

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
2023 年年度报告
2023 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：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 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 2023 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.....	18
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.....	19
§6 审计报告	19
6.1 审计意见.....	20
6.2 形成审计意见的基础.....	20
6.3 管理层和治理层对财务报表的责任.....	20
6.4 注册会计师对财务报表审计的责任.....	20
§7 年度财务报表	22
7.1 资产负债表.....	22
7.2 利润表.....	23
7.3 净资产变动表.....	24
7.4 报表附注.....	26
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况.....	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	57
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.....	58
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	83

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	83
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	83
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	83
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	84
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	84
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	84
8.12	投资组合报告附注	84
§9	基金份额持有人信息	85
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	85
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	86
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	86
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	86
§10	开放式基金份额变动	87
§11	重大事件揭示	87
11.1	基金份额持有人大会决议	87
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	87
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	87
11.4	基金投资策略的改变	88
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	88
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	88
11.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	88
11.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	88
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	88
11.8	其他重大事件	90
12	影响投资者决策的其他重要信息	91
§13	备查文件目录	93
13.1	备查文件目录	93
13.2	存放地点	93
13.3	查阅方式	93

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金	
基金简称	海富通创业板增强	
基金主代码	005287	
交易代码	005287	
基金运作方式	契约型、开放式、发起式	
基金合同生效日	2018 年 4 月 8 日	
基金管理人	海富通基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	656,754,567.29 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
下属分级基金的交易代码	005288	005287
报告期末下属分级基金的份 额总额	502,639,911.79 份	154,114,655.50 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,通过数量化的投资策略模型精选创业板优质股票,力争将本基金净值增长率与业绩基准涨跌幅的日均偏离度控制在 0.5%以内、年化跟踪误差控制在 7.5%以内,同时力求使基金的业绩超越创业板综合指数表现。
投资策略	本基金为增强型指数基金,对指数投资部分将采用抽样复制标的指数投资方法,利用成熟的量化技术模型实现对创业板综合指数的紧密跟踪。本基金对主动投资部分采取积极配置策略,力争在跟踪误差控制范围内,使基金的业绩超越创业板综合指数表现。
业绩比较基准	创业板综合指数收益率×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,属于较高预

	期收益和预期风险水平的投资品种。
--	------------------

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	岳冲	郭明
	联系电话	021-38650788	010-66105799
	电子邮箱	chongyue@hftfund.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		40088-40099	95588
传真		021-33830166	010-66105798
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	北京市西城区复兴门内大街 55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	北京市西城区复兴门内大街 55号
邮政编码		200120	100140
法定代表人		杨仓兵	陈四清

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	上海市浦东新区东育路 588 号 前滩中心 42 楼
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	2023 年		2022 年		2021 年	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
本期已实现收益	-24,205,051.50	-12,070,567.20	-1,932,821.15	-3,730,376.08	8,690,899.98	18,341,403.34
本期利润	-26,809,420.31	-20,863,633.77	-12,040,039.97	-23,181,804.94	8,642,243.04	19,097,093.05
加权平均基金份额本期利润	-0.3116	-0.3382	-0.5598	-0.6121	0.4775	0.4691
本期加权平均净值利润率	-21.42%	-22.73%	-31.63%	-35.00%	23.85%	23.56%
本期基金份额净值增长率	-9.21%	-9.58%	-27.63%	-27.92%	21.76%	21.27%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C

期末可供分配利润	59,793,030.89	12,837,789.02	13,301,105.20	18,035,703.76	11,485,610.03	24,377,490.58
期末可供分配基金份额利润	0.1190	0.0833	0.5487	0.5162	0.6351	0.6082
期末基金资产净值	579,254,677.16	172,767,613.76	38,586,394.86	54,628,645.98	39,779,772.68	86,936,174.23
期末基金份额净值	1.1524	1.1210	1.5918	1.5634	2.1996	2.1691
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
基金份额累计净值增长率	44.51%	41.37%	59.18%	56.34%	119.96%	116.91%

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. 海富通创业板增强 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	-3.86%	0.97%	-2.03%	1.11%	-1.83%	-0.14%
过去六个月	-13.37%	0.93%	-9.45%	1.05%	-3.92%	-0.12%
过去一年	-9.21%	0.91%	-4.05%	1.01%	-5.16%	-0.10%
过去三年	-20.00%	1.38%	-14.92%	1.34%	-5.08%	0.04%
过去五年	84.61%	1.48%	70.10%	1.51%	14.51%	-0.03%
自基金合同生效起至今	44.51%	1.46%	15.80%	1.53%	28.71%	-0.07%

2. 海富通创业板增强 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	-3.96%	0.97%	-2.03%	1.11%	-1.93%	-0.14%
过去六个月	-13.55%	0.93%	-9.45%	1.05%	-4.10%	-0.12%
过去一年	-9.58%	0.91%	-4.05%	1.01%	-5.53%	-0.10%
过去三年	-20.96%	1.38%	-14.92%	1.34%	-6.04%	0.04%
过去五年	81.03%	1.48%	70.10%	1.51%	10.93%	-0.03%
自基金合同生效起至今	41.37%	1.46%	15.80%	1.53%	25.57%	-0.07%

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

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

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. 海富通创业板增强 A

(2018 年 4 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日)



2. 海富通创业板增强 C

(2018 年 4 月 8 日至 2023 年 12 月 31 日)

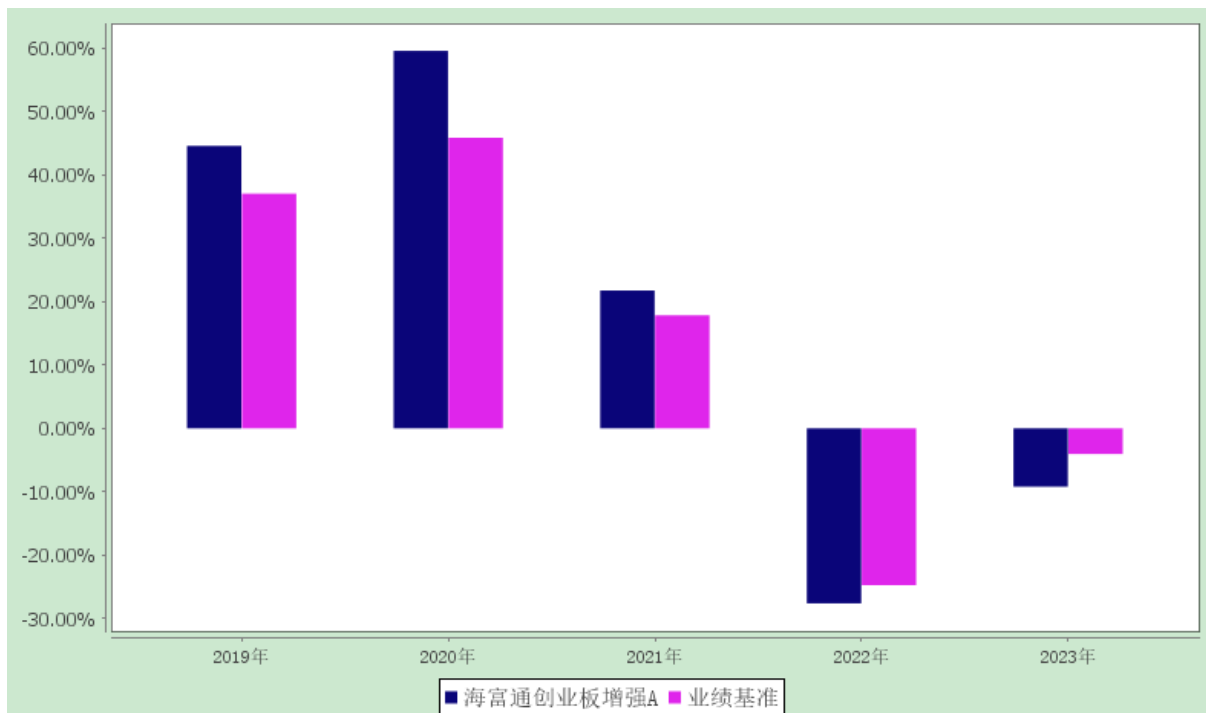


注：本基金合同于 2018 年 4 月 8 日生效，按基金合同规定，本基金自基金合同生效起 6 个月内为建仓期。建仓期结束时本基金的各项投资比例已达到基金合同第十二部分（二）投资范围、（四）投资限制中规定的各项比例。

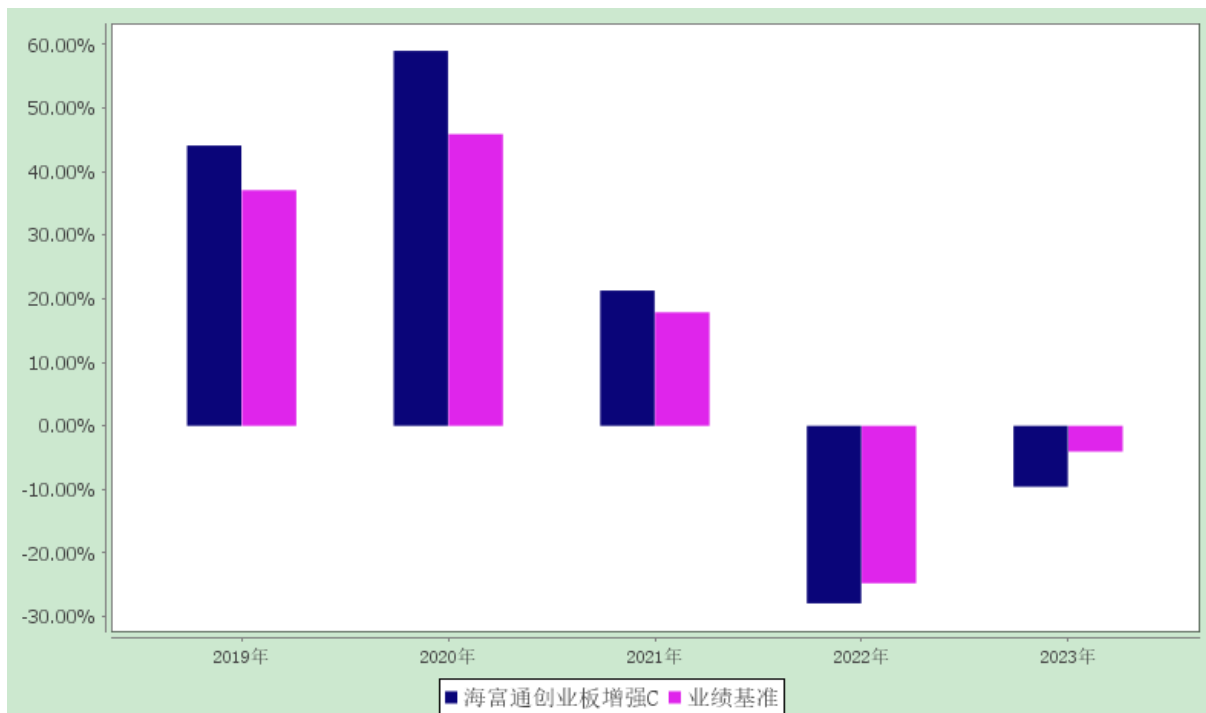
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金
过去五年净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图

1. 海富通创业板增强 A



2. 海富通创业板增强 C



3.3 过去三年基金的利润分配情况

1、海富通创业板增强 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
2023 年	2.896	125,011,474.17	16,168,178.11	141,179,652.28	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	2.896	125,011,474.17	16,168,178.11	141,179,652.28	-

2、海富通创业板增强 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
2023 年	2.896	41,985,485.94	2,512,197.16	44,497,683.10	-
2022 年	-	-	-	-	-
2021 年	-	-	-	-	-
合计	2.896	41,985,485.94	2,512,197.16	44,497,683.10	-

§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 2023 年 12 月 31 日，本基金管理人共管理 88 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 100 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、海富通添鑫收益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、海富通惠增多策略一年定期开放灵活配置混合型证券投资基金、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。

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		
杜晓海	本基金的基金经理；总经理助理兼量化投资部总监。	2018-04-09	-	23 年	硕士，持有基金从业人员资格证书。历任 Man-Drapeau Research 金融工程师，American Bourses Corporation 中国区总经理，海富通基金管理有限公司定量分析师、高级定量分析师、定量及风险管理负责人、定量及风险管理总监、多资产策略投资部总监，现任海富通基金管理有限公司总经理助理兼量化投资部总监。2016 年 6 月起任海富通安颐收益混合（原海富通养老收益混合）基金经理。2016 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通新内需混合基金经理。2016 年 9 月起兼任海富通欣荣混合基金经理。2017 年 4 月至 2018 年 1 月兼任海富通欣盛定开混合基金经理。2017 年 5 月至 2019 年 10 月兼任海富通富睿混合（现海富通沪深 300 增强）基金经理。2018 年 3 月至 2019 年 10 月兼任海富通富祥混合基金经理。2018 年 4 月至 2018 年 7 月兼任海富通东财大数据混合基金经理。2018 年 4 月起兼任海富通阿尔法对冲混合、海富通创业板增强的基金经理。2018 年 4 月至 2020 年 10 月兼任海

