

# 海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基 金

2025 年中期报告

2025 年 6 月 30 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2025 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	46
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	46
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	46
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	46
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	46
7.12 投资组合报告附注	47

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	48
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	49
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	49
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	49
10.1 基金份额持有人大会决议.....	49
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	49
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	49
10.4 基金投资策略的改变.....	49
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	50
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	50
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	50
10.8 其他重大事件.....	51
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	52
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	54
12.1 备查文件目录.....	54
12.2 存放地点.....	54
12.3 查阅方式.....	54

## §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	9,326,751.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024 年 4 月 15 日

### 2.2 基金产品说明

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

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		海富通基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	张姗
	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		谢乐斌	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.hftfund.com">http://www.hftfund.com</a>
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

## 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025年1月1日至2025年6月30日）
本期已实现收益	1,196,154.80
本期利润	2,070,828.34

加权平均基金份额本期利润	0.2552
本期加权平均净值利润率	19.70%
本期基金份额净值增长率	23.12%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2025年6月30日)</b>
期末可供分配利润	4,188,284.86
期末可供分配基金份额利润	0.4491
期末基金资产净值	13,652,227.11
期末基金份额净值	1.4638
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2025年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	46.38%

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)。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.23%	1.02%	6.40%	1.16%	3.83%	-0.14%
过去三个月	13.03%	2.01%	7.62%	2.12%	5.41%	-0.11%
过去六个月	23.12%	1.77%	15.24%	1.94%	7.88%	-0.17%
过去一年	59.16%	2.06%	47.00%	2.18%	12.16%	-0.12%
自基金合同生效起至今	46.38%	2.03%	27.13%	2.15%	19.25%	-0.12%

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

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2024年3月27日至2025年6月30日)



注：本基金合同于 2024 年 3 月 27 日生效。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。

## §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，于 2003 年 4 月 1 日发起设立。目前，公司的股东为国泰海通证券股份有限公司、法国巴黎资产管理 BE 控股公司，注册资本为 3 亿元人民币。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人旗下运作的公募基金共有 98 只，分别是：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、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、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、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、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、海富通量化选股混合型证券投资基金、海富通上证基准做市公司债交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金、海富通远见回报混合型证券投资基金、海富通配置优选三个月持有期混合型基金中基金(FOF)、海富通中证 A500 指数增强型发起式证券投资基金、海富通中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、海富通致远量化选股股票型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
李自悟	本基金的基金经理；量化投资部副总监。	2024-03-27	-	17 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 月起任海富通中证 500 增强基金经理。2023 年 2 月至 2025 年 3 月兼任海富通量化先锋股票基金经理。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。2025 年 3 月起兼任海富通欣益混合基金经理。
朱斌全	本基金的基金经理	2024-03-27	2025-06-12	18 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)、海富通欣益混合的基金经理。2019 年 10 月至 2025 年 5 月兼任海富通量化多因子混合基金经理。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 月至 2025 年 6 月兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。2025 年 3 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。
王宁宁	本基金的基金经理助理	2025-05-08	-	8 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。曾任平安道远投资管理(上海)有限公司企划财务部企划财务，平安基金管理有限公司 ETF 指数投资部指数研究员、ETF 基金经理助理，大成基金管理有限公司指数与期货投资部 ETF 基金经理助理。2024 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，任量化投资部指数研究员。2025 年 5 月起任海富通中证港股通科技 ETF、海富通中证港股通科技 ETF 发起联接、海富通中证 A500ETF、海富通中证 2000 增强策略 ETF 的基金经理助理。

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

非首任基金经理，其任职日期和离任日期均指公司做出决定之日。

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格遵守法律法规关于公平交易的相关规定，确保本公司管理的不同投资组合在授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动和环节得到公平对待。各投资组合均严格按照法律、法规和公司制度执行投资交易，保证公平交易制度的执行和实现。

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金进行可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年国内经济呈现温和复苏的良好趋势，一二季度 GDP 增长分别为 5.4% 和 5.2%，均位于 5% 以上。生产端，1-6 月规模以上工业增加值增速回升至 6.4%，特别是高技术制造业增长迅猛。在此推动下，工业企业盈利状况得到改善，1-6 月规模以上工业企业利润同比降幅收窄至 1.8%。需求端，出口和国内消费均保持了正增长。出口虽然受到关税博弈的影响，但除 2 月外均保证了较高的增速。社会零售在消费补贴的助力下也逐步走强。政策方面，今年 3 月两会财政目标赤字率提高至 4.0% 左右，5 月央行降准降息，财政政策靠前发力，扩张的财政政策有力地支撑了上半年经济的总体修复。

