

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
2025 年中期报告
2025 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中信建投证券股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2025 年 08 月 28 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。

依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2025 年 4 月 16 日起至 2025 年 5 月 19 日 17:00 止。本次大会审议了《关于国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续运作的议案》。本次会议议案于 2025 年 5 月 20 日表决通过，自该日起本次持有人大会决议生效。根据本次基金份额持有人大会决议，本基金将根据基金合同现有规定持续运作。具体可查阅本基金管理人于 2025 年 5 月 21 日发布的《国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 06 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	17
7 投资组合报告	34
7.1 期末基金资产组合情况	34
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	36
7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	58
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	60
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	60
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	60
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	60
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.11 投资组合报告附注	60
8 基金份额持有人信息	61

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末上市基金前十名持有人	62
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	62
9 开放式基金份额变动	62
10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	63
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
11 影响投资者决策的其他重要信息	66
12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	66
12.3 查阅方式	66

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证 2000ETF
场内简称	2000ETF
基金主代码	561370
交易代码	561370
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 13 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中信建投证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,356,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023 年 9 月 21 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略：本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应的调整。但因特殊情况（如成份股长期停牌、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量发生变化、成份股公司行为、市场流动性不足、基金规模不足等）导致本基金管理人无法按照标的指数构成及权重进行同步调整时，基金管理人可以采取替代性策略等方式对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。为了更好地实现跟踪标的指数的目的，基金管理人综合考虑标的指数成份股的流动性、投资限制、交易成本等因素，可以采用抽样复制的策略。在正常市场情况下，本基金的风险控制目标是追求日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大；2、存托凭证投资策略；3、债券投资策略；4、可转换债券和可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		国泰基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李昇	朱志明
	联系电话	021-31081600转	4008-888-108
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	service@csc.com.cn
客户服务电话		(021) 31089000, 400-888-8688	95587
传真		021-31081800	010-56162085
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 浦东大道1200号2层225室	北京市朝阳区安立路66号4号 楼
办公地址		上海市虹口区公平路18号8号 楼嘉昱大厦15-20层	北京市朝阳区景辉街16号院1 号楼泰康集团大厦8层/18层，北 京市朝阳区光华路10号中信大 厦82层
邮政编码		200082	100010
法定代表人		周向勇	刘成

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层和本基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	3,214,915.80
本期利润	3,057,332.91
加权平均基金份额本期利润	0.2155
本期加权平均净值利润率	20.30%
本期基金份额净值增长率	16.10%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	1,392,374.75
期末可供分配基金份额利润	0.1666
期末基金资产净值	9,748,374.75
期末基金份额净值	1.1666
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2025 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	16.66%

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，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

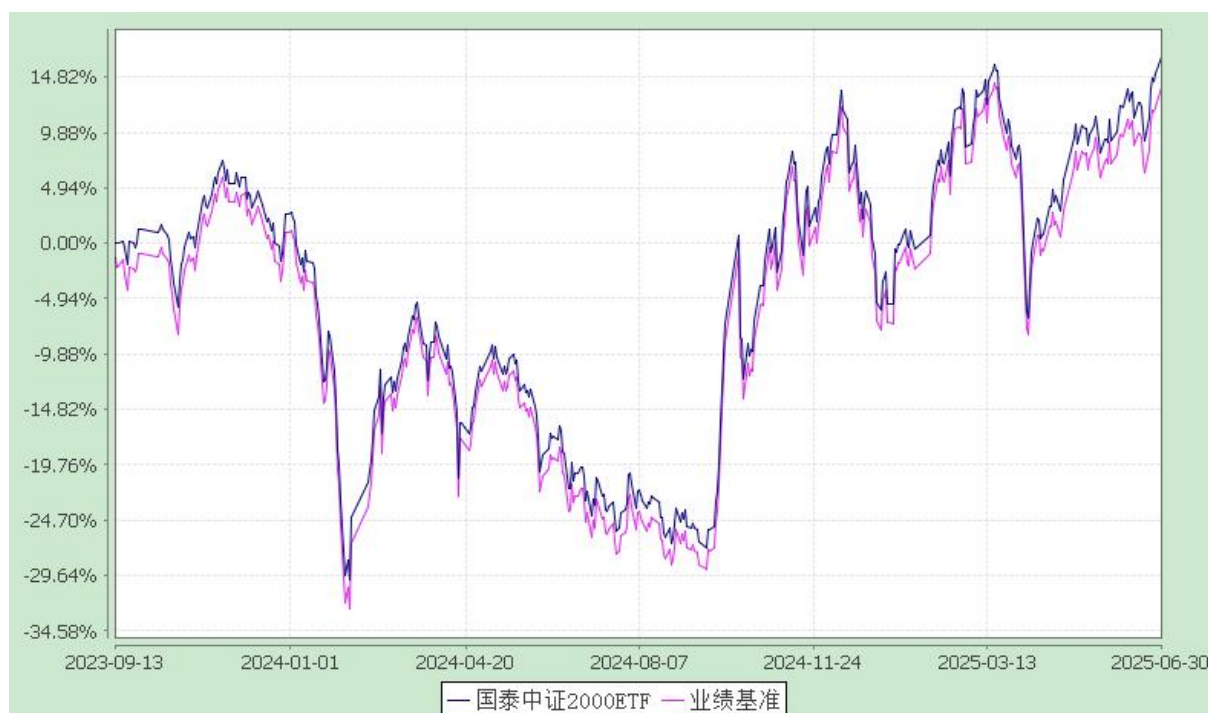
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去一个月	6.92%	1.13%	6.40%	1.16%	0.52%	-0.03%
过去三个月	8.48%	2.11%	7.62%	2.12%	0.86%	-0.01%
过去六个月	16.10%	1.92%	15.24%	1.94%	0.86%	-0.02%
过去一年	46.87%	2.12%	47.00%	2.18%	-0.13%	-0.06%
自基金合同生效起至今	16.66%	2.05%	13.90%	2.14%	2.76%	-0.09%

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

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 （2023 年 9 月 13 日至 2025 年 6 月 30 日）



注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2025 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 280 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

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		
麻绛文	国泰中证有色金属 ETF、国泰中证有色金属矿业主题 ETF、国泰中证 2000ETF、国泰中证全指集成电路 ETF、国泰上证科创板 100ETF 发起联接、国泰中证沪深港黄金产业股票 ETF、国泰上证国有企业红利 ETF、国泰中证港股通高股息投资 ETF、国泰沪深 300 增强策略 ETF 发起联接、国泰创业板 50ETF、国泰富时中国 A 股自由现金流聚焦 ETF、国泰上证科创板综合 ETF、国泰创业板人工智能 ETF、国泰上证科创板芯片 ETF、国泰创业板医药卫生 ETF、国泰创业板新能源 ETF、国泰上证科创板创新药 ETF 的基金经理	2023-09-13	-	5 年	硕士研究生。2020 年 6 月加入国泰基金，历任助理量化研究员、量化研究员、基金经理助理。2023 年 8 月起兼任国泰中证有色金属交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证有色金属矿业主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 9 月起兼任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 10 月起兼任国泰中证全指集成电路交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2023 年 11 月起兼任国泰上证科创板 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 4 月起兼任国泰中证沪深港黄金产业股票交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证国有企业红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 7 月起兼任国泰中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2024 年 9 月起兼任国泰沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理，2024 年 12 月起兼任国泰创业板 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 2 月起兼任国泰富时中国 A 股自由现金流聚焦交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 3 月起兼任国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板人工智能交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 4 月起兼任国泰创业板医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰创业板新能源交易型开放

					式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 7 月起兼任国泰上证科创板创新药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
刘昉元	国泰中证 2000ETF、国泰上证科创板综合 ETF、国泰中证 A500 增强策略 ETF 的基金经理	2025-04-11	-	5 年	硕士研究生。曾任职于浙商基金管理有限公司。2022 年 7 月加入国泰基金，历任量化研究员、基金经理助理。2025 年 4 月起任国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金和国泰上证科创板综合交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2025 年 5 月起兼任国泰中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

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，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

本报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（1 日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金与本基金管理人所管理的其他投资组合未发生大额同日反向交易。本报告期内，未发现本基金有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

市场开年震荡调整，但春节前后 DeepSeek 为代表的 AI 产业趋势持续发酵，叠加 3 月重要会议政策定调积极，催化市场上行，小盘股表现出更强弹性。一季度中证 2000 指数上涨 7.08%。

2025 年二季度 A 股市场先下后上，受 4 月初关税影响，A 股大幅回调，但在“国家队”出手后迅速止跌企稳。中证 2000 指数走势同样呈现先抑后扬趋势，最终单季度录得涨幅 7.62%。

中证 2000 指数选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本，聚焦小盘及微盘股票的整体表现。2025 年以来小微盘风格表现整体强于大盘，产业趋势、宏观及流动性环境、资本市场建设方向等因素均有利于小微盘风格演绎。

作为宽基指数基金，本基金旨在为看好小微盘股表现的投资者提供投资工具。本报告期内，我们根据对市场行情、日常申赎情况和成份股停复牌的分析判断，对股票仓位及头寸进行了合理安排，将跟踪误差控制在合理水平，尽量为投资者提供更精准的投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 16.10%，同期业绩比较基准收益率为 15.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年三季度，随着宏观政策逐步落地，提振内需趋势进一步强化，下半年风险偏好有望持续抬升。叠加流动性改善，市场中长期或将有所表现。

经过前期上涨后小微盘股估值有所抬升，短期波动也有所放大，但当前环境仍偏向小微盘风格，小微盘占优的趋势可能尚未结束。从产业趋势的角度看，小微盘股在新技术爆发时往往能占优，目前全球 AI 产业如火如荼，国内大力推动新质生产力、专精特新、高端制造等新兴产业，有助于推动小微盘风格表现。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内

相关基金估值政策由托管人进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期存在连续六十个工作日基金资产净值低于五千万元的情形，本基金管理人已向中国证监会上海监管局报告本基金的解决方案。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管本基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	720,094.26	399,817.55
结算备付金		31,239.15	33,703.91
存出保证金		15,682.04	160,093.88
交易性金融资产	6.4.7.2	9,304,465.00	17,873,402.76
其中：股票投资		9,304,465.00	17,873,402.76
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		10,071,480.45	18,467,018.10
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,574.79	8,387.49
应付托管费		914.99	1,677.48
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-

