

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 年年度报告

2024 年 12 月 31 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：二〇二五年三月三十一日

§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 3 月 27 日（基金合同生效日）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
§ 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	7
2.5 其他相关资料	7
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§ 5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	17
§ 6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	18
6.3 其他信息	18
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	19
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	19
§ 7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	21
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	24
§ 8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	52
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	62

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	82
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	82
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	82
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	82
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	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	83
§ 9 基金份额持有人信息	84
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	84
9.2 期末上市基金前十名持有人	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
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的情况	85
§ 10 开放式基金份额变动	85
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
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	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	86
11.4 基金投资策略的改变	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	86
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	86
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	87
12 影响投资者决策的其他重要信息	90
§ 13 备查文件目录	92
13.1 备查文件目录	92
13.2 存放地点	92
13.3 查阅方式	92

§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	10,326,751.00 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	本基金主要投资策略包括： （一）股票投资策略 （1）标的指数。 本基金股票资产跟踪的标的指数为中证 2000 指数。 （2）量化增强策略 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。 （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。
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	张姗
	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		路颖	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	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大 楼 8 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 3 月 27 日(基金合同生效日)至 2024 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-6,352,964.35
本期利润	-6,747,641.94
加权平均基金份额本期利润	-0.2132
本期加权平均净值利润率	-21.66%
本期基金份额净值增长率	18.89%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末
期末可供分配利润	1,950,525.72
期末可供分配基金份额利润	0.1889
期末基金资产净值	12,277,276.72
期末基金份额净值	1.1889
3.1.3 累计期末指标	2024 年末
基金份额累计净值增长率	18.89%

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
过去三个 月	9.40%	2.49%	8.40%	2.66%	1.00%	-0.17%
过去六个 月	29.27%	2.30%	27.56%	2.39%	1.71%	-0.09%
自基金合 同生效起 至今	18.89%	2.17%	10.32%	2.28%	8.57%	-0.11%

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的历史走势对比图
(2024 年 3 月 27 日至 2024 年 12 月 31 日)

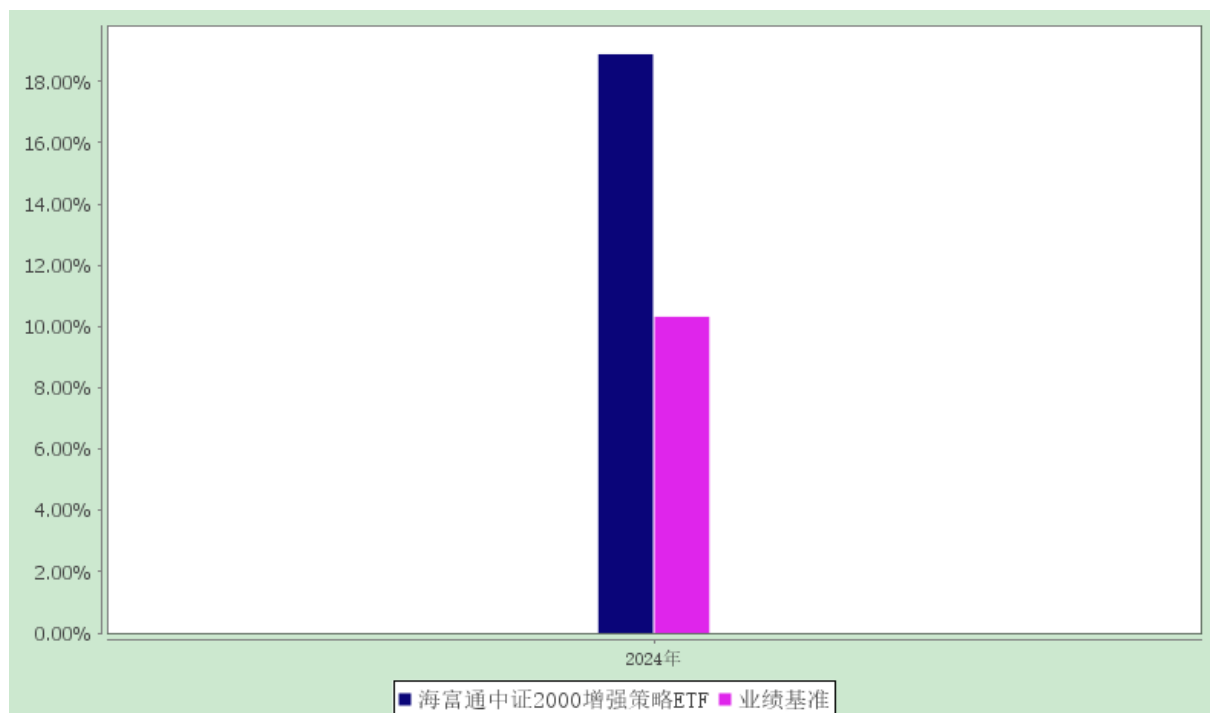


注：1、本基金合同于 2024 年 3 月 27 日生效，截至报告期末本基金合同生效未满一年。
2、按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

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

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：图中列示的 2024 年度基金净值增长率按该年度本基金实际存续期 3 月 27 日（基金合同生效日）起至 12 月 31 日止计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金自基金合同生效日（2024 年 3 月 27 日）至本报告期末未发生利润分配。

§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

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 12 月 31 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 A100 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、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金。

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、海富通量化选股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。	2024-03-2 7	-	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。2024 年 7 月起兼任海富通量化选股混合基金经理。
朱斌全	本基金的基金 经理	2024-03-2 7	-	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 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 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 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同向交易的样本，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。

4.3.3 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

国内经济方面，2024 年中国经济呈现“政策驱动”的弱复苏特征。一季度财政前置发力实现“开门红”，二、三季度经济和市场进入磨底周期，随着三季度末一系列超预期的政策转向，四季度经济增速有所好转。全年我国实际 GDP 同比实现 5% 增长，高于 2022-2023 年的复合增速 4.3%，全年物价保持相对平稳，居民消费价格指数同比上涨 0.2%。特别是随着一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强。

海外经济方面，随着通胀开始降温，美国在 2024 年 9 月开启降息周期，年内累计降幅 100 个基点。与此同时，美国维持了异常宽松的财政政策，赤字率超 6%，将美国债务水平推向了新的高度。但短期而言，积极的财政政策与宽松的货币政策共同作用，对美国股市起到了明显的支撑作用。后续随着新的总统任期开启，预计特朗普将积极调整现有政策导向，需重点关注相关政策带来的内外部影响。

从 A 股市场看，权益市场在 2024 年逐步震荡走高。指数方面，上证指数涨幅为 12.7%，沪深 300 为 14.7%，中证 800 为 12.2%，创业板指为 13.2%，中证 1000 为 1.2%。行业板块方面，根据中信一级行业分类，2024 年表现靠前的板块是银行、非银、家电、通信、交运，靠后的板块是医药、农林牧渔、消费者服务、房地产、食品饮料。总体而言，全年权益市场宽幅震荡，红利、成长、中小盘策略轮流表现占优，前期主要是偏防御的高股息红利相关行业表现强势，924 新政以后 TMT 相关科技板块表现更好。

投资策略方面，2024 年我们积极调整模型，特别是结合上半年市场的变化，逐步加入了行业和风格模型，以期从更多维度寻找投资机会。在风险控制方面，本基金通过风险模型限制行业和个股偏离，保持投资组合的风格暴露在合理范围之内，并根据指数增强产品特性，进一步增加了高阶风险暴露限制。同时，在组合构建时加入动态的风险控制调整，以提升组合收益稳健性。

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 18.89%，同期业绩比较基准收益率为 10.32%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从宏观经济来看，2025 年国内经济复苏的势头有望进一步增强。随着 2024 年三季度末一系列逆周期调节政策的推出，以及各部门积极和迅速的响应，官方对于扭转经济的决心和态度已经逐步明朗。在实体经济层面，四季度经济数据已经开始有所回暖，GDP 增速反弹至 5.4%，CPI 同比转正至 0.5%，贸易顺差创历史新高。多方面信息都反映出经济增速已经进入修复的过程中，这种趋势有望在 2025 年进一步加强。

海外经济方面，2025 年特朗普将开启第二任期，美国在各方面均将迎来较大幅度的政策转向，不管是在国际贸易、国内税收、还是政府开支等方面。这些政策调整的力度目前还较难估量，但可以预见的是对美国的通胀、政府支出、企业利润等都将有显著影响，这些调整对市场的潜在冲击是 2025 年的重要挑战。

年末之交，随着 DeepSeek 大模型、人形机器人和哪吒电影等现象级创新的涌现，全球投资者对中国科技和资产的关注度突飞猛进。结合我国在智能驾驶、半导体芯片等领域的不断突破，世界似乎正在重新评估中国经济的创新活力和增长潜力。这些变化充分体现了新质生产力对经济的促进能同时作用在实体和信心两个层面。对于股票市场而言，2025 年我们或也将迎来 A 股市场盈利和估值共同提升带来的戴维斯双击时刻。我们对 2025 年的市场充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

报告期内，坚持以法律法规和公司制度为依据，对公司和基金运作的各项业务开展提供全面的合规咨询、审核、监测与检查，确保基金运作的合法合规性。根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及公司管理需要，对公司内控制度体系进行了完善和全面梳理，新增和修订了多项内部制度和流程，提升了公司的合规管理水平。

二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审

视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

报告期内，结合反洗钱法规及公司业务特点完善了反洗钱制度，组织多场反洗钱培训和宣传活动；基于风险为本的工作思路，继续开展客户信息数据治理工作，稳步推进代销机构分类管理工作，持续优化监测模型，强化可疑交易监控，并按时向中国反洗钱监测分析中心报送相关数据。报告期内，公司根据监管要求完成了各项洗钱固有风险评估及洗钱风险控制措施有效性调查工作，有效管控公司洗钱固有风险敞口。另外，公司加大反洗钱课题研习工作力度，组织反洗钱专兼职人员深入开展相关课题研究和投稿，提升反洗钱工作质效。

四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

本报告期内，为提高公司全员的合规意识，加大了合规培训力度，强化主动合规意识培育。公司进一步加强组织各类合规培训频率，及时对法规、监管精神和公司要求进行宣导，并通过制作合规法务月刊、开展“合规文化宣传月”主题活动等多样化的合规宣传培训方式进一步提高法律法规宣导工作的及时性，丰富合规宣导工作的形式，激发全体员工学习合规内控政策的积极性，营造合规文化浓厚氛围。通过培训，增强了全体员工的合规意识和风险防范意识，提升了员工的主动识别和控制业务风险的积极性和能力。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金运作合法合规，维护和保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续加强内部控制和风险管理，进一步提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金财产安全、合规、诚信运作。

4.7 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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，在符合有关基金分红条件的前提下，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利润分配，但符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金自 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 7 月 12 日，连续四十七个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形；自 2024 年 7 月 16 日至 2024 年 12 月 31 日，连续超过六十个工作日出现基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人拟持续运作本基金，解决方案已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局进行了报告。

因前述迷你基金情形，经公司决策，自 2024 年 10 月 16 日起由基金管理人承担本基金项下相关固定费用。

§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

毕马威华振审字第 2501767 号

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“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编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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，我们独立于该基金，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。

6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金自 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间报告中涵盖的信息，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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 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编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 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)评价该基金管理人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)对该基金管理人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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(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。

我们与该基金管理人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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
王国蓓 何晨
北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日
资 产：		
货币资金	7.4.7.1	422,879.26
结算备付金		63,568.02
存出保证金		11,429.95
交易性金融资产	7.4.7.2	11,996,733.06
其中：股票投资		11,996,733.06
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	-
应收清算款		502,040.51
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	79,834.12
资产总计		13,076,484.92
负债和净资产	附注号	本期末 2024 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		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		3,463.32
应付托管费		692.67
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	7.4.7.6	795,052.21
负债合计		799,208.20
净资产:		
实收基金	7.4.7.7	10,326,751.00
未分配利润	7.4.7.8	1,950,525.72
净资产合计		12,277,276.72
负债和净资产总计		13,076,484.92