海外方面的演进则主要围绕着关税政策调整、货币政策分化和地缘政治博弈三条主线。一方面，关税博弈和地缘冲突给市场带来了冲击和波动。另一方面欧美经济数据边际走弱和欧央行的降息操作，打开了市场对于美联储货币政策转向的预期。在此大背景下，美国政府和美联储围绕降息节奏

的博弈无疑给市场注入了更多的不确定性。

从 A 股市场运行来看，上半年上证指数涨幅为 2.76%，沪深 300 为 0.03%，中证 800 为 0.87%，创业板指为 0.53%，整体小幅上涨。但以中证 2000 为代表的中小盘指数表现亮眼，中证 2000 年内上涨 15.24%，在宽基指数中位居前列。行业板块方面，根据申万一级行业分类，表现靠前的板块是有色金属、银行、国防军工、传媒、通信，而煤炭、食品饮料、房地产、石油石化、建筑装饰等板块则表现靠后。市场整体呈现先抑后扬的节奏，交投保持活跃，市场风险偏好回升明显。

基金投资策略方面，本基金通过量化模型优选个股，通过风险模型限制行业和风格暴露，保持投资组合风格稳定。上半年市场风格变化剧烈，但总体而言小市值和成长风格占优，有利于量化策略的表现。我们秉持获取稳健、可持续超额的理念，积极调整模型，较好地把握住了获取超额的机会。在策略层面，我们积极探索新的数据源，拓展超额来源，在选股模型、行业择时、和风格配置等方面持续提升。针对增强 ETF 的特性，我们在组合构建和跟踪误差控制方面进行了优化，在满足分散投资和合同约束的前提下，提升投资组合的风险调整后超额收益，力争为投资者创造更高的回报。

#### 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 23.12%，同期业绩比较基准收益率为 15.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于下半年，我们认为权益市场的热度仍将持续。得益于经济整体的复苏态势，特别是在一系列扩张性政策的推动下，预计国内经济下半年仍将保持不错的增速，全年 GDP 实现 5%以上增速的概率较大。从行业中观层面来看，在当下“反内卷”的风潮下，供需失衡产能逐步出清，市场竞争格局改善，或将帮助企业利润在下半年由负转正。从更长周期来看，随着国内产业升级渐入佳境，我国制造业的产品竞争力和盈利能力将由量变带来质变，这对权益市场的估值和盈利将带来双重贡献。

在经历了前期的市场调整后，市场的悲观预期从去年九月底以来也已经有了明显改善。当下市场流动性充裕，市场热点层出不穷，从年初的 Deepseek、人工智能，到二季度的光模块、创新药等，各种主题都在逐步提升大众对于权益市场的想象力。从资金流向来看，不管是外资还是交易型资金都在积极入场，种种迹象都显示国内权益市场正在逐步复苏。

诚然，展望下半年外部环境还存在一定的不确定性，上半年影响市场的一些因素仍将存在，不管是关税博弈、地缘冲突，还是货币政策的分化。但今年的市场，在一项项历史性突破的刺激下，明显打破了原有的循环路径。信心就是黄金，而眼下我们正在经历着信心的历史性重塑。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

上述参与估值流程各方之间无任何重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

自 2024 年 7 月 16 日至 2025 年 6 月 30 日，本基金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。自 2025 年 2 月 20 日至 2025 年 3 月 20 日，本基金连续二十一个工作日出现基金份额持有人数低于 200 人的情形。基金管理人已根据法规要求向中国证券监督管理委员会上海监管局报告并提出解决方案。

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合规守信、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。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	26,961.20	422,879.26
结算备付金		143,026.79	63,568.02
存出保证金		3,926.58	11,429.95
交易性金融资产	6.4.7.2	13,336,346.20	11,996,733.06
其中：股票投资		13,336,346.20	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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		119,464.03	502,040.51
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	174,793.38	79,834.12

资产总计		13,804,518.18	13,076,484.92
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,246.61	3,463.32
应付托管费		1,049.34	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	6.4.7.6	145,995.12	795,052.21
负债合计		152,291.07	799,208.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	9,326,751.00	10,326,751.00
未分配利润	6.4.7.8	4,325,476.11	1,950,525.72
净资产合计		13,652,227.11	12,277,276.72
负债和净资产总计		13,804,518.18	13,076,484.92

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.4638 元，基金份额总额 9,326,751.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 3 月 27 日（基 金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		2,101,986.29	-8,745,730.34
1.利息收入		487.39	121,814.71
其中：存款利息收入	6.4.7.9	487.39	121,814.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,215,479.69	-8,047,118.56