应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	317,615.92	13,684.45
负债合计		323,105.70	23,749.42
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	8,356,000.00	18,356,000.00
未分配利润	6.4.7.8	1,392,374.75	87,268.68
净资产合计		9,748,374.75	18,443,268.68
负债和净资产总计		10,071,480.45	18,467,018.10

注：报告截止日 2025 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.1666 元，基金份额总额 8,356,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
一、营业总收入		3,102,183.56	-4,158,381.08
1.利息收入		1,649.65	9,110.36
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,649.65	9,110.36
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）		3,131,673.10	-1,637,495.63
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,069,784.79	-1,883,432.97
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	61,888.31	245,937.34
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-157,582.89	-1,737,118.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	126,443.70	-792,876.86
减：二、营业总支出		44,850.65	93,144.86
1. 管理人报酬		37,375.47	70,517.51
2. 托管费		7,475.18	14,103.51

3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.16	-	8,523.84
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,057,332.91	-4,251,525.94
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,057,332.91	-4,251,525.94
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,057,332.91	-4,251,525.94

6.3 净资产变动表

会计主体：国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	18,356,000.00	87,268.68	18,443,268.68
二、本期期初净资产	18,356,000.00	87,268.68	18,443,268.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,000,000.00	1,305,106.07	-8,694,893.93
（一）、综合收益总额	-	3,057,332.91	3,057,332.91
（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）	-10,000,000.00	-1,752,226.84	-11,752,226.84
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	28,392.43	12,028,392.43
2.基金赎回款	-22,000,000.00	-1,780,619.27	-23,780,619.27
（三）、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	8,356,000.00	1,392,374.75	9,748,374.75
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	24,356,000.00	635,272.49	24,991,272.49
二、本期期初净资产	24,356,000.00	635,272.49	24,991,272.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	8,000,000.00	-7,292,229.73	707,770.27
（一）、综合收益总额	-	-4,251,525.94	-4,251,525.94
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	8,000,000.00	-3,040,703.79	4,959,296.21
其中：1.基金申购款	194,000,000.00	-30,193,952.12	163,806,047.88
2.基金赎回款	-186,000,000.00	27,153,248.33	-158,846,751.67
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	32,356,000.00	-6,656,957.24	25,699,042.76

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(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[2023]1939 号《关于准予国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由国泰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《国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 600,356,000.00 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(2023)第 0469 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2023 年 9 月 13 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 600,356,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司,基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2023]第 220 号文审核同意,本基金 600,356,000.00 份基金份额于 2023 年 9 月 21 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份股(含存托凭证)、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括主板、创业板、科创板及其他中国证监会允许基金投资的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、股指期货、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可根据法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%,因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即中证 2000 指数收益率。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2025 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会（以下简称“基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 6.4.2 中所列示的中国证监会和基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 6 月 30 日的财务状况、2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况。

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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012] 85 号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015] 101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财政部、税务总局、证监会公告 2019 年第 78 号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于 2008 年 9 月 18 日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016] 36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016] 140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017] 2 号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充

通知》、财税[2017] 56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部税务总局公告 2024 年第 8 号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

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

6.4.7重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
活期存款	720,094.26
等于：本金	720,003.24
加：应计利息	91.02
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	720,094.26

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		8,255,080.81	-	9,304,465.00	1,049,384.19
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	8,255,080.81	-	9,304,465.00	1,049,384.19

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	6,079.36
其中：交易所市场	6,079.36
银行间市场	-
应付利息	-
可退替代款	3.30
应付替代款	311,533.26
合计	317,615.92

注：(1)可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

(2)应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	18,356,000.00	18,356,000.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-22,000,000.00	-22,000,000.00
本期末	8,356,000.00	8,356,000.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,872,694.75	-2,785,426.07	87,268.68
本期期初	2,872,694.75	-2,785,426.07	87,268.68
本期利润	3,214,915.80	-157,582.89	3,057,332.91
本期基金份额交易产生的变动数	-2,755,315.42	1,003,088.58	-1,752,226.84
其中：基金申购款	3,205,621.55	-3,177,229.12	28,392.43
基金赎回款	-5,960,936.97	4,180,317.70	-1,780,619.27
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,332,295.13	-1,939,920.38	1,392,374.75

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,476.56
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	69.38
其他	103.71
合计	1,649.65

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

股票投资收益——买卖股票差价收入	2,345,934.53
股票投资收益——赎回差价收入	723,850.26
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,069,784.79

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,295,208.92
减：卖出股票成本总额	25,924,264.56
减：交易费用	25,009.83
买卖股票差价收入	2,345,934.53

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	23,780,619.27
减：现金支付赎回款总额	16,424,210.27
减：赎回股票成本总额	6,632,558.74
减：交易费用	-
赎回差价收入	723,850.26

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
股票投资产生的股利收益	61,888.31
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	61,888.31

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
1.交易性金融资产	-157,582.89
——股票投资	-157,582.89
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-157,582.89

注：本基金本会计期间公允价值变动损益——股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	126,443.70
合计	126,443.70

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.16 其他费用

本基金本报告期内无其他费用。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中信建投证券股份有限公司（“中信建投证券”）	基金托管人、申购赎回代理券商

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券	7,427,474.50	15.15%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

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。

6.4.10.1.3 债券交易

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。

6.4.10.1.4 债券回购交易

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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日

	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信建投证券	1,007.19	13.08%	847.02	13.93%
关联方名称	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信建投证券	-	-	-	-

注：1.上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费等手续费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2.2024 年 7 月 1 日前，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。自 2024 年 7 月 1 日起，券商不再为本基金提供除交易单元租用以外服务。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	37,375.47	70,517.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	944.25	228.27
应支付基金管理人的净管理费	36,431.22	70,289.24

注：支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年6月 30日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	7,475.18	14,103.51

注：支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期及上年度可比期间均无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2025年1月1日至2025年6月30日		2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券	720,094.26	1,476.56	638,803.22	3,358.34

注：本基金的银行存款由基金托管人中信建投证券保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

6.4.12 期末（2025 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300280	*ST 紫天	2025-03-17	重大事项停牌	8.74	2025-07-07	6.99	400.00	6,653.98	3,496.00	-

600962	国投中鲁	2025-06-23	重大事项停牌	13.43	2025-07-07	14.77	700.00	9,109.41	9,401.00	-
603758	秦安股份	2025-06-30	重大事项停牌	16.48	2025-07-11	16.00	600.00	7,019.44	9,888.00	-
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事项停牌	38.05	2025-07-11	39.98	800.00	15,622.55	30,440.00	-

注：本基金截至 2025 年 6 月 30 日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在消除所公布事项的重大影响后，经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平理论上高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。本基金为指数型基金，跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。本基金的投资目标为紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征

通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于组合资产流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2025 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入

短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	720,094.26	-	-	-	720,094.26
结算备付金	31,239.15	-	-	-	31,239.15
存出保证金	15,682.04	-	-	-	15,682.04
交易性金融资产	-	-	-	9,304,465.00	9,304,465.00

资产总计	767,015.45	-	-	9,304,465.00	10,071,480.45
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	4,574.79	4,574.79
应付托管费	-	-	-	914.99	914.99
其他负债	-	-	-	317,615.92	317,615.92
负债总计	-	-	-	323,105.70	323,105.70
利率敏感度缺口	767,015.45	-	-	8,981,359.30	9,748,374.75
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	399,817.55	-	-	-	399,817.55
结算备付金	33,703.91	-	-	-	33,703.91
存出保证金	160,093.88	-	-	-	160,093.88
交易性金融资产	-	-	-	17,873,402.76	17,873,402.76
资产总计	593,615.34	-	-	17,873,402.76	18,467,018.10
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	8,387.49	8,387.49
应付托管费	-	-	-	1,677.48	1,677.48
其他负债	-	-	-	13,684.45	13,684.45
负债总计	-	-	-	23,749.42	23,749.42
利率敏感度缺口	593,615.34	-	-	17,849,653.34	18,443,268.68

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2024 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2024 年 12 月 31 日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 6 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	9,304,465.00	95.45	17,873,402.76	96.91
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	9,304,465.00	95.45	17,873,402.76	96.91

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 474,771.68	增加约 881,022.90
	业绩比较基准下降 5%	减少约 474,771.68	减少约 881,022.90

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 6 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	9,251,240.00	17,819,238.76
第二层次	53,225.00	54,164.00
第三层次	-	-
合计	9,304,465.00	17,873,402.76

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，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公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2025 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 12,028,392.43 元(2024 年上半年度：163,806,047.88 元)，其中包括以股票支付的申购款 3,407,362.00 元和以现金支付的申购款 8,621,030.43

元(2024 年上半年度：其中包括以股票支付的申购款 42,124,532.94 元和以现金支付的申购款 121,681,514.94 元)。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元			
序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	9,304,465.00	92.38
	其中：股票	9,304,465.00	92.38
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	751,333.41	7.46
8	其他各项资产	15,682.04	0.16
9	合计	10,071,480.45	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元			
代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例

			(%)
A	农、林、牧、渔业	66,253.00	0.68
B	采矿业	63,527.00	0.65
C	制造业	6,577,956.28	67.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	165,602.40	1.70
E	建筑业	118,228.00	1.21
F	批发和零售业	328,789.60	3.37
G	交通运输、仓储和邮政业	100,372.00	1.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,002,041.05	10.28
J	金融业	15,060.00	0.15
K	房地产业	163,636.00	1.68
L	租赁和商务服务业	213,887.80	2.19
M	科学研究和技术服务业	176,569.07	1.81
N	水利、环境和公共设施管理业	121,335.00	1.24
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	63,493.00	0.65
Q	卫生和社会工作	18,332.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	84,707.00	0.87
S	综合	20,838.80	0.21
	合计	9,300,628.00	95.41

