

汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资 基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 3 月 27 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	24
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	24
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	25
§ 6 审计报告	25
6.1 审计报告的基本信息	25
6.2 审计报告的基本内容	25
§ 7 年度财务报表	27
7.1 资产负债表	27
7.2 利润表	28
7.3 净资产变动表	29
7.4 报表附注	31
§ 8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	59

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	78
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	78
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	79
8.12 投资组合报告附注.....	79
§ 9 基金份额持有人信息	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	80
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
9.4 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情况.....	80
9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	80
§ 10 开放式基金份额变动	81
§ 11 重大事件揭示	81
11.1 基金份额持有人大会决议.....	81
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
11.4 基金投资策略的改变.....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
11.8 其他重大事件.....	85
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	88
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	88
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§ 13 备查文件目录	90
13.1 备查文件目录.....	90
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	汇添富中证 2000ETF
场内简称	中证 2000ETF 汇添富
基金主代码	159536
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 09 月 13 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
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（份）	51,261,589.00
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	2023 年 09 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金通过综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本、交易限制等因素，可以选择采取完全复制法或抽样复制法构建基金的股票投资组合，以更好地实现跟踪标的指数的目的。 在特殊情形下，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。特殊情形包括但不限于以下情形：（1）法律法规的限制；（2）标的指数成份股流动性严重不足；（3）标的指数的成份股票长期停牌；（4）其它合理原因导致本基金管理人对标的指数的跟踪构成严重制约等。 本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；债券投资策略；资产支持证券投资策略；金融衍生工具投资策略；参与融资投资策略；参与转融通证券出借业务策略；存托凭证的投资策略等。
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，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，具有与标的指数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		汇添富基金管理股份有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	张姗
	联系电话	021-28932888	400-61-95555
	电子邮箱	service@99fund.com	zhangshan_1027@cmbchina.c

		om
客户服务电话	400-888-9918	400-61-95555
传真	021-28932998	0755-83195201
注册地址	上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	200010	518040
法定代表人	李文	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》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年	2023 年 09 月 13 日（基金合同生效日）-2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,447,378.07	7,547,985.78
本期利润	3,236,157.10	9,025,738.36
加权平均基金份额本期利润	0.0324	0.0244
本期加权平均净值利润率	3.69%	2.42%
本期基金份额净值增长率	0.56%	2.66%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	1,654,739.90	3,965,779.06
期末可供分配基金份额利润	0.0323	0.0266

期末基金资产净值	52,916,328.90	153,227,368.06
期末基金份额净值	1.0323	1.0266
3.1.3 累计期末指标	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	3.23%	2.66%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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（例如：基金的申购赎回费等），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。

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
过去三个月	11.42%	2.53%	8.40%	2.66%	3.02%	-0.13%
过去六个月	29.80%	2.29%	27.56%	2.39%	2.24%	-0.10%
过去一年	0.56%	2.37%	-2.14%	2.45%	2.70%	-0.08%
自基金合同生效起至今	3.23%	2.13%	-1.16%	2.20%	4.39%	-0.07%

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

汇添富中证2000ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

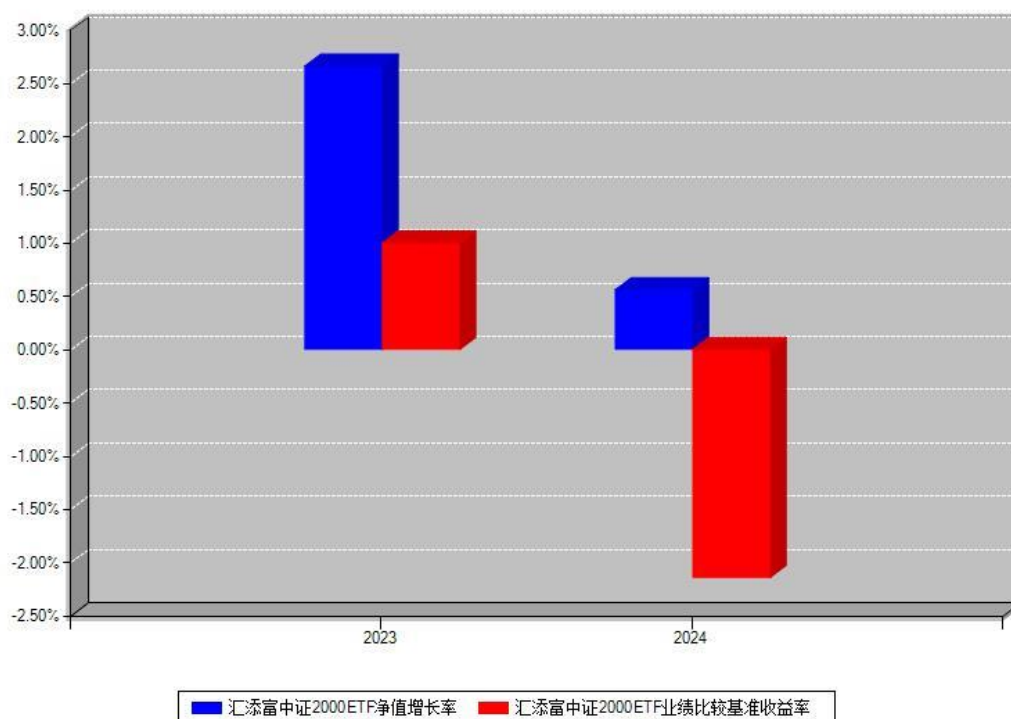


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 09 月 13 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富中证2000ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 09 月 13 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 09 月 13 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国、新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII

基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 年，汇添富基金新成立 32 只公募基金，包括 6 只混合型基金，16 只股票型基金，10 只债券型基金。2024 年底，公司公募基金产品总数达 342 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2024 年，汇添富基金持续稳步推进投顾式销售及服务模式的深度发展，注重从客户需求出发，坚持以客户回报为导向，不断优化基金售前、售中、售后服务及体验。同时，互金业务不断开拓从服务端发力的创新路径，积极探索数字化转型，利用大数据、人工智能等技术，持续优化平台各项功能，力争为客户提供差异化、智能化的服务体验。

另外，汇添富基金与第三方销售机构紧密合作，在工具创新、投教内容及形式创新、客户服务等方面展开了全方位深入合作，形成了较为完善的线上服务体系，更好地满足了客户多元化的投资需求，进一步提升了客户体验及满意度。

2024 年，汇添富基金秉持金融服务实体经济、满足居民财富管理需求的宗旨，以高质量发展为目标，持续提升投资者的获得感。公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务保持高质量发展势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位，同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2024 年，汇添富渠道业务坚持一切从长期出发和客户第一的原则，持续深化渠道融合共建，秉持开放生态理念，通过渠道服务、产品布局、科技赋能与创新意识，全方位提升渠道服务体系的广度与深度，推动渠道合作迈向新高度。广泛开展线下投资者教育工作，全年合计举办投资者教育活动 4846 场，覆盖 417398 人次。线上数字化运营创新升级，围绕着优

化运营模式、提升运营质量、增强运营效率等维度展开，获得银行渠道的一致认可。

2024 年，汇添富基金继续加强券商渠道的专业化服务。全年围绕不同投资主题推出“指增季”“固收季”“主动季”系列调研，并在全中国举办多场投顾赋能培训活动，帮助券商提升资产配置和客户服务能力。为了让投资者获得更多交流机会，公司全年开展超过 2700 场线上线下活动，既有专业投资策略会，也有基金经理面对面和“走进汇添富”交流活动。公司始终把客户体验放在第一位，通过持续为券商提供专业支持，让优质服务覆盖更多投资者。

2024 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2024 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。随着汇添富稳定收益基金获批，汇添富香港子公司进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础。从 2024 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2024 年以来，汇添富基金积极开展公益慈善工作，充分发挥公募基金优势，践行社会责任，为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十六年开展“河流·孩子”公益助学项目，举办第十七期乡村优秀青年教师培训和第七届乡村教育管理研习班，启动添富小学合唱团公益项目，助力乡村教育高质量发展；举办第四期“基业上善”慈善资产管理研修营，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展；发起第二期“致敬城市建设者”公益项目，让人民城市更有温度；参加云南、青海、内蒙古、陕西等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2025 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
董瑾	本基金的	2023 年 09 月	-	15	国籍：中国。学历：

	基金经理	13 日			北京大学西方经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2010 年 8 月至 2012 年 12 月任国泰基金管理有限公司产品经理助理，2012 年 12 月至 2015 年 9 月任汇添富基金管理股份有限公司产品经理，2015 年 9 月至 2016 年 10 月任万家基金管理有限公司量化投资部基金经理助理。2016 年 11 月加入汇添富基金管理股份有限公司。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理助理。2017 年 12 月 18 日至 2019 年 12 月 31 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理助理。2019 年 12 月 4 日至今任汇添富沪深 300 交易型开
--	------	------	--	--	--

					放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 12 月 31 日至今任汇添富沪深 300 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 5 月 8 日任汇添富中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2019 年 12 月 31 日至 2023 年 8 月 29 日任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2023 年 8 月 29 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富中证沪沪深 500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 9 日至今任汇添富中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月 11 日至 2022 年 5 月 23 日任汇添富中证电池主题指数型发
--	--	--	--	--	---

					起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 26 日至 2022 年 10 月 11 日任汇添富中证沪港深 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 3 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 5 月 23 日至今任汇添富中证电池主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月 13 日至 2023 年 11 月 28 日任汇添富中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 29 日至今任汇添富中证全指医疗器械交易型开放式
--	--	--	--	--	---

