 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，现任量化投资部副总监。2023 年 2 月起任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。 |
| 朱斌全 | 本基金的基金经理 | 2024-03-27 | - | 17 年 | 硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥 |

| | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|
| | | | | | 混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强(原海富通富睿混合)、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 指数增强基金经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。 |
|--|--|--|--|--|--|

注：1、对基金的首任基金经理，其任职日期指基金合同生效日，离任日期指公司做出决定之日；非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金资产，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，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和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占优比等指标综合判断是否存在不公平交易或利益输送的可能。结果表明，报告期内公司对旗下各投资组合公平对待，不存在利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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

2024 年上半年国内经济温和复苏，但修复力度有待增强。经济数据在 3、4 月份改善以后，5、6 月份重新放缓，二季度 GDP 增速弱于预期，同时 PMI 制造业采购经理指数在 5、6 月份重新回到荣枯线下方。从经济动能来看，对外出口仍然是增长的主要动力，6 月份单月贸易顺差更是达到 990 亿美元，创历史新高。与之对比，受收入端影响，国内需求有所下降，社会消费品零售数据增幅放缓。房地产投资方面，降幅基本企稳，但反弹的势能仍在积蓄。金融数据方面，人民币贷款和社融增速双双放缓，从去年的 10% 以上回落至 8-9% 的区间。价格数据中 CPI 较为稳定，同时 PPI 降幅明显放缓，预计下半年转正概率较大。海外方面，美国经济数据较好，但 6 月以来就业数据有所走弱，叠加近期 CPI 数据回落，市场对 9 月份开启降息的预期逐步增强。

从金融市场来看，权益市场主要指数以下跌为主，上证指数为-0.25%，沪深 300 为 0.89%，创业板指为-10.99%。风格方面偏向防守，中证红利、上证 50 等指数涨幅居前，中小市值的中证 1000、中证 2000 等跌幅较大。行业方面同样如此，表现靠前的板块是银行、煤炭、石油石化、家电、电力及公用事业，跌幅较大的板块是消费者服务、计算机、商品零售、传媒、医药。

基金投资方面，本基金在力争控制本基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的基础上，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，以指数成份股为主要选股池。在策略方面，本基金以量化多因子选股体系为框架，以人工智能深度学习模型为核心，采用多维度历史数据构建选股模型，并通过组合优化的方式构建符合基金持仓风格的投资组合。在运作方面，本基金严格约束行业和个股权重，并通过风险模型保持投资组合的风格暴露在合理范围之内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金净值增长率为-8.03%，同期业绩比较基准收益率为-13.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年市场，宏观层面仍将保持战略定力，为明年外部环境可能发生的变化预留足够的政策储备。特别是结合当前对于发展质量的追求高于对规模的追求的现状，财政政策有倾向性的发力概率更高，推出大规模经济刺激政策的概率则较小。在此基础上，随着美联储降息周期的临近，人民币汇率上的压力将有所缓解，这在一定程度上将打开货币政策逆周期调节的政策空间。预计央行将灵活运用多样化的货币工具，保持较为宽松的利率环境。

从经济活动来看，目前国内经济正在经历一轮总需求和总产能的再平衡过程，部分行业和企业正在经历上下游产业链重塑的冲击。但另一方面，我们也看到产业结构的升级正在孕育出新的机遇，

手机、新能源车和芯片等正在成为新的出口主力，在量和质两方面同步提升国内经济的含金量。

回到下半年权益市场的机会，我们认为需要让组合更好地契合目前经济发展的大方向。一方面在经济筑底的过程中做好防守，在风格配置上要管理好组合收益的下限。但另一方面，也要积极捕捉新旧经济切换过程中的不断涌现的新机遇，积极布局新经济方向，为经济和市场的双重复苏做好准备。

从量化投资的角度，上半年市场风格的剧烈变化给所有的量化管理人上了很好的一堂课。我们对模型也做了很多调整和迭代。特别是在对市场风格的判断上，量化模型具有一些独特的优势，视野更长、覆盖面更广，使其有机会在复杂多变的市场中更好地把握市场热点的切换。我们也将依托优化后的模型，力争更好地回报投资者。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》、基金合同以及中国基金业协会提供的相关估值指引对基金所持有的投资品种进行估值。日常估值由基金管理人与基金托管人分别独立完成。基金管理人每个工作日对基金资产估值后，将各类基金份额的份额净值结果发送基金托管人，经基金托管人复核无误后，由基金管理人对外公布。

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会对经济环境发生重大变化或发生影响证券价格的重大事件进行评估，充分听取相关部门的建议，并和托管人充分协商后，提交估值建议报告，以便估值委员会决策。基金运营部按照批准后的估值政策进行估值。

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日，连续三十七个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。

§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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|---------|------------------------|
| 资 产： | | |
| 货币资金 | 6.4.7.1 | 927,309.74 |
| 结算备付金 | | 407,168.42 |
| 存出保证金 | | 168,783.43 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 10,118,193.16 |
| 其中：股票投资 | | 10,118,193.16 |
| 基金投资 | | - |
| 债券投资 | | - |
| 资产支持证券投资 | | - |
| 贵金属投资 | | - |

| | | |
|---------------|------------|---------------------------|
| 其他投资 | | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - |
| 应收清算款 | | 672,401.53 |
| 应收股利 | | - |
| 应收申购款 | | - |
| 递延所得税资产 | | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | 82,142.72 |
| 资产总计 | | 12,375,999.00 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2024年6月30日 |
| 负债： | | |
| 短期借款 | | - |
| 交易性金融负债 | | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - |
| 应付清算款 | | 634,615.08 |
| 应付赎回款 | | - |
| 应付管理人报酬 | | 5,935.07 |
| 应付托管费 | | 1,187.03 |
| 应付销售服务费 | | - |
| 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 | 6.4.7.6 | 397,062.69 |
| 负债合计 | | 1,038,799.87 |
| 净资产： | | |
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 12,326,751.00 |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -989,551.87 |
| 净资产合计 | | 11,337,199.13 |
| 负债和净资产总计 | | 12,375,999.00 |

注：1、报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9197 元，基金份额总额 12,326,751.00 份。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.2 利润表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------------------|----------|--|
| 一、营业总收入 | | -8,745,730.34 |
| 1.利息收入 | | 121,814.71 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 121,814.71 |
| 债券利息收入 | | - |
| 资产支持证券利息收入 | | - |
| 买入返售金融资产收入 | | - |
| 其他利息收入 | | - |
| 2.投资收益（损失以“-”填列） | | -8,047,118.56 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | -8,243,839.34 |
| 基金投资收益 | | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - |
| 资产支持证券投资收益 | | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.12 | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.13 | 50,525.34 |
| 股利收益 | 6.4.7.14 | 146,195.44 |
| 其他投资收益 | | - |
| 3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列） | 6.4.7.15 | -567,672.37 |
| 4.汇兑收益（损失以“-”号填列） | | - |
| 5.其他收入（损失以“-”号填列） | 6.4.7.16 | -252,754.12 |
| 减：二、营业总支出 | | 213,866.80 |
| 1. 管理人报酬 | | 95,574.38 |
| 2. 托管费 | | 19,114.87 |
| 3. 销售服务费 | | - |
| 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. 税金及附加 | | 419.83 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.17 | 98,757.72 |
| 三、利润总额（亏损总额以“-”号填列） | | -8,959,597.14 |
| 减：所得税费用 | | - |
| 四、净利润（净亏损以“-”号填列） | | -8,959,597.14 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - |
| 六、综合收益总额 | | -8,959,597.14 |

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--|---|----------------|---------------|-----------------|
| | 实收基金 | 其他综合 收益（若有） | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产 | 212,326,751.00 | - | - | 212,326,751.00 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -200,000,000.00 | - | -989,551.87 | -200,989,551.87 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | -8,959,597.14 | -8,959,597.14 |
| （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） | -200,000,000.00 | - | 7,970,045.27 | -192,029,954.73 |
| 其中：1.基金申购款 | 18,000,000.00 | - | -1,167,623.98 | 16,832,376.02 |
| 2.基金赎回款 | -218,000,000.00 | - | 9,137,669.25 | -208,862,330.75 |
| （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 | 12,326,751.00 | - | -989,551.87 | 11,337,199.13 |

注：本财务报表的实际编制期间为 2024 年 03 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 6 月 30 日，上年度可比期间无比较数据。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：任志强，主管会计工作负责人：胡光涛，会计机构负责人：胡正万

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2023]2191 号《关于准予海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》注册,由海富通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《海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,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 212,308,000.00 元。经向中国证监会备案,《海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2024 年 03 月 27 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 212,326,751.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 18,751.00 份基金份额。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为招商银行股份有限公司。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2024]265 号文核准,本基金 212,326,751.00 份基金份额于 2024 年 4 月 15 日在深交所上市交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资范围为具有良好流动性的金融工具,主要投资于标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现基金的投资目标,本基金可少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份股(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票)、存托凭证、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权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的相关规定)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股(含存托凭证)的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.35% 以内,年化跟踪误差控制在 6.50% 以内。本基金的业绩比较基准为:中证 2000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2024 年 8 月 29 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《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>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况、2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、资产支持证券投资、衍生工具、买入返售金融资产等。

本基金通常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，在初始确认时将金融资产分为不同类别：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其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定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

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融

负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金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；
- 该金融资产已转移，虽然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，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限(包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内(若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期)可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情

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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；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，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，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，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，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，才可以使用不可观察输入值。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 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。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，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根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产

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进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、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。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

本基金的利息支出按资金的本金和适用利率逐日计提。

卖出回购金融资产款在资金实际占用期间按实际利率法逐日确认为利息支出。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配采用现金方式。当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1% 以上时，可进行收益分配；在收益评价日，基金管理人 对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见招募说明书。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2008] 1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2012] 85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2016] 36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税 [2016] 46 号《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》、财税 [2016] 70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140 号《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》、财税 [2017] 2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税 [2017] 90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品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。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b) 对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，股票的股息、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。

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，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，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 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。

(d) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|----------------|------------------------|
| 活期存款 | 927,309.74 |
| 等于：本金 | 927,223.14 |
| 加：应计利息 | 86.60 |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 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 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 合计 | 927,309.74 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|---------------|------------------------|------|---------------|-------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 10,628,705.53 | - | 10,118,193.16 | -510,512.37 |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | - | - | - | - |
| 债券 | 交易所 | - | - | - |
| | 市场 | - | - | - |
| | 银行间 | - | - | - |
| 市场 | - | - | - | - |

| | | | | | |
|--------|---------------|---|---|---------------|-------------|
| | 合计 | - | - | - | - |
| 资产支持证券 | | - | - | - | - |
| 基金 | | - | - | - | - |
| 其他 | | - | - | - | - |
| 合计 | 10,628,705.53 | - | - | 10,118,193.16 | -510,512.37 |

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | | | |
|--------|------------------------|------|----|----|
| | 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 | 1,028,760.00 | - | - | - |
| ——股指期货 | 1,028,760.00 | - | - | - |
| 其他衍生工具 | - | - | - | - |
| 合计 | 1,028,760.00 | - | - | - |

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

| 代码 | 名称 | 持仓量(买/卖) | 合约市值 | 公允价值变动 |
|------------|--------|----------|------------|------------|
| IM2407 | IM2407 | 1.00 | 971,600.00 | -57,160.00 |
| 合计 | - | - | - | -57,160.00 |
| 减：可抵销期货暂收款 | - | - | - | -57,160.00 |
| 净额 | - | - | - | - |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------|------------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | - |
| 待摊费用 | 82,142.72 |
| 合计 | 82,142.72 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 |
|-------------|------------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | - |
| 应付赎回费 | - |
| 应付证券出借违约金 | - |
| 应付交易费用 | 341,427.25 |
| 其中：交易所市场 | 341,427.25 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 55,635.44 |
| 合计 | 397,062.69 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|---|-----------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 基金合同生效日 | 212,326,751.00 | 212,326,751.00 |
| 本期申购 | 18,000,000.00 | 18,000,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -218,000,000.00 | -218,000,000.00 |
| 本期末 | 12,326,751.00 | 12,326,751.00 |

注：1、本基金于 2024 年 3 月 11 日至 2024 年 3 月 22 日期间进行发售，扣除认购费后有效认购资金为人民币 212,308,000.00 元，折合为 212,308,000.00 份基金份额。本基金设立募集期内认购资金的应收孳生利息人民币 18,751.00 元在本基金成立后，折算为 18,751.00 份基金份额归基金份额持有人所有。上述实收有效认购资金人民币 212,326,751.00 元，折合为 212,326,751.00 份基金份额。

2、根据《海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告》的相关规定，本基金于 2024 年 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 4 月 14 日止期间暂不向投资人开放基金交易,申

购和赎回业务自 2024 年 4 月 15 日起开始办理。

3、投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

| 项目 | 已实现部分 | 未实现部分 | 未分配利润合计 |
|----------------|---------------|-------------|---------------|
| 上年度末 | - | - | - |
| 本期期初 | - | - | - |
| 本期利润 | -8,391,924.77 | -567,672.37 | -8,959,597.14 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | 7,867,733.54 | 102,311.73 | 7,970,045.27 |
| 其中：基金申购款 | -470,818.69 | -696,805.29 | -1,167,623.98 |
| 基金赎回款 | 8,338,552.23 | 799,117.02 | 9,137,669.25 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | -524,191.23 | -465,360.64 | -989,551.87 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|-----------|---|
| 活期存款利息收入 | 11,493.03 |
| 定期存款利息收入 | - |
| 其他存款利息收入 | - |
| 结算备付金利息收入 | 110,200.92 |
| 其他 | 120.76 |
| 合计 | 121,814.71 |

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
|------------------|---|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | -3,169,382.20 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | -5,074,457.14 |
| 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 | -8,243,839.34 |

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|------------|---|
| | 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 卖出股票成交总额 | 158,373,306.26 |
| 减：卖出股票成本总额 | 161,092,358.05 |
| 减：交易费用 | 450,330.41 |
| 买卖股票差价收入 | -3,169,382.20 |

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------|---|
| | 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日 |
| 赎回基金份额对价总额 | 208,862,330.75 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 70,126,654.75 |
| 减：赎回股票成本总额 | 143,810,133.14 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | -5,074,457.14 |

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-------------------|--------------------------------|
| | 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
| 股指期货投资收益（税前） | 54,200.00 |
| 减：股指期货差价收入应缴纳增值税额 | 3,498.64 |
| 减：交易费用 | 176.02 |
| 合计 | 50,525.34 |

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|--------------------------------|
| | 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 146,195.44 |
| 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 | 146,195.44 |

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|----------------------------|--------------------------------------|
| 1.交易性金融资产 | -510,512.37 |
| ——股票投资 | -510,512.37 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——基金投资 | - |
| ——贵金属投资 | - |
| ——其他 | - |
| 2.衍生工具 | -57,160.00 |
| ——权证投资 | - |
| ——股指期货 | -57,160.00 |
| 4.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 | -567,672.37 |

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 替代损益 | -253,226.35 |
| 其他收入 | 472.23 |
| 合计 | -252,754.12 |

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|---------|--------------------------------------|
| 审计费用 | 17,142.72 |
| 信息披露费 | 34,285.44 |
| 证券出借违约金 | - |

| | |
|----------|-----------|
| 中登服务费 | 42,857.28 |
| 银行划款手续费 | 265.00 |
| IOPV 计算费 | 4,207.28 |
| 合计 | 98,757.72 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|--------------------|-----------------|
| 海富通基金管理有限公司(“海富通”) | 基金管理人、基金销售机构 |
| 招商银行股份有限公司(“招商银行”) | 基金托管人 |
| 海通证券股份有限公司(“海通证券”) | 基金管理人的股东、基金销售机构 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | |
|-------|--------------------------------|--------------|
| | 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 海通证券 | 463,262,621.14 | 100.00% |

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易，基金合同成立于 2024 年 03

月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | | | |
|-------|--------------------------------------|----------------|------------|------------------|
| | 当期 佣金 | 占当期佣金 总量的比例 | 期末应付佣金余额 | 占期末应付佣 金总额的比例 |
| 海通证券 | 341,427.25 | 100.00% | 341,427.25 | 100.00% |

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、根据证券交易单元租用协议，本基金管理人在租用海通证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还从海通证券获得研究综合服务。

3、基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|------------------|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的管理费 |
| 其中：应支付销售机构的客户维护费 | 303.39 |
| 应支付基金管理人的净管理费 | 95,270.99 |

注：1、支付基金管理人海富通基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 x 0.50%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 |
|----|--------------------------------------|
| | 当期发生的基金应支付的托管费 |

注：1、支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值 x 0.10%/当年天数。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易，基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

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

本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金，基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金，基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 | |
|-------|--------------------------------|-----------|
| | 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日 | |
| | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 招商银行 | 927,309.74 | 11,493.03 |

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券，基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项，基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为增强策略指数基金，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及股指期货等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将相对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“相对收益高、风险适中”的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公