其中：股票投资收益	6.4.7.10	1,102,601.93	-8,243,839.34
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	6.4.7.12	-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	50,525.34
股利收益	6.4.7.14	112,877.76	146,195.44
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	874,673.54	-567,672.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	11,345.67	-252,754.12
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>31,157.95</b>	<b>213,866.80</b>
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	25,877.41	95,574.38
2. 托管费	6.4.10.2.2	5,175.54	19,114.87
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	419.83
8. 其他费用	6.4.7.17	105.00	98,757.72
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>2,070,828.34</b>	<b>-8,959,597.14</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>2,070,828.34</b>	<b>-8,959,597.14</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>2,070,828.34</b>	<b>-8,959,597.14</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,326,751.00	-	1,950,525.72	12,277,276.72
二、本期期初净资产	10,326,751.00	-	1,950,525.72	12,277,276.72

产				
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	2,374,950.39	1,374,950.39
（一）、综合收益总额	-	-	2,070,828.34	2,070,828.34
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-1,000,000.00	-	304,122.05	-695,877.95
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	-	4,052,028.87	16,052,028.87
2.基金赎回款	-13,000,000.00	-	-3,747,906.82	-16,747,906.82
（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	9,326,751.00	-	4,325,476.11	13,652,227.11
项目	上年度可比期间 2024 年 3 月 27 日（基金合同生效日）至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-	-
二、本期期初净资产	212,326,751.00	-	-	212,326,751.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-200,000,000.00	-	-989,551.87	-200,989,551.87
（一）、综合收益总额	-	-	-8,959,597.14	-8,959,597.14
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-200,000,000.00	-	7,970,045.27	-192,029,954.73
其中：1.基金申购款	18,000,000.00	-	-1,167,623.98	16,832,376.02
2.基金赎回款	-218,000,000.00	-	9,137,669.25	-208,862,330.75

（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产	12,326,751.00	-	-989,551.87	11,337,199.13

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金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 8 月 29 日批准报出。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表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 2025 年 6 月 30 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。

#### 6.4.3 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 6.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财税[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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	26,961.20
等于：本金	26,957.72
加：应计利息	3.48
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	26,961.20

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	12,856,350.25	-	13,336,346.20	479,995.95
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	12,856,350.25	-	-	13,336,346.20	479,995.95

### 6.4.7.3 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。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

### 6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	99,177.14
待摊费用	75,616.24
合计	174,793.38

### 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	14,815.74
其中：交易所市场	14,815.74
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,793.38
应退退补款	106,386.00

合计	145,995.12
----	------------

#### 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,326,751.00	10,326,751.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,000,000.00	-13,000,000.00
本期末	9,326,751.00	9,326,751.00

注：投资者申购和赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

#### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,045,105.13	-1,094,579.41	1,950,525.72
本期期初	3,045,105.13	-1,094,579.41	1,950,525.72
本期利润	1,196,154.80	874,673.54	2,070,828.34
本期基金份额交易产生的变动数	-52,975.07	357,097.12	304,122.05
其中：基金申购款	4,155,122.47	-103,093.60	4,052,028.87
基金赎回款	-4,208,097.54	460,190.72	-3,747,906.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,188,284.86	137,191.25	4,325,476.11

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	183.85
其他	8.35
合计	487.39

#### 6.4.7.10 股票投资收益

##### 6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	1,033,043.16
股票投资收益——赎回差价收入	69,558.77
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	1,102,601.93

#### 6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	70,118,359.22
减：卖出股票成本总额	69,015,192.73
减：交易费用	70,123.33
买卖股票差价收入	1,033,043.16

#### 6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	16,747,906.82
减：现金支付赎回款总额	5,486,634.82
减：赎回股票成本总额	11,191,713.23
减：交易费用	-
赎回差价收入	69,558.77

#### 6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

#### 6.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

#### 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	112,877.76
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	112,877.76

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	874,673.54
——股票投资	874,673.54
——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	874,673.54

## 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	11,345.67
合计	11,345.67

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

## 6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
银行划款手续费	105.00
合计	105.00

## 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

### 6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

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

## 6.4.9 关联方关系

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

经中国证券监督管理委员会（以下简称“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吸收合并海通证券股份有限公司。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安证券股份有限公司（后更名为“国泰海通证券股份有限公司”）承继及承接海通证券股份有限公司的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券股份有限公司所持海富通基金管理有限公司（以下简称“海富通基金”）股权亦归属于国泰海通证券股份有限公司，即国泰海通证券股份有限公司成为海富通基金的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金实际控制人。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立，与海通证券发生关联交易业务时间区间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 14 日，与国泰海通证券发生关联交易业务时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 6 月 30 日。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同生效日） 至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例	成交金额	占当期股 票成交总 额的比例
海通证券	47,274,767.12	33.72%	463,262,621.14	100.00%
国泰海通证券	92,927,682.66	66.28%	-	-

