

# 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 年年度报告

2025 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：二〇二六年三月三十一日

## §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 2026 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 2025 年 1 月 1 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遵规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
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	18
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	18
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	18
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	18
§ 6 审计报告	18
6.1 审计意见	18
6.2 形成审计意见的基础	19
6.3 其他信息	19
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	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	23
7.4 报表附注	25
§ 8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	80
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 .....	80
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 .....	80
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 .....	80
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 .....	81
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12 投资组合报告附注 .....	81
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>82</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	83
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 .....	83
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>83</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>84</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	84
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 .....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4 基金投资策略的改变 .....	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
11.8 其他重大事件 .....	86
<b>12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>89</b>
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>90</b>
13.1 备查文件目录 .....	90
13.2 存放地点 .....	91
13.3 查阅方式 .....	91

## §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	中证 2000 增强 ETF 海富通
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	22,326,751.00 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</p>

	<p>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
	联系电话	021-38650788
	电子邮箱	chongyue@hftfund.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》
登载基金年度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	2025 年	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	7,589,276.69	-6,352,964.35
本期利润	8,294,803.58	-6,747,641.94
加权平均基金份额本期利润	0.6280	-0.2132
本期加权平均净值利润率	39.35%	-21.66%
本期基金份额净值增长率	54.55%	18.89%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末
期末可供分配利润	18,143,768.01	1,950,525.72
期末可供分配基金份额利润	0.8126	0.1889
期末基金资产净值	41,022,483.85	12,277,276.72
期末基金份额净值	1.8374	1.1889
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末

基金份额累计净值增长率	83.74%	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。

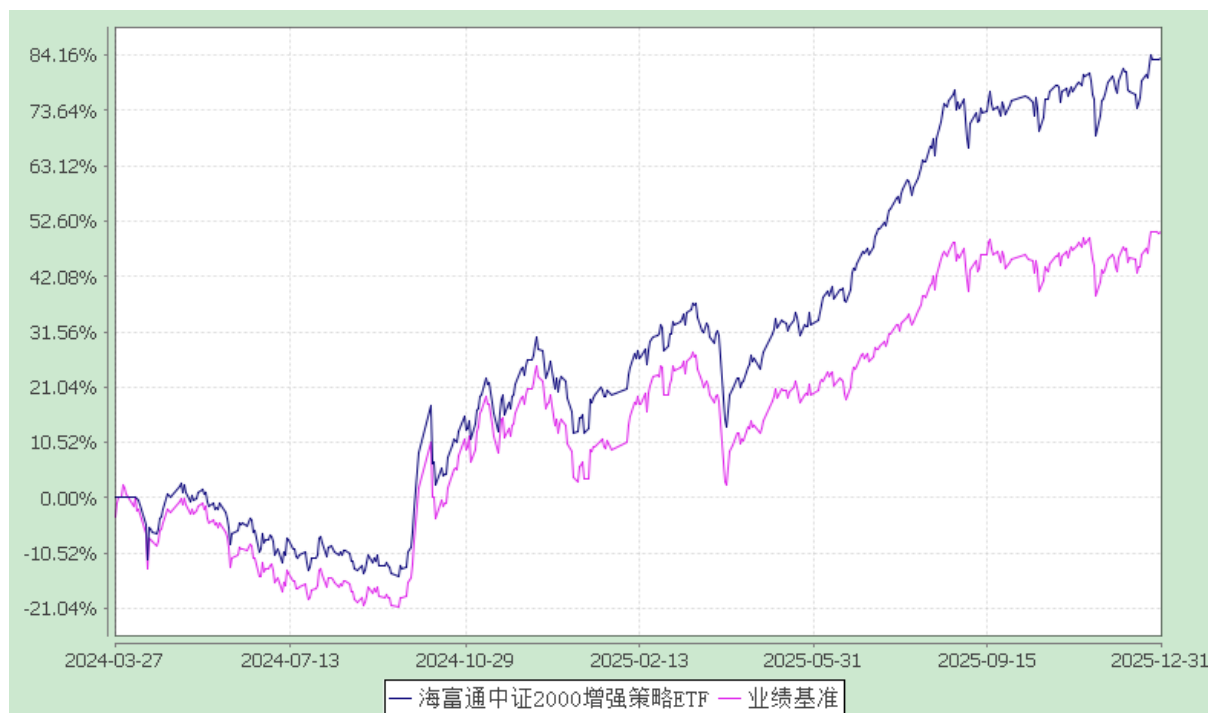
### 3.2 基金净值表现

#### 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	4.77%	1.13%	3.55%	1.19%	1.22%	-0.06%
过去六个月	25.52%	1.09%	18.38%	1.14%	7.14%	-0.05%
过去一年	54.55%	1.46%	36.42%	1.58%	18.13%	-0.12%
自基金合同生效起至今	83.74%	1.80%	50.49%	1.91%	33.25%	-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 2025 年 12 月 31 日)

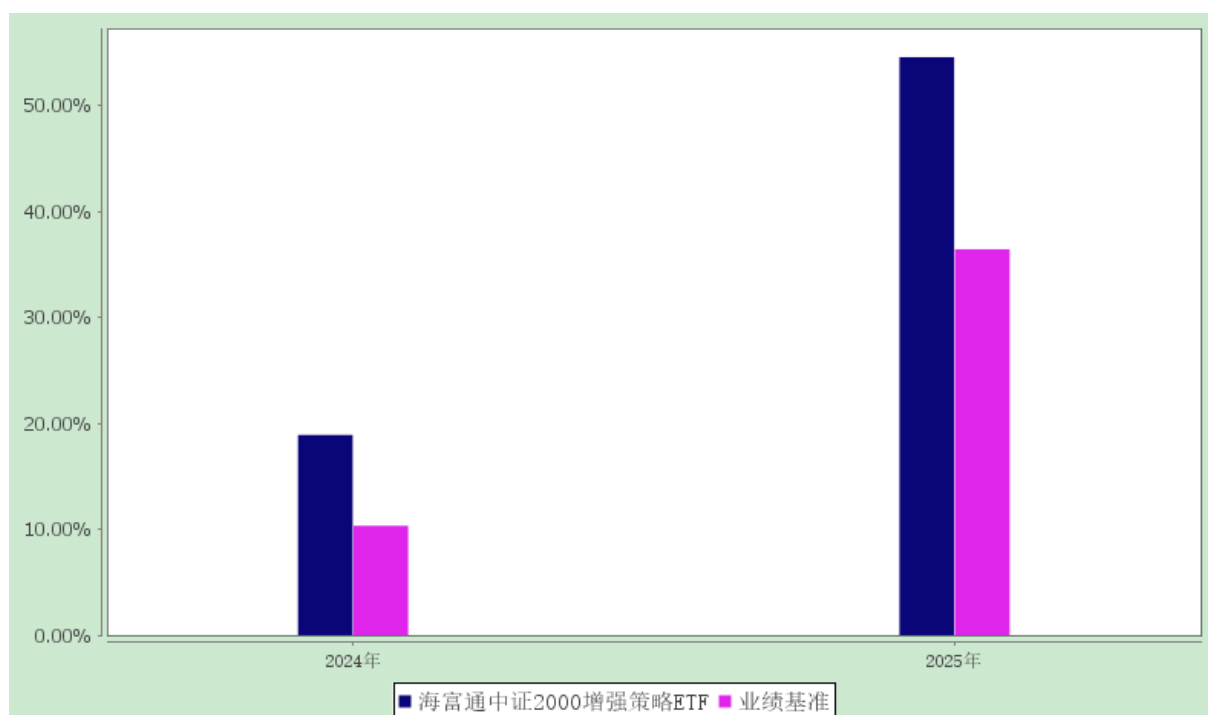


注：本基金合同于 2024 年 3 月 27 日生效。按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同的有关约定。

### 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
2025 年	-	-	-	-	-
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，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 12 月 31 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、海富通添合收益债券型证券投资基金、海富通聚益优选三个月持有期债券型基金中基金（FOF）、海富通稳鑫三个月持有期债券型

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	-	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。2025 年 12 月起兼任海富通中证 A500 指数增强基金经理。
朱斌全	本基金的基 金经理	2024-03-2 7	2025-06-1 2	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

				<p>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 月至 2025 年 8 月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。</p>	
王宁宁	本基金的基金经理助理	2025-05-08	-	8 年	<p>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</p>

					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。

3、本公司于 2026 年 2 月 11 日发布公告，自 2026 年 2 月 9 日起，王宁宁女士不再担任本基金的基金经理助理。

#### 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

2025 年，中国经济在宏观政策的有力支持下展现出强劲韧性与增长潜力。全年国内生产总值（GDP）达 140.19 万亿元，实际增速为 5.0%，继续位居世界主要经济体前列。经济节奏呈现前高后稳的态势，一季度开局良好，同比增长 5.4%；尽管二季度后外部环境出现变化，但出口链竞争力凸显，内生动能保持稳健；三、四季度经济持续在合理区间运行。从结构上看，工业生产与出口成为重要支撑，规模以上工业增加值同比增长 5.9%，出口总额同比增长 5.5%，全产业链优势凸显。政策层面，财政目标赤字率设定在 4.0% 左右，导向积极；货币政策维持宽松，年内适时降准降息，与财政政策协同发力，为实体经济营造了适宜的金融环境。产业政策持续聚焦高质量发展，因地制宜培育新质生产力，推动科技与产业创新深度融合。

海外经济与政策环境在 2025 年呈现“宽松为主、扰动并存”的复杂格局。美国为应对经济变化，于年内如期降息，向全球市场提供了较为充裕的流动性。然而，美国政府在四季度一度出现阶段性停摆，对美国短期经济增长构成扰动。值得关注的是，美联储完成了货币政策框架审查，正式由“平均通胀目标制”回归“灵活通胀目标制”，此举增强了其在稳定物价、促进就业与金融稳定等多重目标间的政策灵活性，也为后续利率路径提供了更大调整空间。与此同时，全球地缘政治与贸易关系的演变持续为国际金融市场带来不确定性，成为影响资本流动与风险偏好的重要变量。

A 股市场在内外因素共同作用下整体上行，结构分化显著，风格切换加速。全年主要宽基指数普遍收涨，其中创业板指表现尤为突出，涨幅达 49.57%，中证 2000 上涨 36.42%，显示成长风格与中小盘资产受到市场青睐。从行业表现看，受益于产业升级与全球需求复苏的有色金属、通信、电子、电力设备及机械设备等行业涨幅居前，勾勒出清晰的科技成长与高端制造主线。市场运行节奏上，年初在积极情绪推动下走出一轮春季行情，年中经历外部冲击带来的短期调整后，随着国内外政策环境同步转暖，市场重拾升势。四季度市场呈现高位震荡、蓄势待发态势，风格更趋均衡。