					<p>富通量化先锋股票、海富通稳固收益债券、海富通欣享混合的基金经理。2018 年 4 月至 2019 年 10 月兼任海富通欣益混合、海富通量化多因子混合的基金经理。2019 年 6 月至 2020 年 10 月兼任海富通研究精选混合基金经理。2020 年 1 月至 2022 年 8 月兼任海富通安益对冲混合基金经理。2020 年 3 月至 2021 年 7 月兼任海富通中证 500 增强（原海富通中证内地低碳指数）基金经理。2020 年 4 月至 2021 年 7 月兼任海富通添鑫收益债券基金经理。2020 年 5 月至 2023 年 10 月兼任海富通富盈混合基金经理。2020 年 6 月起兼任海富通富泽混合基金经理。2021 年 7 月起兼任海富通富利三个月持有混合基金经理。2023 年 10 月起兼任海富通中证港股通科技 ETF 基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

本报告期内，在大盘持续下跌的背景下，全市场来看，低估值、低波、反转类因子表现较好，成长表现较差。创业板内，价值、低波、分析师因子多头超额显著。在北向资金持续流出的背景下，大盘显著跑输小盘，部分权重股持续下跌。当前在低拥挤度的股票中挖掘机会更有利于获得超额。

行业配置方面，截止报告期末，新能源行业由于基本面一般，本基金对电力设备行业显著低配。而对于汽车等受益于出口链的板块，本基金予以超配。其余行业总体配置均衡。

本基金在力求对创业板综指进行有效跟踪的基础上，通过量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金坚持通过多策略并行的方式，根据公司基本面在业绩和估值匹配的公司中寻找投资机会，同时积极运用深度学习量价模型在低关注股票中挖掘机会，力争在风险可控的基础上跑赢基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，海富通创业板增强 A 净值增长率为-9.21%，同期业绩比较基准收益率为-4.05%，基金净值跑输业绩比较基准 5.16 个百分点。海富通创业板增强 C 净值增长率

为-9.58%，同期业绩比较基准收益率为-4.05%，基金净值跑输业绩比较基准 5.53 个百分点。本基金净值跑输基准主要源于如下两个方面原因：报告期内，市场的预期博弈强于基本面，从个股业绩出发的基本面类因子有效性较差；全年来看，小市值风格强于预期，基金对微盘股的配置相对基准有所不足。

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，由于美国财政高杠杆、货币高利率的制约，2024 年美国财政刺激力度将边际走弱，美国经济、通胀也将逐步下行，具体的下行速度、幅度需要具体跟踪。在这个背景下，美联储的具体降息操作将成为全球市场关注的一个焦点。这对全球金融市场、各类资产都将产生较为显著的影响，我们面临的外部金融环境有望缓解。

中国经济暂时仍面临着总需求不足、结构调整阵痛的冲击，在这过程中市场信心的脆弱和不足可能短期加剧经济的疲弱。不过，目前市场信心已在相对低位，监管层也在积极呵护市场，对经济的托底力度也有望进一步加强。我们对此依然怀抱着积极心态，积极跟踪国内政策和经济的变化。

在力求对创业板综指进行有效跟踪的基础上，我们将坚持多策略并行，一方面通过基本面策略跟踪公司的业绩，挖掘估值与成长相匹配、具备投资价值的好公司，另一方面通过深度学习策略在低关注股票中获取超额，力争在风险可控的基础上跑赢市场。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2023 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、专项稽核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，健全内控体系，落实内控责任。

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，新增和修订了多项内部制度和流程，并持续倡导合规文化建设，提升了公司内部控制环境建设。

二、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 and 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。针对上述内外部评估检查中发现的问题，公司相关业务部门均认真进行整改。通过及时跟踪落实各项问题的整改情况，

严格控制了各部门的主要风险，加强并完善了公司的内部控制状况。

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及流程，组织多场反洗钱专项培训和宣传活动；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，全面升级反洗钱系统，持续优化监测模型，强化对大额交易和可疑交易方面的监控，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 2022 年度洗钱固有风险评估工作，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，提升反洗钱工作质效。

四、强化法规学习，组织开展内外部培训，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。另外，通过考试等方式检验培训效果，将法规落实到具体的业务、工作中。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

本基金报告期内进行过一次利润分配，以截止 2023 年 12 月 15 日本基金的可供分配利润为基准。本次分红于 2023 年 12 月 22 日完成权益登记，海富通创业板增强 A 单位分红金额为 0.2896 元，海富通创业板增强 C 单位分红金额为 0.2896 元。合计利润分配金额为 185,677,335.38 元。

符合基金合同规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金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，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，本基金的管理人——海富通基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现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

本托管人依法对海富通基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2024)第 20571 号

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一)我们审计的内容

我们审计了海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金(以下简称“海富通创业板增强基金”)的财务报表,包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表,2023 年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。

(二)我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了海富通创业板增强基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 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。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。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于海富通创业板增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

海富通创业板增强基金的基金管理人海富通基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估海富通创业板增强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,除非基金管理人管理层计划清算海富通创业板增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督海富通创业板增强基金的财务报告过程。

6.4 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：

(一) 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。

(二) 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。

(三) 评价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。

(四) 对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，就可能导致对海富通创业板增强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海富通创业板增强基金不能持续经营。

(五) 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。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 胡莲莲

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2024 年 3 月 27 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	11,148,784.26	1,261,166.11
结算备付金		7,180,565.02	250,218.64
存出保证金		228,450.18	16,700.73
交易性金融资产	7.4.7.2	738,738,889.62	92,021,688.63
其中：股票投资		703,362,613.23	87,953,376.39
基金投资		-	-
债券投资		35,376,276.39	4,068,312.24
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		1,276,963.59	208,662.04
应收股利		-	-
应收申购款		504,316.13	67,081.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		759,077,968.80	93,825,517.86
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		737,077.60	-
应付赎回款		2,934,370.59	81,633.92
应付管理人报酬		1,019,071.94	98,824.74
应付托管费		169,845.33	16,470.78
应付销售服务费		113,306.09	19,724.74

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	2,082,006.33	393,822.84
负债合计		7,055,677.88	610,477.02
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	656,754,567.29	59,183,225.56
未分配利润	7.4.7.8	95,267,723.63	34,031,815.28
净资产合计		752,022,290.92	93,215,040.84
负债和净资产总计		759,077,968.80	93,825,517.86

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，A 类基金份额净值 1.1524 元，C 类基金份额净值 1.1210 元。基金份额总额 656,754,567.29 份，其中 A 类基金份额 502,639,911.79 份，C 类基金份额 154,114,655.50 份。

7.2 利润表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-44,031,740.46	-33,132,747.55
1.利息收入		106,528.89	19,982.54
其中：存款利息收入	7.4.7.9	106,528.89	19,982.54
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）		-33,283,618.95	-3,672,793.49
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-34,392,233.08	-4,454,406.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	219,498.67	121,366.96
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	-371,769.91	-17,165.11
股利收益	7.4.7.14	1,260,885.37	677,410.99
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	-11,397,435.38	-29,558,647.68
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	542,784.98	78,711.08
减：二、营业总支出		3,641,313.62	2,089,097.36
1. 管理人报酬		2,506,552.81	1,253,383.85
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		417,758.77	208,897.20
3. 销售服务费		355,974.84	265,966.22
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		10.24	-
其中：卖出回购金融资产支出		10.24	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		188.96	0.09
8. 其他费用	7.4.7.17	360,828.00	360,850.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-47,673,054.08	-35,221,844.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-47,673,054.08	-35,221,844.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-47,673,054.08	-35,221,844.91

7.3 净资产变动表

会计主体：海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 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	59,183,225.56	-	34,031,815.28	93,215,040.84
二、本期期初净资产	59,183,225.56	-	34,031,815.28	93,215,040.84
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	597,571,341.73	-	61,235,908.35	658,807,250.08

(一)、综合收益总额	-	-	-47,673,054.08	-47,673,054.08
(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)	597,571,341.73	-	294,586,297.81	892,157,639.54
其中: 1. 基金申购款	758,812,019.66	-	361,114,231.97	1,119,926,251.63
2. 基金赎回款	-161,240,677.93	-	-66,527,934.16	-227,768,612.09
(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)	-	-	-185,677,335.38	-185,677,335.38
四、本期期末净资产	656,754,567.29	-	95,267,723.63	752,022,290.92
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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	58,164,119.08	-	68,551,827.83	126,715,946.91
二、本期期初净资产	58,164,119.08	-	68,551,827.83	126,715,946.91
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,019,106.48	-	-34,520,012.55	-33,500,906.07
(一)、综合收益总额	-	-	-35,221,844.91	-35,221,844.91
(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)	1,019,106.48	-	701,832.36	1,720,938.84
其中: 1. 基金申购款	37,327,768.96	-	28,337,262.14	65,665,031.10
2. 基金	-36,308,662.48	-	-27,635,429.78	-63,944,092.

赎回款				26
(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	59,183,225.56	-	34,031,815.28	93,215,040.84

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

海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)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[2017]1237 号文《关于准予海富通创业板综指增强型发起式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《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》公开募集。本基金为发起式股票型证券投资基金,运作方式为契约型开放式,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 39,773,225.86 元,业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(2018)第 0254 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》于 2018 年 4 月 8 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 39,787,405.14 份,A 类基金份额 23,917,653.02 份, C 类基金份额 15,869,752.12 份,其中认购资金利息折合 A 基金份额 8,924.90 份,认购资金利息折合 C 基金份额 5,254.38 份。本基金的基金管理人为海富通基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金为发起式基金,基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为 1,000 万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,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、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、权证、股指期货以及中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金的投资组合比例为:股票资产及存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%,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。如以后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。本基金的业绩比较基准为:创业板综合指数收益率 \times 95%+银行人民币活期存款利率 \times 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 2024 年 3 月 27 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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 2023 年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 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。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来 12 个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定

公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2)当金融工具不存在活跃市场，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。

(3)如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后

的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 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。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

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：

(1) 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。

(2) 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。

(3) 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85

号《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》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。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。

(2)对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，股票的股息、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。

(3)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。对基金从上市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。

(4)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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

活期存款	11,148,784.26	1,261,166.11
等于：本金	11,143,239.70	1,261,001.02
加：应计利息	5,544.56	165.09
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	11,148,784.26	1,261,166.11

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	717,791,566.32	-	703,362,613.23	-14,428,953.09	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	34,770,161.45	568,896.39	35,376,276.39	37,218.55
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	34,770,161.45	568,896.39	35,376,276.39	37,218.55
资产支持证券	-	-	-	-	

基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	752,561,727.77	568,896.39	738,738,889.62	-14,391,734.54	
项目	上年度末 2022 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	90,953,049.07	-	87,953,376.39	-2,999,672.68	
贵金属投资-金交所 黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,009,534.00	53,404.72	4,068,312.24	5,373.52
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,009,534.00	53,404.72	4,068,312.24	5,373.52
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	94,962,583.07	53,404.72	92,021,688.63	-2,994,299.16	

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

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 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	4.31
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,822,006.33	83,818.53
其中：交易所市场	1,822,006.33	83,818.53
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	160,000.00
应付指数使用费	100,000.00	150,000.00
合计	2,082,006.33	393,822.84

7.4.7.7 实收基金**海富通创业板增强 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	24,241,101.09	24,241,101.09
本期申购	483,500,546.43	483,500,546.43
本期赎回（以“-”号填列）	-5,101,735.73	-5,101,735.73
本期末	502,639,911.79	502,639,911.79

海富通创业板增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	34,942,124.47	34,942,124.47
本期申购	275,311,473.23	275,311,473.23
本期赎回（以“-”号填列）	-156,138,942.20	-156,138,942.20

本期末	154,114,655.50	154,114,655.50
-----	----------------	----------------

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.8 未分配利润

海富通创业板增强 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	13,301,105.20	1,044,188.57	14,345,293.77
本期期初	13,301,105.20	1,044,188.57	14,345,293.77
本期利润	-24,205,051.50	-2,604,368.81	-26,809,420.31
本期基金份额交易产生的变动数	211,876,629.47	18,381,914.72	230,258,544.19
其中：基金申购款	214,471,249.74	18,825,439.61	233,296,689.35
基金赎回款	-2,594,620.27	-443,524.89	-3,038,145.16
本期已分配利润	-141,179,652.28	-	-141,179,652.28
本期末	59,793,030.89	16,821,734.48	76,614,765.37

海富通创业板增强 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	18,035,703.76	1,650,817.75	19,686,521.51
本期期初	18,035,703.76	1,650,817.75	19,686,521.51
本期利润	-12,070,567.20	-8,793,066.57	-20,863,633.77
本期基金份额交易产生的变动数	51,370,335.56	12,957,418.06	64,327,753.62
其中：基金申购款	114,449,646.67	13,367,895.95	127,817,542.62
基金赎回款	-63,079,311.11	-410,477.89	-63,489,789.00
本期已分配利润	-44,497,683.10	-	-44,497,683.10
本期末	12,837,789.02	5,815,169.24	18,652,958.26

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
----	----	---------

	2023年1月1日至2023年12月 31日	2022年1月1日至2022年12 月31日
活期存款利息收入	31,736.80	12,312.90
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	27,602.89	7,162.62
其他	47,189.20	507.02
合计	106,528.89	19,982.54

7.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
卖出股票成交总额	1,156,716,275.31	186,707,789.83
减：卖出股票成本总额	1,188,073,956.57	190,688,330.85
减：交易费用	3,034,551.82	473,865.31
买卖股票差价收入	-34,392,233.08	-4,454,406.33

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 2023年1月1日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	189,295.22	85,535.99
债券投资收益——买卖债券(债转股及 债券到期兑付)差价收入	30,203.45	35,830.97
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	219,498.67	121,366.96