司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

本基金的基金管理人建立了由督察长、风险管理委员会、风险管理部和督察稽核部及相关业务部门风险管理责任人构成的三层次风险管理架构体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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。

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有债券和资产支持证券。基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家发行的证券不得超过该证券的 10%，本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注流通受限证券。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性

金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2024年6月30日 | 1年以内 | 1-5年 | 5年以上 | 不计息 | 合计 |
|-------------------|--------------|------|------|---------------|---------------|
| 资产 | | | | | |
| 货币资金 | 927,309.74 | - | - | - | 927,309.74 |
| 结算备付金 | 407,168.42 | - | - | - | 407,168.42 |
| 存出保证金 | 52,191.43 | - | - | 116,592.00 | 168,783.43 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 10,118,193.16 | 10,118,193.16 |
| 应收清算款 | - | - | - | 672,401.53 | 672,401.53 |
| 其他资产 | - | - | - | 82,142.72 | 82,142.72 |
| 资产总计 | 1,386,669.59 | - | - | 10,989,329.41 | 12,375,999.00 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 634,615.08 | 634,615.08 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 5,935.07 | 5,935.07 |
| 应付托管费 | - | - | - | 1,187.03 | 1,187.03 |
| 其他负债 | - | - | - | 397,062.69 | 397,062.69 |
| 负债总计 | - | - | - | 1,038,799.87 | 1,038,799.87 |
| 利率敏感度缺口 | 1,386,669.59 | - | - | 9,950,529.54 | 11,337,199.13 |

注：1、表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

2、基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净

值无重大影响。基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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，一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 80%，投资于标的指数成份股和备选成份股的资产不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2024 年 6 月 30 日 | |
|---------------|------------------------|--------------|
| | 公允价值 | 占基金资产净值比例（%） |
| 交易性金融资产—股票投资 | 10,118,193.16 | 89.25 |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - |
| 合计 | 10,118,193.16 | 89.25 |

注：基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变 | |
|----|--------------------------------|---------------------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元) |
| | | 本期末 2024年6月30日 |
| | 1.业绩比较基准上升 5% | 643,218.05 |
| | 2.业绩比较基准下降 5% | -643,218.05 |

注:基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日,上年度可比期间无比较数据。

6.4.14 公允价值**6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法**

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。

三个层次输入值的定义如下:

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到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位:人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2024年6月30日 |
|---------------|-------------------|
| 第一层次 | 10,118,193.16 |
| 第二层次 | - |
| 第三层次 | - |
| 合计 | 10,118,193.16 |

注:基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日,上年度可比期间无比较数据。

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和可转换债券等,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等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，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 6 月 30 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。基金合同成立于 2024 年 03 月 27 日，上年度可比期间无比较数据。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------------|---------------|---------------|
| 1 | 权益投资 | 10,118,193.16 | 81.76 |
| | 其中：股票 | 10,118,193.16 | 81.76 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | - | - |
| | 其中：债券 | - | - |
| | 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 | 1,334,478.16 | 10.78 |
| 8 | 其他各项资产 | 923,327.68 | 7.46 |
| 9 | 合计 | 12,375,999.00 | 100.00 |

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

| 代码 | 行业类别 | 公允价值 | 占基金资产净值比例 (%) |
|----|------------------|---------------|------------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | 62,289.00 | 0.55 |
| B | 采矿业 | 67,360.00 | 0.59 |
| C | 制造业 | 7,121,958.22 | 62.82 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 327,468.00 | 2.89 |
| E | 建筑业 | 107,464.00 | 0.95 |
| F | 批发和零售业 | 510,831.80 | 4.51 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 180,486.70 | 1.59 |
| H | 住宿和餐饮业 | 23,660.00 | 0.21 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 882,745.64 | 7.79 |
| J | 金融业 | 22,192.00 | 0.20 |
| K | 房地产业 | 132,564.20 | 1.17 |
| L | 租赁和商务服务业 | 144,997.00 | 1.28 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 104,435.20 | 0.92 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 177,469.00 | 1.57 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | 2,946.00 | 0.03 |
| Q | 卫生和社会工作 | 21,648.00 | 0.19 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 180,522.00 | 1.59 |
| S | 综合 | 47,156.40 | 0.42 |
| | 合计 | 10,118,193.16 | 89.25 |

