

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金
2024 年年度报告
2024 年 12 月 31 日

基金管理人：海富通基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2024 年 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	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§ 4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
§ 5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	19
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	19
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	20
§ 6 审计报告	20
6.1 审计意见	20
6.2 形成审计意见的基础	20
6.3 其他信息	20
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	21
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	21
§ 7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表	22
7.2 利润表	24
7.3 净资产变动表	25
7.4 报表附注	27
§ 8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
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	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
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	81
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	82
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
8.12 投资组合报告附注	82
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	84
9.3 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	84
§ 10 开放式基金份额变动	84
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	85
11.4 基金投资策略的改变	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	86
11.8 其他重大事件	87
12 影响投资者决策的其他重要信息	89
§ 13 备查文件目录	91
13.1 备查文件目录	91
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	海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金	
基金简称	海富通沪深 300 增强	
基金主代码	004512	
交易代码	004512	
基金运作方式	契约型、开放式	
基金合同生效日	2019 年 10 月 9 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,122,697,834.03 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
下属分级基金的交易代码	004513	004512
报告期末下属分级基金的份 额总额	766,423,715.58 份	1,356,274,118.45 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制，力求实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金为增强型股票指数基金，以沪深 300 指数为标的指数。本基金以“指数化投资为主、主动性投资为辅”，在跟踪目标指数的基础上一定程度地调整投资组合，力争控制基金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 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%，以实现超越业绩比较基准的投资收益，谋求基金资产的长期增值。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%（税后）
风险收益特征	本基金为股票型基金，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。本基金为指数增强型基金，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。
--	--

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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	许俊
	联系电话	021-38650788	010-66596688
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		40088-40099	95566
传真		021-33830166	010-66594942
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	北京西城区复兴门内大街1 号
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	北京西城区复兴门内大街1 号
邮政编码		200120	100818
法定代表人		路颖	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.hftfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东城区东长安街1号东方广场毕马威大楼8层

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
本期已实现收益	57,297,447.42	106,137,584.84	-10,310,306.90	-4,084,169.11	-59,792,595.49	-31,307,100.04
本期利润	76,270,541.06	145,349,933.36	-8,803,069.19	-2,808,763.67	-58,851,563.02	-49,971,077.21
加权平均基金份额本期利润	0.2857	0.3292	-0.0788	-0.0649	-0.2813	-0.5142
本期加权平均净值利润率	26.03%	28.47%	-7.45%	-5.86%	-25.18%	-42.96%
本期基金份额净值增长率	22.20%	22.08%	-7.88%	-7.97%	-19.75%	-19.83%
3.1.2 期	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

末数据和指标	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
期末可供分配利润	-125,971,401.89	-172,156,938.84	-30,088,295.14	-9,032,086.10	-20,241,085.19	-7,834,527.08
期末可供分配基金份额利润	-0.1644	-0.1269	-0.2658	-0.2316	-0.1734	-0.1341
期末基金资产净值	908,829,694.84	1,676,633,516.34	109,863,238.29	39,491,654.81	122,957,990.39	64,283,744.03
期末基金份额净值	1.1858	1.2362	0.9704	1.0126	1.0534	1.1003
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
基金份额累计净值增长率	31.82%	31.19%	7.88%	7.46%	17.10%	16.77%

注：1. 本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2. 所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3. 期末可供分配利润,采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数(为期末余额,不是当期发生数)。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 海富通沪深 300 增强 A:

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	-0.03%	1.62%	-1.92%	1.65%	1.89%	-0.03%
过去六个月	15.70%	1.51%	13.05%	1.58%	2.65%	-0.07%
过去一年	22.20%	1.23%	14.04%	1.27%	8.16%	-0.04%
过去三年	-9.67%	1.13%	-19.21%	1.12%	9.54%	0.01%
过去五年	27.83%	1.20%	-3.24%	1.17%	31.07%	0.03%
自基金合同生效起至今	31.82%	1.18%	2.96%	1.15%	28.86%	0.03%

2. 海富通沪深 300 增强 C:

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	-0.06%	1.62%	-1.92%	1.65%	1.86%	-0.03%
过去六个月	15.64%	1.51%	13.05%	1.58%	2.59%	-0.07%
过去一年	22.08%	1.23%	14.04%	1.27%	8.04%	-0.04%
过去三年	-9.93%	1.13%	-19.21%	1.12%	9.28%	0.01%
过去五年	27.20%	1.20%	-3.24%	1.17%	30.44%	0.03%
自基金合同生效起至今	31.19%	1.18%	2.96%	1.15%	28.23%	0.03%

3.2.2 自基金转型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

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金
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

1. 海富通沪深 300 增强 A

(2019 年 10 月 9 日至 2024 年 12 月 31 日)



2. 海富通沪深 300 增强 C

(2019 年 10 月 9 日至 2024 年 12 月 31 日)



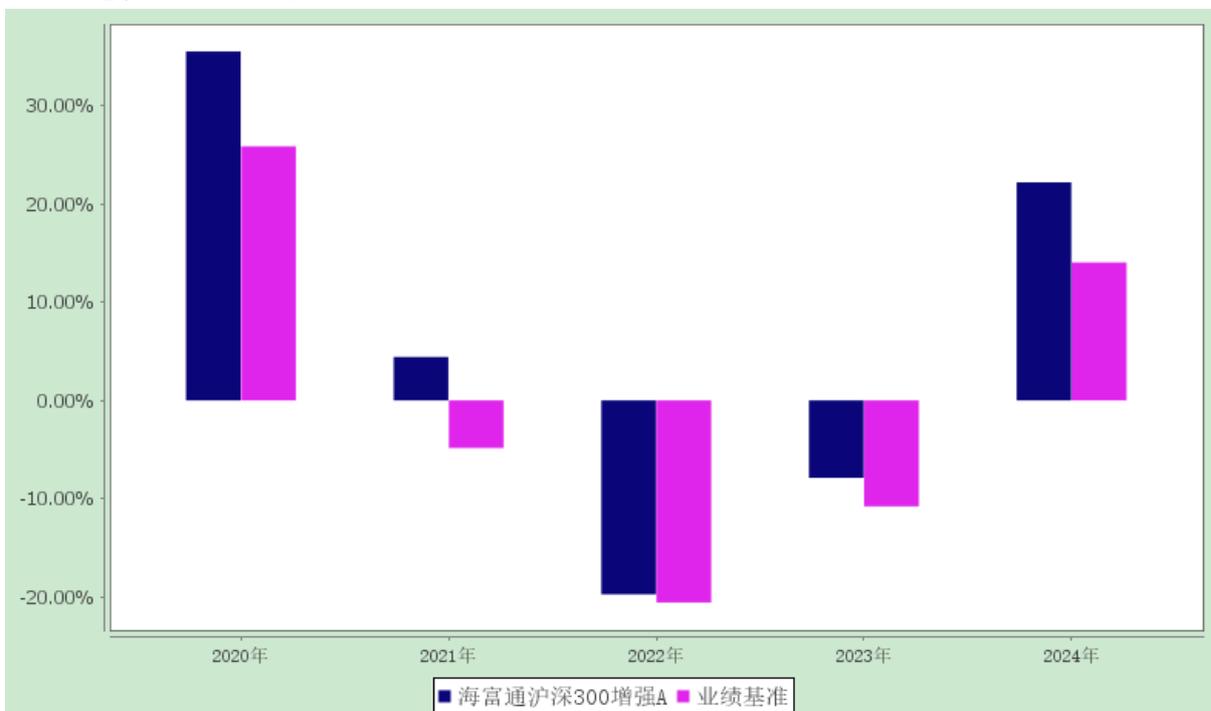
注：本基金转型日期为 2019 年 10 月 9 日。按照本基金合同规定，本基金建仓期为自基金合同转型生效之日起六个月。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

3.2.3 过去五年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

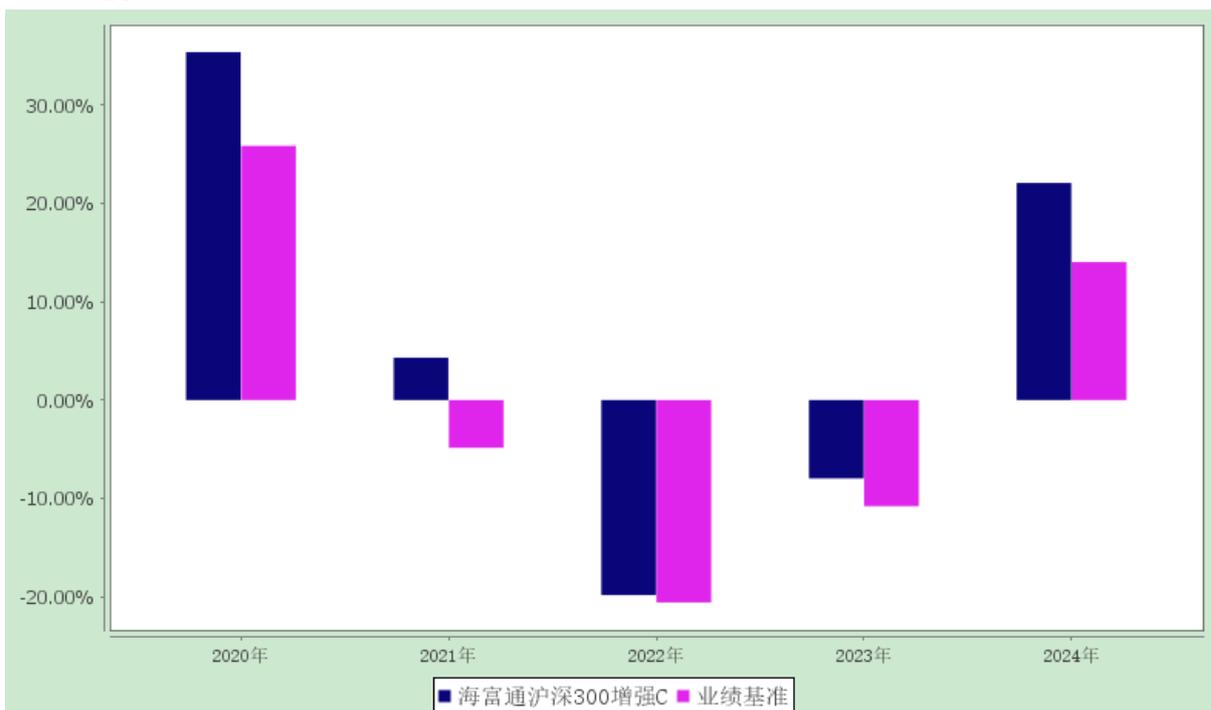
海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通沪深 300 增强 A



2. 海富通沪深 300 增强 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通沪深 300 增强 A:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

2、海富通沪深 300 增强 C:

单位：人民币元

年度	每 10 份基金 份额分 红数	现金形式发放 总额	再投资形式发放 总额	年度利润分配 合计	备注
2024 年	-	-	-	-	-
2023 年	-	-	-	-	-
2022 年	-	-	-	-	-
合计	-	-	-	-	-

注：本基金过去三年未发生利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

基金管理人海富通基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[2003]48 号文批准，由海通证券股份有限公司和富通基金管理公司（现更名为“法国巴黎资产管理 BE 控股公司”）于 2003 年 4 月 1 日共同发起设立。截至 2024 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 97 只公募基金：海富通精选证券投资基金、海富通收益增长证券投资基金、海富通货币市场证券投资基金、海富通股票混合型证券投资基金、海富通强化回报混合型证券投资基金、海富通风格优势混合型证券投资基金、海富通精选贰号混合型证券投资基金、海富通中国海外精选混合型证券投资基金、海富通稳健添利债券型证券投资基金、海富