					指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2023 年 1 月 16 日至今任汇添富中证细分有色金属产业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 2 月 27 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 6 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 13 日至今任汇添富中证环境治理指数型证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 4 月 13 日至 2024 年 6 月 11 日任汇添富中证港股通高股息投资指数发起式证券投资基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 5 月 9 日至今任汇添富中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (LOF) 的基金经理。2023 年 8 月 23 日至 2024 年 10 月 26 日任汇添富中证沪港深消费龙头指数型发起式证
--	--	--	--	--	--

					券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 13 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 24 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 6 月 12 日至今任汇添富中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。
孙浩	本基金的基金经理	2023 年 12 月 12 日	-	4	国籍：中国。学历：北京大学金融硕士。从业资格：证券投资基金从业资格, CFA。从业经历：2020 年 7 月起任汇添富基金管理股份有限公司数量分析师。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任汇添富深证 300 交易型开

					放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 8 月 29 日至今任中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 9 月 28 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2023 年 11 月 28 日至今任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 1 月 30 日至今任汇添富中证红利交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经
--	--	--	--	--	---

					理。2024 年 2 月 7 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 12 日至 2024 年 12 月 26 日任汇添富上证科创板芯片指数型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 3 月 26 日至今任汇添富中证电信主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 4 月 19 日至今任汇添富国证港股通创新药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 4 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。2024 年 6 月 20 日至今任汇添富中证信息技术应用创新产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金
--	--	--	--	--	--

					的基金经理。2024 年 7 月 9 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2024 年 11 月 18 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 18 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 27 日至今任汇添富上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

董瑾 2025 年 03 月 21 日离任本基金基金经理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：

在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 9 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2024 年万得全 A 指数上涨 10.0%，A 股在经历了连续两年的下跌后，实现了年度阳线收官。行业层面来看，银行、非银行金融、家电和通信等行业涨幅居前，医药、农林牧渔、消费者服务和房地产表现相对靠后。风格上，全年大盘和价值类风格占优，小盘和成长类风格

偏弱，但四季度开始小盘和成长风格修复，也迎来了阶段性的表现。

2024 年全年 GDP 同比增长 5.0%，完成了全年经济增速目标。2024 年规模以上工业增加值比上年增长 5.8%，2024 年固定资产投资同比增长 3.2%，分类别看，2024 年制造业投资累计同比增长 9.2%，基建投资累计同比增长 4.4%，地产投资累计同比下降 10.6%，制造业和基建投资增速保持强劲，房地产仍面临较大的下行压力，但 2024 年 12 月房地产投资增速降幅有所收窄，房地产市场在政策的作用下有望止跌回稳的迹象。2024 年社会消费品零售总额同比增长 3.5%，在扩内需、促消费政策背景下，居民消费实现改善，特别是四季度以来，消费品以旧换新政策加力扩容，效果持续显现，促进了经济的回升向好。

外部环境来看，随着 2024 年 11 月美国大选的落地，重要的政治事件不确定性开始消除，市场对于潜在的外部政策有了一定的预期。同时，美联储 2024 年累计降息三次达 100 个基点，符合市场预期，后续美联储降息概率仍存，国内汇率掣肘减少，货币政策空间也有望打开。

中证 2000 指数是 A 股微盘风格的代表，具备高波动和高弹性的特征。报告期内，本基金采用抽样复制方法，在严控跟踪误差的前提下，通过量化多因子和风险模型来追求稳健适度的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为 0.56%。同期业绩比较基准收益率为-2.14%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，外部环境如中美关系及全球通胀仍是潜在扰动变量，但随着 2024 年 12 月中央政治局会议和中央经济工作会议奠定了“积极有为”的政策基调，更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策有望协调发力，政策向宏观经济基本面的传导实效有望逐步显现，宏观经济中长期改善预期持续增强。2025 年 A 股在政策红利下有望维持较好的交投活跃度，随着宏观经济改善得以验证，A 股有望步入盈利修复驱动行情，A 股长期投资价值可期。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规管理

公司以党的二十届三中全会精神、新“国九条”及证监会配套政策等国家重要政策方针为指导，大力深化合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规

资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关

制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配采用现金分红；每一基金份额享有同等分配权；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。基于本基金的性质和特点，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。

本基金本报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 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

托管人声明：

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。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2025)审字第 70015647_B292 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现

报表的责任	公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	

审计报告日期	2025 年 03 月 31 日
--------	------------------

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	426,742.22	2,716,634.95
结算备付金		128,888.64	641,454.78
存出保证金		6,401.54	313,644.64
交易性金融资产	7.4.7.2	52,504,501.00	150,201,312.49
其中：股票投资		52,504,501.00	150,201,312.49
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		15,245.90	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		53,081,779.30	153,873,046.86
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,107.53	154,728.89
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		24,299.00	67,431.57
应付托管费		4,859.80	13,486.32
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	7.4.7.7	134,184.07	410,032.02
负债合计		165,450.40	645,678.80
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	51,261,589.00	149,261,589.00
未分配利润	7.4.7.9	1,654,739.90	3,965,779.06
净资产合计		52,916,328.90	153,227,368.06
负债和净资产总计		53,081,779.30	153,873,046.86

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0323 元，基金份额总额 51,261,589.00 份。

2、本基金合同于 2023 年 09 月 13 日生效，上年度实际报告期间为 2023 年 09 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		3,904,546.04	9,841,195.64
1. 利息收入		13,771.98	202,031.63
其中：存款利息收入	7.4.7.10	13,771.98	202,031.63
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）		-1,077,702.80	6,972,079.60
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-1,971,488.83	6,848,117.76
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-

股利收益	7.4.7.17	893,786.03	123,961.84
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	4,683,535.17	1,477,752.58
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	284,941.69	1,189,331.83
减：二、营业总支出		668,388.94	815,457.28
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	452,253.34	562,476.89
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	90,450.60	112,495.39
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	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.21	125,685.00	140,485.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,236,157.10	9,025,738.36
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,236,157.10	9,025,738.36
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,236,157.10	9,025,738.36

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	149,261,589.00	3,965,779.06	153,227,368.06
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	149,261,589.00	3,965,779.06	153,227,368.06
三、本期增减变	-98,000,000.00	-2,311,039.16	-100,311,039.16

动额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	3,236,157.10	3,236,157.10
（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）	-98,000,000.00	-5,547,196.26	-103,547,196.26
其中：1. 基金申购款	286,000,000.00	-58,828,975.95	227,171,024.05
2. 基金赎回款	-384,000,000.00	53,281,779.69	-330,718,220.31
（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	51,261,589.00	1,654,739.90	52,916,328.90
项目	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	1,213,261,589.00	-	1,213,261,589.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,064,000,000.00	3,965,779.06	-1,060,034,220.94
（一）、综合收益总额	-	9,025,738.36	9,025,738.36
（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）	-1,064,000,000.00	-5,059,959.30	-1,069,059,959.30
其中：1. 基金申购款	64,000,000.00	2,095,896.63	66,095,896.63
2. 基金赎回款	-1,128,000,000.00	-7,155,855.93	-1,135,155,855.93
（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	149,261,589.00	3,965,779.06	153,227,368.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

张晖
基金管理人负责人

李骁
主管会计工作负责人

雷青松
会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系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]1941 号文《关于准予汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 9 月 13 日生效。首次设立基金募集规模为 1,213,261,589.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 70015647_B01 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或

减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

每个资产负债表日,本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估,以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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

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

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

(2) 不存在活跃市场的金融工具,应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时,应优先使用可观察输

入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

期内逐日计提；

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

1、《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配采用现金分红；

3、每一基金份额享有同等分配权；

4、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。基于本基金的性质和特点，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；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2. 增值税

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅

助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

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

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

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

4. 企业所得税

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

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

5. 个人所得税

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

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《关于上市公司股息红利

差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	426,742.22	2,716,634.95
等于：本金	426,682.61	2,716,348.27
加：应计利息	59.61	286.68
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	426,742.22	2,716,634.95

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		46,343,213.25	-	52,504,501.00	6,161,287.75
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	46,343,213.25	-	52,504,501.00	6,161,287.75
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	148,723,559.91	-	150,201,312.49	1,477,752.58
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	148,723,559.91	-	150,201,312.49	1,477,752.58

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-

应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	9,184.07	270,032.02
其中：交易所市场	9,184.07	270,032.02
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	45,000.00	70,000.00
应付信息披露费	80,000.00	70,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
应付或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	134,184.07	410,032.02

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	149,261,589.00	149,261,589.00
本期申购	286,000,000.00	286,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-384,000,000.00	-384,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	51,261,589.00	51,261,589.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 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	6,823,266.33	-2,857,487.27	3,965,779.06

加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	6,823,266.33	-2,857,487.27	3,965,779.06
本期利润	-1,447,378.07	4,683,535.17	3,236,157.10
本期基金份额交易产生的变动数	1,400,065.41	-6,947,261.67	-5,547,196.26
其中：基金申购款	-1,440,601.92	-57,388,374.03	-58,828,975.95
基金赎回款	2,840,667.33	50,441,112.36	53,281,779.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,775,953.67	-5,121,213.77	1,654,739.90

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同 生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	6,391.84	61,259.61
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	5,825.62	139,607.03
其他	1,554.52	1,164.99
合计	13,771.98	202,031.63

