

汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告期自 2024 年 01 月 01 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
1.2 目录	3
§ 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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§ 4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	19
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	19
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	23
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	24
§ 5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	24
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	24
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	24
§ 6 审计报告	24
6.1 审计报告的基本信息	24
6.2 审计报告的基本内容	24
§ 7 年度财务报表	26
7.1 资产负债表	26
7.2 利润表	28
7.3 净资产变动表	29
7.4 报表附注	31
§ 8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	61
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	62

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	82
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	82
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	82
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	82
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
8.12 投资组合报告附注.....	83
§ 9 基金份额持有人信息	83
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	84
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况.....	85
§ 10 开放式基金份额变动	85
§ 11 重大事件揭示	85
11.1 基金份额持有人大会决议.....	85
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
11.4 基金投资策略的改变.....	86
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	86
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
11.8 其他重大事件.....	88
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	89
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
§ 13 备查文件目录	89
13.1 备查文件目录.....	90
13.2 存放地点	90
13.3 查阅方式	90

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	汇添富国证 2000 指数增强	
基金主代码	019318	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 11 月 07 日	
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额（份）	149,013,236.33	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	019318	019319
报告期末下属分级基金的份额总额（份）	89,366,959.03	59,646,277.30

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，进行积极的组合管理和风险控制，力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以国证 2000 指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 8.00%，力求实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略；股票投资策略；存托凭证的投资策略；债券投资策略；可转债及可交换债投资策略；资产支持证券投资策略；股指期货投资策略；国债期货投资策略；股票期权投资策略；融资投资策略及参与转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率*95%+同期银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金属于股票型指数增强基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	汇添富基金管理股份有限公司	招商证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	李鹏	韩鑫普
	联系电话	021-28932888	0755-82943666
	电子邮箱	service@99fund.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-888-9918	95565
传真		021-28932998	0755-82960794
注册地址		上海市黄浦区北京东路666号H区（东座）6楼H686室	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址		上海市黄浦区外马路728号	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		200010	518000
法定代表人		李文	霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路728号 汇添富基金管理股份有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层
注册登记机构	汇添富基金管理股份有限公司	上海市黄浦区外马路728号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数 据和指 标	2024 年		2023 年 11 月 07 日（基金合同生效 日）-2023 年 12 月 31 日	
	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
本期已 实现收 益	-908,950.89	-6,886,538.76	3,829,510.04	3,600,380.43

本期利润	-2,627,576.22	-5,654,197.96	1,742,135.64	1,586,711.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0258	-0.0579	0.0107	0.0101
本期加权平均净值利润率	-2.80%	-6.35%	1.06%	1.00%
本期基金份额净值增长率	11.08%	10.63%	1.07%	1.01%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	10,969,705.08	7,009,627.84	1,742,135.64	1,586,711.69
期末可供分配基金份额利润	0.1227	0.1175	0.0107	0.0101
期末基金资产净值	100,336,664.11	66,655,905.14	165,258,598.96	159,368,289.23
期末基金份额净值	1.1227	1.1175	1.0107	1.0101
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	12.27%	11.75%	1.07%	1.01%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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（例如：基金的申购赎回费等），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。

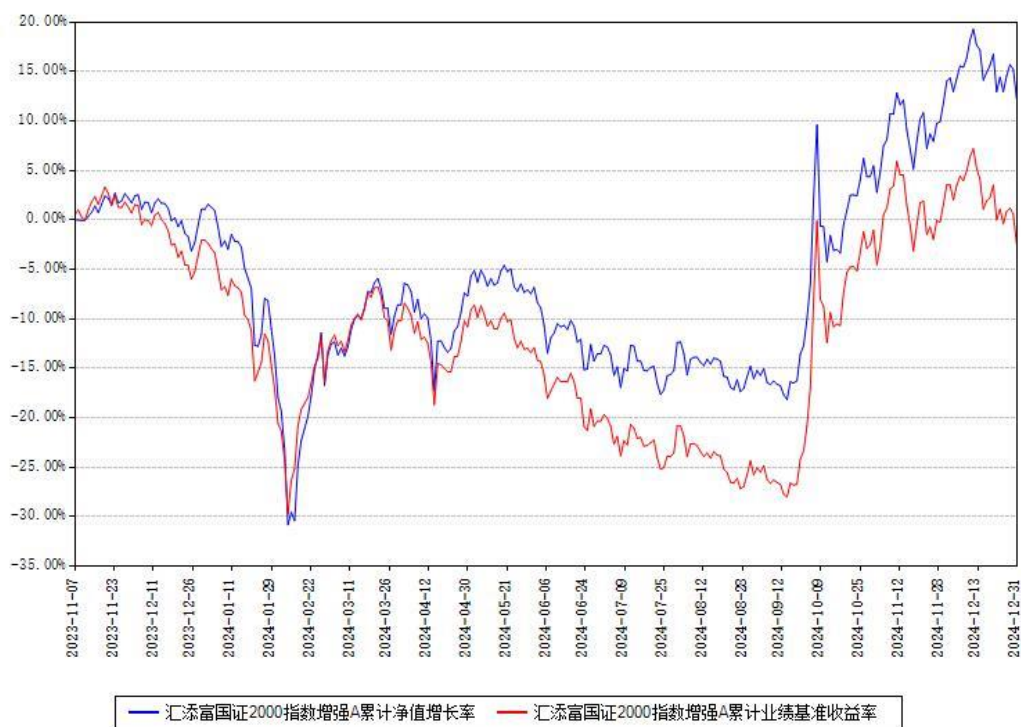
3.2 基金净值表现

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

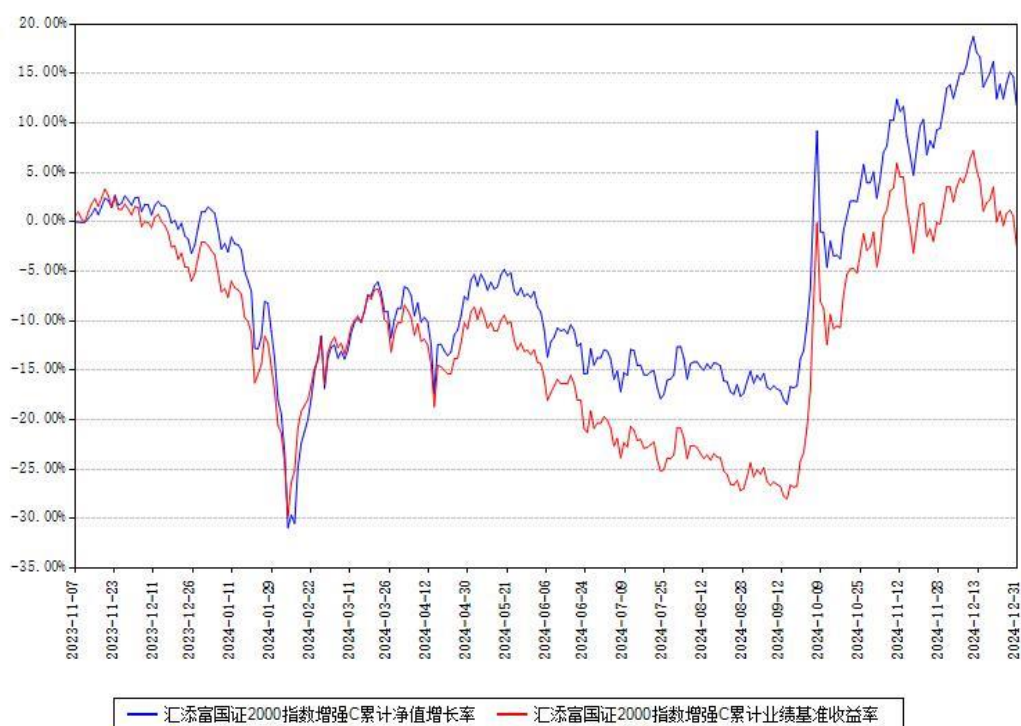
汇添富国证 2000 指数增强 A						
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	9.74%	2.24%	5.99%	2.40%	3.75%	-0.16%
过去六个月	29.81%	2.04%	22.48%	2.21%	7.33%	-0.17%
过去一年	11.08%	2.17%	-0.39%	2.12%	11.47%	0.05%
自基金合同生效起至今	12.27%	2.03%	-2.43%	1.99%	14.70%	0.04%
汇添富国证 2000 指数增强 C						
阶段	份额净值增长率①	份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	9.61%	2.24%	5.99%	2.40%	3.62%	-0.16%
过去六个月	29.55%	2.04%	22.48%	2.21%	7.07%	-0.17%
过去一年	10.63%	2.17%	-0.39%	2.12%	11.02%	0.05%
自基金合同生效起至今	11.75%	2.03%	-2.43%	1.99%	14.18%	0.04%

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

汇添富国证2000指数增强A累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富国证2000指数增强C累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

