

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。

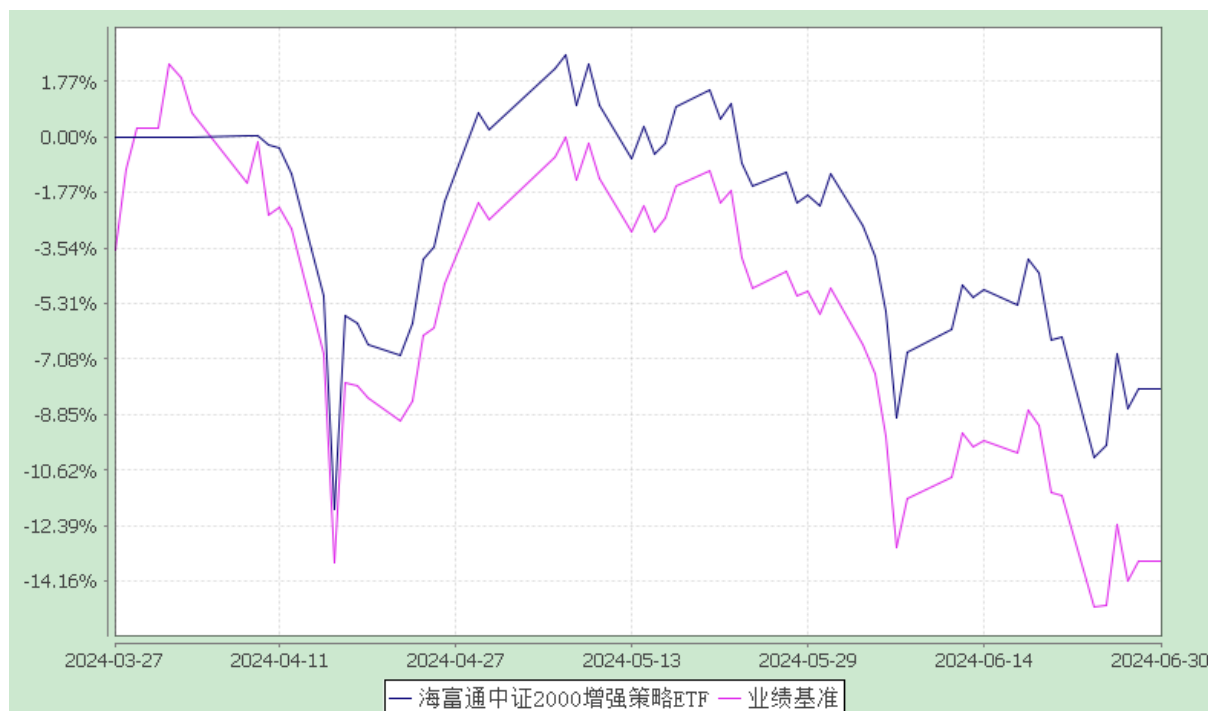
3.2 基金净值表现

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的要求，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	汉宇集团	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