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.1889 元，基金份额总额 10,326,751.00 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。

7.2 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 12 月 31 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 12 月 31 日
一、营业总收入		-6,415,477.55
1.利息收入		123,897.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	123,897.04
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）		-5,974,362.22
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-6,125,322.50
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	7.4.7.12	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-16,977.83
股利收益	7.4.7.14	167,938.11
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-394,677.59
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-170,334.78
减：二、营业总支出		332,164.39
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	117,959.47
其中：暂估管理人报酬（若有）		-
2. 托管费	7.4.10.2. 2	23,591.91
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	7.4.7.17	190,193.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-6,747,641.94
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-6,747,641.94
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-6,747,641.94

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 12 月 31 日，上年度可比期间无比较数据。

7.3 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 12 月 31 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 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合 收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
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）	-202,000,000.00	-	1,950,525.72	-200,049,474.28
（一）、综合收益总额	-	-	-6,747,641.94	-6,747,641.94
（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）	-202,000,000.00	-	8,698,167.66	-193,301,832.34
其中：1. 基金申购款	86,000,000.00	-	-5,467,274.70	80,532,725.30
2. 基金赎回款	-288,000,000.00	-	14,165,442.36	-273,834,557.64
（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	10,326,751.00	-	1,950,525.72	12,277,276.7

资产				2
----	--	--	--	---

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 12 月 31 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 7.1 至 7.4，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

7.4 报表附注

7.4.1 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经中国证券监督管理委员会证监许可[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 3 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 号文审核同意，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 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，开放式基金在基金合同生效后，连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于 2024 年 12 月 31 日，本基金出现连续 60 个工作日基金资产净值低于 5,000 万元的情形，本基金的基金管理人已向中国证监会报告并提出解决方案，故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金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 7.4.2 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 12 月 31 日的财务状况、2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 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。

7.4.4.3 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。

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

(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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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。

7.4.4.9 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。

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。

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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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》(以下简称“基金合同”)的规定,基金收益分配采用现金方式;每一基金份额享有同等分配权;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,基金管理人按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。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;若基金合同生效不满 3 个月则可不进行收益分配;法律法规或监管机关另有规定的,从其规定。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

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

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 税项

根据财税[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 [2004] 78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、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》、财税 [2017] 2 号文《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》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)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，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

(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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税

率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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
活期存款	422,879.26
等于：本金	422,856.59
加：应计利息	22.67
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	422,879.26

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	12,391,410.65	-	11,996,733.06	-394,677.59

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		12,391,410.65	-	11,996,733.06	-394,677.59

注：股票投资包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末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

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。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应收利息	-
其他应收款	79,834.12
待摊费用	-
合计	79,834.12

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	9,594.16
其中：交易所市场	9,594.16
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	144,262.30
应退退补款	641,195.75
合计	795,052.21

7.4.7.7 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 12 月 31 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	86,000,000.00	86,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-288,000,000.00	-288,000,000.00
本期末	10,326,751.00	10,326,751.00

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。

7.4.7.8 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
本期利润	-6,352,964.35	-394,677.59	-6,747,641.94
本期基金份额交易产生的变动数	9,398,069.48	-699,901.82	8,698,167.66
其中：基金申购款	-2,185,064.66	-3,282,210.04	-5,467,274.70
基金赎回款	11,583,134.14	2,582,308.22	14,165,442.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,045,105.13	-1,094,579.41	1,950,525.72

7.4.7.9 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 12 月 31 日
活期存款利息收入	12,218.72
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	111,206.38
其他	471.94
合计	123,897.04

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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 12 月 31 日
----	---

股票投资收益——买卖股票差价收入	-1,146,235.15
股票投资收益——赎回差价收入	-4,979,087.35
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	-6,125,322.50

7.4.7.10.2 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 12 月 31 日
卖出股票成交总额	220,363,324.67
减：卖出股票成本总额	220,996,895.57
减：交易费用	512,664.25
买卖股票差价收入	-1,146,235.15

7.4.7.10.3 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 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	273,834,557.64
减：现金支付赎回款总额	95,193,245.64
减：赎回股票成本总额	183,620,399.35
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,979,087.35

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

7.4.7.13 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12月31日
股指期货投资收益（税前）	-13,280.00
减：股指期货差价收入应缴	3,498.64

纳增值税额	
减：交易费用	199.19
合计	-16,977.83

7.4.7.14 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12月31日
股票投资产生的股利收益	167,938.11
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	167,938.11

7.4.7.15 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12月31日
1.交易性金融资产	-394,677.59
——股票投资	-394,677.59
——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	-
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	-394,677.59

7.4.7.16 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12月31日
基金赎回费收入	-
替代损益	-170,807.01
其他收入	472.23
合计	-170,334.78

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。

7.4.7.17 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12月31日
审计费用	16,249.71
信息披露费	72,499.42
证券出借违约金	-
IOPV 计算费	10,053.76
银行划款手续费	365.00
开户费	400.00
中登服务费	90,625.29
合计	190,193.18

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富

国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

7.4.9 关联方关系

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
法国巴黎资产管理 BE 控股公司（BNP Paribas Asset Management BE Holding）	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	588,551,037.88	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。

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期 佣金	占当期佣 金总量的 比例	期末应付佣金余 额	占期末应付 佣金总额的 比例
海通证券	364,724.64	100.00%	9,594.16	100.00%

注：1.上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金管理人提供的证券投资研究服务等。

2.根据《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，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。公司的该类佣金协议符合《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》。

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。

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 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	117,959.47
其中：应支付销售机构的客户维 护费	454.53
应支付基金管理人的净管理费	117,504.94

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 x0.50%/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。

7.4.10.2.2 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12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	23,591.91

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x0.10%/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。

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

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。

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

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。

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

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。

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

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。

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

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。

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3月27日（基金合同生效日）至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入

招商银行	422,879.26	12,218.72
------	------------	-----------

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

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

于 2024 年 12 月 31 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。

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 (单位：股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
000777	中核科技	2024-12-30	重大事项	18.07	2025-01-14	19.88	600	10,368.60	10,842.00	-

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

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。

7.4.12.3.2 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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款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 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可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 7.4.12 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。

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时间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公司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 7.4.12。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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

本基金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、买入返售金融资产及债券投资等。

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 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	422,879.26	-	-	-	422,879.26
结算备付金	63,568.02	-	-	-	63,568.02

存出保证金	11,429.95	-	-	-	11,429.95
交易性金融资产	-	-	-	11,996,733.06	11,996,733.06
应收清算款	-	-	-	502,040.51	502,040.51
其他资产	-	-	-	79,834.12	79,834.12
资产总计	497,877.23	-	-	12,578,607.69	13,076,484.92
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	3,463.32	3,463.32
应付托管费	-	-	-	692.67	692.67
其他负债	-	-	-	795,052.21	795,052.21
负债总计	-	-	-	799,208.20	799,208.20
利率敏感度缺口	497,877.23	-	-	11,779,399.49	12,277,276.72

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2024 年 12 月 31 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 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	11,996,733.06	97.71
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	-	-
其他	-	-
合计	11,996,733.06	97.71

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)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12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	751,113.06
	2.业绩比较基准下降 5%	-751,113.06

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。

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。

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
第一层次	11,985,891.06
第二层次	10,842.00
第三层次	-
合计	11,996,733.06

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。

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等，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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有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。

7.4.14.4 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。

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，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	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	11,996,733.06	91.74
	其中：股票	11,996,733.06	91.74
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	486,447.28	3.72
8	其他各项资产	593,304.58	4.54
9	合计	13,076,484.92	100.00

注：股票投资包含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	55,753.20	0.45
B	采矿业	93,036.00	0.76
C	制造业	8,576,202.06	69.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	440,412.80	3.59
E	建筑业	96,271.00	0.78
F	批发和零售业	293,664.00	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	390,609.00	3.18
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	689,039.00	5.61
J	金融业	38,799.00	0.32
K	房地产业	364,988.00	2.97
L	租赁和商务服务业	2,217.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	277,566.00	2.26
N	水利、环境和公共设施管理业	123,228.00	1.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,504.00	0.31
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	71,182.00	0.58
S	综合	-	-
	合计	11,550,471.06	94.08

8.2.2 积极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	-	-
B	采矿业	21,538.00	0.18
C	制造业	188,743.00	1.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	21,700.00	0.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	20,496.00	0.17
J	金融业	125,687.00	1.02
K	房地产业	51,131.00	0.42
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	17,115.00	0.14
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	446,410.00	3.64

8.2.3 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	300337	银邦股份	7,300	81,176.00	0.66
2	002253	川大智胜	4,000	55,280.00	0.45
3	688302	海创药业	1,500	46,065.00	0.38
4	688550	瑞联新材	1,400	43,806.00	0.36
5	688419	耐科装备	1,400	43,512.00	0.35
6	688685	迈信林	1,300	43,147.00	0.35
7	002970	锐明技术	900	42,867.00	0.35
8	603416	信捷电气	1,000	41,950.00	0.34
9	001331	胜通能源	3,780	41,617.80	0.34
10	688117	圣诺生物	1,600	41,072.00	0.33
11	688687	凯因科技	1,894	40,872.52	0.33
12	300690	双一科技	1,800	40,698.00	0.33
13	603855	华荣股份	2,000	40,580.00	0.33
14	688680	海优新材	1,200	40,536.00	0.33
15	001205	盛航股份	2,100	40,509.00	0.33
16	688519	南亚新材	1,900	40,394.00	0.33
17	300307	慈星股份	4,900	40,376.00	0.33
18	300684	中石科技	1,800	40,374.00	0.33
19	603035	常熟汽饰	2,800	40,292.00	0.33
20	688233	神工股份	1,700	39,865.00	0.32
21	300174	元力股份	2,700	39,744.00	0.32
22	301112	信邦智能	1,700	39,729.00	0.32
23	002662	京威股份	10,200	39,474.00	0.32
24	300566	激智科技	2,000	39,440.00	0.32
25	603018	华设集团	4,800	39,408.00	0.32
26	300500	启迪设计	3,700	39,257.00	0.32
27	002483	润邦股份	7,500	39,075.00	0.32

28	603010	万盛股份	3,800	39,026.00	0.32
29	688138	清溢光电	1,700	38,930.00	0.32
30	002961	瑞达期货	2,700	38,799.00	0.32
31	603158	腾龙股份	4,800	38,784.00	0.32
32	300943	春晖智控	3,000	38,670.00	0.31
33	601518	吉林高速	13,900	38,642.00	0.31
34	603006	联明股份	3,700	38,591.00	0.31
35	001299	美能能源	3,100	38,564.00	0.31
36	603367	辰欣药业	2,800	38,472.00	0.31
37	603507	振江股份	1,600	38,464.00	0.31
38	301379	天山电子	1,900	38,380.00	0.31
39	300483	首华燃气	3,900	38,376.00	0.31
40	002533	金杯电工	3,900	38,376.00	0.31
41	000888	峨眉山 A	2,900	38,367.00	0.31
42	002255	海陆重工	6,900	38,364.00	0.31
43	002296	辉煌科技	3,900	38,259.00	0.31
44	603967	中创物流	3,900	38,259.00	0.31
45	600284	浦东建设	6,100	38,247.00	0.31
46	300987	川网传媒	2,700	38,232.00	0.31
47	600713	南京医药	7,700	38,192.00	0.31
48	600665	天地源	12,200	38,186.00	0.31
49	300790	宇瞳光学	2,000	38,180.00	0.31
50	002615	哈尔斯	4,800	38,160.00	0.31
51	002083	孚日股份	7,800	38,142.00	0.31
52	300335	迪森股份	7,900	38,078.00	0.31
53	002982	湘佳股份	2,132	38,056.20	0.31
54	603508	思维列控	1,600	38,048.00	0.31
55	603167	渤海轮渡	4,300	38,012.00	0.31
56	300194	福安药业	8,500	37,910.00	0.31
57	603067	振华股份	3,000	37,890.00	0.31
58	002873	新天药业	4,000	37,880.00	0.31
59	300771	智莱科技	3,600	37,872.00	0.31
60	002452	长高电新	5,100	37,842.00	0.31
61	002787	华源控股	4,800	37,824.00	0.31
62	002438	江苏神通	3,100	37,820.00	0.31
63	300248	新开普	3,900	37,791.00	0.31
64	000589	贵州轮胎	7,500	37,725.00	0.31
65	600035	楚天高速	8,200	37,720.00	0.31
66	301282	金禄电子	1,800	37,710.00	0.31
67	688015	交控科技	1,900	37,677.00	0.31
68	002627	三峡旅游	7,500	37,650.00	0.31
69	300057	万顺新材	7,800	37,596.00	0.31
70	600854	春兰股份	8,200	37,556.00	0.31
71	600661	昂立教育	3,200	37,504.00	0.31