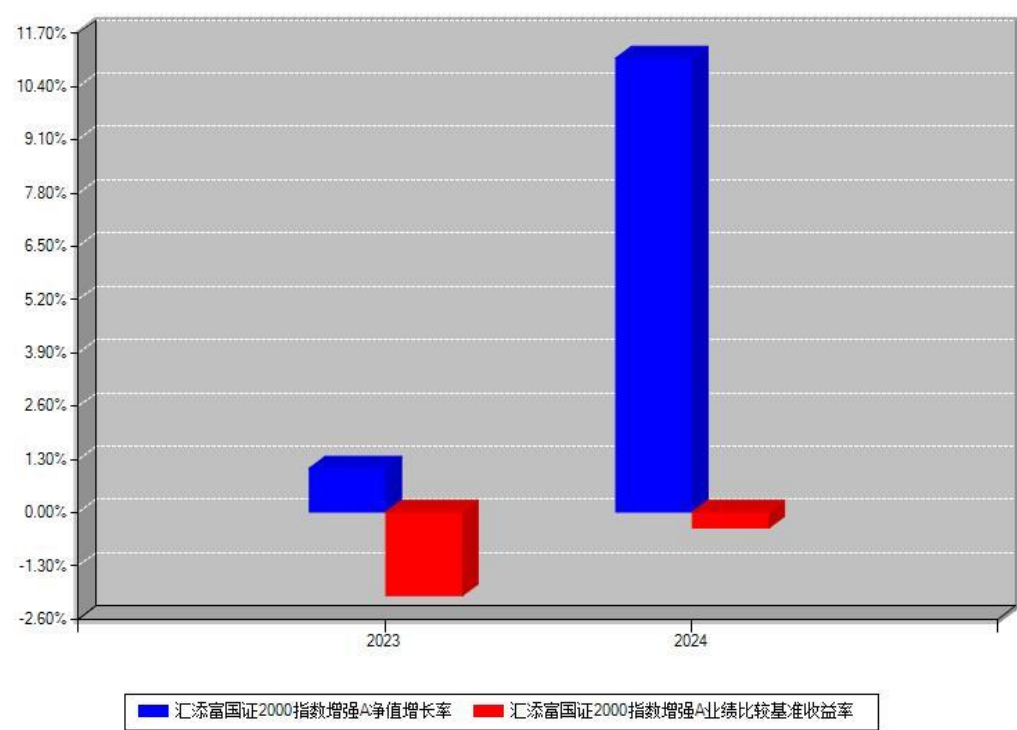


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2023 年 11 月 07 日）起 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

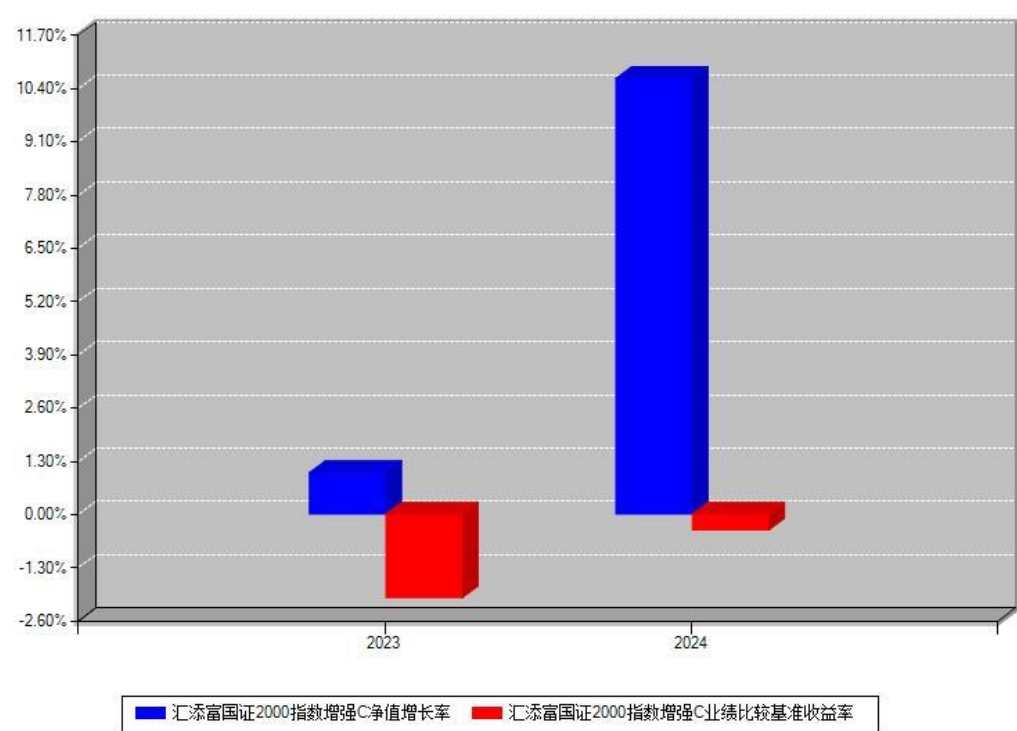
本基金各类份额自实际有资产之日起披露业绩数据。

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

汇添富国证2000指数增强A每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



汇添富国证2000指数增强C每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 11 月 07 日，合同生效当年按实际存续期计算，不

按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本《基金合同》生效之日为 2023 年 11 月 07 日，截至本报告期末未满三年，且未进行利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国、新加坡设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富投资管理有限公司、汇添富资产管理（美国）控股有限公司、汇添富资产管理（新加坡）有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2024 年，汇添富基金新成立 32 只公募基金，包括 6 只混合型基金，16 只股票型基金，10 只债券型基金。2024 年底，公司公募基金产品总数达 342 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2024 年，汇添富基金持续稳步推进投顾式销售及服务模式的深度发展，注重从客户需求出发，坚持以客户回报为导向，不断优化基金售前、售中、售后服务及体验。同时，互金业务不断开拓从服务端发力的创新路径，积极探索数字化转型，利用大数据、人工智能等技术，持续优化平台各项功能，力争为客户提供差异化、智能化的服务体验。

另外，汇添富基金与第三方销售机构紧密合作，在工具创新、投教内容及形式创新、客

户服务等方面展开了全方位深入合作，形成了较为完善的线上服务体系，更好地满足了客户多元化的投资需求，进一步提升了客户体验及满意度。

2024 年，汇添富基金秉持金融服务实体经济、满足居民财富管理需求的宗旨，以高质量发展为目标，持续提升投资者的获得感。公司继续坚定推进与核心机构客户的合作战略，机构业务保持高质量发展势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。公司不断提升客户服务及产品运营能力，聚焦战略级机构客户，与银行及银行理财公司加快合作，保险规模维持市场领先地位，同时也致力于服务其他机构投资者的专业投资需求。积极布局多只创新型品种，满足机构投资者专业化需求。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2024 年，汇添富渠道业务坚持一切从长期出发和客户第一的原则，持续深化渠道融合共建，秉持开放生态理念，通过渠道服务、产品布局、科技赋能与创新意识，全方位提升渠道服务体系的广度与深度，推动渠道合作迈向新高度。广泛开展线下投资者教育工作，全年合计举办投资者教育活动 4846 场，覆盖 417398 人次。线上数字化运营创新升级，围绕着优化运营模式、提升运营质量、增强运营效率等维度展开，获得银行渠道的一致认可。

2024 年，汇添富基金继续加强券商渠道的专业化服务。全年围绕不同投资主题推出“指增季”“固收季”“主动季”系列调研，并在全国举办多场投顾赋能培训活动，帮助券商提升资产配置和客户服务能力。为了让投资者获得更多交流机会，公司全年开展超过 2700 场线上线下活动，既有专业投资策略会，也有基金经理面对面和“走进汇添富”交流活动。公司始终把客户体验放在第一位，通过持续为券商提供专业支持，让优质服务覆盖更多投资者。

2024 年，汇添富基金持续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2024 年，汇添富香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显着成效，国际业务总资产管理规模保持稳定。随着汇添富稳定收益基金获批，汇添富香港子公司进一步完善海外产品线布局，涵盖境外权益、固收、货币类产品，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础。从 2024 年年初开始，继续通过国际路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外机构的沟通，进一步完善个性化客户服务体系，积极引导长期资金入市。

2024 年以来，汇添富基金积极开展公益慈善工作，充分发挥公募基金优势，践行社会责任，为助力实现“共同富裕”与中国式现代化贡献力量。公司连续十六年开展“河流·孩子”公益助学项目，举办第十七期乡村优秀青年教师培训和第七届乡村教育管理研习班，启动添富小学合唱团公益项目，助力乡村教育高质量发展；举办第四期“基业上善”慈善资产管理研修营，用专业力量推动我国公益慈善事业的可持续发展；发起第二期“致敬城市建设者”公益项目，让人民城市更有温度；参加云南、青海、内蒙古、陕西等地产业、教育和养老助老帮扶等项目，深化东西部协作，助力乡村振兴。

2025 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限（年）	说明
		任职日期	离任日期		
吴振翔	本基金的基金经理, 指数与量化投资部副总监	2023 年 11 月 07 日	—	18	国籍：中国。学历：中国科学技术大学管理学博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任长盛基金管理有限公司金融工程研究员、上投摩根基金管理有限公司产品开发高级经理。2008 年 3 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任产品开发高级经理、数量投资高级分析师、基金经理助理，现任指数与量化投资部副总监。2010 年 2 月 6 日至今任汇添富上证综合指