报告期内，本基金根据市场环境和策略表现进行了持续优化与动态调整。面对 2025 年市场整体上行但波动加大、风格轮动显著加快的环境，我们着力于提升模型在不同市场阶段的适应性与稳定性。策略升级主要围绕三个方向展开：一是深化基本面因子加工，引入更精细的数据处理与研究方法，强化对盈利复苏与增长质量的定价能力；二是持续扩充交易类因子体系，融合资金流、情绪指标等多维度实时数据，增强策略对短期市场变化的响应速度与灵活性；三是完善自动化因子挖掘与评估框架，通过系统化流程加速有效因子的发现与迭代，持续提升策略的竞争力和可持续性。这些贯穿全年的系统性改进，使投资组合能在较好控制风险暴露的同时，更敏锐地捕捉市场结构变化带来的超额收益机会。

### 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 54.55%，同期业绩比较基准收益率为 36.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年，我们认为中国经济将在宏观政策持续发力与微观主体信心修复的驱动下，继续保持稳健增长态势。国内市场有望延续震荡上行格局，结构性机会仍将大于整体性行情。我们将持续密切跟踪国内外政策边际变化、经济数据演进及产业趋势动向，动态优化组合结构，保持组合投资符合跟踪指数，力争为投资者创造可持续的超额收益。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2025 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，公司根据法律法规、监管政策的变化，结合业务发展及内部管控需要，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控制度和流程，进一步完善公司的内控体系，提升了公司的合规管理水平。

##### 二、严格落实法规和监管要求，强化各项业务合规管理

报告期内，公司认真落实《推动公募基金高质量发展行动方案》等重要法律法规，进一步健全内控管理及风险控制，合规审慎地开展业务。在投研交易管理方面，公司针对监管重点关注的问题不断升级管控措施，强化了证券池管理、新股申购、投资权限管理、程序化交易、佣金管理等重点领域的合规管控措施。在产品销售营销管理方面，公司着力加强廉洁从业风险防控，进一步规范营销宣传行为，加强对外发声管理和声誉风险管理，认真落实投资者适当性和反洗钱相关要求，不断深化投资者投诉处理和投资者教育工作。运营方面，公司完善了分红业务管控措施，进一步加强了信息系统权限管理，通过数智赋能日常运营管理各业务节点，确保内控措施有效落地。

##### 三、客观开展内外部内控评估，进一步完善内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司加强了各业务条线合规检查，并提升了重要业务环节的合规检查频率；在专项合规检查中，聚焦行业监管关注要点，加强在投研交、销售管理、廉洁从业等方面的检查；审计工作除了开展常规审计外，针对公司重要业务开展了专项内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请外部专业机构对公司开展了合规有效性评估和内部控制评价审计。通过内外部结合的合规检查、评估和审计，系统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认真整改，进一步健全了公司的内部控制体系。

##### 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，公司继续结合自身经营状况和业务特点，持续树立“合规创造价值”的

核心理念，进一步加强组织各类合规培训频率，及时对新颁布的法规、监管精神和公司要求进行宣导，内容覆盖投研交易、销售、运营、廉洁从业、员工行为等方面，以使员工切实领悟法规的精神实质，将法规落实到具体的业务、工作中。同时，通过优化培训内容、丰富培训形式，增强培训的针对性和实效性，进一步强化全员的合规自觉性与执行力。

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

自 2024 年 7 月 16 日至 2025 年 12 月 31 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 2600793 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 2025 年 12 月 31 日的资产负债表、2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的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 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度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和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，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 2025 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

## 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  
叶凯韵 侯雯

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2026 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：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	130,388.17	422,879.26
结算备付金		258,215.46	63,568.02
存出保证金		11,138.74	11,429.95
交易性金融资产	7.4.7.2	40,476,459.00	11,996,733.06
其中：股票投资		40,476,459.00	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		106,133.96	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	197,500.00	79,834.12
资产总计		41,179,835.33	13,076,484.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		47,612.55	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		15,015.41	3,463.32
应付托管费		3,003.06	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	91,720.46	795,052.21
负债合计		157,351.48	799,208.20
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	22,326,751.00	10,326,751.00
未分配利润	7.4.7.8	18,695,732.85	1,950,525.72
净资产合计		41,022,483.85	12,277,276.72
负债和净资产总计		41,179,835.33	13,076,484.92

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.8374 元，基金份额总额 22,326,751.00 份。

## 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 3 月 27 日 (基金合同生效 日) 至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		8,419,917.10	-6,415,477.55
1.利息收入		1,397.09	123,897.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	1,397.09	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）		7,681,500.99	-5,974,362.22
其中：股票投资收益	7.4.7.10	7,515,473.23	-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	166,027.76	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	705,526.89	-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	31,492.13	-170,334.78
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>125,113.52</b>	<b>332,164.39</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	104,082.05	117,959.47
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	20,816.47	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	215.00	190,193.18
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>8,294,803.58</b>	<b>-6,747,641.94</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>8,294,803.58</b>	<b>-6,747,641.94</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>8,294,803.58</b>	<b>-6,747,641.94</b>

### 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：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	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
三、本期增减变	12,000,000.00	-	16,745,207.13	28,745,207.13

动额（减少以“-”号填列）				3
（一）、综合收益总额	-	-	8,294,803.58	8,294,803.58
（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）	12,000,000.00	-	8,450,403.55	20,450,403.55
其中：1. 基金申购款	43,000,000.00	-	25,704,464.24	68,704,464.24
2. 基金赎回款	-31,000,000.00	-	-17,254,060.69	-48,254,060.69
（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	22,326,751.00	-	18,695,732.85	41,022,483.85
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 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	86,000,000.00	-	-5,467,274.70	80,532,725.3

购款				0
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	12,277,276.72

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 2026 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》(以下合称“企业会计准则”)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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

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 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及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度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。

#### 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》的规定，本基金收益分配应遵循下列原则：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；基金管理人可每月评估是否进行收益分配。当收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配；在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率进行计算，计算方法参见招募说明书；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。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》、财政部 税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、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》、财政部 税务总局公告 2025 第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》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。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	130,388.17	422,879.26
等于：本金	130,367.24	422,856.59
加：应计利息	20.93	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	130,388.17	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 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		40,165,609.70	-	40,476,459.00	310,849.30
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		40,165,609.70	-	40,476,459.00	310,849.30
项目		上年度末 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
----	---------------	---	---------------	-------------

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应收利息	-	-
其他应收款	197,500.00	79,834.12
待摊费用	-	-
合计	197,500.00	79,834.12

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 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	44,220.46	9,594.16
其中：交易所市场	44,220.46	9,594.16
银行间市场	-	-

应付利息	-	-
预提费用	47,500.00	144,262.30
应退退补款	-	641,195.75
合计	91,720.46	795,052.21

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 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	43,000,000.00	43,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-31,000,000.00	-31,000,000.00
本期末	22,326,751.00	22,326,751.00

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。

#### 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
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	7,589,276.69	705,526.89	8,294,803.58
本期基金份额交易产生的变动数	7,509,386.19	941,017.36	8,450,403.55
其中：基金申购款	24,474,197.52	1,230,266.72	25,704,464.24
基金赎回款	-16,964,811.33	-289,249.36	-17,254,060.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,143,768.01	551,964.84	18,695,732.85

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	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	746.65	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	628.28	111,206.38
其他	22.16	471.94
合计	1,397.09	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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	7,238,762.01	-1,146,235.15
股票投资收益——赎回差价收入	276,711.22	-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	7,515,473.23	-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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	279,499,033.97	220,363,324.67
减：卖出股票成本总额	271,978,547.06	220,996,895.57
减：交易费用	281,724.90	512,664.25
买卖股票差价收入	7,238,762.01	-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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 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	48,254,060.69	273,834,557.64
减：现金支付赎回款总额	17,879,034.69	95,193,245.64
减：赎回股票成本总额	30,098,314.78	183,620,399.35
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	276,711.22	-4,979,087.35

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31 日	上年度可比期间 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 纳增值税额	-	3,498.64
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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 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	166,027.76	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	166,027.76	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 2025年1月1日至2025年12月 31日	上年度可比期间 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	705,526.89	-394,677.59
——股票投资	705,526.89	-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	705,526.89	-394,677.59

## 7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 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	31,492.13	-170,807.01
其他收入	-	472.23
合计	31,492.13	-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 2025年1月1日至2025年12 月31日	上年度可比期间 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	-	-
银行划款手续费	215.00	365.00
开户费	-	400.00
IOPV 计算费	-	10,053.76
中登服务费	-	90,625.29
合计	215.00	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

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。

#### 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
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
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
上海国际集团有限公司	基金管理人的实际控制人

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：1、经中国证券监督管理委员会于 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。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。其中，本期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 12 月 31 日。

#### 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 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 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	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券	47,274,767.12	8.33%	588,551,037.88	100.00%
国泰海通证券	520,459,259.74	91.67%	-	-

###### 7.4.10.1.2 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。

###### 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 2025年1月1日至2025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	8,791.28	8.33%	-	-
国泰海通证券	96,764.24	91.67%	44,220.46	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。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》。

#### 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 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 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	104,082.05	117,959.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	10,703.04	454.53
应支付基金管理人的净管理费	93,379.01	117,504.94

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 x0.50%/当年天数。

### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年 12月31日	上年度可比期间 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	20,816.47	23,591.91

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 x0.10%/当年天数。

### 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

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

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

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

#### 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

### 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自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自有资金投资本基金。

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

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。

### 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 2025年1月1日至2025年12月31	上年度可比期间 2024年3月27日（基金合同生效
-------	----------------------------	------------------------------

	日		日) 至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商银行	130,388.17	746.65	422,879.26	12,218.72

#### 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。

#### 7.4.10.8 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。

#### 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（2025 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 2025 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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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 2025 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之内。

#### 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 2025 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（2024 年 12 月 31 日：无）。

#### 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上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上市公司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 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 2025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	130,388.17	-	-	-	130,388.17
结算备付金	258,215.46	-	-	-	258,215.46
存出保证金	11,138.74	-	-	-	11,138.74
交易性金融资产	-	-	-	40,476,459.00	40,476,459.00
应收清算款	-	-	-	106,133.96	106,133.96
其他资产	-	-	-	197,500.00	197,500.00
资产总计	399,742.37	-	-	40,780,092.96	41,179,835.33
负债					
应付清算款	-	-	-	47,612.55	47,612.55

应付管理人报酬	-	-	-	15,015.41	15,015.41
应付托管费	-	-	-	3,003.06	3,003.06
其他负债	-	-	-	91,720.46	91,720.46
负债总计	-	-	-	157,351.48	157,351.48
利率敏感度缺口	399,742.37	-	-	40,622,741.48	41,022,483.85
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。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 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)。