通领先成长混合型证券投资基金、海富通中证 A100 指数证券投资基金（LOF）、海富通中小盘混合型证券投资基金、海富通稳固收益债券型证券投资基金、海富通国策导向混合型证券投资基金、海富通中证 500 指数增强型证券投资基金、海富通安颐收益混合型证券投资基金、海富通一年定期开放债券型证券投资基金、海富通内需热点混合型证券投资基金、海富通纯债债券型证券投资基金、上证城投债交易型开放式指数证券投资基金、海富通阿尔法对冲混合型发起式证券投资基金、海富通新内需灵活配置混合型证券投资基金、海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣益灵活配置混合型证券投资基金、海富通欣荣灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞丰债券型证券投资基金、海富通聚利纯债债券型证券投资基金、海富通集利纯债债券型证券投资基金、海富通全球美元收益债券型证券投资基金（LOF）、海富通沪港深灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞利纯债债券型证券投资基金、海富通欣享灵活配置混合型证券投资基金、海富通瑞合纯债债券型证券投资基金、海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金、海富通瑞福债券型证券投资基金、海富通瑞祥一年定期开放债券型证券投资基金、海富通添益货币市场基金、海富通聚优精选混合型基金中基金（FOF）、海富通量化先锋股票型证券投资基金、海富通融丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金、海富通恒丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通量化多因子灵活配置混合型证券投资基金、上证 10 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通弘丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通鼎丰定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通电子信息传媒产业股票型证券投资基金、海富通上海清算所中高等级短期融资券指数证券投资基金、海富通研究精选混合型证券投资基金、海富通稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通中短债债券型证券投资基金、海富通聚合纯债债券型证券投资基金、海富通上证 5 年期地方政府债交易型开放式指数证券投资基金、海富通先进制造股票型证券投资基金、海富通裕通 30 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通安益对冲策略灵活配置混合型证券投资基金、海富通平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、海富通科技创新混合型证券投资基金、海富通裕昇三年定期开放债券型证券投资基金、海富通瑞弘 6 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通富盈混合型证券投资基金、海富通富泽混合型证券投资基金、海富通上证投资级可转债及可交换债券交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金、海富通成长甄选混合型证券投资基金、海富通消费核心资产混合型证券投资基金、海富通成长价值混合型证券投资基金、海富通均衡甄选混合型证券投资基金、海富通惠睿精选混合型证券投资基金、海富通欣睿混合型证券投资基金、海富通消费优选混合型证券投资基金、海富通中债 1-3 年农发行债券指数证券投资基金、海富通策略收益债券型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、海富通利率债债券型证券投资基金、海富通富利三个月持有期混合型证券投资基金、海富通瑞兴 3 个月定期开放债券型证券投资基金、海富通欣利混合型证券投资基金、海富通碳中和主题混合型证券投资基金、海富通成长领航混合型证券投资基金、海富通养老目标日期 2035 三年持有期混合型发起式基

金中基金（FOF）、海富通恒益金融债一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通盈丰一年定期开放债券型发起式证券投资基金、海富通添利收益一年持有期债券型证券投资基金、海富通悦享一年持有期混合型证券投资基金、海富通产业优选混合型证券投资基金、海富通瑞鑫 30 天持有期债券型证券投资基金、海富通优势驱动混合型证券投资基金、海富通 ESG 领先股票型证券投资基金、海富通中债 0-2 年政策性金融债指数证券投资基金、海富通欣盈 6 个月持有期混合型证券投资基金、海富通中证 2000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、海富通中证汽车零部件主题交易型开放式指数证券投资基金、海富通红利优选混合型证券投资基金、海富通中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、海富通数字经济混合型证券投资基金、海富通量化选股混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券从 业年限	说明
		任职日期	离任日期		
朱斌全	本基金的基金经理	2019-10-15	-	17 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。2005 年 7 月至 2006 年 8 月任上海涅柔斯投资管理有限公司美股交易员。2007 年 4 月加入海富通基金管理有限公司，历任交易员、高级交易员、量化分析师、投资经理、基金经理助理。2018 年 11 月至 2022 年 8 月任海富通阿尔法对冲混合基金经理。2019 年 10 月至 2022 年 12 月兼任海富通富祥混合基金经理。2019 年 10 月起兼任海富通沪深 300 增强（原海富通富睿混合）、海富通量化多因子混合及海富通欣益混合的基金经理。2020 年 10 月起兼任海富通欣享混合的基金经理。2020 年 10 月至 2022 年 8 月兼任海富通新内需混合基金经理。2022 年 8 月起兼任海富通安益对冲混合基金经理。2022 年 12 月至 2024 年 4 月兼任海富通量化先锋股票、海富通中证 500 增强基金

					经理。2024 年 3 月起兼任海富通中证 2000 增强策略 ETF 基金经理。
孙恂	本基金的基金经理助理	2024-10-11	-	2 年	统计学硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Dataline Inc. 数据科学家、Freedom Mortgage Inc. 数据科学家、摩根大通银行资深数据科学家、支付宝网络技术有限公司风险策略专家。2022 年 5 月加入海富通基金管理有限公司，任量化研究员。2024 年 10 月起兼任海富通安益对冲混合、海富通沪深 300 增强基金经理助理。
林立禾	本基金的基金经理	2023-11-23	-	6 年	美国密歇根大学定量金融与风险管理硕士，持有基金从业人员资格证书。历任中欧基金管理有限公司风险管理部量化风控岗。2020 年 8 月加入海富通基金管理有限公司，历任量化研究员、量化投资部基金经理助理。2023 年 11 月起任海富通欣益混合、海富通富利三个月持有、海富通沪深 300 增强的基金经理。2024 年 10 月起兼任海富通量化多因子混合基金经理。

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

2、证券从业年限的计算标准：自参加证券行业的相关工作开始计算。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》等法律法规的具体要求，持续完善了公司投

资交易业务流程和公平交易制度。制度和流程覆盖了一级市场和二级市场的所有投资交易管理活动以及公司内部的证券分配，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。同时，公司投资交易业务组织架构保证了各投资组合投资决策相对独立，确保其在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

报告期内，公司对旗下所有投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异进行了分析，并采集了连续四个季度期间内、不同时间窗下（如 1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合同向交易的样本，对其进行了 95% 置信区间，假设溢价率为 0 的 T 分布检验，结合该时间窗下组合互相之间的模拟输送金额、贡献度、交易占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

2024 年，国内经济整体维持弱修复状态，实际 GDP 同比实现 5% 增长，高于 2022-2023 年的复合增速 4.3%。物价也保持相对平稳，全年居民消费价格指数同比上涨 0.2%。从节奏上看，年初经济实现开门红，二季度经济增长开始放缓。但是，随着 9 月 24 日以来一系列宏观政策持续加码，市场信心开始回暖，房地产成交显著放量，居民消费开始好转，股市也震荡走强，最终四季度实际 GDP 实现了 5.4% 的增长。

海外经济方面，2024 年美国积极的财政和宽松的货币政策共同支撑其国内经济。随着美国通胀开始降温，9 月美联储启动了降息，年内累计降息 100BP，2024 财年财政赤字率达到了 6.6%，高于 2023 年的 6.2%。在宽松货币政策和积极财政政策下，短期美国经济还难言衰退。此外，特朗普赢得了美国总统大选，需要关注未来中美关系及特朗普对华政策变化。

从 A 股市场看，全年市场震荡走高。2024 年，上证指数涨幅为 12.7%，沪深 300 为 14.7%，中证 800 为 12.2%。其中，924 以来中小成长风格弹性更大，创业板指涨幅为 39.9%，中证 1000 为 33.3%，中证 800 为 23.7%。行业板块方面，根据中信一级行业

分类，2024 年表现靠前的板块是银行、非银、家电、通信、交运，靠后的板块是医药、农林牧渔、消费者服务、房地产、食品饮料。其中，924 以来成长行业表现更强，计算机、商贸零售、电子、综合金融和传媒涨幅靠前。总体而言，全年市场结构性机会不少，中小成长和红利策略轮流表现占优，前期主要是高股息红利相关行业走强，924 新政以后 TMT 相关科技板块表现更好。

本报告期内，本基金在股票策略上以机器学习和深度学习策略为核心架构的沪深 300 增强策略为主。回顾本报告期的投资操作，收益端，股票标的选择上主要依赖 AI 模型，叠加风格轮动、行业轮动、基本面信息补充和事件驱动等策略，以求提升超额收益的稳定性。风控端，我们在严控风格、行业、个股权重偏离的基础上，添加了对预测跟踪误差的直接控制，以求全面管理风险敞口。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通沪深 300 增强 A 净值增长率为 22.20%，同期业绩比较基准收益率为 14.04%。海富通沪深 300 增强 C 净值增长率为 22.08%，同期业绩比较基准收益率为 14.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从全球经济看，2025 年美国财政刺激力度依然不弱，叠加降息周期还没结束，居民和企业部门资产负债表相对健康，短期美国经济还难言衰退。不过，随着特朗普关税、移民、减税等政策落地，美国通胀压力可能会抬升，美联储的降息节奏和幅度可能还存在变数，经济也存在滞胀风险。同时，美国债务上限问题依旧困扰财政政策，下半年国债发行冲击可能导致美债收益率冲高，这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，未来需要密切跟踪。

从市场方向看，当前中国经济持续修复，随着 924 以来一系列政策出台，官方积极回应市场的关切，市场信心已较大改善，上证指数震荡走高，2024 年第 4 季度 GDP 增速也超预期增长，相关政策对经济有提振作用。在最新中央经济工作会议中，提出了“稳住楼市股市”、“创新金融工具，维护金融市场稳定”等，我们认为国内资本市场风险可控，积极可为。展望未来，我们对 A 股充满信心，将积极跟踪国内政策和经济的变化，把握投资机会。

投资策略上，我们将拥抱 AI，总体来说，策略将“以稳为主”，未来策略依然注重成分内增强和低偏离，力求提供具有较高胜率、较低超额回撤和较短超额回撤修复时间的产品。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2024 年，基金管理人监察稽核工作根据独立、客观、公正的原则，通过业务审核、合规检查、系统监控、重点抽查、专项审计等一系列方式开展工作，强化基金运作和公

司运营的合规性，督促业务部门不断改进内部控制和风险管理，并按规定定期出具监察稽核报告报董事会和公司管理层。

本报告期内，本基金管理人内部监察稽核工作的重点包括以下几个方面：

一、加强合规管理，持续完善公司的规章制度体系

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

二、客观开展内外部内控评估，进一步优化内控措施

根据法规、监管要求并结合风险导向和全覆盖原则，公司继续通过日常业务的定期合规检查、不定期自查等方式，重点关注规章制度的执行情况、第一道防线风险控制的有效性和投资运作与产品合同约定的一致性。同时，对各部门的业务有重点的开展了多项专项检查和内部审计。另外，根据法规和公司管理需要，公司聘请会计师事务所等外部专业机构对公司开展了内部控制评价等方面的审计。通过内外部审计及合规检查，审视法律法规和监管要求的落实情况、监督公司制度流程的执行情况，及时发现存在的问题，并通过加强跨部门的协作沟通，形成合力，认真整改，进一步健全完善了公司的内部控制体系。

三、有效推进反洗钱与反恐怖融资工作

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

四、强化合规文化培训，提升员工的合规及风险意识

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设立估值委员会，组成人员包括分管基金运营业务的高级管理人员、分管投资业务的高级管理人员、督察稽核部负责人、风险管理部负责人、研究部负责人及基金运营部负责人等，以上人员具有丰富的合规、风控、证券研究、会计方面的专业经验。估值委员会负责制定、更新本基金管理人管理的基金的估值政策和程序。估值委员会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

- 一、本基金本报告期内无应分配的收益。
- 二、已实施的利润分配：无。
- 三、不存在应分配但尚未实施的利润。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期无需要说明的情形。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的

计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2502188 号

海富通沪深 300 指数增强型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沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表、2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人海富通基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 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

虞京京 何晨

北京市东城区东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层

2025 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	91,497,053.72	6,057,223.55
结算备付金		23,986,108.60	1,871,390.49
存出保证金		15,137,909.90	279,911.58

交易性金融资产	7.4.7.2	2,454,360,088.74	141,816,859.30
其中：股票投资		2,325,317,696.07	139,778,001.22
基金投资		-	-
债券投资		129,042,392.67	2,038,858.08
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	35,999,055.14	49,805.22
应收清算款		18,125,635.63	2,074,463.65
应收股利		-	-
应收申购款		93,601,469.62	113,867.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		2,732,707,321.35	152,263,521.50
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-2,046.17	-
应付清算款		69,346,038.49	-
应付赎回款		74,748,966.34	2,276,117.54
应付管理人报酬		1,518,947.39	101,335.78
应付托管费		341,763.17	22,800.56
应付销售服务费		127,990.93	3,463.38
应付投资顾问费		-	-
应交税费		904.85	1,681.64
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,161,545.17	503,229.50
负债合计		147,244,110.17	2,908,628.40
净 资 产：			
实收基金	7.4.7.7	2,122,697,834.03	152,219,924.99
未分配利润	7.4.7.8	462,765,377.15	-2,865,031.89
净资产合计		2,585,463,211.18	149,354,893.10
负债和净资产总计		2,732,707,321.35	152,263,521.50

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1858 元，C 类基金份额净值 1.2362 元。基金份额总额 2,122,697,834.03 份，其中 A 类基金份额 766,423,715.58 份，C 类基金份额 1,356,274,118.45 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		230,476,937.68	-9,516,665.56
1.利息收入		464,835.29	72,775.49
其中：存款利息收入	7.4.7.9	329,582.05	58,847.46
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		135,253.24	13,928.03
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		170,546,136.37	-12,416,431.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	146,284,759.51	-16,360,106.26
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	660,403.24	69,797.11
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	7,976,594.69	418,552.82
股利收益	7.4.7.14	15,624,378.93	3,455,324.98
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	58,185,442.16	2,782,643.15
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	1,280,523.86	44,347.15
减：二、营业总支出		8,856,463.26	2,095,167.30
1. 管理人报酬		6,369,560.00	1,332,960.03
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		1,433,150.94	299,916.03
3. 销售服务费		504,270.45	48,095.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		67,400.58	625.03
其中：卖出回购金融资产支出		67,400.58	625.03
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		33,769.16	1,590.88
8. 其他费用	7.4.7.17	448,312.13	411,980.28