					数证券投资基金的基金经理。 2011 年 9 月 16 日至 2013 年 11 月 7 日任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2011 年 9 月 28 日至 2013 年 11 月 7 日任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 8 月 23 日至 2015 年 11 月 2 日任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2013 年 11 月 6 日至今任汇添富沪深 300 安中动态策略指数
--	--	--	--	--	---

					型证券投资基金的基金经理。 2015 年 2 月 16 日至 2023 年 4 月 24 日任汇添富成长多因子量化策略股票型证券投资基金的基金经理。2015 年 3 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2016 年 1 月 21 日至今任汇添富中证精准医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2016 年 7 月 28 日至今任中证上海国企交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证互联网医疗主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2017 年 8 月 10 日至今任汇添富中证 500 指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。2018 年 3 月 23 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富沪深 300
--	--	--	--	--	---

					指数增强型证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月 26 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 9 月 24 日至 2022 年 6 月 13 日任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 11 月 6 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 3 月 5 日至 2022 年 6 月 13 日任汇添富中证国企一带一路交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至 2024 年 4 月 15 日任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交
--	--	--	--	--	--

					易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 1 月 27 日至 2023 年 8 月 23 日任汇添富中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 4 月 28 日至 2024 年 4 月 30 日任汇添富中证沪港深张江自主创新 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2023 年 4 月 25 日至 2024 年 4 月 26 日任汇添富中证 500 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 6 月 6 日至今任汇添富量化选股混合型证券投资基金的基金经理。2023 年 9 月 1 日至今任汇添富稳健回报债券型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7 日至今任汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 22 日至今任汇添富上证综合交易型开放式指数证券投资基金的基金
--	--	--	--	--	--

					经理。2024 年 1 月 31 日至今任汇添富稳丰回报债券型发起式证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 10 日至 2024 年 12 月 11 日任汇添富中证 A500 指数型证券投资基金的基金经理。2024 年 12 月 12 日至今任汇添富中证 A500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。
王星星	本基金的基金经理	2023 年 11 月 07 日	-	9	国籍：中国。学历：中国人民大学金融工程硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2015 年 8 月至 2023 年 2 月任东方证券股份有限公司证券研究所研究员、高级研究员、高级分析师、业务总监（研究）。2023 年 2 月加入汇添富基金管理股份有限公司，担任指数与量化投资部基金经理。2023 年 6 月 29 日至今任汇添富中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。2023 年 11 月 7

					日至今任汇添富 国证 2000 指数 增强型证券投资 基金的基金经 理。
--	--	--	--	--	--

注:基金的首任基金经理,其“任职日期”为基金合同生效日,其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

非首任基金经理,其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注:截至本报告期末,本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》,建立了健全、有效的公平交易制度体系。公司公平交易管理体系覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合;涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动;贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括:

在研究分析环节,公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统,规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程,使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策环节,公司建立健全投资授权制度,明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限,合理确定各投资组合经理的投资权限。投资

决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。

在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易部按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。

在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外价格公允性等。

在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，保障公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种，以及投资授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占优比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量等综合判断交

易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 9 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

此外，为防范基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的潜在利益冲突，本基金管理人从投资指令、交易行为、交易监测等多方面，对兼任组合进行监控管理和分析评估。本报告期内兼任组合未出现违反公平交易或异常交易的情况。

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

报告期内，国证 2000 指数波动较大，上半年先抑后扬，下半年经历阴跌后，随着政策发生积极变化而快速反弹，全年基本收平。受市场风格和 Alpha 波动影响，本基金相对基准的超额收益在报告期内出现了两次较大幅度的回撤，后期随着市场平稳，超额收益均有所恢复，从整个报告期看，产品依然明显跑赢基准指数。

本基金采用量化指数增强的方式运作，在控制组合相对基准跟踪误差的基础上，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。具体操作上，我们采用多因子模型和 AI 量化选股相结合的方式评价个股，在严控组合和基准之间风格和行业偏离的条件下，超配评价较高的个股、低配评价较低的个股以实现超额收益。报告期内组合持仓相对分散，以降低组合对个股的依赖，提升组合超额稳定性，同时对风险事件实时监控，及时剔除风险个股，降低组合尾部风险。投资管理过程中我们尽量避免对组合持仓的直接干预，将投资观点和思想转化为规则化的量化投资策略，审慎地调整量化策略去间接调整组合持仓，以保证投资管理的可复制性，同时避免情绪波动对组合投资的负面影响。在后续的投资研究过程中，我们将稳步推进量化策略的迭代，加强策略的多样性，力争为持有人带来更好的持有体验。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期汇添富国证 2000 指数增强 A 类份额净值增长率为 11.08%，同期业绩比较基准收益率为-0.39%。本报告期汇添富国证 2000 指数增强 C 类份额净值增长率为 10.63%，同期

业绩比较基准收益率为-0.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，我国宏观经济预计将呈现稳中向好的发展态势。其中，房地产市场有望迎来边际改善，但出口领域仍面临不确定性。在此背景下，宏观政策或将保持积极基调：财政政策将加大逆周期调节力度，货币政策维持适度宽松取向。从资本市场表现来看，在经济基本面持续改善与宏观政策双重利好的支撑下，权益类资产收益率有望获得提升，但投资者需警惕外部环境不确定性及经济增长不及预期可能引发的阶段性市场波动，结构性行情或将成为市场常态特征。

自 2024 年 9 月以来，随着一系列稳增长政策组合拳的落地实施，市场情绪显著回暖，投资赚钱效应显现，资金交投活跃度明显提升。其中，小盘股、成长股展现出更强的市场弹性，以国证 2000 为代表的小盘股指数的投资价值突显。本基金将继续严格遵循基金合同约定，在有效控制风险的前提下，力争为投资者创造持续、稳定的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

1、持续提升合规管理

公司以党的二十届三中全会精神、新“国九条”及证监会配套政策等国家重要政策方针为指导，大力深化合规管理体系建设，在合规管理工作中贯彻落实政策精神及各项法规要求，坚守合规底线、防范合规风险。公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的价值观，通过完善合规管理体系、提升合规专业能力、优化合规资源配置等举措，不断提升合规管理工作的有效性。公司强化合规制度建设，同时深入审慎开展合规审查、合规咨询、合规检查、合规监测等日常工作；高度重视并持续开展员工执业操守和职业道德建设，广泛开展合规培训，强化全员合规意识及合规敏感度；加强监督督促职能，规范人员执业行为，强化一线合规执行效果；高度重视合规管理专业能力建设，保障合规资源配置、优化合规工作机制，不断提升公司合规管理水平。

2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

3、持续加强稽核工作

公司持续完善稽核管理机制，促进稽核工作高质量发展；通过开展多种类型多项目稽核检查工作，对公司内部控制的合规与风险管理情况，以及人员履职情况进行检查、评价、报告与监督；通过协助监管机构开展各项自查、核查工作，协调第三方独立机构开展审计、鉴证工作，进一步评估公司内控管理有效性；通过督促并跟踪检查风险隐患整改，持续优化公司内部控制管理，切实维护基金份额持有人利益，促进公司持续、稳定、健康发展。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不

选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；同一类别内每一基金份额享有同等分配权。

本基金本报告期内未进行收益分配。

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

无。

§ 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关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

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告的基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明(2025)审字第 70015647_B300 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人

审计意见	我们审计了汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度和 2023 年 11 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日和 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度和 2023 年 11 月 7 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净值变动情况。
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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估汇添富国证 2000 指数增强型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大

	的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对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，就可能导致对汇添富国证 2000 指数增强型证券投资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汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与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。	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	陈露	韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层	
审计报告日期	2025 年 03 月 31 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			

货币资金	7.4.7.1	11,228,930.99	20,078,764.48
结算备付金		625,311.39	24,583.65
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	155,877,842.23	304,894,496.54
其中：股票投资		155,877,842.23	304,894,496.54
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,435,528.20	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		170,167,612.81	324,997,844.67
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,862,384.66	-
应付管理人报酬		110,151.11	219,598.36
应付托管费		13,768.90	27,449.82
应付销售服务费		23,738.89	53,908.30
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	7.4.7.7	165,000.00	70,000.00
负债合计		3,175,043.56	370,956.48
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	149,013,236.33	321,298,040.86
未分配利润	7.4.7.9	17,979,332.92	3,328,847.33

净资产合计		166,992,569.25	324,626,888.19
负债和净资产总计		170,167,612.81	324,997,844.67

注：1、报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 149,013,236.33 份。本基金下属汇添富国证 2000 指数增强 A 基金份额净值 1.1227 元，基金份额总额 89,366,959.03 份；本基金下属汇添富国证 2000 指数增强 C 基金份额净值 1.1175 元，基金份额总额 59,646,277.30 份。

2、本基金合同于 2023 年 11 月 07 日生效，上年度实际报告期间为 2023 年 11 月 07 日至 2023 年 12 月 31 日，特此说明。

7.2 利润表

会计主体：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日 至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日 (基金合同生效 日)至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-6,100,852.28	3,924,549.43
1. 利息收入		76,408.53	73,836.71
其中：存款利息收入	7.4.7.10	76,408.53	73,836.71
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-5,977,203.15	7,951,755.86
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-8,020,096.70	7,886,286.50
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-480,366.67	-
股利收益	7.4.7.17	2,523,260.22	65,469.36
以摊余成本计量的金融 资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以 “-”号填列）	7.4.7.18	-486,284.53	-4,101,043.14
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	286,226.87	-
减：二、营业总支出		2,180,921.90	595,702.10