#### 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 2025 年 12 月 31 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	40,476,459.00	98.67	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	40,476,459.00	98.67	11,996,733.06	97.71

##### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
1.业绩比较基准上升 5%	2,438,661.86	751,113.06
2.业绩比较基准下降 5%	-2,438,661.86	-751,113.06

#### 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 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	40,476,459.00	11,985,891.06
第二层次	-	10,842.00
第三层次	-	-
合计	40,476,459.00	11,996,733.06

###### 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 2025 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(2024 年 12 月 31 日：无)。

##### 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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，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	40,476,459.00	98.29
	其中：股票	40,476,459.00	98.29
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	388,603.63	0.94
8	其他各项资产	314,772.70	0.76
9	合计	41,179,835.33	100.00

### 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,837,865.00	70.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,394,299.00	3.40
E	建筑业	469,077.00	1.14
F	批发和零售业	981,105.00	2.39
G	交通运输、仓储和邮政业	384,852.00	0.94
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,508,700.00	6.12
J	金融业	5,961.00	0.01
K	房地产业	530,421.00	1.29
L	租赁和商务服务业	187,926.00	0.46
M	科学研究和技术服务业	841,562.00	2.05
N	水利、环境和公共设施管理业	651,033.00	1.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	345,270.00	0.84
R	文化、体育和娱乐业	407,342.00	0.99
S	综合	-	-
	合计	37,545,413.00	91.52

### 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	-	-
C	制造业	1,847,094.00	4.50
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	163,572.00	0.40

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	557,100.00	1.36
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	240,532.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	122,748.00	0.30
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	2,931,046.00	7.14

### 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	300219	鸿利智汇	44,500	320,845.00	0.78
2	603787	新日股份	22,400	314,944.00	0.77
3	300206	理邦仪器	24,100	308,239.00	0.75
4	688299	长阳科技	18,100	306,252.00	0.75
5	300025	华星创业	51,600	297,216.00	0.72
6	002664	信质集团	11,900	285,124.00	0.70
7	002556	辉隆股份	47,100	284,484.00	0.69
8	300566	激智科技	15,500	284,425.00	0.69
9	300032	金龙机电	52,300	280,851.00	0.68
10	688678	福立旺	11,600	280,488.00	0.68
11	688373	盟科药业	46,400	280,256.00	0.68
12	002955	鸿合科技	9,100	275,457.00	0.67
13	002587	奥拓电子	40,400	273,104.00	0.67
14	000601	韶能股份	58,000	272,600.00	0.66
15	300550	和仁科技	18,700	271,337.00	0.66

16	603520	司太立	28,300	266,020.00	0.65
17	002016	世荣兆业	45,600	263,568.00	0.64
18	603330	天洋新材	36,300	262,812.00	0.64
19	688386	泛亚微透	3,000	262,800.00	0.64
20	002838	道恩股份	10,900	262,472.00	0.64
21	301210	金杨精密	7,200	262,080.00	0.64
22	301322	绿通科技	9,500	261,060.00	0.64
23	301419	阿莱德	7,600	257,488.00	0.63
24	300858	科拓生物	15,300	256,581.00	0.63
25	605258	协和电子	8,200	256,414.00	0.63
26	300616	尚品宅配	18,400	256,312.00	0.62
27	688210	统联精密	4,600	254,472.00	0.62
28	603289	泰瑞机器	25,100	254,012.00	0.62
29	000026	飞亚达	15,500	253,890.00	0.62
30	300916	朗特智能	7,700	252,406.00	0.62
31	688201	信安世纪	17,200	251,636.00	0.61
32	002768	国恩股份	4,700	247,596.00	0.60
33	002367	康力电梯	30,700	247,442.00	0.60
34	300365	恒华科技	39,000	246,480.00	0.60
35	301038	深水规院	10,500	246,225.00	0.60
36	603617	君禾股份	32,400	244,296.00	0.60
37	603081	大丰实业	17,400	244,122.00	0.60
38	688059	华锐精密	3,100	243,970.00	0.59
39	688799	华纳药厂	5,100	243,270.00	0.59
40	000919	金陵药业	30,500	242,475.00	0.59
41	688378	奥来德	8,800	240,240.00	0.59
42	688428	诺诚健华	11,700	240,084.00	0.59
43	603776	永安行	13,400	239,592.00	0.58
44	301216	万凯新材	14,200	239,412.00	0.58
45	300956	英力股份	14,300	237,952.00	0.58
46	300571	平治信息	8,600	237,790.00	0.58
47	301285	鸿日达	3,500	237,230.00	0.58
48	002533	金杯电工	19,000	237,120.00	0.58
49	603687	大胜达	24,700	235,391.00	0.57
50	000922	佳电股份	17,100	235,296.00	0.57
51	300994	久祺股份	14,900	235,271.00	0.57
52	688383	新益昌	3,000	234,810.00	0.57
53	300806	斯迪克	7,600	233,624.00	0.57
54	600249	两面针	40,600	233,450.00	0.57
55	000531	穗恒运 A	36,300	232,683.00	0.57
56	300664	鹏鹞环保	43,400	232,624.00	0.57
57	603105	芯能科技	25,300	232,507.00	0.57
58	603489	八方股份	7,600	232,408.00	0.57
59	601599	浙文影业	58,300	232,034.00	0.57

60	603126	中材节能	34,500	231,840.00	0.57
61	002552	宝鼎科技	14,000	231,140.00	0.56
62	300689	澄天伟业	5,100	229,245.00	0.56
63	002574	明牌珠宝	40,700	228,734.00	0.56
64	300950	德固特	10,000	228,600.00	0.56
65	300267	尔康制药	67,000	228,470.00	0.56
66	300590	移为通信	18,000	228,240.00	0.56
67	688159	有方科技	4,700	227,198.00	0.55
68	300945	曼卡龙	14,000	226,240.00	0.55
69	002062	宏润建设	24,100	222,925.00	0.54
70	688577	浙海德曼	2,300	222,778.00	0.54
71	600262	北方股份	8,500	221,255.00	0.54
72	300195	长荣股份	27,600	221,076.00	0.54
73	300461	田中精机	11,500	219,420.00	0.53
74	300381	溢多利	33,600	219,072.00	0.53
75	002483	润邦股份	30,600	218,484.00	0.53
76	000782	恒申新材	44,000	218,240.00	0.53
77	301266	宇邦新材	6,000	218,100.00	0.53
78	603577	汇金通	20,600	216,712.00	0.53
79	300922	天秦装备	9,400	214,978.00	0.52
80	600288	大恒科技	14,300	214,214.00	0.52
81	603006	联明股份	16,300	213,856.00	0.52
82	300018	中元股份	19,300	212,300.00	0.52
83	002886	沃特股份	9,700	210,684.00	0.51
84	300389	艾比森	12,900	209,367.00	0.51
85	002376	新北洋	27,000	208,440.00	0.51
86	688181	八亿时空	6,400	206,848.00	0.50
87	300909	汇创达	4,300	206,830.00	0.50
88	002918	蒙娜丽莎	14,400	204,912.00	0.50
89	300412	迦南科技	38,100	203,835.00	0.50
90	600796	钱江生化	33,600	203,616.00	0.50
91	688219	会通股份	16,200	201,204.00	0.49
92	000920	沃顿科技	16,000	199,200.00	0.49
93	603200	上海洗霸	2,800	199,192.00	0.49
94	600212	绿能慧充	24,700	198,835.00	0.48
95	301052	果麦文化	5,200	198,588.00	0.48
96	300976	达瑞电子	3,300	198,231.00	0.48
97	603116	红蜻蜓	32,200	197,386.00	0.48
98	603607	京华激光	7,200	196,560.00	0.48
99	300382	斯莱克	12,600	196,056.00	0.48
100	301330	熵基科技	5,900	194,995.00	0.48
101	600052	东望时代	41,300	194,523.00	0.47
102	002899	英派斯	7,100	194,327.00	0.47
103	603990	麦迪科技	12,800	194,176.00	0.47

104	603969	银龙股份	19,000	192,090.00	0.47
105	002663	普邦股份	100,800	190,512.00	0.46
106	300951	博硕科技	5,500	188,925.00	0.46
107	002172	澳洋健康	47,400	188,178.00	0.46
108	605050	福然德	13,800	185,886.00	0.45
109	001219	青岛食品	12,500	178,125.00	0.43
110	000011	深物业 A	19,700	177,497.00	0.43
111	688388	嘉元科技	4,300	176,214.00	0.43
112	002940	昂利康	5,200	174,304.00	0.42
113	002290	禾盛新材	3,500	159,950.00	0.39
114	300143	盈康生命	15,900	157,092.00	0.38
115	688191	智洋创新	4,700	151,246.00	0.37
116	300739	明阳电路	8,000	147,040.00	0.36
117	002527	新时达	8,200	145,468.00	0.35
118	003025	思进智能	9,900	142,263.00	0.35
119	688707	振华新材	10,000	138,500.00	0.34
120	002731	萃华珠宝	10,700	134,392.00	0.33
121	000576	甘化科工	12,700	133,731.00	0.33
122	603660	苏州科达	12,100	133,463.00	0.33
123	300162	雷曼光电	16,300	132,519.00	0.32
124	002923	润都股份	10,900	132,435.00	0.32
125	600230	沧州大化	8,500	129,710.00	0.32
126	301007	德迈仕	3,200	129,664.00	0.32
127	300005	探路者	11,900	128,877.00	0.31
128	002438	江苏神通	7,900	125,610.00	0.31
129	688531	日联科技	1,900	125,457.00	0.31
130	300587	天铁科技	20,300	124,439.00	0.30
131	301337	亚华电子	4,500	123,795.00	0.30
132	300302	同有科技	6,800	123,352.00	0.30
133	603275	众辰科技	2,700	123,066.00	0.30
134	600626	申达股份	25,400	122,682.00	0.30
135	002406	远东传动	15,300	121,482.00	0.30
136	300872	天阳科技	5,900	121,304.00	0.30
137	002386	天原股份	22,300	121,089.00	0.30
138	002937	兴瑞科技	5,100	120,360.00	0.29
139	300559	佳发教育	9,500	119,795.00	0.29
140	605168	三人行	3,100	119,598.00	0.29
141	002117	东港股份	8,600	118,766.00	0.29
142	000852	石化机械	16,200	117,774.00	0.29
143	603270	金帝股份	4,300	116,229.00	0.28
144	300863	卡倍亿	2,300	115,920.00	0.28
145	603950	长源东谷	4,000	115,800.00	0.28
146	002454	松芝股份	13,200	114,972.00	0.28
147	605196	华通线缆	3,300	114,642.00	0.28