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-

E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,496.00	0.04
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	3,496.00	0.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688313	仕佳光子	800	30,440.00	0.31
2	688068	热景生物	200	28,028.00	0.29
3	603668	天马科技	2,120	27,941.60	0.29
4	603067	振华股份	1,820	27,736.80	0.28
5	002579	中京电子	1,800	27,270.00	0.28
6	600113	浙江东日	1,000	25,780.00	0.26
7	300016	北陆药业	2,600	24,674.00	0.25
8	002515	金字火腿	4,200	24,612.00	0.25
9	300007	汉威科技	600	24,360.00	0.25
10	002250	联化科技	2,200	24,200.00	0.25
11	605305	中际联合	840	23,335.20	0.24
12	002376	新北洋	3,000	23,310.00	0.24
13	600410	华胜天成	2,400	23,016.00	0.24

14	600184	光电股份	1,300	22,828.00	0.23
15	002033	丽江股份	2,600	22,672.00	0.23
16	002102	能特科技	7,000	22,120.00	0.23
17	002467	二六三	3,400	21,998.00	0.23
18	300378	鼎捷数智	600	21,960.00	0.23
19	300447	全信股份	1,400	21,938.00	0.23
20	300098	高新兴	4,200	21,840.00	0.22
21	300340	科恒股份	1,000	21,800.00	0.22
22	688510	航亚科技	900	21,762.00	0.22
23	300164	通源石油	3,600	21,672.00	0.22
24	002483	润邦股份	3,400	21,250.00	0.22
25	002379	宏创控股	1,600	21,248.00	0.22
26	688787	海天瑞声	200	21,236.00	0.22
27	002235	安妮股份	2,000	21,200.00	0.22
28	000419	通程控股	3,700	21,053.00	0.22
29	300766	每日互动	600	20,964.00	0.22
30	300790	宇瞳光学	1,000	20,910.00	0.21
31	300018	中元股份	2,600	20,670.00	0.21
32	002263	大东南	5,000	20,650.00	0.21
33	002527	新时达	1,400	20,426.00	0.21
34	603601	再升科技	5,000	20,300.00	0.21
35	601113	华鼎股份	5,100	20,145.00	0.21
36	603809	豪能股份	1,314	20,104.20	0.21
37	002009	天奇股份	1,300	20,007.00	0.21
37	002969	嘉美包装	5,700	20,007.00	0.21
39	002160	常铝股份	4,600	19,872.00	0.20
40	000962	东方钨业	1,200	19,692.00	0.20
41	600106	重庆路桥	3,200	19,616.00	0.20
42	002169	智光电气	3,000	19,410.00	0.20
43	300353	东土科技	900	19,215.00	0.20
44	603111	康尼机电	2,900	19,082.00	0.20
45	600255	鑫科材料	5,700	19,038.00	0.20
46	601789	宁波建工	3,400	18,870.00	0.19
47	002878	元隆雅图	800	18,624.00	0.19
48	300278	华昌达	3,400	18,564.00	0.19
49	300057	万顺新材	3,400	18,530.00	0.19
50	002474	榕基软件	2,600	18,434.00	0.19
51	002017	东信和平	1,000	18,430.00	0.19
52	000554	泰山石油	2,600	18,382.00	0.19
53	300382	斯莱克	1,200	18,252.00	0.19
54	002908	德生科技	1,800	18,234.00	0.19
55	300420	五洋自控	5,300	18,232.00	0.19
56	300138	晨光生物	1,500	18,180.00	0.19
57	000548	湖南投资	3,400	18,156.00	0.19

58	002449	国星光电	1,800	18,144.00	0.19
59	300288	朗玛信息	1,200	18,132.00	0.19
60	002578	闽发铝业	5,400	18,090.00	0.19
61	000153	丰原药业	2,920	18,016.40	0.18
62	000551	创元科技	1,400	17,990.00	0.18
63	603173	福斯达	500	17,775.00	0.18
64	301263	泰恩康	500	17,695.00	0.18
65	002512	达华智能	3,500	17,675.00	0.18
66	688627	精智达	200	17,602.00	0.18
67	603969	银龙股份	2,400	17,592.00	0.18
68	600609	金杯汽车	3,300	17,457.00	0.18
69	002206	海 利 得	3,400	17,374.00	0.18
70	002283	天润工业	2,900	17,284.00	0.18
71	600960	渤海汽车	3,200	17,280.00	0.18
72	688535	华海诚科	200	17,198.00	0.18
73	688160	步科股份	200	17,140.00	0.18
74	300241	瑞丰光电	3,000	17,100.00	0.18
74	603167	渤海轮渡	1,500	17,100.00	0.18
76	600071	凤凰光学	800	17,088.00	0.18
77	300586	美联新材	1,600	17,072.00	0.18
78	002067	景兴纸业	4,400	16,984.00	0.17
79	301550	斯菱股份	190	16,965.10	0.17
80	300131	英唐智控	2,200	16,896.00	0.17
81	002741	光华科技	800	16,864.00	0.17
82	002666	德联集团	3,300	16,797.00	0.17
83	002057	中钢天源	1,800	16,722.00	0.17
84	300404	博济医药	1,800	16,596.00	0.17
85	000823	超声电子	1,400	16,590.00	0.17
86	300806	斯迪克	1,000	16,500.00	0.17
87	000726	鲁 泰 A	2,600	16,484.00	0.17
88	002491	通鼎互联	2,900	16,472.00	0.17
89	002546	新联电子	3,000	16,470.00	0.17
90	688382	益方生物	500	16,410.00	0.17
91	002298	中电鑫龙	2,400	16,296.00	0.17
92	300872	天阳科技	700	16,142.00	0.17
93	300173	福能东方	2,500	15,850.00	0.16
94	605196	华通线缆	900	15,849.00	0.16
95	300375	鹏翎股份	3,100	15,841.00	0.16
96	688158	优刻得	700	15,834.00	0.16
97	688711	宏微科技	900	15,831.00	0.16
98	600351	亚宝药业	2,600	15,782.00	0.16
99	002362	汉王科技	700	15,694.00	0.16
100	688205	德科立	250	15,672.50	0.16
101	000819	岳阳兴长	1,000	15,650.00	0.16

102	002290	禾盛新材	500	15,625.00	0.16
102	600730	中国高科	2,500	15,625.00	0.16
104	002167	东方锆业	1,400	15,582.00	0.16
105	600067	冠城新材	5,200	15,496.00	0.16
106	301525	儒竞科技	200	15,446.00	0.16
107	000957	中通客车	1,400	15,302.00	0.16
108	301413	安培龙	200	15,290.00	0.16
109	000701	厦门信达	2,300	15,272.00	0.16
110	000850	华茂股份	3,400	15,164.00	0.16
111	002876	三利谱	600	15,114.00	0.16
112	300547	川环科技	500	15,110.00	0.16
113	603936	博敏电子	1,600	15,088.00	0.15
114	300041	回天新材	1,600	15,072.00	0.15
115	002896	中大力德	260	15,056.60	0.15
116	300120	经纬辉开	1,500	15,045.00	0.15
117	002640	跨境通	3,000	15,030.00	0.15
118	002536	飞龙股份	1,000	14,960.00	0.15
119	300322	硕贝德	1,000	14,950.00	0.15
120	000404	长虹华意	2,100	14,910.00	0.15
121	002369	卓翼科技	1,600	14,896.00	0.15
121	300471	厚普股份	1,400	14,896.00	0.15
123	002792	通宇通讯	960	14,870.40	0.15
124	603633	徕木股份	1,700	14,773.00	0.15
125	300335	迪森股份	2,700	14,742.00	0.15
126	300969	恒帅股份	220	14,735.60	0.15
127	002380	科远智慧	600	14,670.00	0.15
128	688507	索辰科技	200	14,666.00	0.15
129	300973	立高食品	300	14,631.00	0.15
130	300310	宜通世纪	2,200	14,630.00	0.15
131	002246	北化股份	1,000	14,620.00	0.15
132	000036	华联控股	4,000	14,600.00	0.15
133	600105	永鼎股份	1,800	14,562.00	0.15
134	600222	太龙药业	2,600	14,534.00	0.15
135	300690	双一科技	600	14,526.00	0.15
136	600237	铜峰电子	2,000	14,500.00	0.15
137	603916	苏博特	1,600	14,496.00	0.15
138	601929	吉视传媒	8,000	14,480.00	0.15
139	688222	成都先导	900	14,472.00	0.15
140	300355	蒙草生态	3,400	14,450.00	0.15
141	688049	炬芯科技	238	14,399.00	0.15
142	688202	美迪西	400	14,372.00	0.15
143	002392	北京利尔	2,300	14,352.00	0.15
144	600629	华建集团	1,700	14,331.00	0.15
145	300684	中石科技	600	14,328.00	0.15

146	301080	百普赛斯	200	14,306.00	0.15
147	300056	中创环保	1,000	14,300.00	0.15
148	301270	汉仪股份	300	14,298.00	0.15
149	002334	英威腾	1,800	14,274.00	0.15
150	002606	大连电瓷	1,600	14,272.00	0.15
151	300222	科大智能	1,400	14,266.00	0.15
152	002339	积成电子	1,800	14,256.00	0.15
153	002358	森源电气	2,800	14,252.00	0.15
154	002437	誉衡药业	5,000	14,250.00	0.15
155	002587	奥拓电子	2,200	14,190.00	0.15
156	600713	南京医药	2,800	14,168.00	0.15
157	688286	敏芯股份	200	14,138.00	0.15
158	000700	模塑科技	1,800	14,130.00	0.14
159	002965	祥鑫科技	360	14,119.20	0.14
160	300219	鸿利智汇	2,100	14,112.00	0.14
161	603859	能科科技	436	14,091.52	0.14
162	603929	亚翔集成	400	14,040.00	0.14
163	002613	北玻股份	3,800	14,022.00	0.14
164	301127	武汉天源	820	14,013.80	0.14
165	002729	好利科技	1,000	14,000.00	0.14
166	000788	北大医药	2,200	13,970.00	0.14
167	002669	康达新材	1,200	13,920.00	0.14
168	002526	山东矿机	3,600	13,896.00	0.14
169	300681	英搏尔	500	13,830.00	0.14
170	301486	致尚科技	200	13,814.00	0.14
171	600626	申达股份	3,800	13,794.00	0.14
172	300061	旗天科技	1,000	13,750.00	0.14
173	002330	得利斯	3,000	13,740.00	0.14
174	000523	红棉股份	4,200	13,692.00	0.14
175	002685	华东重机	1,800	13,554.00	0.14
176	000803	山高环能	2,200	13,552.00	0.14
176	002769	普路通	1,400	13,552.00	0.14
178	600843	上工申贝	1,200	13,500.00	0.14
179	002418	康盛股份	3,800	13,490.00	0.14
180	300143	盈康生命	1,400	13,482.00	0.14
181	002448	中原内配	1,600	13,392.00	0.14
182	002296	辉煌科技	1,200	13,380.00	0.14
183	688486	龙迅股份	200	13,376.00	0.14
184	600880	博瑞传播	2,500	13,375.00	0.14
185	603528	多伦科技	1,600	13,344.00	0.14
186	300203	聚光科技	600	13,278.00	0.14
186	300503	昊志机电	600	13,278.00	0.14
186	603855	华荣股份	600	13,278.00	0.14
189	300479	神思电子	600	13,242.00	0.14