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	8,791.28	33.72%	-	-
国泰海通证券	17,277.05	66.28%	14,815.74	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同生效日）至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
海通证券	341,427.25	100.00%	341,427.25	100.00%

注：1.上述佣金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》。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同 生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	25,877.41	95,574.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,982.97	303.39
应支付基金管理人的净管理费	23,894.44	95,270.99

注：支付基金管理人海富通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 × 0.50% / 当年天数。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同 生效日）至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	5,175.54	19,114.87

注：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 × 0.10% / 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金在本报告期内及上年度可比期间均未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

## 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日		上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同生效 日）至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	26,961.20	295.19	927,309.74	11,493.03

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

## 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

## 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未实施利润分配。

## 6.4.12 期末（2025年6月30日）本基金持有的流通受限证券

## 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

于2025年6月30日，本基金未持有因认购新发或增发证券而流通受限的证券。

## 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项	38.05	2025-07-11	39.98	900	26,024.33	34,245.00	-

## 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

## 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立审计及风险管理委员会，负责制定公司的风险管理政策，审议批准公司的风险偏好、风险容忍度以及重大风险限额及监督公司内部控制制度和风险管理制度的执行情况等；在管理层层面设立风险管理委员会，负责实施董事会下设审计及风险管理委员会所制定的各项风险管理政策。

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

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同

业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2025 年 6 月 30 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（2024 年 12 月 31 日：无）。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	26,961.20	-	-	-	26,961.20
结算备付金	143,026.79	-	-	-	143,026.79
存出保证金	3,926.58	-	-	-	3,926.58

交易性金融资产	-	-	-	13,336,346.20	13,336,346.20
应收清算款	-	-	-	119,464.03	119,464.03
其他资产	-	-	-	174,793.38	174,793.38
资产总计	173,914.57	-	-	13,630,603.61	13,804,518.18
负债	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	5,246.61	5,246.61
应付托管费	-	-	-	1,049.34	1,049.34
其他负债	-	-	-	145,995.12	145,995.12
负债总计	-	-	-	152,291.07	152,291.07
利率敏感度缺口	173,914.57	-	-	13,478,312.54	13,652,227.11
上年度末					
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：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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2024 年 12 月 31 日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2024 年 12 月 31 日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，一方面采用指数化被动投资策略以追求有效跟踪标的指数，避免大幅偏离标的指数；另一方面采用量化模型调整投资组合，力求实现高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	13,336,346.20	97.69	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	13,336,346.20	97.69	11,996,733.06	97.71

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	850,930.98	751,113.06
2.业绩比较基准下降 5%	-850,930.98	-751,113.06	

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下:

第一层次输入值: 在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价;

第二层次输入值: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值;

第三层次输入值: 相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位: 人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年6月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	13,302,101.20	11,985,891.06
第二层次	34,245.00	10,842.00
第三层次	-	-
合计	13,336,346.20	11,996,733.06

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券等, 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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2025 年 6 月 30 日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2024 年 12 月 31 日:无)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日,本基金无需要说明的其他重要事项。

### §7 投资组合报告

#### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	13,336,346.20	96.61
	其中:股票	13,336,346.20	96.61
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	169,987.99	1.23
8	其他各项资产	298,183.99	2.16
9	合计	13,804,518.18	100.00

#### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	9,092,978.20	66.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	221,864.00	1.63
E	建筑业	217,147.00	1.59
F	批发和零售业	318,444.00	2.33
G	交通运输、仓储和邮政业	108,501.00	0.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,234,227.00	9.04
J	金融业	-	-
K	房地产业	526,185.00	3.85
L	租赁和商务服务业	125,410.00	0.92
M	科学研究和技术服务业	185,853.00	1.36
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	37,800.00	0.28
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	110,073.00	0.81
S	综合	148,903.00	1.09
	合计	12,327,385.20	90.30

## 7.2.2 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	-	-

C	制造业	817,499.00	5.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	39,390.00	0.29
E	建筑业	56,672.00	0.42
F	批发和零售业	73,530.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	21,870.00	0.16
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	1,008,961.00	7.39

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	301338	凯格精机	2,800	133,588.00	0.98
2	688661	和林微纳	3,300	131,241.00	0.96
3	002527	新时达	8,900	129,851.00	0.95
4	600288	大恒科技	12,600	129,528.00	0.95
5	300206	理邦仪器	10,700	128,614.00	0.94
6	000936	华西股份	18,500	127,280.00	0.93
7	600742	富维股份	13,300	126,483.00	0.93