72	301280	珠城科技	900	37,503.00	0.31
73	002420	毅昌科技	7,100	37,488.00	0.31
74	000900	现代投资	8,500	37,485.00	0.31
75	002972	科安达	3,600	37,440.00	0.30
76	603706	东方环宇	2,000	37,420.00	0.30
77	605118	力鼎光电	2,100	37,401.00	0.30
78	300900	广联航空	1,700	37,400.00	0.30
79	002026	山东威达	3,800	37,392.00	0.30
80	603111	康尼机电	6,200	37,386.00	0.30
81	300501	海顺新材	2,800	37,380.00	0.30
82	300228	富瑞特装	5,300	37,365.00	0.30
83	002166	莱茵生物	5,000	37,350.00	0.30
84	300733	西菱动力	3,200	37,344.00	0.30
85	300193	佳士科技	4,200	37,338.00	0.30
86	600237	铜峰电子	5,700	37,335.00	0.30
87	300093	金刚光伏	2,700	37,287.00	0.30
88	002358	森源电气	8,100	37,260.00	0.30
89	000612	焦作万方	5,800	37,236.00	0.30
90	002682	龙洲股份	8,800	37,224.00	0.30
91	600742	一汽富维	4,200	37,170.00	0.30
92	002284	亚太股份	4,800	37,152.00	0.30
93	600758	辽宁能源	10,800	37,152.00	0.30
94	002565	顺灏股份	12,200	37,088.00	0.30
95	600846	同济科技	4,300	37,066.00	0.30
96	600727	鲁北化工	5,000	37,050.00	0.30
97	603058	永吉股份	4,200	37,044.00	0.30
98	000404	长虹华意	5,000	37,000.00	0.30
99	002380	科远智慧	2,000	36,960.00	0.30
100	002102	能特科技	14,100	36,942.00	0.30
101	002655	共达电声	2,900	36,917.00	0.30
102	002286	保龄宝	5,000	36,900.00	0.30
103	300360	炬华科技	2,200	36,894.00	0.30
104	002084	海鸥住工	12,800	36,864.00	0.30
105	603600	永艺股份	3,100	36,859.00	0.30
106	603538	美诺华	2,900	36,859.00	0.30
107	300447	全信股份	2,600	36,842.00	0.30
108	600638	新黄浦	7,200	36,720.00	0.30
109	002035	华帝股份	5,000	36,700.00	0.30
110	002947	恒铭达	1,100	36,663.00	0.30
111	002590	万安科技	3,000	36,660.00	0.30
112	603339	四方科技	2,900	36,656.00	0.30
113	601388	怡球资源	14,900	36,654.00	0.30
114	002731	萃华珠宝	3,900	36,621.00	0.30
115	002248	华东数控	4,700	36,613.00	0.30

116	600592	龙溪股份	3,700	36,556.00	0.30
117	600351	亚宝药业	6,000	36,540.00	0.30
118	300320	海达股份	3,800	36,480.00	0.30
119	002206	海利得	8,500	36,465.00	0.30
120	002900	哈三联	3,700	36,445.00	0.30
121	000652	泰达股份	8,800	36,432.00	0.30
122	300184	力源信息	3,900	36,387.00	0.30
123	002111	威海广泰	3,300	36,366.00	0.30
124	301279	金道科技	1,800	36,342.00	0.30
125	000036	华联控股	8,900	36,312.00	0.30
126	300121	阳谷华泰	3,000	36,270.00	0.30
127	600622	光大嘉宝	11,200	36,176.00	0.29
128	002735	王子新材	3,900	36,114.00	0.29
129	002057	中钢天源	5,000	36,100.00	0.29
130	600101	明星电力	4,100	36,080.00	0.29
131	300988	津荣天宇	2,000	36,080.00	0.29
132	603809	豪能股份	3,100	36,053.00	0.29
133	600310	广西能源	7,900	36,024.00	0.29
134	002106	莱宝高科	3,300	36,003.00	0.29
135	301072	中捷精工	1,900	35,986.00	0.29
136	300758	七彩化学	3,000	35,940.00	0.29
137	300978	东箭科技	3,300	35,937.00	0.29
138	688252	天德钰	1,500	35,925.00	0.29
139	300964	本川智能	1,000	35,900.00	0.29
140	002536	飞龙股份	3,100	35,898.00	0.29
141	000551	创元科技	3,000	35,880.00	0.29
142	000700	模塑科技	5,100	35,802.00	0.29
143	300381	溢多利	5,100	35,802.00	0.29
144	600523	贵航股份	3,000	35,760.00	0.29
145	300756	金马游乐	2,400	35,736.00	0.29
146	600391	航发科技	1,800	35,730.00	0.29
147	300752	隆利科技	2,100	35,700.00	0.29
148	002132	恒星科技	13,000	35,620.00	0.29
149	000897	津滨发展	15,000	35,550.00	0.29
150	300439	美康生物	3,400	35,530.00	0.29
151	002073	软控股份	4,300	35,518.00	0.29
152	300507	苏奥传感	5,300	35,510.00	0.29
153	002725	跃岭股份	3,300	35,409.00	0.29
154	603936	博敏电子	4,200	35,364.00	0.29
155	600784	鲁银投资	6,000	35,340.00	0.29
156	300721	怡达股份	2,900	35,322.00	0.29
157	605162	新中港	5,200	35,308.00	0.29
158	600551	时代出版	4,100	35,301.00	0.29
159	003025	思进智能	2,500	35,225.00	0.29

160	000948	南天信息	2,100	35,133.00	0.29
161	002367	康力电梯	5,100	35,037.00	0.29
162	300341	麦克奥迪	2,000	35,020.00	0.29
163	003020	立方制药	1,934	34,889.36	0.28
164	002845	同兴达	2,300	34,868.00	0.28
165	000042	中洲控股	7,800	34,866.00	0.28
166	688518	联赢激光	2,200	34,848.00	0.28
167	600744	华银电力	11,200	34,832.00	0.28
168	300200	高盟新材	4,200	34,776.00	0.28
169	300429	强力新材	2,900	34,771.00	0.28
170	600496	精工钢构	11,500	34,730.00	0.28
171	000726	鲁泰 A	5,300	34,556.00	0.28
172	300545	联得装备	1,100	34,463.00	0.28
173	603738	泰晶科技	2,300	34,454.00	0.28
174	300304	云意电气	4,300	34,400.00	0.28
175	603998	方盛制药	3,300	34,386.00	0.28
176	301338	凯格精机	1,100	34,320.00	0.28
177	300424	航新科技	1,900	34,314.00	0.28
178	300032	金龙机电	7,600	34,276.00	0.28
179	002218	拓日新能	8,600	34,142.00	0.28
180	605305	中际联合	1,200	33,996.00	0.28
181	300950	德固特	2,100	33,915.00	0.28
182	688299	长阳科技	2,300	33,810.00	0.28
183	300645	正元智慧	2,300	33,787.00	0.28
184	300401	花园生物	2,300	33,718.00	0.27
185	000548	湖南投资	6,500	33,475.00	0.27
186	603261	立航科技	1,200	33,360.00	0.27
187	300650	太龙股份	2,900	33,350.00	0.27
188	000601	韶能股份	8,200	33,292.00	0.27
189	300215	电科院	5,600	33,208.00	0.27
190	300922	天秦装备	2,300	33,005.00	0.27
191	301132	满坤科技	1,200	33,000.00	0.27
192	301281	科源制药	1,100	32,901.00	0.27
193	002782	可立克	2,600	32,890.00	0.27
194	300928	华安鑫创	1,000	32,890.00	0.27
195	300542	新晨科技	1,600	32,864.00	0.27
196	600488	津药药业	7,700	32,648.00	0.27
197	300862	蓝盾光电	1,200	32,604.00	0.27
198	301307	美利信	1,600	32,528.00	0.26
199	301533	威马农机	1,100	32,450.00	0.26
200	600268	国电南自	4,800	32,256.00	0.26
201	301319	唯特偶	1,100	32,076.00	0.26
202	002869	金溢科技	1,200	31,920.00	0.26
203	300801	泰和科技	2,000	31,740.00	0.26

204	301030	仕净科技	1,300	31,382.00	0.26
205	688168	安博通	800	31,280.00	0.25
206	300680	隆盛科技	1,300	31,148.00	0.25
207	002406	远东传动	4,800	30,960.00	0.25
208	301086	鸿富瀚	600	30,522.00	0.25
209	301135	瑞德智能	1,300	30,264.00	0.25
210	688508	芯朋微	700	30,079.00	0.24
211	688543	国科军工	600	30,072.00	0.24
212	688239	航宇科技	800	29,840.00	0.24
213	002957	科瑞技术	1,900	29,811.00	0.24
214	688325	赛微微电	600	29,760.00	0.24
215	300508	维宏股份	1,100	29,755.00	0.24
216	300048	合康新能	5,900	29,736.00	0.24
217	300722	新余国科	1,100	29,722.00	0.24
218	300815	玉禾田	1,900	29,621.00	0.24
219	002412	汉森制药	4,900	29,449.00	0.24
220	002119	康强电子	1,900	29,412.00	0.24
221	688133	泰坦科技	1,600	29,184.00	0.24
222	603788	宁波高发	2,100	29,043.00	0.24
223	002146	荣盛发展	17,600	29,040.00	0.24
224	600173	卧龙地产	7,300	28,908.00	0.24
225	002282	博深股份	3,900	28,899.00	0.24
226	002250	联化科技	5,200	28,652.00	0.23
227	000507	珠海港	5,600	28,560.00	0.23
228	688025	杰普特	600	28,500.00	0.23
229	603977	国泰集团	2,200	28,490.00	0.23
230	603052	可川科技	800	28,488.00	0.23
231	002479	富春环保	6,000	28,440.00	0.23
232	600218	全柴动力	3,600	28,440.00	0.23
233	600668	尖峰集团	2,800	28,420.00	0.23
234	688070	纵横股份	800	28,240.00	0.23
235	688212	澳华内镜	700	28,126.00	0.23
236	300230	永利股份	6,300	28,035.00	0.23
237	603987	康德莱	3,900	28,002.00	0.23
238	300636	同和药业	3,500	27,895.00	0.23
239	002997	瑞鹄模具	800	27,720.00	0.23
240	002688	金河生物	6,200	27,714.00	0.23
241	300565	科信技术	2,300	27,577.00	0.22
242	300698	万马科技	800	27,568.00	0.22
243	300515	三德科技	2,300	27,393.00	0.22
244	002454	松芝股份	4,100	27,265.00	0.22
245	001326	联域股份	800	27,024.00	0.22
246	301020	密封科技	1,400	26,250.00	0.21
247	688135	利扬芯片	1,300	26,091.00	0.21

