

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
2026 年中期报告
2026 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：二〇二六年八月三十一日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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 2026 年 08 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2026 年 01 月 01 日起至 2026 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	11
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	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
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	13
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	13
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	35
7.1 期末基金资产组合情况	35
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	35
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	59
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	59
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	59
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	59
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	盈利投资者数量占比	61
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	61
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	61
9	开放式基金份额变动	62
10	重大事件揭示	62
10.1	基金份额持有人大会决议	62
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	62
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	62
10.4	基金投资策略的改变	62
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	62
10.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	62
10.7	基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	63
10.8	其他重大事件	64
11	影响投资者决策的其他重要信息	64
12	备查文件目录	64
12.1	备查文件目录	64
12.2	存放地点	65
12.3	查阅方式	65

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	中证 2000ETF 国泰
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	22,356,000.00 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	倪莹	邱珂磊
	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	100020
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》
登载基金中期报告的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告置备地点	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（2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	5,768,916.62
本期利润	2,490,130.83
加权平均基金份额本期利润	0.1118
本期加权平均净值利润率	7.32%
本期基金份额净值增长率	9.02%

3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	11,759,956.78
期末可供分配基金份额利润	0.5260
期末基金资产净值	34,115,956.78
期末基金份额净值	1.5260
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	52.60%

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。

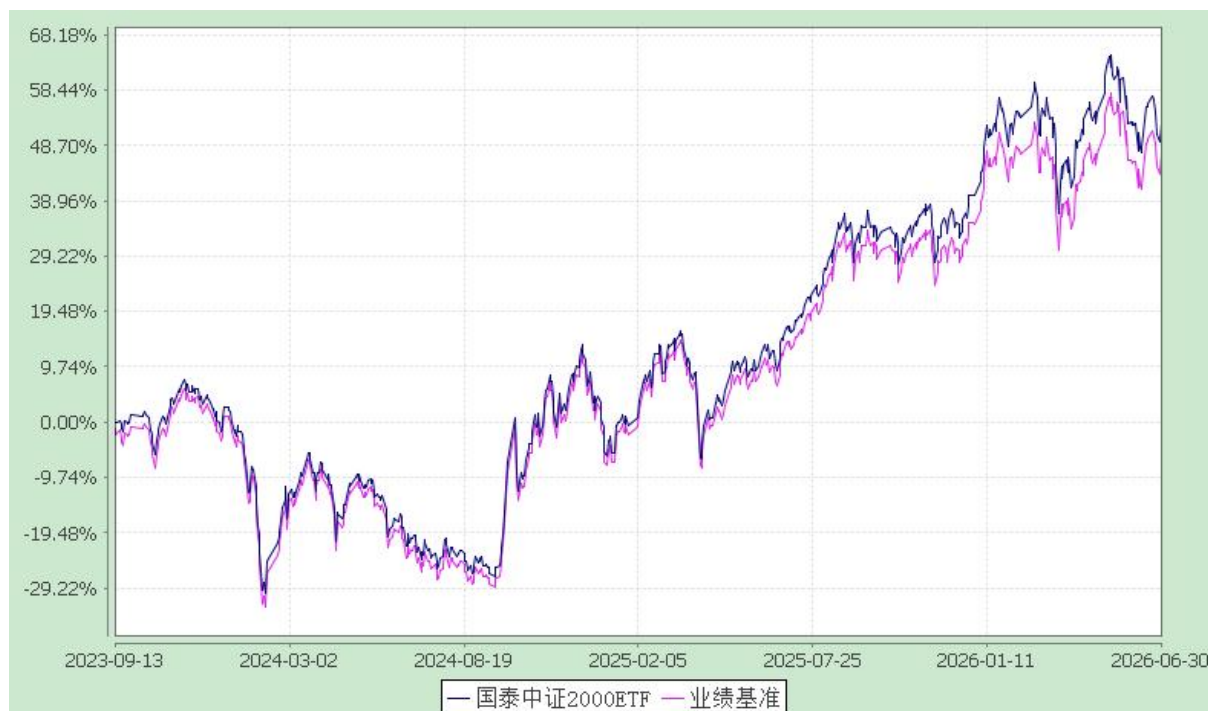
3.2 基金净值表现

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
过去三个月	6.05%	1.58%	7.78%	1.62%	-1.73%	-0.04%
过去六个月	9.02%	1.65%	9.10%	1.68%	-0.08%	-0.03%
过去一年	30.81%	1.40%	29.14%	1.42%	1.67%	-0.02%
自基金合同生效起至今	52.60%	1.84%	47.10%	1.91%	5.50%	-0.07%

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

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 2026 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 2026 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 319 只公开募集证券投资基金。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		
麻绎文	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、国泰上证科创板人工智能 ETF 的基金经理	2023-09-13	-	6 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，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板人工智能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、国泰上证科创板芯片 ETF 发起联接、国泰中证港股通汽车产业主题 ETF、国泰创业板医药卫生 ETF 发起联接、国泰创业板人工智能 ETF 发起联接的基金经理	2025-04-11	-	6 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，2025 年 9 月起兼任国泰上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、国泰中证港股通汽车产业主题交易型开放式指数证券投资基金和国泰创业板医药卫生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，2025 年 10 月起兼任国泰创业板人工智能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。