8	300264	佳创视讯	19,800	126,324.00	0.93
9	002636	金安国纪	13,300	126,084.00	0.92
10	300365	恒华科技	19,000	125,210.00	0.92
11	300556	丝路视觉	6,300	125,181.00	0.92
12	002957	科瑞技术	7,600	124,944.00	0.92
13	688588	凌志软件	8,500	123,845.00	0.91
14	002344	海宁皮城	28,500	123,690.00	0.91
15	000421	南京公用	18,800	123,516.00	0.90
16	300519	新光药业	8,300	123,172.00	0.90
17	603421	鼎信通讯	18,300	123,159.00	0.90
18	002702	海欣食品	29,300	122,474.00	0.90
19	002999	天禾股份	17,500	122,150.00	0.89
20	600683	京投发展	31,700	122,045.00	0.89
21	300732	设研院	16,900	122,018.00	0.89
22	603778	国晟科技	36,300	121,968.00	0.89
23	301318	维海德	3,600	121,824.00	0.89
24	600159	大龙地产	44,100	121,275.00	0.89
25	601996	丰林集团	55,700	120,869.00	0.89
26	600067	冠城新材	40,300	120,094.00	0.88
27	600203	福日电子	12,800	119,808.00	0.88
28	600609	金杯汽车	22,000	116,380.00	0.85
29	002328	新朋股份	19,700	114,654.00	0.84
30	688668	鼎通科技	1,800	112,428.00	0.82
31	300990	同飞股份	2,200	109,780.00	0.80
32	002587	奥拓电子	17,000	109,650.00	0.80
33	300400	劲拓股份	6,500	109,460.00	0.80
34	601002	晋亿实业	22,100	108,953.00	0.80
35	002638	勤上股份	41,400	108,882.00	0.80
36	300279	和晶科技	15,700	108,801.00	0.80
37	600106	重庆路桥	17,700	108,501.00	0.79
38	603095	越剑智能	6,440	105,809.20	0.78
39	603936	博敏电子	11,100	104,673.00	0.77
40	002445	中南文化	40,700	103,785.00	0.76
41	301388	欣灵电气	4,200	103,362.00	0.76
42	600105	永鼎股份	12,500	101,125.00	0.74
43	300160	秀强股份	17,900	100,598.00	0.74
44	605305	中际联合	3,600	100,008.00	0.73
45	688022	瀚川智能	6,700	99,294.00	0.73
46	600708	光明地产	28,900	99,127.00	0.73
47	600819	耀皮玻璃	17,000	98,940.00	0.72
48	000833	粤桂股份	7,900	98,671.00	0.72
49	300112	万讯自控	10,900	98,645.00	0.72
50	002893	京能热力	9,200	98,348.00	0.72
51	603386	骏亚科技	7,700	97,405.00	0.71

52	301020	密封科技	4,400	96,052.00	0.70
53	000823	超声电子	8,000	94,800.00	0.69
54	600983	惠而浦	8,900	92,382.00	0.68
55	002042	华孚时尚	19,900	90,744.00	0.66
56	000717	中南股份	37,000	90,280.00	0.66
57	002725	跃岭股份	6,800	89,624.00	0.66
58	300469	信息发展	2,700	84,753.00	0.62
59	001324	长青科技	4,300	84,710.00	0.62
60	002787	华源控股	10,300	84,151.00	0.62
61	002972	科安达	6,800	83,572.00	0.61
62	300616	尚品宅配	6,300	82,971.00	0.61
63	300615	欣天科技	6,200	82,894.00	0.61
64	603289	泰瑞机器	8,700	82,824.00	0.61
65	300425	中建环能	15,800	82,792.00	0.61
66	601116	三江购物	7,600	82,764.00	0.61
67	300098	高新兴	15,900	82,680.00	0.61
68	300241	瑞丰光电	14,500	82,650.00	0.61
69	600237	铜峰电子	11,400	82,650.00	0.61
70	300235	方直科技	7,500	82,575.00	0.60
71	600218	全柴动力	9,200	82,524.00	0.60
72	002350	北京科锐	12,000	82,320.00	0.60
73	003037	三和管桩	11,400	81,852.00	0.60
74	002392	北京利尔	13,000	81,120.00	0.59
75	600665	天地源	24,000	80,400.00	0.59
76	603330	天洋新材	11,800	80,004.00	0.59
77	603601	再升科技	19,500	79,170.00	0.58
78	300988	津荣天宇	3,700	78,921.00	0.58
79	002543	万和电气	7,000	77,770.00	0.57
80	300062	中能电气	14,200	76,396.00	0.56
81	300978	东箭科技	6,600	73,656.00	0.54
82	688233	神工股份	2,300	73,071.00	0.54
83	600103	青山纸业	32,900	73,038.00	0.53
84	002663	普邦股份	38,000	70,300.00	0.51
85	300560	中富通	5,200	70,252.00	0.51
86	688093	世华科技	2,200	68,310.00	0.50
87	301328	维峰电子	1,600	67,440.00	0.49
88	605118	力鼎光电	2,700	67,041.00	0.49
89	300086	康芝药业	12,100	65,703.00	0.48
90	000815	美利云	4,900	63,210.00	0.46
91	688186	广大特材	2,200	62,942.00	0.46
92	000635	英力特	7,000	62,090.00	0.45
93	603890	春秋电子	5,300	61,480.00	0.45
94	688518	联赢激光	3,000	61,170.00	0.45
95	300081	恒信东方	8,100	57,348.00	0.42