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生 效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,249,399.79	969,881.33
股票投资收益——赎回差价收入	1,277,910.96	5,878,236.43
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	-1,971,488.83	6,848,117.76

7.4.7.11.2 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 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	231,716,183.45	549,075,714.00
减：卖出股票成本总额	234,638,096.20	546,294,400.98
减：交易费用	327,487.04	1,811,431.69
买卖股票差价收入	-3,249,399.79	969,881.33

7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	330,718,220.31	1,135,155,855.93
减：现金支付赎回款总额	112,074,317.31	382,752,875.93
减：赎回股票成本总额	217,365,992.04	746,524,743.57
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,277,910.96	5,878,236.43

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具其他投资收益。

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	893,786.03	123,961.84
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	893,786.03	123,961.84

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生 效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	4,683,535.17	1,477,752.58
——股票投资	4,683,535.17	1,477,752.58
——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	—	—
——权证投资	—	—
——期货投资	—	—
3. 其他	—	—
减：应税金融商品 公允价值变动产生 的预估增值税	—	—
合计	4,683,535.17	1,477,752.58

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	—	—
替代损益	284,941.69	1,189,331.83
其他	—	—

合计	284,941.69	1,189,331.83
----	------------	--------------

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效 日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	70,000.00
信息披露费	80,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	285.00	485.00
指数使用费	-	-
持有人大会 - 公证费	-	-
持有人大会 - 律师费	-	-
开户费	400.00	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	125,685.00	140,485.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
汇添富基金管理股份有限公司	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
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司

汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变更为“全资子公司”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金本报告期及上年度可比期间均不存在向关联方支付佣金的情况。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	2023 年 09 月 13 日（基 金合同生效日）至 2023

		年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	452,253.34	562,476.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	44,598.24	—
应支付基金管理人的净管理费	407,655.10	562,476.89

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	90,450.60	112,495.39

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

务的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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。

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

注：本基金本报告期及上年度可比期间均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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

注：本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 09 月 13 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	426,742.22	6,391.84	2,716,634.95	61,259.61

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000777	中核科技	2024 年 12 月 30 日	重大事项停牌	18.07	2025 年 01 月 14 日	19.88	3,500	52,244.35	63,245.00	
002379	宏创控股	2024 年 12 月 23 日	重大事项停牌	8.97	2025 年 01 月 07 日	9.87	4,600	24,626.11	41,262.00	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任,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,导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券,且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券,不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行,申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外,在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算,因此违约风险发生的可能性很小;基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估,以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系,审慎评估各类资产的流动性,针对性制定流动性风险管理措施,对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控,保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配,确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款,约定在非常情况下赎回申请的处理方式,控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险,有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外,本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求,并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求,对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	426,742.22	-	-	-	-	-	426,742.22
结算备付金	128,888.64	-	-	-	-	-	128,888.64
存出保证金	6,401.54	-	-	-	-	-	6,401.54
交易性金融资产	-	-	-	-	-	52,504,501.00	52,504,501.00
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融	-	-	-	-	-	-	-

资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	15,245.90	15,245.90
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	562,032.40	-	-	-	-	52,519,746.90	53,081,779.30
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,107.53	2,107.53
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	24,299.00	24,299.00

应付 托管 费	-	-	-	-	-	4,859.80	4,859.80
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	-	-	-	-	-	134,184.07	134,184.07
负债 总计	-	-	-	-	-	165,450.40	165,450.40
利率 敏感 度缺 口	562,032.40	-	-	-	-	52,354,296.50	52,916,328.90
上年 度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个 月-1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	2,716,634.95	-	-	-	-	-	2,716,634.95
结算 备付 金	641,454.78	-	-	-	-	-	641,454.78
存出 保证 金	313,644.64	-	-	-	-	-	313,644.64
交易 性金	-	-	-	-	-	150,201,312.49	150,201,312.49

融资产							
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	3,671,734.37	-	-	-	-	150,201,312.49	153,873,046.86
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算	-	-	-	-	-	154,728.89	154,728.89

款							
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	67,431.57	67,431.57
应付托管费	-	-	-	-	-	13,486.32	13,486.32
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	-	-	-	-	-	410,032.02	410,032.02
负债总计	-	-	-	-	-	645,678.80	645,678.80
利率敏感度缺口	3,671,734.37	-	-	-	-	149,555,633.69	153,227,368.06

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	52,504,501.00	99.22	150,201,312.49	98.03
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	52,504,501.00	99.22	150,201,312.49	98.03

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	中证 2000 指数上涨 5%	2,558,715.47	7,114,305.06
	中证 2000 指数下跌 5%	-2,558,715.47	-7,114,305.06

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	52,399,994.00	150,118,790.49
第二层次	104,507.00	82,522.00
第三层次	—	—
合计	52,504,501.00	150,201,312.49

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	52,504,501.00	98.91
	其中：股票	52,504,501.00	98.91
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	555,630.86	1.05
8	其他各项资产	21,647.44	0.04
9	合计	53,081,779.30	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	168,355.00	0.32
B	采矿业	104,682.00	0.20
C	制造业	37,638,582.51	71.13
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,184,083.66	2.24
E	建筑业	700,845.00	1.32
F	批发和零售业	3,200,922.80	6.05
G	交通运输、仓储和邮政业	953,038.80	1.80
H	住宿和餐饮业	151,699.00	0.29
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,957,421.83	9.37
J	金融业	78,007.00	0.15

K	房地产业	817,404.00	1.54
L	租赁和商务服务业	603,880.00	1.14
M	科学研究和技术服务业	541,326.40	1.02
N	水利、环境和公共设施管理业	613,766.00	1.16
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	194,677.00	0.37
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	562,634.00	1.06
S	综合	33,176.00	0.06
	合计	52,504,501.00	99.22

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002449	国星光电	18,400	250,608.00	0.47
2	688697	纽威数控装备	11,301	188,048.64	0.36
3	600300	维维股份	56,400	181,608.00	0.34
4	002546	新联电子	40,900	177,097.00	0.33
5	002479	富春环保	37,300	176,802.00	0.33
6	688588	凌志软件	12,800	176,640.00	0.33
7	300515	三德科技	14,500	172,695.00	0.33
8	688269	西安凯立新材	6,900	172,362.00	0.33
9	600784	鲁银投资	28,900	170,221.00	0.32
10	002860	星帅尔	17,200	168,732.00	0.32
11	000407	胜利股份	48,700	166,554.00	0.31
12	002462	嘉事堂	12,800	165,376.00	0.31
13	300184	力源信息	17,700	165,141.00	0.31
14	688663	新风光科	7,500	162,825.00	0.31

		技			
15	688181	八亿时空 液晶股份	4,932	162,262.80	0.31
16	000900	现代投资	36,700	161,847.00	0.31
17	301028	东亚机械	14,900	160,771.00	0.30
18	600237	铜峰电子	24,400	159,820.00	0.30
19	000533	顺钠股份	26,200	158,772.00	0.30
20	600694	大商股份	5,990	157,956.30	0.30
21	600526	菲达环保	34,900	156,701.00	0.30
22	301377	鼎泰高科	7,400	156,510.00	0.30
23	300279	和晶科技	25,800	156,348.00	0.30
24	600794	保税科技	42,800	155,364.00	0.29
25	000417	合百集团	24,000	153,120.00	0.29
26	002117	东港股份	13,100	153,008.00	0.29
27	002093	国脉科技	19,600	152,880.00	0.29
28	603012	创力集团	28,600	151,866.00	0.29
29	002104	恒宝股份	22,400	151,424.00	0.29
30	002441	众业达	19,300	150,154.00	0.28
31	300548	博创科技	3,200	148,512.00	0.28
32	300048	合康新能	29,400	148,176.00	0.28
33	002580	圣阳股份	17,400	147,552.00	0.28
34	000731	四川美丰	20,100	147,534.00	0.28
35	600973	宝胜股份	23,400	147,420.00	0.28
36	300950	德固特	9,100	146,965.00	0.28
37	600713	南京医药	29,500	146,320.00	0.28
38	300248	新开普	15,000	145,350.00	0.27
39	002491	通鼎互联	28,200	144,948.00	0.27
40	300007	汉威科技	7,000	143,150.00	0.27
41	688519	南亚新材料	6,700	142,442.00	0.27
42	300195	长荣股份	25,300	142,439.00	0.27
43	002082	万邦德	21,900	140,817.00	0.27
44	300485	赛升药业	19,900	139,499.00	0.26
45	002115	三维通信	20,900	138,985.00	0.26
46	002361	神剑股份	25,500	138,975.00	0.26
47	300802	矩子科技	7,600	138,852.00	0.26
48	002662	京威股份	35,800	138,546.00	0.26
49	300331	苏大维格	6,400	138,432.00	0.26
50	600105	永鼎股份	27,700	137,392.00	0.26
51	600503	华丽家族	52,700	137,020.00	0.26
52	002598	山东章鼓	14,400	136,080.00	0.26
53	002031	巨轮智能	27,300	135,681.00	0.26
54	300440	运达科技	17,100	135,432.00	0.26