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值 | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|-----------|--------------|
| 1 | 301279 | 金道科技 | 1,300 | 31,694.00 | 0.28 |
| 2 | 301391 | 卡莱特 | 680 | 29,770.40 | 0.26 |
| 3 | 300835 | 龙磁科技 | 1,000 | 29,050.00 | 0.26 |
| 4 | 688399 | 硕世生物 | 400 | 27,048.00 | 0.24 |
| 5 | 301138 | 华研精机 | 1,100 | 26,279.00 | 0.23 |
| 6 | 300606 | 金太阳 | 1,400 | 25,984.00 | 0.23 |
| 7 | 301072 | 中捷精工 | 1,300 | 25,844.00 | 0.23 |
| 8 | 301338 | 凯格精机 | 800 | 25,704.00 | 0.23 |
| 9 | 002510 | 天汽模 | 6,600 | 25,674.00 | 0.23 |
| 10 | 002997 | 瑞鹄模具 | 800 | 25,576.00 | 0.23 |
| 11 | 300879 | 大叶股份 | 1,900 | 25,422.00 | 0.22 |
| 12 | 002451 | 摩恩电气 | 4,700 | 25,239.00 | 0.22 |
| 13 | 300872 | 天阳科技 | 1,900 | 25,175.00 | 0.22 |
| 14 | 603189 | 网达软件 | 2,300 | 25,162.00 | 0.22 |
| 15 | 300337 | 银邦股份 | 3,100 | 25,110.00 | 0.22 |
| 16 | 002106 | 莱宝高科 | 2,300 | 25,070.00 | 0.22 |
| 17 | 300276 | 三丰智能 | 7,100 | 24,992.00 | 0.22 |
| 18 | 300120 | 经纬辉开 | 4,800 | 24,912.00 | 0.22 |
| 19 | 300173 | 福能东方 | 6,600 | 24,882.00 | 0.22 |
| 20 | 000036 | 华联控股 | 7,630 | 24,721.20 | 0.22 |
| 21 | 300448 | 浩云科技 | 5,900 | 24,721.00 | 0.22 |
| 22 | 605128 | 上海沿浦 | 884 | 24,654.76 | 0.22 |
| 23 | 603912 | 佳力图 | 4,100 | 24,600.00 | 0.22 |
| 24 | 002248 | 华东数控 | 4,100 | 24,559.00 | 0.22 |
| 25 | 603663 | 三祥新材 | 1,700 | 24,463.00 | 0.22 |
| 26 | 002903 | 宇环数控 | 1,400 | 24,458.00 | 0.22 |
| 27 | 600020 | 中原高速 | 6,900 | 24,426.00 | 0.22 |
| 28 | 603977 | 国泰集团 | 2,400 | 24,408.00 | 0.22 |
| 29 | 600255 | 鑫科材料 | 14,100 | 24,393.00 | 0.22 |
| 30 | 300375 | 鹏翎股份 | 6,300 | 24,381.00 | 0.22 |
| 31 | 300921 | 南凌科技 | 1,400 | 24,248.00 | 0.21 |
| 32 | 002725 | 跃岭股份 | 2,900 | 24,244.00 | 0.21 |
| 33 | 000833 | 粤桂股份 | 5,180 | 24,242.40 | 0.21 |
| 34 | 603015 | 弘讯科技 | 3,200 | 24,192.00 | 0.21 |
| 35 | 300304 | 云意电气 | 3,700 | 24,087.00 | 0.21 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 36 | 300184 | 力源信息 | 5,200 | 24,076.00 | 0.21 |
| 37 | 002117 | 东港股份 | 3,400 | 24,072.00 | 0.21 |
| 38 | 300131 | 英唐智控 | 5,400 | 24,030.00 | 0.21 |
| 39 | 300400 | 劲拓股份 | 2,100 | 24,024.00 | 0.21 |
| 40 | 600035 | 楚天高速 | 5,600 | 24,024.00 | 0.21 |
| 41 | 600237 | 铜峰电子 | 4,600 | 24,012.00 | 0.21 |
| 42 | 603206 | 嘉环科技 | 1,900 | 23,997.00 | 0.21 |
| 43 | 603889 | 新澳股份 | 3,100 | 23,994.00 | 0.21 |
| 44 | 002907 | 华森制药 | 1,900 | 23,978.00 | 0.21 |
| 45 | 301507 | 民生健康 | 1,900 | 23,978.00 | 0.21 |
| 46 | 688259 | 创耀科技 | 600 | 23,976.00 | 0.21 |
| 47 | 301133 | 金钟股份 | 1,100 | 23,969.00 | 0.21 |
| 48 | 601339 | 百隆东方 | 4,600 | 23,966.00 | 0.21 |
| 49 | 002337 | 赛象科技 | 6,300 | 23,940.00 | 0.21 |
| 50 | 300559 | 佳发教育 | 2,500 | 23,925.00 | 0.21 |
| 51 | 002533 | 金杯电工 | 2,400 | 23,880.00 | 0.21 |
| 52 | 002476 | 宝莫股份 | 6,500 | 23,855.00 | 0.21 |
| 53 | 300176 | 派生科技 | 5,400 | 23,814.00 | 0.21 |
| 54 | 301263 | 泰恩康 | 1,900 | 23,807.00 | 0.21 |
| 55 | 300360 | 炬华科技 | 1,400 | 23,800.00 | 0.21 |
| 56 | 002137 | 实益达 | 5,000 | 23,800.00 | 0.21 |
| 57 | 002380 | 科远智慧 | 1,300 | 23,790.00 | 0.21 |
| 58 | 001234 | 泰慕士 | 1,400 | 23,786.00 | 0.21 |
| 59 | 300771 | 智莱科技 | 2,700 | 23,733.00 | 0.21 |
| 60 | 002225 | 濮耐股份 | 5,800 | 23,722.00 | 0.21 |
| 61 | 002420 | 毅昌科技 | 5,200 | 23,712.00 | 0.21 |
| 62 | 603727 | 博迈科 | 1,800 | 23,688.00 | 0.21 |
| 63 | 603266 | 天龙股份 | 1,400 | 23,688.00 | 0.21 |
| 64 | 002406 | 远东传动 | 4,800 | 23,664.00 | 0.21 |
| 65 | 301073 | 君亭酒店 | 1,300 | 23,660.00 | 0.21 |
| 66 | 002787 | 华源控股 | 3,500 | 23,660.00 | 0.21 |
| 67 | 002835 | 同为股份 | 1,400 | 23,646.00 | 0.21 |
| 68 | 605016 | 百龙创园 | 1,160 | 23,629.20 | 0.21 |
| 69 | 002611 | 东方精工 | 4,500 | 23,625.00 | 0.21 |
| 70 | 002953 | 日丰股份 | 3,010 | 23,598.40 | 0.21 |
| 71 | 002519 | 银河电子 | 4,800 | 23,568.00 | 0.21 |
| 72 | 002238 | 天威视讯 | 3,000 | 23,550.00 | 0.21 |
| 73 | 688579 | 山大地纬 | 3,000 | 23,550.00 | 0.21 |
| 74 | 001331 | 胜通能源 | 1,700 | 23,545.00 | 0.21 |
| 75 | 300047 | 天源迪科 | 3,600 | 23,544.00 | 0.21 |
| 76 | 300231 | 银信科技 | 3,200 | 23,520.00 | 0.21 |
| 77 | 002577 | 雷柏科技 | 1,900 | 23,503.00 | 0.21 |
| 78 | 002449 | 国星光电 | 3,300 | 23,496.00 | 0.21 |
| 79 | 301285 | 鸿日达 | 900 | 23,481.00 | 0.21 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 80 | 300941 | 创识科技 | 1,300 | 23,478.00 | 0.21 |
| 81 | 603861 | 白云电器 | 2,800 | 23,436.00 | 0.21 |
| 82 | 600525 | 长园集团 | 5,500 | 23,430.00 | 0.21 |
| 83 | 300556 | 丝路视觉 | 1,400 | 23,422.00 | 0.21 |
| 84 | 000409 | 云鼎科技 | 2,900 | 23,403.00 | 0.21 |
| 85 | 600558 | 大西洋 | 6,500 | 23,400.00 | 0.21 |
| 86 | 003025 | 思进智能 | 1,900 | 23,389.00 | 0.21 |
| 87 | 600551 | 时代出版 | 3,300 | 23,364.00 | 0.21 |
| 88 | 600228 | 返利科技 | 4,800 | 23,328.00 | 0.21 |
| 89 | 603353 | 和顺石油 | 1,800 | 23,328.00 | 0.21 |
| 90 | 002017 | 东信和平 | 2,800 | 23,324.00 | 0.21 |
| 91 | 603081 | 大丰实业 | 2,500 | 23,300.00 | 0.21 |
| 92 | 000593 | 德龙汇能 | 5,000 | 23,300.00 | 0.21 |
| 93 | 301280 | 珠城科技 | 600 | 23,280.00 | 0.21 |
| 94 | 600769 | 祥龙电业 | 3,700 | 23,273.00 | 0.21 |
| 95 | 000045 | 深纺织 A | 2,900 | 23,258.00 | 0.21 |
| 96 | 002095 | 生意宝 | 1,900 | 23,256.00 | 0.21 |
| 97 | 688252 | 天德钰 | 1,600 | 23,248.00 | 0.21 |
| 98 | 300424 | 航新科技 | 1,900 | 23,237.00 | 0.20 |
| 99 | 603960 | 克来机电 | 1,100 | 23,210.00 | 0.20 |
| 100 | 600694 | 大商股份 | 1,380 | 23,197.80 | 0.20 |
| 101 | 300962 | 中金辐照 | 1,700 | 23,188.00 | 0.20 |
| 102 | 603738 | 泰晶科技 | 1,700 | 23,188.00 | 0.20 |
| 103 | 000919 | 金陵药业 | 3,700 | 23,162.00 | 0.20 |
| 104 | 300504 | 天邑股份 | 1,900 | 23,161.00 | 0.20 |
| 105 | 300607 | 拓斯达 | 1,700 | 23,154.00 | 0.20 |
| 106 | 688233 | 神工股份 | 1,200 | 23,124.00 | 0.20 |
| 107 | 600738 | 丽尚国潮 | 6,300 | 23,121.00 | 0.20 |
| 108 | 002364 | 中恒电气 | 4,200 | 23,100.00 | 0.20 |
| 109 | 301149 | 隆华新材 | 2,500 | 23,100.00 | 0.20 |
| 110 | 603222 | 济民医疗 | 4,200 | 23,100.00 | 0.20 |
| 111 | 300978 | 东箭科技 | 2,500 | 23,075.00 | 0.20 |
| 112 | 300426 | 唐德影视 | 3,400 | 23,052.00 | 0.20 |
| 113 | 002164 | 宁波东力 | 6,000 | 23,040.00 | 0.20 |
| 114 | 000803 | 山高环能 | 6,600 | 23,034.00 | 0.20 |
| 115 | 300571 | 平治信息 | 1,100 | 23,034.00 | 0.20 |
| 116 | 002765 | 蓝黛科技 | 4,900 | 23,030.00 | 0.20 |
| 117 | 002908 | 德生科技 | 3,000 | 23,010.00 | 0.20 |
| 118 | 002660 | 茂硕电源 | 3,100 | 23,002.00 | 0.20 |
| 119 | 603357 | 设计总院 | 2,500 | 22,975.00 | 0.20 |
| 120 | 603507 | 振江股份 | 700 | 22,974.00 | 0.20 |
| 121 | 301063 | 海锅股份 | 1,600 | 22,944.00 | 0.20 |
| 122 | 002615 | 哈尔斯 | 3,700 | 22,940.00 | 0.20 |
| 123 | 300228 | 富瑞特装 | 4,200 | 22,932.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 124 | 300275 | 梅安森 | 2,300 | 22,931.00 | 0.20 |
| 125 | 301185 | 鸥玛软件 | 1,600 | 22,928.00 | 0.20 |
| 126 | 600088 | 中视传媒 | 1,400 | 22,918.00 | 0.20 |
| 127 | 000532 | 华金资本 | 1,900 | 22,914.00 | 0.20 |
| 128 | 002073 | 软控股份 | 3,100 | 22,909.00 | 0.20 |
| 129 | 002543 | 万和电气 | 2,300 | 22,908.00 | 0.20 |
| 130 | 300805 | 电声股份 | 3,600 | 22,896.00 | 0.20 |
| 131 | 603315 | 福鞍股份 | 2,400 | 22,896.00 | 0.20 |
| 132 | 003000 | 劲仔食品 | 1,900 | 22,895.00 | 0.20 |
| 133 | 002915 | 中欣氟材 | 2,300 | 22,885.00 | 0.20 |
| 134 | 001217 | 华尔泰 | 2,500 | 22,875.00 | 0.20 |
| 135 | 300584 | 海辰药业 | 1,500 | 22,845.00 | 0.20 |
| 136 | 300247 | 融捷健康 | 9,400 | 22,842.00 | 0.20 |
| 137 | 601700 | 风范股份 | 5,200 | 22,828.00 | 0.20 |
| 138 | 000544 | 中原环保 | 2,900 | 22,823.00 | 0.20 |
| 139 | 001319 | 铭科精技 | 1,400 | 22,820.00 | 0.20 |
| 140 | 000530 | 冰山冷热 | 6,300 | 22,806.00 | 0.20 |
| 141 | 300800 | 力合科技 | 2,200 | 22,792.00 | 0.20 |
| 142 | 603618 | 杭电股份 | 5,200 | 22,776.00 | 0.20 |
| 143 | 001328 | 登康口腔 | 900 | 22,770.00 | 0.20 |
| 144 | 002375 | 亚厦股份 | 7,000 | 22,750.00 | 0.20 |
| 145 | 001300 | 三柏硕 | 2,000 | 22,740.00 | 0.20 |
| 146 | 002441 | 众业达 | 3,000 | 22,740.00 | 0.20 |
| 147 | 000099 | 中信海直 | 1,400 | 22,736.00 | 0.20 |
| 148 | 300560 | 中富通 | 2,100 | 22,722.00 | 0.20 |
| 149 | 603999 | 读者传媒 | 4,800 | 22,704.00 | 0.20 |
| 150 | 003015 | 日久光电 | 2,500 | 22,700.00 | 0.20 |
| 151 | 002771 | 真视通 | 1,400 | 22,694.00 | 0.20 |
| 152 | 002277 | 友阿股份 | 10,500 | 22,680.00 | 0.20 |
| 153 | 600191 | 华资实业 | 4,700 | 22,654.00 | 0.20 |
| 154 | 002885 | 京泉华 | 2,100 | 22,638.00 | 0.20 |
| 155 | 002161 | 远望谷 | 4,900 | 22,638.00 | 0.20 |
| 156 | 605218 | 伟时电子 | 1,400 | 22,610.00 | 0.20 |
| 157 | 002177 | 御银股份 | 7,000 | 22,610.00 | 0.20 |
| 158 | 603258 | 电魂网络 | 1,400 | 22,610.00 | 0.20 |
| 159 | 002664 | 信质集团 | 1,900 | 22,610.00 | 0.20 |
| 160 | 600758 | 辽宁能源 | 7,900 | 22,594.00 | 0.20 |
| 161 | 301126 | 达嘉维康 | 2,500 | 22,575.00 | 0.20 |
| 162 | 300272 | 开能健康 | 4,600 | 22,540.00 | 0.20 |
| 163 | 603158 | 腾龙股份 | 3,200 | 22,528.00 | 0.20 |
| 164 | 600368 | 五洲交通 | 6,310 | 22,526.70 | 0.20 |
| 165 | 300279 | 和晶科技 | 5,400 | 22,518.00 | 0.20 |
| 166 | 600292 | 远达环保 | 4,800 | 22,512.00 | 0.20 |
| 167 | 301408 | 华人健康 | 2,200 | 22,506.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 168 | 300238 | 冠昊生物 | 2,500 | 22,500.00 | 0.20 |
| 169 | 300708 | 聚灿光电 | 2,500 | 22,500.00 | 0.20 |
| 170 | 300434 | 金石亚药 | 3,000 | 22,500.00 | 0.20 |
| 171 | 603777 | 来伊份 | 2,400 | 22,488.00 | 0.20 |
| 172 | 301330 | 熵基科技 | 1,000 | 22,480.00 | 0.20 |
| 173 | 002140 | 东华科技 | 2,900 | 22,475.00 | 0.20 |
| 174 | 300414 | 中光防雷 | 3,400 | 22,474.00 | 0.20 |
| 175 | 002845 | 同兴达 | 1,700 | 22,474.00 | 0.20 |
| 176 | 300569 | 天能重工 | 5,400 | 22,464.00 | 0.20 |
| 177 | 301062 | 上海艾录 | 2,200 | 22,462.00 | 0.20 |
| 178 | 600829 | 人民同泰 | 4,000 | 22,440.00 | 0.20 |
| 179 | 603408 | 建霖家居 | 1,700 | 22,423.00 | 0.20 |
| 180 | 301102 | 兆讯传媒 | 1,900 | 22,401.00 | 0.20 |
| 181 | 600576 | 祥源文旅 | 5,100 | 22,389.00 | 0.20 |
| 182 | 300566 | 激智科技 | 1,600 | 22,384.00 | 0.20 |
| 183 | 000715 | 中兴商业 | 4,700 | 22,372.00 | 0.20 |
| 184 | 002515 | 金字火腿 | 5,900 | 22,361.00 | 0.20 |
| 185 | 600825 | 新华传媒 | 5,900 | 22,361.00 | 0.20 |
| 186 | 301160 | 翔楼新材 | 600 | 22,350.00 | 0.20 |
| 187 | 605005 | 合兴股份 | 1,400 | 22,344.00 | 0.20 |
| 188 | 000900 | 现代投资 | 6,100 | 22,326.00 | 0.20 |
| 189 | 301116 | 益客食品 | 2,500 | 22,325.00 | 0.20 |
| 190 | 002521 | 齐峰新材 | 1,900 | 22,325.00 | 0.20 |
| 191 | 301111 | 粤万年青 | 1,600 | 22,320.00 | 0.20 |
| 192 | 603967 | 中创物流 | 2,400 | 22,320.00 | 0.20 |
| 193 | 002896 | 中大力德 | 800 | 22,320.00 | 0.20 |
| 194 | 002187 | 广百股份 | 5,400 | 22,302.00 | 0.20 |
| 195 | 603095 | 越剑智能 | 1,700 | 22,287.00 | 0.20 |
| 196 | 300945 | 曼卡龙 | 2,500 | 22,275.00 | 0.20 |
| 197 | 000965 | 天保基建 | 8,500 | 22,270.00 | 0.20 |
| 198 | 002752 | 昇兴股份 | 4,400 | 22,264.00 | 0.20 |
| 199 | 600226 | 亨通股份 | 11,300 | 22,261.00 | 0.20 |
| 200 | 301318 | 维海德 | 810 | 22,250.70 | 0.20 |
| 201 | 000899 | 赣能股份 | 2,300 | 22,241.00 | 0.20 |
| 202 | 002358 | 森源电气 | 6,500 | 22,230.00 | 0.20 |
| 203 | 300048 | 合康新能 | 4,800 | 22,224.00 | 0.20 |
| 204 | 300968 | 格林精密 | 2,400 | 22,224.00 | 0.20 |
| 205 | 300908 | 仲景食品 | 800 | 22,224.00 | 0.20 |
| 206 | 600503 | 华丽家族 | 12,400 | 22,196.00 | 0.20 |
| 207 | 603687 | 大胜达 | 3,100 | 22,196.00 | 0.20 |
| 208 | 688247 | 宣泰医药 | 2,700 | 22,194.00 | 0.20 |
| 209 | 600053 | 九鼎投资 | 1,600 | 22,192.00 | 0.20 |
| 210 | 688077 | 大地熊 | 1,400 | 22,162.00 | 0.20 |
| 211 | 603017 | 中衡设计 | 2,500 | 22,150.00 | 0.20 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 212 | 688049 | 炬芯科技 | 1,000 | 22,120.00 | 0.20 |
| 213 | 300545 | 联得装备 | 900 | 22,095.00 | 0.19 |
| 214 | 688371 | 菲沃泰 | 2,200 | 22,088.00 | 0.19 |
| 215 | 002666 | 德联集团 | 6,100 | 22,082.00 | 0.19 |
| 216 | 300802 | 矩子科技 | 1,400 | 22,078.00 | 0.19 |
| 217 | 603318 | 水发燃气 | 3,900 | 22,074.00 | 0.19 |
| 218 | 601116 | 三江购物 | 2,900 | 22,069.00 | 0.19 |
| 219 | 603193 | 润本股份 | 1,200 | 22,068.00 | 0.19 |
| 220 | 300194 | 福安药业 | 5,900 | 22,066.00 | 0.19 |
| 221 | 688195 | 腾景科技 | 900 | 22,059.00 | 0.19 |
| 222 | 002333 | 罗普斯金 | 4,100 | 22,017.00 | 0.19 |
| 223 | 300307 | 慈星股份 | 3,700 | 22,015.00 | 0.19 |
| 224 | 603496 | 恒为科技 | 900 | 22,005.00 | 0.19 |
| 225 | 000631 | 顺发恒业 | 9,400 | 21,996.00 | 0.19 |
| 226 | 603336 | 宏辉果蔬 | 7,300 | 21,973.00 | 0.19 |
| 227 | 688662 | 富信科技 | 900 | 21,960.00 | 0.19 |
| 228 | 300731 | 科创新源 | 1,500 | 21,960.00 | 0.19 |
| 229 | 603569 | 长久物流 | 3,200 | 21,952.00 | 0.19 |
| 230 | 002526 | 山东矿机 | 9,300 | 21,948.00 | 0.19 |
| 231 | 300534 | 陇神戎发 | 3,100 | 21,948.00 | 0.19 |
| 232 | 600354 | 敦煌种业 | 4,600 | 21,942.00 | 0.19 |
| 233 | 300505 | 川金诺 | 1,800 | 21,942.00 | 0.19 |
| 234 | 603520 | 司太立 | 2,300 | 21,942.00 | 0.19 |
| 235 | 603239 | 浙江仙通 | 1,600 | 21,936.00 | 0.19 |
| 236 | 603211 | 晋拓股份 | 1,600 | 21,936.00 | 0.19 |
| 237 | 688022 | 瀚川智能 | 1,600 | 21,936.00 | 0.19 |
| 238 | 603230 | 内蒙新华 | 1,900 | 21,926.00 | 0.19 |
| 239 | 002418 | 康盛股份 | 11,600 | 21,924.00 | 0.19 |
| 240 | 002330 | 得利斯 | 6,000 | 21,900.00 | 0.19 |
| 241 | 002033 | 丽江股份 | 2,500 | 21,900.00 | 0.19 |
| 242 | 000812 | 陕西金叶 | 6,100 | 21,899.00 | 0.19 |
| 243 | 002833 | 弘亚数控 | 1,200 | 21,888.00 | 0.19 |
| 244 | 600987 | 航民股份 | 3,100 | 21,886.00 | 0.19 |
| 245 | 002111 | 威海广泰 | 2,100 | 21,882.00 | 0.19 |
| 246 | 002866 | 传艺科技 | 1,700 | 21,879.00 | 0.19 |
| 247 | 300403 | 汉宇集团 | 3,200 | 21,856.00 | 0.19 |
| 248 | 300174 | 元力股份 | 1,600 | 21,840.00 | 0.19 |
| 249 | 600814 | 杭州解百 | 3,700 | 21,830.00 | 0.19 |
| 250 | 301187 | 欧圣电气 | 900 | 21,825.00 | 0.19 |
| 251 | 002175 | 东方智造 | 12,400 | 21,824.00 | 0.19 |
| 252 | 002881 | 美格智能 | 1,100 | 21,824.00 | 0.19 |
| 253 | 600880 | 博瑞传播 | 5,800 | 21,808.00 | 0.19 |
| 254 | 002014 | 永新股份 | 2,300 | 21,804.00 | 0.19 |
| 255 | 600367 | 红星发展 | 2,200 | 21,802.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|-------|-------|-----------|------|
| 256 | 000888 | 峨眉山 A | 2,000 | 21,780.00 | 0.19 |
| 257 | 000523 | 红棉股份 | 8,400 | 21,756.00 | 0.19 |
| 258 | 300145 | 中金环境 | 8,700 | 21,750.00 | 0.19 |
| 259 | 002574 | 明牌珠宝 | 5,200 | 21,736.00 | 0.19 |
| 260 | 300798 | 锦鸡股份 | 3,500 | 21,735.00 | 0.19 |
| 261 | 300453 | 三鑫医疗 | 3,400 | 21,726.00 | 0.19 |
| 262 | 300314 | 戴维医疗 | 2,100 | 21,714.00 | 0.19 |
| 263 | 301382 | 蜂助手 | 1,200 | 21,708.00 | 0.19 |
| 264 | 002876 | 三利谱 | 900 | 21,708.00 | 0.19 |
| 265 | 600789 | 鲁抗医药 | 3,100 | 21,700.00 | 0.19 |
| 266 | 601065 | 江盐集团 | 2,500 | 21,675.00 | 0.19 |
| 267 | 002029 | 七匹狼 | 4,300 | 21,672.00 | 0.19 |
| 268 | 002172 | 澳洋健康 | 8,800 | 21,648.00 | 0.19 |
| 269 | 688292 | 浩瀚深度 | 1,400 | 21,644.00 | 0.19 |
| 270 | 301226 | 祥明智能 | 1,300 | 21,632.00 | 0.19 |
| 271 | 002133 | 广宇集团 | 9,700 | 21,631.00 | 0.19 |
| 272 | 002090 | 金智科技 | 2,500 | 21,600.00 | 0.19 |
| 273 | 000576 | 甘化科工 | 3,600 | 21,600.00 | 0.19 |
| 274 | 002026 | 山东威达 | 2,600 | 21,580.00 | 0.19 |
| 275 | 688222 | 成都先导 | 1,900 | 21,565.00 | 0.19 |
| 276 | 002009 | 天奇股份 | 1,900 | 21,546.00 | 0.19 |
| 277 | 300278 | 华昌达 | 7,500 | 21,525.00 | 0.19 |
| 278 | 301139 | 元道通信 | 1,000 | 21,510.00 | 0.19 |
| 279 | 688138 | 清溢光电 | 1,000 | 21,500.00 | 0.19 |
| 280 | 002988 | 豪美新材 | 1,400 | 21,490.00 | 0.19 |
| 281 | 600283 | 钱江水利 | 1,700 | 21,488.00 | 0.19 |
| 282 | 600785 | 新华百货 | 1,600 | 21,472.00 | 0.19 |
| 283 | 605007 | 五洲特纸 | 1,700 | 21,471.00 | 0.19 |
| 284 | 300349 | 金卡智能 | 1,800 | 21,456.00 | 0.19 |
| 285 | 300021 | 大禹节水 | 6,500 | 21,450.00 | 0.19 |
| 286 | 000612 | 焦作万方 | 3,300 | 21,450.00 | 0.19 |
| 287 | 605228 | 神通科技 | 2,500 | 21,450.00 | 0.19 |
| 288 | 601199 | 江南水务 | 4,400 | 21,428.00 | 0.19 |
| 289 | 300153 | 科泰电源 | 3,600 | 21,420.00 | 0.19 |
| 290 | 002478 | 常宝股份 | 4,300 | 21,414.00 | 0.19 |
| 291 | 603949 | 雪龙集团 | 1,900 | 21,394.00 | 0.19 |
| 292 | 000533 | 顺钠股份 | 6,500 | 21,385.00 | 0.19 |
| 293 | 603689 | 皖天然气 | 2,600 | 21,372.00 | 0.19 |
| 294 | 603121 | 华培动力 | 3,000 | 21,360.00 | 0.19 |
| 295 | 603668 | 天马科技 | 1,880 | 21,338.00 | 0.19 |
| 296 | 600108 | 亚盛集团 | 9,000 | 21,330.00 | 0.19 |
| 297 | 002103 | 广博股份 | 4,300 | 21,328.00 | 0.19 |
| 298 | 300512 | 中亚股份 | 3,600 | 21,312.00 | 0.19 |
| 299 | 688560 | 明冠新材 | 2,000 | 21,300.00 | 0.19 |