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	上年度可比期间

	2023年1月1日至2023年 12月31日	2022年1月1日至2022年 12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付） 成交总额	23,762,494.52	10,792,715.94
减：卖出债券（债转股及债券到期兑 付）成本总额	23,293,136.55	10,517,539.93
减：应计利息总额	439,149.24	239,332.44
减：交易费用	5.28	12.60
买卖债券差价收入	30,203.45	35,830.97

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
	2023年1月1日至2023年12月31 日	2022年1月1日至2022年12月31 日
股指期货投资收益（税前）	-367,340.00	-17,100.00
减：股指期货差价收入应缴 纳增值税额	1,574.56	-
减：交易费用	2,855.35	65.11
合计	-371,769.91	-17,165.11

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
	2023年1月1日至2023年12月 31日	2022年1月1日至2022年12月 31日
股票投资产生的股利收益	1,260,885.37	677,410.99
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	1,260,885.37	677,410.99

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
1.交易性金融资产	-11,397,435.38	-29,558,647.68
——股票投资	-11,429,280.41	-29,557,051.15
——债券投资	31,845.03	-1,596.53
——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	-11,397,435.38	-29,558,647.68

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日
基金赎回费收入	541,894.18	78,493.62
基金转换费收入	890.80	217.46
合计	542,784.98	78,711.08

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31 日

审计费用	50,000.00	50,000.00
信息披露费	110,000.00	110,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	828.00	850.00
指数使用费	200,000.00	200,000.00
合计	360,828.00	360,850.00

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.02% 的年费率计提，逐日累计，按季支付，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 50,000 元。

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

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	成交金额	占当期股	成交金额	占当期股

		票成交总 额的比例		票成交总 额的比例
海通证券	359,782,464.10	12.11%	30,855,854.04	8.26%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023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	263,750.11	12.18%	213,579.08	11.72%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	21,948.00	8.55%	-	-

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2023年1月1日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,506,552.81	1,253,383.85
其中：应支付销售机构的客户维护	432,309.04	300,043.07

费		
应支付基金管理人的净管理费	2,074,243.77	953,340.78

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 1.20% 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 x 1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年 12月31日	2022年1月1日至2022年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	417,758.77	208,897.20

注：支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20% 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 x 0.20%/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		
	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		
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	41,636.27	41,636.27
海通证券	-	37,181.48	37,181.48
海富通	-	170,323.32	170,323.32
合计	-	249,141.07	249,141.07
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2022年1月1日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	海富通创业板增强A	海富通创业板增强C	合计
工商银行	-	42,610.45	42,610.45
海通证券	-	38,432.62	38,432.62
海富通	-	102,561.57	102,561.57
合计	-	183,604.64	183,604.64

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 0.40%，

基金销售服务费按前一日 C 类基金份额资产净值的 0.40% 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 0.40% / 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固有资金投资本基金的情况

份额单位: 份

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日	
	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
报告期初持有的基金份额	10,493,445.94	-	10,493,445.94	-
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	10,493,445.94	-	10,493,445.94	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.09%	-	43.29%	-

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 2023年1月1日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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
中国工商银行	11,148,784.26	31,736.80	1,261,166.11	12,312.90

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 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	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	301228	实朴检测	网下发行	2,191	43,995.28

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

海富通创业板增强 A

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2023-12-22	2023-12-22	2.896	125,011,474.17	16,168,178.11	141,179,652.28	-
合计			2.896	125,011,474.17	16,168,178.11	141,179,652.28	-

海富通创业板增强 C

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日	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	本期利润分配合计	备注
1	2023-12-22	2023-12-22	2.896	41,985,485.94	2,512,197.16	44,497,683.10	-
合计			2.896	41,985,485.94	2,512,197.16	44,497,683.10	-

7.4.12 期末（2023 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**

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
001378	德冠新材	2023-10-23	6 个月	新股锁定	31.68	31.27	84	2,661.12	2,626.68	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股锁定	25.82	31.80	99	2,556.18	3,148.20	-

301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	新股锁定	57.88	45.48	70	4,051.60	3,183.60	-
301272	英华特	2023-07-06	6个月	新股锁定	51.39	53.38	63	3,237.57	3,362.94	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6个月	新股锁定	38.13	28.36	139	5,300.07	3,942.04	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	新股锁定	19.99	19.35	179	3,578.21	3,463.65	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	新股锁定	21.00	22.23	151	3,171.00	3,356.73	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	新股锁定	55.68	37.58	57	3,173.76	2,142.06	-
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	新股锁定	51.88	50.20	60	3,112.80	3,012.00	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	新股锁定	39.99	38.81	89	3,559.11	3,454.09	-
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	新股锁定	23.97	20.89	107	2,564.79	2,235.23	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	新股锁定	26.35	35.81	91	2,397.85	3,258.71	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	新股锁定	10.00	15.85	250	2,500.00	3,962.50	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	新股锁定	31.16	28.27	89	2,773.24	2,516.03	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	新股锁定	26.87	43.69	69	1,854.03	3,014.61	-
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	新股锁定	20.93	20.21	156	3,265.08	3,152.76	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	新股锁定	67.88	52.74	36	2,443.68	1,898.64	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	新股锁定	71.80	68.91	43	3,087.40	2,963.13	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	新股锁定	37.56	43.57	67	2,516.52	2,919.19	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	新股锁定	22.88	32.44	166	3,798.08	5,385.04	-
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	新股锁定	24.22	18.24	121	2,930.62	2,207.04	-
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	新股锁定	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301578	辰奕智能	2023-12-21	6个月	新股锁定	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-

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

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

本基金为增强型股票指数基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资、权证投资及股指期货等。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 2023 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（2022 年 12 月 31 日：0.02%）。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	22,223,553.10	4,051,363.29
合计	22,223,553.10	4,051,363.29

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	16,948.95
AAA 以下	-	-
未评级	13,152,723.29	-
合计	13,152,723.29	16,948.95

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、未评级部分为国债。

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上述比例限制）。

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、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 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	11,148,784.26	-	-	-	11,148,784.26
结算备付金	7,180,565.02	-	-	-	7,180,565.02
存出保证金	228,450.18	-	-	-	228,450.18
交易性金融资产	35,376,276.39	-	-	703,362,613.23	738,738,889.62
应收清算款	-	-	-	1,276,963.59	1,276,963.59

应收申购款	103,284.07	-	-	401,032.06	504,316.13
资产总计	54,037,359.92	-	-	705,040,608.88	759,077,968.80
负债					
应付清算款	-	-	-	737,077.60	737,077.60
应付赎回款	-	-	-	2,934,370.59	2,934,370.59
应付管理人报酬	-	-	-	1,019,071.94	1,019,071.94
应付托管费	-	-	-	169,845.33	169,845.33
应付销售服务费	-	-	-	113,306.09	113,306.09
其他负债	-	-	-	2,082,006.33	2,082,006.33
负债总计	-	-	-	7,055,677.88	7,055,677.88
利率敏感度缺口	54,037,359.92	-	-	697,984,931.00	752,022,290.92
上年度末 2022 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	1,261,166.11	-	-	-	1,261,166.11
结算备付金	250,218.64	-	-	-	250,218.64
存出保证金	16,700.73	-	-	-	16,700.73
交易性金融资产	4,051,363.29	16,948.95	-	87,953,376.39	92,021,688.63
应收清算款	-	-	-	208,662.04	208,662.04
应收申购款	-	-	-	67,081.71	67,081.71
资产总计	5,579,448.77	16,948.95	-	88,229,120.14	93,825,517.86
负债					
应付赎回款	-	-	-	81,633.92	81,633.92
应付管理人报酬	-	-	-	98,824.74	98,824.74
应付托管费	-	-	-	16,470.78	16,470.78
应付销售服务费	-	-	-	19,724.74	19,724.74
其他负债	-	-	-	393,822.84	393,822.84
负债总计	-	-	-	610,477.02	610,477.02
利率敏感度缺口	5,579,448.77	16,948.95	-	87,618,643.12	93,215,040.84

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	市场利率上升 25 个基点	-18,139.05	-3,296.48
市场利率下降 25 个基点	18,202.87	3,309.00	

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、存托凭证和债券，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和存托凭证投资比例不低于基金资产的 90%，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 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	703,362,613.23	93.53	87,953,376.39	94.36
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	703,362,613.23	93.53	87,953,376.39	94.36

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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 7.4.1)上升 5%	31,500,383.65	4,678,484.27
2.业绩比较基准(附注 7.4.1)下降 5%	-31,500,383.65	-4,678,484.27	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	703,276,593.96	87,738,844.78
第二层次	35,376,276.39	4,157,390.49
第三层次	86,019.27	125,453.36
合计	738,738,889.62	92,021,688.63

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，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，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

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 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	-	125,453.36	125,453.36
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	151,782.71	151,782.71
转出第三层次	-	242,537.49	242,537.49
当期利得或损失总额	-	51,320.69	51,320.69
其中：计入损益的利得或损失	-	51,320.69	51,320.69
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	86,019.27	86,019.27
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	-	10,585.24	10,585.24
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	225,437.35	225,437.35
转出第三层次	-	102,453.35	102,453.35
当期利得或损失总额	-	2,469.36	2,469.36
其中：计入损益的利得或损失	-	2,469.36	2,469.36

计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	125,453.36	125,453.36
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	-	-2,392.69	-2,392.69

注：于2023年12月31日，本基金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（2022年12月31日：同）。于2023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（2022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	86,019.27	亚式期权模型	预期年化波动率	19.69%~194.82%	负相关
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	125,453.36	亚式期权模型	预期年化波动率	20.63%~247.56%	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2023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资产(2022年12月31日：同)。

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和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

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	703,362,613.23	92.66
	其中：股票	703,362,613.23	92.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	35,376,276.39	4.66
	其中：债券	35,376,276.39	4.66
	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	18,329,349.28	2.41
8	其他各项资产	2,009,729.90	0.26
9	合计	759,077,968.80	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	4,392,850.34	0.58
B	采矿业	2,002,727.00	0.27
C	制造业	502,588,666.06	66.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,713,450.00	0.49
E	建筑业	788,057.60	0.10
F	批发和零售业	16,131,753.72	2.15
G	交通运输、仓储和邮政业	4,629,261.00	0.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	79,230,049.06	10.54

J	金融业	5,369,978.16	0.71
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	6,257,567.90	0.83
M	科学研究和技术服务业	46,939,330.74	6.24
N	水利、环境和公共设施管理业	6,160,903.76	0.82
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	104,622.00	0.01
Q	卫生和社会工作	20,145,126.14	2.68
R	文化、体育和娱乐业	4,908,269.75	0.65
S	综合	-	-
	合计	703,362,613.23	93.53

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	300750	宁德时代	234,580	38,297,530.80	5.09
2	300760	迈瑞医疗	104,200	30,280,520.00	4.03
3	300130	新国都	483,000	11,688,600.00	1.55
4	300416	苏试试验	614,387	11,286,289.19	1.50
5	300015	爱尔眼科	695,377	11,000,864.14	1.46
6	300791	仙乐健康	280,250	9,713,465.00	1.29
7	300782	卓胜微	68,038	9,593,358.00	1.28
8	300866	安克创新	102,600	9,090,360.00	1.21
9	300592	华凯易佰	354,100	8,771,057.00	1.17
10	300244	迪安诊断	355,700	8,469,217.00	1.13
11	300124	汇川技术	129,750	8,192,415.00	1.09
12	300303	聚飞光电	1,253,600	7,433,848.00	0.99
13	300638	广和通	307,187	5,845,768.61	0.78
14	300604	长川科技	141,630	5,380,523.70	0.72
15	300059	东方财富	371,304	5,213,108.16	0.69
16	300908	仲景食品	123,000	5,076,210.00	0.68
17	300832	新产业	64,334	5,030,918.80	0.67
18	300274	阳光电源	57,300	5,018,907.00	0.67

19	301096	百诚医药	75,900	4,941,090.00	0.66
20	300926	博俊科技	162,500	4,766,125.00	0.63
21	300470	中密控股	125,800	4,755,240.00	0.63
22	301050	雷电微力	80,100	4,666,626.00	0.62
23	301345	涛涛车业	75,400	4,591,860.00	0.61
24	300319	麦捷科技	465,900	4,491,276.00	0.60
25	300873	海晨股份	188,100	4,478,661.00	0.60
26	300001	特锐德	221,500	4,452,150.00	0.59
27	301047	义翘神州	52,960	4,363,904.00	0.58
28	300532	今天国际	263,400	4,325,028.00	0.58
29	300454	深信服	57,000	4,120,530.00	0.55
30	300679	电连技术	96,300	3,996,450.00	0.53
31	300002	神州泰岳	442,100	3,912,585.00	0.52
32	300999	金龙鱼	117,213	3,912,569.94	0.52
33	300938	信测标准	108,300	3,886,887.00	0.52
34	300398	飞凯材料	244,800	3,858,048.00	0.51
35	300687	赛意信息	172,200	3,750,516.00	0.50
36	300558	贝达药业	71,800	3,701,290.00	0.49
37	301376	致欧科技	150,316	3,595,558.72	0.48
38	301257	普蕊斯	56,500	3,587,750.00	0.48
39	300415	伊之密	194,800	3,434,324.00	0.46
40	300406	九强生物	176,640	3,373,824.00	0.45
41	300457	赢合科技	180,700	3,332,108.00	0.44
42	300482	万孚生物	109,800	3,312,666.00	0.44
43	300012	华测检测	230,600	3,274,520.00	0.44
44	300428	立中集团	151,100	3,191,232.00	0.42
45	300253	卫宁健康	432,800	3,111,832.00	0.41
46	300450	先导智能	118,900	3,043,840.00	0.40
47	300919	中伟股份	61,900	3,041,147.00	0.40
48	300446	航天智造	191,100	2,994,537.00	0.40
49	300682	朗新科技	179,100	2,935,449.00	0.39
50	300037	新宙邦	60,600	2,866,380.00	0.38
51	300639	凯普生物	297,000	2,773,980.00	0.37
52	301283	聚胶股份	82,500	2,712,600.00	0.36
53	300693	盛弘股份	90,239	2,699,048.49	0.36
54	301356	天振股份	148,100	2,693,939.00	0.36
55	300348	长亮科技	260,100	2,681,631.00	0.36
56	300623	捷捷微电	167,100	2,651,877.00	0.35
57	300627	华测导航	85,140	2,641,042.80	0.35
58	300741	华宝股份	122,800	2,629,148.00	0.35
59	300021	大禹节水	550,300	2,619,428.00	0.35
60	300308	中际旭创	23,160	2,614,995.60	0.35
61	300003	乐普医疗	158,100	2,554,896.00	0.34
62	300821	东岳硅材	306,800	2,546,440.00	0.34