190	300412	迦南科技	2,600	13,208.00	0.14
191	002069	獐子岛	3,400	13,192.00	0.14
192	601616	广电电气	3,400	13,158.00	0.13
193	300148	天舟文化	2,600	13,156.00	0.13
194	001267	汇绿生态	1,400	13,132.00	0.13
195	600268	国电南自	1,678	13,121.96	0.13
196	002148	北纬科技	1,800	13,104.00	0.13
197	688059	华锐精密	280	13,092.80	0.13
198	002790	瑞尔特	1,800	13,086.00	0.13
199	688509	正元地信	3,034	13,015.86	0.13
200	002782	可立克	1,000	12,980.00	0.13
201	002112	三变科技	1,000	12,950.00	0.13
202	300048	合康新能	2,200	12,914.00	0.13
203	000973	佛塑科技	1,800	12,816.00	0.13
204	300540	蜀道装备	780	12,807.60	0.13
205	300195	长荣股份	1,800	12,798.00	0.13
205	300988	津荣天宇	600	12,798.00	0.13
207	002037	保利联合	1,400	12,796.00	0.13
208	300047	天源迪科	800	12,760.00	0.13
208	603889	新澳股份	2,200	12,760.00	0.13
210	601218	吉鑫科技	3,100	12,741.00	0.13
211	603520	司太立	1,300	12,740.00	0.13
212	688080	映翰通	250	12,722.50	0.13
213	603309	维力医疗	1,000	12,720.00	0.13
214	301299	卓创资讯	200	12,718.00	0.13
215	300292	吴通控股	2,600	12,662.00	0.13
216	688095	福昕软件	186	12,631.26	0.13
217	600503	华丽家族	5,000	12,550.00	0.13
218	002178	延华智能	2,000	12,520.00	0.13
219	688668	鼎通科技	200	12,492.00	0.13
220	002577	雷柏科技	600	12,432.00	0.13
221	300520	科大国创	500	12,400.00	0.13
222	301368	丰立智能	200	12,366.00	0.13
223	301110	青木科技	220	12,317.80	0.13
224	300231	银信科技	1,000	12,310.00	0.13
225	688800	瑞可达	250	12,300.00	0.13
226	300490	华自科技	1,400	12,250.00	0.13
227	688518	联赢激光	600	12,234.00	0.13
228	688428	诺诚健华	500	12,215.00	0.13
229	300448	浩云科技	1,800	12,204.00	0.13
230	600496	精工钢构	3,800	12,160.00	0.12
230	603519	立霸股份	1,000	12,160.00	0.12
232	003010	若羽臣	200	12,120.00	0.12
233	300873	海晨股份	600	12,114.00	0.12

234	605016	百龙创园	586	12,089.18	0.12
235	688207	格灵深瞳	800	12,080.00	0.12
236	002799	环球印务	1,400	12,068.00	0.12
237	000782	恒申新材	2,400	12,024.00	0.12
238	300206	理邦仪器	1,000	12,020.00	0.12
239	600756	浪潮软件	800	12,016.00	0.12
240	300632	光莆股份	900	12,015.00	0.12
241	000912	泸天化	2,600	12,012.00	0.12
242	603918	金桥信息	600	11,994.00	0.12
243	002869	金溢科技	500	11,965.00	0.12
244	002912	中新赛克	500	11,925.00	0.12
245	002575	群兴玩具	1,400	11,914.00	0.12
246	002175	东方智造	2,600	11,882.00	0.12
247	600749	西藏旅游	1,000	11,870.00	0.12
248	002725	跃岭股份	900	11,862.00	0.12
249	300652	雷迪克	200	11,778.00	0.12
250	002785	万里石	400	11,772.00	0.12
251	002642	荣联科技	1,500	11,715.00	0.12
251	300709	精研科技	300	11,715.00	0.12
253	605128	上海沿浦	386	11,680.36	0.12
254	002523	天桥起重	3,200	11,680.00	0.12
254	002609	捷顺科技	1,000	11,680.00	0.12
256	600708	光明地产	3,400	11,662.00	0.12
257	300608	思特奇	1,000	11,640.00	0.12
258	002937	兴瑞科技	700	11,634.00	0.12
259	600613	神奇制药	1,800	11,628.00	0.12
260	300267	尔康制药	3,700	11,618.00	0.12
261	002995	天地在线	600	11,610.00	0.12
262	688073	毕得医药	200	11,604.00	0.12
263	301580	爱迪特	280	11,600.40	0.12
264	603890	春秋电子	1,000	11,600.00	0.12
265	300217	东方电热	2,200	11,594.00	0.12
266	300328	宜安科技	1,000	11,570.00	0.12
267	688799	华纳药厂	280	11,564.00	0.12
268	002375	亚厦股份	3,000	11,550.00	0.12
269	002398	垒知集团	2,328	11,500.32	0.12
270	603018	华设集团	1,400	11,494.00	0.12
271	002570	贝因美	1,800	11,484.00	0.12
272	002343	慈文传媒	1,300	11,453.00	0.12
273	300984	金沃股份	200	11,450.00	0.12
274	000698	沈阳化工	3,000	11,430.00	0.12
275	603703	盛洋科技	1,100	11,407.00	0.12
276	301018	申菱环境	300	11,382.00	0.12
277	600846	同济科技	1,000	11,380.00	0.12

278	002248	华东数控	1,300	11,375.00	0.12
279	300680	隆盛科技	300	11,373.00	0.12
280	301102	兆讯传媒	1,040	11,356.80	0.12
281	688023	安恒信息	200	11,348.00	0.12
282	002374	中锐股份	3,800	11,324.00	0.12
283	688365	光云科技	744	11,323.68	0.12
284	000509	华塑控股	3,400	11,322.00	0.12
285	002580	圣阳股份	800	11,304.00	0.12
286	002886	沃特股份	600	11,292.00	0.12
287	002170	芭田股份	1,100	11,275.00	0.12
288	605366	宏柏新材	1,800	11,268.00	0.12
289	300505	川金诺	600	11,220.00	0.12
290	002297	博云新材	1,400	11,200.00	0.11
291	300515	三德科技	500	11,175.00	0.11
292	688277	天智航	800	11,120.00	0.11
293	002843	泰嘉股份	500	11,095.00	0.11
294	002664	信质集团	600	11,082.00	0.11
295	600684	珠江股份	2,500	11,075.00	0.11
296	300071	福石控股	2,200	11,066.00	0.11
297	002866	传艺科技	600	11,034.00	0.11
298	600121	郑州煤电	2,800	11,032.00	0.11
299	688626	翔宇医疗	250	11,005.00	0.11
300	300194	福安药业	2,600	10,998.00	0.11
301	002232	启明信息	600	10,980.00	0.11
302	301366	一博科技	280	10,970.40	0.11
303	603558	健盛集团	1,200	10,932.00	0.11
304	300304	云意电气	1,500	10,920.00	0.11
305	001283	豪鹏科技	200	10,890.00	0.11
306	301379	天山电子	404	10,875.68	0.11
307	002344	海宁皮城	2,500	10,850.00	0.11
308	603660	苏州科达	1,500	10,845.00	0.11
309	300793	佳禾智能	600	10,842.00	0.11
310	300781	因赛集团	200	10,824.00	0.11
311	300825	阿尔特	1,000	10,810.00	0.11
312	002210	飞马国际	3,800	10,754.00	0.11
313	600590	泰豪科技	1,100	10,747.00	0.11
314	300467	迅游科技	500	10,735.00	0.11
315	002915	中欣氟材	600	10,728.00	0.11
316	600439	瑞贝卡	3,000	10,710.00	0.11
317	300499	高澜股份	600	10,680.00	0.11
318	000042	中洲控股	1,500	10,665.00	0.11
319	000892	欢瑞世纪	2,200	10,648.00	0.11
320	300435	中泰股份	700	10,626.00	0.11
320	600973	宝胜股份	2,100	10,626.00	0.11

320	603319	美湖股份	300	10,626.00	0.11
323	300149	睿智医药	1,000	10,600.00	0.11
324	300862	蓝盾光电	400	10,592.00	0.11
325	300275	梅安森	800	10,576.00	0.11
326	603032	德新科技	600	10,554.00	0.11
327	688195	腾景科技	234	10,530.00	0.11
328	000421	南京公用	1,600	10,512.00	0.11
329	000576	甘化科工	1,000	10,510.00	0.11
330	002559	亚威股份	1,100	10,505.00	0.11
331	300145	南方泵业	3,000	10,500.00	0.11
331	301005	超捷股份	300	10,500.00	0.11
333	002703	浙江世宝	800	10,496.00	0.11
334	300248	新开普	700	10,493.00	0.11
335	002445	中南文化	4,100	10,455.00	0.11
336	002323	雅博股份	6,700	10,452.00	0.11
337	603037	凯众股份	840	10,449.60	0.11
338	002386	天原股份	2,100	10,416.00	0.11
339	600860	京城股份	900	10,413.00	0.11
340	600293	三峡新材	3,400	10,404.00	0.11
341	603085	天成自控	900	10,359.00	0.11
342	300647	超频三	1,600	10,352.00	0.11
343	600288	大恒科技	1,000	10,280.00	0.11
344	002119	康强电子	600	10,254.00	0.11
345	000922	佳电股份	900	10,242.00	0.11
346	300968	格林精密	700	10,234.00	0.10
347	603867	新化股份	400	10,232.00	0.10
348	688598	金博股份	400	10,168.00	0.10
349	301128	强瑞技术	200	10,164.00	0.10
350	300153	科泰电源	300	10,155.00	0.10
351	600830	香溢融通	1,000	10,120.00	0.10
352	300160	秀强股份	1,800	10,116.00	0.10
353	300400	劲拓股份	600	10,104.00	0.10
354	002377	国创高新	3,400	10,098.00	0.10
355	002181	粤传媒	1,400	10,094.00	0.10
356	002196	方正电机	1,100	10,087.00	0.10
357	688311	盟升电子	234	10,073.70	0.10
358	002919	名臣健康	596	10,066.44	0.10
359	000659	珠海中富	3,400	10,064.00	0.10
360	301439	泓淋电力	600	10,056.00	0.10
361	300094	国联水产	2,770	10,055.10	0.10
362	001896	豫能控股	2,200	10,054.00	0.10
363	002759	天际股份	1,000	10,050.00	0.10
364	002042	华孚时尚	2,200	10,032.00	0.10
365	600855	航天长峰	700	10,031.00	0.10