| | | | | | |
|-----|--------|--------|-------|-----------|------|
| 300 | 000633 | 合金投资 | 5,400 | 21,276.00 | 0.19 |
| 301 | 300219 | 鸿利智汇 | 3,800 | 21,242.00 | 0.19 |
| 302 | 300966 | 共同药业 | 1,300 | 21,242.00 | 0.19 |
| 303 | 002702 | 海欣食品 | 5,900 | 21,240.00 | 0.19 |
| 304 | 603322 | 超讯通信 | 800 | 21,208.00 | 0.19 |
| 305 | 002849 | 威星智能 | 1,900 | 21,204.00 | 0.19 |
| 306 | 300172 | 中电环保 | 4,700 | 21,197.00 | 0.19 |
| 307 | 002393 | 力生制药 | 1,340 | 21,185.40 | 0.19 |
| 308 | 688089 | 嘉必优 | 1,600 | 21,184.00 | 0.19 |
| 309 | 688182 | 灿勤科技 | 1,600 | 21,184.00 | 0.19 |
| 310 | 600846 | 同济科技 | 3,100 | 21,173.00 | 0.19 |
| 311 | 300181 | 佐力药业 | 1,400 | 21,168.00 | 0.19 |
| 312 | 603701 | 德宏股份 | 2,000 | 21,160.00 | 0.19 |
| 313 | 300179 | 四方达 | 3,200 | 21,152.00 | 0.19 |
| 314 | 603110 | 东方材料 | 1,900 | 21,147.00 | 0.19 |
| 315 | 688133 | 泰坦科技 | 1,340 | 21,145.20 | 0.19 |
| 316 | 600664 | 哈药股份 | 8,000 | 21,120.00 | 0.19 |
| 317 | 605198 | 安德利 | 800 | 21,120.00 | 0.19 |
| 318 | 001223 | 欧克科技 | 600 | 21,114.00 | 0.19 |
| 319 | 688378 | 奥来德 | 900 | 21,114.00 | 0.19 |
| 320 | 002282 | 博深股份 | 3,300 | 21,087.00 | 0.19 |
| 321 | 603619 | 中曼石油 | 900 | 21,078.00 | 0.19 |
| 322 | 300792 | 壹网壹创 | 1,400 | 21,070.00 | 0.19 |
| 323 | 603897 | 长城科技 | 1,200 | 21,060.00 | 0.19 |
| 324 | 688148 | 芳源股份 | 5,000 | 21,050.00 | 0.19 |
| 325 | 601566 | 九牧王 | 2,500 | 21,050.00 | 0.19 |
| 326 | 603399 | 吉翔股份 | 3,400 | 21,046.00 | 0.19 |
| 327 | 300493 | 润欣科技 | 2,600 | 21,034.00 | 0.19 |
| 328 | 603630 | 拉芳家化 | 2,000 | 21,020.00 | 0.19 |
| 329 | 603662 | 柯力传感 | 900 | 21,006.00 | 0.19 |
| 330 | 605389 | 长龄液压 | 1,000 | 20,990.00 | 0.19 |
| 331 | 600336 | 澳柯玛 | 4,900 | 20,972.00 | 0.18 |
| 332 | 002686 | 亿利达 | 5,000 | 20,950.00 | 0.18 |
| 333 | 002536 | 飞龙股份 | 2,200 | 20,944.00 | 0.18 |
| 334 | 688313 | 仕佳光子 | 2,200 | 20,944.00 | 0.18 |
| 335 | 603065 | 宿迁联盛 | 2,800 | 20,916.00 | 0.18 |
| 336 | 603367 | 辰欣药业 | 1,500 | 20,910.00 | 0.18 |
| 337 | 002613 | 北玻股份 | 6,000 | 20,880.00 | 0.18 |
| 338 | 301256 | 华融化学 | 3,400 | 20,876.00 | 0.18 |
| 339 | 000421 | 南京公用 | 4,700 | 20,868.00 | 0.18 |
| 340 | 600613 | 神奇制药 | 3,900 | 20,865.00 | 0.18 |
| 341 | 300681 | 英搏尔 | 1,600 | 20,864.00 | 0.18 |
| 342 | 002668 | TCL 智家 | 2,300 | 20,838.00 | 0.18 |
| 343 | 688189 | 南新制药 | 3,700 | 20,831.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 344 | 300985 | 致远新能 | 1,300 | 20,826.00 | 0.18 |
| 345 | 002150 | 通润装备 | 1,700 | 20,791.00 | 0.18 |
| 346 | 000404 | 长虹华意 | 3,900 | 20,787.00 | 0.18 |
| 347 | 601089 | 福元医药 | 1,500 | 20,775.00 | 0.18 |
| 348 | 301085 | 亚康股份 | 500 | 20,760.00 | 0.18 |
| 349 | 300982 | 苏文电能 | 1,100 | 20,746.00 | 0.18 |
| 350 | 300969 | 恒帅股份 | 300 | 20,739.00 | 0.18 |
| 351 | 300351 | 永贵电器 | 1,400 | 20,720.00 | 0.18 |
| 352 | 002864 | 盘龙药业 | 800 | 20,704.00 | 0.18 |
| 353 | 688533 | 上声电子 | 800 | 20,696.00 | 0.18 |
| 354 | 600468 | 百利电气 | 4,800 | 20,688.00 | 0.18 |
| 355 | 002559 | 亚威股份 | 2,700 | 20,682.00 | 0.18 |
| 356 | 688068 | 热景生物 | 800 | 20,664.00 | 0.18 |
| 357 | 002300 | 太阳电缆 | 3,912 | 20,655.36 | 0.18 |
| 358 | 605305 | 中际联合 | 800 | 20,632.00 | 0.18 |
| 359 | 300858 | 科拓生物 | 1,400 | 20,608.00 | 0.18 |
| 360 | 300063 | 天龙集团 | 5,400 | 20,574.00 | 0.18 |
| 361 | 300740 | 水羊股份 | 1,400 | 20,552.00 | 0.18 |
| 362 | 002952 | 亚世光电 | 1,000 | 20,550.00 | 0.18 |
| 363 | 002438 | 江苏神通 | 1,900 | 20,539.00 | 0.18 |
| 364 | 002481 | 双塔食品 | 5,300 | 20,511.00 | 0.18 |
| 365 | 603970 | 中农立华 | 1,200 | 20,496.00 | 0.18 |
| 366 | 605398 | 新炬网络 | 1,000 | 20,490.00 | 0.18 |
| 367 | 605555 | 德昌股份 | 1,100 | 20,471.00 | 0.18 |
| 368 | 600866 | 星湖科技 | 3,700 | 20,424.00 | 0.18 |
| 369 | 002824 | 和胜股份 | 1,600 | 20,416.00 | 0.18 |
| 370 | 603768 | 常青股份 | 1,800 | 20,412.00 | 0.18 |
| 371 | 300791 | 仙乐健康 | 810 | 20,412.00 | 0.18 |
| 372 | 002115 | 三维通信 | 4,200 | 20,412.00 | 0.18 |
| 373 | 300818 | 耐普矿机 | 800 | 20,400.00 | 0.18 |
| 374 | 301092 | 争光股份 | 900 | 20,376.00 | 0.18 |
| 375 | 603359 | 东珠生态 | 5,600 | 20,328.00 | 0.18 |
| 376 | 300258 | 精锻科技 | 2,500 | 20,325.00 | 0.18 |
| 377 | 605289 | 罗曼股份 | 800 | 20,320.00 | 0.18 |
| 378 | 300396 | 迪瑞医疗 | 1,000 | 20,310.00 | 0.18 |
| 379 | 002616 | 长青集团 | 4,700 | 20,304.00 | 0.18 |
| 380 | 605299 | 舒华体育 | 2,500 | 20,300.00 | 0.18 |
| 381 | 001212 | 中旗新材 | 1,000 | 20,300.00 | 0.18 |
| 382 | 002284 | 亚太股份 | 3,000 | 20,280.00 | 0.18 |
| 383 | 301398 | 星源卓镁 | 500 | 20,275.00 | 0.18 |
| 384 | 688510 | 航亚科技 | 1,100 | 20,251.00 | 0.18 |
| 385 | 688566 | 吉贝尔 | 900 | 20,250.00 | 0.18 |
| 386 | 301066 | 万事利 | 2,500 | 20,250.00 | 0.18 |
| 387 | 600186 | 莲花控股 | 5,900 | 20,237.00 | 0.18 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|-----------|------|
| 388 | 688025 | 杰普特 | 500 | 20,195.00 | 0.18 |
| 389 | 600897 | 厦门空港 | 1,600 | 20,176.00 | 0.18 |
| 390 | 600429 | 三元股份 | 5,400 | 20,142.00 | 0.18 |
| 391 | 002454 | 松芝股份 | 3,600 | 20,124.00 | 0.18 |
| 392 | 301101 | 明月镜片 | 900 | 20,106.00 | 0.18 |
| 393 | 300288 | 朗玛信息 | 1,900 | 20,083.00 | 0.18 |
| 394 | 002093 | 国脉科技 | 3,300 | 20,031.00 | 0.18 |
| 395 | 002799 | 环球印务 | 3,400 | 19,992.00 | 0.18 |
| 396 | 002264 | 新华都 | 3,900 | 19,929.00 | 0.18 |
| 397 | 301419 | 阿莱德 | 800 | 19,864.00 | 0.18 |
| 398 | 002483 | 润邦股份 | 4,400 | 19,844.00 | 0.18 |
| 399 | 002792 | 通宇通讯 | 1,900 | 19,836.00 | 0.17 |
| 400 | 002971 | 和远气体 | 800 | 19,824.00 | 0.17 |
| 401 | 300950 | 德固特 | 1,300 | 19,812.00 | 0.17 |
| 402 | 002560 | 通达股份 | 3,600 | 19,800.00 | 0.17 |
| 403 | 603610 | 麒盛科技 | 2,000 | 19,760.00 | 0.17 |
| 404 | 000042 | 中洲控股 | 5,000 | 19,750.00 | 0.17 |
| 405 | 002962 | 五方光电 | 1,300 | 19,656.00 | 0.17 |
| 406 | 603051 | 鹿山新材 | 900 | 19,647.00 | 0.17 |
| 407 | 603859 | 能科科技 | 932 | 19,590.64 | 0.17 |
| 408 | 002112 | 三变科技 | 2,200 | 19,536.00 | 0.17 |
| 409 | 600727 | 鲁北化工 | 3,100 | 19,530.00 | 0.17 |
| 410 | 603998 | 方盛制药 | 1,900 | 19,513.00 | 0.17 |
| 411 | 002695 | 煌上煌 | 3,000 | 19,470.00 | 0.17 |
| 412 | 002165 | 红宝丽 | 5,900 | 19,470.00 | 0.17 |
| 413 | 000936 | 华西股份 | 3,400 | 19,448.00 | 0.17 |
| 414 | 001239 | 永达股份 | 1,400 | 19,432.00 | 0.17 |
| 415 | 300987 | 川网传媒 | 1,600 | 19,424.00 | 0.17 |
| 416 | 603809 | 豪能股份 | 2,400 | 19,392.00 | 0.17 |
| 417 | 605188 | 国光连锁 | 2,500 | 19,375.00 | 0.17 |
| 418 | 000524 | 岭南控股 | 2,400 | 19,344.00 | 0.17 |
| 419 | 301199 | 迈赫股份 | 800 | 19,344.00 | 0.17 |
| 420 | 002046 | 国机精工 | 1,900 | 19,323.00 | 0.17 |
| 421 | 300539 | 横河精密 | 2,400 | 19,320.00 | 0.17 |
| 422 | 002035 | 华帝股份 | 3,100 | 19,313.00 | 0.17 |
| 423 | 002644 | 佛慈制药 | 3,000 | 19,260.00 | 0.17 |
| 424 | 301151 | 冠龙节能 | 1,300 | 19,136.00 | 0.17 |
| 425 | 603706 | 东方环宇 | 1,300 | 19,045.00 | 0.17 |
| 426 | 605018 | 长华集团 | 2,100 | 19,026.00 | 0.17 |
| 427 | 300972 | 万辰集团 | 900 | 19,017.00 | 0.17 |
| 428 | 300752 | 隆利科技 | 1,400 | 19,012.00 | 0.17 |
| 429 | 301439 | 泓淋电力 | 1,500 | 19,005.00 | 0.17 |
| 430 | 603878 | 武进不锈 | 2,900 | 18,966.00 | 0.17 |
| 431 | 000521 | 长虹美菱 | 2,500 | 18,950.00 | 0.17 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|--------|-----------|------|
| 432 | 300997 | 欢乐家 | 1,600 | 18,912.00 | 0.17 |
| 433 | 603203 | 快克智能 | 800 | 18,864.00 | 0.17 |
| 434 | 300582 | 英飞特 | 2,200 | 18,832.00 | 0.17 |
| 435 | 002897 | 意华股份 | 500 | 18,830.00 | 0.17 |
| 436 | 603135 | 中重科技 | 1,500 | 18,795.00 | 0.17 |
| 437 | 000159 | 国际实业 | 3,600 | 18,792.00 | 0.17 |
| 438 | 600560 | 金自天正 | 1,400 | 18,760.00 | 0.17 |
| 439 | 603508 | 思维列控 | 1,000 | 18,750.00 | 0.17 |
| 440 | 603611 | 诺力股份 | 1,100 | 18,744.00 | 0.17 |
| 441 | 002917 | 金奥博 | 2,100 | 18,648.00 | 0.16 |
| 442 | 603278 | 大业股份 | 3,000 | 18,630.00 | 0.16 |
| 443 | 002404 | 嘉欣丝绸 | 3,500 | 18,515.00 | 0.16 |
| 444 | 600979 | 广安爱众 | 5,500 | 18,480.00 | 0.16 |
| 445 | 601086 | 国芳集团 | 5,000 | 18,450.00 | 0.16 |
| 446 | 002846 | 英联股份 | 2,700 | 18,441.00 | 0.16 |
| 447 | 300468 | 四方精创 | 2,100 | 18,186.00 | 0.16 |
| 448 | 301499 | 维科精密 | 800 | 18,184.00 | 0.16 |
| 449 | 000882 | 华联股份 | 19,400 | 18,042.00 | 0.16 |
| 450 | 000922 | 佳电股份 | 1,500 | 17,895.00 | 0.16 |
| 451 | 002039 | 黔源电力 | 1,000 | 17,600.00 | 0.16 |
| 452 | 300870 | 欧陆通 | 400 | 17,352.00 | 0.15 |
| 453 | 688258 | 卓易信息 | 500 | 16,700.00 | 0.15 |
| 454 | 688035 | 德邦科技 | 200 | 6,444.00 | 0.06 |
| 455 | 001229 | 魅视科技 | 200 | 5,834.00 | 0.05 |
| 456 | 301096 | 百诚医药 | 100 | 5,808.00 | 0.05 |
| 457 | 002322 | 理工能科 | 300 | 4,806.00 | 0.04 |
| 458 | 603867 | 新化股份 | 200 | 4,666.00 | 0.04 |
| 459 | 300729 | 乐歌股份 | 300 | 4,647.00 | 0.04 |
| 460 | 301211 | 亨迪药业 | 300 | 4,383.00 | 0.04 |
| 461 | 300465 | 高伟达 | 600 | 4,362.00 | 0.04 |
| 462 | 301183 | 东田微 | 100 | 4,326.00 | 0.04 |
| 463 | 002149 | 西部材料 | 300 | 4,188.00 | 0.04 |
| 464 | 605088 | 冠盛股份 | 200 | 4,168.00 | 0.04 |
| 465 | 002593 | 日上集团 | 1,300 | 4,160.00 | 0.04 |
| 466 | 300793 | 佳禾智能 | 300 | 4,158.00 | 0.04 |
| 467 | 603617 | 君禾股份 | 700 | 4,130.00 | 0.04 |
| 468 | 600721 | 百花医药 | 700 | 4,060.00 | 0.04 |
| 469 | 300404 | 博济医药 | 500 | 4,005.00 | 0.04 |
| 470 | 002892 | 科力尔 | 400 | 3,840.00 | 0.03 |
| 471 | 300690 | 双一科技 | 200 | 3,758.00 | 0.03 |
| 472 | 000680 | 山推股份 | 400 | 3,708.00 | 0.03 |
| 473 | 300221 | 银禧科技 | 700 | 3,682.00 | 0.03 |
| 474 | 002981 | 朝阳科技 | 200 | 3,662.00 | 0.03 |
| 475 | 600476 | 湘邮科技 | 300 | 3,600.00 | 0.03 |

| | | | | | |
|-----|--------|------|-------|----------|------|
| 476 | 300828 | 锐新科技 | 300 | 3,561.00 | 0.03 |
| 477 | 300441 | 鲍斯股份 | 600 | 3,558.00 | 0.03 |
| 478 | 605319 | 无锡振华 | 200 | 3,540.00 | 0.03 |
| 479 | 300629 | 新劲刚 | 200 | 3,532.00 | 0.03 |
| 480 | 603256 | 宏和科技 | 500 | 3,530.00 | 0.03 |
| 481 | 600293 | 三峡新材 | 1,400 | 3,486.00 | 0.03 |
| 482 | 002919 | 名臣健康 | 300 | 3,483.00 | 0.03 |
| 483 | 300590 | 移为通信 | 300 | 3,426.00 | 0.03 |
| 484 | 600713 | 南京医药 | 800 | 3,376.00 | 0.03 |
| 485 | 300522 | 世名科技 | 300 | 3,315.00 | 0.03 |
| 486 | 300774 | 倍杰特 | 500 | 3,265.00 | 0.03 |
| 487 | 603223 | 恒通股份 | 500 | 3,260.00 | 0.03 |
| 488 | 002361 | 神剑股份 | 1,000 | 3,240.00 | 0.03 |
| 489 | 600982 | 宁波能源 | 900 | 3,213.00 | 0.03 |
| 490 | 002342 | 巨力索具 | 1,100 | 3,168.00 | 0.03 |
| 491 | 605196 | 华通线缆 | 300 | 3,156.00 | 0.03 |
| 492 | 002578 | 闽发铝业 | 1,200 | 3,156.00 | 0.03 |
| 493 | 002641 | 公元股份 | 800 | 3,144.00 | 0.03 |
| 494 | 300531 | 优博讯 | 300 | 3,126.00 | 0.03 |
| 495 | 601579 | 会稽山 | 300 | 3,072.00 | 0.03 |
| 496 | 300192 | 科德教育 | 300 | 2,946.00 | 0.03 |
| 497 | 300990 | 同飞股份 | 100 | 2,811.00 | 0.02 |
| 498 | 603018 | 华设集团 | 300 | 2,727.00 | 0.02 |