63	300994	久祺股份	170,200	2,501,940.00	0.33
64	300170	汉得信息	300,000	2,493,000.00	0.33
65	300019	硅宝科技	150,800	2,489,708.00	0.33
66	300409	道氏技术	222,400	2,477,536.00	0.33
67	301179	泽宇智能	95,331	2,473,839.45	0.33
68	300566	激智科技	130,900	2,445,212.00	0.33
69	300412	迦南科技	426,800	2,428,492.00	0.32
70	300365	恒华科技	357,600	2,417,376.00	0.32
71	300830	金现代	297,000	2,396,790.00	0.32
72	300148	天舟文化	634,700	2,392,819.00	0.32
73	300384	三联虹普	149,000	2,378,040.00	0.32
74	300326	凯利泰	372,900	2,360,457.00	0.31
75	300071	福石控股	676,900	2,342,074.00	0.31
76	300279	和晶科技	361,700	2,340,199.00	0.31
77	300990	同飞股份	52,500	2,336,775.00	0.31
78	300498	温氏股份	116,289	2,332,757.34	0.31
79	300850	新强联	73,100	2,326,773.00	0.31
80	300408	三环集团	78,900	2,323,605.00	0.31
81	300529	健帆生物	103,500	2,300,805.00	0.31
82	300628	亿联网络	76,500	2,260,575.00	0.30
83	300181	佐力药业	210,100	2,239,666.00	0.30
84	301207	华兰疫苗	80,500	2,237,900.00	0.30
85	301308	江波龙	24,200	2,227,610.00	0.30
86	300211	亿通科技	218,100	2,204,991.00	0.29
87	300147	香雪制药	427,100	2,199,565.00	0.29
88	300129	泰胜风能	204,100	2,198,157.00	0.29
89	300421	力星股份	167,300	2,159,843.00	0.29
90	300145	中金环境	710,600	2,146,012.00	0.29
91	300770	新媒股份	55,400	2,142,872.00	0.28
92	300893	松原股份	72,600	2,122,098.00	0.28
93	300957	贝泰妮	30,700	2,092,819.00	0.28
94	300354	东华测试	42,100	2,091,107.00	0.28
95	301201	诚达药业	82,100	2,087,803.00	0.28
96	300645	正元智慧	113,700	2,068,203.00	0.28
97	300894	火星人	126,700	2,057,608.00	0.27
98	301004	嘉益股份	44,200	2,008,890.00	0.27
99	300289	利德曼	325,100	1,999,365.00	0.27
100	300435	中泰股份	138,100	1,985,878.00	0.26
101	300188	美亚柏科	123,300	1,975,266.00	0.26
102	301391	卡莱特	17,200	1,969,056.00	0.26
103	301033	迈普医学	45,100	1,963,654.00	0.26
104	300394	天孚通信	21,249	1,944,708.48	0.26
105	300043	星辉娱乐	520,400	1,930,684.00	0.26
106	300451	创业慧康	292,517	1,915,986.35	0.25

107	301160	翔楼新材	44,100	1,862,343.00	0.25
108	301200	大族数控	49,200	1,858,284.00	0.25
109	300286	安科瑞	71,500	1,853,995.00	0.25
110	301215	中汽股份	299,500	1,847,915.00	0.25
111	301095	广立微	24,600	1,838,358.00	0.24
112	301302	华如科技	72,600	1,822,986.00	0.24
113	300115	长盈精密	137,400	1,820,550.00	0.24
114	301029	怡合达	70,340	1,813,365.20	0.24
115	301109	军信股份	110,700	1,749,060.00	0.23
116	301227	森鹰窗业	63,600	1,721,652.00	0.23
117	301132	满坤科技	59,800	1,716,858.00	0.23
118	300759	康龙化成	58,500	1,695,330.00	0.23
119	300773	拉卡拉	105,500	1,692,220.00	0.23
120	300259	新天科技	465,500	1,689,765.00	0.22
121	300453	三鑫医疗	219,900	1,677,837.00	0.22
122	301123	奕东电子	70,500	1,653,930.00	0.22
123	300369	绿盟科技	171,600	1,618,188.00	0.22
124	300140	节能环境	218,700	1,611,819.00	0.21
125	300026	红日药业	375,400	1,591,696.00	0.21
126	300082	奥克股份	226,800	1,580,796.00	0.21
127	300239	东宝生物	253,300	1,578,059.00	0.21
128	301102	兆讯传媒	82,035	1,570,149.90	0.21
129	300815	玉禾田	106,900	1,560,740.00	0.21
130	300263	隆华科技	221,200	1,557,248.00	0.21
131	301235	华康医疗	59,900	1,535,237.00	0.20
132	300708	聚灿光电	135,100	1,523,928.00	0.20
133	300940	南极光	79,000	1,523,120.00	0.20
134	300842	帝科股份	21,400	1,509,770.00	0.20
135	300144	宋城演艺	151,125	1,491,603.75	0.20
136	300296	利亚德	241,800	1,450,800.00	0.19
137	300476	胜宏科技	77,400	1,428,030.00	0.19
138	300323	华灿光电	193,500	1,416,420.00	0.19
139	300206	理邦仪器	137,900	1,407,959.00	0.19
140	300066	三川智慧	273,500	1,381,175.00	0.18
141	300452	山河药辅	96,400	1,372,736.00	0.18
142	300017	网宿科技	171,700	1,347,845.00	0.18
143	300979	华利集团	25,600	1,347,584.00	0.18
144	300710	万隆光电	55,000	1,337,600.00	0.18
145	300161	华中数控	36,600	1,313,940.00	0.17
146	000034	神州数码	43,800	1,310,058.00	0.17
147	300776	帝尔激光	21,700	1,307,642.00	0.17
148	300009	安科生物	127,424	1,302,273.28	0.17
149	300818	耐普矿机	39,200	1,293,992.00	0.17
150	300671	富满微	40,000	1,293,200.00	0.17

151	300102	乾照光电	175,900	1,292,865.00	0.17
152	300922	天秦装备	75,700	1,292,199.00	0.17
153	300218	安利股份	95,200	1,289,960.00	0.17
154	300768	迪普科技	87,000	1,285,860.00	0.17
155	300424	航新科技	98,100	1,285,110.00	0.17
156	300497	富祥药业	136,600	1,278,576.00	0.17
157	301208	中亦科技	32,600	1,272,704.00	0.17
158	300149	睿智医药	166,300	1,272,195.00	0.17
159	300183	东软载波	83,900	1,266,051.00	0.17
160	300173	福能东方	257,800	1,265,798.00	0.17
161	300285	国瓷材料	54,550	1,261,196.00	0.17
162	300533	冰川网络	44,900	1,243,730.00	0.17
163	300490	华自科技	107,000	1,242,270.00	0.17
164	300177	中海达	172,500	1,240,275.00	0.16
165	301021	英诺激光	47,100	1,239,201.00	0.16
166	300281	金明精机	203,500	1,218,965.00	0.16
167	300485	赛升药业	114,900	1,216,791.00	0.16
168	300909	汇创达	39,100	1,216,010.00	0.16
169	300050	世纪鼎利	256,000	1,210,880.00	0.16
170	300228	富瑞特装	170,300	1,209,130.00	0.16
171	300217	东方电热	224,400	1,207,272.00	0.16
172	300355	蒙草生态	321,900	1,207,125.00	0.16
173	301051	信濠光电	18,900	1,203,363.00	0.16
174	300681	英搏尔	62,400	1,202,448.00	0.16
175	301377	鼎泰高科	50,800	1,201,420.00	0.16
176	300696	爱乐达	69,000	1,201,290.00	0.16
177	600422	昆药集团	57,300	1,195,278.00	0.16
178	300797	钢研纳克	93,100	1,194,473.00	0.16
179	002126	银轮股份	63,700	1,189,279.00	0.16
180	300833	浩洋股份	13,100	1,180,310.00	0.16
181	300601	康泰生物	43,100	1,170,165.00	0.16
182	300719	安达维尔	87,700	1,169,041.00	0.16
183	300136	信维通信	49,500	1,168,200.00	0.16
184	301196	唯科科技	33,900	1,165,482.00	0.15
185	300018	中元股份	190,200	1,162,122.00	0.15
186	300732	设研院	131,500	1,161,145.00	0.15
187	300569	天能重工	162,371	1,160,952.65	0.15
188	300316	晶盛机电	26,300	1,159,567.00	0.15
189	300344	立方数科	203,400	1,157,346.00	0.15
190	301058	中粮科工	104,900	1,146,557.00	0.15
191	301279	金道科技	45,900	1,137,861.00	0.15
192	300389	艾比森	65,300	1,132,302.00	0.15
193	301159	三维天地	24,700	1,127,061.00	0.15
194	300413	芒果超媒	44,210	1,114,092.00	0.15

195	300383	光环新网	113,500	1,103,220.00	0.15
196	300377	赢时胜	141,900	1,101,144.00	0.15
197	300088	长信科技	163,000	1,090,470.00	0.15
198	300769	德方纳米	17,380	1,060,701.40	0.14
199	300494	盛天网络	66,580	1,052,629.80	0.14
200	300563	神宇股份	65,700	1,050,543.00	0.14
201	300699	光威复材	39,200	1,045,464.00	0.14
202	603518	锦泓集团	103,200	1,034,064.00	0.14
203	300658	延江股份	151,900	1,028,363.00	0.14
204	002027	分众传媒	158,800	1,003,616.00	0.13
205	300606	金太阳	29,100	994,056.00	0.13
206	300487	蓝晓科技	18,700	992,222.00	0.13
207	601138	工业富联	65,600	991,872.00	0.13
208	600161	天坛生物	32,000	990,080.00	0.13
209	300653	正海生物	32,900	954,758.00	0.13
210	301191	菲菱科思	10,300	949,660.00	0.13
211	300685	艾德生物	43,200	949,536.00	0.13
212	300806	斯迪克	67,469	949,288.83	0.13
213	301121	紫建电子	22,800	947,568.00	0.13
214	300337	银邦股份	117,100	947,339.00	0.13
215	300347	泰格医药	17,216	946,363.52	0.13
216	300357	我武生物	32,400	939,600.00	0.12
217	300709	精研科技	30,100	938,819.00	0.12
218	300360	炬华科技	68,260	932,431.60	0.12
219	300882	万胜智能	37,900	923,244.00	0.12
220	300755	华致酒行	50,100	916,329.00	0.12
221	600900	长江电力	38,700	903,258.00	0.12
222	301012	扬电科技	43,760	883,952.00	0.12
223	300039	上海凯宝	132,600	881,790.00	0.12
224	300751	迈为股份	6,800	880,668.00	0.12
225	300674	宇信科技	53,840	876,515.20	0.12
226	300223	北京君正	13,500	872,775.00	0.12
227	300670	大烨智能	111,100	869,913.00	0.12
228	300525	博思软件	58,100	866,852.00	0.12
229	600519	贵州茅台	500	863,000.00	0.11
230	300430	诚益通	60,300	861,687.00	0.11
231	300868	杰美特	38,900	844,908.00	0.11
232	300824	北鼎股份	93,200	841,596.00	0.11
233	300829	金丹科技	40,300	841,464.00	0.11
234	300573	兴齐眼药	4,560	831,379.20	0.11
235	300872	天阳科技	59,700	816,696.00	0.11
236	300193	佳士科技	104,200	809,634.00	0.11
237	301149	隆华新材	65,400	808,998.00	0.11
238	300800	力合科技	59,000	806,530.00	0.11