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	1,471,245.76	383,583.72
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	7.4.10.2.2	183,905.72	47,947.95
3. 销售服务费		359,452.03	94,170.43
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		104.29	-
8. 其他费用	7.4.7.21	166,214.10	70,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,281,774.18	3,328,847.33
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,281,774.18	3,328,847.33
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,281,774.18	3,328,847.33

7.3 净资产变动表

会计主体：汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	321,298,040.86	3,328,847.33	324,626,888.19
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	321,298,040.86	3,328,847.33	324,626,888.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-172,284,804.53	14,650,485.59	-157,634,318.94
（一）、综合收益总额	-	-8,281,774.18	-8,281,774.18
（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）	-172,284,804.53	22,932,259.77	-149,352,544.76

其中：1. 基金申购款	467,257,062.81	-6,225,286.04	461,031,776.77
2. 基金赎回款	-639,541,867.34	29,157,545.81	-610,384,321.53
（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	149,013,236.33	17,979,332.92	166,992,569.25
项目	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	321,298,040.86	-	321,298,040.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	3,328,847.33	3,328,847.33
（一）、综合收益总额	-	3,328,847.33	3,328,847.33
（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）	-	-	-
其中：1. 基金申购款	-	-	-
2. 基金赎回款	-	-	-
（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	321,298,040.86	3,328,847.33	324,626,888.19

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2023]1873 号《关于准予汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。本基金募集期间为 2023 年 10 月 23 日至 2023 年 11 月 3 日，设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币 321,242,374.27 元，在募集期间产生的利息为人民币 55,666.59 元，以上实收基金（本息）合计为人民币 321,298,040.86 元，折合 321,298,040.86 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2023）验字第 70015647_B04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，基金合同于 2023 年 11 月 7 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构均为汇添富基金管理股份有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金

在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加,如果信用风险自初始确认后未显著增加,处于第一阶段,本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的,处于第二阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照账面余额和实际利率计算利息收入;如果初始确认后发生信用减值的,处于第三阶段,本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备,并按照摊余成本和实际利率计算利息收入;

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础,通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险,以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况;

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括:通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值,以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息;

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时,该金融资产成为已发生信用减值的金融资产;

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时,本基金直接减记该金融资产的账面余额;

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止,或该收取金融资产现金流量的权利已转移,且符合金融资产转移的终止确认条件的,金融资产将终止确认;

本基金已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的,终止确认该金融资产;保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的,不终止确认该金融资产;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的,分别下列情况处理:放弃了对该金融资产控制的,终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债;未放弃对该金融资产控制的,按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产,并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债(含交易性金融负债和衍生金融负债),按照公允价值进行后续计量,所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债,采用实际利率法,按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满,则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

1、在符合有关基金分红条件的前提下，本基金可进行基金收益分配，若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

2、本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别的基金份额进行再投资，基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

3、基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；

4、同一类别内每一基金份额享有同等分配权；

5、法律法规或监管机构另有规定的，从其规定。

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

本基金本报告期无会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰调整为 1‰；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金

的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。

4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从

公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	556,357.57	3,108,350.20
等于：本金	554,196.34	3,106,879.79
加：应计利息	2,161.23	1,470.41
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
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	10,672,573.42	16,970,414.28
等于：本金	10,672,077.02	16,968,374.94
加：应计利息	496.40	2,039.34
减：坏账准备	-	-
合计	11,228,930.99	20,078,764.48

注：其他存款余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		160,465,169.90	-	155,877,842.23	-4,587,327.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		160,465,169.90	-	155,877,842.23	-4,587,327.67

项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		308,995,539.68	-	304,894,496.54	-4,101,043.14
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		308,995,539.68	-	304,894,496.54	-4,101,043.14

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均无衍生金融资产/负债余额。

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

注：本基金本报告期末及上年度末均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

注：本基金本报告期末及上年度末均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金无债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金不存在债权投资减值准备计提情况。

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末均无其他资产余额。

7.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-

应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	45,000.00	-
应付信息披露费	120,000.00	70,000.00
应付指数使用费	-	-
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
应付或有管理费	-	-
其他	-	-
合计	165,000.00	70,000.00

7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

汇添富国证 2000 指数增强 A		
项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,516,463.32	163,516,463.32
本期申购	279,152,441.27	279,152,441.27
本期赎回（以“-”号填列）	-353,301,945.56	-353,301,945.56
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	89,366,959.03	89,366,959.03
汇添富国证 2000 指数增强 C		
项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	157,781,577.54	157,781,577.54
本期申购	188,104,621.54	188,104,621.54
本期赎回（以“-”号填列）	-286,239,921.78	-286,239,921.78

基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	59,646,277.30	59,646,277.30

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

汇添富国证 2000 指数增强 A			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,829,510.04	-2,087,374.40	1,742,135.64
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	3,829,510.04	-2,087,374.40	1,742,135.64
本期利润	-908,950.89	-1,718,625.33	-2,627,576.22
本期基金份额交易产生的变动数	9,201,779.33	2,653,366.33	11,855,145.66
其中：基金申购款	-8,951,599.96	9,417,233.48	465,633.52
基金赎回款	18,153,379.29	-6,763,867.15	11,389,512.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,122,338.48	-1,152,633.40	10,969,705.08
汇添富国证 2000 指数增强 C			
项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,600,380.43	-2,013,668.74	1,586,711.69
加：会计政策变更	-	-	-
本期期初	3,600,380.43	-2,013,668.74	1,586,711.69
本期利润	-6,886,538.76	1,232,340.80	-5,654,197.96
本期基金份额交易产生的变动数	11,061,100.19	16,013.92	11,077,114.11
其中：基金申购款	-9,431,812.44	2,740,892.88	-6,690,919.56
基金赎回款	20,492,912.63	-2,724,878.96	17,768,033.67

本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,774,941.86	-765,314.02	7,009,627.84

7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	43,434.99	37,054.96
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	28,639.94	14,198.10
结算备付金利息收入	3,731.73	22,583.65
其他	601.87	-
合计	76,408.53	73,836.71

注：“其他”包含直销申购款利息收入和结算保证金利息收入。

7.4.7.11 股票投资收益

7.4.7.11.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合 同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	1,306,105,883.18	201,385,577.89
减：卖出股票成本总额	1,312,489,269.14	193,044,353.76
减：交易费用	1,636,710.74	454,937.63
买卖股票差价收入	-8,020,096.70	7,886,286.50

7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖债券差价收入。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-480,366.67	-
外汇远期投资收益	-	-
国债期货投资收益	-	-
外汇期货投资收益	-	-

7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金 合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	2,523,260.22	65,469.36
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	2,523,260.22	65,469.36

7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-486,284.53	-4,101,043.14
——股票投资	-486,284.53	-4,101,043.14
——债券投资	-	-

——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
——期货投资	-	-
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	-486,284.53	-4,101,043.14

7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	286,226.87	-
替代损益	-	-
其他	-	-
合计	286,226.87	-

7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无信用减值损失。

7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	45,000.00	-
信息披露费	120,000.00	70,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	-	-
持有人大会- 公证费	-	-

持有人大会- 律师费	-	-
开户费	1,200.00	-
上市费	-	-
或有管理费	-	-
其他	14.10	-
合计	166,214.10	70,000.00

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，本基金无需要披露的重大或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构, 基金注册登记机构
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	基金托管人, 基金代销机构
东方证券股份有限公司（“东方证券”）	基金管理人的股东, 基金代销机构
上海上投资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（美国）控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（香港）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理（新加坡）有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员

注：1、以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、根据《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》《基金管理公司子公司管理规定》等法律法规的有关规定，经中国证券监督管理委员会同意，汇添富基金管理股份有限公司（以下简称“本公司”）已受让汇添富资本管理有限公司持有的汇添富投资管理有限公司（以下简称“汇添富投资”）全部股权。汇添富投资已由本公司的“全资子公司的全资子公司”变

更为“全资子公司”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）
招商证券	2,276,205,867.15	92.15	676,547,699.90	96.22

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例（%）
招商证券	762,742.63	92.43	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）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（%）
招商证券	297,499.25	96.23	-	-

注：1. 上述佣金按协议约定的佣金率计算，佣金率由协议签订方参考市场价格确定。截至 2024 年 6 月 30 日止，该类佣金协议的服务范围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。

2. 根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	1,471,245.76	383,583.72
其中：应支付销售机构的客户维护费	411,865.74	42,241.42
应支付基金管理人的净管理费	1,059,380.02	341,342.30

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.80%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.80\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

对于基金中基金、ETF 联接基金等特殊类型的基金产品，由于本基金管理人对基金财产中持有的本基金管理人自身管理的基金部分或基金财产中投资于目标 ETF 的部分不收取管理费，但客户维护费的收取标准并不调减，可能出现净管理费为负值的情况。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基 金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	183,905.72	47,947.95

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C	合计
东方证券股份有限公司	-	385.41	385.41
汇添富基金管理股份有限公司	-	30,337.79	30,337.79
招商证券股份有限公司	-	279,202.63	279,202.63
合计	-	309,925.83	309,925.83
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C	合计
汇添富基金管理股份有限公司	-	23.95	23.95
招商证券股份有限公司	-	87,060.27	87,060.27