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 688035 | 德邦科技 | 822,469.08 | 7.25 |
| 2 | 688258 | 卓易信息 | 821,299.53 | 7.24 |
| 3 | 300400 | 劲拓股份 | 783,587.00 | 6.91 |
| 4 | 688157 | 松井股份 | 703,939.91 | 6.21 |
| 5 | 688550 | 瑞联新材 | 698,423.44 | 6.16 |
| 6 | 300181 | 佐力药业 | 669,987.00 | 5.91 |
| 7 | 000892 | 欢瑞世纪 | 669,138.00 | 5.90 |
| 8 | 600237 | 铜峰电子 | 660,390.00 | 5.82 |
| 9 | 002451 | 摩恩电气 | 659,219.00 | 5.81 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 10 | 300360 | 炬华科技 | 653,288.00 | 5.76 |
| 11 | 688601 | 力芯微 | 651,857.63 | 5.75 |
| 12 | 002543 | 万和电气 | 651,731.00 | 5.75 |
| 13 | 688247 | 宣泰医药 | 649,423.18 | 5.73 |
| 14 | 000521 | 长虹美菱 | 645,402.45 | 5.69 |
| 15 | 002666 | 德联集团 | 639,856.00 | 5.64 |
| 16 | 002679 | 福建金森 | 626,812.00 | 5.53 |
| 17 | 002094 | 青岛金王 | 619,397.00 | 5.46 |
| 18 | 600020 | 中原高速 | 617,733.00 | 5.45 |
| 19 | 301191 | 菲菱科思 | 616,707.00 | 5.44 |
| 20 | 600525 | 长园集团 | 615,785.00 | 5.43 |
| 21 | 002115 | 三维通信 | 612,373.00 | 5.40 |
| 22 | 600769 | 祥龙电业 | 611,646.00 | 5.40 |
| 23 | 600814 | 杭州解百 | 606,780.36 | 5.35 |
| 24 | 605128 | 上海沿浦 | 604,153.00 | 5.33 |
| 25 | 300047 | 天源迪科 | 600,670.00 | 5.30 |
| 26 | 688595 | 芯海科技 | 595,173.17 | 5.25 |
| 27 | 688049 | 炬芯科技 | 594,286.63 | 5.24 |
| 28 | 301215 | 中汽股份 | 592,205.00 | 5.22 |
| 29 | 600613 | 神奇制药 | 591,832.33 | 5.22 |
| 30 | 601007 | 金陵饭店 | 590,357.00 | 5.21 |
| 31 | 688371 | 菲沃泰 | 588,178.03 | 5.19 |
| 32 | 300066 | 三川智慧 | 586,085.00 | 5.17 |
| 33 | 000159 | 国际实业 | 584,382.00 | 5.15 |
| 34 | 603125 | 常青科技 | 583,388.13 | 5.15 |
| 35 | 603258 | 电魂网络 | 581,668.00 | 5.13 |
| 36 | 603110 | 东方材料 | 580,034.00 | 5.12 |
| 37 | 603949 | 雪龙集团 | 575,064.00 | 5.07 |
| 38 | 000837 | 秦川机床 | 573,630.00 | 5.06 |
| 39 | 688566 | 吉贝尔 | 570,627.88 | 5.03 |
| 40 | 002723 | 小崧股份 | 570,312.00 | 5.03 |
| 41 | 000593 | 德龙汇能 | 568,550.00 | 5.01 |
| 42 | 002510 | 天汽模 | 568,484.00 | 5.01 |
| 43 | 300153 | 科泰电源 | 568,209.00 | 5.01 |
| 44 | 600721 | 百花医药 | 566,865.00 | 5.00 |
| 45 | 301318 | 维海德 | 559,236.00 | 4.93 |
| 46 | 688025 | 杰普特 | 558,443.77 | 4.93 |
| 47 | 002577 | 雷柏科技 | 558,016.00 | 4.92 |
| 48 | 300048 | 合康新能 | 557,684.00 | 4.92 |
| 49 | 300100 | 双林股份 | 556,047.00 | 4.90 |
| 50 | 300571 | 平治信息 | 555,803.00 | 4.90 |
| 51 | 002137 | 实益达 | 555,732.00 | 4.90 |
| 52 | 603051 | 鹿山新材 | 550,588.00 | 4.86 |
| 53 | 000533 | 顺钠股份 | 547,487.00 | 4.83 |