239	300900	广联航空	32,600	804,568.00	0.11
240	300501	海顺新材	55,700	803,751.00	0.11
241	300743	天地数码	57,500	798,100.00	0.11
242	300248	新开普	82,900	795,011.00	0.11
243	300947	德必集团	50,600	793,914.00	0.11
244	300876	蒙泰高新	31,700	793,134.00	0.11
245	000338	潍柴动力	58,000	791,700.00	0.11
246	300371	汇中股份	64,800	789,912.00	0.11
247	301082	久盛电气	43,500	789,525.00	0.10
248	300930	屹通新材	33,000	789,360.00	0.10
249	301115	建科股份	44,000	787,600.00	0.10
250	300855	图南股份	25,775	778,405.00	0.10
251	603556	海兴电力	26,700	775,101.00	0.10
252	301219	腾远钴业	19,660	774,014.20	0.10
253	301126	达嘉维康	58,000	755,740.00	0.10
254	300969	恒帅股份	8,399	754,818.13	0.10
255	688012	中微公司	4,912	754,483.20	0.10
256	000921	海信家电	36,900	752,760.00	0.10
257	300447	全信股份	51,900	752,550.00	0.10
258	601567	三星医疗	36,600	750,300.00	0.10
259	300231	银信科技	71,000	730,590.00	0.10
260	300111	向日葵	240,200	730,208.00	0.10
261	301061	匠心家居	14,600	726,350.00	0.10
262	300511	雪榕生物	135,700	725,995.00	0.10
263	002252	上海莱士	90,600	724,800.00	0.10
264	301181	标榜股份	25,600	722,688.00	0.10
265	300488	恒锋工具	28,800	707,904.00	0.09
266	300380	安硕信息	32,300	685,083.00	0.09
267	300808	久量股份	43,800	682,404.00	0.09
268	301231	荣信文化	26,600	676,970.00	0.09
269	300241	瑞丰光电	118,100	664,903.00	0.09
270	301267	华夏眼科	20,500	657,845.00	0.09
271	601689	拓普集团	8,900	654,150.00	0.09
272	301388	欣灵电气	26,800	653,652.00	0.09
273	301282	金禄电子	26,000	649,740.00	0.09
274	301127	天源环保	58,600	644,014.00	0.09
275	688503	聚和材料	11,891	637,357.60	0.08
276	300251	光线传媒	77,900	634,885.00	0.08
277	301063	海锅股份	27,800	633,840.00	0.08
278	300150	世纪瑞尔	129,500	628,075.00	0.08
279	300443	金雷股份	22,700	626,293.00	0.08
280	002475	立讯精密	18,100	623,545.00	0.08
281	300426	唐德影视	56,500	623,195.00	0.08
282	002429	兆驰股份	111,500	622,170.00	0.08

283	300138	晨光生物	45,420	609,990.60	0.08
284	002920	德赛西威	4,600	595,746.00	0.08
285	300120	经纬辉开	81,900	594,594.00	0.08
286	301195	北路智控	14,597	592,346.26	0.08
287	300647	超频三	91,400	586,788.00	0.08
288	300460	惠伦晶体	47,600	583,576.00	0.08
289	300122	智飞生物	9,500	580,545.00	0.08
290	688676	金盘科技	16,147	578,547.01	0.08
291	603993	洛阳钼业	111,100	577,720.00	0.08
292	301248	杰创智能	32,800	577,608.00	0.08
293	000400	许继电气	26,000	570,960.00	0.08
294	301129	瑞纳智能	21,240	565,621.20	0.08
295	300863	卡倍亿	11,300	565,452.00	0.08
296	300458	全志科技	24,600	558,174.00	0.07
297	300659	中孚信息	25,100	557,722.00	0.07
298	300594	朗进科技	26,200	547,056.00	0.07
299	002600	领益智造	80,500	544,180.00	0.07
300	300952	恒辉安防	24,900	542,322.00	0.07
301	300775	三角防务	18,800	524,520.00	0.07
302	300596	利安隆	17,700	523,212.00	0.07
303	301030	仕净科技	12,500	521,250.00	0.07
304	603035	常熟汽饰	27,600	520,812.00	0.07
305	300582	英飞特	43,300	520,033.00	0.07
306	300991	创益通	29,900	519,662.00	0.07
307	002011	盾安环境	37,700	518,375.00	0.07
308	601857	中国石油	73,400	518,204.00	0.07
309	301167	建研设计	30,500	516,060.00	0.07
310	300695	兆丰股份	9,700	513,712.00	0.07
311	600060	海信视像	24,500	512,050.00	0.07
312	688091	上海谊众	7,987	511,168.00	0.07
313	300677	英科医疗	21,800	509,248.00	0.07
314	300972	万辰集团	13,500	506,790.00	0.07
315	300057	万顺新材	82,100	506,557.00	0.07
316	002452	长高电新	70,800	502,680.00	0.07
317	601126	四方股份	35,400	501,264.00	0.07
318	300902	国安达	14,200	500,550.00	0.07
319	600497	驰宏锌锗	99,100	500,455.00	0.07
320	300729	乐歌股份	27,700	496,107.00	0.07
321	600993	马应龙	19,900	481,182.00	0.06
322	301312	智立方	4,400	476,696.00	0.06
323	300040	九洲集团	84,800	474,880.00	0.06
324	300117	嘉寓股份	163,400	473,860.00	0.06
325	300246	宝莱特	45,900	472,770.00	0.06
326	603596	伯特利	6,800	471,240.00	0.06

327	300634	彩讯股份	22,900	468,763.00	0.06
328	300004	南风股份	75,800	468,444.00	0.06
329	300891	惠云钛业	48,200	467,540.00	0.06
330	301290	东星医疗	16,800	463,512.00	0.06
331	300234	开尔新材	88,400	460,564.00	0.06
332	300190	维尔利	108,700	454,366.00	0.06
333	002463	沪电股份	20,400	451,248.00	0.06
334	300404	博济医药	49,900	446,605.00	0.06
335	300771	智莱科技	41,000	445,670.00	0.06
336	300224	正海磁材	37,600	440,672.00	0.06
337	300661	圣邦股份	4,935	439,264.35	0.06
338	300445	康斯特	24,700	430,521.00	0.06
339	300499	高澜股份	29,900	428,766.00	0.06
340	000700	模塑科技	60,800	425,600.00	0.06
341	300189	神农科技	129,200	425,068.00	0.06
342	301525	儒竞科技	5,000	421,900.00	0.06
343	300831	派瑞股份	34,300	420,518.00	0.06
344	300935	盈建科	15,100	413,891.00	0.06
345	300440	运达科技	54,800	408,260.00	0.05
346	688072	拓荆科技	1,759	406,856.70	0.05
347	300087	荃银高科	48,000	402,240.00	0.05
348	300442	润泽科技	15,800	400,846.00	0.05
349	300718	长盛轴承	20,800	385,840.00	0.05
350	301166	优宁维	10,000	384,200.00	0.05
351	300238	冠昊生物	28,100	381,036.00	0.05
352	300298	三诺生物	12,300	373,920.00	0.05
353	300176	派生科技	55,200	373,152.00	0.05
354	002353	杰瑞股份	13,200	371,052.00	0.05
355	300258	精锻科技	28,500	368,220.00	0.05
356	605090	九丰能源	13,000	363,090.00	0.05
357	300196	长海股份	32,300	351,424.00	0.05
358	300740	水羊股份	20,900	348,403.00	0.05
359	300204	舒泰神	33,200	337,312.00	0.04
360	603112	华翔股份	27,700	336,555.00	0.04
361	000333	美的集团	6,100	333,243.00	0.04
362	300567	精测电子	3,800	332,956.00	0.04
363	300397	天和防务	31,900	329,208.00	0.04
364	603300	华铁应急	51,200	327,680.00	0.04
365	002737	葵花药业	12,500	324,750.00	0.04
366	300422	博世科	52,900	316,871.00	0.04
367	300433	蓝思科技	24,000	316,800.00	0.04
368	300114	中航电测	7,241	316,793.75	0.04
369	601989	中国重工	74,200	306,446.00	0.04
370	300349	金卡智能	24,400	303,048.00	0.04

371	301313	凡拓数创	8,400	302,904.00	0.04
372	300174	元力股份	18,700	299,387.00	0.04
373	300570	太辰光	7,600	296,780.00	0.04
374	300092	科新机电	21,900	291,708.00	0.04
375	300502	新易盛	5,839	287,979.48	0.04
376	300153	科泰电源	35,500	283,290.00	0.04
377	605599	菜百股份	18,000	268,020.00	0.04
378	002345	潮宏基	38,800	264,228.00	0.04
379	600803	新奥股份	15,700	264,074.00	0.04
380	300666	江丰电子	4,500	263,610.00	0.04
381	300875	捷强装备	9,000	262,710.00	0.03
382	600989	宝丰能源	17,700	261,429.00	0.03
383	605319	无锡振华	11,200	257,824.00	0.03
384	603889	新澳股份	36,100	257,032.00	0.03
385	300381	溢多利	34,800	256,476.00	0.03
386	688169	石头科技	892	252,391.40	0.03
387	601001	晋控煤业	20,400	251,532.00	0.03
388	301052	果麦文化	5,700	249,546.00	0.03
389	300955	嘉亨家化	11,200	247,632.00	0.03
390	300472	新元科技	26,000	245,440.00	0.03
391	300697	电工合金	18,900	244,188.00	0.03
392	300132	青松股份	46,500	242,730.00	0.03
393	000065	北方国际	21,600	242,352.00	0.03
394	300887	谱尼测试	20,368	240,546.08	0.03
395	300896	爱美客	805	236,935.65	0.03
396	300811	铂科新材	4,420	233,685.40	0.03
397	300545	联得装备	6,600	228,030.00	0.03
398	301055	张小泉	15,500	223,510.00	0.03
399	300119	瑞普生物	13,500	221,265.00	0.03
400	300642	透景生命	12,520	220,978.00	0.03
401	300030	阳普医疗	28,200	218,550.00	0.03
402	300963	中洲特材	16,500	216,480.00	0.03
403	300284	苏交科	39,200	213,640.00	0.03
404	300396	迪瑞医疗	7,080	208,506.00	0.03
405	300519	新光药业	12,500	207,125.00	0.03
406	301296	新巨丰	19,700	202,910.00	0.03
407	301216	万凯新材	14,200	200,646.00	0.03
408	300973	立高食品	4,100	199,055.00	0.03
409	300317	珈伟新能	39,000	198,510.00	0.03
410	301039	中集车辆	20,800	195,104.00	0.03
411	300559	佳发教育	12,100	187,550.00	0.02
412	300076	GQY 视讯	33,800	184,548.00	0.02
413	300996	普联软件	8,000	183,200.00	0.02
414	300179	四方达	20,300	180,873.00	0.02

415	301006	迈拓股份	9,800	177,478.00	0.02
416	300473	德尔股份	9,700	177,316.00	0.02
417	300300	海峡创新	44,000	176,440.00	0.02
418	301020	密封科技	8,100	176,013.00	0.02
419	300109	新开源	9,700	174,988.00	0.02
420	300575	中旗股份	22,900	174,956.00	0.02
421	300378	鼎捷软件	8,000	170,480.00	0.02
422	300481	濮阳惠成	9,500	165,775.00	0.02
423	301280	珠城科技	4,000	164,320.00	0.02
424	300160	秀强股份	27,500	162,250.00	0.02
425	301236	软通动力	3,450	159,390.00	0.02
426	300810	中科海讯	7,800	159,120.00	0.02
427	300033	同花顺	1,000	156,870.00	0.02
428	603979	金诚信	4,100	154,816.00	0.02
429	601021	春秋航空	3,000	150,600.00	0.02
430	300054	鼎龙股份	6,200	150,040.00	0.02
431	301130	西点药业	5,200	144,976.00	0.02
432	300951	博硕科技	2,200	142,516.00	0.02
433	300277	海联讯	16,300	140,995.00	0.02
434	601500	通用股份	33,000	136,620.00	0.02
435	300692	中环环保	21,800	135,160.00	0.02
436	300986	志特新材	10,189	129,705.97	0.02
437	300660	江苏雷利	4,280	129,512.80	0.02
438	301009	可靠股份	11,900	126,854.00	0.02
439	300795	米奥会展	3,400	125,358.00	0.02
440	300915	海融科技	3,800	124,792.00	0.02
441	300162	雷曼光电	15,400	124,740.00	0.02
442	300294	博雅生物	3,700	124,616.00	0.02
443	300745	欣锐科技	4,400	119,548.00	0.02
444	300474	景嘉微	1,650	116,671.50	0.02
445	301297	富乐德	4,300	115,928.00	0.02
446	300257	开山股份	7,200	113,472.00	0.02
447	300272	开能健康	17,800	110,360.00	0.01
448	301213	观想科技	2,700	109,242.00	0.01
449	300595	欧普康视	4,832	109,106.56	0.01
450	600150	中国船舶	3,700	108,928.00	0.01
451	300121	阳谷华泰	12,100	107,448.00	0.01
452	301028	东亚机械	9,100	106,743.00	0.01
453	301087	可孚医疗	2,800	106,120.00	0.01
454	300192	科德教育	10,600	104,622.00	0.01
455	300154	瑞凌股份	14,000	103,600.00	0.01
456	301117	佳缘科技	1,900	103,569.00	0.01
457	301360	荣旗科技	1,100	102,960.00	0.01
458	300618	寒锐钴业	3,600	101,844.00	0.01