366	600513	联环药业	1,000	10,030.00	0.10
367	002661	克明食品	1,000	10,010.00	0.10
368	002628	成都路桥	2,200	9,988.00	0.10
369	688595	芯海科技	267	9,983.13	0.10
370	300990	同飞股份	200	9,980.00	0.10
371	688621	阳光诺和	200	9,978.00	0.10
372	300380	安硕信息	200	9,968.00	0.10
373	301382	蜂助手	250	9,937.50	0.10
374	300465	高伟达	600	9,918.00	0.10
375	002885	京泉华	700	9,905.00	0.10
376	002225	濮耐股份	2,000	9,900.00	0.10
376	300172	中电环保	1,800	9,900.00	0.10
378	603758	秦安股份	600	9,888.00	0.10
379	002733	雄韬股份	600	9,882.00	0.10
380	000570	苏常柴 A	1,700	9,843.00	0.10
381	002955	鸿合科技	400	9,828.00	0.10
382	600283	钱江水利	960	9,811.20	0.10
383	002614	奥佳华	1,500	9,810.00	0.10
384	300488	恒锋工具	300	9,786.00	0.10
385	300174	元力股份	600	9,780.00	0.10
386	600108	亚盛集团	3,300	9,768.00	0.10
386	603110	东方材料	600	9,768.00	0.10
388	603040	新坐标	243	9,761.31	0.10
389	603618	杭电股份	1,600	9,760.00	0.10
390	300247	融捷健康	2,500	9,750.00	0.10
390	603990	麦迪科技	600	9,750.00	0.10
392	003038	鑫铂股份	500	9,745.00	0.10
392	300566	激智科技	500	9,745.00	0.10
394	300302	同有科技	600	9,744.00	0.10
395	300189	神农种业	2,200	9,724.00	0.10
396	300341	麦克奥迪	600	9,708.00	0.10
396	605077	华康股份	600	9,708.00	0.10
398	300245	天玑科技	500	9,685.00	0.10
399	600592	龙溪股份	400	9,660.00	0.10
399	688070	纵横股份	200	9,660.00	0.10
401	600981	汇鸿集团	3,400	9,656.00	0.10
402	002213	大为股份	500	9,655.00	0.10
403	300842	帝科股份	220	9,642.60	0.10
404	000936	华西股份	1,400	9,632.00	0.10
405	002917	金奥博	700	9,625.00	0.10
406	603222	济民健康	1,400	9,590.00	0.10
407	002090	金智科技	1,000	9,580.00	0.10
407	688591	泰凌微	200	9,580.00	0.10
409	603122	合富中国	1,400	9,562.00	0.10

410	000526	学大教育	200	9,550.00	0.10
411	301000	肇民科技	200	9,528.00	0.10
412	603289	泰瑞机器	1,000	9,520.00	0.10
413	300480	光力科技	598	9,508.20	0.10
414	002055	得润电子	1,300	9,490.00	0.10
415	002636	金安国纪	1,000	9,480.00	0.10
416	300032	金龙机电	1,800	9,468.00	0.10
417	300063	天龙集团	1,100	9,460.00	0.10
418	688320	禾川科技	200	9,458.00	0.10
419	001314	亿道信息	200	9,450.00	0.10
419	002381	双箭股份	1,400	9,450.00	0.10
421	002922	伊戈尔	600	9,438.00	0.10
422	688458	美芯晟	200	9,432.00	0.10
423	300469	信息发展	300	9,417.00	0.10
424	600367	红星发展	600	9,414.00	0.10
425	600962	国投中鲁	700	9,401.00	0.10
426	600868	梅雁吉祥	3,400	9,384.00	0.10
427	002082	万邦德	1,400	9,380.00	0.10
428	600203	福日电子	1,000	9,360.00	0.10
429	600650	锦江在线	600	9,348.00	0.10
430	002873	新天药业	1,000	9,340.00	0.10
431	300345	华民股份	1,100	9,328.00	0.10
432	688031	星环科技	200	9,326.00	0.10
433	300996	普联软件	620	9,318.60	0.10
434	605066	天正电气	1,250	9,312.50	0.10
435	603209	兴通股份	600	9,312.00	0.10
436	301007	德迈仕	300	9,297.00	0.10
437	603722	阿科力	200	9,288.00	0.10
438	603966	法兰泰克	1,000	9,280.00	0.10
439	002554	惠博普	3,300	9,273.00	0.10
440	300698	万马科技	200	9,236.00	0.09
441	002522	浙江众成	1,800	9,234.00	0.09
442	002115	三维通信	1,000	9,230.00	0.09
443	002786	银宝山新	1,000	9,220.00	0.09
444	002321	华英农业	3,900	9,204.00	0.09
444	002364	中恒电气	600	9,204.00	0.09
446	002962	五方光电	600	9,192.00	0.09
447	002122	汇洲智能	2,200	9,174.00	0.09
448	002599	盛通股份	1,100	9,163.00	0.09
449	603602	纵横通信	600	9,150.00	0.09
450	002686	亿利达	1,400	9,114.00	0.09
451	688662	富信科技	250	9,112.50	0.09
452	300590	移为通信	700	9,107.00	0.09
453	600706	曲江文旅	900	9,099.00	0.09

454	300959	线上线下	200	9,094.00	0.09
455	300991	创益通	300	9,093.00	0.09
456	002655	共达电声	700	9,072.00	0.09
456	002659	凯文教育	1,800	9,072.00	0.09
458	002441	众业达	1,000	9,070.00	0.09
459	603186	华正新材	300	9,054.00	0.09
460	300112	万讯自控	1,000	9,050.00	0.09
460	300213	佳讯飞鸿	1,000	9,050.00	0.09
462	300622	博士眼镜	260	9,040.20	0.09
463	603325	博隆技术	100	9,029.00	0.09
464	002348	高乐股份	2,200	9,020.00	0.09
465	002479	富春环保	1,800	9,018.00	0.09
465	300121	阳谷华泰	600	9,018.00	0.09
467	002451	摩恩电气	1,300	9,009.00	0.09
468	600540	新赛股份	1,800	9,000.00	0.09
468	603629	利通电子	400	9,000.00	0.09
470	301220	亚香股份	200	8,980.00	0.09
471	000534	万泽股份	600	8,952.00	0.09
472	301230	泓博医药	260	8,949.20	0.09
473	300941	创识科技	300	8,949.00	0.09
474	300484	蓝海华腾	400	8,948.00	0.09
475	688665	四方光电	200	8,944.00	0.09
476	002350	北京科锐	1,300	8,918.00	0.09
477	000560	我爱我家	3,000	8,910.00	0.09
477	002616	长青集团	1,500	8,910.00	0.09
479	300739	明阳电路	600	8,904.00	0.09
480	002689	远大智能	2,300	8,901.00	0.09
481	600103	青山纸业	4,000	8,880.00	0.09
482	600523	贵航股份	600	8,874.00	0.09
482	601002	晋亿实业	1,800	8,874.00	0.09
484	301323	新莱福	200	8,872.00	0.09
485	300046	台基股份	200	8,850.00	0.09
486	300489	光智科技	200	8,832.00	0.09
487	002708	光洋股份	800	8,824.00	0.09
488	300818	耐普矿机	400	8,820.00	0.09
489	002035	华帝股份	1,400	8,806.00	0.09
489	002438	江苏神通	700	8,806.00	0.09
491	002345	潮宏基	600	8,778.00	0.09
492	002877	智能自控	1,000	8,750.00	0.09
493	688588	凌志软件	600	8,742.00	0.09
494	301507	民生健康	600	8,706.00	0.09
495	301396	宏景科技	140	8,695.40	0.09
496	600686	金龙汽车	700	8,680.00	0.09
497	002676	顺威股份	1,200	8,676.00	0.09

498	600354	敦煌种业	1,400	8,666.00	0.09
499	300424	航新科技	500	8,660.00	0.09
500	603138	海量数据	600	8,652.00	0.09
501	000920	沃顿科技	800	8,640.00	0.09
502	301280	珠城科技	220	8,619.60	0.09
503	002198	嘉应制药	1,400	8,610.00	0.09
504	603617	君禾股份	1,200	8,604.00	0.09
505	002950	奥美医疗	1,000	8,600.00	0.09
506	300481	濮阳惠成	600	8,586.00	0.09
507	605388	均瑶健康	1,040	8,569.60	0.09
508	300272	开能健康	1,300	8,541.00	0.09
508	603002	宏昌电子	1,300	8,541.00	0.09
510	600661	昂立教育	800	8,520.00	0.09
511	300403	汉宇集团	560	8,506.40	0.09
512	002026	山东威达	700	8,505.00	0.09
512	300135	宝利国际	2,100	8,505.00	0.09
514	002547	春兴精工	1,800	8,496.00	0.09
515	688246	嘉和美康	289	8,493.71	0.09
516	300911	亿田智能	200	8,492.00	0.09
517	002983	芯瑞达	400	8,476.00	0.09
518	301397	溯联股份	240	8,443.20	0.09
519	301328	维峰电子	200	8,430.00	0.09
520	000863	三湘印象	2,400	8,424.00	0.09
520	301030	仕净科技	480	8,424.00	0.09
522	002823	凯中精密	600	8,418.00	0.09
523	300708	聚灿光电	700	8,400.00	0.09
524	300852	四会富仕	260	8,390.20	0.09
525	600858	银座股份	1,400	8,386.00	0.09
526	300833	浩洋股份	250	8,357.50	0.09
527	688550	瑞联新材	194	8,343.94	0.09
528	002046	国机精工	500	8,340.00	0.09
529	688499	利元亨	200	8,322.00	0.09
530	002520	日发精机	1,300	8,307.00	0.09
531	300221	银禧科技	1,000	8,300.00	0.09
532	300258	精锻科技	600	8,292.00	0.09
533	002137	实益达	1,000	8,290.00	0.09
534	002117	东港股份	700	8,288.00	0.09
535	600052	东望时代	1,800	8,280.00	0.08
535	600658	电子城	1,800	8,280.00	0.08
537	600653	中华控股	4,400	8,272.00	0.08
538	002165	红宝丽	900	8,271.00	0.08
539	000592	平潭发展	2,700	8,235.00	0.08
540	300815	玉禾田	400	8,220.00	0.08
541	688039	当虹科技	250	8,205.00	0.08