| | | | | |
|----|--------|-------|------------|------|
| 54 | 002020 | 京新药业 | 546,398.00 | 4.82 |
| 55 | 301312 | 智立方 | 546,197.00 | 4.82 |
| 56 | 300651 | 金陵体育 | 545,596.00 | 4.81 |
| 57 | 301338 | 凯格精机 | 543,943.00 | 4.80 |
| 58 | 688259 | 创耀科技 | 542,739.21 | 4.79 |
| 59 | 300828 | 锐新科技 | 541,804.00 | 4.78 |
| 60 | 301330 | 熵基科技 | 541,226.00 | 4.77 |
| 61 | 603283 | 赛腾股份 | 540,439.00 | 4.77 |
| 62 | 603738 | 泰晶科技 | 539,641.00 | 4.76 |
| 63 | 301172 | 君逸数码 | 539,466.00 | 4.76 |
| 64 | 300976 | 达瑞电子 | 538,041.00 | 4.75 |
| 65 | 605368 | 蓝天燃气 | 537,311.00 | 4.74 |
| 66 | 300660 | 江苏雷利 | 537,166.00 | 4.74 |
| 67 | 600479 | 千金药业 | 537,165.00 | 4.74 |
| 68 | 688311 | 盟升电子 | 535,694.55 | 4.73 |
| 69 | 603999 | 读者传媒 | 535,611.00 | 4.72 |
| 70 | 300683 | 海特生物 | 534,988.00 | 4.72 |
| 71 | 603668 | 天马科技 | 532,068.00 | 4.69 |
| 72 | 688658 | 悦康药业 | 529,996.29 | 4.67 |
| 73 | 000421 | 南京公用 | 529,086.00 | 4.67 |
| 74 | 002955 | 鸿合科技 | 527,988.00 | 4.66 |
| 75 | 300545 | 联得装备 | 525,581.00 | 4.64 |
| 76 | 301151 | 冠龙节能 | 525,240.00 | 4.63 |
| 77 | 000045 | 深纺织 A | 524,441.00 | 4.63 |
| 78 | 002393 | 力生制药 | 524,060.00 | 4.62 |
| 79 | 301018 | 申菱环境 | 523,535.00 | 4.62 |
| 80 | 300307 | 慈星股份 | 522,151.00 | 4.61 |
| 81 | 002073 | 软控股份 | 522,024.00 | 4.60 |
| 82 | 300279 | 和晶科技 | 521,092.00 | 4.60 |
| 83 | 300718 | 长盛轴承 | 520,851.00 | 4.59 |
| 84 | 600180 | 瑞茂通 | 520,417.00 | 4.59 |
| 85 | 002264 | 新华都 | 520,236.00 | 4.59 |
| 86 | 301225 | 恒勃股份 | 520,195.00 | 4.59 |
| 87 | 601188 | 龙江交通 | 519,487.00 | 4.58 |
| 88 | 603890 | 春秋电子 | 518,819.00 | 4.58 |
| 89 | 300042 | 朗科科技 | 518,547.00 | 4.57 |
| 90 | 000755 | 山西高速 | 518,470.00 | 4.57 |
| 91 | 300793 | 佳禾智能 | 518,335.00 | 4.57 |
| 92 | 002149 | 西部材料 | 517,615.00 | 4.57 |
| 93 | 600706 | 曲江文旅 | 517,513.00 | 4.56 |
| 94 | 001234 | 泰慕士 | 517,260.00 | 4.56 |
| 95 | 002616 | 长青集团 | 517,092.00 | 4.56 |
| 96 | 300580 | 贝斯特 | 515,235.00 | 4.54 |
| 97 | 301096 | 百诚医药 | 514,244.00 | 4.54 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 98 | 603358 | 华达科技 | 514,042.00 | 4.53 |
| 99 | 301076 | 新瀚新材 | 513,879.00 | 4.53 |
| 100 | 002845 | 同兴达 | 513,482.00 | 4.53 |
| 101 | 300314 | 戴维医疗 | 512,182.00 | 4.52 |
| 102 | 300465 | 高伟达 | 512,082.00 | 4.52 |
| 103 | 300365 | 恒华科技 | 511,606.00 | 4.51 |
| 104 | 002017 | 东信和平 | 511,438.00 | 4.51 |
| 105 | 300341 | 麦克奥迪 | 511,156.00 | 4.51 |
| 106 | 300176 | 派生科技 | 510,528.00 | 4.50 |
| 107 | 301101 | 明月镜片 | 510,375.00 | 4.50 |
| 108 | 603662 | 柯力传感 | 510,348.00 | 4.50 |
| 109 | 002686 | 亿利达 | 510,264.00 | 4.50 |
| 110 | 300650 | 太龙股份 | 508,123.00 | 4.48 |
| 111 | 300766 | 每日互动 | 507,779.00 | 4.48 |
| 112 | 002912 | 中新赛克 | 507,300.00 | 4.47 |
| 113 | 601089 | 福元医药 | 506,588.00 | 4.47 |
| 114 | 301387 | 光大同创 | 506,317.66 | 4.47 |
| 115 | 002164 | 宁波东力 | 506,085.00 | 4.46 |
| 116 | 603687 | 大胜达 | 506,011.00 | 4.46 |
| 117 | 600133 | 东湖高新 | 505,058.00 | 4.45 |
| 118 | 002170 | 芭田股份 | 504,765.00 | 4.45 |
| 119 | 002231 | 奥维通信 | 504,038.00 | 4.45 |
| 120 | 603386 | 骏亚科技 | 504,025.00 | 4.45 |
| 121 | 000793 | 华闻集团 | 503,702.00 | 4.44 |
| 122 | 605289 | 罗曼股份 | 503,549.00 | 4.44 |
| 123 | 000757 | 浩物股份 | 503,161.00 | 4.44 |
| 124 | 000510 | 新金路 | 502,796.00 | 4.43 |
| 125 | 301011 | 华立科技 | 502,472.00 | 4.43 |
| 126 | 300941 | 创识科技 | 502,065.00 | 4.43 |
| 127 | 300391 | 长药控股 | 501,357.00 | 4.42 |
| 128 | 688252 | 天德钰 | 501,018.24 | 4.42 |
| 129 | 002947 | 恒铭达 | 500,939.00 | 4.42 |
| 130 | 002640 | 跨境通 | 500,742.00 | 4.42 |
| 131 | 300608 | 思特奇 | 500,239.00 | 4.41 |
| 132 | 603367 | 辰欣药业 | 500,000.00 | 4.41 |
| 133 | 000698 | 沈阳化工 | 499,699.00 | 4.41 |
| 134 | 600620 | 天宸股份 | 499,541.00 | 4.41 |
| 135 | 002039 | 黔源电力 | 499,432.80 | 4.41 |
| 136 | 300412 | 迦南科技 | 499,239.50 | 4.40 |
| 137 | 002588 | 史丹利 | 499,039.00 | 4.40 |
| 138 | 300008 | 天海防务 | 499,034.00 | 4.40 |
| 139 | 301270 | 汉仪股份 | 498,886.00 | 4.40 |
| 140 | 688313 | 仕佳光子 | 498,668.57 | 4.40 |
| 141 | 601339 | 百隆东方 | 498,217.00 | 4.39 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 142 | 002323 | 雅博股份 | 498,203.00 | 4.39 |
| 143 | 600033 | 福建高速 | 498,009.00 | 4.39 |
| 144 | 300021 | 大禹节水 | 497,967.00 | 4.39 |
| 145 | 600789 | 鲁抗医药 | 497,880.00 | 4.39 |
| 146 | 002358 | 森源电气 | 497,788.00 | 4.39 |
| 147 | 603889 | 新澳股份 | 497,718.00 | 4.39 |
| 148 | 300460 | 惠伦晶体 | 497,645.00 | 4.39 |
| 149 | 600269 | 赣粤高速 | 497,390.00 | 4.39 |
| 150 | 300550 | 和仁科技 | 497,370.00 | 4.39 |
| 151 | 002935 | 天奥电子 | 497,251.00 | 4.39 |
| 152 | 601579 | 会稽山 | 496,939.00 | 4.38 |
| 153 | 603206 | 嘉环科技 | 496,812.00 | 4.38 |
| 154 | 603618 | 杭电股份 | 496,769.00 | 4.38 |
| 155 | 300120 | 经纬辉开 | 496,454.00 | 4.38 |
| 156 | 000836 | ST 富通 | 496,303.00 | 4.38 |
| 157 | 001313 | 粤海饲料 | 496,140.00 | 4.38 |
| 158 | 603569 | 长久物流 | 495,882.28 | 4.37 |
| 159 | 002671 | 龙泉股份 | 495,602.00 | 4.37 |
| 160 | 300884 | 狄耐克 | 495,456.00 | 4.37 |
| 161 | 002983 | 芯瑞达 | 495,432.00 | 4.37 |
| 162 | 300951 | 博硕科技 | 495,305.00 | 4.37 |
| 163 | 603223 | 恒通股份 | 495,151.00 | 4.37 |
| 164 | 600468 | 百利电气 | 495,018.00 | 4.37 |
| 165 | 600186 | 莲花控股 | 494,895.00 | 4.37 |
| 166 | 002519 | 银河电子 | 494,884.00 | 4.37 |
| 167 | 300700 | 岱勒新材 | 494,694.00 | 4.36 |
| 168 | 300025 | 华星创业 | 494,469.00 | 4.36 |
| 169 | 600035 | 楚天高速 | 494,176.00 | 4.36 |
| 170 | 000822 | 山东海化 | 493,482.00 | 4.35 |
| 171 | 301181 | 标榜股份 | 493,362.00 | 4.35 |
| 172 | 600738 | 丽尚国潮 | 492,936.00 | 4.35 |
| 173 | 002995 | 天地在线 | 492,724.00 | 4.35 |
| 174 | 600794 | 保税科技 | 492,433.00 | 4.34 |
| 175 | 300291 | 百纳千成 | 492,386.00 | 4.34 |
| 176 | 002971 | 和远气体 | 492,123.00 | 4.34 |
| 177 | 300516 | 久之洋 | 492,065.00 | 4.34 |
| 178 | 300447 | 全信股份 | 491,570.00 | 4.34 |
| 179 | 000753 | 漳州发展 | 491,470.00 | 4.34 |
| 180 | 600829 | 人民同泰 | 491,468.00 | 4.34 |
| 181 | 301320 | 豪江智能 | 491,432.00 | 4.33 |
| 182 | 600981 | 汇鸿集团 | 491,005.00 | 4.33 |
| 183 | 688579 | 山大地纬 | 490,771.98 | 4.33 |
| 184 | 002045 | 国光电器 | 490,567.00 | 4.33 |
| 185 | 000863 | 三湘印象 | 490,506.00 | 4.33 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 186 | 300005 | 探路者 | 490,330.00 | 4.32 |
| 187 | 301179 | 泽宇智能 | 490,165.00 | 4.32 |
| 188 | 603158 | 腾龙股份 | 489,994.00 | 4.32 |
| 189 | 600713 | 南京医药 | 489,883.00 | 4.32 |
| 190 | 605555 | 德昌股份 | 489,571.00 | 4.32 |
| 191 | 002284 | 亚太股份 | 489,432.00 | 4.32 |
| 192 | 002615 | 哈尔斯 | 489,141.00 | 4.31 |
| 193 | 601566 | 九牧王 | 488,966.00 | 4.31 |
| 194 | 600461 | 洪城环境 | 488,838.00 | 4.31 |
| 195 | 002514 | 宝馨科技 | 488,792.00 | 4.31 |
| 196 | 002334 | 英威腾 | 488,424.00 | 4.31 |
| 197 | 603617 | 君禾股份 | 488,234.00 | 4.31 |
| 198 | 002783 | 凯龙股份 | 488,089.00 | 4.31 |
| 199 | 000978 | 桂林旅游 | 487,833.00 | 4.30 |
| 200 | 003032 | 传智教育 | 487,755.00 | 4.30 |
| 201 | 688292 | 浩瀚深度 | 487,309.20 | 4.30 |
| 202 | 600503 | 华丽家族 | 487,146.00 | 4.30 |
| 203 | 600433 | 冠豪高新 | 487,072.00 | 4.30 |
| 204 | 603630 | 拉芳家化 | 486,716.00 | 4.29 |
| 205 | 300099 | 尤洛卡 | 486,715.00 | 4.29 |
| 206 | 603998 | 方盛制药 | 486,651.00 | 4.29 |
| 207 | 605116 | 奥锐特 | 486,569.00 | 4.29 |
| 208 | 600353 | 旭光电子 | 486,565.00 | 4.29 |
| 209 | 300551 | 古鳌科技 | 486,341.39 | 4.29 |
| 210 | 301208 | 中亦科技 | 486,237.00 | 4.29 |
| 211 | 000544 | 中原环保 | 485,889.50 | 4.29 |
| 212 | 002533 | 金杯电工 | 485,884.00 | 4.29 |
| 213 | 002342 | 巨力索具 | 485,623.00 | 4.28 |
| 214 | 600576 | 祥源文旅 | 485,593.00 | 4.28 |
| 215 | 300706 | 阿石创 | 485,327.00 | 4.28 |
| 216 | 002787 | 华源控股 | 485,008.00 | 4.28 |
| 217 | 002937 | 兴瑞科技 | 484,988.00 | 4.28 |
| 218 | 688138 | 清溢光电 | 484,917.30 | 4.28 |
| 219 | 600851 | 海欣股份 | 484,733.00 | 4.28 |
| 220 | 002593 | 日上集团 | 484,196.00 | 4.27 |
| 221 | 002817 | 黄山胶囊 | 484,025.00 | 4.27 |
| 222 | 600513 | 联环药业 | 483,740.00 | 4.27 |
| 223 | 002303 | 美盈森 | 483,648.00 | 4.27 |
| 224 | 002329 | 皇氏集团 | 483,611.00 | 4.27 |
| 225 | 000936 | 华西股份 | 483,539.00 | 4.27 |
| 226 | 600757 | 长江传媒 | 483,455.00 | 4.26 |
| 227 | 600354 | 敦煌种业 | 482,795.00 | 4.26 |
| 228 | 002695 | 煌上煌 | 482,742.00 | 4.26 |
| 229 | 001268 | 联合精密 | 482,432.00 | 4.26 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 230 | 300543 | 朗科智能 | 482,385.00 | 4.25 |
| 231 | 001328 | 登康口腔 | 482,253.00 | 4.25 |
| 232 | 000607 | 华媒控股 | 482,223.00 | 4.25 |
| 233 | 000900 | 现代投资 | 482,171.00 | 4.25 |
| 234 | 603867 | 新化股份 | 482,081.00 | 4.25 |
| 235 | 600523 | 贵航股份 | 481,979.60 | 4.25 |
| 236 | 301357 | 北方长龙 | 481,945.00 | 4.25 |
| 237 | 600853 | 龙建股份 | 481,210.00 | 4.24 |
| 238 | 301229 | 纽泰格 | 481,109.00 | 4.24 |
| 239 | 300522 | 世名科技 | 480,987.00 | 4.24 |
| 240 | 002803 | 吉宏股份 | 480,790.00 | 4.24 |
| 241 | 600987 | 航民股份 | 480,644.00 | 4.24 |
| 242 | 002818 | 富森美 | 480,609.60 | 4.24 |
| 243 | 301051 | 信濠光电 | 480,347.00 | 4.24 |
| 244 | 600664 | 哈药股份 | 480,203.00 | 4.24 |
| 245 | 002333 | 罗普斯金 | 480,102.00 | 4.23 |
| 246 | 301383 | 天键股份 | 479,926.00 | 4.23 |
| 247 | 002896 | 中大力德 | 479,810.00 | 4.23 |
| 248 | 002623 | 亚玛顿 | 479,610.00 | 4.23 |
| 249 | 300491 | 通合科技 | 478,569.00 | 4.22 |
| 250 | 300259 | 新天科技 | 477,866.00 | 4.22 |
| 251 | 002095 | 生意宝 | 477,779.00 | 4.21 |
| 252 | 300756 | 金马游乐 | 477,528.50 | 4.21 |
| 253 | 300514 | 友讯达 | 477,417.00 | 4.21 |
| 254 | 300815 | 玉禾田 | 476,811.64 | 4.21 |
| 255 | 300384 | 三联虹普 | 476,655.00 | 4.20 |
| 256 | 002184 | 海得控制 | 476,342.00 | 4.20 |
| 257 | 300721 | 怡达股份 | 476,303.00 | 4.20 |
| 258 | 301169 | 零点有数 | 476,228.00 | 4.20 |
| 259 | 300468 | 四方精创 | 476,144.00 | 4.20 |
| 260 | 600894 | 广日股份 | 476,081.00 | 4.20 |
| 261 | 002437 | 誉衡药业 | 475,610.00 | 4.20 |
| 262 | 002035 | 华帝股份 | 475,559.00 | 4.19 |
| 263 | 300145 | 中金环境 | 475,000.00 | 4.19 |
| 264 | 688505 | 复旦张江 | 474,900.90 | 4.19 |
| 265 | 301159 | 三维天地 | 474,417.00 | 4.18 |
| 266 | 000523 | 红棉股份 | 473,693.00 | 4.18 |
| 267 | 300531 | 优博讯 | 473,423.00 | 4.18 |
| 268 | 002611 | 东方精工 | 473,122.00 | 4.17 |
| 269 | 000531 | 穗恒运 A | 472,981.00 | 4.17 |
| 270 | 688231 | 隆达股份 | 472,390.93 | 4.17 |
| 271 | 002300 | 太阳电缆 | 472,253.00 | 4.17 |
| 272 | 000663 | 永安林业 | 471,981.00 | 4.16 |
| 273 | 002122 | 汇洲智能 | 471,908.00 | 4.16 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 274 | 300231 | 银信科技 | 471,713.00 | 4.16 |
| 275 | 002293 | 罗莱生活 | 471,604.00 | 4.16 |
| 276 | 002117 | 东港股份 | 470,969.00 | 4.15 |
| 277 | 301256 | 华融化学 | 470,880.00 | 4.15 |
| 278 | 301149 | 隆华新材 | 470,509.57 | 4.15 |
| 279 | 000899 | 赣能股份 | 470,398.00 | 4.15 |
| 280 | 300403 | 汉字集团 | 470,203.00 | 4.15 |
| 281 | 000631 | 顺发恒业 | 469,742.00 | 4.14 |
| 282 | 601008 | 连云港 | 469,027.00 | 4.14 |
| 283 | 301377 | 鼎泰高科 | 468,860.00 | 4.14 |
| 284 | 002345 | 潮宏基 | 468,546.00 | 4.13 |
| 285 | 002375 | 亚厦股份 | 468,358.00 | 4.13 |
| 286 | 002165 | 红宝丽 | 468,309.00 | 4.13 |
| 287 | 002112 | 三变科技 | 468,213.00 | 4.13 |
| 288 | 603333 | 尚纬股份 | 467,748.00 | 4.13 |
| 289 | 000428 | 华天酒店 | 467,725.00 | 4.13 |
| 290 | 300538 | 同益股份 | 466,594.00 | 4.12 |
| 291 | 000912 | 泸天化 | 466,249.00 | 4.11 |
| 292 | 300817 | 双飞集团 | 465,538.00 | 4.11 |
| 293 | 301127 | 天源环保 | 465,362.00 | 4.10 |
| 294 | 300678 | 中科信息 | 464,783.00 | 4.10 |
| 295 | 002682 | 龙洲股份 | 464,776.00 | 4.10 |
| 296 | 002757 | 南兴股份 | 464,757.00 | 4.10 |
| 297 | 002878 | 元隆雅图 | 464,679.00 | 4.10 |
| 298 | 002858 | 力盛体育 | 464,125.00 | 4.09 |
| 299 | 600105 | 永鼎股份 | 463,436.00 | 4.09 |
| 300 | 300997 | 欢乐家 | 463,229.00 | 4.09 |
| 301 | 002154 | 报喜鸟 | 463,069.00 | 4.08 |
| 302 | 603070 | 万控智造 | 463,058.00 | 4.08 |
| 303 | 603222 | 济民医疗 | 462,809.00 | 4.08 |
| 304 | 301038 | 深水规院 | 462,773.20 | 4.08 |
| 305 | 603416 | 信捷电气 | 462,380.00 | 4.08 |
| 306 | 600410 | 华胜天成 | 462,070.00 | 4.08 |
| 307 | 300349 | 金卡智能 | 461,679.00 | 4.07 |
| 308 | 301066 | 万事利 | 461,601.00 | 4.07 |
| 309 | 603590 | 康辰药业 | 461,272.00 | 4.07 |
| 310 | 300007 | 汉威科技 | 461,221.00 | 4.07 |
| 311 | 002026 | 山东威达 | 460,990.00 | 4.07 |
| 312 | 300304 | 云意电气 | 460,162.00 | 4.06 |
| 313 | 300415 | 伊之密 | 460,084.00 | 4.06 |
| 314 | 002016 | 世荣兆业 | 460,066.00 | 4.06 |
| 315 | 601789 | 宁波建工 | 459,403.00 | 4.05 |
| 316 | 601999 | 出版传媒 | 459,288.00 | 4.05 |
| 317 | 002495 | 佳隆股份 | 459,076.00 | 4.05 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 318 | 600495 | 晋西车轴 | 458,700.00 | 4.05 |
| 319 | 000635 | 英力特 | 458,696.00 | 4.05 |
| 320 | 002093 | 国脉科技 | 458,586.00 | 4.04 |
| 321 | 605068 | 明新旭腾 | 458,136.00 | 4.04 |
| 322 | 600425 | 青松建化 | 458,047.00 | 4.04 |
| 323 | 300933 | 中辰股份 | 457,588.00 | 4.04 |
| 324 | 600594 | 益佰制药 | 457,372.00 | 4.03 |
| 325 | 688799 | 华纳药厂 | 457,342.23 | 4.03 |
| 326 | 603698 | 航天工程 | 457,296.00 | 4.03 |
| 327 | 600716 | 凤凰股份 | 457,253.00 | 4.03 |
| 328 | 603028 | 赛福天 | 456,964.00 | 4.03 |
| 329 | 300996 | 普联软件 | 456,473.80 | 4.03 |
| 330 | 301136 | 招标股份 | 456,430.00 | 4.03 |
| 331 | 605377 | 华旺科技 | 455,647.00 | 4.02 |
| 332 | 600184 | 光电股份 | 455,478.00 | 4.02 |
| 333 | 600249 | 两面针 | 455,320.00 | 4.02 |
| 334 | 300513 | 恒实科技 | 455,175.00 | 4.01 |
| 335 | 603106 | 恒银科技 | 455,034.00 | 4.01 |
| 336 | 688319 | 欧林生物 | 454,856.20 | 4.01 |
| 337 | 600735 | 新华锦 | 454,816.00 | 4.01 |
| 338 | 300258 | 精锻科技 | 454,155.00 | 4.01 |
| 339 | 600351 | 亚宝药业 | 453,742.00 | 4.00 |
| 340 | 002364 | 中恒电气 | 453,447.00 | 4.00 |
| 341 | 603366 | 日出东方 | 453,278.00 | 4.00 |
| 342 | 603809 | 豪能股份 | 453,050.00 | 4.00 |
| 343 | 301211 | 亨迪药业 | 452,947.00 | 4.00 |
| 344 | 600130 | 波导股份 | 452,693.00 | 3.99 |
| 345 | 603676 | 卫信康 | 452,660.00 | 3.99 |
| 346 | 600488 | 津药药业 | 452,468.00 | 3.99 |
| 347 | 000920 | 沃顿科技 | 451,985.00 | 3.99 |
| 348 | 600939 | 重庆建工 | 451,958.00 | 3.99 |
| 349 | 603078 | 江化微 | 451,938.30 | 3.99 |
| 350 | 600230 | 沧州大化 | 451,900.00 | 3.99 |
| 351 | 605388 | 均瑶健康 | 451,716.00 | 3.98 |
| 352 | 603969 | 银龙股份 | 451,528.00 | 3.98 |
| 353 | 300421 | 力星股份 | 451,208.60 | 3.98 |
| 354 | 301303 | 真兰仪表 | 451,059.00 | 3.98 |
| 355 | 600855 | 航天长峰 | 451,024.00 | 3.98 |
| 356 | 600611 | 大众交通 | 450,889.00 | 3.98 |
| 357 | 300590 | 移为通信 | 450,652.00 | 3.97 |
| 358 | 600327 | 大东方 | 450,541.00 | 3.97 |
| 359 | 600280 | 中央商场 | 449,821.00 | 3.97 |
| 360 | 300710 | 万隆光电 | 449,789.00 | 3.97 |
| 361 | 300872 | 天阳科技 | 449,755.00 | 3.97 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 362 | 600537 | 亿晶光电 | 449,668.00 | 3.97 |
| 363 | 603538 | 美诺华 | 449,062.00 | 3.96 |
| 364 | 605266 | 健之佳 | 448,919.00 | 3.96 |
| 365 | 605077 | 华康股份 | 448,607.00 | 3.96 |
| 366 | 300990 | 同飞股份 | 448,346.00 | 3.95 |
| 367 | 605598 | 上海港湾 | 447,890.00 | 3.95 |
| 368 | 600636 | 国新文化 | 447,761.00 | 3.95 |
| 369 | 300605 | 恒锋信息 | 447,487.00 | 3.95 |
| 370 | 002989 | 中天精装 | 446,913.00 | 3.94 |
| 371 | 600310 | 广西能源 | 446,880.00 | 3.94 |
| 372 | 301263 | 泰恩康 | 446,588.00 | 3.94 |
| 373 | 002315 | 焦点科技 | 446,330.00 | 3.94 |
| 374 | 300607 | 拓斯达 | 446,265.00 | 3.94 |
| 375 | 002235 | 安妮股份 | 446,163.00 | 3.94 |
| 376 | 603029 | 天鹄股份 | 446,088.00 | 3.93 |
| 377 | 603708 | 家家悦 | 445,244.00 | 3.93 |
| 378 | 002599 | 盛通股份 | 445,098.00 | 3.93 |
| 379 | 300691 | 联合光电 | 444,899.00 | 3.92 |
| 380 | 603123 | 翠微股份 | 444,666.00 | 3.92 |
| 381 | 300740 | 水羊股份 | 444,439.00 | 3.92 |
| 382 | 002106 | 莱宝高科 | 444,213.00 | 3.92 |
| 383 | 300797 | 钢研纳克 | 444,186.00 | 3.92 |
| 384 | 002860 | 星帅尔 | 444,011.00 | 3.92 |
| 385 | 300345 | 华民股份 | 443,490.00 | 3.91 |
| 386 | 002546 | 新联电子 | 443,325.00 | 3.91 |
| 387 | 002587 | 奥拓电子 | 443,136.00 | 3.91 |
| 388 | 002491 | 通鼎互联 | 443,059.00 | 3.91 |
| 389 | 002795 | 永和智控 | 443,003.00 | 3.91 |
| 390 | 002181 | 粤传媒 | 442,992.00 | 3.91 |
| 391 | 002554 | 惠博普 | 442,877.00 | 3.91 |
| 392 | 000925 | 众合科技 | 442,505.00 | 3.90 |
| 393 | 300852 | 四会富仕 | 442,483.00 | 3.90 |
| 394 | 603937 | 丽岛新材 | 442,264.00 | 3.90 |
| 395 | 688580 | 伟思医疗 | 442,052.60 | 3.90 |
| 396 | 300533 | 冰川网络 | 441,963.00 | 3.90 |
| 397 | 301117 | 佳缘科技 | 441,620.00 | 3.90 |
| 398 | 002270 | 华明装备 | 441,590.00 | 3.90 |
| 399 | 002527 | 新时达 | 441,304.00 | 3.89 |
| 400 | 001319 | 铭科精技 | 441,285.00 | 3.89 |
| 401 | 301393 | 昊帆生物 | 441,274.00 | 3.89 |
| 402 | 002338 | 奥普光电 | 441,131.00 | 3.89 |
| 403 | 600268 | 国电南自 | 441,083.20 | 3.89 |
| 404 | 300499 | 高澜股份 | 440,934.00 | 3.89 |
| 405 | 601890 | 亚星锚链 | 440,860.00 | 3.89 |