248	688152	麒麟信安	500	26,020.00	0.21
249	301555	惠柏新材	1,100	25,817.00	0.21
250	605058	澳弘电子	1,300	25,779.00	0.21
251	003015	日久光电	1,800	25,758.00	0.21
252	603031	安孚科技	900	25,740.00	0.21
253	001229	魅视科技	700	25,011.00	0.20
254	301333	诺思格	500	24,995.00	0.20
255	603380	易德龙	1,000	24,990.00	0.20
256	688195	腾景科技	616	24,750.88	0.20
257	688089	嘉必优	1,300	24,739.00	0.20
258	002462	嘉事堂	1,900	24,548.00	0.20
259	300540	蜀道装备	1,000	24,520.00	0.20
260	688103	国力股份	600	24,402.00	0.20
261	600605	汇通能源	700	24,283.00	0.20
262	300791	仙乐健康	910	23,960.30	0.20
263	002448	中原内配	3,800	23,788.00	0.19
264	300852	四会富仕	900	23,598.00	0.19
265	002733	雄韬股份	1,700	23,528.00	0.19
266	301004	嘉益股份	200	23,130.00	0.19
267	002671	龙泉股份	5,100	23,103.00	0.19
268	002912	中新赛克	900	23,031.00	0.19
269	301170	锡南科技	1,000	22,920.00	0.19
270	600684	珠江股份	6,900	22,770.00	0.19
271	301139	元道通信	1,000	22,750.00	0.19
272	300293	蓝英装备	1,000	22,720.00	0.19
273	000823	超声电子	2,200	22,704.00	0.18
274	002338	奥普光电	600	22,632.00	0.18
275	605056	咸亨国际	1,800	22,482.00	0.18
276	300797	钢研纳克	1,900	22,439.00	0.18
277	300290	荣科科技	1,100	22,385.00	0.18
278	300577	开润股份	900	22,365.00	0.18
279	688319	欧林生物	2,100	22,260.00	0.18
280	000096	广聚能源	1,800	22,068.00	0.18
281	300812	易天股份	1,000	22,040.00	0.18
282	603095	越剑智能	1,000	22,010.00	0.18
283	600619	海立股份	1,800	21,960.00	0.18
284	002884	凌霄泵业	1,200	21,924.00	0.18
285	001216	华瓷股份	1,700	21,675.00	0.18
286	000407	胜利股份	6,300	21,546.00	0.18
287	300881	盛德鑫泰	700	21,518.00	0.18
288	603408	建霖家居	1,700	21,301.00	0.17
289	002298	中电兴发	4,000	21,280.00	0.17
290	600106	重庆路桥	3,800	21,242.00	0.17
291	002968	新大正	2,300	21,183.00	0.17

292	300135	宝利国际	5,300	20,988.00	0.17
293	600525	长园集团	4,300	20,984.00	0.17
294	002116	中国海诚	2,100	20,958.00	0.17
295	600353	旭光电子	2,900	20,938.00	0.17
296	300531	优博讯	1,500	20,925.00	0.17
297	601188	龙江交通	5,800	20,880.00	0.17
298	603165	荣晟环保	1,700	20,808.00	0.17
299	600367	红星发展	1,800	20,772.00	0.17
300	002401	中远海科	1,300	20,644.00	0.17
301	688310	迈得医疗	1,900	20,520.00	0.17
302	002543	万和电气	2,000	20,480.00	0.17
303	003019	宸展光电	800	20,464.00	0.17
304	603823	百合花	2,200	20,460.00	0.17
305	300825	阿尔特	1,800	20,340.00	0.17
306	600746	江苏索普	2,900	20,329.00	0.17
307	000922	佳电股份	1,800	20,322.00	0.17
308	300241	瑞丰光电	3,700	20,313.00	0.17
309	600278	东方创业	2,900	20,271.00	0.17
310	300975	商络电子	1,800	20,250.00	0.16
311	002548	金新农	5,100	20,247.00	0.16
312	603208	江山欧派	1,100	20,240.00	0.16
313	600769	祥龙电业	2,100	20,181.00	0.16
314	300697	电工合金	1,600	20,176.00	0.16
315	301529	福赛科技	700	20,132.00	0.16
316	300111	向日葵	6,200	20,088.00	0.16
317	603227	雪峰科技	2,300	19,987.00	0.16
318	002574	明牌珠宝	4,300	19,823.00	0.16
319	300099	尤洛卡	3,300	19,800.00	0.16
320	300523	辰安科技	1,000	19,790.00	0.16
321	300533	冰川网络	1,000	19,760.00	0.16
322	603611	诺力股份	1,100	19,745.00	0.16
323	300095	华伍股份	2,900	19,691.00	0.16
324	603999	读者传媒	3,200	19,680.00	0.16
325	000949	新乡化纤	4,900	19,649.00	0.16
326	600200	江苏吴中	2,100	19,572.00	0.16
327	300583	赛托生物	1,000	19,550.00	0.16
328	600439	瑞贝卡	5,800	19,546.00	0.16
329	000592	平潭发展	6,700	19,229.00	0.16
330	300653	正海生物	900	19,170.00	0.16
331	300275	梅安森	1,300	19,110.00	0.16
332	002167	东方锆业	2,600	19,084.00	0.16
333	603618	杭电股份	3,500	19,005.00	0.15
334	301258	富士莱	800	18,896.00	0.15
335	002955	鸿合科技	800	18,816.00	0.15

336	000521	长虹美菱	2,300	18,768.00	0.15
337	300873	海晨股份	1,100	18,601.00	0.15
338	000710	贝瑞基因	2,200	18,590.00	0.15
339	300259	新天科技	5,300	18,550.00	0.15
340	002556	辉隆股份	3,300	18,381.00	0.15
341	603106	恒银科技	2,300	18,101.00	0.15
342	301397	溯联股份	700	18,025.00	0.15
343	300292	吴通控股	3,700	17,945.00	0.15
344	300511	雪榕生物	5,100	17,697.00	0.14
345	002017	东信和平	1,700	17,629.00	0.14
346	300859	西域旅游	500	17,590.00	0.14
347	300288	朗玛信息	1,200	17,544.00	0.14
348	300139	晓程科技	1,200	17,508.00	0.14
349	000544	中原环保	2,000	17,460.00	0.14
350	301215	中汽股份	2,900	17,255.00	0.14
351	300127	银河磁体	700	17,206.00	0.14
352	601599	浙文影业	4,800	17,184.00	0.14
353	688010	福光股份	600	17,100.00	0.14
354	300322	硕贝德	1,300	17,043.00	0.14
355	301106	骏成科技	600	16,896.00	0.14
356	688376	美埃科技	500	16,695.00	0.14
357	300067	安诺其	2,700	16,659.00	0.14
358	301025	读客文化	1,700	16,201.00	0.13
359	603689	皖天然气	1,800	16,164.00	0.13
360	688510	航亚科技	900	15,678.00	0.13
361	002474	榕基软件	2,600	15,574.00	0.13
362	301083	百胜智能	1,100	15,477.00	0.13
363	688312	燕麦科技	500	15,400.00	0.13
364	603112	华翔股份	1,200	15,000.00	0.12
365	000510	新金路	4,100	14,760.00	0.12
366	300917	特发服务	300	14,514.00	0.12
367	688253	英诺特	400	14,504.00	0.12
368	300996	普联软件	800	14,496.00	0.12
369	600960	渤海汽车	4,300	14,319.00	0.12
370	688020	方邦股份	400	14,140.00	0.12
371	300120	经纬辉开	1,500	13,950.00	0.11
372	688662	富信科技	400	13,728.00	0.11
373	688456	有研粉材	400	13,296.00	0.11
374	688606	奥泰生物	200	12,660.00	0.10
375	301099	雅创电子	300	12,435.00	0.10
376	002897	意华股份	300	12,405.00	0.10
377	300842	帝科股份	300	12,306.00	0.10
378	603319	湘油泵	600	11,820.00	0.10
379	603009	北特科技	300	11,724.00	0.10

380	001283	豪鹏科技	200	11,578.00	0.09
381	000777	中核科技	600	10,842.00	0.09
382	603890	春秋电子	900	10,575.00	0.09
383	688080	映翰通	300	9,876.00	0.08
384	300590	移为通信	600	9,276.00	0.08
385	603617	君禾股份	1,200	8,796.00	0.07
386	605268	王力安防	1,000	8,400.00	0.07
387	300246	宝莱特	1,200	7,908.00	0.06
388	301021	英诺激光	300	7,767.00	0.06
389	601116	三江购物	600	6,528.00	0.05
390	600159	大龙地产	2,700	6,480.00	0.05
391	603258	电魂网络	300	5,967.00	0.05
392	301120	新特电气	600	5,946.00	0.05
393	300572	安车检测	300	5,421.00	0.04
394	603105	芯能科技	600	5,406.00	0.04
395	300541	先进数通	300	4,065.00	0.03
396	603386	骏亚科技	300	3,336.00	0.03
397	601113	华鼎股份	600	2,340.00	0.02
398	002707	众信旅游	300	2,217.00	0.02
399	600189	泉阳泉	300	2,163.00	0.02
400	000936	华西股份	200	1,634.00	0.01
401	000523	红棉股份	300	915.00	0.01

注：1、根据安徽中电鑫龙科技股份有限公司于 2025 年 2 月 28 日发布的《关于公司变更名称、证券简称并取得营业执照的公告》，自 2025 年 3 月 3 日起，公司的证券简称由“中电兴发”变更为“中电鑫龙”，证券代码“002298”保持不变。

2、根据湖南美湖智造股份有限公司于 2025 年 3 月 17 日发布的《公司证券简称变更实施公告》，自 2025 年 3 月 20 日起，公司的证券简称由“湘油泵”变更为“美湖股份”，证券代码“603319”保持不变。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
1	600246	万通发展	4,100	30,545.00	0.25
2	601919	中远海控	1,400	21,700.00	0.18
3	301209	联合化学	800	21,640.00	0.18
4	002128	电投能源	1,100	21,538.00	0.18
5	688090	瑞松科技	600	21,312.00	0.17
6	601009	南京银行	2,000	21,300.00	0.17
7	601998	中信银行	3,000	20,940.00	0.17
8	300497	富祥药业	2,500	20,850.00	0.17

9	301032	新柴股份	2,200	20,658.00	0.17
10	301503	智迪科技	600	20,592.00	0.17
11	600383	金地集团	4,700	20,586.00	0.17
12	300845	捷安高科	1,600	20,496.00	0.17
13	600926	杭州银行	1,400	20,454.00	0.17
14	002423	中粮资本	1,500	20,085.00	0.16
15	301079	邵阳液压	1,300	19,812.00	0.16
16	000617	中油资本	2,800	19,292.00	0.16
17	300746	汉嘉设计	1,500	17,115.00	0.14
18	603799	华友钴业	500	14,630.00	0.12
19	301359	东南电子	600	13,428.00	0.11
20	301448	开创电气	600	12,336.00	0.10
21	688175	高凌信息	700	12,061.00	0.10
22	601916	浙商银行	4,100	11,931.00	0.10
23	601169	北京银行	1,900	11,685.00	0.10
24	300243	瑞丰高材	1,200	11,424.00	0.09

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	688258	卓易信息	951,213.53	7.75
2	688035	德邦科技	856,157.08	6.97
3	600237	铜峰电子	833,569.00	6.79
4	300400	劲拓股份	784,649.00	6.39
5	600814	杭州解百	778,389.36	6.34
6	600020	中原高速	778,068.00	6.34
7	600769	祥龙电业	776,672.00	6.33
8	688049	炬芯科技	762,984.63	6.21
9	603949	雪龙集团	760,389.00	6.19
10	688550	瑞联新材	756,184.80	6.16
11	300181	佐力药业	744,223.00	6.06
12	601007	金陵饭店	741,469.00	6.04
13	603738	泰晶科技	740,986.00	6.04
14	600613	神奇制药	738,211.33	6.01
15	600525	长园集团	732,717.00	5.97
16	000521	长虹美菱	730,071.45	5.95
17	603110	东方材料	728,467.00	5.93
18	300360	炬华科技	724,081.00	5.90
19	603158	腾龙股份	716,270.00	5.83