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		221,620,474.42	-11,611,832.86
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		221,620,474.42	-11,611,832.86
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		221,620,474.42	-11,611,832.86

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 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	152,219,924.99	-	-2,865,031.89	149,354,893.10
二、本期期初净资产	152,219,924.99	-	-2,865,031.89	149,354,893.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,970,477,909.04	-	465,630,409.04	2,436,108,318.08
（一）、综合收益总额	-	-	221,620,474.42	221,620,474.42
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	1,970,477,909.04	-	244,009,934.62	2,214,487,843.66
其中：1. 基金申购款	2,784,345,877.82	-	398,207,161.93	3,182,553,039.75
2. 基金赎回款	-813,867,968.78	-	-154,197,227.31	-968,065,196.09
（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	2,122,697,834.03	-	462,765,377.15	2,585,463,211.18
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	175,144,708.35	-	12,097,026.07	187,241,734.42
二、本期期初净资产	175,144,708.35	-	12,097,026.07	187,241,734.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,924,783.36	-	-14,962,057.96	-37,886,841.32
（一）、综合收益总额	-	-	-11,611,832.86	-11,611,832.86
（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）	-22,924,783.36	-	-3,350,225.10	-26,275,008.46
其中：1. 基金申购款	25,981,828.79	-	2,705,569.19	28,687,397.98
2. 基金赎回款	-48,906,612.15	-	-6,055,794.29	-54,962,406.44
（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	152,219,924.99	-	-2,865,031.89	149,354,893.10

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

海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)是由原海富通富睿混合型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。原基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]1173 号《关于准予海富通富睿混合型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《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。原基金为契约型开放式证券投资基金,存续期限不定。首次设立募集不包括认购资金利息共募集 337,844,741.50 元,已经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2017)第 489 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》于 2017 年 5 月 10 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 337,986,530.53 份,其中认购资金利息折合 141,789.03 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,基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,海富通富睿混合型证券投资基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会,于 2019 年 9 月 17 日表决通过了《关于海富通富睿混合型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《海富通基金管理有限公司关于海富通富睿混合型证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》,《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》将自 2019 年 10 月 9 日起正式生效,原《海富通富睿混合型证券投资基金基金合同》将自同日起失效。于 2019 年 10 月 9 日起,海富通富睿混合型证券投资基金的基金份额全部转换为海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金的基金份额。

根据《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、赎回费用和销售服务费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用,但不从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为海富通沪深 300 指数增强 A 类基金份额;在投资者认购/申购时不收取认/申购费用,而是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为海富通沪深 300 指数增强 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金为增强型股票指数基金,在力求对标的指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的投资策略模型进行积极的指数组合管理与风险控制,力求实现超越业绩比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、央行票据、企业债、公司债、中期票据、地方政府债、次级债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、债券回购、银行存款、货币市场工具、同业存单、资产支持证券、股指期货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%；本基金在每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值 5% 的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金及应收申购款等。法律法规或监管机构日后允许本基金投资的其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+银行人民币活期存款利率×5%（税后）。

本财务报表由本基金的基金管理人海富通基金管理有限公司于 2025 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年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、买入

返售金融资产等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

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（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金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、托管费和销售服务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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

(a)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(b)对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

(c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

(d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	91,497,053.72	6,057,223.55
等于：本金	91,488,976.61	6,056,639.36
加：应计利息	8,077.11	584.19
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	91,497,053.72	6,057,223.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,273,379,609.0 0	-	2,325,317,696. 07	51,938,087.0 7

贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	127,893,045.91	1,187,682.07	129,042,392.67	-38,335.31
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	127,893,045.91	1,187,682.07	129,042,392.67	-38,335.31
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,401,272,654.91	1,187,682.07	2,454,360,088.74	51,899,751.76
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		147,684,280.19	-	139,778,001.22	-7,906,278.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,999,200.00	38,658.08	2,038,858.08	1,000.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,999,200.00	38,658.08	2,038,858.08	1,000.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		149,683,480.19	38,658.08	141,816,859.30	-7,905,278.97

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	119,616,188.57	-	-	-
——股指期货	119,616,188.57	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	119,616,188.57	-	-	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-1,031,640.00	-	-	-
——股指期货	-1,031,640.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-1,031,640.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2501	IF2501	23.00	27,177,720.00	-403,962.86
IF2502	IF2502	32.00	37,814,400.00	-296,820.00
IF2503	IF2503	25.00	29,535,000.00	-496,885.71
IF2506	IF2506	20.00	23,468,400.00	-423,000.00
合计	-	-	-	-1,620,668.57
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	-1,620,668.57
净额	-	-	-	-

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计核算业务细则（试行）》及《企业会计准则——金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具——股指期货投资”与“证券清算款——股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具——股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

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

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	35,999,055.14	-
银行间市场	-	-
合计	35,999,055.14	-
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	49,805.22	-
银行间市场	-	-
合计	49,805.22	-

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买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末其他资产无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	1,338.75	0.23
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	914,189.09	283,229.27
其中：交易所市场	914,189.09	283,229.27
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	170,000.00	170,000.00
应付指数使用费	76,017.33	50,000.00
合计	1,161,545.17	503,229.50

7.4.7.7 实收基金

海富通沪深 300 增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,218,925.65	113,218,925.65
本期申购	800,222,440.32	800,222,440.32
本期赎回（以“-”号填列）	-147,017,650.39	-147,017,650.39
本期末	766,423,715.58	766,423,715.58

海富通沪深 300 增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	39,000,999.34	39,000,999.34
本期申购	1,984,123,437.50	1,984,123,437.50
本期赎回（以“-”号填列）	-666,850,318.39	-666,850,318.39
本期末	1,356,274,118.45	1,356,274,118.45

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通沪深 300 增强 A

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	-30,088,295.14	26,732,607.78	-3,355,687.36
本期期初	-30,088,295.14	26,732,607.78	-3,355,687.36
本期利润	57,297,447.42	18,973,093.64	76,270,541.06

本期基金份额交易产生的变动数	-153,180,554.17	222,671,679.73	69,491,125.56
其中：基金申购款	-185,887,285.24	278,055,837.51	92,168,552.27
基金赎回款	32,706,731.07	-55,384,157.78	-22,677,426.71
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-125,971,401.89	268,377,381.15	142,405,979.26

海富通沪深 300 增强 C

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	-9,032,086.10	9,522,741.57	490,655.47
本期期初	-9,032,086.10	9,522,741.57	490,655.47
本期利润	106,137,584.84	39,212,348.52	145,349,933.36
本期基金份额交易产生的变动数	-269,262,437.58	443,781,246.64	174,518,809.06
其中：基金申购款	-380,571,980.14	686,610,589.80	306,038,609.66
基金赎回款	111,309,542.56	-242,829,343.16	-131,519,800.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-172,156,938.84	492,516,336.73	320,359,397.89

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12 月31日
活期存款利息收入	60,454.91	35,440.83
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	126,111.97	22,239.85
其他	143,015.17	1,166.78
合计	329,582.05	58,847.46

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,564,939,982.74	955,194,293.96
减：卖出股票成本总额	3,413,924,301.46	969,356,681.06
减：交易费用	4,730,921.77	2,197,719.16
买卖股票差价收入	146,284,759.51	-16,360,106.26

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	706,460.43	28,213.57
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-46,057.19	41,583.54
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	660,403.24	69,797.11

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	28,795,863.39	2,224,316.85
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	28,352,681.19	2,150,320.00
减：应计利息总额	489,239.39	32,405.53
减：交易费用	-	7.78
买卖债券差价收入	-46,057.19	41,583.54

7.4.7.12 贵金属投资收益

本基金本报告期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	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股指期货投资收益（税前）	8,382,988.57	440,720.00
减：股指期货差价收入应缴纳增值税额	277,352.22	12,836.50
减：交易费用	129,041.66	9,330.68
合计	7,976,594.69	418,552.82

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,624,378.93	3,455,324.98
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	15,624,378.93	3,455,324.98

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2024年1月1日至2024年12月31日	2023年1月1日至2023年12月31日
1.交易性金融资产	59,805,030.73	2,829,703.15
——股票投资	59,844,366.04	2,836,987.95
——债券投资	-39,335.31	-7,284.80
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-1,619,588.57	-47,060.00
——权证投资	-	-

——股指期货	-1,619,588.57	-47,060.00
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	58,185,442.16	2,782,643.15

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
基金赎回费收入	1,279,285.46	43,280.37
基金转换费收入	1,238.40	1,066.78
合计	1,280,523.86	44,347.15

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31 日
审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	226,017.33	200,000.00
银行划款手续费	15,094.80	4,780.28
债券托管账户维护费	36,000.00	36,000.00
其他费用	1,200.00	1,200.00
合计	448,312.13	411,980.28

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

经中国证监会于 2025 年 1 月 17 日出具《关于同意国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司并募集配套资金注册、核准国泰君安证券股份有限公司吸收合并海通证券股份有限公司、海富通基金管理有限公司变更主要股东及实际控制人、富国基金管理有限公司变更主要股东、海通期货股份有限公司变更主要股东及实际控制人的批复》（证监许可〔2025〕96 号）核准，国泰君安证券股份有限公司（以下简称“国泰君安”）吸收合并海通证券股份有限公司（以下简称“海通证券”）。自本次吸收合并交割日（即 2025 年 3 月 14 日）起，合并后的国泰君安承继及承接海通证券的全部资产、负债、业务、人员、合同、资质及其他一切权利与义务，海通证券所持海富通基金管理有限公司股权亦归属于合并后的国泰君安，即合并后的国泰君安成为海富通基金管理有限公司的主要股东，上海国际集团有限公司成为海富通基金管理有限公司实际控制人。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
海富通基金管理有限公司(“海富通”)	基金管理人、基金销售机构
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	基金托管人、基金销售机构
海通证券股份有限公司(“海通证券”)	基金管理人的股东、基金销售机构
法国巴黎资产管理 BE 控股公司(BNP Paribas Asset Management BE Holding)	基金管理人的股东
上海富诚海富通资产管理有限公司	基金管理人的子公司

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金在本报告期内及上年度可比期间均没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	6,369,560.00	1,332,960.03
其中：应支付销售机构的客户维护 费	801,512.32	168,270.83
应支付基金管理人的净管理费	5,568,047.68	1,164,689.20

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 0.80% 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 x0.80%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,433,150.94	299,916.03

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.18% 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 x0.18%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通沪深300增强A	海富通沪深300增强C	合计
中国银行	-	2,634.16	2,634.16
海通证券	-	240.77	240.77
海富通	-	281,883.02	281,883.02
合计	-	284,757.95	284,757.95

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年1月1日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通沪深300增强A	海富通沪深300增强C	合计
中国银行	-	2,465.78	2,465.78
海通证券	-	274.52	274.52
海富通	-	13,725.63	13,725.63
合计	-	16,465.93	16,465.93

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费，C 类份额的基金销售服务费年费率为 0.10%，基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.10% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。销售服务费的计算方法如下：日销售服务费 = 前一日 C 类份额的基金资产净值 \times 0.10% / 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生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固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2024年1月1日至2024年12月31日		2023年1月1日至2023年12月31日	
	海富通沪深300增强A	海富通沪深300增强C	海富通沪深300增强A	海富通沪深300增强C

报告期初持有的基金份额	4,243,401.51	-	4,243,401.51	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	4,243,401.51	-	4,243,401.51	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.55%	-	3.75%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

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 2024年1月1日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
	中国银行	91,497,053.72	60,454.91	6,057,223.55

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2024年1月1日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位：股/张)	总金额
海通证券	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	

				数量(单位: 股/张)	总金额
海通证券	688469	芯联集成	网下发行	19,250	109,532.50

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（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发或增发证券而受约束的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末 成本总额	期末 估值总额	备注
002252	上海莱士	2024-12-23	重大事项	7.22	2025-01-07	6.93	1,789,367	12,853,135.49	12,919,229.74	-
300807	天迈科技	2024-12-30	重大事项	30.31	2025-01-07	36.37	38,700	1,249,451.00	1,172,997.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无从事银行间市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所市场债券正回购交易作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期内未发生转融通证券出借业务。

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

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

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放于信用良好的银行，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于 2024 年 12 月 31 日，本基金未持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券和资产支持证券（2023 年 12 月 31 日：无）。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	115,128,574.17	2,038,858.08
合计	115,128,574.17	2,038,858.08

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	-	-
未评级	13,913,818.50	-
合计	13,913,818.50	-

注：债券评级取自第三方评级机构的债项评级。未评级部分一般为国债、政策性金融债、央票、无第三方评级机构评级的债券。

7.4.13.3 流动性风险

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

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 7.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均能及时变现。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家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 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	91,497,053.72	-	-	-	91,497,053.72
结算备付金	23,986,108.60	-	-	-	23,986,108.60
存出保证金	978,447.50	-	-	14,159,462.40	15,137,909.90
交易性金融资产	129,042,392.67	-	-	2,325,317,696.07	2,454,360,088.74
买入返售金融资产	35,999,055.14	-	-	-	35,999,055.14
应收清算款	-	-	-	18,125,635.63	18,125,635.63
应收申购款	60,000,198.81	-	-	33,601,270.81	93,601,469.62
资产总计	341,503,256.44	-	-	2,391,204,064.91	2,732,707,321.35
负债					
卖出回购金融资产款	-2,046.17	-	-	-	-2,046.17
应付清算款	-	-	-	69,346,038.49	69,346,038.49
应付赎回款	-	-	-	74,748,966.34	74,748,966.34
应付管理人报酬	-	-	-	1,518,947.39	1,518,947.39
应付托管费	-	-	-	341,763.17	341,763.17
应付销售服务费	-	-	-	127,990.93	127,990.93
应交税费	-	-	-	904.85	904.85
其他负债	-	-	-	1,161,545.17	1,161,545.17
负债总计	-2,046.17	-	-	147,246,156.34	147,244,110.17
利率敏感度缺	341,505,302.6	-	-	2,243,957,908.	2,585,463,211.