96	002989	中天精装	1,700	57,086.00	0.42
97	603173	福斯达	1,600	56,880.00	0.42
98	002364	中恒电气	3,700	56,758.00	0.42
99	000042	中洲控股	7,800	55,458.00	0.41
100	300473	德尔股份	1,700	55,335.00	0.41
101	301248	杰创智能	2,200	54,736.00	0.40
102	688602	康鹏科技	6,500	54,470.00	0.40
103	301270	汉仪股份	1,100	52,426.00	0.38
104	301161	唯万密封	2,300	52,187.00	0.38
105	600620	天宸股份	9,200	50,232.00	0.37
106	688369	致远互联	1,900	50,141.00	0.37
107	603098	森特股份	4,900	49,931.00	0.37
108	301119	正强股份	1,400	49,504.00	0.36
109	300231	银信科技	4,000	49,240.00	0.36
110	600724	宁波富达	10,800	49,140.00	0.36
111	688512	慧智微	4,500	49,095.00	0.36
112	300053	航宇微	3,700	48,840.00	0.36
113	300583	赛托生物	2,800	48,272.00	0.35
114	002782	可立克	3,700	48,026.00	0.35
115	002285	世联行	21,000	47,880.00	0.35
116	688800	瑞可达	960	47,232.00	0.35
117	600713	南京医药	9,300	47,058.00	0.34
118	300939	秋田微	1,500	45,600.00	0.33
119	301151	冠龙节能	2,600	45,370.00	0.33
120	002783	凯龙股份	5,200	44,876.00	0.33
121	600960	渤海汽车	7,700	41,580.00	0.30
122	301332	德尔玛	4,000	40,960.00	0.30
123	600846	同济科技	3,500	39,830.00	0.29
124	003015	日久光电	2,300	39,445.00	0.29
125	301260	格力博	2,000	39,440.00	0.29
126	300507	苏奥传感	5,100	39,168.00	0.29
127	688685	迈信林	700	39,095.00	0.29
128	300486	东杰智能	4,700	38,869.00	0.28
129	300788	中信出版	1,200	38,496.00	0.28
130	300708	聚灿光电	3,200	38,400.00	0.28
131	002362	汉王科技	1,700	38,114.00	0.28
132	600973	宝胜股份	7,500	37,950.00	0.28
133	002823	凯中精密	2,700	37,881.00	0.28
134	002659	凯文教育	7,500	37,800.00	0.28
135	300105	龙源技术	4,900	37,779.00	0.28
136	603861	白云电器	3,800	37,506.00	0.27
137	300975	商络电子	3,100	37,448.00	0.27
138	603990	麦迪科技	2,300	37,375.00	0.27
139	301566	达利凯普	2,000	37,100.00	0.27