20	603668	天马科技	713,372.00	5.81
21	688371	菲沃泰	712,276.53	5.80
22	603258	电魂网络	711,062.00	5.79
23	603999	读者传媒	709,452.00	5.78
24	688157	松井股份	703,939.91	5.73
25	603998	方盛制药	694,724.00	5.66
26	002543	万和电气	684,195.00	5.57
27	600035	楚天高速	683,679.00	5.57
28	688025	杰普特	681,834.77	5.55
29	000892	欢瑞世纪	681,607.00	5.55
30	002451	摩恩电气	679,442.00	5.53
31	603367	辰欣药业	679,295.00	5.53
32	688138	清溢光电	665,961.98	5.42
33	600789	鲁抗医药	664,522.00	5.41
34	603051	鹿山新材	663,694.00	5.41
35	603687	大胜达	663,217.00	5.40
36	605289	罗曼股份	661,948.00	5.39
37	600186	莲花控股	656,935.00	5.35
38	603569	长久物流	655,545.28	5.34
39	688601	力芯微	651,857.63	5.31
40	600738	丽尚国潮	651,151.00	5.30
41	600664	哈药股份	650,340.00	5.30
42	688247	宣泰医药	649,423.18	5.29
43	002666	德联集团	648,655.00	5.28
44	301191	菲菱科思	646,280.00	5.26
45	603662	柯力传感	642,770.00	5.24
46	603867	新化股份	640,537.00	5.22
47	603889	新澳股份	639,501.00	5.21
48	603206	嘉环科技	637,317.00	5.19
49	688313	仕佳光子	636,121.07	5.18
50	002115	三维通信	633,061.00	5.16
51	688292	浩瀚深度	631,848.20	5.15
52	605555	德昌股份	631,059.00	5.14
53	002679	福建金森	626,812.00	5.11
54	603078	江化微	624,556.30	5.09
55	000159	国际实业	624,094.00	5.08
56	000593	德龙汇能	622,704.00	5.07
57	688579	山大地纬	622,688.84	5.07
58	600829	人民同泰	621,844.00	5.06
59	600503	华丽家族	621,569.00	5.06
60	601339	百隆东方	621,032.00	5.06
61	002094	青岛金王	619,397.00	5.05
62	600576	祥源文旅	617,829.00	5.03
63	603630	拉芳家化	616,684.00	5.02

64	605128	上海沿浦	614,608.00	5.01
65	301215	中汽股份	612,030.00	4.99
66	600987	航民股份	607,760.00	4.95
67	300047	天源迪科	607,218.00	4.95
68	600468	百利电气	606,470.00	4.94
69	300100	双林股份	605,923.00	4.94
70	002723	小崧股份	603,373.00	4.91
71	600354	敦煌种业	601,666.00	4.90
72	600479	千金药业	600,309.00	4.89
73	301318	维海德	597,818.40	4.87
74	601566	九牧王	597,071.00	4.86
75	688595	芯海科技	595,173.17	4.85
76	603222	济民健康	594,052.00	4.84
77	300153	科泰电源	593,349.00	4.83
78	002510	天汽模	590,701.00	4.81
79	688566	吉贝尔	589,876.88	4.80
80	300048	合康新能	589,424.00	4.80
81	300545	联得装备	587,451.00	4.78
82	300650	太龙股份	586,941.00	4.78
83	300066	三川智慧	586,085.00	4.77
84	002577	雷柏科技	584,686.00	4.76
85	603125	常青科技	583,388.13	4.75
86	002947	恒铭达	577,717.00	4.71
87	301011	华立科技	575,054.00	4.68
88	300976	达瑞电子	574,821.00	4.68
89	600721	百花医药	574,555.00	4.68
90	000837	秦川机床	573,630.00	4.67
91	301338	凯格精机	573,232.00	4.67
92	002073	软控股份	571,961.00	4.66
93	301172	君逸数码	571,676.00	4.66
94	603890	春秋电子	571,116.00	4.65
95	300365	恒华科技	571,048.00	4.65
96	688252	天德钰	570,625.36	4.65
97	002845	同兴达	568,553.00	4.63
98	300571	平治信息	565,567.00	4.61
99	603538	美诺华	565,454.00	4.61
100	002137	实益达	565,435.00	4.61
101	301096	百诚医药	564,405.00	4.60
102	000510	新金路	564,162.00	4.60
103	603618	杭电股份	562,497.00	4.58
104	601188	龙江交通	561,375.00	4.57
105	002264	新华都	559,097.00	4.55
106	688259	创耀科技	557,715.21	4.54
107	000533	顺钠股份	557,462.00	4.54

108	001234	泰慕士	557,246.00	4.54
109	300531	优博讯	556,788.00	4.54
110	300828	锐新科技	555,741.00	4.53
111	300307	慈星股份	555,199.00	4.52
112	002149	西部材料	554,994.00	4.52
113	600713	南京医药	554,708.00	4.52
114	600133	东湖高新	553,168.00	4.51
115	603416	信捷电气	552,961.00	4.50
116	301330	熵基科技	552,957.00	4.50
117	300884	狄耐克	552,956.00	4.50
118	000045	深纺织 A	551,617.00	4.49
119	300543	朗科智能	550,309.00	4.48
120	000544	中原环保	549,255.50	4.47
121	600620	天宸股份	548,983.00	4.47
122	300279	和晶科技	548,335.00	4.47
123	002017	东信和平	547,775.00	4.46
124	603809	豪能股份	546,414.00	4.45
125	002020	京新药业	546,398.00	4.45
126	000421	南京公用	546,338.00	4.45
127	301312	智立方	546,197.00	4.45
128	300651	金陵体育	545,596.00	4.44
129	600180	瑞茂通	544,997.00	4.44
130	300580	贝斯特	544,304.00	4.43
131	000523	红棉股份	544,262.00	4.43
132	002616	长青集团	543,990.00	4.43
133	002588	史丹利	541,745.00	4.41
134	603283	赛腾股份	540,439.00	4.40
135	301018	申菱环境	539,750.00	4.40
136	002170	芭田股份	539,515.00	4.39
137	002039	黔源电力	539,008.80	4.39
138	002955	鸿合科技	538,528.00	4.39
139	002284	亚太股份	538,443.00	4.39
140	603386	骏亚科技	537,981.00	4.38
141	603617	君禾股份	537,584.00	4.38
142	300766	每日互动	537,331.00	4.38
143	605368	蓝天燃气	537,311.00	4.38
144	300660	江苏雷利	537,166.00	4.38
145	300341	麦克奥迪	536,257.00	4.37
146	002615	哈尔斯	535,889.00	4.36
147	688311	盟升电子	535,694.55	4.36
148	300683	海特生物	534,988.00	4.36
149	002983	芯瑞达	534,975.00	4.36
150	603223	恒通股份	534,834.00	4.36
151	600488	津药药业	534,224.00	4.35

152	002519	银河电子	534,180.00	4.35
153	301076	新瀚新材	533,539.00	4.35
154	002787	华源控股	531,791.00	4.33
155	300941	创识科技	531,782.00	4.33
156	000863	三湘印象	531,204.00	4.33
157	301151	冠龙节能	530,984.00	4.32
158	300176	鸿特科技	530,858.00	4.32
159	002358	森源电气	530,470.00	4.32
160	301101	明月镜片	530,178.00	4.32
161	688658	悦康药业	529,996.29	4.32
162	000936	华西股份	529,670.00	4.31
163	300120	经纬辉开	529,413.00	4.31
164	300005	探路者	528,111.00	4.30
165	002686	亿利达	527,999.00	4.30
166	300793	佳禾智能	527,279.00	4.29
167	600523	贵航股份	526,556.60	4.29
168	002671	龙泉股份	525,712.00	4.28
169	002393	力生制药	525,606.00	4.28
170	300756	金马游乐	525,113.50	4.28
171	002045	国光电器	524,991.00	4.28
172	002164	宁波东力	524,284.00	4.27
173	002935	天奥电子	523,809.00	4.27
174	301387	光大同创	523,319.66	4.26
175	300951	博硕科技	523,154.00	4.26
176	300193	佳士科技	522,556.00	4.26
177	300403	汉宇集团	522,283.00	4.25
178	002912	中新赛克	521,210.00	4.25
179	601089	福元医药	521,050.00	4.24
180	300718	长盛轴承	520,851.00	4.24
181	301225	恒勃股份	520,195.00	4.24
182	002122	汇洲智能	518,654.00	4.22
183	000900	现代投资	518,626.00	4.22
184	300042	朗科科技	518,547.00	4.22
185	000755	山西高速	518,470.00	4.22
186	300314	戴维医疗	518,281.00	4.22
187	300721	怡达股份	518,211.00	4.22
188	600513	联环药业	518,084.00	4.22
189	300008	天海防务	517,798.00	4.22
190	300447	全信股份	517,566.00	4.22
191	600706	曲江文旅	517,513.00	4.22
192	000899	赣能股份	514,539.00	4.19
193	300412	迦南科技	514,321.50	4.19
194	603358	华达科技	514,042.00	4.19
195	600353	旭光电子	513,954.00	4.19

196	002035	华帝股份	513,810.00	4.19
197	002026	山东威达	512,651.00	4.18
198	002695	煌上煌	512,106.00	4.17
199	300465	高伟达	512,082.00	4.17
200	300384	三联虹普	511,484.00	4.17
201	601579	会稽山	511,484.00	4.17
202	300145	中金环境	511,464.00	4.17
203	002533	金杯电工	510,451.00	4.16
204	603912	佳力图	509,925.00	4.15
205	603698	航天工程	508,781.00	4.14
206	002112	三变科技	508,386.00	4.14
207	002682	龙洲股份	508,150.00	4.14
208	300259	新天科技	507,929.00	4.14
209	688319	欧林生物	507,838.77	4.14
210	601999	出版传媒	507,387.00	4.13
211	600351	亚宝药业	506,512.00	4.13
212	300468	四方精创	506,512.00	4.13
213	300922	天秦装备	505,072.51	4.11
214	000607	华媒控股	504,871.00	4.11
215	002623	亚玛顿	504,446.00	4.11
216	603333	尚纬股份	504,248.00	4.11
217	002231	奥维通信	504,038.00	4.11
218	000793	华闻集团	503,702.00	4.10
219	301229	纽泰格	503,402.00	4.10
220	000757	浩物股份	503,161.00	4.10
221	002342	巨力索具	502,969.00	4.10
222	002922	伊戈尔	502,434.00	4.09
223	300538	同益股份	502,418.00	4.09
224	600268	国电南自	502,135.20	4.09
225	001268	联合精密	502,015.00	4.09
226	300099	尤洛卡	501,441.00	4.08
227	001328	登康口腔	501,409.00	4.08
228	300391	长药控股	501,357.00	4.08
229	301066	万事利	501,202.00	4.08
230	301383	天键股份	501,083.00	4.08
231	002640	跨境通	500,742.00	4.08
232	002334	英威腾	500,707.00	4.08
233	301208	中亦科技	500,533.00	4.08
234	300608	思特奇	500,239.00	4.07
235	000698	沈阳化工	499,699.00	4.07
236	600894	广日股份	499,691.00	4.07
237	002803	吉宏股份	499,684.00	4.07
238	301270	汉仪股份	498,886.00	4.06
239	002303	美盈森	498,640.00	4.06