口	1			57	18
上年度末 2023 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	6,057,223.55	-	-	-	6,057,223.55
结算备付金	1,871,390.49	-	-	-	1,871,390.49
存出保证金	31,669.98	-	-	248,241.60	279,911.58
交易性金融资产	2,038,858.08	-	-	139,778,001.22	141,816,859.30
买入返售金融资产	49,805.22	-	-	-	49,805.22
应收清算款	-	-	-	2,074,463.65	2,074,463.65
应收申购款	-	-	-	113,867.71	113,867.71
资产总计	10,048,947.32	-	-	142,214,574.18	152,263,521.50
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,276,117.54	2,276,117.54
应付管理人报酬	-	-	-	101,335.78	101,335.78
应付托管费	-	-	-	22,800.56	22,800.56
应付销售服务费	-	-	-	3,463.38	3,463.38
应交税费	-	-	-	1,681.64	1,681.64
其他负债	-	-	-	503,229.50	503,229.50
负债总计	-	-	-	2,908,628.40	2,908,628.40
利率敏感度缺口	10,048,947.32	-	-	139,305,945.78	149,354,893.10

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

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	市场利率上升 25 个基点		-143,258.00

市场利率下降 25 个基点	143,828.15	230.82
---------------	------------	--------

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，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,325,317,696.07	89.94	139,778,001.22	93.59
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	2,325,317,696.07	89.94	139,778,001.22	93.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注 7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	1.业绩比较基准上升 5%	122,340,419.77	6,496,841.16
2.业绩比较基准下降 5%	-122,340,419.77	-6,496,841.16	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值:相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位:人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	2,311,225,469.33	139,702,381.62
第二层次	143,134,619.41	2,038,858.08
第三层次	-	75,619.60
合计	2,454,360,088.74	141,816,859.30

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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位:人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	75,619.60	75,619.60
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	63,029.89	63,029.89
当期利得或损失总额	-	-12,589.71	-12,589.71
其中:计入损益的利得或损失	-	-12,589.71	-12,589.71
计入其他综合收益的利得或损失(若有)	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023年1月1日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	745,068.03	745,068.03
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	239,947.53	239,947.53
转出第三层次	-	1,324,785.99	1,324,785.99
当期利得或损失总额	-	415,390.03	415,390.03
其中:计入损益的利得或损失	-	415,390.03	415,390.03

计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	75,619.60	75,619.60
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-2,527.42	-2,527.42

注：于2024年12月31日，本基金未持有第三层次的交易性金融资产（2023年12月31日：持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资）。于2024年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2023年度：同）。

计入损益的利得或损失计入利润表中的投资收益及公允价值变动损益项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	-	-	-	-	-
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	75,619.60	亚式期权模型	预期年化波动率	19.62%~194.82%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具(2023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资产和负债主要包括应收款项、买入返售金融资产、卖出回购金融资产款和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,325,317,696.07	85.09
	其中：股票	2,325,317,696.07	85.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	129,042,392.67	4.72
	其中：债券	129,042,392.67	4.72
	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	35,999,055.14	1.32
	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	115,483,162.32	4.23
8	其他各项资产	126,865,015.15	4.64
9	合计	2,732,707,321.35	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	4,367,961.63	0.17
B	采矿业	46,242,153.00	1.79
C	制造业	1,364,985,330.13	52.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	28,311,135.00	1.10
E	建筑业	105,977,816.22	4.10
F	批发和零售业	9,015,603.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	27,155,419.36	1.05

H	住宿和餐饮业	368,726.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	110,210,536.38	4.26
J	金融业	536,339,726.35	20.74
K	房地产业	35,545,521.00	1.37
L	租赁和商务服务业	39,826,841.00	1.54
M	科学研究和技术服务业	8,106,032.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	6,371,925.00	0.25
R	文化、体育和娱乐业	2,492,970.00	0.10
S	综合	-	-
	合计	2,325,317,696.07	89.94

8.2.2 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

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	000333	美的集团	990,874	74,533,542.28	2.88
2	600519	贵州茅台	48,324	73,645,776.00	2.85
3	601318	中国平安	1,259,000	66,286,350.00	2.56
4	300750	宁德时代	228,740	60,844,840.00	2.35
5	000858	五粮液	410,812	57,530,112.48	2.23
6	600887	伊利股份	1,771,300	53,457,834.00	2.07
7	601288	农业银行	9,508,325	50,774,455.50	1.96
8	601398	工商银行	7,199,100	49,817,772.00	1.93
9	000725	京东方 A	10,771,100	47,285,129.00	1.83
10	601766	中国中车	5,252,000	44,011,760.00	1.70
11	002475	立讯精密	1,028,000	41,901,280.00	1.62
12	600050	中国联通	7,859,850	41,735,803.50	1.61
13	000001	平安银行	3,565,831	41,720,222.70	1.61
14	002415	海康威视	1,352,000	41,506,400.00	1.61
15	300433	蓝思科技	1,696,800	37,159,920.00	1.44

16	002027	分众传媒	5,208,700	36,617,161.00	1.42
17	603288	海天味业	783,928	35,982,295.20	1.39
18	601138	工业富联	1,662,350	35,740,525.00	1.38
19	300408	三环集团	900,400	34,674,404.00	1.34
20	600048	保利发展	3,870,600	34,293,516.00	1.33
21	600031	三一重工	2,052,300	33,821,904.00	1.31
22	601319	中国人保	4,345,200	33,110,424.00	1.28
23	300628	亿联网络	854,810	32,995,666.00	1.28
24	002236	大华股份	2,053,330	32,853,280.00	1.27
25	601618	中国中冶	9,856,200	32,525,460.00	1.26
26	601939	建设银行	3,689,100	32,427,189.00	1.25
27	600196	复星医药	1,252,450	31,123,382.50	1.20
28	600406	国电南瑞	1,215,329	30,650,597.38	1.19
29	600219	南山铝业	7,714,900	30,165,259.00	1.17
30	000776	广发证券	1,851,100	30,006,331.00	1.16
31	600875	东方电气	1,867,400	29,672,986.00	1.15
32	600372	中航机载	2,361,100	29,112,363.00	1.13
33	000651	格力电器	587,900	26,720,055.00	1.03
34	600036	招商银行	672,480	26,428,464.00	1.02
35	601688	华泰证券	1,447,800	25,466,802.00	0.98
36	002179	中航光电	643,400	25,285,620.00	0.98
37	601916	浙商银行	8,123,400	23,639,094.00	0.91
38	000895	双汇发展	872,500	22,650,100.00	0.88
39	000166	申万宏源	4,127,900	22,084,265.00	0.85
40	600900	长江电力	734,800	21,713,340.00	0.84
41	601117	中国化学	2,615,300	21,680,837.00	0.84
42	000063	中兴通讯	528,100	21,335,240.00	0.83
43	601601	中国太保	622,600	21,218,208.00	0.82
44	600362	江西铜业	1,026,000	21,176,640.00	0.82
45	601669	中国电建	3,875,000	21,157,500.00	0.82
46	300373	扬杰科技	479,500	20,867,840.00	0.81
47	601600	中国铝业	2,712,562	19,937,330.70	0.77
48	601668	中国建筑	3,274,900	19,649,400.00	0.76
49	600690	海尔智家	688,725	19,608,000.75	0.76
50	601728	中国电信	2,675,525	19,317,290.50	0.75
51	601877	正泰电器	753,700	17,644,117.00	0.68
52	002594	比亚迪	60,312	17,047,789.92	0.66
53	600438	通威股份	760,300	16,810,233.00	0.65
54	300014	亿纬锂能	351,200	16,415,088.00	0.63
55	002241	歌尔股份	565,678	14,600,149.18	0.56
56	601857	中国石油	1,576,625	14,095,027.50	0.55
57	601328	交通银行	1,676,800	13,028,736.00	0.50
58	002252	上海莱士	1,789,367	12,919,229.74	0.50
59	600999	招商证券	648,020	12,416,063.20	0.48

60	002736	国信证券	1,102,200	12,344,640.00	0.48
61	688009	中国通号	1,884,851	11,799,167.26	0.46
62	000768	中航西飞	408,675	11,540,982.00	0.45
63	000617	中油资本	1,673,300	11,529,037.00	0.45
64	000807	云铝股份	837,600	11,332,728.00	0.44
65	002938	鹏鼎控股	294,025	10,726,032.00	0.41
66	601919	中远海控	659,100	10,216,050.00	0.40
67	002001	新和成	453,600	9,965,592.00	0.39
68	600019	宝钢股份	1,420,125	9,940,875.00	0.38
69	603993	洛阳钼业	1,466,850	9,754,552.50	0.38
70	600015	华夏银行	1,142,800	9,153,828.00	0.35
71	601169	北京银行	1,472,375	9,055,106.25	0.35
72	601658	邮储银行	1,514,762	8,603,848.16	0.33
73	600585	海螺水泥	342,600	8,147,028.00	0.32
74	600660	福耀玻璃	121,737	7,596,388.80	0.29
75	601231	环旭电子	420,300	6,934,950.00	0.27
76	688223	晶科能源	911,500	6,480,765.00	0.25
77	603799	华友钴业	217,800	6,372,828.00	0.25
78	300015	爱尔眼科	480,900	6,371,925.00	0.25
79	601899	紫金矿业	418,400	6,326,208.00	0.24
80	002180	纳思达	222,712	6,273,797.04	0.24
81	601166	兴业银行	311,375	5,965,945.00	0.23
82	300184	力源信息	639,300	5,964,669.00	0.23
83	000060	中金岭南	1,137,100	5,332,999.00	0.21
84	600018	上港集团	866,303	5,301,774.36	0.21
85	002648	卫星化学	258,000	4,847,820.00	0.19
86	688126	沪硅产业	251,100	4,725,702.00	0.18
87	601390	中国中铁	725,850	4,638,181.50	0.18
88	300369	绿盟科技	638,800	4,592,972.00	0.18
89	600332	白云山	159,550	4,534,411.00	0.18
90	300012	华测检测	328,200	4,079,526.00	0.16
91	300285	国瓷材料	239,000	4,072,560.00	0.16
92	000538	云南白药	60,425	3,622,478.75	0.14
93	600489	中金黄金	282,400	3,397,272.00	0.13
94	603259	药明康德	61,000	3,357,440.00	0.13
95	002255	海陆重工	596,800	3,318,208.00	0.13
96	300498	温氏股份	196,113	3,237,825.63	0.13
97	300059	东方财富	123,897	3,199,020.54	0.12
98	300661	圣邦股份	38,300	3,132,174.00	0.12
99	300462	华铭智能	341,800	3,048,856.00	0.12
100	300645	正元智慧	197,000	2,893,930.00	0.11
101	000090	天健集团	680,252	2,795,835.72	0.11
102	600030	中信证券	93,900	2,739,063.00	0.11
103	601377	兴业证券	435,400	2,725,604.00	0.11