55	600255	鑫科材料	39,500	135,090.00	0.26
56	002788	鹭燕医药	16,300	133,823.00	0.25
57	688121	卓然技术	12,300	132,471.00	0.25
58	600982	宁波能源	31,800	131,016.00	0.25
59	002825	纳尔股份	16,700	130,594.00	0.25
60	002448	中原内配	20,700	129,582.00	0.24
61	603987	康德莱	18,000	129,240.00	0.24
62	002768	国恩股份	5,600	129,192.00	0.24
63	300193	佳士科技	14,500	128,905.00	0.24
64	600293	三峡新材	40,900	128,835.00	0.24
65	002301	齐心集团	18,100	128,691.00	0.24
66	002863	今飞凯达	27,600	128,064.00	0.24
67	600512	腾达建设	53,700	127,269.00	0.24
68	000931	中关村	26,700	127,092.00	0.24
69	002548	金新农	32,000	127,040.00	0.24
70	300378	鼎捷数智	4,900	126,763.00	0.24
71	000026	飞亚达	12,200	126,514.00	0.24
72	300131	英唐智控	15,400	124,894.00	0.24
73	688313	仕佳光子	7,600	124,564.00	0.24
74	300664	鹏鹞环保	21,150	124,362.00	0.24
75	300018	中元股份	18,300	123,891.00	0.23
76	002282	博深股份	16,700	123,747.00	0.23
77	300414	中光防雷	15,500	123,380.00	0.23
78	002106	莱宝高科	11,300	123,283.00	0.23
79	002132	恒星科技	44,800	122,752.00	0.23
80	002570	贝因美	29,000	122,090.00	0.23
81	603811	诚意药业	15,800	121,976.00	0.23
82	002083	孚日股份	24,900	121,761.00	0.23
83	301170	锡南科技	5,300	121,476.00	0.23
84	300384	三联虹普	6,500	121,030.00	0.23
85	600846	同济科技	14,000	120,680.00	0.23
86	300145	中金环境	32,500	120,575.00	0.23
87	002628	成都路桥	26,600	120,498.00	0.23
88	600590	泰豪科技	22,100	119,782.00	0.23
89	000541	佛山照明	19,300	119,660.00	0.23
90	300341	麦克奥迪	6,800	119,068.00	0.23
91	002169	智光电气	19,300	118,695.00	0.22
92	300541	先进数通	8,730	118,291.50	0.22
93	002686	亿利达	21,800	116,848.00	0.22
94	688566	吉贝尔药业	5,200	116,480.00	0.22
95	300005	探路者	16,600	116,366.00	0.22
96	002170	芭田股份	13,300	116,109.00	0.22

97	002334	英威腾	15,400	115,808.00	0.22
98	300098	高新兴	21,100	115,628.00	0.22
99	002386	天原股份	25,300	115,621.00	0.22
100	000912	泸天化	26,300	115,194.00	0.22
101	603938	三孚股份	10,600	114,586.00	0.22
102	600351	亚宝药业	18,700	113,883.00	0.22
103	600425	青松建化	28,900	113,288.00	0.21
104	601616	广电电气	25,800	113,262.00	0.21
105	600609	金杯汽车	15,700	113,040.00	0.21
106	688186	张家港广大特材	7,355	112,899.25	0.21
107	301127	天源环保	7,439	112,626.46	0.21
108	000823	超声电子	10,900	112,488.00	0.21
109	300465	高伟达	6,100	111,996.00	0.21
110	300420	五洋自控	36,000	111,960.00	0.21
111	600736	苏州高新	17,900	111,159.00	0.21
112	600278	东方创业	15,900	111,141.00	0.21
113	002073	软控股份	13,400	110,684.00	0.21
114	300566	激智科技	5,600	110,432.00	0.21
115	002616	长青集团	23,100	110,418.00	0.21
116	002454	松芝股份	16,600	110,390.00	0.21
117	600180	瑞茂通	25,600	110,080.00	0.21
118	300290	荣科科技	5,400	109,890.00	0.21
119	688468	科美诊断	16,000	109,600.00	0.21
120	002437	誉衡药业	44,000	109,560.00	0.21
121	000551	创元科技	9,100	108,836.00	0.21
122	000507	珠海港	21,200	108,120.00	0.20
123	600251	冠农股份	14,800	107,892.00	0.20
124	600880	博瑞传播	22,600	107,124.00	0.20
125	300247	融捷健康	29,900	107,042.00	0.20
126	002376	新北洋	16,400	106,928.00	0.20
127	002538	司尔特	19,000	106,780.00	0.20
128	300532	今天国际	9,320	106,434.40	0.20
129	603777	来伊份	6,900	106,398.00	0.20
130	300213	佳讯飞鸿	13,800	106,122.00	0.20
131	002752	昇兴股份	16,700	106,045.00	0.20
132	300543	朗科智能	10,100	105,848.00	0.20
133	688049	炬芯科技	2,356	105,713.72	0.20
134	603009	北特科技	2,700	105,516.00	0.20
135	300349	金卡智能	7,700	105,259.00	0.20
136	688678	福立旺精密	7,080	105,138.00	0.20
137	600368	五洲交通	21,940	104,653.80	0.20

138	000036	华联控股	25,600	104,448.00	0.20
139	600525	长园集团	21,400	104,432.00	0.20
140	300275	梅安森	7,100	104,370.00	0.20
141	000852	石化机械	15,100	104,190.00	0.20
142	300872	天阳科技	6,600	103,950.00	0.20
143	300307	慈星股份	12,600	103,824.00	0.20
144	600035	楚天高速	22,400	103,040.00	0.19
145	002642	荣联科技	14,400	102,960.00	0.19
145	300278	华昌达	17,600	102,960.00	0.19
147	002876	三利谱	4,000	102,640.00	0.19
148	688419	耐科装备	3,300	102,564.00	0.19
149	000589	贵州轮胎	20,300	102,109.00	0.19
150	002398	垒知集团	23,100	101,409.00	0.19
151	300099	尤洛卡	16,900	101,400.00	0.19
152	600419	天润乳业	10,800	100,548.00	0.19
153	603867	新化股份	4,100	99,958.00	0.19
154	603035	常熟汽饰	6,900	99,291.00	0.19
155	300790	宇瞳光学	5,200	99,268.00	0.19
156	605128	上海沿浦	2,684	99,173.80	0.19
157	603738	泰晶科技	6,600	98,868.00	0.19
158	000936	华西股份	12,100	98,857.00	0.19
159	300447	全信股份	6,900	97,773.00	0.18
160	300829	金丹科技	5,200	97,708.00	0.18
161	002277	友阿股份	16,600	97,110.00	0.18
162	002303	美盈森	27,100	97,018.00	0.18
163	002885	京泉华	6,800	96,900.00	0.18
164	300053	航宇微	7,400	96,866.00	0.18
165	002419	天虹股份	16,500	96,690.00	0.18
166	688667	菱电电控	2,400	96,456.00	0.18
167	300328	宜安科技	13,089	96,335.04	0.18
168	000501	武商集团	9,200	96,232.00	0.18
169	300217	东方电热	21,300	96,063.00	0.18
170	300174	元力股份	6,500	95,680.00	0.18
171	300493	润欣科技	3,400	95,642.00	0.18
172	300453	三鑫医疗	12,800	95,488.00	0.18
173	688698	伟创电气	2,170	95,480.00	0.18
174	300061	旗天科技	7,400	95,460.00	0.18
175	603681	永冠新材	7,400	95,386.00	0.18
176	688025	杰普特光电	2,000	95,000.00	0.18
177	002342	巨力索具	29,400	94,962.00	0.18
178	002733	雄韬股份	6,800	94,112.00	0.18
179	601999	出版传媒	15,000	94,050.00	0.18

180	300194	福安药业	21,000	93,660.00	0.18
181	300047	天源迪科	7,900	92,825.00	0.18
182	688068	热景生物	1,500	92,760.00	0.18
183	002255	海陆重工	16,400	91,184.00	0.17
184	300041	回天新材	9,900	91,080.00	0.17
185	605007	五洲特纸	7,100	90,809.00	0.17
186	688618	三旺通信	4,300	90,343.00	0.17
187	600730	中国高科	14,900	90,145.00	0.17
188	301322	绿通科技	4,100	90,118.00	0.17
189	002664	信质集团	6,400	89,984.00	0.17
190	600558	大西洋	22,100	89,947.00	0.17
191	000670	盈方微	10,800	89,856.00	0.17
192	000886	海南高速	11,500	89,355.00	0.17
193	002445	中南文化	36,410	89,204.50	0.17
194	300951	博硕科技	2,980	89,012.60	0.17
195	301379	天山电子	4,400	88,880.00	0.17
196	301018	申菱环境	2,300	88,642.00	0.17
197	002533	金杯电工	9,000	88,560.00	0.17
198	002345	潮宏基	15,200	88,312.00	0.17
199	603416	信捷电气	2,100	88,095.00	0.17
200	002540	亚太科技	14,300	88,088.00	0.17
201	002611	东方精工	9,000	87,750.00	0.17
202	002996	顺博合金	13,200	87,648.00	0.17
203	300219	鸿利智汇	11,700	87,633.00	0.17
204	600693	东百集团	12,500	87,500.00	0.17
205	600495	晋西车轴	23,000	87,400.00	0.17
206	688095	福昕软件开发	1,300	87,308.00	0.16
207	300292	吴通控股	18,000	87,300.00	0.16
208	002551	尚荣医疗	28,300	87,164.00	0.16
209	300259	新天科技	24,900	87,150.00	0.16
210	300925	法本信息	3,900	86,892.00	0.16
211	300426	唐德影视	8,800	86,856.00	0.16
212	000534	万泽股份	6,700	86,229.00	0.16
213	002803	吉宏股份	6,800	86,224.00	0.16
214	603187	海容冷链	7,700	86,163.00	0.16
215	688768	容知日新	2,369	86,089.46	0.16
216	300063	天龙集团	9,400	85,728.00	0.16
217	000707	双环科技	11,600	85,608.00	0.16
218	002965	祥鑫科技	2,500	85,575.00	0.16
219	601007	金陵饭店	12,200	85,522.00	0.16
220	688015	交控科技	4,300	85,269.00	0.16
221	002559	亚威股份	9,500	85,215.00	0.16