240	002093	国脉科技	498,342.00	4.06
241	002323	雅博股份	498,203.00	4.06
242	600851	海欣股份	498,026.00	4.06
243	600033	福建高速	498,009.00	4.06
244	603315	福鞍股份	497,984.00	4.06
245	300021	大禹节水	497,967.00	4.06
246	300460	惠伦晶体	497,645.00	4.05
247	600269	赣粤高速	497,390.00	4.05
248	300550	和仁科技	497,370.00	4.05
249	002971	和远气体	497,265.00	4.05
250	300231	银信科技	496,740.00	4.05
251	603106	恒银科技	496,455.00	4.04
252	000836	ST 富通	496,303.00	4.04
253	001313	粤海饲料	496,140.00	4.04
254	002300	太阳电缆	495,980.00	4.04
255	300522	世名科技	495,795.00	4.04
256	301127	天源环保	494,861.00	4.03
257	300700	岱勒新材	494,694.00	4.03
258	300815	玉禾田	494,529.64	4.03
259	300025	华星创业	494,469.00	4.03
260	002611	东方精工	494,293.00	4.03
261	002184	海得控制	494,207.00	4.03
262	600853	龙建股份	493,528.00	4.02
263	000822	山东海化	493,482.00	4.02
264	000631	顺发恒业	493,477.00	4.02
265	301181	标榜股份	493,362.00	4.02
266	301149	隆华新材	493,267.57	4.02
267	300304	云意电气	493,172.00	4.02
268	600310	广西能源	493,170.00	4.02
269	002995	天地在线	492,724.00	4.01
270	600794	保税科技	492,433.00	4.01
271	300291	百纳千成	492,386.00	4.01
272	002165	红宝丽	492,101.00	4.01
273	300516	久之洋	492,065.00	4.01
274	000753	漳州发展	491,470.00	4.00
275	301320	豪江智能	491,432.00	4.00
276	600981	汇鸿集团	491,005.00	4.00
277	600611	大众交通	490,570.00	4.00
278	002437	誉衡药业	490,493.00	4.00
279	301179	泽宇智能	490,165.00	3.99
280	300817	双飞集团	489,815.00	3.99
281	600461	洪城环境	488,838.00	3.98
282	002514	宝馨科技	488,792.00	3.98
283	000912	泸天化	488,752.00	3.98

284	300349	金卡智能	488,696.00	3.98
285	000531	穗恒运 A	488,644.00	3.98
286	601008	连云港	488,133.00	3.98
287	002783	凯龙股份	488,089.00	3.98
288	000978	桂林旅游	487,833.00	3.97
289	003032	传智教育	487,755.00	3.97
290	002896	中大力德	487,250.00	3.97
291	600433	冠豪高新	487,072.00	3.97
292	605116	奥锐特	486,569.00	3.96
293	300872	天阳科技	486,405.00	3.96
294	300551	古鳌科技	486,341.39	3.96
295	002095	生意宝	485,983.00	3.96
296	300740	水羊股份	485,938.00	3.96
297	600249	两面针	485,782.00	3.96
298	300706	阿石创	485,327.00	3.95
299	300607	拓斯达	485,144.00	3.95
300	300590	移为通信	485,005.00	3.95
301	002937	兴瑞科技	484,988.00	3.95
302	300852	四会富仕	484,750.00	3.95
303	300996	普联软件	484,634.80	3.95
304	002593	日上集团	484,196.00	3.94
305	002817	黄山胶囊	484,025.00	3.94
306	002878	元隆雅图	483,912.00	3.94
307	002375	亚厦股份	483,895.00	3.94
308	300248	新开普	483,823.00	3.94
309	300421	力星股份	483,693.60	3.94
310	002329	皇氏集团	483,611.00	3.94
311	600757	长江传媒	483,455.00	3.94
312	300514	友讯达	483,218.00	3.94
313	600594	益佰制药	483,044.00	3.93
314	301377	鼎泰高科	482,824.00	3.93
315	605266	健之佳	482,554.00	3.93
316	301357	北方长龙	481,945.00	3.93
317	002900	哈三联	481,350.00	3.92
318	600327	大东方	481,257.00	3.92
319	002364	中恒电气	481,141.00	3.92
320	002858	力盛体育	480,663.00	3.92
321	002818	富森美	480,609.60	3.91
322	301051	信濠光电	480,347.00	3.91
323	300007	汉威科技	480,247.00	3.91
324	002333	罗普斯金	480,102.00	3.91
325	605377	华旺科技	479,916.00	3.91
326	002823	凯中精密	479,694.00	3.91
327	300378	鼎捷数智	479,394.00	3.90

328	300491	通合科技	478,569.00	3.90
329	000788	北大医药	477,519.00	3.89
330	300258	精锻科技	477,344.00	3.89
331	605388	均瑶健康	476,367.00	3.88
332	301169	零点有数	476,228.00	3.88
333	002345	潮宏基	476,076.00	3.88
334	301263	泰恩康	475,969.00	3.88
335	300997	欢乐家	475,632.00	3.87
336	300485	赛升药业	475,608.00	3.87
337	600636	国新文化	475,406.00	3.87
338	688505	复旦张江	474,900.90	3.87
339	301159	三维天地	474,417.00	3.86
340	301256	华融化学	473,196.00	3.85
341	000635	英力特	472,760.00	3.85
342	002491	通鼎互联	472,715.00	3.85
343	688231	隆达股份	472,390.93	3.85
344	000663	永安林业	471,981.00	3.84
345	002965	祥鑫科技	471,835.00	3.84
346	002293	罗莱生活	471,604.00	3.84
347	300933	中辰股份	471,380.00	3.84
348	002495	佳隆股份	471,237.00	3.84
349	002117	东港股份	470,969.00	3.84
350	300533	冰川网络	469,411.00	3.82
351	300710	万隆光电	468,377.00	3.81
352	000920	沃顿科技	468,045.00	3.81
353	300032	金龙机电	467,969.00	3.81
354	000428	华天酒店	467,725.00	3.81
355	000957	中通客车	467,350.00	3.81
356	300439	美康生物	467,079.00	3.80
357	601789	宁波建工	466,883.00	3.80
358	002587	奥拓电子	466,123.00	3.80
359	002571	德力股份	465,528.00	3.79
360	600230	沧州大化	465,307.00	3.79
361	300678	中科信息	464,783.00	3.79
362	002757	南兴股份	464,757.00	3.79
363	600495	晋西车轴	464,625.00	3.78
364	603029	天鹅股份	464,065.00	3.78
365	600105	永鼎股份	463,436.00	3.77
366	300589	江龙船艇	463,284.00	3.77
367	002154	报喜鸟	463,069.00	3.77
368	603070	万控智造	463,058.00	3.77
369	301393	昊帆生物	463,029.00	3.77
370	301038	深水规院	462,773.20	3.77
371	300698	万马科技	462,480.00	3.77

372	002106	莱宝高科	462,337.00	3.77
373	301117	佳缘科技	462,224.00	3.76
374	600410	华胜天成	462,070.00	3.76
375	603590	康辰药业	461,272.00	3.76
376	000948	南天信息	461,155.00	3.76
377	600855	航天长峰	460,965.00	3.75
378	300415	伊之密	460,084.00	3.75
379	002016	世荣兆业	460,066.00	3.75
380	002662	京威股份	459,753.00	3.74
381	300691	联合光电	458,742.00	3.74
382	600939	重庆建工	458,589.00	3.74
383	002445	中南文化	458,451.00	3.73
384	605068	明新旭腾	458,136.00	3.73
385	002338	奥普光电	458,057.00	3.73
386	600425	青松建化	458,047.00	3.73
387	300797	钢研纳克	458,013.00	3.73
388	300667	必创科技	457,906.00	3.73
389	688799	华纳药厂	457,342.23	3.73
390	300605	恒锋信息	457,253.00	3.72
391	600716	凤凰股份	457,253.00	3.72
392	300809	华辰装备	457,198.40	3.72
393	603028	赛福天	456,964.00	3.72
394	301136	招标股份	456,430.00	3.72
395	002181	粤传媒	456,259.00	3.72
396	600184	光电股份	455,478.00	3.71
397	300513	恒实科技	455,175.00	3.71
398	600735	新华锦	454,816.00	3.70
399	002975	博杰股份	454,717.00	3.70
400	002988	豪美新材	454,664.00	3.70
401	603366	日出东方	453,278.00	3.69
402	301211	亨迪药业	452,947.00	3.69
403	600130	波导股份	452,693.00	3.69
404	603676	卫信康	452,660.00	3.69
405	300840	酷特智能	452,108.00	3.68
406	002208	合肥城建	451,731.00	3.68
407	603969	银龙股份	451,528.00	3.68
408	301303	真兰仪表	451,059.00	3.67
409	002599	盛通股份	450,982.00	3.67
410	300355	蒙草生态	450,899.00	3.67
411	600694	大商股份	449,911.00	3.66
412	600280	中央商场	449,821.00	3.66
413	600537	亿晶光电	449,668.00	3.66
414	605077	华康股份	448,607.00	3.65
415	300990	同飞股份	448,346.00	3.65

416	002379	宏创控股	447,914.00	3.65
417	605598	上海港湾	447,890.00	3.65
418	002989	中天精装	446,913.00	3.64
419	002315	焦点科技	446,330.00	3.64
420	002235	安妮股份	446,163.00	3.63
421	603708	家家悦	445,244.00	3.63
422	603123	翠微股份	444,666.00	3.62
423	002860	星帅尔	444,011.00	3.62
424	002970	锐明技术	443,817.00	3.61
425	300345	华民股份	443,490.00	3.61
426	002546	新联电子	443,325.00	3.61
427	002795	永和智控	443,003.00	3.61
428	002554	惠博普	442,877.00	3.61
429	000925	众合科技	442,505.00	3.60
430	603937	丽岛新材	442,264.00	3.60
431	688580	伟思医疗	442,052.60	3.60
432	002270	华明装备	441,590.00	3.60
433	002527	新时达	441,304.00	3.59
434	001319	铭科精技	441,285.00	3.59
435	300499	高澜股份	440,934.00	3.59
436	601890	亚星锚链	440,860.00	3.59
437	002471	中超控股	440,653.00	3.59
438	688588	凌志软件	440,018.93	3.58
439	300510	金冠股份	439,383.00	3.58
440	300098	高新兴	439,263.00	3.58
441	002877	智能自控	438,939.00	3.58
442	300011	鼎汉技术	438,818.00	3.57
443	002062	宏润建设	438,540.00	3.57
444	002197	ST 证通	438,062.00	3.57
445	300632	光莆股份	437,905.00	3.57
446	300853	申昊科技	437,650.00	3.56
447	300592	华凯易佰	437,327.00	3.56
448	301525	儒竞科技	437,219.63	3.56
449	002689	远大智能	437,170.00	3.56
450	605188	国光连锁	436,954.00	3.56
451	301089	拓新药业	436,784.00	3.56
452	601929	吉视传媒	436,475.00	3.56
453	002426	胜利精密	436,351.00	3.55
454	301311	昆船智能	436,330.00	3.55
455	002043	兔宝宝	436,023.00	3.55
456	688328	深科达	435,738.31	3.55
457	300519	新光药业	435,662.00	3.55
458	000906	浙商中拓	435,497.00	3.55
459	600557	康缘药业	435,192.00	3.54