459	301322	绿通科技	2,400	98,784.00	0.01
460	300993	玉马遮阳	8,800	96,624.00	0.01
461	300724	捷佳伟创	1,300	96,213.00	0.01
462	300790	宇瞳光学	5,900	95,993.00	0.01
463	300826	测绘股份	5,300	95,771.00	0.01
464	300585	奥联电子	5,700	95,532.00	0.01
465	300118	东方日升	5,400	95,310.00	0.01
466	601717	郑煤机	7,500	94,875.00	0.01
467	300058	蓝色光标	13,200	94,776.00	0.01
468	300185	通裕重工	39,000	93,600.00	0.01
469	300332	天壕能源	11,600	92,220.00	0.01
470	301093	华兰股份	2,800	90,440.00	0.01
471	300664	鹏鹞环保	16,900	90,415.00	0.01
472	601985	中国核电	11,900	89,250.00	0.01
473	300510	金冠股份	14,800	88,356.00	0.01
474	301161	唯万密封	4,300	86,946.00	0.01
475	301188	力诺特玻	4,800	85,872.00	0.01
476	002540	亚太科技	12,900	85,269.00	0.01
477	300827	上能电气	2,800	84,728.00	0.01
478	300073	当升科技	2,200	84,040.00	0.01
479	300260	新莱应材	2,700	82,161.00	0.01
480	300788	中信出版	2,800	81,480.00	0.01
481	300491	通合科技	3,600	80,208.00	0.01
482	301177	迪阿股份	2,600	76,674.00	0.01
483	300014	亿纬锂能	1,802	76,044.40	0.01
484	300777	中简科技	2,500	74,575.00	0.01
485	002371	北方华创	300	73,713.00	0.01
486	300870	欧陆通	1,600	70,832.00	0.01
487	300411	金盾股份	10,000	69,900.00	0.01
488	300617	安靠智电	2,300	69,828.00	0.01
489	300390	天华新能	2,730	69,205.50	0.01
490	600970	中材国际	7,200	67,248.00	0.01
491	300423	昇辉科技	7,100	67,166.00	0.01
492	300496	中科创达	800	64,048.00	0.01
493	300407	凯发电气	6,500	61,360.00	0.01
494	300889	爱克股份	3,400	57,120.00	0.01
495	300753	爱朋医疗	3,100	53,227.00	0.01
496	300997	欢乐家	3,500	48,895.00	0.01
497	300624	万兴科技	500	47,300.00	0.01
498	301077	星华新材	2,300	46,759.00	0.01
499	300468	四方精创	4,300	46,655.00	0.01
500	300820	英杰电气	775	44,392.00	0.01
501	300386	飞天诚信	4,100	43,993.00	0.01
502	300479	神思电子	2,200	43,296.00	0.01

503	300762	上海瀚讯	2,800	42,224.00	0.01
504	300351	永贵电器	2,000	41,440.00	0.01
505	300504	天邑股份	2,200	40,238.00	0.01
506	300942	易瑞生物	3,400	39,746.00	0.01
507	301285	鸿日达	2,400	38,352.00	0.01
508	300772	运达股份	3,400	36,176.00	0.00
509	300837	浙矿股份	1,100	32,857.00	0.00
510	301153	中科江南	400	31,308.00	0.00
511	300547	川环科技	1,700	28,645.00	0.00
512	300475	香农芯创	800	27,032.00	0.00
513	300358	楚天科技	2,500	26,750.00	0.00
514	300560	中富通	1,500	26,565.00	0.00
515	301171	易点天下	1,300	25,701.00	0.00
516	300843	胜蓝股份	1,100	25,278.00	0.00
517	301035	润丰股份	300	21,000.00	0.00
518	603368	柳药集团	1,000	18,920.00	0.00
519	300395	菲利华	500	18,280.00	0.00
520	301239	普瑞眼科	200	17,200.00	0.00
521	300226	上海钢联	600	17,094.00	0.00
522	300861	美畅股份	500	16,645.00	0.00
523	300857	协创数据	300	15,897.00	0.00
524	300335	迪森股份	2,800	15,680.00	0.00
525	300910	瑞丰新材	300	13,782.00	0.00
526	300918	南山智尚	1,300	13,429.00	0.00
527	300315	掌趣科技	2,600	13,390.00	0.00
528	301566	达利凯普	576	12,752.64	0.00
529	300036	超图软件	600	12,540.00	0.00
530	300856	科思股份	200	12,446.00	0.00
531	300860	锋尚文化	200	10,926.00	0.00
532	300568	星源材质	700	10,794.00	0.00
533	300684	中石科技	500	10,745.00	0.00
534	300897	山科智能	300	10,260.00	0.00
535	300925	法本信息	800	9,400.00	0.00
536	301026	浩通科技	300	9,135.00	0.00
537	300327	中颖电子	400	9,120.00	0.00
538	301263	泰恩康	500	8,165.00	0.00
539	301578	辰奕智能	118	8,061.76	0.00
540	301025	读客文化	700	7,945.00	0.00
541	300068	南都电源	600	7,764.00	0.00
542	300763	锦浪科技	110	7,689.00	0.00
543	300133	华策影视	1,300	7,631.00	0.00
544	301363	美好医疗	200	7,360.00	0.00
545	300801	泰和科技	400	6,872.00	0.00
546	300796	贝斯美	420	6,762.00	0.00

547	300291	百纳千成	1,000	6,440.00	0.00
548	300853	申昊科技	200	5,440.00	0.00
549	300548	博创科技	200	5,394.00	0.00
550	301555	惠柏新材	166	5,385.04	0.00
551	301018	申菱环境	200	5,268.00	0.00
552	300898	熊猫乳品	200	4,832.00	0.00
553	300401	花园生物	400	4,724.00	0.00
554	300982	苏文电能	140	4,597.60	0.00
555	301329	信音电子	200	4,469.03	0.00
556	300705	九典制药	120	3,987.60	0.00
557	301507	民生健康	250	3,962.50	0.00
558	301291	明阳电气	139	3,942.04	0.00
559	300911	亿田智能	100	3,763.00	0.00
560	301505	苏州规划	100	3,586.31	0.00
561	300182	捷成股份	700	3,556.00	0.00
562	301292	海科新源	179	3,463.65	0.00
563	301498	乖宝宠物	89	3,454.09	0.00
564	002154	报喜鸟	600	3,408.00	0.00
565	300146	汤臣倍健	200	3,406.00	0.00
566	301272	英华特	63	3,362.94	0.00
567	301210	金杨股份	70	3,183.60	0.00
568	301519	舜禹股份	156	3,152.76	0.00
569	301202	朗威股份	99	3,148.20	0.00
570	301517	陕西华达	69	3,014.61	0.00
571	301418	协昌科技	60	3,012.00	0.00
572	301528	多浦乐	43	2,963.13	0.00
573	301550	斯菱股份	67	2,919.19	0.00
574	301515	港通医疗	100	2,830.85	0.00
575	001378	德冠新材	84	2,626.68	0.00
576	301500	飞南资源	107	2,235.23	0.00
577	301559	中集环科	121	2,207.04	0.00
578	300041	回天新材	220	2,204.40	0.00
579	300765	新诺威	60	2,197.20	0.00
580	301371	敷尔佳	57	2,142.06	0.00
581	301520	万邦医药	36	1,898.64	0.00
582	300200	高盟新材	100	883.00	0.00
583	300047	天源迪科	100	875.00	0.00
584	300230	永利股份	200	806.00	0.00
585	300420	五洋停车	200	608.00	0.00
586	300737	科顺股份	20	122.80	0.00

注：1、根据厦门市美亚柏科信息股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日发布的《关于变更公司名称、证券简称、住所暨完成工商变更登记的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“美亚柏科”变更为“国投智能”，证券代码“300188”保持不变。

2、根据朗新科技集团股份有限公司于 2023 年 12 月 29 日发布的《关于变更证券简称的公告》，自 2024 年 1 月 2 日起，公司的证券简称由“朗新科技”变更为“朗新集团”，证券代码“300682”保持不变。

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	59,907,498.52	64.27
2	300760	迈瑞医疗	46,542,634.00	49.93
3	300015	爱尔眼科	20,266,195.05	21.74
4	300498	温氏股份	15,839,965.10	16.99
5	300866	安克创新	14,168,264.00	15.20
6	300782	卓胜微	14,073,616.31	15.10
7	300274	阳光电源	13,860,703.00	14.87
8	300416	苏试试验	13,466,132.18	14.45
9	300638	广和通	12,728,997.00	13.66
10	300130	新国都	12,602,757.00	13.52
11	300308	中际旭创	12,156,082.19	13.04
12	300303	聚飞光电	11,453,818.00	12.29
13	002252	上海莱士	11,401,641.00	12.23
14	300124	汇川技术	11,208,677.86	12.02
15	300639	凯普生物	10,995,398.04	11.80
16	300406	九强生物	10,025,718.20	10.76
17	001965	招商公路	9,974,906.00	10.70
18	300592	华凯易佰	9,839,897.78	10.56
19	300791	仙乐健康	9,774,815.00	10.49
20	300244	迪安诊断	9,436,154.00	10.12
21	300059	东方财富	9,026,663.00	9.68
22	300001	特锐德	8,947,637.00	9.60
23	300908	仲景食品	8,383,784.00	8.99
24	301047	义翘神州	8,037,276.50	8.62
25	300926	博俊科技	7,966,844.60	8.55
26	301345	涛涛车业	7,800,846.47	8.37
27	000338	潍柴动力	7,722,883.00	8.29
28	300604	长川科技	7,672,318.06	8.23
29	300628	亿联网络	7,659,820.19	8.22
30	300012	华测检测	7,582,428.43	8.13

31	300470	中密控股	7,542,085.28	8.09
32	300896	爱美客	7,420,571.60	7.96
33	300428	立中集团	7,373,818.00	7.91
34	300450	先导智能	7,328,759.00	7.86
35	300832	新产业	7,267,962.20	7.80
36	300957	贝泰妮	7,227,754.00	7.75
37	300253	卫宁健康	7,125,474.00	7.64
38	605168	三人行	7,089,497.20	7.61
39	000034	神州数码	7,013,422.00	7.52
40	300482	万孚生物	7,005,824.32	7.52
41	300319	麦捷科技	6,830,103.00	7.33
42	300384	三联虹普	6,747,827.00	7.24
43	300687	赛意信息	6,730,227.29	7.22
44	300118	东方日升	6,729,810.00	7.22
45	300850	新强联	6,676,282.96	7.16
46	301096	百诚医药	6,606,026.00	7.09
47	300532	今天国际	6,593,916.01	7.07
48	300724	捷佳伟创	6,563,445.00	7.04
49	300645	正元智慧	6,552,703.00	7.03
50	300999	金龙鱼	6,507,510.00	6.98
51	300769	德方纳米	6,306,039.60	6.77
52	300679	电连技术	6,086,344.00	6.53
53	300019	硅宝科技	5,932,306.96	6.36
54	002126	银轮股份	5,913,647.44	6.34
55	603035	常熟汽饰	5,843,044.00	6.27
56	300026	红日药业	5,804,916.00	6.23
57	301050	雷电微力	5,754,069.00	6.17
58	300457	赢合科技	5,749,131.00	6.17
59	603518	锦泓集团	5,739,085.00	6.16
60	300413	芒果超媒	5,696,381.00	6.11
61	300919	中伟股份	5,644,716.00	6.06
62	300938	信测标准	5,452,503.88	5.85
63	002027	分众传媒	5,362,898.00	5.75
64	300682	朗新科技	5,315,299.00	5.70
65	300148	天舟文化	5,234,000.00	5.61
66	300415	伊之密	5,204,345.57	5.58
67	300699	光威复材	5,133,517.00	5.51
68	301029	怡合达	5,069,728.00	5.44
69	300627	华测导航	5,066,362.00	5.44
70	300558	贝达药业	5,011,301.00	5.38
71	300181	佐力药业	4,935,152.00	5.29
72	301109	军信股份	4,884,858.62	5.24
73	301257	普蕊斯	4,828,841.00	5.18
74	301061	匠心家居	4,816,176.46	5.17

75	300623	捷捷微电	4,776,195.94	5.12
76	300458	全志科技	4,712,543.70	5.06
77	300398	飞凯材料	4,708,082.00	5.05
78	301283	聚胶股份	4,654,313.00	4.99
79	601001	晋控煤业	4,648,827.00	4.99
80	002600	领益智造	4,638,306.00	4.98
81	300873	海晨股份	4,509,813.00	4.84
82	300211	亿通科技	4,506,907.00	4.83
83	300377	赢时胜	4,483,603.25	4.81
84	300566	激智科技	4,463,866.00	4.79
85	300002	神州泰岳	4,446,641.00	4.77
86	300454	深信服	4,404,235.96	4.72
87	301302	华如科技	4,345,030.00	4.66
88	301208	中亦科技	4,341,660.00	4.66
89	300435	中泰股份	4,299,982.00	4.61
90	300021	大禹节水	4,280,010.00	4.59
91	300741	华宝股份	4,239,007.00	4.55
92	300770	新媒股份	4,221,523.00	4.53
93	300693	盛弘股份	4,186,456.56	4.49
94	300991	创益通	4,159,070.00	4.46
95	300821	东岳硅材	4,158,404.00	4.46
96	300776	帝尔激光	4,138,300.60	4.44
97	300446	航天智造	4,136,394.00	4.44
98	300409	道氏技术	4,119,183.00	4.42
99	300685	艾德生物	4,099,582.00	4.40
100	301207	华兰疫苗	4,092,952.50	4.39
101	003816	中国广核	4,090,906.00	4.39
102	300326	凯利泰	4,061,130.19	4.36
103	300365	恒华科技	4,041,078.00	4.34
104	300285	国瓷材料	3,999,967.00	4.29
105	301227	森鹰窗业	3,994,332.00	4.29
106	300759	康龙化成	3,986,942.75	4.28
107	300357	我武生物	3,972,062.00	4.26
108	300170	汉得信息	3,957,859.00	4.25
109	300451	创业慧康	3,932,636.00	4.22
110	300279	和晶科技	3,917,195.00	4.20
111	300898	熊猫乳品	3,848,380.00	4.13
112	300071	福石控股	3,840,581.00	4.12
113	300369	绿盟科技	3,834,524.00	4.11
114	300994	久祺股份	3,807,397.13	4.08
115	688012	中微公司	3,794,238.55	4.07
116	300003	乐普医疗	3,768,547.00	4.04
117	601058	赛轮轮胎	3,765,695.00	4.04
118	300563	神宇股份	3,731,233.00	4.00