104	300253	卫宁健康	375,300	2,687,148.00	0.10
105	603118	共进股份	297,200	2,645,080.00	0.10
106	603106	恒银科技	332,700	2,618,349.00	0.10
107	300701	森霸传感	254,000	2,603,500.00	0.10
108	600938	中国海油	86,500	2,552,615.00	0.10
109	601088	中国神华	58,200	2,530,536.00	0.10
110	601009	南京银行	236,700	2,520,855.00	0.10
111	601628	中国人寿	60,000	2,515,200.00	0.10
112	002142	宁波银行	100,200	2,435,862.00	0.09
113	600795	国电电力	525,200	2,405,416.00	0.09
114	000876	新希望	259,625	2,331,432.50	0.09
115	300771	智莱科技	219,300	2,307,036.00	0.09
116	601211	国泰君安	123,700	2,307,005.00	0.09
117	300155	安居宝	478,300	2,291,057.00	0.09
118	300686	智动力	261,600	2,283,768.00	0.09
119	601888	中国中免	32,600	2,184,526.00	0.08
120	600968	海油发展	510,200	2,178,554.00	0.08
121	600958	东方证券	205,125	2,166,120.00	0.08
122	002105	信隆健康	432,400	2,157,676.00	0.08
123	600028	中国石化	319,500	2,134,260.00	0.08
124	601061	中信金属	288,300	2,093,058.00	0.08
125	002916	深南电路	16,600	2,075,000.00	0.08
126	300549	优德精密	123,700	2,026,206.00	0.08
127	301185	鸥玛软件	116,300	1,986,404.00	0.08
128	601868	中国能建	866,700	1,984,743.00	0.08
129	601901	方正证券	236,600	1,970,878.00	0.08
130	000425	徐工机械	233,400	1,850,862.00	0.07
131	002920	德赛西威	16,800	1,849,848.00	0.07
132	601111	中国国航	231,700	1,832,747.00	0.07
133	600233	圆通速递	127,700	1,812,063.00	0.07
134	600919	江苏银行	184,300	1,809,826.00	0.07
135	300132	青松股份	362,200	1,785,646.00	0.07
136	601555	东吴证券	228,700	1,783,860.00	0.07
137	300735	光弘科技	63,100	1,766,169.00	0.07
138	300160	秀强股份	324,600	1,765,824.00	0.07
139	600029	南方航空	264,500	1,716,605.00	0.07
140	301339	通行宝	84,100	1,710,594.00	0.07
141	000338	潍柴动力	124,375	1,703,937.50	0.07
142	300150	世纪瑞尔	383,600	1,680,168.00	0.06
143	600380	健康元	148,400	1,672,468.00	0.06
144	000977	浪潮信息	31,100	1,613,468.00	0.06
145	601989	中国重工	332,100	1,597,401.00	0.06
146	300988	津荣天宇	85,000	1,533,400.00	0.06
147	300414	中光防雷	192,400	1,531,504.00	0.06

148	688425	铁建重工	346,700	1,525,480.00	0.06
149	601816	京沪高铁	243,300	1,498,728.00	0.06
150	300943	春晖智控	113,200	1,459,148.00	0.06
151	600089	特变电工	112,400	1,431,976.00	0.06
152	301197	工大科雅	94,600	1,422,784.00	0.06
153	000938	紫光股份	47,688	1,327,157.04	0.05
154	301282	金禄电子	62,700	1,313,565.00	0.05
155	603006	黎明股份	123,700	1,290,191.00	0.05
156	600353	旭光电子	172,600	1,246,172.00	0.05
157	300807	天迈科技	38,700	1,172,997.00	0.05
158	600741	华域汽车	66,100	1,164,021.00	0.05
159	002714	牧原股份	29,400	1,130,136.00	0.04
160	603987	康德莱	156,200	1,121,516.00	0.04
161	002479	富春环保	235,000	1,113,900.00	0.04
162	600517	国网英大	200,300	1,103,653.00	0.04
163	002365	永安药业	130,800	1,045,092.00	0.04
164	000157	中联重科	143,500	1,037,505.00	0.04
165	600073	光明肉业	149,400	1,036,836.00	0.04
166	600662	外服控股	202,200	1,025,154.00	0.04
167	601225	陕西煤业	42,900	997,854.00	0.04
168	300274	阳光电源	12,920	953,883.60	0.04
169	301515	港通医疗	52,600	945,748.00	0.04
170	600330	天通股份	132,900	943,590.00	0.04
171	600276	恒瑞医药	20,385	935,671.50	0.04
172	603999	读者传媒	143,300	881,295.00	0.03
173	301448	开创电气	42,524	874,293.44	0.03
174	300337	银邦股份	78,000	867,360.00	0.03
175	000533	顺钠股份	142,500	863,550.00	0.03
176	002474	榕基软件	143,800	861,362.00	0.03
177	300306	远方信息	72,500	841,000.00	0.03
178	601818	光大银行	215,200	832,824.00	0.03
179	603586	金麒麟	56,900	823,343.00	0.03
180	601998	中信银行	116,000	809,680.00	0.03
181	301158	德石股份	57,300	803,919.00	0.03
182	600901	江苏金租	152,600	796,572.00	0.03
183	601006	大秦铁路	115,400	782,412.00	0.03
184	002412	汉森制药	130,000	781,300.00	0.03
185	002459	晶澳科技	55,400	761,750.00	0.03
186	300485	赛升药业	107,900	756,379.00	0.03
187	001318	阳光乳业	66,400	754,968.00	0.03
188	600522	中天科技	51,700	740,344.00	0.03
189	002972	科安达	69,220	719,888.00	0.03
190	002578	闽发铝业	230,100	687,999.00	0.03
191	600064	南京高科	86,700	673,659.00	0.03

192	600925	苏能股份	126,600	670,980.00	0.03
193	600096	云天化	29,800	664,540.00	0.03
194	300517	海波重科	78,300	658,503.00	0.03
195	301359	东南电子	29,100	651,258.00	0.03
196	603811	诚意药业	82,712	638,536.64	0.02
197	600115	中国东航	155,100	620,400.00	0.02
198	688419	耐科装备	19,400	602,952.00	0.02
199	002671	龙泉股份	131,800	597,054.00	0.02
200	002194	武汉凡谷	51,100	573,342.00	0.02
201	002548	金新农	143,500	569,695.00	0.02
202	601098	中南传媒	37,300	559,873.00	0.02
203	601808	中海油服	36,604	558,211.00	0.02
204	300434	金石亚药	58,600	483,450.00	0.02
205	600268	国电南自	71,900	483,168.00	0.02
206	688981	中芯国际	5,100	482,562.00	0.02
207	003816	中国广核	114,700	473,711.00	0.02
208	000757	浩物股份	126,400	471,472.00	0.02
209	301192	泰祥股份	27,000	470,070.00	0.02
210	000728	国元证券	55,700	465,652.00	0.02
211	600820	隧道股份	61,900	445,061.00	0.02
212	600273	嘉化能源	54,800	436,756.00	0.02
213	688307	中润光学	17,913	429,912.00	0.02
214	601997	贵阳银行	71,200	427,200.00	0.02
215	301298	东利机械	30,900	425,802.00	0.02
216	601018	宁波港	108,300	416,955.00	0.02
217	300759	康龙化成	16,000	411,200.00	0.02
218	600717	天津港	83,900	408,593.00	0.02
219	603367	辰欣药业	29,200	401,208.00	0.02
220	000729	燕京啤酒	33,175	399,427.00	0.02
221	000039	中集集团	51,188	397,730.76	0.02
222	300371	汇中股份	41,100	394,149.00	0.02
223	600642	申能股份	41,400	392,886.00	0.02
224	002048	宁波华翔	31,000	391,220.00	0.02
225	600141	兴发集团	18,000	390,600.00	0.02
226	603053	成都燃气	38,700	388,161.00	0.02
227	600282	南钢股份	82,700	387,863.00	0.02
228	600528	中铁工业	46,600	375,596.00	0.01
229	002871	伟隆股份	38,500	373,065.00	0.01
230	601007	金陵饭店	52,600	368,726.00	0.01
231	600874	创业环保	60,400	360,588.00	0.01
232	603132	金徽股份	32,100	360,483.00	0.01
233	601326	秦港股份	106,200	355,770.00	0.01
234	002233	塔牌集团	44,700	342,849.00	0.01
235	601928	凤凰传媒	29,700	342,738.00	0.01

236	600008	首创环保	100,200	328,656.00	0.01
237	600461	洪城环境	31,700	315,415.00	0.01
238	002788	鹭燕医药	38,100	312,801.00	0.01
239	002352	顺丰控股	7,700	310,310.00	0.01
240	600383	金地集团	70,600	309,228.00	0.01
241	300696	爱乐达	19,800	307,494.00	0.01
242	600269	赣粤高速	54,100	303,501.00	0.01
243	600757	长江传媒	29,100	278,487.00	0.01
244	002839	张家港行	62,400	272,688.00	0.01
245	688663	新风光	12,500	271,375.00	0.01
246	000100	TCL 科技	51,862	260,865.86	0.01
247	300746	汉嘉设计	22,600	257,866.00	0.01
248	000598	兴蓉环境	33,600	255,024.00	0.01
249	600583	海油工程	46,500	254,355.00	0.01
250	603075	热威股份	13,385	249,362.55	0.01
251	300699	光威复材	6,900	239,085.00	0.01
252	002507	涪陵榨菜	16,700	235,971.00	0.01
253	601000	唐山港	49,700	234,087.00	0.01
254	002558	巨人网络	18,400	233,496.00	0.01
255	601168	西部矿业	13,400	215,338.00	0.01
256	600125	铁龙物流	36,300	215,259.00	0.01
257	300674	宇信科技	11,000	214,720.00	0.01
258	000902	新洋丰	16,400	213,856.00	0.01
259	300979	华利集团	2,700	212,355.00	0.01
260	000792	盐湖股份	12,800	210,688.00	0.01
261	002393	力生制药	11,900	209,916.00	0.01
262	600325	华发股份	35,000	201,600.00	0.01
263	601298	青岛港	22,100	201,331.00	0.01
264	601127	赛力斯	1,500	200,085.00	0.01
265	300415	伊之密	9,900	198,594.00	0.01
266	601107	四川成渝	36,200	189,326.00	0.01
267	000528	柳工	15,400	185,724.00	0.01
268	600350	山东高速	17,800	182,984.00	0.01
269	600039	四川路桥	24,600	179,088.00	0.01
270	600295	鄂尔多斯	18,000	175,680.00	0.01
271	002724	海洋王	32,200	171,304.00	0.01
272	601717	郑煤机	13,000	168,740.00	0.01
273	600373	中文传媒	13,400	168,170.00	0.01
274	601019	山东出版	14,700	166,845.00	0.01
275	600098	广州发展	25,900	166,278.00	0.01
276	601077	渝农商行	27,400	165,770.00	0.01
277	001299	美能能源	13,200	164,208.00	0.01
278	002367	康力电梯	22,800	156,636.00	0.01
279	601229	上海银行	16,800	153,720.00	0.01

280	000878	云南铜业	12,500	152,375.00	0.01
281	600177	雅戈尔	16,500	146,850.00	0.01
282	000685	中山公用	15,400	142,142.00	0.01
283	002249	大洋电机	24,200	142,054.00	0.01
284	000498	山东路桥	23,300	138,635.00	0.01
285	002107	沃华医药	28,238	134,977.64	0.01
286	300360	炬华科技	8,000	134,160.00	0.01
287	600377	宁沪高速	8,700	133,197.00	0.01
288	688291	金橙子	6,400	123,008.00	0.00
289	601163	三角轮胎	8,100	122,067.00	0.00
290	600444	国机通用	7,600	115,596.00	0.00
291	600531	豫光金铅	17,700	113,634.00	0.00
292	300001	特锐德	5,000	109,750.00	0.00
293	301022	海泰科	5,300	107,590.00	0.00
294	001965	招商公路	7,500	104,625.00	0.00
295	601666	平煤股份	10,400	104,208.00	0.00
296	300813	泰林生物	5,900	101,893.00	0.00
297	600987	航民股份	13,400	92,996.00	0.00
298	002443	金洲管道	15,700	92,316.00	0.00
299	600886	国投电力	5,500	91,410.00	0.00
300	603886	元祖股份	6,200	89,404.00	0.00
301	001872	招商港口	4,300	88,021.00	0.00
302	601339	百隆东方	15,700	85,408.00	0.00
303	600012	皖通高速	4,800	84,720.00	0.00
304	600248	陕建股份	18,800	84,224.00	0.00
305	002004	华邦健康	18,300	82,716.00	0.00
306	600710	苏美达	8,600	79,980.00	0.00
307	600563	法拉电子	600	71,352.00	0.00
308	002206	海利得	16,550	70,999.50	0.00
309	000002	万科 A	9,300	67,518.00	0.00
310	601222	林洋能源	9,500	67,165.00	0.00
311	002100	天康生物	9,900	64,845.00	0.00
312	002416	爱施德	3,900	63,453.00	0.00
313	603323	苏农银行	11,700	61,893.00	0.00
314	002567	唐人神	11,900	60,690.00	0.00
315	002275	桂林三金	4,000	60,360.00	0.00
316	300627	华测导航	1,400	58,520.00	0.00
317	601898	中煤能源	4,800	58,464.00	0.00
318	600232	金鹰股份	10,700	55,961.00	0.00
319	601801	皖新传媒	7,500	55,050.00	0.00
320	300875	捷强装备	1,900	53,504.00	0.00
321	600546	山煤国际	4,500	53,235.00	0.00
322	002278	神开股份	9,900	52,767.00	0.00
323	301559	中集环科	3,400	52,190.00	0.00