460	301323	新莱福	435,163.60	3.54
461	000650	仁和药业	434,794.00	3.54
462	300017	网宿科技	434,534.00	3.54
463	001219	青岛食品	434,532.00	3.54
464	603518	锦泓集团	434,270.00	3.54
465	000828	东莞控股	433,760.00	3.53
466	603306	华懋科技	432,788.00	3.53
467	002031	巨轮智能	432,682.00	3.52
468	603267	鸿远电子	432,285.00	3.52
469	000078	海王生物	432,204.00	3.52
470	300377	赢时胜	431,481.00	3.51
471	002540	亚太科技	427,994.00	3.49
472	300380	安硕信息	423,692.00	3.45
473	002561	徐家汇	423,317.00	3.45
474	688207	格灵深瞳	416,062.92	3.39
475	300461	田中精机	411,999.00	3.36
476	601126	四方股份	409,850.00	3.34
477	600121	郑州煤电	401,970.00	3.27
478	600226	亨通股份	390,080.00	3.18
479	688089	嘉必优	389,454.25	3.17
480	688293	奥浦迈	387,588.63	3.16
481	600846	同济科技	386,120.00	3.14
482	300160	秀强股份	382,811.00	3.12
483	688222	成都先导	377,087.52	3.07
484	603768	常青股份	376,317.00	3.07
485	600429	三元股份	374,513.00	3.05
486	603897	长城科技	372,434.00	3.03
487	600551	时代出版	366,811.00	2.99
488	688068	热景生物	366,048.11	2.98
489	002014	永新股份	364,723.00	2.97
490	600368	五洲交通	363,991.00	2.96
491	600638	新黄浦	362,394.00	2.95
492	603359	东珠生态	360,354.00	2.94
493	603987	康德莱	357,815.00	2.91
494	300065	海兰信	357,333.00	2.91
495	603859	能科科技	356,701.00	2.91
496	688182	灿勤科技	355,848.19	2.90
497	300055	万邦达	354,325.00	2.89
498	600207	安彩高科	351,935.00	2.87
499	603520	司太立	349,390.00	2.85
500	600897	厦门空港	340,884.00	2.78
501	603701	德宏股份	338,813.00	2.76
502	600084	中信尼雅	338,471.00	2.76
503	600880	博瑞传播	338,032.00	2.75

504	688590	新致软件	335,622.68	2.73
505	002681	奋达科技	333,233.00	2.71
506	002632	道明光学	333,170.00	2.71
507	600108	亚盛集团	325,654.00	2.65
508	000501	武商集团	325,275.00	2.65
509	605398	新炬网络	317,281.00	2.58
510	000514	渝开发	316,400.00	2.58
511	600825	新华传媒	310,414.00	2.53
512	688226	威腾电气	308,374.15	2.51
513	603727	博迈科	305,276.00	2.49
514	600308	华泰股份	305,170.00	2.49
515	002330	得利斯	304,996.00	2.48
516	603266	天龙股份	304,835.00	2.48
517	300709	精研科技	303,545.00	2.47
518	002483	润邦股份	302,551.00	2.46
519	600054	黄山旅游	301,035.00	2.45
520	002075	沙钢股份	299,719.00	2.44
521	002418	康盛股份	294,942.00	2.40
522	600255	鑫科材料	294,731.00	2.40
523	300195	长荣股份	294,043.00	2.40
524	688253	英诺特	292,704.69	2.38
525	603960	克来机电	292,404.00	2.38
526	600292	远达环保	290,647.00	2.37
527	002189	中光学	288,294.00	2.35
528	605228	神通科技	285,677.00	2.33
529	300131	英唐智控	285,610.00	2.33
530	603360	百傲化学	283,388.00	2.31
531	600159	大龙地产	283,174.00	2.31
532	002881	美格智能	283,147.00	2.31
533	300602	飞荣达	282,104.00	2.30
534	688391	钜泉科技	281,811.36	2.30
535	603211	晋拓股份	281,681.00	2.29
536	603558	健盛集团	280,967.00	2.29
537	300369	绿盟科技	280,818.00	2.29
538	002752	昇兴股份	280,288.00	2.28
539	002725	跃岭股份	278,523.00	2.27
540	688053	思科瑞	278,265.42	2.27
541	002337	赛象科技	276,236.00	2.25
542	300053	航宇微	275,885.00	2.25
543	300192	科德教育	275,134.00	2.24
544	600623	华谊集团	274,633.00	2.24
545	688348	昱能科技	272,019.18	2.22
546	688560	明冠新材	271,637.77	2.21
547	688077	大地熊	270,072.20	2.20

548	300184	力源信息	270,055.00	2.20
549	002133	广宇集团	269,763.00	2.20
550	603399	永杉锂业	269,513.00	2.20
551	300404	博济医药	268,757.00	2.19
552	603131	上海沪工	268,486.00	2.19
553	000505	京粮控股	268,094.00	2.18
554	002141	*ST 贤丰	268,081.00	2.18
555	600228	返利科技	266,771.00	2.17
556	688071	华依科技	266,461.70	2.17
557	300731	科创新源	265,136.00	2.16
558	000411	英特集团	262,696.00	2.14
559	601599	浙文影业	262,021.00	2.13
560	300245	天玑科技	261,371.00	2.13
561	000633	合金投资	260,340.00	2.12
562	603390	通达电气	259,935.00	2.12
563	688205	德科立	257,500.17	2.10
564	002084	海鸥住工	256,727.22	2.09
565	300217	东方电热	256,228.00	2.09
566	300441	鲍斯股份	255,903.00	2.08
567	002306	中科云网	255,076.00	2.08
568	600476	湘邮科技	253,858.00	2.07
569	002406	远东传动	252,267.00	2.05
570	002962	五方光电	250,188.00	2.04
571	300275	梅安森	250,072.00	2.04
572	688609	九联科技	249,500.76	2.03
573	603496	恒为科技	249,307.00	2.03
574	688593	新相微	248,755.73	2.03
575	600336	澳柯玛	248,105.00	2.02
576	300925	法本信息	248,046.00	2.02
577	001223	欧克科技	247,531.00	2.02
578	300713	英可瑞	246,629.00	2.01
579	301368	丰立智能	246,610.00	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。

8.4.2 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	688258	卓易信息	926,590.47	7.55
2	688035	德邦科技	836,385.98	6.81
3	600237	铜峰电子	773,388.00	6.30

4	600020	中原高速	773,112.00	6.30
5	688049	炬芯科技	761,415.89	6.20
6	603949	雪龙集团	750,452.00	6.11
7	600814	杭州解百	749,192.00	6.10
8	600789	鲁抗医药	724,602.00	5.90
9	603110	东方材料	720,571.00	5.87
10	600613	神奇制药	713,960.00	5.82
11	688550	瑞联新材	711,783.77	5.80
12	601007	金陵饭店	705,301.00	5.74
13	603738	泰晶科技	700,585.80	5.71
14	600769	祥龙电业	694,188.00	5.65
15	688371	菲沃泰	686,029.90	5.59
16	688157	松井股份	685,545.98	5.58
17	600525	长园集团	684,274.00	5.57
18	603999	读者传媒	674,213.00	5.49
19	603668	天马科技	670,965.80	5.47
20	603998	方盛制药	670,086.00	5.46
21	603158	腾龙股份	670,034.00	5.46
22	603258	电魂网络	667,310.00	5.44
23	688313	仕佳光子	663,979.32	5.41
24	600664	哈药股份	661,772.00	5.39
25	603889	新澳股份	660,344.00	5.38
26	600035	楚天高速	656,736.00	5.35
27	605555	德昌股份	651,804.00	5.31
28	688247	宣泰医药	647,150.92	5.27
29	603051	鹿山新材	644,504.00	5.25
30	603367	辰欣药业	643,937.00	5.24
31	688138	清溢光电	643,048.40	5.24
32	603569	长久物流	640,673.00	5.22
33	688601	力芯微	640,635.83	5.22
34	605289	罗曼股份	639,499.00	5.21
35	600186	莲花控股	637,280.00	5.19
36	688025	杰普特	636,983.41	5.19
37	603662	柯力传感	635,683.00	5.18
38	603867	新化股份	624,530.00	5.09
39	600738	丽尚国潮	622,277.00	5.07
40	603206	嘉环科技	622,001.00	5.07
41	601339	百隆东方	618,695.00	5.04
42	688292	浩瀚深度	616,692.45	5.02
43	603687	大胜达	615,259.00	5.01
44	688579	山大地纬	610,147.47	4.97
45	688566	吉贝尔	609,918.77	4.97
46	600479	千金药业	609,878.00	4.97
47	600829	人民同泰	603,193.00	4.91

48	605128	上海沿浦	601,892.88	4.90
49	603630	拉芳家化	599,964.00	4.89
50	600503	华丽家族	596,048.00	4.85
51	600468	百利电气	590,269.00	4.81
52	600987	航民股份	588,521.00	4.79
53	600576	祥源文旅	584,544.00	4.76
54	603078	江化微	584,397.00	4.76
55	603222	济民健康	583,300.00	4.75
56	603125	常青科技	579,180.55	4.72
57	601566	九牧王	575,676.00	4.69
58	600354	敦煌种业	565,816.00	4.61
59	600721	百花医药	563,424.00	4.59
60	603358	华达科技	561,111.00	4.57
61	688595	芯海科技	555,371.92	4.52
62	600133	东湖高新	551,867.00	4.50
63	603283	赛腾股份	542,383.00	4.42
64	000837	秦川机床	541,613.00	4.41
65	600894	广日股份	537,026.00	4.37
66	688252	天德钰	536,242.21	4.37
67	002020	京新药业	534,317.00	4.35
68	688658	悦康药业	530,476.06	4.32
69	603912	佳力图	523,611.00	4.26
70	601089	福元医药	522,468.00	4.26
71	603315	福鞍股份	521,276.00	4.25
72	603890	春秋电子	521,241.00	4.25
73	605368	蓝天燃气	521,184.40	4.25
74	603698	航天工程	519,766.00	4.23
75	601188	龙江交通	519,556.00	4.23
76	688259	创耀科技	518,894.09	4.23
77	603618	杭电股份	516,263.00	4.21
78	603416	信捷电气	515,848.71	4.20
79	600180	瑞茂通	513,984.00	4.19
80	601579	会稽山	513,832.00	4.19
81	600713	南京医药	512,018.00	4.17
82	600461	洪城环境	510,401.00	4.16
83	688311	盟升电子	509,514.86	4.15
84	603538	美诺华	507,789.00	4.14
85	600269	赣粤高速	507,755.00	4.14
86	600513	联环药业	507,454.00	4.13
87	603386	骏亚科技	506,562.00	4.13
88	603617	君禾股份	501,107.00	4.08
89	600620	天宸股份	497,759.00	4.05
90	600033	福建高速	496,576.00	4.04
91	603223	恒通股份	495,632.40	4.04

92	600488	津药药业	495,418.00	4.04
93	600757	长江传媒	494,809.00	4.03
94	601999	出版传媒	490,131.00	3.99
95	601008	连云港	490,075.00	3.99
96	605116	奥锐特	488,444.00	3.98
97	688319	欧林生物	487,039.67	3.97
98	600851	海欣股份	484,039.00	3.94
99	600853	龙建股份	484,039.00	3.94
100	603809	豪能股份	483,945.00	3.94
101	605266	健之佳	482,765.00	3.93
102	600433	冠豪高新	476,799.00	3.88
103	600523	贵航股份	476,440.00	3.88
104	605377	华旺科技	475,944.00	3.88
105	600353	旭光电子	475,405.00	3.87
106	600611	大众交通	473,071.00	3.85
107	601789	宁波建工	473,049.00	3.85
108	600694	大商股份	471,791.80	3.84
109	600794	保税科技	471,777.00	3.84
110	600855	航天长峰	469,691.00	3.83
111	600351	亚宝药业	467,761.00	3.81
112	688505	复旦张江	466,975.84	3.80
113	605077	华康股份	466,933.00	3.80
114	688231	隆达股份	463,766.98	3.78
115	600268	国电南自	461,700.00	3.76
116	002043	兔宝宝	460,564.00	3.75
117	603590	康辰药业	460,417.00	3.75
118	603333	尚纬股份	458,655.00	3.74
119	300017	网宿科技	456,630.00	3.72
120	603676	卫信康	455,736.00	3.71
121	600230	沧州大化	454,155.00	3.70
122	600981	汇鸿集团	453,281.00	3.69
123	600495	晋西车轴	452,786.00	3.69
124	600327	大东方	450,670.00	3.67
125	600636	国新文化	449,352.00	3.66
126	600184	光电股份	449,168.00	3.66
127	600105	永鼎股份	448,998.00	3.66
128	600425	青松建化	447,223.00	3.64
129	600249	两面针	446,791.00	3.64
130	605388	均瑶健康	442,617.00	3.61
131	000650	仁和药业	442,451.00	3.60
132	605598	上海港湾	441,479.00	3.60
133	603070	万控智造	441,433.10	3.60
134	600410	华胜天成	440,560.00	3.59
135	600939	重庆建工	439,630.00	3.58