222	001205	盛航股份	4,400	84,876.00	0.16
223	000788	北大医药	14,100	84,600.00	0.16
224	300545	联得装备	2,700	84,591.00	0.16
225	000700	模塑科技	12,000	84,240.00	0.16
225	300008	天海防务	18,000	84,240.00	0.16
227	300569	天能重工	16,900	84,162.00	0.16
228	000409	云鼎科技	9,400	83,754.00	0.16
229	600410	华胜天成	11,500	83,260.00	0.16
230	002149	西部材料	4,700	83,190.00	0.16
231	002443	金洲管道	14,100	82,908.00	0.16
232	600288	大恒科技	9,700	82,838.00	0.16
233	002969	嘉美包装	26,600	82,726.00	0.16
234	002609	捷顺科技	10,000	82,600.00	0.16
235	301329	信音电子	3,900	82,095.00	0.16
236	300629	新劲刚	3,800	82,080.00	0.16
237	000948	南天信息	4,900	81,977.00	0.15
238	688590	新致软件	5,100	81,753.00	0.15
239	688159	有方科技	2,700	81,648.00	0.15
240	600611	大众交通	11,800	81,420.00	0.15
241	002892	科力尔	5,280	81,312.00	0.15
242	603339	四方科技	6,400	80,896.00	0.15
243	300884	狄耐克	7,200	80,496.00	0.15
244	300353	东土科技	7,000	80,360.00	0.15
245	301389	隆扬电子	4,800	80,256.00	0.15
246	600226	亨通股份	31,400	80,070.00	0.15
247	300304	云意电气	10,000	80,000.00	0.15
248	603380	易德龙	3,200	79,968.00	0.15
249	300046	台基股份	2,200	79,794.00	0.15
250	600742	一汽富维	9,000	79,650.00	0.15
251	603809	豪能股份	6,816	79,270.08	0.15
252	688258	江苏卓易 信息科技	2,288	79,164.80	0.15
253	002328	新朋股份	12,900	79,077.00	0.15
254	003038	鑫铂股份	4,760	78,920.80	0.15
255	300360	炬华科技	4,700	78,819.00	0.15
256	600353	旭光电子	10,900	78,698.00	0.15
257	002046	国机精工	5,600	78,400.00	0.15
258	600106	重庆路桥	14,000	78,260.00	0.15
259	600067	冠城新材	29,500	78,175.00	0.15
260	601789	宁波建工	17,600	78,144.00	0.15
261	002045	国光电器	3,600	78,084.00	0.15
262	688533	上声电子 股份	2,240	77,996.80	0.15

263	688259	创耀通信科技	2,220	77,944.20	0.15
264	688080	映翰通网络	2,366	77,888.72	0.15
265	000544	中原环保	8,900	77,697.00	0.15
266	002655	共达电声	6,100	77,653.00	0.15
267	002919	名臣健康	4,720	77,644.00	0.15
268	002845	同兴达	5,100	77,316.00	0.15
269	601956	东贝集团	16,000	77,280.00	0.15
270	300302	同有科技	4,900	77,224.00	0.15
271	000925	众合科技	8,900	77,163.00	0.15
272	002724	海洋王	14,500	77,140.00	0.15
273	600594	益佰制药	21,600	76,896.00	0.15
274	002438	江苏神通	6,300	76,860.00	0.15
275	300468	四方精创	4,700	76,610.00	0.14
276	603227	雪峰科技	8,800	76,472.00	0.14
277	600200	江苏吴中	8,200	76,424.00	0.14
278	688550	瑞联新材料	2,440	76,347.60	0.14
279	688308	欧科亿数控刀具	4,200	75,810.00	0.14
280	605555	德昌股份	3,500	75,740.00	0.14
281	002122	汇洲智能	22,200	75,480.00	0.14
282	002536	飞龙股份	6,500	75,270.00	0.14
283	002298	中电兴发	14,100	75,012.00	0.14
284	688299	长阳科技	5,100	74,970.00	0.14
285	002849	威星智能	4,200	74,844.00	0.14
286	301370	国科恒泰	6,900	74,520.00	0.14
287	600191	华资实业	10,700	74,044.00	0.14
288	603889	新澳股份	10,500	73,605.00	0.14
289	600616	金枫酒业	12,900	73,530.00	0.14
290	301185	鸥玛软件	4,300	73,444.00	0.14
291	002148	北纬科技	11,100	73,371.00	0.14
292	002442	龙星化工	12,200	73,322.00	0.14
293	300994	久祺股份	6,500	73,320.00	0.14
294	002480	新筑股份	14,200	73,272.00	0.14
295	603999	读者传媒	11,900	73,185.00	0.14
296	603558	健盛集团	6,800	73,168.00	0.14
297	300439	美康生物	7,000	73,150.00	0.14
298	603018	华设集团	8,900	73,069.00	0.14
299	002512	达华智能	15,400	72,996.00	0.14
300	300559	佳发教育	6,100	72,956.00	0.14
301	300793	佳禾智能	3,700	72,927.00	0.14

302	688551	科威尔股份	2,600	72,774.00	0.14
303	600758	辽宁能源	21,100	72,584.00	0.14
304	002783	凯龙股份	8,900	72,535.00	0.14
305	002133	广宇集团	28,300	72,165.00	0.14
306	600397	安源煤业	17,100	72,162.00	0.14
307	603096	新经典	3,800	72,010.00	0.14
308	600379	宝光股份	7,600	71,972.00	0.14
309	688189	南新制药	11,000	71,940.00	0.14
310	600218	全柴动力	9,100	71,890.00	0.14
311	002526	山东矿机	20,300	71,659.00	0.14
312	002375	亚厦股份	18,500	71,410.00	0.13
313	002483	润邦股份	13,700	71,377.00	0.13
314	605377	华旺科技	5,340	71,289.00	0.13
315	002997	瑞鹄模具	2,057	71,275.05	0.13
316	002094	青岛金王	12,900	70,950.00	0.13
317	603815	交建股份	12,600	70,938.00	0.13
318	603897	长城科技	3,000	70,500.00	0.13
319	600469	风神股份	11,400	70,224.00	0.13
320	600756	浪潮软件	4,900	70,217.00	0.13
321	002039	黔源电力	4,600	70,196.00	0.13
322	002135	东南网架	16,500	70,125.00	0.13
322	002971	和远气体	3,740	70,125.00	0.13
324	001380	华纬科技	3,200	70,080.00	0.13
324	300320	海达股份	7,300	70,080.00	0.13
326	002772	众兴菌业	9,500	70,015.00	0.13
327	300503	昊志机电	3,700	70,004.00	0.13
328	000822	山东海化	12,300	69,864.00	0.13
329	601599	浙文影业	19,500	69,810.00	0.13
330	002523	天桥起重	21,300	69,651.00	0.13
331	002543	万和电气	6,800	69,632.00	0.13
332	002250	联化科技	12,600	69,426.00	0.13
333	300066	三川智慧	17,600	69,344.00	0.13
334	301225	恒勃股份	2,600	69,004.00	0.13
335	300825	阿尔特	6,100	68,930.00	0.13
336	601177	杭齿前进	8,300	68,724.00	0.13
337	301085	亚康股份	1,000	68,570.00	0.13
338	300592	华凯易佰	4,800	68,544.00	0.13
339	605066	天正电气	11,350	68,327.00	0.13
340	002955	鸿合科技	2,900	68,208.00	0.13
341	300400	劲拓股份	4,200	68,124.00	0.13
342	002358	森源电气	14,800	68,080.00	0.13
343	688233	神工半导	2,900	68,005.00	0.13