合计	-	87,084.22	87,084.22
----	---	-----------	-----------

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。
计算方法如下：

$$H = E \times 0.40\% \div \text{当年天数}$$

H 为 C 类基金份额每日应计提的销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日基金资产净值

销售服务费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，自动在次月初五个工作日内、按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 5 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 5 个工作日内支付。

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

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

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

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

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

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

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

注：本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

汇添富国证 2000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
招商证券股份有限公司	-	-	6,999,000.00	4.28
汇添富国证 2000 指数增强 C				
关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例（%）
	-	-	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 11 月 07 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券	9,430,439.13	24,796.07	15,855,764.81	12,282.11

注：基金托管人受托作为本基金的证券经纪商。上述款项为本基金存放于基金托管人基金专用证券账户中的证券交易结算资金，按协议约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未在承销期内直接购入关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末未进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

注：本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：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

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

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同责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市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管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

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

利率风险是指基金的财务状况和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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年 以上	不计息	合计
资产							
货币 资金	11,228,930.99	-	-	-	-	-	11,228,930.99
结算 备付 金	625,311.39	-	-	-	-	-	625,311.39
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	155,877,842.23	155,877,842.23
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-
应收 股利	-	-	-	-	-	-	-
应收 申购 款	-	-	-	-	-	2,435,528.20	2,435,528.20
递延 所得 税资	-	-	-	-	-	-	-

产							
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	11,854,242.38	-	-	-	-	158,313,370.43	170,167,612.81
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,862,384.66	2,862,384.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	110,151.11	110,151.11
应付托管费	-	-	-	-	-	13,768.90	13,768.90
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,738.89	23,738.89
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	-	-	-	-	-	165,000.00	165,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	3,175,043.56	3,175,043.56
利率 敏感 度缺 口	11,854,242.38	-	-	-	-	155,138,326.87	166,992,569.25
上年 度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月- 1 年	1-5 年	5 年以 上	不计息	合计
资产							
货币 资金	20,078,764.48	-	-	-	-	-	20,078,764.48
结算 备付 金	24,583.65	-	-	-	-	-	24,583.65
存出 保证 金	-	-	-	-	-	-	-
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	304,894,496.54	304,894,496.54
衍生 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
买入 返售 金融 资产	-	-	-	-	-	-	-
债权 投资	-	-	-	-	-	-	-
应收 清算 款	-	-	-	-	-	-	-

应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	20,103,348.13	-	-	-	-	304,894,496.54	324,997,844.67
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	219,598.36	219,598.36
应付托管费	-	-	-	-	-	27,449.82	27,449.82
应付销售服务	-	-	-	-	-	53,908.30	53,908.30

费							
应付 投资 顾问 费	-	-	-	-	-	-	-
应交 税费	-	-	-	-	-	-	-
应付 利润	-	-	-	-	-	-	-
递延 所得 税负 债	-	-	-	-	-	-	-
其他 负债	-	-	-	-	-	70,000.00	70,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	370,956.48	370,956.48
利率 敏感 度缺 口	20,103,348.13	-	-	-	-	304,523,540.06	324,626,888.19

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	155,877,842.23	93.34	304,894,496.54	93.92
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	—	—
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	155,877,842.23	93.34	304,894,496.54	93.92

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变； 2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	国证 2000 指数上涨 5%	7,862,145.75	12,983,412.79
	国证 2000 指数下跌 5%	-7,862,145.75	-12,983,412.79

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	155,877,842.23	304,894,496.54
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	155,877,842.23	304,894,496.54

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.3.2 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

注：本基金本报告期末以及上年度末均不存在第三层次公允价值余额。

7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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，除本报告“4 管理人报告-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”章节中所列示情况外，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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	155,877,842.23	91.60
	其中：股票	155,877,842.23	91.60
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	11,854,242.38	6.97
8	其他各项资产	2,435,528.20	1.43
9	合计	170,167,612.81	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资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	1,208,240.00	0.72
B	采矿业	1,148,770.00	0.69
C	制造业	87,971,540.64	52.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,486,055.00	2.69
E	建筑业	3,110,089.00	1.86
F	批发和零售业	2,832,940.00	1.70
G	交通运输、仓储和邮政业	3,996,002.00	2.39
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	12,820,707.00	7.68
J	金融业	2,080,264.00	1.25
K	房地产业	2,774,486.00	1.66
L	租赁和商务服务业	1,419,575.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	1,849,134.00	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	1,815,790.00	1.09
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—

Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,879,687.00	1.13
S	综合	-	-
	合计	129,393,279.64	77.48

8.2.2 报告期末积极投资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	173,211.00	0.10
B	采矿业	438,867.00	0.26
C	制造业	19,955,226.59	11.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,076,655.00	0.64
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	903,398.00	0.54
G	交通运输、仓储和邮政业	106,929.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	334,853.00	0.20
J	金融业	2,125,254.00	1.27
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	463,295.00	0.28
M	科学研究和技术服务业	906,874.00	0.54
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	26,484,562.59	15.86

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	300627	华测导航	18,100	756,580.00	0.45
2	002126	银轮股份	40,000	748,800.00	0.45
3	688208	道通科技	17,905	701,159.80	0.42
4	002222	福晶科技	21,500	696,600.00	0.42
5	300035	中科电气	44,200	660,790.00	0.40
6	300674	宇信科技	33,800	659,776.00	0.40
7	600850	电科数字	27,400	654,860.00	0.39
8	300181	佐力药业	42,000	645,120.00	0.39
9	300972	万辰集团	7,900	635,239.00	0.38
10	002139	拓邦股份	46,100	627,421.00	0.38
11	301050	雷电微力	12,100	624,118.00	0.37
12	600864	哈投股份	84,800	623,280.00	0.37
13	300525	博思软件	39,900	621,642.00	0.37
14	601137	博威合金	30,200	613,060.00	0.37
15	600210	紫江企业	92,600	612,086.00	0.37
16	300811	铂科新材	11,300	609,183.00	0.36
17	600664	哈药股份	146,400	604,632.00	0.36
18	002073	软控股份	72,300	597,198.00	0.36
19	300579	数字认证	18,800	590,696.00	0.35
20	300415	伊之密	29,300	587,758.00	0.35
21	000685	中山公用	63,600	587,028.00	0.35
22	002043	兔宝	49,300	585,684.00	0.35

		宝			
23	001309	德明利	6,700	584,240.00	0.35
24	601369	陕鼓动力	67,100	583,770.00	0.35
25	600366	宁波韵升	78,600	578,496.00	0.35
26	300151	昌红科技	34,000	578,000.00	0.35
27	300360	炬华科技	34,400	576,888.00	0.35
28	601616	广电电气	131,400	576,846.00	0.35
29	002020	京新药业	44,800	573,440.00	0.34
30	605507	国邦医药	27,500	572,825.00	0.34
31	300790	宇瞳光学	30,000	572,700.00	0.34
32	300598	诚迈科技	11,800	571,120.00	0.34
33	002226	江南化工	104,300	565,306.00	0.34
34	000928	中钢国际	88,400	563,108.00	0.34
35	300770	新媒股份	13,800	557,658.00	0.33
36	002533	金杯电工	56,600	556,944.00	0.33
37	002550	千红制药	89,800	556,760.00	0.33
38	600496	精工钢构	184,300	556,586.00	0.33
39	603969	银龙股份	82,200	555,672.00	0.33
40	600648	外高桥	46,500	553,815.00	0.33
41	000061	农产品	78,700	551,687.00	0.33
42	000957	中通客车	50,100	551,100.00	0.33
43	002218	拓日新能	138,100	548,257.00	0.33
44	600284	浦东建设	87,400	547,998.00	0.33

45	300326	凯利泰	84,300	547,950.00	0.33
46	002194	武汉凡谷	48,800	547,536.00	0.33
47	600073	光明肉业	78,800	546,872.00	0.33
48	688158	优刻得科技	39,000	545,220.00	0.33
49	600446	金证股份	31,600	544,784.00	0.33
50	300121	阳谷华泰	45,000	544,050.00	0.33
51	603299	苏盐井神	48,700	542,518.00	0.32
52	600035	楚天高速	117,900	542,340.00	0.32
53	000404	长虹华意	73,200	541,680.00	0.32
54	300581	晨曦航空	48,300	541,443.00	0.32
55	002662	京威股份	139,900	541,413.00	0.32
56	002967	广电计量	33,000	541,200.00	0.32
57	300320	海达股份	56,300	540,480.00	0.32
58	600979	广安爱众	116,700	539,154.00	0.32
59	601226	华电科工	79,700	538,772.00	0.32
60	600710	苏美达	57,800	537,540.00	0.32
61	301175	中科环保	99,500	537,300.00	0.32
62	300821	东岳硅材	69,100	536,216.00	0.32
63	300248	新开普	55,300	535,857.00	0.32
64	300341	麦克奥迪	30,600	535,806.00	0.32
65	300455	航天智装	41,300	535,248.00	0.32
66	600874	创业环保	89,600	534,912.00	0.32
67	600643	爱建集团	103,400	534,578.00	0.32