148	301157	华塑科技	2,200	114,444.00	0.28
149	001258	立新能源	16,000	113,760.00	0.28
150	603901	永创智能	8,000	113,600.00	0.28
151	002282	博深股份	15,400	113,190.00	0.28
152	603004	鼎龙科技	4,800	112,656.00	0.27
153	300700	岱勒新材	9,100	112,385.00	0.27
154	002440	闰土股份	14,900	111,303.00	0.27
155	300940	南极光	3,900	110,994.00	0.27
156	688222	成都先导	4,700	110,215.00	0.27
157	002137	实益达	12,800	109,824.00	0.27
158	605056	咸亨国际	6,600	108,900.00	0.27
159	601226	华电科工	13,600	106,624.00	0.26
160	300452	山河药辅	7,800	104,364.00	0.25
161	001205	盛航股份	6,100	104,310.00	0.25
162	603848	好太太	5,700	104,139.00	0.25
163	002106	莱宝高科	9,400	103,024.00	0.25
164	688598	金博股份	3,300	96,888.00	0.24
165	603191	望变电气	6,400	94,784.00	0.23
166	000548	湖南投资	17,400	94,656.00	0.23
167	301030	仕净科技	8,000	94,640.00	0.23
168	300222	科大智能	8,500	92,990.00	0.23
169	301382	蜂助手	2,600	92,144.00	0.22
170	002314	南山控股	31,200	88,920.00	0.22
171	002449	国星光电	10,500	88,830.00	0.22
172	300154	瑞凌股份	8,700	85,695.00	0.21
173	301388	欣灵电气	2,800	85,064.00	0.21
174	688556	高测股份	7,300	83,366.00	0.20
175	601798	蓝科高新	9,100	80,717.00	0.20
176	001896	豫能控股	15,400	80,080.00	0.20
177	002442	龙星科技	12,800	79,488.00	0.19
178	301257	普蕊斯	1,500	78,060.00	0.19
179	688071	华依科技	2,300	76,291.00	0.19
180	000911	广农糖业	10,400	76,024.00	0.19
181	301380	挖金客	2,000	75,600.00	0.18
182	000421	南京公用	10,900	75,319.00	0.18
183	300975	商络电子	5,900	74,871.00	0.18
184	603602	纵横通信	5,100	74,256.00	0.18
185	300388	节能国祯	9,200	73,968.00	0.18
186	300756	金马游乐	1,300	73,944.00	0.18
187	688085	三友医疗	4,100	73,882.00	0.18
188	603811	诚意药业	7,000	73,500.00	0.18
189	600613	神奇制药	12,100	73,447.00	0.18
190	605162	新中港	8,600	73,444.00	0.18
191	688401	路维光电	1,500	73,215.00	0.18

192	002616	长青集团	13,300	72,618.00	0.18
193	301051	信濠光电	3,700	72,520.00	0.18
194	301009	可靠股份	5,700	72,276.00	0.18
195	300790	宇瞳光学	2,400	71,784.00	0.17
196	002884	凌霄泵业	4,000	70,760.00	0.17
197	688167	炬光科技	400	70,028.00	0.17
198	002293	罗莱生活	6,800	69,836.00	0.17
199	688238	和元生物	10,300	68,598.00	0.17
200	002866	传艺科技	3,800	68,438.00	0.17
201	603373	安邦护卫	1,800	68,328.00	0.17
202	000978	桂林旅游	9,400	68,056.00	0.17
203	688195	腾景科技	400	67,820.00	0.17
204	603008	喜临门	3,300	67,584.00	0.16
205	688661	和林微纳	1,300	67,288.00	0.16
206	688259	创耀科技	1,600	66,880.00	0.16
207	688135	利扬芯片	2,400	66,624.00	0.16
208	301328	维峰电子	1,400	66,598.00	0.16
209	300636	同和药业	8,800	66,088.00	0.16
210	688512	慧智微	5,900	65,844.00	0.16
211	300583	赛托生物	4,800	65,712.00	0.16
212	688653	康希通信	5,400	65,610.00	0.16
213	603966	法兰泰克	5,500	65,450.00	0.16
214	600419	天润乳业	6,600	65,340.00	0.16
215	603917	合力科技	4,400	65,076.00	0.16
216	688079	美迪凯	5,700	64,524.00	0.16
217	300317	珈伟新能	16,800	64,512.00	0.16
218	688117	圣诺生物	1,700	64,243.00	0.16
219	003019	宸展光电	1,900	63,612.00	0.16
220	301132	满坤科技	1,900	63,270.00	0.15
221	002021	中捷资源	25,600	63,232.00	0.15
222	605580	恒盛能源	2,800	63,168.00	0.15
223	002298	中电鑫龙	5,900	61,596.00	0.15
224	301489	思泉新材	300	59,700.00	0.15
225	603098	森特股份	4,000	55,640.00	0.14
226	300318	博晖创新	8,800	55,176.00	0.13
227	300643	万通智控	2,400	46,656.00	0.11
228	002452	长高电新	5,500	45,265.00	0.11
229	000862	银星能源	7,400	43,216.00	0.11
230	688609	九联科技	4,100	41,861.00	0.10
231	002546	新联电子	5,700	39,843.00	0.10
232	600679	上海凤凰	2,700	36,261.00	0.09
233	002803	吉宏股份	2,000	32,720.00	0.08
234	002919	名臣健康	1,400	32,186.00	0.08
235	002437	誉衡药业	9,700	29,779.00	0.07

236	300291	百纳千成	1,900	14,231.00	0.03
237	603579	荣泰健康	500	11,905.00	0.03
238	603380	易德龙	300	11,400.00	0.03
239	301387	光大同创	200	11,080.00	0.03
240	002969	嘉美包装	800	10,128.00	0.02
241	002148	北纬科技	1,100	9,790.00	0.02
242	688207	格灵深瞳	600	9,120.00	0.02
243	300400	劲拓股份	400	7,920.00	0.02
244	001300	三柏硕	500	7,725.00	0.02
245	300911	亿田智能	200	6,660.00	0.02
246	301456	盘古智能	200	6,300.00	0.02
247	002284	亚太股份	400	5,972.00	0.01
248	600053	九鼎投资	300	5,961.00	0.01
249	688108	赛诺医疗	300	5,772.00	0.01
250	002523	天桥起重	1,300	5,577.00	0.01
251	300918	南山智尚	300	5,577.00	0.01
252	002380	科远智慧	200	5,440.00	0.01
253	600742	富维股份	500	5,000.00	0.01
254	603611	诺力股份	200	4,890.00	0.01
255	300709	精研科技	100	4,716.00	0.01
256	603035	常熟汽饰	300	4,641.00	0.01
257	601339	百隆东方	800	4,632.00	0.01
258	002033	丽江股份	500	4,575.00	0.01
259	600300	维维股份	1,300	4,563.00	0.01
260	002935	天奥电子	200	4,470.00	0.01
261	600982	宁波能源	900	3,906.00	0.01
262	002615	哈尔斯	500	3,835.00	0.01
263	301151	冠龙节能	200	3,760.00	0.01
264	002662	峰璟股份	900	3,618.00	0.01
265	300264	佳创视讯	500	3,355.00	0.01
266	002950	奥美医疗	300	3,276.00	0.01
267	300501	海顺新材	200	3,064.00	0.01
268	300491	通合科技	100	2,513.00	0.01
269	600684	珠江股份	100	436.00	0.00

### 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	688091	上海谊众	5,000	235,000.00	0.57
2	301555	惠柏新材	6,700	223,981.00	0.55
3	300243	瑞丰高材	21,100	220,073.00	0.54

4	603818	曲美家居	60,100	216,961.00	0.53
5	300789	唐源电气	9,300	213,900.00	0.52
6	300682	朗新集团	14,000	212,940.00	0.52
7	300204	舒泰神	7,700	210,364.00	0.51
8	688509	正元地信	36,100	198,189.00	0.48
9	688166	博瑞医药	3,700	181,522.00	0.44
10	300723	一品红	5,100	171,105.00	0.42
11	300464	星徽股份	25,800	163,572.00	0.40
12	603588	高能环境	15,900	122,748.00	0.30
13	301316	慧博云通	2,100	93,828.00	0.23
14	300779	惠城环保	700	91,077.00	0.22
15	600552	凯盛科技	6,000	74,400.00	0.18
16	002273	水晶光电	2,400	60,288.00	0.15
17	688690	纳微科技	2,300	59,363.00	0.14
18	688553	汇宇制药	3,000	53,370.00	0.13
19	002036	联创电子	4,500	49,590.00	0.12
20	301027	华蓝集团	2,300	42,343.00	0.10
21	300113	顺网科技	1,800	36,432.00	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	603787	新日股份	1,201,268.00	9.78
2	688800	瑞可达	1,037,773.73	8.45
3	603330	天洋新材	983,116.00	8.01
4	688588	凌志软件	934,842.04	7.61
5	603969	银龙股份	915,146.00	7.45
6	601339	百隆东方	895,315.00	7.29
7	601002	晋亿实业	874,258.00	7.12
8	603168	莎普爱思	843,930.00	6.87
9	603270	金帝股份	840,437.00	6.85
10	603173	福斯达	840,054.00	6.84
11	603289	泰瑞机器	822,707.70	6.70
12	688022	瀚川智能	791,063.43	6.44
13	600159	大龙地产	786,677.00	6.41
14	002799	环球印务	782,621.00	6.37
15	601996	丰林集团	765,304.00	6.23
16	600790	轻纺城	764,276.00	6.23
17	603429	集友股份	751,461.00	6.12

18	603890	春秋电子	737,958.00	6.01
19	688049	炬芯科技	737,309.85	6.01
20	300098	高新兴	730,748.00	5.95
21	603017	中衡设计	725,491.00	5.91
22	688182	灿勤科技	720,762.92	5.87
23	600983	惠而浦	719,041.00	5.86
24	605228	神通科技	714,997.00	5.82
25	688382	益方生物	714,335.75	5.82
26	002768	国恩股份	697,050.00	5.68
27	605118	力鼎光电	686,698.00	5.59
28	600960	渤海汽车	685,693.00	5.59
29	688428	诺诚健华	681,379.56	5.55
30	603166	福达股份	680,980.00	5.55
31	688143	长盈通	671,566.31	5.47
32	688550	瑞联新材	671,001.99	5.47
33	600620	天宸股份	668,617.00	5.45
34	603950	长源东谷	661,195.00	5.39
35	002345	潮宏基	659,854.00	5.37
36	603617	君禾股份	658,830.00	5.37
37	000717	中南股份	656,246.00	5.35
38	300389	艾比森	656,023.00	5.34
39	002838	道恩股份	654,405.00	5.33
40	605168	三人行	649,020.00	5.29
41	003027	同兴科技	642,095.00	5.23
42	300994	久祺股份	638,193.00	5.20
43	002556	辉隆股份	630,709.00	5.14
44	603665	康隆达	629,379.00	5.13
45	603004	鼎龙科技	623,046.00	5.07
46	301555	惠柏新材	620,954.00	5.06
47	688509	正元地信	620,497.82	5.05
48	300310	宜通世纪	619,092.00	5.04
49	688508	芯朋微	616,532.73	5.02
50	600742	富维股份	615,721.00	5.02
51	603191	望变电气	611,602.00	4.98
52	688093	世华科技	608,143.32	4.95
53	001216	华瓷股份	607,747.00	4.95
54	300464	星徽股份	595,138.00	4.85
55	688159	有方科技	590,944.76	4.81
56	002943	宇晶股份	589,602.10	4.80
57	600774	汉商集团	586,061.00	4.77
58	688668	鼎通科技	584,046.40	4.76
59	002367	康力电梯	582,141.00	4.74
60	002787	华源控股	580,319.05	4.73
61	688591	泰凌微	578,318.75	4.71