140	600351	亚宝药业	6,100	37,027.00	0.27
141	300812	易天股份	1,600	36,976.00	0.27
142	301386	未来电器	1,700	36,941.00	0.27
143	600825	新华传媒	5,400	36,720.00	0.27
144	301382	蜂助手	900	35,775.00	0.26
145	603191	望变电气	2,800	35,336.00	0.26
146	300766	每日互动	1,000	34,940.00	0.26
147	603230	内蒙新华	2,700	34,857.00	0.26
148	688313	仕佳光子	900	34,245.00	0.25
149	688158	优刻得	1,500	33,930.00	0.25
150	002953	日丰股份	3,200	33,216.00	0.24
151	688509	正元地信	7,700	33,033.00	0.24
152	603499	翔港科技	2,000	32,980.00	0.24
153	688298	东方生物	1,200	32,820.00	0.24
154	688660	电气风电	3,700	32,116.00	0.24
155	600071	凤凰光学	1,500	32,040.00	0.23
156	600619	海立股份	2,700	30,807.00	0.23
157	002441	众业达	3,200	29,024.00	0.21
158	002480	新筑股份	4,700	28,952.00	0.21
159	300825	阿尔特	2,600	28,106.00	0.21
160	002686	亿利达	4,300	27,993.00	0.21
161	600336	澳柯玛	4,100	27,962.00	0.20
162	002296	辉煌科技	2,400	26,760.00	0.20
163	300809	华辰装备	700	26,306.00	0.19
164	002367	康力电梯	3,700	26,011.00	0.19
165	300228	富瑞特装	3,300	25,707.00	0.19
166	002454	松芝股份	3,300	25,476.00	0.19
167	301005	超捷股份	700	24,500.00	0.18
168	300267	尔康制药	7,200	22,608.00	0.17
169	002976	瑞玛精密	800	20,800.00	0.15
170	002685	华东重机	2,600	19,578.00	0.14
171	300375	鹏翎股份	3,600	18,396.00	0.13
172	300414	中光防雷	900	13,932.00	0.10
173	002330	得利斯	2,000	9,160.00	0.07
174	688562	航天软件	400	7,496.00	0.05
175	603187	海容冷链	600	7,056.00	0.05
176	002949	华阳国际	200	2,696.00	0.02
177	002303	美盈森	600	2,136.00	0.02
178	002248	华东数控	200	1,750.00	0.01
179	300063	天龙集团	200	1,720.00	0.01
180	600268	国电南自	200	1,564.00	0.01
181	002358	森源电气	200	1,018.00	0.01

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

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	300686	智动力	9,400	93,906.00	0.69
2	000553	安道麦 A	11,400	82,308.00	0.60
3	002611	东方精工	6,300	75,978.00	0.56
4	600335	国机汽车	11,400	73,530.00	0.54
5	300289	利德曼	13,200	68,640.00	0.50
6	603612	索通发展	3,700	68,006.00	0.50
7	603311	金海高科	5,800	64,148.00	0.47
8	300185	通裕重工	21,800	62,348.00	0.46
9	002084	海鸥住工	16,300	57,865.00	0.42
10	600491	龙元建设	15,400	56,672.00	0.42
11	600866	星湖科技	7,500	51,825.00	0.38
12	600408	安泰集团	24,100	49,646.00	0.36
13	300088	长信科技	7,400	44,104.00	0.32
14	600635	大众公用	10,100	39,390.00	0.29
15	600808	马钢股份	8,300	28,635.00	0.21
16	301045	天禄科技	1,100	25,190.00	0.18
17	000586	汇源通信	2,200	24,464.00	0.18
18	300500	启迪设计	1,800	21,870.00	0.16
19	300270	中威电子	2,600	20,436.00	0.15

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

## 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603778	国晟科技	298,860.00	2.43
2	688800	瑞可达	292,488.32	2.38
3	600742	富维股份	277,648.00	2.26
4	603017	中衡设计	277,068.00	2.26
5	301318	维海德	277,013.00	2.26
6	688588	凌志软件	272,615.57	2.22
7	600609	金杯汽车	260,539.00	2.12
8	300968	格林精密	258,617.00	2.11
9	601996	丰林集团	257,050.00	2.09
10	600203	福日电子	252,133.00	2.05
11	600819	耀皮玻璃	250,930.00	2.04

12	603706	东方环宇	241,585.00	1.97
13	603516	淳中科技	232,960.00	1.90
14	603230	内蒙新华	227,429.00	1.85
15	600106	重庆路桥	223,428.00	1.82
16	603787	新日股份	220,307.00	1.79
17	301338	凯格精机	217,333.00	1.77
18	600408	安泰集团	215,344.00	1.75
19	601999	出版传媒	209,630.00	1.71
20	600288	大恒科技	206,591.00	1.68

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603017	中衡设计	287,777.00	2.34
2	688800	瑞可达	279,217.13	2.27
3	603706	东方环宇	276,007.00	2.25
4	603787	新日股份	244,542.00	1.99
5	300968	格林精密	234,713.00	1.91
6	001299	美能能源	230,707.00	1.88
7	688419	耐科装备	229,280.52	1.87
8	603516	淳中科技	220,602.00	1.80
9	300925	法本信息	216,684.00	1.76
10	603788	宁波高发	212,945.00	1.73
11	601999	出版传媒	209,643.00	1.71
12	300578	会畅通讯	208,938.00	1.70
13	002045	国光电器	207,171.00	1.69
14	600168	武汉控股	206,104.00	1.68
15	300570	太辰光	204,486.00	1.67
16	300846	首都在线	203,936.00	1.66
17	300827	上能电气	201,833.00	1.64
18	603508	思维列控	201,662.00	1.64
19	688205	德科立	201,097.84	1.64
20	688518	联赢激光	200,204.25	1.63