68	002014	永新股份	48,600	532,656.00	0.32
69	300193	佳士科技	59,800	531,622.00	0.32
70	002483	润邦股份	101,500	528,815.00	0.32
71	002093	国脉科技	67,700	528,060.00	0.32
72	600990	四创电子	24,800	527,744.00	0.32
73	002479	富春环保	111,300	527,562.00	0.32
74	601096	宏盛华源铁塔集团	120,700	525,045.00	0.31
75	300241	瑞丰光电	95,600	524,844.00	0.31
76	300545	联得装备	16,700	523,211.00	0.31
77	000601	韶能股份	128,500	521,710.00	0.31
78	002768	国恩股份	22,600	521,382.00	0.31
79	600237	铜峰电子	79,600	521,380.00	0.31
80	600268	国电南自	77,500	520,800.00	0.31
81	600367	红星发展	45,100	520,454.00	0.31
82	600531	豫光金铅	81,000	520,020.00	0.31
83	600218	全柴动力	65,700	519,030.00	0.31
84	603158	腾龙股份	64,100	517,928.00	0.31
85	600345	长江通信	22,400	517,888.00	0.31
86	600758	辽宁能源	150,300	517,032.00	0.31
87	002912	中新赛克	20,200	516,918.00	0.31
88	300533	冰川网络	26,100	515,736.00	0.31
89	002166	莱茵生	69,000	515,430.00	0.31

		物			
90	300758	七彩化学	43,000	515,140.00	0.31
91	300453	三鑫医疗	69,000	514,740.00	0.31
92	002772	众兴菌业	69,800	514,426.00	0.31
93	002970	锐明技术	10,800	514,404.00	0.31
94	600551	时代出版	59,700	514,017.00	0.31
95	000828	东莞控股	48,000	513,120.00	0.31
96	002208	合肥城建	72,100	512,631.00	0.31
97	300523	辰安科技	25,900	512,561.00	0.31
98	002752	昇兴股份	80,700	512,445.00	0.31
99	688209	英集芯科技	29,000	512,430.00	0.31
100	603111	康尼机电	84,900	511,947.00	0.31
101	600162	香江控股	266,500	511,680.00	0.31
101	603098	森特股份	53,300	511,680.00	0.31
103	603530	神马电力	20,700	511,497.00	0.31
104	603995	甬金股份	27,900	510,291.00	0.31
105	601083	锦江航运	53,400	508,368.00	0.30
106	300659	中孚信息	31,400	508,366.00	0.30
107	002688	金河生物	113,600	507,792.00	0.30
108	002284	亚太股份	65,600	507,744.00	0.30
109	601811	新华文轩	32,000	507,200.00	0.30
110	603109	神驰机电	28,540	506,585.00	0.30

111	002380	科远智慧	27,400	506,352.00	0.30
112	002546	新联电子	116,900	506,177.00	0.30
113	603527	众源新材	52,700	505,393.00	0.30
114	688588	凌志软件	36,600	505,080.00	0.30
115	603987	康德莱	70,300	504,754.00	0.30
116	002852	道道全	61,000	503,860.00	0.30
117	002782	可立克	39,800	503,470.00	0.30
118	300447	全信股份	35,500	503,035.00	0.30
119	688252	天德钰科技	21,000	502,950.00	0.30
120	002666	德联集团	115,300	502,708.00	0.30
121	000551	创元科技	42,000	502,320.00	0.30
122	688336	三生国健	23,400	501,228.00	0.30
123	002578	闽发铝业	167,400	500,526.00	0.30
124	688371	菲沃泰纳米科技	32,238	500,333.76	0.30
125	603058	永吉股份	56,700	500,094.00	0.30
126	001359	平安电工	19,300	500,063.00	0.30
127	300402	宝色股份	33,900	500,025.00	0.30
128	000045	深纺织 A	47,000	499,610.00	0.30
129	300648	星云股份	21,700	499,100.00	0.30
130	688233	神工半导体	21,241	498,101.45	0.30
131	300656	民德电子	20,000	497,600.00	0.30
132	301439	泓淋电力	36,100	496,375.00	0.30
133	300733	西菱动	42,500	495,975.00	0.30

		力			
134	002160	常铝股份	132,800	494,016.00	0.30
135	601116	三江购物	45,400	493,952.00	0.30
136	603309	维力医疗	41,200	493,576.00	0.30
137	301099	雅创电子	11,900	493,255.00	0.30
138	688680	海优新材	14,600	493,188.00	0.30
139	603055	台华新材	44,500	493,060.00	0.30
140	003013	地铁设计	32,600	492,912.00	0.30
141	000920	沃顿科技	55,200	492,384.00	0.29
142	688128	中国电器研究院	23,326	490,079.26	0.29
143	688152	麒麟信安	9,400	489,176.00	0.29
144	300978	东箭科技	44,900	488,961.00	0.29
145	600480	凌云股份	45,200	488,612.00	0.29
146	600640	国脉文化	40,800	487,152.00	0.29
147	002907	华森制药	37,400	486,200.00	0.29
148	301389	隆扬电子	29,000	484,880.00	0.29
149	603230	内蒙新华	38,300	484,878.00	0.29
150	603075	热威科技股份	26,000	484,380.00	0.29
151	000517	荣安地产	217,200	484,356.00	0.29
152	002724	海洋王	90,900	483,588.00	0.29
153	600783	鲁信创投	38,100	482,727.00	0.29
154	301262	海看股份	19,400	482,478.00	0.29

155	301377	鼎泰高科	22,700	480,105.00	0.29
156	002895	川恒股份	19,400	477,240.00	0.29
157	605286	同力日升	15,800	476,528.00	0.29
158	300191	潜能恒信	37,100	474,880.00	0.28
159	603680	今创集团	57,000	473,100.00	0.28
160	603618	杭电股份	87,100	472,953.00	0.28
161	301180	万祥科技	30,500	471,835.00	0.28
162	300926	博俊科技	21,400	471,014.00	0.28
163	600320	振华重工	119,900	470,008.00	0.28
164	600468	百利电气	99,700	468,590.00	0.28
165	600744	华银电力	150,000	466,500.00	0.28
166	300307	慈星股份	56,500	465,560.00	0.28
167	000848	承德露露	51,700	463,749.00	0.28
168	300259	新天科技	132,300	463,050.00	0.28
169	000541	佛山照明	74,300	460,660.00	0.28
170	300881	盛德鑫泰	14,900	458,026.00	0.27
171	002818	富森美	30,400	454,176.00	0.27
172	300745	欣锐科技	28,500	453,720.00	0.27
173	300272	开能健康	73,600	452,640.00	0.27
174	601619	嘉泽新能	136,100	451,852.00	0.27
175	002980	华盛昌	17,600	451,440.00	0.27
176	601678	滨化股份	119,800	450,448.00	0.27
177	300187	永清环	88,600	447,430.00	0.27

		保			
178	603167	渤海轮渡	50,400	445,536.00	0.27
179	002635	安洁科技	27,900	444,168.00	0.27
180	002923	润都股份	46,400	442,656.00	0.27
181	600053	九鼎投资	31,700	439,679.00	0.26
182	600575	淮河能源	110,500	438,685.00	0.26
183	601200	上海环境	53,100	433,827.00	0.26
184	600866	星湖科技	67,000	433,490.00	0.26
185	002406	远东传动	66,900	431,505.00	0.26
186	301393	昊帆生物	10,800	431,028.00	0.26
187	603386	骏亚科技	38,300	425,896.00	0.26
188	002275	桂林三金	28,200	425,538.00	0.25
189	300772	运达股份	32,000	423,680.00	0.25
190	000417	合百集团	65,200	415,976.00	0.25
191	000090	天健集团	101,000	415,110.00	0.25
192	301488	豪恩汽电	7,500	414,675.00	0.25
193	301217	铜冠铜箔	37,400	414,392.00	0.25
194	600662	外服控股	81,600	413,712.00	0.25
195	002536	飞龙股份	35,700	413,406.00	0.25
196	600458	时代新材	31,700	406,077.00	0.24
197	600649	城投控股	91,000	404,950.00	0.24
198	002328	新朋股份	66,000	404,580.00	0.24

199	603162	海通发展	43,700	402,040.00	0.24
200	300618	寒锐钴业	11,900	401,863.00	0.24
201	000885	城发环境	30,300	397,233.00	0.24
202	301120	新特电气	40,000	396,400.00	0.24
203	688321	微芯生物	21,139	392,762.62	0.24
204	002367	康力电梯	57,000	391,590.00	0.23
205	002437	誉衡药业	156,800	390,432.00	0.23
206	002023	海特高新	38,100	386,715.00	0.23
207	603328	依顿电子	39,200	386,512.00	0.23
208	688123	聚辰半导体	6,601	386,290.52	0.23
209	002454	松芝股份	57,700	383,705.00	0.23
210	002376	新北洋	58,800	383,376.00	0.23
211	600798	宁波海运	126,300	382,689.00	0.23
212	002274	华昌化工	49,100	381,507.00	0.23
213	600846	同济科技	44,200	381,004.00	0.23
214	603013	亚普股份	25,400	380,492.00	0.23
215	600787	中储股份	59,500	379,610.00	0.23
216	000897	津滨发展	158,900	376,593.00	0.23
217	002838	道恩股份	31,800	375,558.00	0.22
218	002378	章源钨业	57,800	373,966.00	0.22
219	600229	城市传媒	53,600	373,592.00	0.22
220	603538	美诺华	29,300	372,403.00	0.22
221	002174	游族网	39,700	371,195.00	0.22