62	600288	大恒科技	570,727.00	4.65
63	600973	宝胜股份	569,729.00	4.64
64	603489	八方股份	566,905.12	4.62
65	688665	四方光电	565,664.15	4.61
66	002206	海利得	555,395.00	4.52
67	603187	海容冷链	554,655.00	4.52
68	300975	商络电子	551,613.00	4.49
69	603278	大业股份	547,911.00	4.46
70	600982	宁波能源	547,620.00	4.46
71	002782	可立克	547,540.00	4.46
72	300556	丝路视觉	545,061.00	4.44
73	300553	集智股份	542,646.70	4.42
74	600292	远达环保	541,504.00	4.41
75	301118	恒光股份	541,031.00	4.41
76	000957	中通客车	540,600.00	4.40
77	000017	深中华 A	533,962.00	4.35
78	600203	福日电子	532,281.00	4.34
79	300469	信息发展	530,636.00	4.32
80	002181	粤传媒	528,903.00	4.31
81	301218	华是科技	525,502.00	4.28
82	301387	光大同创	525,213.00	4.28
83	600526	菲达环保	524,620.00	4.27
84	301388	欣灵电气	524,242.00	4.27
85	300636	同和药业	520,536.00	4.24
86	002803	吉宏股份	519,655.00	4.23
87	603818	曲美家居	519,359.00	4.23
88	601116	三江购物	516,604.00	4.21
89	301365	矩阵股份	514,632.00	4.19
90	605258	协和电子	514,507.00	4.19
91	600367	红星发展	513,590.00	4.18
92	601226	华电科工	512,971.00	4.18
93	600105	永鼎股份	511,971.00	4.17
94	300400	劲拓股份	511,631.00	4.17
95	002303	美盈森	511,014.00	4.16
96	002574	明牌珠宝	509,236.00	4.15
97	301281	科源制药	504,907.00	4.11
98	600336	澳柯玛	503,778.00	4.10
99	000159	国际实业	502,452.00	4.09
100	000635	英力特	501,556.00	4.09
101	300940	南极光	498,670.00	4.06
102	002344	海宁皮城	497,100.00	4.05
103	002989	中天精装	494,526.00	4.03
104	300667	必创科技	494,354.00	4.03
105	301382	蜂助手	492,134.00	4.01

106	688089	嘉必优	490,198.41	3.99
107	300988	津荣天宇	488,219.00	3.98
108	000726	鲁泰 A	486,477.00	3.96
109	300652	雷迪克	481,239.00	3.92
110	688299	长阳科技	480,832.69	3.92
111	300566	激智科技	480,181.00	3.91
112	002284	亚太股份	479,324.00	3.90
113	002576	通达动力	476,914.00	3.88
114	603006	联明股份	475,894.00	3.88
115	300206	理邦仪器	469,328.00	3.82
116	688661	和林微纳	468,495.15	3.82
117	688108	赛诺医疗	467,266.98	3.81
118	002663	普邦股份	465,594.00	3.79
119	688313	仕佳光子	463,119.73	3.77
120	688103	国力电子	461,817.28	3.76
121	002723	小崧股份	461,057.00	3.76
122	002887	绿茵生态	455,441.00	3.71
123	300341	麦克奥迪	455,132.00	3.71
124	603990	麦迪科技	454,673.00	3.70
125	688181	八亿时空	454,637.08	3.70
126	603267	鸿远电子	453,587.00	3.69
127	000715	中兴商业	453,574.00	3.69
128	688222	成都先导	453,329.54	3.69
129	603897	长城科技	452,806.00	3.69
130	603038	华立股份	452,694.00	3.69
131	300616	尚品宅配	452,439.00	3.69
132	600106	重庆路桥	451,991.00	3.68
133	301603	乔锋智能	449,825.00	3.66
134	300519	新光药业	449,784.00	3.66
135	301159	三维天地	449,639.00	3.66
136	300365	恒华科技	448,022.00	3.65
137	300230	永利股份	447,272.00	3.64
138	603966	法兰泰克	447,057.00	3.64
139	688531	日联科技	446,895.67	3.64
140	002483	润邦股份	444,192.00	3.62
141	600830	香溢融通	444,023.00	3.62
142	300112	万讯自控	442,659.00	3.61
143	300756	金马游乐	439,074.00	3.58
144	688365	光云科技	438,484.27	3.57
145	001300	三柏硕	437,394.00	3.56
146	002290	禾盛新材	436,645.00	3.56
147	301507	民生健康	435,791.00	3.55
148	300985	致远新能	435,446.00	3.55
149	000955	欣龙控股	435,344.00	3.55

150	301030	仕净科技	433,161.20	3.53
151	603373	安邦护卫	433,122.00	3.53
152	002527	新时达	431,551.00	3.52
153	300615	欣天科技	431,523.00	3.51
154	300264	佳创视讯	431,434.00	3.51
155	300990	同飞股份	428,167.00	3.49
156	301285	鸿日达	428,001.00	3.49
157	300709	精研科技	426,312.00	3.47
158	300805	电声股份	423,819.00	3.45
159	300771	智莱科技	421,777.00	3.44
160	300643	万通智控	420,998.00	3.43
161	301548	崇德科技	419,661.00	3.42
162	300583	赛托生物	417,470.00	3.40
163	300707	威唐工业	416,158.00	3.39
164	688015	交控科技	415,477.16	3.38
165	301099	雅创电子	415,273.40	3.38
166	600135	乐凯胶片	414,379.00	3.38
167	300850	新强联	413,591.00	3.37
168	000828	东莞控股	412,006.00	3.36
169	300381	溢多利	409,996.00	3.34
170	000501	武商集团	407,549.00	3.32
171	600590	泰豪科技	405,874.00	3.31
172	002106	莱宝高科	403,980.00	3.29
173	601599	浙文影业	403,827.00	3.29
174	600067	冠城新材	402,228.00	3.28
175	300219	鸿利智汇	401,908.00	3.27
176	301337	亚华电子	397,275.00	3.24
177	000421	南京公用	396,680.00	3.23
178	300320	海达股份	393,762.00	3.21
179	300732	设研院	392,201.00	3.19
180	300606	金太阳	391,593.00	3.19
181	603200	上海洗霸	391,131.00	3.19
182	603098	森特股份	390,423.00	3.18
183	605069	正和生态	389,656.00	3.17
184	300723	一品红	388,326.00	3.16
185	603081	大丰实业	387,525.00	3.16
186	002533	金杯电工	387,362.00	3.16
187	300565	科信技术	386,730.00	3.15
188	605080	浙江自然	386,330.00	3.15
189	603577	汇金通	386,018.00	3.14
190	603111	康尼机电	385,735.00	3.14
191	688071	华依科技	385,676.29	3.14
192	603421	鼎信通讯	385,464.00	3.14
193	001219	青岛食品	384,274.00	3.13

194	002957	科瑞技术	383,608.00	3.12
195	600218	全柴动力	382,386.00	3.11
196	600714	金瑞矿业	381,584.00	3.11
197	002869	金溢科技	380,868.00	3.10
198	000532	华金资本	376,318.00	3.07
199	300909	汇创达	373,780.50	3.04
200	002712	思美传媒	373,694.00	3.04
201	002997	瑞鹄模具	372,365.00	3.03
202	300143	盈康生命	369,394.00	3.01
203	603095	越剑智能	367,441.00	2.99
204	600609	金杯汽车	366,914.00	2.99
205	301328	维峰电子	365,768.00	2.98
206	688378	奥来德	364,322.21	2.97
207	603315	福鞍股份	363,690.00	2.96
208	300571	平治信息	362,592.00	2.95
209	300267	尔康制药	362,060.00	2.95
210	688678	福立旺	362,007.08	2.95
211	002593	日上集团	361,962.00	2.95
212	600512	腾达建设	361,780.00	2.95
213	300500	启迪设计	360,611.00	2.94
214	300911	亿田智能	360,219.00	2.93
215	603788	宁波高发	357,867.00	2.91
216	000936	华西股份	357,619.00	2.91
217	600168	武汉控股	354,077.00	2.88
218	002825	纳尔股份	352,052.00	2.87
219	002587	奥拓电子	351,050.00	2.86
220	301529	福赛科技	349,619.00	2.85
221	002285	世联行	348,780.00	2.84
222	002250	联化科技	348,747.00	2.84
223	001256	炜冈科技	348,601.00	2.84
224	300792	壹网壹创	347,752.00	2.83
225	300025	华星创业	345,955.00	2.82
226	300473	德尔股份	345,540.00	2.81
227	001324	长青科技	345,511.00	2.81
228	301396	宏景科技	345,496.00	2.81
229	603687	大胜达	342,343.00	2.79
230	000833	粤桂股份	342,010.00	2.79
231	688166	博瑞医药	341,666.13	2.78
232	603116	红蜻蜓	341,482.00	2.78
233	300945	曼卡龙	341,419.00	2.78
234	600262	北方股份	339,026.00	2.76
235	002554	惠博普	338,983.00	2.76
236	300647	超频三	337,189.00	2.75
237	603565	中谷物流	335,476.00	2.73