324	000948	南天信息	3,100	51,863.00	0.00
325	000548	湖南投资	9,900	50,985.00	0.00
326	301395	仁信新材	4,600	50,876.00	0.00
327	601369	陕鼓动力	5,700	49,590.00	0.00
328	301320	豪江智能	3,200	47,712.00	0.00
329	301056	森赫股份	5,700	46,626.00	0.00
330	002057	中钢天源	5,700	41,154.00	0.00
331	603230	内蒙新华	3,200	40,512.00	0.00
332	601186	中国铁建	4,400	40,348.00	0.00
333	301389	隆扬电子	2,400	40,128.00	0.00
334	603577	汇金通	4,800	38,352.00	0.00
335	002626	金达威	2,500	37,750.00	0.00
336	002120	韵达股份	4,900	36,848.00	0.00
337	603967	中创物流	3,700	36,297.00	0.00
338	003015	日久光电	2,500	35,775.00	0.00
339	300413	芒果超媒	1,200	32,268.00	0.00
340	301063	海锅股份	1,900	30,172.00	0.00
341	600916	中国黄金	3,500	30,170.00	0.00
342	600202	哈空调	5,800	25,810.00	0.00
343	601008	连云港	5,700	21,831.00	0.00
344	002063	远光软件	2,800	16,128.00	0.00

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	300750	宁德时代	101,295,789.76	67.82
2	600519	贵州茅台	92,518,799.13	61.95
3	000333	美的集团	78,580,198.19	52.61
4	601318	中国平安	77,128,346.00	51.64
5	600050	中国联通	77,056,565.00	51.59
6	000858	五粮液	69,866,957.16	46.78
7	600887	伊利股份	66,113,389.00	44.27
8	600036	招商银行	65,009,205.45	43.53
9	002415	海康威视	61,343,718.01	41.07
10	000001	平安银行	57,811,943.45	38.71
11	000725	京东方 A	57,675,317.00	38.62
12	601138	工业富联	57,552,065.00	38.53

13	600900	长江电力	54,699,081.10	36.62
14	601766	中国中车	54,646,220.00	36.59
15	601398	工商银行	51,686,845.00	34.61
16	601288	农业银行	51,041,938.00	34.17
17	600406	国电南瑞	50,168,693.62	33.59
18	600048	保利发展	49,871,790.00	33.39
19	300628	亿联网络	48,155,433.40	32.24
20	002475	立讯精密	48,070,145.00	32.19
21	601939	建设银行	46,213,162.67	30.94
22	600372	中航机载	46,072,952.09	30.85
23	600219	南山铝业	45,937,189.00	30.76
24	002236	大华股份	44,189,508.50	29.59
25	300408	三环集团	43,520,595.00	29.14
26	002027	分众传媒	43,329,168.00	29.01
27	002241	歌尔股份	43,326,883.08	29.01
28	300433	蓝思科技	41,092,283.50	27.51
29	601688	华泰证券	39,676,440.97	26.57
30	600875	东方电气	39,311,604.40	26.32
31	000651	格力电器	38,670,041.00	25.89
32	000938	紫光股份	37,486,253.00	25.10
33	601877	正泰电器	37,068,683.00	24.82
34	603288	海天味业	37,046,836.10	24.80
35	000776	广发证券	36,188,748.94	24.23
36	601728	中国电信	35,931,071.00	24.06
37	688009	中国通号	35,412,026.29	23.71
38	000063	中兴通讯	35,185,255.91	23.56
39	000977	浪潮信息	35,139,489.56	23.53
40	600196	复星医药	34,994,368.00	23.43
41	601618	中国中冶	34,723,227.00	23.25
42	600031	三一重工	34,437,284.00	23.06
43	601319	中国人保	34,247,668.00	22.93
44	000100	TCL 科技	31,450,296.40	21.06
45	601698	中国卫通	31,080,990.12	20.81
46	601881	中国银河	31,038,474.00	20.78
47	000568	泸州老窖	30,768,084.92	20.60
48	601600	中国铝业	30,539,310.00	20.45
49	601117	中国化学	30,538,708.80	20.45
50	601857	中国石油	29,524,895.00	19.77
51	600919	江苏银行	29,509,386.20	19.76
52	300496	中科创达	28,837,865.84	19.31
53	601901	方正证券	28,762,052.00	19.26
54	600660	福耀玻璃	28,731,014.00	19.24
55	300059	东方财富	28,681,410.71	19.20
56	300033	同花顺	27,864,560.00	18.66

57	300014	亿纬锂能	27,666,431.00	18.52
58	000895	双汇发展	27,654,227.00	18.52
59	600690	海尔智家	27,360,476.00	18.32
60	600015	华夏银行	27,251,804.80	18.25
61	601919	中远海控	27,247,981.00	18.24
62	300760	迈瑞医疗	27,144,773.68	18.17
63	601899	紫金矿业	27,067,916.50	18.12
64	002179	中航光电	26,992,022.47	18.07
65	002594	比亚迪	26,928,947.90	18.03
66	600332	白云山	26,643,208.15	17.84
67	601916	浙商银行	26,246,761.00	17.57
68	000166	申万宏源	25,832,001.59	17.30
69	688981	中芯国际	25,783,416.88	17.26
70	601816	京沪高铁	25,510,257.22	17.08
71	601668	中国建筑	25,051,626.00	16.77
72	601601	中国太保	24,848,513.00	16.64
73	600958	东方证券	23,981,611.12	16.06
74	601328	交通银行	23,677,194.40	15.85
75	601669	中国电建	23,671,247.00	15.85
76	600362	江西铜业	23,567,118.00	15.78
77	688187	时代电气	23,525,241.01	15.75
78	300015	爱尔眼科	22,977,517.00	15.38
79	300373	扬杰科技	22,427,767.00	15.02
80	600028	中国石化	21,942,484.50	14.69
81	000538	云南白药	21,473,964.40	14.38
82	002938	鹏鼎控股	21,037,761.29	14.09
83	002812	恩捷股份	20,803,665.60	13.93
84	603986	兆易创新	20,704,755.00	13.86
85	002555	三七互娱	20,615,077.44	13.80
86	002648	卫星化学	20,561,407.79	13.77
87	600795	国电电力	20,077,111.00	13.44
88	300017	网宿科技	19,997,440.00	13.39
89	601186	中国铁建	19,862,877.24	13.30
90	300498	温氏股份	19,717,570.88	13.20
91	600999	招商证券	19,611,318.60	13.13
92	002001	新和成	19,431,309.55	13.01
93	600938	中国海油	19,411,549.00	13.00
94	600025	华能水电	19,306,872.00	12.93
95	600438	通威股份	19,041,079.00	12.75
96	600030	中信证券	18,922,716.25	12.67
97	000157	中联重科	18,616,389.00	12.46
98	600089	特变电工	18,430,727.60	12.34
99	600161	天坛生物	18,155,557.15	12.16
100	600276	恒瑞医药	18,072,558.40	12.10

101	601088	中国神华	18,001,956.00	12.05
102	002736	国信证券	17,903,258.00	11.99
103	603993	洛阳钼业	17,723,516.00	11.87
104	000807	云铝股份	17,522,357.00	11.73
105	300122	智飞生物	17,252,848.00	11.55
106	300308	中际旭创	16,636,141.80	11.14
107	601989	中国重工	15,286,135.00	10.23
108	002230	科大讯飞	15,059,976.00	10.08
109	002252	上海莱士	15,031,588.94	10.06
110	000617	中油资本	14,984,026.00	10.03
111	002601	龙佰集团	14,943,677.00	10.01
112	605499	东鹏饮料	14,815,721.80	9.92
113	000338	潍柴动力	14,798,637.00	9.91
114	601166	兴业银行	14,565,992.50	9.75
115	600183	生益科技	14,426,592.00	9.66
116	601808	中海油服	14,409,445.39	9.65
117	300274	阳光电源	14,370,356.80	9.62
118	300124	汇川技术	14,002,214.99	9.38
119	600019	宝钢股份	13,885,900.00	9.30
120	600741	华域汽车	13,865,972.00	9.28
121	002371	北方华创	13,214,719.00	8.85
122	601169	北京银行	13,128,451.69	8.79
123	002202	金风科技	13,038,695.00	8.73
124	601231	环旭电子	12,931,195.80	8.66
125	000768	中航西飞	12,659,639.00	8.48
126	600941	中国移动	12,469,604.00	8.35
127	601607	上海医药	12,336,319.00	8.26
128	603259	药明康德	12,304,332.56	8.24
129	600415	小商品城	11,924,154.00	7.98
130	601998	中信银行	11,921,030.00	7.98
131	688223	晶科能源	11,895,800.31	7.96
132	600989	宝丰能源	11,461,107.50	7.67
133	601211	国泰君安	11,312,806.00	7.57
134	601985	中国核电	11,273,277.00	7.55
135	001965	招商公路	11,109,303.00	7.44
136	300999	金龙鱼	11,022,264.00	7.38
137	688126	沪硅产业	10,903,934.63	7.30
138	000021	深科技	10,716,380.11	7.18
139	300232	洲明科技	10,678,057.00	7.15
140	002180	纳思达	10,657,143.00	7.14
141	601012	隆基绿能	10,588,943.60	7.09
142	601658	邮储银行	10,503,209.25	7.03
143	688256	寒武纪	10,491,661.06	7.02
144	688012	中微公司	10,490,697.56	7.02

145	002714	牧原股份	10,405,911.80	6.97
146	000963	华东医药	10,331,583.00	6.92
147	300641	正丹股份	10,262,509.00	6.87
148	002028	思源电气	10,155,828.00	6.80
149	600585	海螺水泥	9,988,140.00	6.69
150	603195	公牛集团	9,775,156.07	6.54
151	603659	璞泰来	9,773,157.32	6.54
152	600000	浦发银行	9,115,453.18	6.10
153	603369	今世缘	9,025,511.00	6.04
154	601888	中国中免	8,894,419.96	5.96
155	688588	凌志软件	8,752,767.95	5.86
156	300142	沃森生物	8,686,032.00	5.82
157	600926	杭州银行	8,559,494.60	5.73
158	600188	兖矿能源	8,538,406.87	5.72
159	600703	三安光电	8,263,393.00	5.53
160	688728	格科微	8,122,657.38	5.44
161	600760	中航沈飞	8,086,025.76	5.41
162	300450	先导智能	8,073,426.00	5.41
163	600809	山西汾酒	8,001,141.00	5.36
164	600380	健康元	7,919,111.36	5.30
165	002389	航天彩虹	7,793,535.00	5.22
166	002410	广联达	7,792,930.00	5.22
167	603106	恒银科技	7,610,809.00	5.10
168	601229	上海银行	7,368,005.00	4.93
169	000729	燕京啤酒	7,333,771.00	4.91
170	300475	香农芯创	7,309,574.00	4.89
171	601225	陕西煤业	7,260,576.00	4.86
172	601390	中国中铁	6,984,227.00	4.68
173	000060	中金岭南	6,906,080.42	4.62
174	603799	华友钴业	6,834,245.00	4.58
175	300162	雷曼光电	6,795,258.88	4.55
176	601006	大秦铁路	6,749,561.00	4.52
177	000425	徐工机械	6,739,575.00	4.51
178	688468	科美诊断	6,717,719.00	4.50
179	603392	万泰生物	6,694,602.80	4.48
180	600018	上港集团	6,663,542.70	4.46
181	300661	圣邦股份	6,631,421.00	4.44
182	601717	郑煤机	6,618,071.38	4.43
183	601898	中煤能源	6,456,445.00	4.32
184	300184	力源信息	6,393,778.00	4.28
185	002493	荣盛石化	6,255,574.76	4.19
186	601628	中国人寿	6,234,271.00	4.17
187	300759	康龙化成	6,159,612.00	4.12
188	600029	南方航空	6,097,437.72	4.08