542	600724	宁波富达	1,800	8,190.00	0.08
543	300249	依米康	600	8,184.00	0.08
544	603686	福龙马	500	8,170.00	0.08
545	002346	柘中股份	600	8,160.00	0.08
546	002420	毅昌科技	1,300	8,112.00	0.08
546	300563	神宇股份	200	8,112.00	0.08
548	002949	华阳国际	600	8,088.00	0.08
549	002412	汉森制药	1,300	8,086.00	0.08
550	605198	安德利	200	8,062.00	0.08
551	688416	恒烁股份	200	8,052.00	0.08
552	002765	蓝黛科技	600	8,034.00	0.08
553	688388	嘉元科技	400	8,032.00	0.08
554	002103	广博股份	700	8,029.00	0.08
555	002462	嘉事堂	600	8,022.00	0.08
556	300107	建新股份	1,000	8,010.00	0.08
557	301160	翔楼新材	100	8,008.00	0.08
558	601010	文峰股份	2,900	8,004.00	0.08
559	301326	捷邦科技	100	7,974.00	0.08
560	603158	腾龙股份	1,000	7,960.00	0.08
561	601226	华电科工	1,300	7,930.00	0.08
562	002012	凯恩股份	1,400	7,924.00	0.08
563	002094	青岛金王	900	7,920.00	0.08
563	300053	航宇微	600	7,920.00	0.08
565	603499	翔港科技	480	7,915.20	0.08
566	300494	盛天网络	580	7,911.20	0.08
567	603663	三祥新材	300	7,902.00	0.08
568	301251	威尔高	200	7,842.00	0.08
569	000010	美丽生态	2,600	7,826.00	0.08
570	002277	友阿股份	1,300	7,813.00	0.08
571	688181	八亿时空	251	7,811.12	0.08
572	603011	合锻智能	500	7,790.00	0.08
573	300354	东华测试	200	7,776.00	0.08
574	002269	美邦服饰	4,200	7,770.00	0.08
575	603230	内蒙新华	600	7,746.00	0.08
576	000833	粤桂股份	620	7,743.80	0.08
577	000815	美利云	600	7,740.00	0.08
578	002284	亚太股份	700	7,735.00	0.08
579	600135	乐凯胶片	1,000	7,720.00	0.08
580	300105	龙源技术	1,000	7,710.00	0.08
581	300805	电声股份	700	7,700.00	0.08
582	002589	瑞康医药	2,600	7,696.00	0.08
583	300582	英飞特	600	7,692.00	0.08
584	000925	众合科技	1,000	7,680.00	0.08
585	000532	华金资本	500	7,635.00	0.08

586	300727	润禾材料	290	7,624.10	0.08
587	603825	华扬联众	600	7,620.00	0.08
588	600152	维科技术	1,000	7,610.00	0.08
589	000705	浙江震元	900	7,605.00	0.08
590	002988	豪美新材	200	7,600.00	0.08
591	603386	骏亚科技	600	7,590.00	0.08
592	002757	南兴股份	400	7,584.00	0.08
592	605088	冠盛股份	200	7,584.00	0.08
594	603626	科森科技	900	7,578.00	0.08
595	000880	潍柴重机	200	7,564.00	0.08
596	300951	博硕科技	220	7,546.00	0.08
597	300543	朗科智能	700	7,525.00	0.08
598	002662	峰璟股份	2,200	7,524.00	0.08
599	300809	华辰装备	200	7,516.00	0.08
600	688620	安凯微	600	7,506.00	0.08
601	300192	科德教育	500	7,500.00	0.08
602	688369	致远互联	284	7,494.76	0.08
603	002766	索菱股份	1,400	7,490.00	0.08
603	600736	苏州高新	1,400	7,490.00	0.08
605	002455	百川股份	1,000	7,480.00	0.08
605	600825	新华传媒	1,100	7,480.00	0.08
607	002723	小崧股份	1,000	7,470.00	0.08
608	600605	汇通能源	200	7,458.00	0.08
609	301370	国科恒泰	700	7,455.00	0.08
610	000882	华联股份	3,800	7,448.00	0.08
611	301383	天键股份	180	7,430.40	0.08
612	300042	朗科科技	300	7,422.00	0.08
613	688360	德马科技	400	7,420.00	0.08
614	301210	金杨股份	178	7,394.12	0.08
615	002480	新筑股份	1,200	7,392.00	0.08
616	688590	新致软件	359	7,373.86	0.08
617	002997	瑞鹄模具	200	7,370.00	0.08
618	002996	顺博合金	1,000	7,360.00	0.08
619	002478	常宝股份	1,400	7,350.00	0.08
620	301310	鑫宏业	200	7,348.00	0.08
621	688609	九联科技	700	7,329.00	0.08
622	000717	中南股份	3,000	7,320.00	0.08
622	002590	万安科技	500	7,320.00	0.08
622	300399	天利科技	200	7,320.00	0.08
625	002639	雪人集团	700	7,315.00	0.08
626	603318	水发燃气	1,100	7,249.00	0.07
627	688258	卓易信息	149	7,216.07	0.07
628	300111	向日葵	2,200	7,216.00	0.07
629	002150	通润装备	600	7,194.00	0.07

630	300436	广生堂	200	7,180.00	0.07
631	688159	有方科技	100	7,167.00	0.07
632	300201	海伦哲	1,300	7,163.00	0.07
633	301195	北路智控	200	7,160.00	0.07
634	605098	行动教育	200	7,156.00	0.07
635	001338	永顺泰	600	7,152.00	0.07
636	601956	东贝集团	1,100	7,150.00	0.07
637	300853	申昊科技	300	7,140.00	0.07
638	600510	黑牡丹	1,400	7,126.00	0.07
639	002702	海欣食品	1,700	7,106.00	0.07
639	601599	浙文影业	1,900	7,106.00	0.07
641	000530	冰山冷热	1,200	7,092.00	0.07
642	600824	益民集团	1,700	7,089.00	0.07
643	301378	通达海	240	7,087.20	0.07
644	688168	安博通	100	7,087.00	0.07
645	002552	宝鼎科技	500	7,085.00	0.07
646	002796	世嘉科技	600	7,080.00	0.07
646	300081	恒信东方	1,000	7,080.00	0.07
646	300559	佳发教育	600	7,080.00	0.07
646	301488	豪恩汽电	100	7,080.00	0.07
650	600624	复旦复华	1,000	7,070.00	0.07
651	300603	立昂技术	625	7,062.50	0.07
652	300342	天银机电	400	7,056.00	0.07
652	603778	国晟科技	2,100	7,056.00	0.07
654	688182	灿勤科技	256	7,055.36	0.07
655	301118	恒光股份	300	7,011.00	0.07
656	600722	金牛化工	1,100	7,007.00	0.07
657	002208	合肥城建	1,000	7,000.00	0.07
658	002971	和远气体	300	6,999.00	0.07
659	603058	永吉股份	800	6,992.00	0.07
660	300611	美力科技	300	6,987.00	0.07
661	600819	耀皮玻璃	1,200	6,984.00	0.07
662	000533	顺钠股份	1,000	6,970.00	0.07
663	300176	鸿特科技	1,000	6,960.00	0.07
663	300388	节能国祯	1,000	6,960.00	0.07
665	301076	新瀚新材	200	6,956.00	0.07
666	300389	艾比森	600	6,948.00	0.07
667	000521	长虹美菱	1,000	6,940.00	0.07
668	600594	益佰制药	1,800	6,930.00	0.07
669	603861	白云电器	700	6,909.00	0.07
670	000751	锌业股份	2,200	6,908.00	0.07
671	688035	德邦科技	170	6,905.40	0.07
672	600571	信雅达	400	6,904.00	0.07
673	300583	赛托生物	400	6,896.00	0.07

674	300252	金信诺	600	6,888.00	0.07
675	002824	和胜股份	400	6,880.00	0.07
676	301149	隆华新材	600	6,864.00	0.07
677	600619	海立股份	600	6,846.00	0.07
678	002975	博杰股份	200	6,836.00	0.07
679	002562	兄弟科技	1,400	6,832.00	0.07
680	600405	动力源	1,200	6,828.00	0.07
681	300005	探路者	800	6,824.00	0.07
682	000816	智慧农业	2,200	6,820.00	0.07
683	000919	金陵药业	1,000	6,810.00	0.07
684	002218	拓日新能	2,100	6,804.00	0.07
685	002471	中超控股	1,400	6,790.00	0.07
686	301013	利和兴	400	6,780.00	0.07
687	002551	尚荣医疗	1,800	6,768.00	0.07
688	002730	电光科技	400	6,764.00	0.07
689	002561	徐家汇	800	6,760.00	0.07
690	002615	哈尔斯	800	6,728.00	0.07
691	600467	好当家	2,900	6,699.00	0.07
692	603779	威龙股份	900	6,687.00	0.07
693	301266	宇邦新材	200	6,686.00	0.07
694	002543	万和电气	600	6,666.00	0.07
695	688793	倍轻松	200	6,658.00	0.07
696	600742	富维股份	700	6,657.00	0.07
697	603982	泉峰汽车	600	6,648.00	0.07
698	002272	川润股份	600	6,636.00	0.07
699	002285	世联行	2,900	6,612.00	0.07
700	600628	新世界	900	6,588.00	0.07
701	001229	魅视科技	200	6,584.00	0.07
702	000812	陕西金叶	1,400	6,566.00	0.07
703	600630	龙头股份	800	6,560.00	0.07
704	603992	松霖科技	300	6,558.00	0.07
705	002827	高争民爆	200	6,556.00	0.07
706	002184	海得控制	500	6,550.00	0.07
707	605488	福莱新材	200	6,546.00	0.07
707	688512	慧智微	600	6,546.00	0.07
709	300890	翔丰华	200	6,538.00	0.07
710	603527	众源新材	600	6,522.00	0.07
711	688677	海泰新光	167	6,514.67	0.07
712	002632	道明光学	700	6,510.00	0.07
712	300473	德尔股份	200	6,510.00	0.07
714	688378	奥来德	386	6,504.10	0.07
715	001205	盛航股份	400	6,500.00	0.07
716	688581	安杰思	100	6,483.00	0.07
717	002021	中捷资源	2,800	6,468.00	0.07