238	688246	嘉和美康	334,995.34	2.73
239	002632	道明光学	334,984.00	2.73
240	003025	思进智能	333,104.00	2.71
241	600249	两面针	332,621.00	2.71
242	301246	宏源药业	332,249.00	2.71
243	688233	神工股份	331,338.93	2.70
244	688602	康鹏科技	331,051.48	2.70
245	300222	科大智能	330,541.00	2.69
246	603778	国晟科技	329,149.00	2.68
247	600785	新华百货	328,879.00	2.68
248	300682	朗新集团	328,867.00	2.68
249	688258	卓易信息	328,814.02	2.68
250	002170	芭田股份	328,676.00	2.68
251	300291	百纳千成	328,197.00	2.67
252	688298	东方生物	325,456.94	2.65
253	301011	华立科技	325,403.00	2.65
254	603380	易德龙	324,688.00	2.64
255	001222	源飞宠物	324,101.00	2.64
256	301330	熵基科技	324,002.00	2.64
257	688519	南亚新材	323,360.97	2.63
258	688059	华锐精密	323,139.02	2.63
259	300812	易天股份	320,956.00	2.61
260	003015	日久光电	320,903.00	2.61
261	603520	司太立	320,816.00	2.61
262	600419	天润乳业	320,457.00	2.61
263	300086	康芝药业	319,924.00	2.61
264	603105	芯能科技	319,902.00	2.61
265	300995	奇德新材	319,381.00	2.60
266	600210	紫江企业	319,306.00	2.60
267	300422	博世科	318,315.00	2.59
268	002293	罗莱生活	318,223.00	2.59
269	603776	永安行	317,594.00	2.59
270	300806	斯迪克	317,527.00	2.59
271	301216	万凯新材	316,898.00	2.58
272	603135	中重科技	316,626.00	2.58
273	300221	银禧科技	316,274.00	2.58
274	300243	瑞丰高材	315,536.00	2.57
275	300587	天铁科技	314,840.00	2.56
276	000862	银星能源	314,031.00	2.56
277	300491	通合科技	313,532.00	2.55
278	603126	中材节能	313,177.00	2.55
279	002807	江阴银行	313,120.00	2.55
280	688448	磁谷科技	311,004.09	2.53
281	000905	厦门港务	309,974.00	2.52

282	300056	中创环保	309,950.00	2.52
283	002849	威星智能	309,825.00	2.52
284	300872	天阳科技	308,431.00	2.51
285	301022	海泰科	307,846.00	2.51
286	001288	运机集团	307,618.00	2.51
287	301009	可靠股份	305,182.00	2.49
288	600053	九鼎投资	304,020.00	2.48
289	301038	深水规院	303,787.00	2.47
290	002918	蒙娜丽莎	303,436.00	2.47
291	688373	盟科药业	302,978.78	2.47
292	688238	和元生物	302,609.80	2.46
293	301196	唯科科技	302,560.00	2.46
294	300005	探路者	302,114.00	2.46
295	002084	海鸥住工	302,095.00	2.46
296	301052	果麦文化	301,822.00	2.46
297	301279	金道科技	300,841.00	2.45
298	300991	创益通	298,966.00	2.44
299	301221	光庭信息	298,856.00	2.43
300	301132	满坤科技	297,856.00	2.43
301	603615	茶花股份	297,710.00	2.42
302	301282	金禄电子	297,661.00	2.42
303	300505	川金诺	296,486.00	2.41
304	688288	鸿泉技术	296,240.03	2.41
305	300790	宇瞳光学	295,386.00	2.41
306	603508	思维列控	294,237.00	2.40
307	605060	联德股份	293,908.00	2.39
308	300532	今天国际	293,400.00	2.39
309	000922	佳电股份	292,864.00	2.39
310	300645	正元智慧	290,802.00	2.37
311	300950	德固特	290,675.00	2.37
312	603588	高能环境	290,197.00	2.36
313	002469	三维化学	289,291.00	2.36
314	300683	海特生物	288,651.00	2.35
315	603579	荣泰健康	287,613.00	2.34
316	600708	光明地产	287,256.00	2.34
317	688388	嘉元科技	286,986.76	2.34
318	300461	田中精机	286,732.00	2.34
319	301186	超达装备	286,379.00	2.33
320	300664	鹏鹞环保	286,165.00	2.33
321	600439	瑞贝卡	285,818.00	2.33
322	300916	朗特智能	285,771.00	2.33
323	301106	骏成科技	285,316.00	2.32
324	603273	天元智能	285,070.00	2.32
325	002016	世荣兆业	285,070.00	2.32

326	300032	金龙机电	284,764.00	2.32
327	300550	和仁科技	284,621.00	2.32
328	301083	百胜智能	284,588.00	2.32
329	002664	信质集团	284,238.00	2.32
330	301018	申菱环境	283,958.00	2.31
331	002373	千方科技	283,745.00	2.31
332	300412	迦南科技	283,488.00	2.31
333	001332	锡装股份	283,006.00	2.31
334	600386	北巴传媒	282,918.00	2.30
335	301419	阿莱德	281,872.00	2.30
336	603230	内蒙新华	281,546.00	2.29
337	603511	爱慕股份	280,655.00	2.29
338	300489	光智科技	280,642.00	2.29
339	301313	凡拓数创	280,245.00	2.28
340	000815	美利云	279,895.00	2.28
341	000576	甘化科工	279,657.00	2.28
342	600237	铜峰电子	279,382.00	2.28
343	301392	汇成真空	278,185.00	2.27
344	600469	风神股份	277,360.00	2.26
345	600630	龙头股份	277,106.00	2.26
346	301318	维海德	277,013.00	2.26
347	002671	龙泉股份	276,210.00	2.25
348	301258	富士莱	275,114.00	2.24
349	600268	国电南自	274,550.00	2.24
350	301263	泰恩康	273,204.00	2.23
351	300162	雷曼光电	271,954.00	2.22
352	603708	家家悦	271,161.00	2.21
353	688621	阳光诺和	270,952.98	2.21
354	603982	泉峰汽车	270,624.00	2.20
355	688256	寒武纪	269,610.00	2.20
356	002702	海欣食品	269,502.00	2.20
357	300382	斯莱克	269,362.00	2.19
358	605196	华通线缆	269,065.00	2.19
359	688189	南新制药	268,141.23	2.18
360	300920	润阳科技	267,842.00	2.18
361	600501	航天晨光	267,694.00	2.18
362	300928	华安鑫创	267,556.00	2.18
363	002441	众业达	267,478.00	2.18
364	000790	华神科技	267,313.00	2.18
365	000419	通程控股	266,658.00	2.17
366	603150	万朗磁塑	266,593.00	2.17
367	600817	宇通重工	265,766.00	2.16
368	603528	多伦科技	265,736.00	2.16
369	600684	珠江股份	265,672.00	2.16

370	300018	中元股份	265,192.00	2.16
371	301322	绿通科技	265,008.00	2.16
372	600284	浦东建设	264,595.00	2.16
373	301169	零点有数	264,329.00	2.15
374	300452	山河药辅	263,973.00	2.15
375	000919	金陵药业	263,533.00	2.15
376	300245	天玑科技	263,407.00	2.15
377	688091	上海谊众	263,380.78	2.15
378	688207	格灵深瞳	262,996.15	2.14
379	600241	时代万恒	262,957.00	2.14
380	300541	先进数通	262,801.00	2.14
381	600683	京投发展	262,531.00	2.14
382	603663	三祥新材	262,313.00	2.14
383	603602	纵横通信	262,124.00	2.14
384	300765	新诺威	261,902.00	2.13
385	300788	中信出版	261,801.00	2.13
386	300786	国林科技	261,432.00	2.13
387	002884	凌霄泵业	261,381.00	2.13
388	002376	新北洋	260,251.00	2.12
389	300976	达瑞电子	259,900.00	2.12
390	002437	誉衡药业	259,399.00	2.11
391	300968	格林精密	258,617.00	2.11
392	300879	大叶股份	258,084.00	2.10
393	000601	韶能股份	257,853.00	2.10
394	002137	实益达	257,603.00	2.10
395	002324	普利特	256,890.00	2.09
396	301210	金杨精密	256,721.00	2.09
397	688386	泛亚微透	256,490.54	2.09
398	300721	怡达股份	255,872.00	2.08
399	002449	国星光电	255,696.00	2.08
400	688158	优刻得	255,684.74	2.08
401	688581	安杰思	255,110.96	2.08
402	603901	永创智能	254,690.00	2.07
403	002955	鸿合科技	254,305.00	2.07
404	300154	瑞凌股份	253,370.00	2.06
405	301126	达嘉维康	251,920.00	2.05
406	300922	天秦装备	251,825.00	2.05
407	600665	天地源	251,652.00	2.05
408	688435	英方软件	251,606.55	2.05
409	002999	天禾股份	251,422.00	2.05
410	600819	耀皮玻璃	250,930.00	2.04
411	603936	博敏电子	250,909.00	2.04
412	600533	栖霞建设	249,894.00	2.04
413	688799	华纳药厂	249,611.12	2.03

414	002454	松芝股份	249,187.00	2.03
415	600052	东望时代	248,562.00	2.02
416	300443	金雷股份	247,653.00	2.02
417	300414	中光防雷	247,542.00	2.02
418	002638	勤上股份	247,404.00	2.02
419	300560	中富通	247,368.00	2.01
420	300195	长荣股份	247,334.00	2.01
421	000042	中洲控股	246,361.00	2.01
422	301119	正强股份	246,169.00	2.01
423	688035	德邦科技	245,702.93	2.00

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	688800	瑞可达	1,103,837.28	8.99
2	688588	凌志软件	989,008.45	8.06
3	603787	新日股份	905,861.00	7.38
4	601339	百隆东方	894,748.00	7.29
5	601002	晋亿实业	888,986.00	7.24
6	300469	信息发展	877,438.00	7.15
7	603429	集友股份	853,807.00	6.95
8	603168	莎普爱思	848,235.00	6.91
9	603173	福斯达	841,895.00	6.86
10	300098	高新兴	835,941.00	6.81
11	605228	神通科技	790,022.00	6.43
12	600159	大龙地产	786,152.00	6.40
13	688022	瀚川智能	785,920.88	6.40
14	603969	银龙股份	781,518.00	6.37
15	688049	炬芯科技	776,744.17	6.33
16	603890	春秋电子	772,602.00	6.29
17	601996	丰林集团	766,182.00	6.24
18	600960	渤海汽车	762,682.00	6.21
19	300990	同飞股份	760,016.00	6.19
20	603017	中衡设计	758,172.00	6.18
21	002989	中天精装	757,871.00	6.17
22	002787	华源控股	756,455.00	6.16
23	600790	轻纺城	749,786.00	6.11
24	002181	粤传媒	743,379.00	6.05
25	605118	力鼎光电	735,163.00	5.99