| | | | | |
|-----|--------|-------|------------|------|
| 406 | 300485 | 赛升药业 | 440,803.00 | 3.89 |
| 407 | 002471 | 中超控股 | 440,653.00 | 3.89 |
| 408 | 300032 | 金龙机电 | 440,128.00 | 3.88 |
| 409 | 002988 | 豪美新材 | 439,737.00 | 3.88 |
| 410 | 300698 | 万马科技 | 439,647.00 | 3.88 |
| 411 | 300378 | 鼎捷软件 | 439,599.00 | 3.88 |
| 412 | 300510 | 金冠股份 | 439,383.00 | 3.88 |
| 413 | 300098 | 高新兴 | 439,263.00 | 3.87 |
| 414 | 002877 | 智能自控 | 438,939.00 | 3.87 |
| 415 | 300589 | 江龙船艇 | 438,927.00 | 3.87 |
| 416 | 300011 | 鼎汉技术 | 438,818.00 | 3.87 |
| 417 | 002062 | 宏润建设 | 438,540.00 | 3.87 |
| 418 | 002197 | ST 证通 | 438,062.00 | 3.86 |
| 419 | 300632 | 光莆股份 | 437,905.00 | 3.86 |
| 420 | 002571 | 德力股份 | 437,818.00 | 3.86 |
| 421 | 300853 | 申昊科技 | 437,650.00 | 3.86 |
| 422 | 300193 | 佳士科技 | 437,629.00 | 3.86 |
| 423 | 300667 | 必创科技 | 437,351.00 | 3.86 |
| 424 | 300592 | 华凯易佰 | 437,327.00 | 3.86 |
| 425 | 301525 | 儒竞科技 | 437,219.63 | 3.86 |
| 426 | 002689 | 远大智能 | 437,170.00 | 3.86 |
| 427 | 000957 | 中通客车 | 437,142.00 | 3.86 |
| 428 | 300248 | 新开普 | 436,879.00 | 3.85 |
| 429 | 000948 | 南天信息 | 436,791.00 | 3.85 |
| 430 | 301089 | 拓新药业 | 436,784.00 | 3.85 |
| 431 | 002900 | 哈三联 | 436,493.00 | 3.85 |
| 432 | 601929 | 吉视传媒 | 436,475.00 | 3.85 |
| 433 | 002426 | 胜利精密 | 436,351.00 | 3.85 |
| 434 | 301311 | 昆船智能 | 436,330.00 | 3.85 |
| 435 | 002043 | 兔宝宝 | 436,023.00 | 3.85 |
| 436 | 002379 | 宏创控股 | 435,922.00 | 3.85 |
| 437 | 688328 | 深科达 | 435,738.31 | 3.84 |
| 438 | 300355 | 蒙草生态 | 435,667.00 | 3.84 |
| 439 | 300519 | 新光药业 | 435,662.00 | 3.84 |
| 440 | 000906 | 浙商中拓 | 435,497.00 | 3.84 |
| 441 | 600557 | 康缘药业 | 435,192.00 | 3.84 |
| 442 | 301323 | 新莱福 | 435,163.60 | 3.84 |
| 443 | 002662 | 京威股份 | 434,935.00 | 3.84 |
| 444 | 300840 | 酷特智能 | 434,909.00 | 3.84 |
| 445 | 000650 | 仁和药业 | 434,794.00 | 3.84 |
| 446 | 300017 | 网宿科技 | 434,534.00 | 3.83 |
| 447 | 001219 | 青岛食品 | 434,532.00 | 3.83 |
| 448 | 002208 | 合肥城建 | 434,491.00 | 3.83 |
| 449 | 000788 | 北大医药 | 434,372.00 | 3.83 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 450 | 603518 | 锦泓集团 | 434,270.00 | 3.83 |
| 451 | 002823 | 凯中精密 | 434,180.00 | 3.83 |
| 452 | 300439 | 美康生物 | 433,987.00 | 3.83 |
| 453 | 002445 | 中南文化 | 433,917.00 | 3.83 |
| 454 | 000828 | 东莞控股 | 433,760.00 | 3.83 |
| 455 | 002922 | 伊戈尔 | 432,919.00 | 3.82 |
| 456 | 603306 | 华懋科技 | 432,788.00 | 3.82 |
| 457 | 002031 | 巨轮智能 | 432,682.00 | 3.82 |
| 458 | 603267 | 鸿远电子 | 432,285.00 | 3.81 |
| 459 | 000078 | 海王生物 | 432,204.00 | 3.81 |
| 460 | 300809 | 华辰装备 | 432,194.40 | 3.81 |
| 461 | 300377 | 赢时胜 | 431,481.00 | 3.81 |
| 462 | 002965 | 祥鑫科技 | 427,003.00 | 3.77 |
| 463 | 300922 | 天秦装备 | 426,007.00 | 3.76 |
| 464 | 300380 | 安硕信息 | 423,692.00 | 3.74 |
| 465 | 002561 | 徐家汇 | 423,317.00 | 3.73 |
| 466 | 688588 | 凌志软件 | 422,315.93 | 3.73 |
| 467 | 002975 | 博杰股份 | 419,859.00 | 3.70 |
| 468 | 688207 | 格灵深瞳 | 416,062.92 | 3.67 |
| 469 | 002970 | 锐明技术 | 412,095.00 | 3.63 |
| 470 | 300461 | 田中精机 | 411,999.00 | 3.63 |
| 471 | 601126 | 四方股份 | 409,850.00 | 3.62 |
| 472 | 002540 | 亚太科技 | 406,277.00 | 3.58 |
| 473 | 600121 | 郑州煤电 | 401,970.00 | 3.55 |
| 474 | 300160 | 秀强股份 | 382,811.00 | 3.38 |
| 475 | 605188 | 国光连锁 | 375,949.00 | 3.32 |
| 476 | 688293 | 奥浦迈 | 369,116.63 | 3.26 |
| 477 | 300065 | 海兰信 | 357,333.00 | 3.15 |
| 478 | 603912 | 佳力图 | 356,020.00 | 3.14 |
| 479 | 002014 | 永新股份 | 354,481.00 | 3.13 |
| 480 | 300055 | 万邦达 | 354,325.00 | 3.13 |
| 481 | 603315 | 福鞍股份 | 342,871.00 | 3.02 |
| 482 | 600084 | 中信尼雅 | 338,471.00 | 2.99 |
| 483 | 600207 | 安彩高科 | 337,579.00 | 2.98 |
| 484 | 002681 | 奋达科技 | 333,233.00 | 2.94 |
| 485 | 603987 | 康德莱 | 322,300.00 | 2.84 |
| 486 | 000514 | 渝开发 | 301,625.00 | 2.66 |
| 487 | 002632 | 道明光学 | 300,341.00 | 2.65 |
| 488 | 002075 | 沙钢股份 | 299,719.00 | 2.64 |
| 489 | 300195 | 长荣股份 | 294,043.00 | 2.59 |
| 490 | 002330 | 得利斯 | 287,559.00 | 2.54 |
| 491 | 600308 | 华泰股份 | 285,267.00 | 2.52 |
| 492 | 603360 | 百傲化学 | 283,388.00 | 2.50 |
| 493 | 300602 | 飞荣达 | 282,104.00 | 2.49 |

| | | | | |
|-----|--------|--------|------------|------|
| 494 | 688391 | 钜泉科技 | 281,811.36 | 2.49 |
| 495 | 300369 | 绿盟科技 | 280,818.00 | 2.48 |
| 496 | 688053 | 思科瑞 | 278,265.42 | 2.45 |
| 497 | 600623 | 华谊集团 | 274,633.00 | 2.42 |
| 498 | 000501 | 武商集团 | 272,962.00 | 2.41 |
| 499 | 002418 | 康盛股份 | 272,916.00 | 2.41 |
| 500 | 688348 | 昱能科技 | 272,019.18 | 2.40 |
| 501 | 002752 | 昇兴股份 | 271,594.00 | 2.40 |
| 502 | 300131 | 英唐智控 | 269,311.00 | 2.38 |
| 503 | 002483 | 润邦股份 | 269,111.00 | 2.37 |
| 504 | 603131 | 上海沪工 | 268,486.00 | 2.37 |
| 505 | 000505 | 京粮控股 | 268,094.00 | 2.36 |
| 506 | 002141 | *ST 贤丰 | 268,081.00 | 2.36 |
| 507 | 600054 | 黄山旅游 | 264,908.00 | 2.34 |
| 508 | 605228 | 神通科技 | 263,857.00 | 2.33 |
| 509 | 300709 | 精研科技 | 263,043.00 | 2.32 |
| 510 | 002189 | 中光学 | 262,793.00 | 2.32 |
| 511 | 000411 | 英特集团 | 262,696.00 | 2.32 |
| 512 | 300245 | 天玑科技 | 261,371.00 | 2.31 |
| 513 | 300053 | 航宇微 | 260,886.00 | 2.30 |
| 514 | 300217 | 东方电热 | 256,228.00 | 2.26 |
| 515 | 600694 | 大商股份 | 255,138.00 | 2.25 |
| 516 | 002306 | 中科云网 | 255,076.00 | 2.25 |
| 517 | 600159 | 大龙地产 | 254,711.00 | 2.25 |
| 518 | 002337 | 赛象科技 | 254,700.00 | 2.25 |
| 519 | 603266 | 天龙股份 | 252,881.00 | 2.23 |
| 520 | 600226 | 亨通股份 | 249,780.00 | 2.20 |
| 521 | 688226 | 威腾电气 | 249,286.95 | 2.20 |
| 522 | 688593 | 新相微 | 248,755.73 | 2.19 |
| 523 | 300713 | 英可瑞 | 246,629.00 | 2.18 |
| 524 | 002725 | 跃岭股份 | 244,940.00 | 2.16 |
| 525 | 002263 | 大东南 | 244,402.00 | 2.16 |
| 526 | 600429 | 三元股份 | 243,733.00 | 2.15 |
| 527 | 688071 | 华依科技 | 240,591.70 | 2.12 |
| 528 | 603768 | 常青股份 | 240,224.00 | 2.12 |
| 529 | 002892 | 科力尔 | 238,797.00 | 2.11 |
| 530 | 002042 | 华孚时尚 | 237,554.00 | 2.10 |
| 531 | 688205 | 德科立 | 237,012.17 | 2.09 |
| 532 | 603859 | 能科科技 | 236,020.00 | 2.08 |
| 533 | 600476 | 湘邮科技 | 235,131.00 | 2.07 |
| 534 | 300441 | 鲍斯股份 | 232,094.00 | 2.05 |
| 535 | 300681 | 英搏尔 | 229,734.00 | 2.03 |
| 536 | 300731 | 科创新源 | 227,836.00 | 2.01 |
| 537 | 002881 | 美格智能 | 227,584.00 | 2.01 |

注：“买入金额”按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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 | 占期末基金资产净值比例 (%) |
|----|--------|------|------------|-----------------|
| 1 | 688035 | 德邦科技 | 787,067.22 | 6.94 |
| 2 | 688258 | 卓易信息 | 780,343.50 | 6.88 |
| 3 | 688550 | 瑞联新材 | 699,017.77 | 6.17 |
| 4 | 688157 | 松井股份 | 685,545.98 | 6.05 |
| 5 | 688601 | 力芯微 | 640,635.83 | 5.65 |
| 6 | 688247 | 宣泰医药 | 625,033.44 | 5.51 |
| 7 | 600237 | 铜峰电子 | 615,084.00 | 5.43 |
| 8 | 600020 | 中原高速 | 584,498.00 | 5.16 |
| 9 | 603125 | 常青科技 | 579,180.55 | 5.11 |
| 10 | 688566 | 吉贝尔 | 570,374.05 | 5.03 |
| 11 | 605128 | 上海沿浦 | 569,678.00 | 5.02 |
| 12 | 600525 | 长园集团 | 569,413.00 | 5.02 |
| 13 | 688049 | 炬芯科技 | 567,098.64 | 5.00 |
| 14 | 603358 | 华达科技 | 561,111.00 | 4.95 |
| 15 | 688595 | 芯海科技 | 555,371.92 | 4.90 |
| 16 | 600721 | 百花医药 | 551,982.00 | 4.87 |
| 17 | 601007 | 金陵饭店 | 550,336.00 | 4.85 |
| 18 | 600814 | 杭州解百 | 549,705.00 | 4.85 |
| 19 | 603110 | 东方材料 | 547,041.00 | 4.83 |
| 20 | 600479 | 千金药业 | 546,534.00 | 4.82 |
| 21 | 603283 | 赛腾股份 | 542,383.00 | 4.78 |
| 22 | 603949 | 雪龙集团 | 541,643.00 | 4.78 |
| 23 | 000837 | 秦川机床 | 541,613.00 | 4.78 |
| 24 | 600613 | 神奇制药 | 538,178.00 | 4.75 |
| 25 | 002020 | 京新药业 | 534,317.00 | 4.71 |
| 26 | 688371 | 菲沃泰 | 533,581.38 | 4.71 |
| 27 | 688658 | 悦康药业 | 530,476.06 | 4.68 |
| 28 | 600789 | 鲁抗医药 | 529,026.00 | 4.67 |
| 29 | 603258 | 电魂网络 | 524,527.00 | 4.63 |
| 30 | 600769 | 祥龙电业 | 522,545.00 | 4.61 |
| 31 | 605368 | 蓝天燃气 | 521,184.40 | 4.60 |
| 32 | 688025 | 杰普特 | 513,197.41 | 4.53 |
| 33 | 600894 | 广日股份 | 513,104.00 | 4.53 |
| 34 | 603051 | 鹿山新材 | 511,270.00 | 4.51 |
| 35 | 600461 | 洪城环境 | 510,401.00 | 4.50 |