		络			
222	002111	威海广泰	33,500	369,170.00	0.22
223	600691	阳煤化工	165,900	368,298.00	0.22
224	002626	金达威	23,800	359,380.00	0.22
225	002401	中远海科	22,300	354,124.00	0.21
226	002057	中钢天源	48,900	353,058.00	0.21
227	002977	火箭科技	12,900	351,009.00	0.21
228	000523	红棉股份	115,000	350,750.00	0.21
229	688553	汇宇制药	23,063	350,557.60	0.21
230	601518	吉林高速	125,900	350,002.00	0.21
231	000597	东北制药	65,700	346,239.00	0.21
232	600488	津药药业	81,400	345,136.00	0.21
233	601368	绿城水务	72,200	343,672.00	0.21
234	301031	中熔电气	3,300	343,266.00	0.21
235	600523	贵航股份	28,700	342,104.00	0.20
236	600526	菲达环保	76,000	341,240.00	0.20
237	300236	上海新阳	9,100	340,067.00	0.20
238	000950	重药控股	62,900	338,402.00	0.20
239	601068	中铝国际	76,500	337,365.00	0.20
240	300172	中电环保	66,500	335,825.00	0.20
241	002783	凯龙股份	41,100	334,965.00	0.20
242	300951	博硕科技	11,100	331,557.00	0.20
243	600810	神马股	40,700	329,263.00	0.20

		份			
244	688519	南亚新材料	15,258	324,385.08	0.19
245	002287	奇正藏药	15,000	321,000.00	0.19
246	300946	恒而达	11,800	320,488.00	0.19
247	603983	丸美生物	9,800	316,148.00	0.19
248	002125	湘潭电化	31,000	312,480.00	0.19
249	605319	无锡振华	14,700	309,435.00	0.19
250	300322	硕贝德	23,600	309,396.00	0.19
251	603929	亚翔集成	10,800	299,484.00	0.18
252	603067	振华股份	22,900	289,227.00	0.17
253	300293	蓝英装备	12,600	286,272.00	0.17
254	301297	富乐德	6,500	276,250.00	0.17
255	002655	共达电声	21,600	274,968.00	0.16
256	688306	均普智能制造	35,200	272,800.00	0.16
257	002438	江苏神通	22,100	269,620.00	0.16
258	300587	天铁股份	60,000	263,400.00	0.16
259	300119	瑞普生物	14,000	257,180.00	0.15
260	002428	云南锗业	13,500	255,150.00	0.15
261	000707	双环科技	33,500	247,230.00	0.15
262	600602	云赛智联	15,200	240,464.00	0.14
263	002801	微光股份	9,800	239,708.00	0.14
264	300698	万马科技	6,900	237,774.00	0.14
265	300737	科顺股份	45,800	232,206.00	0.14
266	603325	博隆技	2,900	229,419.00	0.14

		术			
267	603222	济民健康	31,100	211,169.00	0.13
268	000631	顺发恒业	69,300	203,742.00	0.12
269	603367	辰欣药业	14,700	201,978.00	0.12
270	002261	拓维信息	11,000	201,410.00	0.12
271	603387	基蛋生物	24,000	198,000.00	0.12
272	300696	爱乐达	12,500	194,125.00	0.12
273	000862	银星能源	36,000	177,840.00	0.11
274	600746	江苏索普	25,300	177,353.00	0.11
275	603119	浙江荣泰股份	7,700	172,403.00	0.10
276	002003	伟星股份	11,400	161,538.00	0.10
277	000029	深深房 A	10,700	161,142.00	0.10
278	301087	可孚医疗	4,400	155,584.00	0.09
279	002649	博彦科技	12,000	145,440.00	0.09
280	300439	美康生物	13,500	141,075.00	0.08
281	688579	山大地纬软件	14,200	130,498.00	0.08
282	600094	大名城	32,800	119,392.00	0.07
283	605118	力鼎光电	6,600	117,546.00	0.07
284	000603	盛达资源	9,200	110,308.00	0.07
285	300485	赛升药业	14,900	104,449.00	0.06
286	000913	钱江摩托	4,800	86,448.00	0.05
287	002412	汉森制药	12,600	75,726.00	0.05
288	688609	广东九联科技	6,600	69,960.00	0.04

289	000534	万泽股份	5,100	65,637.00	0.04
290	002393	力生制药	3,400	59,976.00	0.04
291	603477	巨星农牧	3,300	58,575.00	0.04
292	002953	日丰股份	5,700	57,342.00	0.03
293	002140	东华科技	5,500	54,340.00	0.03
294	300620	光库科技	1,000	48,600.00	0.03
295	000968	蓝焰控股	7,000	46,550.00	0.03
296	600285	羚锐制药	1,900	42,104.00	0.03
297	600351	亚宝药业	6,900	42,021.00	0.03
298	000973	佛塑科技	6,700	39,798.00	0.02
299	300809	华辰装备	1,100	34,848.00	0.02
300	600020	中原高速	7,100	29,962.00	0.02
301	301559	中集环科	1,800	27,630.00	0.02
302	000409	云鼎科技	3,000	26,730.00	0.02
303	002880	卫光生物	600	16,206.00	0.01
304	688523	航天环宇科技	800	16,000.00	0.01
305	603076	乐惠国际	400	9,216.00	0.01
306	002545	东方铁塔	1,100	7,733.00	0.00
307	603100	川仪股份	200	4,310.00	0.00
308	600428	中远海特	500	3,650.00	0.00
309	688733	壹石通	37	699.30	0.00
310	688443	智翔金泰	25	627.25	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产 净值比例 （%）
1	600830	香溢融通	43,200	505,008.00	0.30
2	002931	锋龙股份	30,800	500,808.00	0.30
3	002837	英维克	11,800	476,720.00	0.29
4	300540	蜀道装备	19,200	470,784.00	0.28
5	301077	星华新材	17,600	470,448.00	0.28
6	000966	长源电力	98,500	467,875.00	0.28
7	300956	英力股份	20,700	467,820.00	0.28
8	605056	咸亨国际	37,400	467,126.00	0.28
9	300865	大宏立	20,000	466,800.00	0.28
10	002825	纳尔股份	59,600	466,072.00	0.28
11	603373	安邦护卫集团股份	15,500	463,295.00	0.28
12	603577	汇金通	57,900	462,621.00	0.28
13	002916	深南电路	3,700	462,500.00	0.28
14	600707	彩虹股份	56,200	461,964.00	0.28
15	300822	贝仕达克	22,300	460,495.00	0.28
16	603038	华立股份	28,100	459,435.00	0.28
17	300743	天地数码	30,100	458,423.00	0.27
18	300666	江丰电子	6,600	458,370.00	0.27
19	301020	密封科技	24,400	457,500.00	0.27

20	000686	东北证 券	57,600	457,344.00	0.27
21	300564	筑博设 计	37,000	457,320.00	0.27
22	002273	水晶光 电	20,500	455,510.00	0.27
23	300777	中简科 技	16,100	455,469.00	0.27
24	002500	山西证 券	72,100	452,788.00	0.27
25	600319	亚星化 学	94,200	452,160.00	0.27
26	300346	南大光 电	11,700	451,503.00	0.27
27	300771	智莱科 技	42,900	451,308.00	0.27
28	300746	汉嘉设 计	39,400	449,554.00	0.27
29	301379	天山电 子	22,200	448,440.00	0.27
30	603595	东尼电 子	26,200	447,758.00	0.27
31	600168	武汉控 股	100,700	446,101.00	0.27
32	002155	湖南黄 金	27,900	438,867.00	0.26
33	688079	美迪凯 股份	50,400	436,464.00	0.26
34	600386	北巴传 媒	97,600	436,272.00	0.26
35	600521	华海药 业	24,200	432,454.00	0.26
36	300502	新易盛	3,700	427,646.00	0.26
37	600067	冠城新 材	161,000	426,650.00	0.26
38	301022	海泰科	21,000	426,300.00	0.26
39	300394	天孚通 信	4,600	420,256.00	0.25
40	002427	尤夫股 份	118,400	412,032.00	0.25
41	600282	南钢股 份	83,800	393,022.00	0.24
42	601002	晋亿实	86,800	377,580.00	0.23

		业			
43	000729	燕京啤酒	31,000	373,240.00	0.22
44	600731	湖南海利	65,400	372,780.00	0.22
45	603380	易德龙	14,000	349,860.00	0.21
46	600444	国机通用	22,800	346,788.00	0.21
47	600155	华创云信	46,700	345,580.00	0.21
48	600592	龙溪股份	33,100	327,028.00	0.20
49	601231	环旭电子	19,500	321,750.00	0.19
50	603676	卫信康	32,300	321,385.00	0.19
51	000887	中鼎股份	24,300	318,816.00	0.19
52	002282	博深股份	36,300	268,983.00	0.16
53	603697	有友食品	26,000	264,680.00	0.16
54	300010	豆神教育	42,500	263,925.00	0.16
55	300308	中际旭创	2,100	259,371.00	0.16
56	300804	广康生化	10,300	232,368.00	0.14
57	300207	欣旺达	10,300	229,793.00	0.14
58	301503	智迪科技	6,100	209,352.00	0.13
59	301107	瑜欣电子	7,800	199,758.00	0.12
60	603011	合锻智能	28,900	197,965.00	0.12
61	000510	新金路	51,700	186,120.00	0.11
62	000776	广发证券	11,400	184,794.00	0.11
63	000728	国元证券	21,500	179,740.00	0.11
64	600969	郴电国际	25,300	162,679.00	0.10
65	000955	欣龙控股	37,400	154,836.00	0.09