119	301376	致欧科技	3,694,941.93	3.96
120	300476	胜宏科技	3,684,981.00	3.95
121	600795	国电电力	3,677,627.00	3.95
122	300289	利德曼	3,650,451.00	3.92
123	000039	中集集团	3,648,351.10	3.91
124	300424	航新科技	3,627,345.00	3.89
125	300751	迈为股份	3,623,949.11	3.89
126	603556	海兴电力	3,579,027.00	3.84
127	300990	同飞股份	3,544,026.15	3.80
128	300453	三鑫医疗	3,494,145.70	3.75
129	300354	东华测试	3,481,280.00	3.73
130	300773	拉卡拉	3,438,790.00	3.69
131	300696	爱乐达	3,412,027.60	3.66
132	300380	安硕信息	3,401,106.00	3.65
133	300601	康泰生物	3,375,324.20	3.62
134	300842	帝科股份	3,370,729.44	3.62
135	300887	谱尼测试	3,362,590.31	3.61
136	300408	三环集团	3,335,674.58	3.58
137	300493	润欣科技	3,321,559.00	3.56
138	301033	迈普医学	3,308,776.00	3.55
139	300348	长亮科技	3,285,451.00	3.52
140	300147	香雪制药	3,267,613.00	3.51
141	300394	天孚通信	3,263,884.00	3.50
142	300286	安科瑞	3,222,740.00	3.46
143	300144	宋城演艺	3,220,408.17	3.45
144	300856	科思股份	3,216,756.00	3.45
145	300145	中金环境	3,195,452.00	3.43
146	300218	安利股份	3,154,270.00	3.38
147	300894	火星人	3,141,809.48	3.37
148	300037	新宙邦	3,121,902.00	3.35
149	300460	惠伦晶体	3,106,009.00	3.33
150	301179	泽宇智能	3,102,154.70	3.33
151	300122	智飞生物	3,097,409.00	3.32
152	600583	海油工程	3,096,461.00	3.32
153	301356	天振股份	3,091,013.40	3.32
154	300241	瑞丰光电	3,085,456.00	3.31
155	300115	长盈精密	3,077,546.00	3.30
156	301132	满坤科技	3,066,763.00	3.29
157	600519	贵州茅台	3,033,387.00	3.25
158	300818	耐普矿机	3,032,136.00	3.25
159	300875	捷强装备	3,013,536.00	3.23
160	300529	健帆生物	3,000,849.00	3.22
161	301160	翔楼新材	2,999,339.00	3.22
162	300412	迦南科技	2,991,075.80	3.21

163	300830	金现代	2,990,495.00	3.21
164	300111	向日葵	2,964,124.00	3.18
165	300815	玉禾田	2,955,856.80	3.17
166	300086	康芝药业	2,954,790.00	3.17
167	301121	紫建电子	2,930,069.00	3.14
168	300659	中孚信息	2,926,133.00	3.14
169	300973	立高食品	2,920,810.00	3.13
170	301201	诚达药业	2,914,076.00	3.13
171	301196	唯科科技	2,894,592.41	3.11
172	300138	晨光生物	2,886,169.00	3.10
173	300206	理邦仪器	2,872,241.00	3.08
174	301200	大族数控	2,862,315.00	3.07
175	601567	三星医疗	2,841,825.00	3.05
176	301165	锐捷网络	2,840,319.05	3.05
177	301235	华康医疗	2,821,959.00	3.03
178	300681	英搏尔	2,821,479.50	3.03
179	300161	华中数控	2,818,850.00	3.02
180	300404	博济医药	2,815,614.28	3.02
181	000921	海信家电	2,814,457.00	3.02
182	300217	东方电热	2,803,340.00	3.01
183	301391	卡莱特	2,801,196.00	3.01
184	300125	聆达股份	2,790,532.35	2.99
185	300360	炬华科技	2,783,369.32	2.99
186	300719	安达维尔	2,766,245.00	2.97
187	300316	晶盛机电	2,739,806.00	2.94
188	300443	金雷股份	2,708,706.00	2.91
189	300129	泰胜风能	2,701,466.00	2.90
190	300833	浩洋股份	2,686,674.00	2.88
191	300979	华利集团	2,673,534.00	2.87
192	300223	北京君正	2,667,429.00	2.86
193	600131	国网信通	2,663,927.00	2.86
194	605090	九丰能源	2,647,726.00	2.84
195	301159	三维天地	2,645,489.76	2.84
196	300452	山河药辅	2,643,132.00	2.84
197	300947	德必集团	2,641,892.00	2.83
198	688596	正帆科技	2,640,400.18	2.83
199	300034	钢研高纳	2,613,282.00	2.80
200	002014	永新股份	2,590,088.00	2.78
201	301123	奕东电子	2,589,256.83	2.78
202	300725	药石科技	2,571,573.40	2.76
203	300653	正海生物	2,570,738.04	2.76
204	301102	兆讯传媒	2,556,448.00	2.74
205	300203	聚光科技	2,543,320.00	2.73
206	300477	合纵科技	2,526,641.00	2.71

207	300105	龙源技术	2,525,040.00	2.71
208	300017	网宿科技	2,504,876.00	2.69
209	300014	亿纬锂能	2,470,466.00	2.65
210	300430	诚益通	2,450,035.00	2.63
211	300232	洲明科技	2,447,107.00	2.63
212	300808	久量股份	2,431,285.00	2.61
213	300426	唐德影视	2,414,297.00	2.59
214	300674	宇信科技	2,395,891.56	2.57
215	300228	富瑞特装	2,392,213.00	2.57
216	300940	南极光	2,358,870.00	2.53
217	300768	迪普科技	2,357,382.00	2.53
218	300043	星辉娱乐	2,343,231.00	2.51
219	600258	首旅酒店	2,334,871.00	2.50
220	300082	奥克股份	2,333,809.00	2.50
221	002429	兆驰股份	2,331,302.00	2.50
222	000090	天健集团	2,324,909.00	2.49
223	300525	博思软件	2,323,216.40	2.49
224	300876	蒙泰高新	2,322,503.00	2.49
225	300922	天秦装备	2,320,486.60	2.49
226	300589	江龙船艇	2,318,949.00	2.49
227	300893	松原股份	2,317,265.14	2.49
228	300710	万隆光电	2,309,638.00	2.48
229	600422	昆药集团	2,305,345.00	2.47
230	301308	江波龙	2,285,792.00	2.45
231	601500	通用股份	2,274,456.00	2.44
232	301181	标榜股份	2,241,364.00	2.40
233	300189	神农科技	2,224,582.00	2.39
234	300239	东宝生物	2,222,831.00	2.38
235	300959	线上线下	2,214,170.00	2.38
236	300378	鼎捷软件	2,205,041.47	2.37
237	600941	中国移动	2,204,361.00	2.36
238	000811	冰轮环境	2,199,777.64	2.36
239	000983	山西焦煤	2,195,701.00	2.36
240	300853	申昊科技	2,195,203.56	2.35
241	600933	爱柯迪	2,189,491.00	2.35
242	300096	ST 易联众	2,186,703.00	2.35
243	300658	延江股份	2,184,513.60	2.34
244	601138	工业富联	2,179,925.00	2.34
245	300263	隆华科技	2,173,972.00	2.33
246	300909	汇创达	2,167,281.00	2.33
247	300797	钢研纳克	2,158,175.50	2.32
248	300397	天和防务	2,158,000.00	2.32
249	300755	华致酒行	2,147,982.00	2.30
250	688676	金盘科技	2,147,582.64	2.30

251	301051	信濠光电	2,134,468.00	2.29
252	000589	贵州轮胎	2,128,633.00	2.28
253	301095	广立微	2,126,521.00	2.28
254	301021	英诺激光	2,115,568.00	2.27
255	300066	三川智慧	2,112,671.00	2.27
256	301082	久盛电气	2,104,062.00	2.26
257	300149	睿智医药	2,100,788.00	2.25
258	300565	科信技术	2,100,632.00	2.25
259	300347	泰格医药	2,095,769.00	2.25
260	300520	科大国创	2,092,286.00	2.24
261	301213	观想科技	2,088,677.00	2.24
262	000988	华工科技	2,086,260.00	2.24
263	300727	润禾材料	2,085,521.70	2.24
264	301377	鼎泰高科	2,082,335.00	2.23
265	301267	华夏眼科	2,080,792.00	2.23
266	300933	中辰股份	2,076,014.00	2.23
267	300655	晶瑞电材	2,074,265.07	2.23
268	300389	艾比森	2,054,703.00	2.20
269	300533	冰川网络	2,054,134.00	2.20
270	002028	思源电气	2,053,075.00	2.20
271	301058	中粮科工	2,027,223.71	2.17
272	300337	银邦股份	2,025,425.00	2.17
273	300248	新开普	2,024,196.00	2.17
274	300671	富满微	2,017,497.00	2.16
275	301004	嘉益股份	2,007,687.00	2.15
276	300188	美亚柏科	1,999,800.20	2.15
277	605368	蓝天燃气	1,999,542.20	2.15
278	300421	力星股份	1,997,063.00	2.14
279	300300	海峡创新	1,984,634.89	2.13
280	300568	星源材质	1,983,916.85	2.13
281	300556	丝路视觉	1,969,652.00	2.11
282	300569	天能重工	1,935,419.00	2.08
283	300975	商络电子	1,933,301.00	2.07
284	300485	赛升药业	1,928,485.00	2.07
285	300173	福能东方	1,927,666.00	2.07
286	300249	依米康	1,926,189.00	2.07
287	300183	东软载波	1,903,136.00	2.04
288	300383	光环新网	1,897,403.00	2.04
289	301285	鸿日达	1,896,189.00	2.03
290	300009	安科生物	1,874,792.00	2.01

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 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	23,593,421.60	25.31
2	300760	迈瑞医疗	21,223,748.00	22.77
3	300498	温氏股份	14,372,178.00	15.42
4	002252	上海莱士	11,590,551.34	12.43
5	300308	中际旭创	10,940,627.41	11.74
6	001965	招商公路	10,025,132.70	10.75
7	300274	阳光电源	9,609,526.00	10.31
8	300015	爱尔眼科	8,279,308.78	8.88
9	300639	凯普生物	7,723,714.67	8.29
10	605168	三人行	7,369,936.75	7.91
11	300724	捷佳伟创	7,205,418.00	7.73
12	300406	九强生物	6,849,625.00	7.35
13	300638	广和通	6,733,560.03	7.22
14	000338	潍柴动力	6,430,288.00	6.90
15	300896	爱美客	6,386,590.00	6.85
16	300118	东方日升	6,164,112.00	6.61
17	300866	安克创新	5,393,481.00	5.79
18	300628	亿联网络	5,300,343.00	5.69
19	000034	神州数码	5,100,797.00	5.47
20	300059	东方财富	4,889,823.66	5.25
21	300782	卓胜微	4,879,526.00	5.23
22	300699	光威复材	4,837,452.72	5.19
23	300769	德方纳米	4,781,585.00	5.13
24	300957	贝泰妮	4,745,674.00	5.09
25	603035	常熟汽饰	4,715,135.00	5.06
26	300428	立中集团	4,709,217.00	5.05
27	300001	特锐德	4,703,478.00	5.05
28	603518	锦泓集团	4,689,740.00	5.03
29	002126	银轮股份	4,576,912.00	4.91
30	300413	芒果超媒	4,574,535.50	4.91
31	301061	匠心家居	4,493,194.40	4.82
32	601001	晋控煤业	4,434,020.00	4.76
33	300384	三联虹普	4,369,652.00	4.69
34	003816	中国广核	4,290,700.00	4.60
35	002027	分众传媒	4,242,812.00	4.55
36	300450	先导智能	4,193,799.40	4.50
37	301345	涛涛车业	4,130,518.84	4.43
38	002600	领益智造	3,998,404.00	4.29
39	300124	汇川技术	3,978,368.93	4.27