| | | | | |
|----|--------|------|------------|------|
| 36 | 603738 | 泰晶科技 | 510,282.00 | 4.50 |
| 37 | 688311 | 盟升电子 | 509,514.86 | 4.49 |
| 38 | 600269 | 赣粤高速 | 507,755.00 | 4.48 |
| 39 | 600133 | 东湖高新 | 502,697.00 | 4.43 |
| 40 | 601188 | 龙江交通 | 499,378.00 | 4.40 |
| 41 | 603889 | 新澳股份 | 498,494.00 | 4.40 |
| 42 | 600033 | 福建高速 | 496,576.00 | 4.38 |
| 43 | 688313 | 仕佳光子 | 495,936.53 | 4.37 |
| 44 | 601579 | 会稽山 | 495,541.00 | 4.37 |
| 45 | 600757 | 长江传媒 | 494,809.00 | 4.36 |
| 46 | 603999 | 读者传媒 | 491,161.00 | 4.33 |
| 47 | 688138 | 清溢光电 | 488,531.93 | 4.31 |
| 48 | 605116 | 奥锐特 | 488,444.00 | 4.31 |
| 49 | 605555 | 德昌股份 | 487,348.00 | 4.30 |
| 50 | 601089 | 福元医药 | 487,041.00 | 4.30 |
| 51 | 600180 | 瑞茂通 | 485,863.00 | 4.29 |
| 52 | 603367 | 辰欣药业 | 485,676.00 | 4.28 |
| 53 | 600713 | 南京医药 | 482,729.00 | 4.26 |
| 54 | 600035 | 楚天高速 | 482,625.00 | 4.26 |
| 55 | 603662 | 柯力传感 | 480,171.00 | 4.24 |
| 56 | 603890 | 春秋电子 | 478,877.00 | 4.22 |
| 57 | 688259 | 创耀科技 | 477,848.20 | 4.21 |
| 58 | 600433 | 冠豪高新 | 476,799.00 | 4.21 |
| 59 | 603386 | 骏亚科技 | 476,255.00 | 4.20 |
| 60 | 603998 | 方盛制药 | 475,743.00 | 4.20 |
| 61 | 688252 | 天德钰 | 472,263.15 | 4.17 |
| 62 | 601339 | 百隆东方 | 471,848.00 | 4.16 |
| 63 | 600794 | 保税科技 | 471,777.00 | 4.16 |
| 64 | 600513 | 联环药业 | 471,719.00 | 4.16 |
| 65 | 601008 | 连云港 | 471,395.00 | 4.16 |
| 66 | 600853 | 龙建股份 | 471,216.00 | 4.16 |
| 67 | 600353 | 旭光电子 | 470,857.00 | 4.15 |
| 68 | 600851 | 海欣股份 | 470,796.00 | 4.15 |
| 69 | 600523 | 贵航股份 | 469,135.00 | 4.14 |
| 70 | 688505 | 复旦张江 | 466,975.84 | 4.12 |
| 71 | 605077 | 华康股份 | 466,933.00 | 4.12 |
| 72 | 605289 | 罗曼股份 | 466,527.00 | 4.12 |
| 73 | 603668 | 天马科技 | 465,065.00 | 4.10 |
| 74 | 601789 | 宁波建工 | 464,342.00 | 4.10 |
| 75 | 603867 | 新化股份 | 464,102.00 | 4.09 |
| 76 | 688231 | 隆达股份 | 463,766.98 | 4.09 |
| 77 | 600664 | 哈药股份 | 460,569.00 | 4.06 |
| 78 | 002043 | 兔宝宝 | 460,564.00 | 4.06 |
| 79 | 603416 | 信捷电气 | 460,511.71 | 4.06 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 80 | 603590 | 康辰药业 | 460,417.00 | 4.06 |
| 81 | 600855 | 航天长峰 | 459,736.00 | 4.06 |
| 82 | 603158 | 腾龙股份 | 459,727.00 | 4.06 |
| 83 | 600468 | 百利电气 | 459,369.00 | 4.05 |
| 84 | 603698 | 航天工程 | 459,176.00 | 4.05 |
| 85 | 688319 | 欧林生物 | 457,043.67 | 4.03 |
| 86 | 300017 | 网宿科技 | 456,630.00 | 4.03 |
| 87 | 603676 | 卫信康 | 455,736.00 | 4.02 |
| 88 | 603569 | 长久物流 | 455,645.00 | 4.02 |
| 89 | 600981 | 汇鸿集团 | 453,281.00 | 4.00 |
| 90 | 603206 | 嘉环科技 | 452,775.00 | 3.99 |
| 91 | 603223 | 恒通股份 | 452,550.40 | 3.99 |
| 92 | 600351 | 亚宝药业 | 451,523.00 | 3.98 |
| 93 | 600829 | 人民同泰 | 450,908.00 | 3.98 |
| 94 | 603617 | 君禾股份 | 450,529.00 | 3.97 |
| 95 | 688579 | 山大地纬 | 450,374.93 | 3.97 |
| 96 | 605377 | 华旺科技 | 450,060.00 | 3.97 |
| 97 | 600184 | 光电股份 | 449,168.00 | 3.96 |
| 98 | 600105 | 永鼎股份 | 448,998.00 | 3.96 |
| 99 | 605266 | 健之佳 | 448,980.00 | 3.96 |
| 100 | 601566 | 九牧王 | 448,630.00 | 3.96 |
| 101 | 603630 | 拉芳家化 | 447,699.00 | 3.95 |
| 102 | 600425 | 青松建化 | 447,223.00 | 3.94 |
| 103 | 600495 | 晋西车轴 | 446,569.00 | 3.94 |
| 104 | 600186 | 莲花控股 | 446,460.00 | 3.94 |
| 105 | 600620 | 天宸股份 | 445,466.00 | 3.93 |
| 106 | 603618 | 杭电股份 | 444,799.00 | 3.92 |
| 107 | 600488 | 津药药业 | 442,969.00 | 3.91 |
| 108 | 000650 | 仁和药业 | 442,451.00 | 3.90 |
| 109 | 688292 | 浩瀚深度 | 441,904.18 | 3.90 |
| 110 | 605598 | 上海港湾 | 441,479.00 | 3.89 |
| 111 | 603070 | 万控智造 | 441,433.10 | 3.89 |
| 112 | 600987 | 航民股份 | 441,066.00 | 3.89 |
| 113 | 600230 | 沧州大化 | 440,757.00 | 3.89 |
| 114 | 600410 | 华胜天成 | 440,560.00 | 3.89 |
| 115 | 600738 | 丽尚国潮 | 439,558.00 | 3.88 |
| 116 | 601126 | 四方股份 | 437,500.00 | 3.86 |
| 117 | 601890 | 亚星锚链 | 437,281.00 | 3.86 |
| 118 | 600503 | 华丽家族 | 437,162.00 | 3.86 |
| 119 | 601999 | 出版传媒 | 436,668.00 | 3.85 |
| 120 | 603267 | 鸿远电子 | 435,943.00 | 3.85 |
| 121 | 600706 | 曲江文旅 | 435,823.00 | 3.84 |
| 122 | 603687 | 大胜达 | 434,956.00 | 3.84 |
| 123 | 600268 | 国电南自 | 434,368.00 | 3.83 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 124 | 600939 | 重庆建工 | 432,828.00 | 3.82 |
| 125 | 605068 | 明新旭腾 | 431,944.00 | 3.81 |
| 126 | 603969 | 银龙股份 | 430,931.00 | 3.80 |
| 127 | 603538 | 美诺华 | 428,957.00 | 3.78 |
| 128 | 603222 | 济民医疗 | 428,725.00 | 3.78 |
| 129 | 603366 | 日出东方 | 428,591.00 | 3.78 |
| 130 | 600576 | 祥源文旅 | 427,773.00 | 3.77 |
| 131 | 600611 | 大众交通 | 426,787.00 | 3.76 |
| 132 | 600354 | 敦煌种业 | 425,185.00 | 3.75 |
| 133 | 600636 | 国新文化 | 424,007.00 | 3.74 |
| 134 | 603708 | 家家悦 | 423,276.00 | 3.73 |
| 135 | 688799 | 华纳药厂 | 422,915.12 | 3.73 |
| 136 | 600716 | 凤凰股份 | 422,851.00 | 3.73 |
| 137 | 300377 | 赢时胜 | 422,200.00 | 3.72 |
| 138 | 600310 | 广西能源 | 419,025.00 | 3.70 |
| 139 | 600735 | 新华锦 | 418,833.00 | 3.69 |
| 140 | 603518 | 锦泓集团 | 418,126.00 | 3.69 |
| 141 | 600327 | 大东方 | 417,307.00 | 3.68 |
| 142 | 605388 | 均瑶健康 | 417,049.00 | 3.68 |
| 143 | 600130 | 波导股份 | 416,253.00 | 3.67 |
| 144 | 600249 | 两面针 | 415,047.00 | 3.66 |
| 145 | 603029 | 天鹅股份 | 414,737.00 | 3.66 |
| 146 | 603106 | 恒银科技 | 414,040.00 | 3.65 |
| 147 | 603333 | 尚纬股份 | 413,852.00 | 3.65 |
| 148 | 600537 | 亿晶光电 | 413,404.00 | 3.65 |
| 149 | 603078 | 江化微 | 411,894.00 | 3.63 |
| 150 | 603028 | 赛福天 | 411,770.00 | 3.63 |
| 151 | 603306 | 华懋科技 | 411,680.00 | 3.63 |
| 152 | 000828 | 东莞控股 | 411,365.00 | 3.63 |
| 153 | 688207 | 格灵深瞳 | 407,792.92 | 3.60 |
| 154 | 688580 | 伟思医疗 | 406,019.45 | 3.58 |
| 155 | 688588 | 凌志软件 | 404,917.47 | 3.57 |
| 156 | 600557 | 康缘药业 | 402,222.00 | 3.55 |
| 157 | 603123 | 翠微股份 | 402,145.00 | 3.55 |
| 158 | 601929 | 吉视传媒 | 396,504.00 | 3.50 |
| 159 | 301525 | 儒竞科技 | 395,081.00 | 3.48 |
| 160 | 603937 | 丽岛新材 | 393,397.00 | 3.47 |
| 161 | 603809 | 豪能股份 | 388,106.00 | 3.42 |
| 162 | 600594 | 益佰制药 | 387,711.00 | 3.42 |
| 163 | 301089 | 拓新药业 | 386,599.00 | 3.41 |
| 164 | 600280 | 中央商场 | 386,029.00 | 3.40 |
| 165 | 688293 | 奥浦迈 | 384,423.10 | 3.39 |
| 166 | 688328 | 深科达 | 383,218.42 | 3.38 |
| 167 | 600121 | 郑州煤电 | 381,373.00 | 3.36 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 168 | 002426 | 胜利精密 | 378,253.00 | 3.34 |
| 169 | 000892 | 欢瑞世纪 | 372,246.00 | 3.28 |
| 170 | 605188 | 国光连锁 | 348,849.00 | 3.08 |
| 171 | 603912 | 佳力图 | 346,541.00 | 3.06 |
| 172 | 300461 | 田中精机 | 345,689.00 | 3.05 |
| 173 | 002900 | 哈三联 | 345,100.00 | 3.04 |
| 174 | 603315 | 福鞍股份 | 341,686.00 | 3.01 |
| 175 | 600207 | 安彩高科 | 335,304.00 | 2.96 |
| 176 | 603360 | 百傲化学 | 324,524.00 | 2.86 |
| 177 | 300065 | 海兰信 | 323,835.00 | 2.86 |
| 178 | 002094 | 青岛金王 | 319,803.00 | 2.82 |
| 179 | 002270 | 华明装备 | 315,294.00 | 2.78 |
| 180 | 300415 | 伊之密 | 313,462.00 | 2.76 |
| 181 | 300181 | 佐力药业 | 310,627.00 | 2.74 |
| 182 | 600084 | 中信尼雅 | 309,958.22 | 2.73 |
| 183 | 603131 | 上海沪工 | 307,319.00 | 2.71 |
| 184 | 002679 | 福建金森 | 306,051.00 | 2.70 |
| 185 | 300602 | 飞荣达 | 303,569.00 | 2.68 |
| 186 | 603987 | 康德莱 | 302,484.00 | 2.67 |
| 187 | 002264 | 新华都 | 296,698.00 | 2.62 |
| 188 | 600308 | 华泰股份 | 294,059.00 | 2.59 |
| 189 | 301311 | 昆船智能 | 293,964.00 | 2.59 |
| 190 | 600623 | 华谊集团 | 292,979.00 | 2.58 |
| 191 | 002922 | 伊戈尔 | 290,306.00 | 2.56 |
| 192 | 300709 | 精研科技 | 289,189.00 | 2.55 |
| 193 | 688071 | 华依科技 | 286,010.56 | 2.52 |
| 194 | 688053 | 思科瑞 | 285,846.40 | 2.52 |
| 195 | 688226 | 威腾电气 | 285,736.57 | 2.52 |
| 196 | 688391 | 钜泉科技 | 285,222.78 | 2.52 |
| 197 | 300922 | 天秦装备 | 282,328.00 | 2.49 |
| 198 | 688348 | 昱能科技 | 279,766.29 | 2.47 |
| 199 | 000957 | 中通客车 | 277,484.00 | 2.45 |
| 200 | 301215 | 中汽股份 | 272,929.00 | 2.41 |
| 201 | 000521 | 长虹美菱 | 271,061.00 | 2.39 |
| 202 | 300400 | 劲拓股份 | 269,648.00 | 2.38 |
| 203 | 000159 | 国际实业 | 268,801.00 | 2.37 |
| 204 | 300756 | 金马游乐 | 266,230.00 | 2.35 |
| 205 | 600054 | 黄山旅游 | 265,672.00 | 2.34 |
| 206 | 300098 | 高新兴 | 264,809.00 | 2.34 |
| 207 | 300590 | 移为通信 | 264,000.00 | 2.33 |
| 208 | 605228 | 神通科技 | 261,450.00 | 2.31 |
| 209 | 300066 | 三川智慧 | 257,651.00 | 2.27 |
| 210 | 002587 | 奥拓电子 | 254,092.00 | 2.24 |
| 211 | 002031 | 巨轮智能 | 253,053.00 | 2.23 |

| | | | | |
|-----|--------|------|------------|------|
| 212 | 002593 | 日上集团 | 253,018.00 | 2.23 |
| 213 | 300369 | 绿盟科技 | 252,968.00 | 2.23 |
| 214 | 600159 | 大龙地产 | 252,356.00 | 2.23 |
| 215 | 002451 | 摩恩电气 | 251,554.00 | 2.22 |
| 216 | 300360 | 炬华科技 | 250,633.00 | 2.21 |
| 217 | 300840 | 酷特智能 | 248,687.00 | 2.19 |
| 218 | 688205 | 德科立 | 247,820.11 | 2.19 |
| 219 | 600694 | 大商股份 | 246,433.20 | 2.17 |
| 220 | 002878 | 元隆雅图 | 245,530.00 | 2.17 |
| 221 | 002965 | 祥鑫科技 | 245,372.00 | 2.16 |
| 222 | 000948 | 南天信息 | 245,288.00 | 2.16 |
| 223 | 603266 | 天龙股份 | 243,379.00 | 2.15 |
| 224 | 002561 | 徐家汇 | 240,453.00 | 2.12 |
| 225 | 000428 | 华天酒店 | 239,136.00 | 2.11 |
| 226 | 300516 | 久之洋 | 238,884.00 | 2.11 |
| 227 | 600476 | 湘邮科技 | 237,678.00 | 2.10 |
| 228 | 301169 | 零点有数 | 236,683.00 | 2.09 |
| 229 | 300100 | 双林股份 | 235,789.00 | 2.08 |
| 230 | 300491 | 通合科技 | 232,942.00 | 2.05 |
| 231 | 603859 | 能科科技 | 232,071.00 | 2.05 |
| 232 | 002543 | 万和电气 | 231,369.00 | 2.04 |
| 233 | 300047 | 天源迪科 | 230,807.00 | 2.04 |
| 234 | 300809 | 华辰装备 | 229,872.00 | 2.03 |
| 235 | 600429 | 三元股份 | 229,255.00 | 2.02 |
| 236 | 002947 | 恒铭达 | 228,181.00 | 2.01 |
| 237 | 300700 | 岱勒新材 | 227,338.00 | 2.01 |
| 238 | 300721 | 怡达股份 | 227,195.00 | 2.00 |

注：“卖出金额”按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

| | |
|---------------|----------------|
| 买入股票的成本（成交）总额 | 304,889,314.88 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 158,373,306.26 |

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的。本基金管理人将充分考虑股指期货的流动性及风险收益特征，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约进行多头或空头套期保值等策略操作。法律法规对于基金投资股指期货的投资策略另有规定的，本基金将按法律法规的规定执行。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金在进行国债期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为目的，采用流动性好、交易活跃的期货合约，通过对债券市场和期货市场运行趋势的研究，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。国债期货相关投资严格遵循法律法规及中国证监会的规定。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有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。

7.12.2 本基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|----|-------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 168,783.43 |
| 2 | 应收清算款 | 672,401.53 |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 82,142.72 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 923,327.68 |

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

| 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 |
| 360 | 34,240.98 | 750,633.00 | 6.09% | 11,576,118.00 | 93.91% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额（份） | 占上市总份额比例 |
|----|------------|--------------|----------|
| 1 | 陈雪玲 | 1,000,077.00 | 8.11% |
| 2 | 华晨宇 | 900,073.00 | 7.30% |
| 3 | 吴晓彤 | 830,902.00 | 6.74% |
| 4 | 中信证券股份有限公司 | 750,633.00 | 6.09% |
| 5 | 陆斌 | 698,429.00 | 5.67% |
| 6 | 肖静敏 | 589,968.00 | 4.79% |
| 7 | 厉建强 | 355,810.00 | 2.89% |
| 8 | 邹家年 | 304,400.00 | 2.47% |
| 9 | 刘志娟 | 300,023.00 | 2.43% |
| 10 | 李爽 | 260,035.00 | 2.11% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 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 | 3,000.00 | 0.0243% |

8.4 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的情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|--------------------------------|----------------|
| 基金合同生效日（2024 年 3 月 27 日）基金份额总额 | 212,326,751.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额 | 18,000,000.00 |
| 减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额 | 218,000,000.00 |
| 基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 12,326,751.00 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来聘请毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易单元数量 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|--------|----------------|--------------|------------|------------|----|
| | | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 佣金 | 占当期佣金总量的比例 | |
| 海通证券 | 3 | 463,262,621.14 | 100.00% | 341,427.25 | 100.00% | - |

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，

并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 债券交易 | | 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 |
| 海通证券 | - | - | - | - | - | - |

10.8 其他重大事件

| 序号 | 公告事项 | 法定披露方式 | 法定披露日期 |
|----|---|-----------------------------|------------|
| 1 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-06 |
| 2 | 海富通基金管理有限公司关于海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-21 |
| 3 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-03-28 |
| 4 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-10 |
| 5 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-10 |
| 6 | 海富通基金管理有限公司关于新增部分券商为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-15 |
| 7 | 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-15 |
| 8 | 海富通基金管理有限公司关于新增平安证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-18 |

| | | | |
|----|---|-----------------------------|------------|
| | 公告 | | |
| 9 | 海富通基金管理有限公司关于新增长江证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-25 |
| 10 | 关于海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-04-26 |
| 11 | 海富通基金管理有限公司关于新增招商证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-05-14 |
| 12 | 海富通基金管理有限公司关于新增中信建投证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-05-22 |
| 13 | 海富通基金管理有限公司关于新增国泰君安证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-06-06 |
| 14 | 海富通基金管理有限公司关于新增渤海证券股份有限公司为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-06-11 |
| 15 | 海富通基金管理有限公司关于新增部分券商为海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-06-17 |
| 16 | 关于海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告 | 上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站 | 2024-06-20 |

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

| 投资者类别 | 报告期内持有基金份额变化情况 | | | | | 报告期末持有基金情况 | |
|---|----------------|------------------------|------|---------------|---------------|------------|------|
| | 序号 | 持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间 | 期初份额 | 申购份额 | 赎回份额 | 持有份额 | 份额占比 |
| 个人 | 1 | 2024/5/6-2024/5/16 | - | 59,182,216.00 | 59,182,216.00 | - | - |
| 产品特有风险 | | | | | | | |
| 报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括： | | | | | | | |

- 1、当基金份额持有人占比过于集中时，可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金净值剧烈波动的风险；
- 2、若某单一基金份额持有人巨额赎回有可能引发基金的流动性风险，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；
- 3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现五十个工作日低于5000万元的风险，本基金可能会面临终止基金合同的情形；
- 4、其他可能的风险。

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

海富通基金管理有限公司成立于 2003 年 4 月，是中国首批获准成立的中外合资基金管理公司。

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 123 只公募基金。截至 2024 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1613 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月，海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证中国基金投教创新案例奖”。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一)中国证监会批准设立海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的文件
- (二)海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- (三)海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- (四)海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

中国（上海）自由贸易试验区陆家嘴环路 479 号 18 层 1802-1803 室以及 19 层 1901-1908 室

12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日