66	000623	吉林敖东	8,900	153,703.00	0.09
67	600960	渤海汽车	43,000	143,190.00	0.09
68	688247	宣泰医药	13,200	132,792.00	0.08
69	603967	中创物流	10,900	106,929.00	0.06
70	301282	金禄电子	5,100	106,845.00	0.06
71	688516	奥特维科技	2,400	103,944.00	0.06
72	000528	柳工	8,200	98,892.00	0.06
73	002982	湘佳股份	5,500	98,175.00	0.06
74	002472	双环传动	2,700	82,674.00	0.05
75	688597	煜邦电力	7,723	75,144.79	0.04
76	600097	开创国际	7,400	75,036.00	0.04
77	603811	诚意药业	9,600	74,112.00	0.04
78	603893	瑞芯微	600	66,036.00	0.04
79	300277	海联讯	5,400	60,858.00	0.04
80	301225	恒勃股份	1,500	39,810.00	0.02
81	605259	绿田机械	1,800	27,270.00	0.02
82	000158	常山北明	500	10,070.00	0.01
83	301016	雷尔伟	30	628.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300857	协创数据	3,526,365.00	1.09
2	600551	时代出版	2,817,400.00	0.87

3	603595	东尼电子	2,807,058.00	0.86
4	600828	茂业商业	2,668,011.00	0.82
5	603109	神驰机电	2,559,476.80	0.79
6	601137	博威合金	2,448,704.00	0.75
7	002073	软控股份	2,412,644.60	0.74
8	300280	紫天科技	2,375,289.00	0.73
9	002912	中新赛克	2,331,790.00	0.72
10	300547	川环科技	2,296,207.00	0.71
11	300727	润禾材料	2,273,689.00	0.70
12	688519	南亚新材料	2,224,843.66	0.69
13	002437	誉衡药业	2,219,952.00	0.68
14	300709	精研科技	2,216,972.00	0.68
15	688152	麒麟信安	2,212,661.24	0.68
16	600577	精达股份	2,198,151.00	0.68
17	605286	同力日升	2,170,141.00	0.67
18	300105	龙源技术	2,160,623.00	0.67
19	600643	爱建集团	2,160,178.00	0.67
20	300552	万集科技	2,153,552.00	0.66

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，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	300709	精研科技	3,944,752.65	1.22
2	600819	耀皮玻璃	3,743,364.00	1.15
3	601137	博威合金	3,676,070.00	1.13
4	300857	协创数据	3,656,542.00	1.13
5	603920	世运电路	3,578,775.00	1.10
6	300739	明阳电路	2,875,558.60	0.89
7	600828	茂业商业	2,818,555.00	0.87
8	603283	赛腾股份	2,741,985.00	0.84
9	600577	精达股份	2,734,679.00	0.84
10	603897	长城科技	2,730,849.00	0.84
11	002533	金杯电工	2,717,335.00	0.84
12	600979	广安爱众	2,680,840.00	0.83
13	600595	中孚实业	2,614,193.00	0.81
14	000680	山推股份	2,585,866.00	0.80
15	603098	森特股份	2,577,907.00	0.79
16	002187	广百股份	2,571,669.00	0.79
17	000698	沈阳化工	2,532,892.00	0.78

18	300219	鸿利智汇	2,504,188.00	0.77
19	603530	神马电力	2,499,198.01	0.77
20	601101	昊华能源	2,491,873.00	0.77

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，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

买入股票成本（成交）总额	1,163,958,899.36
卖出股票收入（成交）总额	1,306,105,883.18

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

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

注：本基金本报告期末未持有权证投资。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险性特征，运用股指期货对冲系统性风险、对冲特殊情况下的流动性风险，如大额申购赎回等，以降低交易成本和组合风险，提高投资效率。

若相关法律法规发生变化时，基金管理人股指期货投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注：本基金本报告期末未投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

报告期内本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及其派出机构、国家金融监督管理总局（前身为中国银保监会）及其派出机构、中国证监会及其派出机构、国家市场监督管理总局及机关单位、交易所立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,435,528.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,435,528.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

§ 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	持有人	户均持有的	持有人结构
----	-----	-------	-------

级别	户数 (户)	基金份额	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 (%)
汇添 富国 证 2000 指数 增强 A	1,211	73,796.00	27,124,220.95	30.35	62,242,738.08	69.65
汇添 富国 证 2000 指数 增强 C	1,089	54,771.60	27,976,271.94	46.90	31,670,005.36	53.10
合计	2,300	64,788.36	55,100,492.89	36.98	93,912,743.44	63.02

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	汇添富国证 2000 指数增强 A	770,666.01	0.86
	汇添富国证 2000 指数增强 C	0.00	0.00
	合计	770,666.01	0.52

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	汇添富国证 2000 指数增强 A	0
	汇添富国证 2000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开 放式基金	汇添富国证 2000 指数增强 A	10~50
	汇添富国证 2000 指数增强 C	0

	合计	10~50
--	----	-------

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金基金经理期末未兼任私募资产管理计划的投资经理。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	汇添富国证 2000 指数增强 A	汇添富国证 2000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 11 月 07 日) 基金份额总额	163,516,463.32	157,781,577.54
本报告期期初基金份额总额	163,516,463.32	157,781,577.54
本报告期基金总申购份额	279,152,441.27	188,104,621.54
减：本报告期基金总赎回份额	353,301,945.56	286,239,921.78
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	89,366,959.03	59,646,277.30

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

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

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

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去易卫东担任的托管部总经理职务，另有任用。

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘赵斗斗担任托管部总经理。

2024 年 7 月 22 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去牛中强担任的托管部副总经理职务，另有任用。

2024 年 7 月 25 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘蒋伟担任托管部副总经理。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自产品成立日（2023 年 11 月 07 日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付的审计费用为人民币 45,000.00 元。

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

注：本报告期内未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例（%）	佣金	占当期佣金总量的比例（%）	
招商证券	3	2,276,205,867.15	92.15	762,742.63	92.43	
平安证券	3	97,178,362.53	3.93	31,244.21	3.79	

方正 证券	3	96,680,552.86	3.91	31,245.71	3.79	
----------	---	---------------	------	-----------	------	--

注：此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计，不单指股票交易佣金。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交 金额	占当期债 券成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期债 券回购成 交总额的 比例 (%)	成交 金额	占当期权 证成交总 额的比例 (%)	成交 金额	占当期基 金成交总 额的比例 (%)
招商 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注：1、专用交易单元的选择标准和程序：

（1）基金交易单元选择和成交量的分配工作由公司投资研究总部/指数与量化投资部（合称“投资研究部门”）根据法律法规及公司内部规定相应负责组织、协调和监督。投资研究部门选择财务状况良好、经营行为规范、合规风控能力和交易、研究服务能力较强的证券公司，租用其交易单元。

（2）交易单元分配的目标是按照中国证监会的有关规定和对券商交易或研究服务的评价控制交易单元的分配比例。

（3）投资研究部门根据定期评分的结果决定交易单元分配比例。通过一家证券公司进行证券交易的年交易佣金总额的上限，需符合相关法律法规规定的要求。（采用券商交易模式的基金不适用相关法律法规规定的证券交易佣金分配比例上限。）

（4）每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

（5）调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部门决定。

（6）交易单元的选择程序为投资研究部门按上述标准对券商进行评估，根据法律法规及公司内部规定确认选用的券商，与被选中的券商签订相关协议。

2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内未新增或退租交易单元。

3、《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，《汇添富基金管理股份有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》公告首次披露的报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，特此说明。

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	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2024 年 01 月 02 日
2	关于汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换、定期定额投资业务公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 06 日
3	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京增财基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 01 月 17 日
4	汇添富基金管理股份有限公司关于提醒投资者持续完善客户身份信息资料的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 03 日
5	汇添富基金管理股份有限公司关于汇添富投资管理有限公司股东变更的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 16 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 04 月 22 日
7	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 24 日
8	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 05 月 24 日
9	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与北京中期时代基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 06 月 13 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网	2024 年 07 月 19 日

		站	
11	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与中民财富基金销售（上海）有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 15 日
12	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 08 月 30 日
13	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 09 日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2024 年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 10 月 25 日
15	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 15 日
16	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 15 日
17	关于汇添富基金管理股份有限公司终止与乾道基金销售有限公司合作关系的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 11 月 20 日
18	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	上证报, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2024 年 12 月 19 日

§ 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者超过 20%的情况

注：无。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金募集的文件；
- 2、《汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内汇添富国证 2000 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

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，或登录基金管理人网站 www.99fund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2025 年 03 月 31 日