189	002409	雅克科技	6,026,877.00	4.04
190	688111	金山办公	5,902,399.31	3.95
191	300418	昆仑万维	5,901,975.00	3.95
192	002129	TCL 中环	5,895,933.00	3.95
193	002255	海陆重工	5,860,275.00	3.92
194	600886	国投电力	5,852,209.00	3.92
195	300144	宋城演艺	5,622,156.00	3.76
196	601360	三六零	5,609,840.00	3.76
197	002311	海大集团	5,606,975.85	3.75
198	600160	巨化股份	5,509,295.00	3.69
199	300979	华利集团	5,478,866.00	3.67
200	000002	万科 A	5,430,915.00	3.64
201	002142	宁波银行	5,393,257.00	3.61
202	000625	长安汽车	5,384,352.00	3.61
203	600674	川投能源	5,380,023.00	3.60
204	601009	南京银行	5,277,286.00	3.53
205	688082	盛美上海	5,253,937.38	3.52
206	688041	海光信息	5,244,201.93	3.51
207	600436	片仔癀	5,227,476.00	3.50
208	688122	西部超导	5,212,313.11	3.49
209	601868	中国能建	5,194,791.00	3.48
210	301339	通行宝	5,067,285.00	3.39
211	600905	三峡能源	5,046,444.00	3.38
212	002249	大洋电机	4,983,383.00	3.34
213	300369	绿盟科技	4,961,880.00	3.32
214	300140	节能环保	4,912,130.00	3.29
215	000876	新希望	4,889,471.30	3.27
216	600879	航天电子	4,886,948.00	3.27
217	300684	中石科技	4,750,361.00	3.18
218	002007	华兰生物	4,668,233.00	3.13
219	600588	用友网络	4,666,248.00	3.12
220	688169	石头科技	4,515,795.31	3.02
221	300223	北京君正	4,500,699.41	3.01
222	600872	中炬高新	4,493,609.89	3.01
223	601633	长城汽车	4,460,317.44	2.99
224	600763	通策医疗	4,451,625.18	2.98
225	600309	万华化学	4,450,803.00	2.98
226	600893	航发动力	4,408,510.00	2.95
227	601800	中国交建	4,384,807.00	2.94
228	002724	海洋王	4,351,915.00	2.91
229	688363	华熙生物	4,317,232.80	2.89
230	300285	国瓷材料	4,282,686.00	2.87
231	002304	洋河股份	4,245,327.00	2.84
232	300012	华测检测	4,224,410.00	2.83

233	300054	鼎龙股份	4,186,965.00	2.80
234	002519	银河电子	4,090,718.00	2.74
235	002920	德赛西威	4,076,925.00	2.73
236	000999	华润三九	4,073,118.00	2.73
237	002352	顺丰控股	4,057,926.00	2.72
238	603501	韦尔股份	4,000,294.00	2.68
239	000700	模塑科技	3,971,496.00	2.66
240	600104	上汽集团	3,938,162.00	2.64
241	600489	中金黄金	3,925,077.00	2.63
242	601238	广汽集团	3,912,256.00	2.62
243	300699	光威复材	3,862,019.00	2.59
244	300782	卓胜微	3,859,955.00	2.58
245	601377	兴业证券	3,820,508.00	2.56
246	600803	新奥股份	3,811,157.00	2.55
247	300132	青松股份	3,775,780.00	2.53
248	000039	中集集团	3,739,367.00	2.50
249	002533	金杯电工	3,714,763.60	2.49
250	300696	爱乐达	3,693,943.00	2.47
251	688235	百济神州	3,687,202.58	2.47
252	300896	爱美客	3,680,796.80	2.46
253	688385	复旦微电	3,667,260.88	2.46
254	301218	华是科技	3,651,926.00	2.45
255	600132	重庆啤酒	3,643,169.00	2.44
256	601555	东吴证券	3,639,432.00	2.44
257	300442	润泽科技	3,613,070.00	2.42
258	002351	漫步者	3,600,287.00	2.41
259	688008	澜起科技	3,557,747.00	2.38
260	300462	华铭智能	3,555,195.00	2.38
261	300771	智莱科技	3,545,781.00	2.37
262	301056	森赫股份	3,531,020.04	2.36
263	300701	森霸传感	3,523,384.12	2.36
264	301013	利和兴	3,508,113.00	2.35
265	000090	天健集团	3,489,362.32	2.34
266	002916	深南电路	3,485,555.00	2.33
267	300765	新诺威	3,457,677.60	2.32
268	002050	三花智控	3,416,173.00	2.29
269	601018	宁波港	3,407,643.99	2.28
270	300454	深信服	3,361,869.00	2.25
271	300155	安居宝	3,344,638.98	2.24
272	300645	正元智慧	3,320,285.00	2.22
273	601061	中信金属	3,306,430.00	2.21
274	000975	山金国际	3,292,151.00	2.20
275	601066	中信建投	3,286,409.00	2.20
276	688506	百利天恒	3,285,621.12	2.20

277	300943	春晖智控	3,280,228.00	2.20
278	600968	海油发展	3,221,770.00	2.16
279	002841	视源股份	3,139,946.00	2.10
280	601789	宁波建工	3,100,896.00	2.08
281	600584	长电科技	3,097,703.00	2.07
282	002271	东方雨虹	3,051,943.00	2.04
283	601336	新华保险	3,024,707.00	2.03
284	301282	金禄电子	2,992,072.00	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	300750	宁德时代	57,171,678.17	38.28
2	000938	紫光股份	44,614,001.55	29.87
3	600036	招商银行	43,373,259.50	29.04
4	601698	中国卫通	41,631,262.30	27.87
5	300496	中科创达	41,247,152.00	27.62
6	000100	TCL 科技	39,439,596.37	26.41
7	600050	中国联通	39,148,176.36	26.21
8	600900	长江电力	39,043,940.75	26.14
9	000977	浪潮信息	38,048,424.89	25.48
10	000568	泸州老窖	36,614,020.00	24.51
11	002241	歌尔股份	36,374,830.51	24.35
12	601881	中国银河	36,033,414.74	24.13
13	600919	江苏银行	32,770,368.85	21.94
14	688981	中芯国际	32,191,756.37	21.55
15	300760	迈瑞医疗	31,037,710.28	20.78
16	300059	东方财富	28,327,580.44	18.97
17	601901	方正证券	26,149,110.00	17.51
18	600958	东方证券	25,541,965.21	17.10
19	600660	福耀玻璃	25,413,658.34	17.02
20	601816	京沪高铁	25,385,020.00	17.00
21	600519	贵州茅台	24,940,457.71	16.70
22	300122	智飞生物	24,211,952.45	16.21
23	688009	中国通号	24,093,812.93	16.13
24	002812	恩捷股份	23,957,726.27	16.04
25	300033	同花顺	23,759,428.88	15.91
26	000063	中兴通讯	23,709,641.00	15.87
27	688187	时代电气	23,390,952.59	15.66

28	002415	海康威视	22,832,997.25	15.29
29	603986	兆易创新	22,597,897.18	15.13
30	601186	中国铁建	22,420,682.40	15.01
31	300017	网宿科技	22,354,183.25	14.97
32	600332	白云山	22,242,648.10	14.89
33	600028	中国石化	22,074,858.93	14.78
34	600015	华夏银行	21,906,037.80	14.67
35	600406	国电南瑞	21,694,001.51	14.53
36	002555	三七互娱	21,569,073.82	14.44
37	601899	紫金矿业	21,404,739.64	14.33
38	601728	中国电信	21,350,816.75	14.30
39	600025	华能水电	21,111,958.67	14.14
40	601877	正泰电器	20,538,348.87	13.75
41	601919	中远海控	19,425,955.00	13.01
42	601138	工业富联	18,984,129.50	12.71
43	600276	恒瑞医药	18,247,920.36	12.22
44	600030	中信证券	18,182,585.00	12.17
45	600938	中国海油	17,755,572.00	11.89
46	000538	云南白药	17,748,303.55	11.88
47	300015	爱尔眼科	17,728,372.75	11.87
48	600219	南山铝业	17,457,859.00	11.69
49	601939	建设银行	17,323,213.00	11.60
50	002230	科大讯飞	17,226,412.50	11.53
51	600183	生益科技	16,949,131.75	11.35
52	002202	金风科技	16,740,109.00	11.21
53	300308	中际旭创	16,709,984.00	11.19
54	601088	中国神华	16,658,991.50	11.15
55	600795	国电电力	16,598,543.00	11.11
56	601318	中国平安	16,564,059.00	11.09
57	000725	京东方 A	16,560,434.00	11.09
58	002648	卫星化学	16,466,330.56	11.02
59	000157	中联重科	16,440,133.50	11.01
60	600161	天坛生物	16,437,173.92	11.01
61	300498	温氏股份	16,387,302.67	10.97
62	000651	格力电器	16,375,204.00	10.96
63	300628	亿联网络	16,324,349.86	10.93
64	600372	中航机载	16,150,788.31	10.81
65	601688	华泰证券	16,105,543.75	10.78
66	300014	亿纬锂能	16,084,863.00	10.77
67	600887	伊利股份	16,045,005.00	10.74
68	600089	特变电工	15,966,885.82	10.69
69	605499	东鹏饮料	15,894,766.34	10.64
70	601857	中国石油	15,867,502.99	10.62
71	601766	中国中车	15,746,311.00	10.54

72	000001	平安银行	15,483,123.00	10.37
73	600415	小商品城	14,895,910.45	9.97
74	300124	汇川技术	14,393,186.56	9.64
75	600741	华域汽车	14,140,439.00	9.47
76	601985	中国核电	13,964,885.51	9.35
77	002601	龙佰集团	13,897,021.00	9.30
78	601607	上海医药	13,652,210.00	9.14
79	601808	中海油服	13,413,664.41	8.98
80	000021	深科技	13,410,286.50	8.98
81	601328	交通银行	13,407,188.00	8.98
82	300408	三环集团	13,306,696.00	8.91
83	000338	潍柴动力	13,305,849.66	8.91
84	000333	美的集团	13,230,891.00	8.86
85	600941	中国移动	13,135,079.66	8.79
86	002371	北方华创	13,083,904.00	8.76
87	300274	阳光电源	12,636,583.00	8.46
88	601989	中国重工	12,517,538.00	8.38
89	600999	招商证券	12,366,562.60	8.28
90	601998	中信银行	11,862,229.00	7.94
91	601117	中国化学	11,848,812.72	7.93
92	600048	保利发展	11,745,198.39	7.86
93	601600	中国铝业	11,666,559.18	7.81
94	000776	广发证券	11,618,136.77	7.78
95	001965	招商公路	11,413,453.00	7.64
96	000858	五粮液	11,256,255.00	7.54
97	601211	国泰君安	11,254,197.00	7.54
98	002938	鹏鼎控股	11,184,030.25	7.49
99	300999	金龙鱼	11,094,131.00	7.43
100	688256	寒武纪	10,913,624.68	7.31
101	300232	洲明科技	10,873,852.00	7.28
102	002001	新和成	10,820,329.20	7.24
103	000963	华东医药	10,658,883.55	7.14
104	600989	宝丰能源	10,570,181.38	7.08
105	002236	大华股份	10,556,120.00	7.07
106	002028	思源电气	10,537,739.94	7.06
107	002027	分众传媒	10,394,288.00	6.96
108	601012	隆基绿能	10,384,308.60	6.95
109	601166	兴业银行	10,382,456.96	6.95
110	002714	牧原股份	10,169,741.80	6.81
111	688012	中微公司	10,124,655.49	6.78
112	300641	正丹股份	10,089,672.00	6.76
113	600875	东方电气	9,586,863.00	6.42
114	002594	比亚迪	9,404,529.20	6.30
115	601288	农业银行	9,356,469.50	6.26

116	603659	璞泰来	9,304,730.47	6.23
117	601398	工商银行	9,285,877.00	6.22
118	603195	公牛集团	9,246,213.43	6.19
119	600926	杭州银行	9,148,990.00	6.13
120	600690	海尔智家	9,052,102.00	6.06
121	603993	洛阳钼业	9,030,718.00	6.05
122	600000	浦发银行	8,926,232.00	5.98
123	603259	药明康德	8,728,204.00	5.84
124	601668	中国建筑	8,719,727.00	5.84
125	600703	三安光电	8,711,469.00	5.83
126	300450	先导智能	8,683,151.72	5.81
127	300142	沃森生物	8,625,893.45	5.78
128	600760	中航沈飞	8,588,267.75	5.75
129	603369	今世缘	8,416,720.00	5.64
130	600809	山西汾酒	8,245,795.00	5.52
131	601888	中国中免	8,188,639.71	5.48
132	002389	航天彩虹	8,151,477.00	5.46
133	002410	广联达	8,149,590.00	5.46
134	600188	兖矿能源	8,096,481.40	5.42
135	601229	上海银行	7,985,685.17	5.35
136	688588	凌志软件	7,970,676.38	5.34
137	000807	云铝股份	7,720,782.00	5.17
138	688728	格科微	7,339,173.89	4.91
139	601006	大秦铁路	7,329,725.00	4.91
140	002129	TCL 中环	7,269,790.00	4.87
141	300162	雷曼光电	7,238,324.00	4.85
142	000729	燕京啤酒	7,122,420.25	4.77
143	601360	三六零	7,087,500.58	4.75
144	300759	康龙化成	7,021,482.00	4.70
145	688111	金山办公	6,976,996.46	4.67
146	600674	川投能源	6,960,162.86	4.66
147	000625	长安汽车	6,879,060.14	4.61
148	300475	香农芯创	6,868,535.00	4.60
149	688468	科美诊断	6,816,878.56	4.56
150	002493	荣盛石化	6,807,685.25	4.56
151	601898	中煤能源	6,772,511.42	4.53
152	600019	宝钢股份	6,636,567.00	4.44
153	601717	郑煤机	6,557,983.98	4.39
154	601231	环旭电子	6,524,088.00	4.37
155	600380	健康元	6,486,050.20	4.34
156	601225	陕西煤业	6,184,611.00	4.14
157	603392	万泰生物	6,120,675.42	4.10
158	002409	雅克科技	6,066,323.50	4.06
159	688126	沪硅产业	5,996,033.57	4.01