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	70,084,090.56
---------------	---------------

卖出股票的收入（成交）总额	70,118,359.22
---------------	---------------

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

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

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	3,926.58
2	应收清算款	119,464.03
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	99,177.14
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	298,183.99

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中未存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中未存在流通受限情况。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
298	31,297.82	6,195,355.00	66.43%	3,131,396.00	33.57%

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	浙江瓊尔德投资管理有限公司-瓊尔德润鑫 11 号私募证券投资基金	2,000,000.00	21.44%
2	上海橡杉资产管理有限公司-橡杉量化对冲二号私募证券投资基金	1,835,000.00	19.67%
3	方正证券股份有限公司	930,603.00	9.98%
4	中信证券股份有限公司	616,752.00	6.61%
5	钱跃富	466,300.00	5.00%
6	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	458,100.00	4.91%
7	管涛	261,100.00	2.80%
8	袁华松	226,000.00	2.42%
9	刘倩	183,800.00	1.97%
10	李宝	120,000.00	1.29%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

注：本基金本报告期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

**8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况**

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

**§9 开放式基金份额变动**

单位：份

基金合同生效日（2024 年 3 月 27 日）基金份额总额	212,326,751.00
本报告期期初基金份额总额	10,326,751.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,326,751.00

**§10 重大事件揭示****10.1 基金份额持有人大会决议**

本基金于 2025 年 4 月 11 日至 2025 年 5 月 14 日期间以通讯方式召开了基金份额持有人大会，审议《关于持续运作海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的议案》。根据计票结果，本人直接出具表决意见或授权他人代表出具表决意见的基金份额持有人所持有的基金份额小于在权益登记日基金总份额的二分之一（含二分之一），未达到法定的基金份额持有人大会召开条件。详情请参考本基金管理人发布的相关公告。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

基金管理人：

2025 年 4 月 23 日，海富通基金管理有限公司发布公告，谢乐斌先生自 2025 年 4 月 21 日起担任公司董事长，路颖女士因工作调整不再担任公司董事长。

基金托管人：

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

**10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼**

报告期内，无涉及本基金基金管理人基金管理业务、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	3	92,927,682.66	66.28%	17,277.05	66.28%	-
海通证券	3	47,274,767.12	33.72%	8,791.28	33.72%	-

注：1、报告期内本基金租用券商交易单元没有发生变更。上述租用海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 3 月 14 日，租用国泰海通证券交易单元进行交易时间区间为 2025 年 3 月 15 日至 2025 年 6 月 30 日。

#### 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》。

#### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	回购交易	权证交易

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总 额的比例	成交金额	占当期权证成交总 额的比例
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

注：上述租用海通证券交易单元进行交易时间区间为2025年1月1日至2025年3月14日，租用国泰海通证券交易单元进行交易时间区间为2025年3月15日至2025年6月30日。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于变更主要股东及实际控制人事项获得中国证券监督管理委员会批复的公告	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	2025-01-21
2	海富通基金管理有限公司关于新增瑞银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	2025-01-21
3	海富通基金管理有限公司关于新增东莞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	2025-02-13
4	海富通基金管理有限公司关于公司主要股东和实际控制人变更的公告	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	2025-03-18
5	海富通基金管理有限公司关于新增东北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	2025-03-19
6	海富通基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况 (2024 年下半年度)	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	2025-03-31
7	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	2025-04-09
8	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	2025-04-10
9	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金	2025-04-11

	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	电子披露网站	
10	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新增中银国际证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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	2025-04-11
11	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	2025-04-23
12	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	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	2025-05-08
13	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	2025-05-15
14	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新增民生证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	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	2025-05-15
15	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会议情况的公告	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	2025-05-16
16	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经理变更公告	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	2025-06-13

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025/6/9-2025/6/30	-	2,000,000.00	-	2,000,000.00	21.44%
	2	2025/3/7-2025/3/23,2025/3/26-2025/5/6,2025/6/12-2025/6/29	-	2,000,000.00	165,000.00	1,835,000.00	19.67%
	3	2025/1/2-2025/1/21,2025/1/23-2025/2/10,2025/2/13-2025/2/23,2025/2/25-2025/3/5	1,946,687.00	5,900,300.00	7,230,235.00	616,752.00	6.61%

	4	2025/3/6-2025/5/6, 2025/5/8-2025/5/1 2	-	2,000,0 00.00	2,000,000. 00	-	-
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>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；</p> <p>4、其他可能的风险。</p>							

注：报告期内单一投资者申购赎回份额包含二级市场交易数据。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 131 只公募基金。截至 2025 年 6 月 30 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2161 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”。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

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

### 12.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日