26	688550	瑞联新材	733,477.11	5.97
27	603330	天洋新材	729,456.00	5.94
28	603270	金帝股份	721,676.00	5.88
29	688508	芯朋微	716,944.12	5.84
30	002723	小崧股份	715,119.00	5.82
31	600983	惠而浦	712,697.00	5.81
32	688182	灿勤科技	711,637.50	5.80
33	688382	益方生物	708,106.12	5.77
34	300556	丝路视觉	701,293.00	5.71
35	600620	天宸股份	693,981.00	5.65
36	002799	环球印务	687,555.00	5.60
37	603166	福达股份	686,165.00	5.59
38	301118	恒光股份	686,155.00	5.59
39	688093	世华科技	680,150.80	5.54
40	002344	海宁皮城	679,062.00	5.53
41	003027	同兴科技	671,525.00	5.47
42	688668	鼎通科技	666,330.42	5.43
43	603665	康隆达	661,296.00	5.39
44	600742	富维股份	659,316.00	5.37
45	300400	劲拓股份	644,814.00	5.25
46	603950	长源东谷	632,641.00	5.15
47	000715	中兴商业	628,918.00	5.12
48	000501	武商集团	625,140.00	5.09
49	688143	长盈通	620,924.63	5.06
50	300519	新光药业	618,379.00	5.04
51	688591	泰凌微	615,985.66	5.02
52	300310	宜通世纪	615,959.00	5.02
53	600203	福日电子	615,105.00	5.01
54	300264	佳创视讯	604,805.00	4.93
55	002206	海利得	602,711.00	4.91
56	300988	津荣天宇	595,002.00	4.85
57	002782	可立克	590,385.00	4.81
58	002284	亚太股份	587,546.00	4.79
59	301387	光大同创	586,199.00	4.77
60	688665	四方光电	585,715.91	4.77
61	600973	宝胜股份	583,089.00	4.75
62	300112	万讯自控	582,938.00	4.75
63	600105	永鼎股份	575,608.00	4.69
64	002957	科瑞技术	575,434.00	4.69
65	001300	三柏硕	574,641.00	4.68
66	603289	泰瑞机器	574,591.00	4.68
67	603278	大业股份	574,539.00	4.68
68	000635	英力特	572,486.00	4.66
69	600367	红星发展	572,467.00	4.66

70	300771	智莱科技	572,432.00	4.66
71	600774	汉商集团	569,921.00	4.64
72	600292	远达环保	569,481.00	4.64
73	601116	三江购物	562,855.00	4.58
74	000717	中南股份	561,588.00	4.57
75	603191	望变电气	555,723.00	4.53
76	301388	欣灵电气	552,831.00	4.50
77	002576	通达动力	552,443.00	4.50
78	603187	海容冷链	550,463.00	4.48
79	300464	星徽股份	534,991.00	4.36
80	002943	宇晶股份	532,762.00	4.34
81	000936	华西股份	529,789.00	4.32
82	300341	麦克奥迪	528,897.00	4.31
83	600982	宁波能源	528,500.00	4.30
84	002838	道恩股份	527,042.00	4.29
85	301218	华是科技	526,035.00	4.28
86	688313	仕佳光子	525,607.67	4.28
87	605168	三人行	524,406.00	4.27
88	002702	海欣食品	521,241.00	4.25
89	000833	粤桂股份	520,885.00	4.24
90	600106	重庆路桥	520,790.00	4.24
91	600526	菲达环保	517,831.00	4.22
92	603004	鼎龙科技	516,576.00	4.21
93	300975	商络电子	510,153.00	4.16
94	300473	德尔股份	509,374.00	4.15
95	300732	设研院	507,266.00	4.13
96	000159	国际实业	504,727.00	4.11
97	603038	华立股份	503,209.00	4.10
98	000726	鲁泰 A	503,108.00	4.10
99	002290	禾盛新材	494,976.00	4.03
100	000042	中洲控股	494,531.00	4.03
101	300615	欣天科技	494,320.00	4.03
102	002869	金溢科技	493,615.00	4.02
103	300086	康芝药业	492,752.00	4.01
104	688089	嘉必优	491,901.02	4.01
105	688103	国力电子	491,032.97	4.00
106	300320	海达股份	490,889.00	4.00
107	000017	深中华 A	490,093.56	3.99
108	002345	潮宏基	488,291.00	3.98
109	301603	乔锋智能	487,581.00	3.97
110	300991	创益通	484,165.00	3.94
111	300389	艾比森	483,018.80	3.93
112	001216	华瓷股份	478,740.00	3.90
113	600336	澳柯玛	477,944.00	3.89

114	002285	世联行	477,890.00	3.89
115	000957	中通客车	476,139.00	3.88
116	301507	民生健康	474,880.00	3.87
117	300667	必创科技	474,375.00	3.86
118	002887	绿茵生态	471,645.00	3.84
119	002803	吉宏股份	471,139.00	3.84
120	603617	君禾股份	467,573.00	3.81
121	688108	赛诺医疗	464,630.34	3.78
122	000421	南京公用	463,371.00	3.77
123	300652	雷迪克	458,349.70	3.73
124	300850	新强联	458,251.00	3.73
125	002303	美盈森	456,926.00	3.72
126	688509	正元地信	456,802.78	3.72
127	603897	长城科技	454,389.41	3.70
128	301159	三维天地	452,816.00	3.69
129	603267	鸿远电子	449,144.00	3.66
130	000955	欣龙控股	448,747.00	3.66
131	300709	精研科技	448,317.00	3.65
132	688015	交控科技	442,737.33	3.61
133	300606	金太阳	441,084.00	3.59
134	000532	华金资本	440,857.00	3.59
135	300994	久祺股份	436,692.00	3.56
136	301281	科源制药	436,528.00	3.56
137	688365	光云科技	434,646.93	3.54
138	300985	致远新能	433,277.00	3.53
139	688661	和林微纳	433,170.25	3.53
140	301382	蜂助手	432,647.00	3.52
141	002953	日丰股份	432,505.00	3.52
142	300206	理邦仪器	430,136.00	3.50
143	601226	华电科工	429,712.00	3.50
144	600218	全柴动力	429,256.00	3.50
145	600830	香溢融通	428,110.00	3.49
146	600135	乐凯胶片	425,817.00	3.47
147	688428	诺诚健华	423,751.68	3.45
148	300805	电声股份	422,917.00	3.44
149	300241	瑞丰光电	422,220.00	3.44
150	600288	大恒科技	420,682.00	3.43
151	600067	冠城新材	417,452.00	3.40
152	301365	矩阵股份	415,916.50	3.39
153	002527	新时达	414,143.00	3.37
154	603421	鼎信通讯	411,319.00	3.35
155	688233	神工股份	411,171.76	3.35
156	002999	天禾股份	409,951.00	3.34
157	300879	大叶股份	409,585.00	3.34

158	301246	宏源药业	408,362.00	3.33
159	002997	瑞鹄模具	406,559.00	3.31
160	600590	泰豪科技	405,331.00	3.30
161	300701	森霸传感	404,079.00	3.29
162	300500	启迪设计	402,850.00	3.28
163	603788	宁波高发	402,263.00	3.28
164	000828	东莞控股	400,878.00	3.27
165	603111	康尼机电	400,106.00	3.26
166	002367	康力电梯	399,786.00	3.26
167	300911	亿田智能	395,068.00	3.22
168	603966	法兰泰克	394,650.00	3.21
169	300812	易天股份	394,607.00	3.21
170	301328	维峰电子	393,149.00	3.20
171	605080	浙江自然	387,171.00	3.15
172	002419	天虹股份	384,884.00	3.13
173	301313	凡拓数创	384,054.00	3.13
174	300491	通合科技	383,811.00	3.13
175	605069	正和生态	383,554.00	3.12
176	300291	百纳千成	383,409.00	3.12
177	300756	金马游乐	383,255.00	3.12
178	002823	凯中精密	379,547.00	3.09
179	300707	威唐工业	378,939.00	3.09
180	300647	超频三	378,726.00	3.08
181	001379	腾达科技	378,487.00	3.08
182	301030	仕净科技	378,458.00	3.08
183	002632	道明光学	378,278.00	3.08
184	603778	国晟科技	377,812.00	3.08
185	301396	宏景科技	377,668.00	3.08
186	300583	赛托生物	377,591.00	3.08
187	603095	越剑智能	375,760.60	3.06
188	603098	森特股份	374,774.80	3.05
189	003015	日久光电	374,500.00	3.05
190	301248	杰创智能	373,286.00	3.04
191	603315	福鞍股份	372,493.00	3.03
192	002825	纳尔股份	371,737.00	3.03
193	001324	长青科技	371,568.00	3.03
194	600714	金瑞矿业	368,950.00	3.01
195	300553	集智股份	366,970.62	2.99
196	300565	科信技术	366,483.00	2.99
197	002556	辉隆股份	366,376.00	2.98
198	603380	易德龙	366,293.00	2.98
199	002695	煌上煌	365,498.00	2.98
200	603373	安邦护卫	364,600.00	2.97
201	001256	炜冈科技	362,500.00	2.95

202	002768	国恩股份	359,569.00	2.93
203	301529	福赛科技	358,438.00	2.92
204	300940	南极光	357,514.00	2.91
205	002638	勤上股份	353,972.00	2.88
206	600168	武汉控股	353,753.00	2.88
207	688531	日联科技	353,599.22	2.88
208	002106	莱宝高科	353,335.00	2.88
209	600609	金杯汽车	352,723.00	2.87
210	300645	正元智慧	351,169.00	2.86
211	002712	思美传媒	349,767.00	2.85
212	301132	满坤科技	348,815.00	2.84
213	002250	联化科技	348,182.00	2.84
214	688246	嘉和美康	347,988.76	2.83
215	000419	通程控股	347,591.00	2.83
216	300230	永利股份	346,266.00	2.82
217	688222	成都先导	345,508.22	2.81
218	301099	雅创电子	344,219.20	2.80
219	300056	中创环保	344,115.00	2.80
220	300489	光智科技	343,210.00	2.80
221	300365	恒华科技	342,679.00	2.79
222	600785	新华百货	342,664.00	2.79
223	000815	美利云	342,443.00	2.79
224	600512	腾达建设	340,349.00	2.77
225	300616	尚品宅配	338,378.50	2.76
226	301282	金禄电子	335,051.00	2.73
227	688519	南亚新材	334,878.62	2.73
228	001288	运机集团	334,652.00	2.73
229	603565	中谷物流	334,535.00	2.72
230	002170	芭田股份	332,879.00	2.71
231	600237	铜峰电子	332,027.00	2.70
232	300995	奇德新材	331,592.00	2.70
233	688602	康鹏科技	331,477.29	2.70
234	300304	云意电气	328,745.00	2.68
235	603508	思维列控	327,789.00	2.67
236	301119	正强股份	326,480.00	2.66
237	301083	百胜智能	326,079.20	2.66
238	600053	九鼎投资	325,405.00	2.65
239	301548	崇德科技	324,899.00	2.65
240	300532	今天国际	324,794.00	2.65
241	300505	川金诺	324,610.00	2.64
242	300809	华辰装备	324,290.40	2.64
243	603135	中重科技	323,987.00	2.64
244	002523	天桥起重	323,283.00	2.63
245	688258	卓易信息	322,661.16	2.63