40	300645	正元智慧	3,957,079.00	4.25
41	300850	新强联	3,949,069.50	4.24
42	300458	全志科技	3,939,276.00	4.23
43	600795	国电电力	3,839,069.00	4.12
44	300303	聚飞光电	3,833,142.00	4.11
45	300122	智飞生物	3,825,957.00	4.10
46	300253	卫宁健康	3,812,072.60	4.09
47	300012	华测检测	3,809,996.00	4.09
48	300026	红日药业	3,769,723.00	4.04
49	300898	熊猫乳品	3,741,958.00	4.01
50	000039	中集集团	3,669,633.00	3.94
51	601058	赛轮轮胎	3,589,360.00	3.85
52	300181	佐力药业	3,565,245.00	3.82
53	300019	硅宝科技	3,536,476.00	3.79
54	300991	创益通	3,535,018.00	3.79
55	300482	万孚生物	3,479,857.00	3.73
56	300832	新产业	3,285,258.30	3.52
57	300014	亿纬锂能	3,249,677.00	3.49
58	300493	润欣科技	3,241,542.00	3.48
59	300856	科思股份	3,201,985.00	3.44
60	301047	义翘神州	3,127,175.20	3.35
61	300887	谱尼测试	3,124,537.00	3.35
62	300416	苏试试验	3,071,468.39	3.30
63	300148	天舟文化	3,028,573.00	3.25
64	688012	中微公司	3,006,729.98	3.23
65	603556	海兴电力	2,996,013.00	3.21
66	301109	军信股份	2,989,776.50	3.21
67	300476	胜宏科技	2,974,517.00	3.19
68	300685	艾德生物	2,968,397.80	3.18
69	600583	海油工程	2,958,643.00	3.17
70	300470	中密控股	2,926,143.00	3.14
71	300377	赢时胜	2,924,575.00	3.14
72	300380	安硕信息	2,918,272.00	3.13
73	300086	康芝药业	2,914,142.00	3.13
74	301208	中亦科技	2,849,573.00	3.06
75	300357	我武生物	2,833,078.00	3.04
76	300908	仲景食品	2,829,894.00	3.04
77	301165	锐捷网络	2,782,160.24	2.98
78	300926	博俊科技	2,779,736.00	2.98
79	300682	朗新科技	2,774,294.00	2.98
80	300394	天孚通信	2,761,113.96	2.96
81	688596	正帆科技	2,734,139.68	2.93
82	300776	帝尔激光	2,732,826.40	2.93
83	300241	瑞丰光电	2,726,988.98	2.93

84	300285	国瓷材料	2,716,365.00	2.91
85	300438	鹏辉能源	2,699,124.00	2.90
86	300751	迈为股份	2,698,279.20	2.89
87	301029	怡合达	2,662,888.56	2.86
88	300138	晨光生物	2,636,664.00	2.83
89	300125	聆达股份	2,612,943.00	2.80
90	300875	捷强装备	2,609,925.00	2.80
91	300627	华测导航	2,593,978.00	2.78
92	300034	钢研高纳	2,568,529.00	2.76
93	300563	神宇股份	2,544,265.00	2.73
94	002014	永新股份	2,517,137.00	2.70
95	300203	聚光科技	2,513,974.00	2.70
96	300999	金龙鱼	2,507,644.00	2.69
97	300725	药石科技	2,507,313.80	2.69
98	600131	国网信通	2,493,696.00	2.68
99	300354	东华测试	2,487,487.00	2.67
100	300460	惠伦晶体	2,467,208.00	2.65
101	300105	龙源技术	2,461,655.00	2.64
102	300601	康泰生物	2,460,697.40	2.64
103	300457	赢合科技	2,459,078.00	2.64
104	300347	泰格医药	2,445,734.04	2.62
105	300604	长川科技	2,436,440.00	2.61
106	601567	三星医疗	2,416,076.00	2.59
107	300973	立高食品	2,411,020.00	2.59
108	300232	洲明科技	2,406,719.00	2.58
109	300679	电连技术	2,381,091.00	2.55
110	300919	中伟股份	2,367,748.00	2.54
111	000983	山西焦煤	2,333,014.00	2.50
112	600258	首旅酒店	2,321,260.00	2.49
113	300687	赛意信息	2,313,734.80	2.48
114	000811	冰轮环境	2,290,018.00	2.46
115	300408	三环集团	2,286,401.00	2.45
116	000090	天健集团	2,272,968.00	2.44
117	300477	合纵科技	2,272,274.17	2.44
118	300565	科信技术	2,269,146.00	2.43
119	300589	江龙船艇	2,267,881.00	2.43
120	300435	中泰股份	2,259,284.00	2.42
121	600941	中国移动	2,257,726.00	2.42
122	300568	星源材质	2,254,118.87	2.42
123	300404	博济医药	2,250,213.00	2.41
124	300759	康龙化成	2,243,143.00	2.41
125	300659	中孚信息	2,235,780.00	2.40
126	300319	麦捷科技	2,230,952.00	2.39
127	300532	今天国际	2,226,404.00	2.39

128	300853	申昊科技	2,223,397.00	2.39
129	300566	激智科技	2,200,719.98	2.36
130	300933	中辰股份	2,200,182.00	2.36
131	300424	航新科技	2,191,351.00	2.35
132	300360	炬华科技	2,189,915.00	2.35
133	300211	亿通科技	2,182,886.00	2.34
134	605368	蓝天燃气	2,166,973.20	2.32
135	300096	ST 易联众	2,154,383.00	2.31
136	000988	华工科技	2,154,013.00	2.31
137	605090	九丰能源	2,143,873.00	2.30
138	301302	华如科技	2,138,568.00	2.29
139	300369	绿盟科技	2,135,083.00	2.29
140	000589	贵州轮胎	2,129,255.00	2.28
141	300696	爱乐达	2,122,254.22	2.28
142	300959	线上线下	2,111,408.00	2.27
143	300451	创业慧康	2,106,289.00	2.26
144	300453	三鑫医疗	2,093,339.80	2.25
145	300727	润禾材料	2,092,002.00	2.24
146	300111	向日葵	2,088,013.00	2.24
147	300378	鼎捷软件	2,068,000.79	2.22
148	300443	金雷股份	2,058,173.00	2.21
149	300520	科大国创	2,047,998.80	2.20
150	300556	丝路视觉	2,040,010.00	2.19
151	002028	思源电气	2,017,812.00	2.16
152	300979	华利集团	2,016,604.00	2.16
153	601500	通用股份	1,999,706.00	2.15
154	600933	爱柯迪	1,992,308.13	2.14
155	600519	贵州茅台	1,988,348.00	2.13
156	300975	商络电子	1,982,274.00	2.13
157	300770	新媒股份	1,960,539.00	2.10
158	301121	紫建电子	1,959,020.00	2.10
159	300655	晶瑞电材	1,958,870.98	2.10
160	000921	海信家电	1,954,805.00	2.10
161	300818	耐普矿机	1,944,414.00	2.09
162	300415	伊之密	1,897,550.00	2.04
163	300623	捷捷微电	1,897,021.00	2.04
164	301213	观想科技	1,873,720.00	2.01
165	300249	依米康	1,873,442.00	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	1,814,912,473.82
卖出股票的收入（成交）总额	1,156,716,275.31

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	35,376,276.39	4.70
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	35,376,276.39	4.70

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	019694	23 国债 01	218,000	22,223,553.10	2.96
2	019678	22 国债 13	130,000	13,152,723.29	1.75

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，本基金暂不投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

根据本基金合同，本基金暂不投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，安克创新科技股份有限公司在本报告编制日前一年内曾受到长沙市市场监督管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。

除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在本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	228,450.18
2	应收清算款	1,276,963.59
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	504,316.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,009,729.90

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
海富通创业板增强 A	1,758	285,915.76	482,178,364.68	95.93%	20,461,547.11	4.07%
海富通创业板增强 C	2,143	71,915.38	116,422,364.82	75.54%	37,692,290.68	24.46%
合计	3,901	168,355.44	598,600,729.50	91.15%	58,153,837.79	8.85%

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	海富通创业板增强 A	346,250.26	0.0689%
	海富通创业板增强 C	14,471.80	0.0094%
	合计	360,722.06	0.0549%

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	海富通创业板增强 A	10~50
	海富通创业板增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	海富通创业板增强 A	10~50
	海富通创业板增强 C	0
	合计	10~50

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,493,445.94	1.60%	4,802,250.22	0.73%	不少于 3 年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,493,445.94	1.60%	4,802,250.22	0.73%	-

注：1、本基金募集期间，本基金管理人运用固有资金作为发起资金总计 1,000.10 万元

认购了本基金，其中，认购费用为 1,000.00 元，符合基金合同和招募说明书等法律文件的约定。发起资金认购的基金份额自基金合同生效之日起持有不少于 3 年。

2、2021 年 4 月 7 日，本基金管理人运用自有资金总计 1000.10 万元申购本基金，其中，申购费为 1,000.00 元。

3、2021 年 5 月 26 日，本基金管理人赎回发起资金持有份额 520.00 万份，本基金合同于 2018 年 4 月 8 日生效，发起份额持有期限自基金合同生效之日已超过 3 年。

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	海富通创业板增强 A	海富通创业板增强 C
基金合同生效日（2018 年 4 月 8 日）基金份额总额	23,917,653.02	15,869,752.12
本报告期期初基金份额总额	24,241,101.09	34,942,124.47
本报告期基金总申购份额	483,500,546.43	275,311,473.23
减：本报告期基金总赎回份额	5,101,735.73	156,138,942.20
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	502,639,911.79	154,114,655.50

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

2023 年 12 月 13 日，海富通基金管理有限公司发布公告，经公司第七届董事会第二十一临时会议审议通过，何树方先生不再担任公司副总经理职务。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期无基金管理人、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

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 50,000.00 元。目前事务所已提供审计服务的年限是 6 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	2	359,782,464.10	12.11%	263,750.11	12.18%	-
兴业证券	2	348,371,302.51	11.73%	256,303.34	11.84%	-
中泰证券	1	337,409,892.95	11.36%	248,195.77	11.46%	-
东方证券	3	336,264,840.83	11.32%	248,883.29	11.50%	-
国海证券	2	297,557,134.83	10.02%	217,928.70	10.07%	-
浙商证券	2	212,480,583.01	7.15%	156,218.86	7.22%	-
德邦证券	2	190,903,547.15	6.43%	140,488.50	6.49%	-
东吴证券	2	188,050,341.56	6.33%	138,928.31	6.42%	-
长江证券	2	179,316,657.84	6.04%	131,340.73	6.07%	-
东兴证券	2	169,727,900.70	5.71%	124,902.25	5.77%	-
东北证券	1	153,460,021.33	5.17%	112,783.84	5.21%	-
广发证券	2	68,878,368.64	2.32%	50,686.71	2.34%	-
申万宏源	2	60,496,752.07	2.04%	25,569.10	1.18%	-
太平洋证券	2	24,117,919.06	0.81%	17,395.82	0.80%	-
华泰证券	1	23,949,769.64	0.81%	17,513.29	0.81%	-

方正证券	2	12,693,615.54	0.43%	9,171.64	0.42%	-
中信证券	4	6,612,264.34	0.22%	4,931.07	0.23%	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	1	-	-	-	-	-

注：1、本基金本报告期新增国海证券 2 个交易单元。

2、(1)交易单元的选择标准

本基金的管理人对证券公司的综合实力及声誉、研究水平和综合服务支持三个部分进行评议，形成证券公司交易单元租用意见。

(2)交易单元的选择程序

本基金的管理人按照如下程序进行交易单元的选择：

<1> 推荐。投资部业务人员推荐，经投资部部门内部讨论，形成证券公司交易单元租用意见，并报公司总经理办公会审议。

<2> 核准。在完成对证券公司的评估和审核后，由基金管理人的总经理办公会核准。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
海通证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	199,920.00	0.26%	-	-	-	-
中泰证券	1,211,376.55	1.57%	200,000.00	100.00%	-	-
东方证券	19,981,579.00	25.85%	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	8,076,007.59	10.45%	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	17,395,453.00	22.51%	-	-	-	-
长江证券	19,985,908.00	25.86%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	4,324.95	0.01%	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	17,061.76	0.02%	-	-	-	-
华泰证券	8,914,741.74	11.53%	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,499,700.00	1.94%	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

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旗下部分基金新增东方财富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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-08
2	海富通基金管理有限公司关于公司住所变更的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-02-22
3	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增北京创金启富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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
4	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增新华信通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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
5	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增麦高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	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-08-01
6	海富通基金管理有限公司关于旗下部分基金新增玄元保险代理有限公司为销售机构并参加其申购费率优惠活动的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-11-14
7	海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金暂停大额申购和转换转入业务的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证	2023-11-27

	公告	监会基金电子披露网站	
8	海富通基金管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-13
9	海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金第一次分红公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-12-20

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	2023/11/23-2023/11/26,2023/12/21-2023/12/31	-	134,525,459.07	-	134,525,459.07	20.48%
	2	2023/10/16-2023/11/15,2023/11/17-2023/11/19	-	67,862,040.06	-	67,862,040.06	10.33%
	3	2023/11/27-2023/12/20	-	205,671,396.45	137,950,062.08	67,721,334.37	10.31%
	4	2023/11/17-2023/11/19	-	53,092,605.22	-	53,092,605.22	8.08%
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、基金合同生效满三年后继续存续的，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、</p>							

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 113 只公募基金。截至 2023 年 12 月 31 日，海富通管理的公募基金资产规模约 1510 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“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“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“金基金·灵活配置型基金三年期奖”，海富通内需热点混合型证券投资基金荣获“金基金·偏股混合型基金五年期奖”。

2023 年 3 月，海富通中证短融交易型开放式指数证券投资基金荣获上海证券交易所颁发的“上交所 2022 年度债券旗舰 ETF”。2023 年 6 月，海富通收益增长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”。

§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创业板综指增强型发起式证券投资基金的文件
- (二)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金基金合同
- (三)海富通创业板综指增强型发起式证券投资基金招募说明书
- (四)海富通创业板综指增强型发起式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
二〇二四年三月二十九日