718	605398	新炬网络	180	6,467.40	0.07
719	603706	东方环宇	300	6,462.00	0.07
720	002712	思美传媒	1,100	6,457.00	0.07
721	000561	烽火电子	600	6,438.00	0.07
722	301318	维海德	190	6,429.60	0.07
723	300963	中洲特材	280	6,412.00	0.07
724	688339	亿华通	300	6,405.00	0.07
725	600101	明星电力	627	6,395.40	0.07
726	603600	永艺股份	600	6,384.00	0.07
727	002442	龙星科技	1,000	6,380.00	0.07
727	300264	佳创视讯	1,000	6,380.00	0.07
729	300688	创业黑马	200	6,376.00	0.07
730	002902	铭普光磁	300	6,372.00	0.07
731	300785	值得买	200	6,366.00	0.07
731	603223	恒通股份	600	6,366.00	0.07
733	300571	平治信息	200	6,364.00	0.07
734	603106	恒银科技	600	6,360.00	0.07
735	301252	同星科技	255	6,357.15	0.07
736	000655	金岭矿业	900	6,354.00	0.07
736	688233	神工股份	200	6,354.00	0.07
738	000707	双环科技	1,000	6,340.00	0.07
739	300843	胜蓝股份	200	6,338.00	0.07
740	002593	日上集团	1,300	6,331.00	0.06
741	603901	永创智能	600	6,324.00	0.06
742	002638	勤上股份	2,400	6,312.00	0.06
743	002870	香山股份	200	6,302.00	0.06
744	300154	瑞凌股份	700	6,300.00	0.06
745	300654	世纪天鸿	600	6,288.00	0.06
746	300291	百纳千成	1,100	6,281.00	0.06
747	002953	日丰股份	600	6,228.00	0.06
748	301150	中一科技	290	6,223.40	0.06
749	002106	莱宝高科	600	6,210.00	0.06
749	688093	世华科技	200	6,210.00	0.06
751	000531	穗恒运 A	1,000	6,150.00	0.06
752	002293	罗莱生活	700	6,118.00	0.06
753	603098	森特股份	600	6,114.00	0.06
754	688103	国力股份	100	6,084.00	0.06
755	300162	雷曼光电	800	6,080.00	0.06
756	688660	电气风电	700	6,076.00	0.06
757	300359	全通教育	1,000	6,070.00	0.06
758	002029	七匹狼	900	6,066.00	0.06
759	002014	永新股份	500	6,060.00	0.06
760	001212	中旗新材	140	6,059.20	0.06
761	603366	日出东方	600	6,036.00	0.06

762	600292	远达环保	500	6,030.00	0.06
763	605289	罗曼股份	200	6,010.00	0.06
764	002825	纳尔股份	600	5,988.00	0.06
765	002535	林州重机	1,500	5,985.00	0.06
766	000897	津滨发展	2,600	5,980.00	0.06
767	300556	丝路视觉	300	5,961.00	0.06
768	300662	科锐国际	200	5,942.00	0.06
769	688228	开普云	100	5,938.00	0.06
770	603031	安孚科技	200	5,918.00	0.06
771	000514	渝 开 发	1,300	5,889.00	0.06
772	605266	健之佳	280	5,888.40	0.06
773	603187	海容冷链	500	5,880.00	0.06
774	002903	宇环数控	300	5,877.00	0.06
775	688066	航天宏图	300	5,874.00	0.06
776	688191	智洋创新	247	5,873.66	0.06
777	600796	钱江生化	1,000	5,870.00	0.06
778	301152	天力锂能	200	5,852.00	0.06
778	603727	博迈科	400	5,852.00	0.06
780	300067	安诺其	1,000	5,850.00	0.06
780	600187	国中水务	1,800	5,850.00	0.06
782	600731	湖南海利	800	5,832.00	0.06
783	002540	亚太科技	1,000	5,830.00	0.06
784	000558	天府文旅	1,300	5,824.00	0.06
785	002328	新朋股份	1,000	5,820.00	0.06
785	002746	仙坛股份	1,000	5,820.00	0.06
787	300916	朗特智能	200	5,814.00	0.06
788	300215	电科院	1,000	5,800.00	0.06
788	300639	凯普生物	1,000	5,800.00	0.06
790	300127	银河磁体	200	5,798.00	0.06
791	002641	公元股份	1,400	5,782.00	0.06
792	002394	联发股份	700	5,761.00	0.06
793	002059	云南旅游	1,100	5,753.00	0.06
794	300756	金马游乐	200	5,738.00	0.06
795	000715	中兴商业	1,000	5,730.00	0.06
796	000409	云鼎科技	500	5,720.00	0.06
797	002787	华源控股	700	5,719.00	0.06
798	600400	红豆股份	2,500	5,700.00	0.06
799	688636	智明达	168	5,676.72	0.06
800	600576	祥源文旅	700	5,649.00	0.06
801	002510	天汽模	800	5,648.00	0.06
802	002695	煌上煌	600	5,640.00	0.06
802	002805	丰元股份	400	5,640.00	0.06
804	003002	壶化股份	200	5,628.00	0.06
805	603429	集友股份	600	5,622.00	0.06

806	603416	信捷电气	100	5,607.00	0.06
807	688685	迈信林	100	5,585.00	0.06
808	688508	芯朋微	100	5,582.00	0.06
809	002452	长高电新	800	5,560.00	0.06
809	605080	浙江自然	200	5,560.00	0.06
811	002728	特一药业	660	5,550.60	0.06
812	000716	黑芝麻	900	5,544.00	0.06
813	002164	宁波东力	600	5,538.00	0.06
814	603012	创力集团	1,000	5,530.00	0.06
815	301302	华如科技	200	5,502.00	0.06
816	002016	世荣兆业	1,000	5,480.00	0.06
817	300830	金现代	600	5,478.00	0.06
818	000068	华控赛格	1,600	5,472.00	0.06
819	600620	天宸股份	1,000	5,460.00	0.06
820	603088	宁波精达	600	5,454.00	0.06
820	603378	亚士创能	900	5,454.00	0.06
822	301129	瑞纳智能	200	5,432.00	0.06
823	000949	新乡化纤	1,400	5,418.00	0.06
824	002454	松芝股份	700	5,404.00	0.06
825	603598	引力传媒	300	5,394.00	0.06
826	605277	新亚电子	300	5,388.00	0.06
827	688533	上声电子	200	5,386.00	0.06
828	603421	鼎信通讯	800	5,384.00	0.06
829	000631	顺发恒业	1,800	5,364.00	0.06
830	002365	永安药业	200	5,350.00	0.05
831	603931	格林达	200	5,324.00	0.05
831	605086	龙高股份	200	5,324.00	0.05
833	605208	永茂泰	400	5,320.00	0.05
834	300161	华中数控	200	5,298.00	0.05
835	002238	天威视讯	600	5,286.00	0.05
836	300909	汇创达	200	5,282.00	0.05
837	605162	新中港	700	5,257.00	0.05
838	300425	中建环能	1,000	5,240.00	0.05
839	603718	海利生物	700	5,208.00	0.05
840	002976	瑞玛精密	200	5,200.00	0.05
841	600527	江南高纤	2,500	5,175.00	0.05
842	688155	先惠技术	100	5,162.00	0.05
843	002631	德尔未来	1,100	5,148.00	0.05
844	301199	迈赫股份	200	5,104.00	0.05
845	605018	长华集团	400	5,096.00	0.05
846	002255	海陆重工	600	5,052.00	0.05
847	600979	广安爱众	1,000	5,040.00	0.05
848	300293	蓝英装备	200	5,028.00	0.05
849	001380	华纬科技	244	4,997.12	0.05

850	603610	麒盛科技	400	4,996.00	0.05
851	002469	三维化学	600	4,986.00	0.05
852	600512	腾达建设	2,200	4,972.00	0.05
853	300486	东杰智能	600	4,962.00	0.05
854	002644	佛慈制药	600	4,950.00	0.05
855	600622	光大嘉宝	1,700	4,947.00	0.05
856	002692	远程股份	1,000	4,940.00	0.05
856	002970	锐明技术	100	4,940.00	0.05
856	600318	新力金融	500	4,940.00	0.05
859	600965	福成股份	1,000	4,920.00	0.05
860	300631	久吾高科	200	4,912.00	0.05
861	600838	上海九百	600	4,854.00	0.05
862	600327	大东方	1,000	4,850.00	0.05
863	002177	御银股份	600	4,836.00	0.05
864	002331	皖通科技	600	4,830.00	0.05
865	002066	瑞泰科技	400	4,808.00	0.05
866	301399	英特科技	241	4,807.95	0.05
867	600526	菲达环保	1,000	4,800.00	0.05
868	300307	慈星股份	600	4,794.00	0.05
869	002852	道道全	500	4,780.00	0.05
870	688678	福立旺	250	4,760.00	0.05
871	300730	科创信息	300	4,743.00	0.05
872	300531	优博讯	200	4,738.00	0.05
873	000759	中百集团	600	4,668.00	0.05
874	603121	华培动力	200	4,654.00	0.05
875	603095	越剑智能	280	4,600.40	0.05
876	603615	茶花股份	200	4,594.00	0.05
877	002406	远东传动	600	4,578.00	0.05
878	600386	北巴传媒	1,000	4,570.00	0.05
879	002134	天津普林	200	4,560.00	0.05
879	600262	北方股份	200	4,560.00	0.05
881	000639	西王食品	1,400	4,508.00	0.05
882	002282	博深股份	600	4,482.00	0.05
883	605218	伟时电子	200	4,476.00	0.05
884	300840	酷特智能	200	4,460.00	0.05
885	003005	竞业达	220	4,446.20	0.05
886	002735	王子新材	300	4,443.00	0.05
887	688299	长阳科技	224	4,428.48	0.05
888	600397	安源煤业	700	4,389.00	0.05
889	603038	华立股份	300	4,386.00	0.04
890	002731	萃华珠宝	300	4,380.00	0.04
891	000601	韶能股份	900	4,374.00	0.04
892	002553	南方精工	200	4,296.00	0.04
893	000037	深南电 A	500	4,280.00	0.04