		体			
344	300120	经纬辉开	7,300	67,890.00	0.13
345	300571	平治信息	2,700	67,716.00	0.13
346	002035	华帝股份	9,200	67,528.00	0.13
347	600868	梅雁吉祥	27,165	67,369.20	0.13
348	300688	创业黑马	2,100	67,221.00	0.13
349	300766	每日互动	4,600	67,206.00	0.13
350	603855	华荣股份	3,300	66,957.00	0.13
351	688391	钜泉科技	2,205	66,921.75	0.13
352	000521	长虹美菱	8,200	66,912.00	0.13
353	300291	百纳千成	13,300	66,899.00	0.13
354	002627	三峡旅游	13,300	66,766.00	0.13
355	000926	福星股份	26,040	66,402.00	0.13
356	688510	航亚科技	3,800	66,196.00	0.13
357	605108	同庆楼	2,700	66,177.00	0.13
358	300377	赢时胜	2,400	66,144.00	0.12
359	000612	焦作万方	10,300	66,126.00	0.12
360	605016	百龙创园	3,910	66,079.00	0.12
361	300335	迪森股份	13,700	66,034.00	0.12
362	603629	利通电子	3,300	65,703.00	0.12
363	600658	电子城	15,000	65,700.00	0.12
364	688377	迪威尔高 端制造	3,400	65,552.00	0.12
365	000922	佳电股份	5,800	65,482.00	0.12
366	603758	秦安股份	7,900	65,254.00	0.12
367	300179	四方达	5,800	65,250.00	0.12
368	300946	恒而达	2,400	65,184.00	0.12
369	000404	长虹华意	8,800	65,120.00	0.12
370	002284	亚太股份	8,400	65,016.00	0.12
370	300424	航新科技	3,600	65,016.00	0.12
372	300514	友讯达	4,500	64,980.00	0.12
373	300342	天银机电	4,000	64,920.00	0.12
374	603538	美诺华	5,100	64,821.00	0.12
375	301235	华康医疗	3,200	64,672.00	0.12
376	603322	超讯通信	1,700	64,600.00	0.12
377	688589	力合微电 子	2,359	64,565.83	0.12
378	300337	银邦股份	5,800	64,496.00	0.12
379	603610	麒盛科技	5,100	64,311.00	0.12
380	300228	富瑞特装	9,100	64,155.00	0.12
381	002137	实益达	7,100	63,829.00	0.12
382	000631	顺发恒业	21,700	63,798.00	0.12
383	300241	瑞丰光电	11,600	63,684.00	0.12

384	002369	卓翼科技	10,000	63,600.00	0.12
385	002707	众信旅游	8,600	63,554.00	0.12
386	002947	恒铭达	1,900	63,327.00	0.12
387	300908	仲景食品	2,060	63,324.40	0.12
388	000777	中核科技	3,500	63,245.00	0.12
389	002367	康力电梯	9,200	63,204.00	0.12
390	300095	华伍股份	9,300	63,147.00	0.12
391	002102	能特科技	24,100	63,142.00	0.12
392	300355	蒙草生态	12,300	63,099.00	0.12
393	002792	通宇通讯	4,240	63,091.20	0.12
394	300494	盛天网络	5,600	62,944.00	0.12
395	688135	利扬芯片	3,136	62,939.52	0.12
396	300138	晨光生物	7,200	62,784.00	0.12
397	002042	华孚时尚	13,900	62,550.00	0.12
398	600088	中视传媒	3,500	62,510.00	0.12
399	600222	太龙药业	12,200	62,098.00	0.12
400	600789	鲁抗医药	6,500	62,075.00	0.12
401	688133	泰坦股份	3,400	62,016.00	0.12
402	300389	艾比森	5,200	61,932.00	0.12
403	001201	东瑞股份	3,900	61,698.00	0.12
404	300976	达瑞电子	900	61,650.00	0.12
405	002338	奥普光电	1,630	61,483.60	0.12
406	300160	秀强股份	11,300	61,472.00	0.12
407	688305	科德数控	900	61,353.00	0.12
408	002765	蓝黛科技	7,100	61,060.00	0.12
409	300830	金现代	7,500	61,050.00	0.12
410	000949	新乡化纤	15,200	60,952.00	0.12
411	000779	甘咨询	7,400	60,902.00	0.12
412	603507	振江股份	2,530	60,821.20	0.11
413	603516	淳中科技	1,100	60,808.00	0.11
414	002084	海鸥住工	21,100	60,768.00	0.11
415	603208	江山欧派	3,300	60,720.00	0.11
416	688609	广东九联科技	5,701	60,430.60	0.11
417	600665	天地源	19,300	60,409.00	0.11
418	002401	中远海科	3,800	60,344.00	0.11
419	000509	华塑控股	18,100	60,273.00	0.11
420	000812	陕西金叶	13,100	60,260.00	0.11
421	688677	青岛海泰新光	1,600	60,256.00	0.11
422	300531	优博讯	4,300	59,985.00	0.11
423	002296	辉煌科技	6,100	59,841.00	0.11
424	300975	商络电子	5,300	59,625.00	0.11

425	688311	盟升电子	1,800	59,598.00	0.11
426	002263	大东南	24,000	59,520.00	0.11
427	300221	银禧科技	10,100	58,984.00	0.11
428	300938	信测标准	2,285	58,678.80	0.11
429	600979	广安爱众	12,700	58,674.00	0.11
430	603966	法兰泰克	7,600	58,672.00	0.11
431	000078	海王生物	23,000	58,650.00	0.11
432	300288	朗玛信息	4,000	58,480.00	0.11
433	002111	威海广泰	5,300	58,406.00	0.11
434	603203	快克智能	2,536	58,378.72	0.11
435	600617	国新能源	21,560	58,212.00	0.11
436	300032	金龙机电	12,900	58,179.00	0.11
437	603067	振华股份	4,600	58,098.00	0.11
438	688601	力芯微股份	1,400	58,002.00	0.11
439	002527	新时达	6,600	57,948.00	0.11
440	002908	德生科技	6,600	57,816.00	0.11
441	600571	信雅达	4,600	57,776.00	0.11
442	688246	嘉和美康科技	2,325	57,660.00	0.11
443	002136	安纳达	5,900	57,525.00	0.11
444	301149	隆华新材	5,800	57,362.00	0.11
445	300590	移为通信	3,700	57,202.00	0.11
446	002478	常宝股份	10,800	57,132.00	0.11
447	603319	湘油泵	2,900	57,130.00	0.11
448	002286	保龄宝	7,700	56,826.00	0.11
449	300441	鲍斯股份	6,500	56,680.00	0.11
450	300501	海顺新材	4,200	56,070.00	0.11
451	300057	万顺新材	11,600	55,912.00	0.11
452	002519	银河电子	9,400	55,836.00	0.11
453	000159	国际实业	9,300	55,800.00	0.11
454	688378	奥来德光电	2,440	55,656.40	0.11
455	000888	峨眉山 A	4,200	55,566.00	0.11
456	688239	贵州航宇科技	1,488	55,502.40	0.10
457	600127	金健米业	8,200	55,186.00	0.10
458	002632	道明光学	6,200	55,180.00	0.10
459	603686	福龙马	5,300	55,120.00	0.10
460	688621	阳光诺和	1,458	54,966.60	0.10
461	002577	雷柏科技	2,900	54,897.00	0.10
462	300909	汇创达	2,300	54,855.00	0.10
463	301319	唯特偶	1,880	54,820.80	0.10

464	600636	国新文化	5,900	54,752.00	0.10
465	002225	濮耐股份	11,000	54,670.00	0.10
466	002161	远望谷	9,800	54,586.00	0.10
467	300900	广联航空	2,480	54,560.00	0.10
468	002852	道道全	6,600	54,516.00	0.10
469	600054	黄山旅游	4,800	54,240.00	0.10
470	300192	科德教育	3,400	54,060.00	0.10
471	301011	华立科技	2,100	53,949.00	0.10
472	603611	诺力股份	3,000	53,850.00	0.10
473	605196	华通线缆	4,600	53,728.00	0.10
474	300310	宜通世纪	7,106	53,721.36	0.10
475	000819	岳阳兴长	3,200	53,536.00	0.10
476	003000	劲仔食品	3,900	53,430.00	0.10
477	600686	金龙汽车	3,800	53,428.00	0.10
478	002452	长高电新	7,200	53,424.00	0.10
479	300042	朗科科技	2,300	53,130.00	0.10
480	688138	清溢光电	2,300	52,670.00	0.10
481	301051	信濠光电	1,940	52,496.40	0.10
482	300293	蓝英装备	2,300	52,256.00	0.10
483	300709	精研科技	1,300	52,221.00	0.10
484	688003	天准科技	1,200	51,960.00	0.10
485	300617	安靠智电	1,800	51,858.00	0.10
486	002734	利民股份	6,500	51,805.00	0.10
487	300867	圣元环保	4,000	51,720.00	0.10
488	300740	水羊股份	3,900	51,558.00	0.10
489	000576	甘化科工	7,100	51,546.00	0.10
490	688182	灿勤科技	2,872	51,351.36	0.10
491	300350	华鹏飞	9,500	51,300.00	0.10
492	603078	江化微	3,056	51,157.44	0.10
493	000859	国风新材	10,100	51,106.00	0.10
494	002623	亚玛顿	3,311	51,088.73	0.10
495	300752	隆利科技	3,000	51,000.00	0.10
496	603887	城地香江	3,200	50,944.00	0.10
497	688028	沃尔德金刚石	2,300	50,899.00	0.10
498	300582	英飞特	3,600	50,688.00	0.10
499	000526	学大教育	1,200	50,472.00	0.10
500	603977	国泰集团	3,896	50,453.20	0.10
501	301282	金禄电子	2,400	50,280.00	0.10
502	600830	香溢融通	4,300	50,267.00	0.09
503	603111	康尼机电	8,300	50,049.00	0.09
504	300351	永贵电器	2,800	49,672.00	0.09
505	600785	新华百货	3,800	49,666.00	0.09