136	601126	四方股份	437,500.00	3.56
137	601890	亚星锚链	437,281.00	3.56
138	603106	恒银科技	436,706.00	3.56
139	603267	鸿远电子	435,943.00	3.55
140	600706	曲江文旅	435,823.00	3.55
141	603029	天鹅股份	432,037.00	3.52
142	605068	明新旭腾	431,944.00	3.52
143	603969	银龙股份	430,931.00	3.51
144	605188	国光连锁	429,236.00	3.50
145	603366	日出东方	428,591.00	3.49
146	600310	广西能源	426,457.00	3.47
147	688588	凌志软件	424,047.77	3.45
148	603708	家家悦	423,276.00	3.45
149	688799	华纳药厂	422,915.12	3.44
150	600716	凤凰股份	422,851.00	3.44
151	300377	赢时胜	422,200.00	3.44
152	600735	新华锦	418,833.00	3.41
153	603518	锦泓集团	418,126.00	3.41
154	600130	波导股份	416,253.00	3.39
155	600594	益佰制药	414,366.00	3.38
156	600537	亿晶光电	413,404.00	3.37
157	603028	赛福天	411,770.00	3.35
158	603306	华懋科技	411,680.00	3.35
159	000828	东莞控股	411,365.00	3.35
160	688207	格灵深瞳	407,792.92	3.32
161	688580	伟思医疗	406,019.45	3.31
162	688293	奥浦迈	403,098.10	3.28
163	600557	康缘药业	402,222.00	3.28
164	603123	翠微股份	402,145.00	3.28
165	601929	吉视传媒	396,504.00	3.23
166	301525	儒竞科技	395,081.00	3.22
167	603937	丽岛新材	393,397.00	3.20
168	603897	长城科技	389,757.00	3.17
169	688222	成都先导	389,360.65	3.17
170	300181	佐力药业	388,404.00	3.16
171	301089	拓新药业	386,599.00	3.15
172	600280	中央商场	386,029.00	3.14
173	000892	欢瑞世纪	385,731.00	3.14
174	600226	亨通股份	384,389.00	3.13
175	688328	深科达	383,218.42	3.12
176	600121	郑州煤电	381,373.00	3.11
177	600429	三元股份	379,256.00	3.09
178	002426	胜利精密	378,253.00	3.08
179	603768	常青股份	377,047.00	3.07

180	600368	五洲交通	375,808.90	3.06
181	688089	嘉必优	375,595.96	3.06
182	603359	东珠生态	373,466.00	3.04
183	688182	灿勤科技	371,681.63	3.03
184	603859	能科科技	369,814.00	3.01
185	688068	热景生物	367,565.15	2.99
186	002900	哈三联	365,131.00	2.97
187	603701	德宏股份	353,054.00	2.88
188	600846	同济科技	352,224.00	2.87
189	600638	新黄浦	352,211.00	2.87
190	688226	威腾电气	349,893.49	2.85
191	600207	安彩高科	349,407.00	2.85
192	002264	新华都	346,702.95	2.82
193	603520	司太立	346,270.00	2.82
194	300461	田中精机	345,689.00	2.82
195	600897	厦门空港	344,364.00	2.80
196	600880	博瑞传播	342,005.00	2.79
197	688590	新致软件	340,800.26	2.78
198	002922	伊戈尔	338,876.00	2.76
199	300709	精研科技	330,481.00	2.69
200	600108	亚盛集团	328,934.00	2.68
201	600551	时代出版	325,850.00	2.65
202	603360	百傲化学	324,524.00	2.64
203	300065	海兰信	323,835.00	2.64
204	605398	新炬网络	323,650.00	2.64
205	002094	青岛金王	319,803.00	2.60
206	000521	长虹美菱	319,621.00	2.60
207	603266	天龙股份	318,008.00	2.59
208	688071	华依科技	317,531.56	2.59
209	002270	华明装备	315,294.00	2.57
210	600308	华泰股份	314,264.00	2.56
211	300415	伊之密	313,462.00	2.55
212	300922	天秦装备	311,560.00	2.54
213	600084	中信尼雅	309,958.22	2.52
214	603987	康德莱	308,364.00	2.51
215	603131	上海沪工	307,319.00	2.50
216	605228	神通科技	306,150.00	2.49
217	002679	福建金森	306,051.00	2.49
218	600825	新华传媒	305,981.00	2.49
219	000957	中通客车	305,493.00	2.49
220	300602	飞荣达	303,569.00	2.47
221	300360	炬华科技	303,277.00	2.47
222	300590	移为通信	301,563.00	2.46
223	600054	黄山旅游	301,424.00	2.46

224	603727	博迈科	300,335.00	2.45
225	600255	鑫科材料	298,983.00	2.44
226	002451	摩恩电气	295,674.00	2.41
227	301311	昆船智能	293,964.00	2.39
228	300100	双林股份	293,412.00	2.39
229	600623	华谊集团	292,979.00	2.39
230	000159	国际实业	292,602.00	2.38
231	600292	远达环保	291,790.00	2.38
232	300400	劲拓股份	289,088.00	2.35
233	002965	祥鑫科技	288,809.00	2.35
234	603558	健盛集团	287,272.00	2.34
235	603211	晋拓股份	286,322.00	2.33
236	688053	思科瑞	285,846.40	2.33
237	300756	金马游乐	285,720.00	2.33
238	688391	钜泉科技	285,222.78	2.32
239	603960	克来机电	281,321.00	2.29
240	301215	中汽股份	280,278.00	2.28
241	688348	昱能科技	279,766.29	2.28
242	688253	英诺特	278,888.94	2.27
243	002947	恒铭达	277,145.00	2.26
244	688077	大地熊	276,801.89	2.25
245	002587	奥拓电子	276,508.00	2.25
246	600159	大龙地产	271,982.00	2.22
247	688205	德科立	271,505.63	2.21
248	300840	酷特智能	267,669.00	2.18
249	603399	永杉锂业	267,450.00	2.18
250	002543	万和电气	265,819.00	2.17
251	688560	明冠新材	265,172.44	2.16
252	300098	高新兴	264,809.00	2.16
253	002878	元隆雅图	264,280.00	2.15
254	002026	山东威达	263,780.00	2.15
255	002975	博杰股份	263,597.00	2.15
256	603390	通达电气	263,573.00	2.15
257	600228	返利科技	262,933.00	2.14
258	600476	湘邮科技	262,006.00	2.13
259	300047	天源迪科	260,123.00	2.12
260	300066	三川智慧	257,651.00	2.10
261	002593	日上集团	256,992.00	2.09
262	300809	华辰装备	256,189.00	2.09
263	002031	巨轮智能	253,053.00	2.06
264	300369	绿盟科技	252,968.00	2.06
265	603496	恒为科技	249,648.00	2.03
266	000510	新金路	248,700.00	2.03
267	688609	九联科技	247,941.03	2.02

268	600336	澳柯玛	247,623.00	2.02
-----	--------	-----	------------	------

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	368,187,713.21
卖出股票的收入（成交）总额	220,363,324.67

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。

8.5 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。

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

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

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金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。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金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。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

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	11,429.95
2	应收清算款	502,040.51
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	79,834.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	593,304.58

8.12.4 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。

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

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。

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
270	38,247.23	7,490,197.00	72.53%	2,836,554.00	27.47%

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	上海展弘投资管理有限公司-展弘金选套利 1 号私募证券投资基金	2,000,000.00	19.37%
2	中信证券股份有限公司	1,946,687.00	18.85%
3	方正证券股份有限公司	1,198,010.00	11.60%
4	上海证券-国泰君安证券股份有限公司-上海证券正和 2 号 FOF 单一资产管理计划	1,000,000.00	9.68%
5	法巴农银理财有限责任公司-法巴农银理财珐琅金固收增强封闭式 C002 期	831,300.00	8.05%
6	肖静敏	430,000.00	4.16%
7	刘志娟	300,023.00	2.91%
8	国都期货有限公司	200,000.00	1.94%
9	陈盈	200,000.00	1.94%
10	UBS AG	117,100.00	1.13%

9.3 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	1,000.00	0.0097%
------------------	----------	---------

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

§10 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	86,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	288,000,000.00
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	10,326,751.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 2024 年 7 月 25 日至 2024 年 8 月 26 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，于 2024 年 8 月 27 日表决通过了《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修改基金合同终止条款的议案》。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

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

基金管理人：

2024 年 9 月 4 日，海富通基金管理有限公司发布公告，路颖女士自 2024 年 9 月 2 日起担任公司董事长，杨仓兵先生因退休不再担任公司董事长。

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12

月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 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。

11.5 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。本年度应支付的审计费用是 30,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的年限是 1 年。

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

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。

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无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易 单元 数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	佣金	占当期 佣金总 量的比 例	
海通证券	3	588,551,037.88	100.00%	364,724.64	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、交易单元的选择标准：

基金管理人选择财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强的证券公司，租用其交易单元供本基金证券交易。

3、交易单元的选择程序：

- (1) 由牵头部门依据上述交易单元选择标准及公司内控制度要求，对候选券商开展尽职调查，综合评估其财务状况、经营行为、合规风控能力、交易、研究等服务能力。
- (2) 经评估，牵头部门将符合公司制度要求的券商相关材料提交督察长进行合规性审查，再提交基金管理人的总经理办公会审议。
- (3) 基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》。

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		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	-	-	-	-	-	-

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	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证	2024-04-15

	型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	监会基金电子披露网站	
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	2024-04-18
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
17	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	2024-07-04

		网站	
18	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	2024-07-11
19	海富通基金管理有限公司关于新增兴业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	2024-07-18
20	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	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	2024-07-24
21	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	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	2024-07-25
22	海富通基金管理有限公司关于以通讯方式召开海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	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	2024-07-26
23	海富通基金管理有限公司关于新增国金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	2024-08-02
24	海富通基金管理有限公司关于新增爱建证券有限责任公司为海富通中证 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	2024-08-14
25	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基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	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	2024-08-27
26	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基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	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	2024-08-28
27	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	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	2024-09-04
28	海富通基金管理有限公司关于新增联储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	2024-10-14

29	海富通基金管理有限公司关于新增国联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	2024-11-11
30	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	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	2024-12-11
31	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调整最小申购、赎回单位的公告	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	2024-12-24
32	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	2024-12-24
33	海富通基金管理有限公司关于新增方正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	2024-12-25

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/7/15-2024/7/15,2024/7/25-2024/7/25	-	34,000,000.00	32,000,000.00	2,000,000.00	19.37%
	2	2024/10/21-2024/10/24,2024/10/28-2024/12/29	-	30,932,066.00	28,985,379.00	1,946,687.00	18.85%
	3	2024/11/5-2024/11/5	-	1,609,600.00	1,609,600.00	-	-
	4	2024/7/15-2024/7/15	-	16,000,000.00	16,000,000.00	-	-

个人	1	2024/5/6-2024/5/16	-	59,701,316.00	59,701,316.00	-	-
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六十个工作日低于5000万元的风险，本基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或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。

12.2 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 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1722 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”。

2024 年 12 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“债券型 ETF 典型精品案例”。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

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。

海富通基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日