894	000965	天保基建	1,100	4,268.00	0.04
895	688722	同益中	200	4,254.00	0.04
896	300040	九洲集团	600	4,248.00	0.04
897	000900	现代投资	1,000	4,230.00	0.04
898	300423	昇辉科技	600	4,224.00	0.04
899	300938	信测标准	201	4,223.01	0.04
900	002367	康力电梯	600	4,218.00	0.04
901	688239	航宇科技	120	4,197.60	0.04
902	300578	会畅通讯	200	4,194.00	0.04
903	300025	华星创业	600	4,164.00	0.04
904	600479	千金药业	400	4,160.00	0.04
905	001379	腾达科技	200	4,144.00	0.04
906	300553	集智股份	100	4,143.00	0.04
907	300577	开润股份	200	4,098.00	0.04
907	600501	航天晨光	200	4,098.00	0.04
909	300179	四方达	400	4,084.00	0.04
910	600694	大商股份	220	4,081.00	0.04
911	688225	亚信安全	200	4,078.00	0.04
912	000886	海南高速	600	4,032.00	0.04
912	605179	一鸣食品	200	4,032.00	0.04
914	300139	晓程科技	200	4,020.00	0.04
915	600353	旭光电子	300	4,002.00	0.04
916	601008	连云港	600	3,996.00	0.04
917	601579	会稽山	200	3,982.00	0.04
918	603518	锦泓集团	400	3,952.00	0.04
919	000096	广聚能源	300	3,939.00	0.04
920	300879	大叶股份	100	3,928.00	0.04
921	300822	贝仕达克	200	3,904.00	0.04
922	688143	长盈通	100	3,900.00	0.04
923	600853	龙建股份	1,100	3,894.00	0.04
924	301060	兰卫医学	400	3,860.00	0.04
925	300918	南山智尚	200	3,846.00	0.04
926	002361	神剑股份	600	3,762.00	0.04
927	601177	杭齿前进	200	3,746.00	0.04
928	000652	泰达股份	900	3,735.00	0.04
929	300411	金盾股份	300	3,711.00	0.04
930	002022	科华生物	600	3,684.00	0.04
931	603278	大业股份	400	3,640.00	0.04
932	600693	东百集团	600	3,600.00	0.04
933	605068	明新旭腾	200	3,594.00	0.04
934	688697	纽威数控	268	3,575.12	0.04
935	688716	中研股份	100	3,560.00	0.04
936	600300	维维股份	1,000	3,400.00	0.03
937	688108	赛诺医疗	300	3,366.00	0.03

938	605166	聚合顺	300	3,357.00	0.03
939	688593	新相微	200	3,266.00	0.03
940	688663	新风光	117	3,153.15	0.03
941	600558	大西洋	600	3,120.00	0.03
942	688253	英诺特	100	3,086.00	0.03
943	688579	山大地纬	267	2,987.73	0.03
944	300320	海达股份	300	2,982.00	0.03
945	688418	震有科技	100	2,646.00	0.03
946	601086	国芳集团	200	2,430.00	0.02
947	688312	燕麦科技	100	2,403.00	0.02
948	688733	壹石通	100	1,894.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	300280	*ST 紫天	400	3,496.00	0.04

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300972	万辰集团	94,451.00	0.51
2	002250	联化科技	71,147.00	0.39
3	002376	新北洋	66,509.00	0.36
4	002896	中大力德	62,768.00	0.34
5	002033	丽江股份	60,655.00	0.33
6	002031	巨轮智能	60,268.00	0.33
7	300766	每日互动	56,536.00	0.31
8	300718	长盛轴承	54,897.00	0.30
9	002515	金字火腿	52,380.00	0.28
10	000419	通程控股	49,257.00	0.27
11	002102	能特科技	49,062.00	0.27
12	002449	国星光电	48,805.00	0.26
13	002965	祥鑫科技	48,414.00	0.26
14	300790	宇瞳光学	48,391.00	0.26
15	002483	润邦股份	47,700.00	0.26
16	300098	高新兴	46,251.00	0.25
17	920799	艾融软件	45,754.00	0.25

18	000962	东方钨业	44,790.00	0.24
19	601956	东贝集团	44,704.00	0.24
20	002969	嘉美包装	43,038.00	0.23

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300972	万辰集团	156,929.00	0.85
2	002031	巨轮智能	128,439.00	0.70
3	002250	联化科技	95,775.00	0.52
4	300377	赢时胜	93,015.00	0.50
5	300766	每日互动	87,485.00	0.47
6	300548	长芯博创	84,706.00	0.46
7	300718	长盛轴承	84,390.00	0.46
8	300100	双林股份	83,933.40	0.46
9	002896	中大力德	80,203.00	0.43
10	300607	拓斯达	77,449.00	0.42
11	002611	东方精工	73,251.00	0.40
12	300276	三丰智能	71,475.00	0.39
13	300493	润欣科技	69,667.00	0.38
14	300184	力源信息	69,398.00	0.38
15	002979	雷赛智能	66,888.00	0.36
16	920799	艾融软件	66,550.70	0.36
17	300925	法本信息	65,058.00	0.35
18	002376	新北洋	63,976.00	0.35
19	300010	豆神教育	63,080.00	0.34
20	002881	美格智能	61,237.00	0.33

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	20,738,106.43
卖出股票的收入（成交）总额	28,295,208.92

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体未发现有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 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情况。

7.11.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	15,682.04
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,682.04

7.11.4 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可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	688313	仕佳光子	30,440.00	0.31	重大事项

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	300280	*ST 紫天	3,496.00	0.04	重大事项

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
488	17,122.95	3,337,898.00	39.95%	5,018,102.00	60.05%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	2,198,644.00	26.31%
2	胡晓明	1,000,000.00	11.97%
3	上海万丰友方投资管理有限公司	919,500.00	11.00%
4	王晓丽	351,000.00	4.20%
5	朱大立	291,800.00	3.49%
6	马玉明	249,800.00	2.99%
7	范丹	211,400.00	2.53%
8	刘长元	209,000.00	2.50%
9	余康华	100,000.00	1.20%
10	胡晓	94,000.00	1.12%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 13 日）基金份额总额	600,356,000.00
本报告期期初基金份额总额	18,356,000.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	22,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,356,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，大会投票表决起止时间为自 2025 年 4 月 16 日起至 2025 年 5 月 19 日 17:00 止。参加本次基金份额持有人大会投票表决的本基金基金份额持有人及代理人所持基金份额共计 9,464,244.00 份，占本基金权益登记日基金总份额 18,356,000.00 份的 51.56%，达到法定开会条件，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定。

本次基金份额持有人大会审议了《关于国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金持续运作的议案》，并由参加大会的基金份额持有人及代理人对本次会议议案进行表决，表决结果为：9,464,244.00 份基金份额同意，0 份基金份额反对，0 份基金份额弃权。同意本次会议议案的基金份额占参加本次会议表决的持有人及代理人所持表决权的 100%，达二分之一以上，符合《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》和本基金基金合同的有关规定，本次会议议案获得通过。

根据本次基金份额持有人大会决议，本基金将根据基金合同现有规定持续运作。本基金基金管理人将根据本基金基金合同的规定，继续依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，本基金管理人重大人事变动如下：

2025 年 5 月 30 日，本基金管理人发布了《国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，经本基金管理人第八届董事会第三十六次会议审议通过，刘国华女士离任公司督察长，公司总经理李昇代任督察长。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2025-05-09
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	个别机制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已完成整改。
其他	无

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华金证券	1	24,287,281.96	49.53%	3,301.45	42.87%	-
申万宏源证券	3	17,318,558.89	35.32%	3,392.41	44.05%	-
中信建投	6	7,427,474.50	15.15%	1,007.19	13.08%	-

注：1、交易单元的选择标准：

- （1）实力雄厚、信誉良好；
- （2）财务状况良好，经营行为稳健、规范，合规风控能力较强；
- （3）具备基金交易所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理本公司管理的基金进行证券交易的需要；
- （4）研究实力较强，能及时为本公司管理的基金提供高质量服务，包括但不限于各类研究分析

报告、上市公司路演及反路演、各类研究策略会等。

2、选择程序：

券商按照我司要求提供机构情况介绍说明，该说明作为券商尽调材料进行内部审议，符合要求的券商经批准进入券商白名单，白名单内的券商根据其提供的研究服务情况进行考评，符合交易席位租用标准的，经审批后可成为我司签约券商并签订交易业务单元租用协议。

3、本基金本报告期内中信建投增加 2 个席位；中信建投减少 1 个席位。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
华金证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	《证券时报》	2025-04-12
2	关于以通讯方式召开国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	《证券时报》	2025-04-16
3	关于以通讯方式召开国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	《证券时报》	2025-04-17
4	关于以通讯方式召开国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	《证券时报》	2025-04-18
5	国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	《证券时报》	2025-05-21
6	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公	《中国证券报》	2025-05-30

	告		
--	---	--	--

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	8,150,644.00	11,336,500.00	17,288,500.00	2,198,644.00	26.31%
产品特有风险							
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份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层。

基金托管人住所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二五年八月三十日