506	002897	意华股份	1,200	49,620.00	0.09
507	600854	春兰股份	10,800	49,464.00	0.09
508	688070	成都纵横	1,400	49,420.00	0.09
509	603618	杭电股份	9,100	49,413.00	0.09
510	300286	安科瑞	2,400	49,320.00	0.09
511	600738	丽尚国潮	9,900	49,203.00	0.09
512	300429	强力新材	4,100	49,159.00	0.09
513	301123	奕东电子	2,400	49,080.00	0.09
514	605208	永茂泰	6,360	49,035.60	0.09
515	600178	东安动力	4,200	48,888.00	0.09
516	688668	鼎通科技	1,040	48,734.40	0.09
517	300354	东华测试	1,400	48,706.00	0.09
518	603817	海峡环保	8,700	48,546.00	0.09
519	688071	华依科技集团	1,800	48,510.00	0.09
520	600592	龙溪股份	4,900	48,412.00	0.09
521	603617	君禾股份	6,600	48,378.00	0.09
522	300019	硅宝科技	3,300	48,312.00	0.09
523	603602	纵横通信	3,000	48,000.00	0.09
524	300680	隆盛科技	2,000	47,920.00	0.09
525	300806	斯迪克	3,700	47,915.00	0.09
526	002057	中钢天源	6,600	47,652.00	0.09
527	300842	帝科股份	1,160	47,583.20	0.09
528	603508	思维列控	2,000	47,560.00	0.09
529	603050	科林电气	2,300	47,472.00	0.09
530	300430	诚益通	3,100	47,430.00	0.09
531	002431	棕榈股份	22,600	47,234.00	0.09
532	300781	因赛集团	800	47,224.00	0.09
533	300586	美联新材	5,800	47,212.00	0.09
534	600215	派斯林	6,900	47,196.00	0.09
535	002009	天奇股份	3,100	47,182.00	0.09
536	300421	力星股份	4,200	46,998.00	0.09
537	300238	冠昊生物	3,900	46,956.00	0.09
538	000863	三湘印象	12,100	46,948.00	0.09
539	300401	花园生物	3,200	46,912.00	0.09
540	002843	泰嘉股份	2,200	46,904.00	0.09
541	600135	乐凯胶片	7,100	46,789.00	0.09
542	002196	方正电机	8,700	46,632.00	0.09
543	300480	光力科技	3,600	46,620.00	0.09
544	002029	七匹狼	7,100	46,434.00	0.09
545	603408	建霖家居	3,700	46,361.00	0.09
546	002922	伊戈尔	2,600	46,332.00	0.09
547	003019	宸展光电	1,810	46,299.80	0.09

548	000659	珠海中富	16,400	46,248.00	0.09
549	002819	东方中科	1,700	46,206.00	0.09
550	002055	得润电子	6,400	46,080.00	0.09
551	300081	恒信东方	6,400	45,952.00	0.09
552	002067	景兴纸业	11,600	45,936.00	0.09
553	300607	拓斯达	1,800	45,882.00	0.09
554	301030	仕净科技	1,900	45,866.00	0.09
555	600537	亿晶光电	14,900	45,743.00	0.09
556	002937	兴瑞科技	2,700	45,630.00	0.09
557	300507	苏奥传感	6,800	45,560.00	0.09
558	688356	键凯科技	800	45,552.00	0.09
559	002365	永安药业	5,700	45,543.00	0.09
560	603309	维力医疗	3,800	45,524.00	0.09
561	002322	理工能科	3,601	45,336.59	0.09
562	688687	北京凯因科技	2,100	45,318.00	0.09
563	688543	国科军工	900	45,108.00	0.09
564	002238	天威视讯	5,600	44,968.00	0.08
565	688489	三未信安	1,300	44,850.00	0.08
566	002638	勤上股份	19,900	44,775.00	0.08
567	603890	春秋电子	3,800	44,650.00	0.08
568	300608	思特奇	4,100	44,608.00	0.08
569	000530	冰山冷热	7,400	44,474.00	0.08
570	300444	双杰电气	6,400	44,352.00	0.08
571	300396	迪瑞医疗	2,700	44,118.00	0.08
572	000751	锌业股份	15,700	44,117.00	0.08
573	603165	荣晟环保	3,600	44,064.00	0.08
574	002297	博云新材	6,400	44,032.00	0.08
575	603232	格尔软件	3,400	43,792.00	0.08
576	300176	鸿特科技	6,300	43,596.00	0.08
577	000705	浙江震元	5,500	43,505.00	0.08
578	603011	合锻智能	6,300	43,155.00	0.08
579	000523	红棉股份	14,100	43,005.00	0.08
580	300933	中辰股份	5,100	42,636.00	0.08
581	002455	百川股份	5,700	42,579.00	0.08
582	300448	浩云科技	6,400	42,176.00	0.08
583	300632	光莆股份	3,800	42,142.00	0.08
584	600203	福日电子	4,700	42,112.00	0.08
585	301278	快可电子	1,200	41,940.00	0.08
586	301096	百诚医药	1,100	41,734.00	0.08
587	301368	丰立智能	900	41,535.00	0.08
588	002404	嘉欣丝绸	6,700	41,473.00	0.08
589	300698	万马科技	1,200	41,352.00	0.08

590	002026	山东威达	4,200	41,328.00	0.08
591	002379	宏创控股	4,600	41,262.00	0.08
592	300708	聚灿光电	3,300	41,217.00	0.08
593	002593	日上集团	8,100	41,067.00	0.08
594	002766	索菱股份	7,100	40,825.00	0.08
595	002160	常铝股份	10,900	40,548.00	0.08
596	300653	正海生物	1,900	40,470.00	0.08
597	688319	欧林生物	3,800	40,280.00	0.08
598	300795	米奥会展	2,000	40,020.00	0.08
598	600851	海欣股份	6,900	40,020.00	0.08
600	002492	恒基达鑫	8,300	39,923.00	0.08
601	601388	怡球资源	16,200	39,852.00	0.08
602	300056	中创环保	3,000	39,840.00	0.08
602	300622	博士眼镜	800	39,840.00	0.08
604	300252	金信诺	3,700	39,812.00	0.08
605	300572	安车检测	2,200	39,754.00	0.08
606	600230	沧州大化	3,700	39,664.00	0.07
607	688022	瀚川智能	3,603	39,488.88	0.07
608	301020	密封科技	2,100	39,375.00	0.07
609	300513	恒实科技	4,300	39,259.00	0.07
610	600628	新世界	4,800	39,216.00	0.07
611	002206	海利得	9,100	39,039.00	0.07
612	300575	中旗股份	6,400	38,848.00	0.07
613	002166	莱茵生物	5,200	38,844.00	0.07
614	000419	通程控股	6,800	38,828.00	0.07
615	600833	第一医药	2,875	38,812.50	0.07
616	688508	芯朋微电子	900	38,673.00	0.07
617	000957	中通客车	3,500	38,500.00	0.07
618	301386	未来电器	1,800	37,962.00	0.07
619	603960	克来机电	1,900	37,810.00	0.07
620	605398	新炬网络	1,740	37,792.80	0.07
621	002392	北京利尔	8,000	37,760.00	0.07
622	603878	武进不锈	6,600	37,752.00	0.07
623	300469	信息发展	1,600	37,600.00	0.07
624	301168	通灵股份	1,400	37,562.00	0.07
625	300903	科翔股份	4,700	37,553.00	0.07
626	688191	智洋创新科技	2,200	37,444.00	0.07
627	002264	新华都	6,000	37,080.00	0.07
628	688410	山外山血液净化	3,300	36,828.00	0.07
629	300512	中亚股份	5,400	36,774.00	0.07

630	002708	光洋股份	3,300	36,762.00	0.07
631	600540	新赛股份	9,300	36,642.00	0.07
632	000906	浙商中拓	5,500	36,300.00	0.07
633	600212	绿能慧充	4,800	36,288.00	0.07
634	000973	佛塑科技	6,100	36,234.00	0.07
635	002785	万里石	1,100	36,025.00	0.07
636	600630	龙头股份	3,800	36,024.00	0.07
637	300111	向日葵	11,100	35,964.00	0.07
638	600187	国中水务	10,700	35,952.00	0.07
639	002933	新兴装备	1,200	35,796.00	0.07
640	003015	日久光电	2,500	35,775.00	0.07
641	600824	益民集团	8,000	35,760.00	0.07
642	000548	湖南投资	6,900	35,535.00	0.07
643	300963	中洲特材	4,040	35,430.80	0.07
644	301195	北路智控	1,100	35,321.00	0.07
645	301199	迈赫股份	1,200	35,196.00	0.07
646	301528	多浦乐	900	35,100.00	0.07
647	301112	信邦智能	1,500	35,055.00	0.07
648	300542	新晨科技	1,700	34,918.00	0.07
649	603667	五洲新春	1,400	34,650.00	0.07
650	300650	太龙股份	3,000	34,500.00	0.07
651	000593	德龙汇能	6,300	34,335.00	0.06
652	002757	南兴股份	2,200	34,166.00	0.06
653	003037	三和管桩	4,600	33,902.00	0.06
654	603663	三祥新材	2,100	33,495.00	0.06
655	600620	天宸股份	5,800	33,176.00	0.06
656	603630	拉芳家化	2,400	33,072.00	0.06
657	002521	齐峰新材	3,300	33,066.00	0.06
658	603138	海量数据	2,300	33,051.00	0.06
659	300553	集智股份	1,200	33,000.00	0.06
660	300230	永利股份	7,400	32,930.00	0.06
661	300636	同和药业	4,100	32,677.00	0.06
662	600501	航天晨光	1,800	32,652.00	0.06
663	600292	远达环保	2,500	32,475.00	0.06
664	300218	安利股份	2,100	32,340.00	0.06
664	300667	必创科技	2,000	32,340.00	0.06
666	300200	高盟新材	3,900	32,292.00	0.06
666	300381	溢多利	4,600	32,292.00	0.06
668	300719	安达维尔	1,800	32,238.00	0.06
669	002575	群兴玩具	3,900	32,136.00	0.06
670	300139	晓程科技	2,200	32,098.00	0.06
671	300520	科大国创	1,400	32,032.00	0.06
672	002869	金溢科技	1,200	31,920.00	0.06