160	300433	蓝思科技	5,918,795.00	3.96
161	002475	立讯精密	5,892,753.00	3.95
162	601319	中国人保	5,803,593.00	3.89
163	300418	昆仑万维	5,796,490.52	3.88
164	600436	片仔癀	5,785,373.00	3.87
165	600309	万华化学	5,690,552.00	3.81
166	300144	宋城演艺	5,652,490.00	3.78
167	002311	海大集团	5,641,508.54	3.78
168	300979	华利集团	5,579,842.50	3.74
169	600879	航天电子	5,544,303.00	3.71
170	600160	巨化股份	5,531,155.25	3.70
171	688041	海光信息	5,444,148.31	3.65
172	002736	国信证券	5,357,685.00	3.59
173	600029	南方航空	5,315,791.00	3.56
174	000002	万科 A	5,260,518.00	3.52
175	000425	徐工机械	5,232,646.00	3.50
176	002142	宁波银行	5,206,676.00	3.49
177	300684	中石科技	5,144,581.00	3.44
178	600886	国投电力	5,118,632.33	3.43
179	002249	大洋电机	5,111,019.00	3.42
180	688122	西部超导	5,083,082.61	3.40
181	002180	纳思达	5,024,627.92	3.36
182	601169	北京银行	5,014,517.56	3.36
183	000895	双汇发展	5,003,411.00	3.35
184	300223	北京君正	4,948,793.00	3.31
185	601800	中国交建	4,829,814.00	3.23
186	600905	三峡能源	4,790,443.50	3.21
187	002007	华兰生物	4,702,759.09	3.15
188	603501	韦尔股份	4,684,606.90	3.14
189	603106	恒银科技	4,681,317.00	3.13
190	002304	洋河股份	4,649,255.12	3.11
191	002519	银河电子	4,629,382.10	3.10
192	600104	上汽集团	4,622,826.00	3.10
193	601238	广汽集团	4,595,215.20	3.08
194	688082	盛美上海	4,588,660.49	3.07
195	600893	航发动力	4,536,478.00	3.04
196	000166	申万宏源	4,525,754.00	3.03
197	300054	鼎龙股份	4,517,477.06	3.02
198	300140	节能环境	4,507,495.00	3.02
199	601633	长城汽车	4,445,074.72	2.98
200	600872	中炬高新	4,428,946.00	2.97
201	000700	模塑科技	4,373,512.00	2.93
202	600588	用友网络	4,336,462.63	2.90
203	688363	华熙生物	4,321,052.48	2.89

204	301013	利和兴	4,275,228.00	2.86
205	300896	爱美客	4,232,086.15	2.83
206	688008	澜起科技	4,165,847.86	2.79
207	600584	长电科技	4,151,125.20	2.78
208	688223	晶科能源	4,149,499.26	2.78
209	002352	顺丰控股	4,145,937.97	2.78
210	300442	润泽科技	4,013,471.47	2.69
211	300699	光威复材	3,981,147.80	2.67
212	000999	华润三九	3,925,074.45	2.63
213	600763	通策医疗	3,899,524.70	2.61
214	601628	中国人寿	3,848,746.00	2.58
215	601789	宁波建工	3,848,028.00	2.58
216	301056	森赫股份	3,840,261.00	2.57
217	688169	石头科技	3,830,148.05	2.56
218	600803	新奥股份	3,822,015.25	2.56
219	002533	金杯电工	3,801,332.40	2.55
220	000039	中集集团	3,781,224.55	2.53
221	301218	华是科技	3,767,944.00	2.52
222	002724	海洋王	3,750,371.00	2.51
223	002351	漫步者	3,726,566.00	2.50
224	002271	东方雨虹	3,703,482.50	2.48
225	601390	中国中铁	3,689,381.50	2.47
226	688235	百济神州	3,609,827.68	2.42
227	000617	中油资本	3,465,230.80	2.32
228	300782	卓胜微	3,457,358.80	2.31
229	301339	通行宝	3,440,135.00	2.30
230	300454	深信服	3,395,882.00	2.27
231	600132	重庆啤酒	3,353,236.00	2.25
232	300696	爱乐达	3,340,818.54	2.24
233	000975	山金国际	3,314,585.00	2.22
234	300765	新诺威	3,303,717.80	2.21
235	300661	圣邦股份	3,256,582.00	2.18
236	600629	华建集团	3,253,372.00	2.18
237	002050	三花智控	3,250,132.75	2.18
238	002841	视源股份	3,242,726.00	2.17
239	688506	百利天恒	3,091,965.90	2.07
240	300822	贝仕达克	3,085,090.77	2.07
241	601868	中国能建	3,078,358.00	2.06
242	688385	复旦微电	3,065,498.15	2.05
243	601336	新华保险	3,023,316.00	2.02
244	601066	中信建投	2,988,000.00	2.00

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

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	5,539,619,630.27
卖出股票的收入（成交）总额	3,564,939,982.74

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	129,042,392.67	4.99
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	129,042,392.67	4.99

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24 国债 09	353,000	35,745,979.23	1.38
2	019749	24 国债 15	315,000	31,744,491.78	1.23
3	019733	24 国债 02	243,000	24,764,402.96	0.96
4	019758	24 国债 21	227,740	22,873,700.20	0.88
5	019723	23 国债 20	90,000	9,130,144.93	0.35

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，以套期保值为主要目的。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**

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同,本基金不参与国债期货交易。

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	15,137,909.90

2	应收清算款	18,125,635.63
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	93,601,469.62
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	126,865,015.15

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

本基金本报告期末前十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

份额级别	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
海富通沪深 300 增强 A	9,380	81,708.29	698,257,104.96	91.11%	68,166,610.62	8.89%
海富通沪深 300 增强 C	47,326	28,658.12	1,143,335,989.95	84.30%	212,938,128.50	15.70%
合计	56,706	37,433.39	1,841,593,094.91	86.76%	281,104,739.12	13.24%

注：本表基金机构/个人投资者持有份额占总份额比例的计算中，A、C 级比例分母为各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	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	海富通沪深 300 增强 A	625,147.60	0.0816%
	海富通沪深 300 增强 C	255,103.71	0.0188%
	合计	880,251.31	0.0415%

9.3 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	海富通沪深 300 增强 A	10~50
	海富通沪深 300 增强 C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通沪深 300 增强 A	10~50
	海富通沪深 300 增强 C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通沪深 300 增强 A	海富通沪深 300 增强 C
基金合同生效日（2019 年 10 月 9 日）基金份额总额	6,889,756.32	1,555,113.21
本报告期期初基金份额总额	113,218,925.65	39,000,999.34
本报告期基金总申购份额	800,222,440.32	1,984,123,437.50
减：本报告期基金总赎回份额	147,017,650.39	666,850,318.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	766,423,715.58	1,356,274,118.45

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

基金管理人：

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

2024 年 12 月 11 日，海富通基金管理有限公司发布公告，周小波先生自 2024 年 12 月 9 日起担任公司副总经理。

基金托管人：

本报告期内，经中国银行股份有限公司研究决定，郭德秋先生不再担任中国银行股份有限公司托管业务部总经理职务。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期内改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金审计的会计师事务所，并依法履行了公告手续。报告期内本基金应支付给所聘任会计师事务所的报酬为 50,000.00 元，该审计机构已为本基金提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	6,295,322,766.40	69.14%	1,238,693.12	52.38%	-
招商证券	2	986,855,738.85	10.84%	378,804.94	16.02%	-
国泰君安	2	871,254,391.38	9.57%	161,971.81	6.85%	-
申万宏源	2	401,562,672.80	4.41%	176,791.57	7.48%	-
国盛证券	2	359,891,148.10	3.95%	266,856.45	11.29%	-
华西证券	1	88,396,510.69	0.97%	65,935.72	2.79%	-
天风证券	2	66,192,124.98	0.73%	49,372.97	2.09%	-
西南证券	2	35,084,259.81	0.39%	26,169.27	1.11%	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、报告期内本基金退租中信证券两个交易单元、中信建投两个交易单元、太平洋证券两个交易单元、上海证券一个交易单元和渤海证券一个交易单元。

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
中信证券	131,544,684.60	72.06%	1,779,190,000.00	68.37%	-	-
招商证券	29,269,873.50	16.03%	479,029,000.00	18.41%	-	-
国泰君安	-	-	50,030,000.00	1.92%	-	-
申万宏源	9,628,011.00	5.27%	87,290,000.00	3.35%	-	-
国盛证券	3,302,596.00	1.81%	117,839,000.00	4.53%	-	-
华西证券	2,301,379.00	1.26%	37,400,000.00	1.44%	-	-
天风证券	3,501,473.00	1.92%	30,412,000.00	1.17%	-	-
西南证券	200,659.00	0.11%	19,350,000.00	0.74%	-	-
国金证券	2,804,475.00	1.54%	1,800,000.00	0.07%	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
野村东方国际证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增开源证券股份有限公司为销售机构并参加	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网	2024-02-08

	其申购费率优惠活动的公告	站	
2	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增贵州省贵文文化基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-18
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增山西证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-09
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增深圳前海微众银行股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-16
5	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增华泰证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-18
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-07-25
7	海富通基金管理有限公司关于董事长变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-04
8	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-11
9	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增爱建证券有限责任公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-25
10	海富通基金管理有限公司关于旗下基金持有的股票停牌后估值方法变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-09-30
11	海富通基金管理有限公司关于增聘基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-10-11
12	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增泛华普益基金销售有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-10-11

13	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增交通银行股份有限公司为销售机构的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-10-23
14	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-11-22
15	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-11
16	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-13
17	海富通基金管理有限公司关于海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金新增国元证券股份有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-12-19

12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2024/8/15-2024/12/17	-	532,213,899.71	307,235,273.32	224,978,626.39	10.60%
	2	2024/1/1-2024/4/23	54,206,989.38	-	-	54,206,989.38	2.55%
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</p>							

无法及时变现基金资产以应对基金份额持有人的赎回申请，基金份额持有人可能无法及时赎回持有的全部基金份额；

3、若个别投资者大额赎回后，可能会导致基金资产净值连续出现六十个工作日低于 5000 万元的风险，基金可能会面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；

4、其他可能的风险。

另外，当某单一基金份额持有人所持有的基金份额已经达到或超过本基金规模的 50% 或者接受某笔或者某些申购或转换转入申请有可能导致单一投资者持有基金份额的比例达到或者超过 50% 时，本基金管理人可拒绝该持有人对本基金基金份额提出的申购及转换转入申请。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

从 2003 年 8 月开始，海富通先后募集成立了 124 只公募基金。截至 2024 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1722 亿元人民币。

海富通是国家人力资源和社会保障部首批企业年金基金投资管理人，是首批获得特定客户资产管理业务资格的基金管理公司。2010 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为境内委托投资管理人。2012 年 9 月，中国保监会公告确认海富通为首批保险资金投资管理人之一。2014 年 8 月，海富通全资子公司上海富诚海富通资产管理有限公司正式开业，获准开展特定客户资产管理服务。2016 年 12 月，海富通被全国社会保障基金理事会选聘为首批基本养老保险基金投资管理人。

2021 年 7 月，海富通内需热点混合型证券投资基金蝉联《上海证券报》颁发的“金基金·偏股混合型基金三年期奖”。2021 年 9 月，由《中国证券报》主办的第十八届“中国基金业金牛奖”揭晓，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。

2022 年 7 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置混合型明星基金奖”。2022 年 8 月，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获《中国证券报》颁发的“五年期开放式混合型持续优胜金牛基金”，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获“三年期开放式混合型持续优胜金牛基金”。2022 年 9 月，海富通荣获中国保险资产管理业协会颁发的“IAMAC 推介 2021 年度保险资产管理业最受欢迎投资业务合作机构——最具进取基金公司”。2022 年 11 月，海富通改革驱动灵活配置混合型证券投资基金荣获《上海证券报》颁发的“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金

金五年期奖”。

2023 年 3 月,海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月,海富通收益增长证券投资基金荣获《证券时报》颁发的“五年持续回报灵活配置型明星基金奖”。2023 年 8 月,海富通荣获《上海证券报》颁发的“上证·中国基金投教创新案例奖”。

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

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (一)中国证监会准予海富通富睿混合型证券投资基金变更注册的文件
- (二)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金基金合同
- (三)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金招募说明书
- (四)海富通沪深 300 指数增强型证券投资基金托管协议
- (五)中国证监会批准设立海富通基金管理有限公司的文件
- (六)法律法规及中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

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

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅。

海富通基金管理有限公司

二〇二五年三月三十一日