246	300375	鹏翎股份	322,608.00	2.63
247	301279	金道科技	322,560.40	2.63
248	688448	磁谷科技	322,453.69	2.63
249	301022	海泰科	321,397.00	2.62
250	688298	东方生物	320,911.74	2.61
251	600210	紫江企业	320,168.00	2.61
252	300959	线上线下	319,659.00	2.60
253	300643	万通智控	317,815.00	2.59
254	301392	汇成真空	317,183.00	2.58
255	300636	同和药业	316,942.00	2.58
256	001332	锡装股份	315,766.00	2.57
257	600268	国电南自	315,472.00	2.57
258	603489	八方股份	314,619.00	2.56
259	300786	国林科技	314,311.00	2.56
260	300683	海特生物	313,958.00	2.56
261	688071	华依科技	313,279.99	2.55
262	301555	惠柏新材	312,731.58	2.55
263	002593	日上集团	311,836.00	2.54
264	300928	华安鑫创	311,144.00	2.53
265	301020	密封科技	311,023.00	2.53
266	600246	万通发展	310,989.00	2.53
267	301106	骏成科技	310,785.00	2.53
268	003025	思进智能	310,777.26	2.53
269	002807	江阴银行	310,689.00	2.53
270	603615	茶花股份	310,053.00	2.53
271	300792	壹网壹创	309,907.00	2.52
272	300721	怡达股份	309,746.00	2.52
273	300245	天玑科技	307,731.00	2.51
274	002454	松芝股份	307,414.00	2.50
275	002324	普利特	306,511.00	2.50
276	688159	有方科技	305,278.96	2.49
277	301263	泰恩康	304,897.00	2.48
278	603006	联明股份	304,513.00	2.48
279	001222	源飞宠物	304,479.00	2.48
280	301337	亚华电子	304,452.00	2.48
281	300765	新诺威	304,272.00	2.48
282	002084	海鸥住工	304,112.00	2.48
283	605060	联德股份	304,038.00	2.48
284	300422	博世科	303,756.00	2.47
285	603936	博敏电子	303,317.00	2.47
286	002441	众业达	303,184.00	2.47
287	002373	千方科技	301,750.00	2.46
288	002671	龙泉股份	301,679.00	2.46
289	002380	科远智慧	300,329.00	2.45

290	300560	中富通	299,487.00	2.44
291	301151	冠龙节能	298,449.00	2.43
292	603150	万朗磁塑	298,432.00	2.43
293	300703	创源股份	298,424.00	2.43
294	002849	威星智能	297,338.00	2.42
295	600439	瑞贝卡	297,010.00	2.42
296	002293	罗莱生活	296,617.00	2.42
297	002296	辉煌科技	296,561.00	2.42
298	600665	天地源	295,439.00	2.41
299	300267	尔康制药	293,193.00	2.39
300	600284	浦东建设	292,163.00	2.38
301	600501	航天晨光	292,109.00	2.38
302	603273	天元智能	291,786.00	2.38
303	301018	申菱环境	290,737.00	2.37
304	002042	华孚时尚	289,968.00	2.36
305	002574	明牌珠宝	288,478.00	2.35
306	301221	光庭信息	288,391.00	2.35
307	600708	光明地产	288,261.00	2.35
308	603230	内蒙新华	286,107.00	2.33
309	301196	唯科科技	285,764.00	2.33
310	301318	维海德	284,815.00	2.32
311	301566	达利凯普	284,039.00	2.31
312	300788	中信出版	283,853.00	2.31
313	002554	惠博普	283,742.00	2.31
314	002483	润邦股份	283,493.00	2.31
315	002437	誉衡药业	283,373.00	2.31
316	600386	北巴传媒	283,190.00	2.31
317	600684	珠江股份	282,854.00	2.30
318	000790	华神科技	282,416.00	2.30
319	603528	多伦科技	280,614.00	2.29
320	300221	银禧科技	279,886.00	2.28
321	600469	风神股份	278,935.00	2.27
322	000862	银星能源	278,931.00	2.27
323	000701	厦门信达	278,253.00	2.27
324	301126	达嘉维康	277,742.00	2.26
325	002663	普邦股份	276,999.00	2.26
326	603706	东方环宇	276,007.00	2.25
327	300053	航宇微	275,960.00	2.25
328	603663	三祥新材	275,924.00	2.25
329	603708	家家悦	275,924.00	2.25
330	603600	永艺股份	275,869.00	2.25
331	603818	曲美家居	275,451.00	2.24
332	688288	鸿泉技术	274,850.36	2.24
333	603982	泉峰汽车	274,101.00	2.23

334	605305	中际联合	273,186.00	2.23
335	301285	鸿日达	272,956.00	2.22
336	600819	耀皮玻璃	272,801.00	2.22
337	002298	中电鑫龙	271,854.00	2.21
338	300443	金雷股份	271,557.00	2.21
339	301503	智迪科技	271,331.00	2.21
340	603511	爱慕股份	271,059.00	2.21
341	600630	龙头股份	270,926.00	2.21
342	300790	宇瞳光学	270,448.00	2.20
343	300541	先进数通	269,625.00	2.20
344	301169	零点有数	269,462.00	2.19
345	688256	寒武纪	269,204.00	2.19
346	603579	荣泰健康	269,183.00	2.19
347	300154	瑞凌股份	267,868.00	2.18
348	300110	华仁药业	267,346.00	2.18
349	300920	润阳科技	266,801.00	2.17
350	600683	京投发展	266,744.00	2.17
351	600817	宇通重工	265,931.00	2.17
352	002893	京能热力	265,751.00	2.16
353	301338	凯格精机	265,202.00	2.16
354	300978	东箭科技	265,051.00	2.16
355	688518	联赢激光	265,000.25	2.16
356	688158	优刻得	264,106.18	2.15
357	002968	新大正	263,757.00	2.15
358	688189	南新制药	263,688.91	2.15
359	601929	吉视传媒	263,520.00	2.15
360	600854	春兰股份	263,390.00	2.15
361	000905	厦门港务	263,297.00	2.14
362	301186	超达装备	262,946.00	2.14
363	688181	八亿时空	262,732.96	2.14
364	001229	魅视科技	262,647.00	2.14
365	301399	英特科技	262,452.00	2.14
366	301326	捷邦科技	261,673.00	2.13
367	000949	新乡化纤	260,739.00	2.12
368	001219	青岛食品	260,371.00	2.12
369	301258	富士莱	258,620.00	2.11
370	600241	时代万恒	257,829.00	2.10
371	688621	阳光诺和	257,642.21	2.10
372	002209	达意隆	257,079.00	2.09
373	600533	栖霞建设	255,999.00	2.09
374	603386	骏亚科技	255,652.00	2.08
375	300828	锐新科技	254,904.00	2.08
376	300680	隆盛科技	253,943.00	2.07
377	688253	英诺特	253,458.65	2.06

378	000802	北京文化	251,903.00	2.05
379	300872	天阳科技	251,591.00	2.05
380	300222	科大智能	251,558.00	2.05
381	300507	苏奥传感	250,246.00	2.04
382	301386	未来电器	250,220.00	2.04
383	600257	大湖股份	250,002.00	2.04
384	600351	亚宝药业	249,787.00	2.03
385	688035	德邦科技	249,211.68	2.03
386	300133	华策影视	248,977.00	2.03
387	300414	中光防雷	248,627.00	2.03
388	002469	三维化学	248,616.00	2.03
389	688435	英方软件	247,935.97	2.02
390	600853	龙建股份	247,787.00	2.02
391	688066	航天宏图	246,997.67	2.01
392	688207	格灵深瞳	246,982.68	2.01
393	002961	瑞达期货	246,433.00	2.01

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	288,234,992.89
卖出股票的收入（成交）总额	279,499,033.97

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	11,138.74
2	应收清算款	106,133.96
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	197,500.00
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	314,772.70
---	----	------------

#### 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
628	35,552.15	13,489,682.00	60.42%	8,837,069.00	39.58%

### 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	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 180 天最短持有期 1 号	1,585,500.00	7.10%
2	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 360 天最短持有期 1 号	1,492,600.00	6.69%
3	国信证券股份有限公司	1,388,400.00	6.22%

4	杭州稻达私募基金管理有限公司-稻达盛禾 2 号私募证券投资基金	1,309,700.00	5.87%
5	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	1,000,000.00	4.48%
6	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	835,000.00	3.74%
7	丁永源	833,800.00	3.73%
8	杭州稻达私募基金管理有限公司-稻达盛鑫 2 号私募证券投资基金	821,600.00	3.68%
9	杭州稻达私募基金管理有限公司-稻达盛鑫 1 号私募证券投资基金	763,100.00	3.42%
10	杭州稻达私募基金管理有限公司-稻达盛鑫 3 号私募证券投资基金	648,000.00	2.90%

### 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	7,000.00	0.0314%

### 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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## §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
--------------------------------	----------------

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	43,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	31,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,326,751.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本基金于 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。

### 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：

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。

### 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

报告期内，本基金未改聘为其审计的会计师事务所。本年度应支付的审计费用是 15,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的年限是 2 年。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	海富通基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 8 月 19 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	出具警示函
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作
受到处罚的依据	《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》
管理人采取整改措施的情况 (如提出整改意见)	已完成有关整改工作。
其他	-

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	4	520,459,259.74	91.67%	96,764.24	91.67%	-
海通证券	3	47,274,767.12	8.33%	8,791.28	8.33%	-

注：1、报告期内本基金增加国泰海通证券 1 个券商交易单元。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 12 月 31 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》。

### 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
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 12 月 31 日。

### 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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露	2025-02-13

	金一级交易商的公告	网站	
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	2025-04-11
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
17	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华西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	2025-07-08
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	2025-08-05
19	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	2025-08-25
20	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东方财富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	2025-08-27
21	海富通基金管理有限公司关于调整海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金收益分配原则并相应修改基金合同的公告	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	2025-08-27
22	海富通基金管理有限公司关于旗下部分公募基金产品风险等级变动的公告	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	2025-09-29
23	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部分券商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	2025-11-20
24	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变更场内简称的公告	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	2025-12-18

## 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	2025/6/9-2025/7/8	-	2,000,000.00	1,000,000.00	1,000,000.00	4.48%
	2	2025/3/7-2025/3/23,2025/3/26-2025/5/6,2025/6/12-2025/6/29	-	2,835,000.00	2,000,000.00	835,000.00	3.74%
	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	14,555,998.00	16,124,326.00	378,359.00	1.69%
	4	2025/3/6-2025/5/6,2025/5/8-2025/5/12	-	2,000,000.00	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。

### 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 134 只公募基金。截至 2025 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 2566 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。

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 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 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”。

2025 年 12 月，海富通国策导向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”。

## §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  
二〇二六年三月三十一日