673	001316	润贝航科	1,100	31,900.00	0.06
674	000652	泰达股份	7,700	31,878.00	0.06
675	688165	埃夫特智能	1,200	31,680.00	0.06
676	300161	华中数控	1,200	31,608.00	0.06
677	002198	嘉应制药	4,300	31,476.00	0.06
678	300852	四会富仕	1,200	31,464.00	0.06
679	002786	银宝山新	3,400	31,450.00	0.06
680	300107	建新股份	3,300	31,152.00	0.06
681	002590	万安科技	2,500	30,550.00	0.06
681	301013	利和兴	2,600	30,550.00	0.06
683	603173	福斯达深冷	1,300	29,965.00	0.06
684	603601	再升科技	8,900	29,904.00	0.06
685	300071	福石控股	6,200	29,388.00	0.06
686	300484	蓝海华腾	1,400	28,924.00	0.05
687	600818	中路股份	2,500	28,900.00	0.05
688	002394	联发股份	3,800	28,576.00	0.05
689	300771	智莱科技	2,700	28,404.00	0.05
690	600336	澳柯玛	4,200	28,392.00	0.05
691	300102	乾照光电	2,700	27,972.00	0.05
692	601700	风范股份	6,200	27,900.00	0.05
693	000782	恒申新材	6,100	27,816.00	0.05
694	600053	九鼎投资	2,000	27,740.00	0.05
695	002224	三力士	6,400	27,648.00	0.05
696	603859	能科科技	904	27,029.60	0.05
697	002515	金字火腿	5,900	26,727.00	0.05
698	002666	德联集团	6,000	26,160.00	0.05
699	002877	智能自控	3,000	24,870.00	0.05
700	002829	星网宇达	1,300	24,648.00	0.05

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

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688076	诺泰生物	961,137.12	0.63

2	688378	奥来德光电	788,074.98	0.51
3	688049	炬芯科技	637,236.67	0.42
4	600133	东湖高新	628,342.00	0.41
5	688687	北京凯因科技	595,670.56	0.39
6	688697	纽威数控装备	554,868.40	0.36
7	688181	八亿时空液晶股份	543,895.90	0.35
8	600186	莲花控股	542,796.00	0.35
9	605266	健之佳	521,186.24	0.34
10	688233	神工半导体	492,002.53	0.32
11	600114	东睦股份	484,633.00	0.32
12	688087	英科再生	478,842.11	0.31
13	688121	卓然技术	470,485.68	0.31
14	600200	江苏吴中	468,678.00	0.31
15	600410	华胜天成	461,215.00	0.30
16	600351	亚宝药业	458,016.00	0.30
17	603283	赛腾股份	457,030.00	0.30
18	688135	利扬芯片	451,343.72	0.29
19	600105	永鼎股份	443,713.00	0.29
20	688377	迪威尔高端制造	437,464.79	0.29

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	688076	诺泰生物	1,191,722.94	0.78
2	600133	东湖高新	999,761.00	0.65
3	600186	莲花控股	871,949.00	0.57
4	688378	奥来德光电	850,050.88	0.55
5	603283	赛腾股份	732,715.00	0.48
6	600114	东睦股份	723,643.99	0.47
7	688049	炬芯科技	697,608.47	0.46
8	600410	华胜天成	682,192.00	0.45
9	603496	恒为科技	653,542.00	0.43
10	688062	迈威生物	645,402.66	0.42
11	688687	北京凯因科技	637,573.47	0.42

12	603220	中贝通信	613,892.00	0.40
13	600200	江苏吴中	603,546.00	0.39
14	603662	柯力传感	597,101.00	0.39
15	601020	华钰矿业	596,650.00	0.39
16	603859	能科科技	587,526.00	0.38
17	605266	健之佳	572,064.88	0.37
18	688087	英科再生	569,544.95	0.37
19	600790	轻纺城	561,683.00	0.37
20	688181	八亿时空液 晶股份	559,568.07	0.37

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	210,089,084.02
卖出股票收入（成交）总额	231,716,183.45

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,401.54
2	应收清算款	15,245.90
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	—
8	其他	—
9	合计	21,647.44

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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（%）
1,169	43,850.80	17,835,049.00	34.79	33,426,540.00	65.21

9.2 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	中信建投证券股份有限公司	7,304,810.00	14.25
2	国信证券股份有限公司	3,179,800.00	6.20
3	UBS AG	2,149,000.00	4.19
4	谢清桃	2,000,154.00	3.90
5	迟向荣	2,000,000.00	3.90
6	华泰证券股份有限公司	1,610,390.00	3.14
7	姜文哲	1,523,100.00	2.97
8	苏梅琼	1,131,500.00	2.21
9	徐嘉俊	1,108,300.00	2.16
10	国泰君安证券股份有限公司	1,062,186.00	2.07

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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

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

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 09 月 13 日） 基金份额总额	1,213,261,589.00
本报告期期初基金份额总额	149,261,589.00
本报告期基金总申购份额	286,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	384,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	51,261,589.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 09 月 13 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 45,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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没有受到监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	佣金	占当期佣金总量的比例(%)	
国投证券	3	304,087,620.75	68.83	159,035.11	86.78	
国信证券	2	45,230,316.50	10.24	7,956.58	4.34	
国泰君安	4	39,863,102.42	9.02	7,012.16	3.83	
招商证券	3	26,928,768.65	6.10	4,728.78	2.58	
申万宏源证券	2	15,330,539.66	3.47	2,696.83	1.47	
中信证券	4	10,140,411.49	2.30	1,783.62	0.97	
华泰证券	3	159,886.00	0.04	28.06	0.02	
中信建投证券	2	62,694.00	0.01	11.03	0.01	
广发证券	4	1,928.00	0.00	0.34	0.00	
德邦证券	2	—	—	—	—	
东北证券	2	—	—	—	—	
东方财富	2	—	—	—	—	
东方证券	3	—	—	—	—	
高盛中国	2	—	—	—	—	
国金证券	2	—	—	—	—	

海通 证券	4	-	-	-	-	
华安 证券	2	-	-	-	-	
开源 证券	2	-	-	-	-	
民生 证券	2	-	-	-	-	
平安 证券	2	-	-	-	-	
天风 证券	2	-	-	-	-	
银河 证券	2	-	-	-	-	
中金 财富	2	-	-	-	-	
中泰 证券	1	-	-	-	-	
中原 证券	2	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商 名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交 金额	占当期债 券成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期权 证成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例 (%)
国投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰 君安	-	-	-	-	-	-	-	-
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万 宏源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
德邦 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东北 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
东方 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
高盛 中国	-	-	-	-	-	-	-	-
国金 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中原 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

(1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

(2) 交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

(3) 投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

(6) 交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内退租1家证券公司的2个交易单元：申港证券（深交所单元，上交所单元）。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，《汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》公告首次披露的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，特此说明。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2024 年 01 月 02 日
2	汇添富基金管理股份有限公司关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 05 日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 17 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年第四季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 22 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基	2024 年 02 月 22 日

	金产品资料概要	金电子披露网站	
6	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金增加申购赎回代理券商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 04 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华金证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 08 日
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加申万宏源证券和申万宏源西部证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 15 日
9	汇添富基金管理股份有限公司关于调整旗下部分证券投资基金主流动性服务商为一般流动性服务商的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 25 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2023 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 03 月 29 日
11	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 16 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 22 日
14	关于汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 26 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加渤海证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 20 日
16	汇添富基金管理股份有限公司关于提高旗下部分深市 ETF 现金替代退补款交收效率的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 30 日
17	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 31 日

	(2024 年 5 月 31 日更新)	露网站	
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加财达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 03 日
19	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 07 日
20	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 13 日
21	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 25 日
22	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 19 日
23	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加信达证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 07 月 31 日
24	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 01 日
25	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加华鑫证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 07 日
26	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与中民财富基金销售(上海)有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 15 日
27	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 30 日
28	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加联储证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 02 日
29	关于汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基	2024 年 09 月 06 日

	购、赎回单位的公告	金电子披露网站	
30	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更新招募说明书（2024 年 9 月 9 日更新）	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 09 日
31	关于汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 19 日
32	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 20 日
33	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 09 月 20 日
34	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 25 日
35	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分深交所 ETF 变更场内简称的公告	上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 15 日
36	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与乾道基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 20 日
37	汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金更新基金产品资料概要(2024 年 11 月 22 日更新)	公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 22 日
38	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加大同证券为申购赎回代理券商的公告	中证报, 上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 25 日
39	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况

投资者	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	持有基	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额

类别	号	金份额比例达到或者超过20%的时间区间					占比(%)
机构	1	2024 年 11 月 21 日至 2024 年 11 月 21 日	10,251,653.00	262,361,969.00	265,308,812.00	7,304,810.00	14.25
	2	2024 年 10 月 24 日至 2024 年 10 月 27 日, 2024 年 10 月 29 日至 2024 年 10 月 30 日, 2024 年 11 月 7 日至 2024 年 11 月 11 日	3,424,547.00	217,594,094.00	221,018,591.00	50.00	0.00
产品特有风险							
1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。 2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。 3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或与其他基金合并。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 03 月 31 日