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 and 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，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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% 的交易共 10 次，为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。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

2026 年一季度，市场大幅波动，开年 A 股单日成交量一度逼近 4 万亿元，随后市场不断降温并进入震荡阶段。受地缘风险因素影响，全球避险情绪升温，A 股市场在季度末出现了较大幅度调整，中证 2000 指数整体先涨后跌。

2026 年二季度，市场分化加剧，科技板块与非科技板块走势差异显著，AI 相关板块涨幅明显，其他板块大都出现不同程度回调。地缘政治方面，紧张局势较一季度有所缓和。中证 2000 指数在 4 月上涨后进入宽幅震荡阶段。

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。2026 年二季度，受市场风格较为极致的影响，小微盘风格虽有绝对收益，但相对大盘跑出一定负超额。不过从产业趋势、宏观及流动性环境、资本市场建设方向等因素看，小微盘风格仍有望进一步演绎。

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 9.02%，同期业绩比较基准收益率为 9.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，随着宏观政策逐步落地，提振内需趋势进一步强化，市场风险偏好有望维持在较高位置，为中小盘股票提供流动性支撑。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。随着资金面逐步从增量市向存量市转变，指数层面出现系统性估值提升的概率相对不大，缺乏基本面支撑的个股可能面临较大调整压力。

综合来看，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合规守信、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的真实、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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	586,744.42	591,626.78
结算备付金		151,902.74	-
存出保证金		17,941.85	16,332.19
交易性金融资产	6.4.7.2	33,386,892.43	30,703,380.91
其中：股票投资		33,386,892.43	30,703,380.91
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		34,143,481.44	31,311,339.88
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 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		14,007.35	13,037.24
应付托管费		2,801.46	2,607.44
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	10,715.85	1,997.02
负债合计		27,524.66	17,641.70
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	22,356,000.00	22,356,000.00
未分配利润	6.4.7.8	11,759,956.78	8,937,698.18
净资产合计		34,115,956.78	31,293,698.18
负债和净资产总计		34,143,481.44	31,311,339.88

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5260 元，基金份额总额 22,356,000.00 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		2,590,831.89	3,102,183.56
1.利息收入		2,054.42	1,649.65
其中：存款利息收入	6.4.7.9	2,054.42	1,649.65
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）		5,892,286.65	3,131,673.10

其中：股票投资收益	6.4.7.10	5,743,930.43	3,069,784.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	599.90	-
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	147,756.32	61,888.31
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	-3,278,785.79	-157,582.89
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	-24,723.39	126,443.70
减：二、营业总支出		100,701.06	44,850.65
1. 管理人报酬		83,917.60	37,375.47
2. 托管费		16,783.46	7,475.18
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	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,490,130.83	3,057,332.91
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,490,130.83	3,057,332.91
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		2,490,130.83	3,057,332.91

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	22,356,000.00	8,937,698.18	31,293,698.18
二、本期期初净资产	22,356,000.00	8,937,698.18	31,293,698.18

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	0.00	2,822,258.60	2,822,258.60
（一）、综合收益总额	-	2,490,130.83	2,490,130.83
（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）	0.00	332,127.77	332,127.77
其中：1.基金申购款	10,000,000.00	5,903,311.89	15,903,311.89
2.基金赎回款	-10,000,000.00	-5,571,184.12	-15,571,184.12
（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	22,356,000.00	11,759,956.78	34,115,956.78
项目	上年度可比期间 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

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：吴洪涛，会计机构负责人：张洁清

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 2026 年 8 月 27 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,同时亦按照中国证券投资基金业协会(以下简称“基金业协会”)颁布的《公开募集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》、《证券投资基金会计核算业务指引》及中国证监会、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 2026 年 6 月 30 日的财务状况、2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 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》、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》、财税[2025] 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10 号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》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) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照 3% 的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自 2026 年 1 月 1 日至 2027 年 12 月 31 日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、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。对本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。

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

d) 本基金卖出股票按 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) 对本基金运营过程中缴纳的增值税,分别按照本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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	586,744.42
等于: 本金	586,630.17
加: 应计利息	114.25
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	586,744.42

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		34,022,006.16	-	33,386,892.43	-635,113.73
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		34,022,006.16	-	33,386,892.43	-635,113.73

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 2026 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	10,715.85
其中：交易所市场	10,715.85
银行间市场	-
应付利息	-
合计	10,715.85

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	22,356,000.00	22,356,000.00
本期申购	10,000,000.00	10,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-10,000,000.00	-10,000,000.00
本期末	22,356,000.00	22,356,000.00

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	12,728,103.93	-3,790,405.75	8,937,698.18
本期期初	12,728,103.93	-3,790,405.75	8,937,698.18
本期利润	5,768,916.62	-3,278,785.79	2,490,130.83
本期基金份额交易产生的变动数	15,089.76	317,038.01	332,127.77
其中：基金申购款	6,792,200.44	-888,888.55	5,903,311.89
基金赎回款	-6,777,110.68	1,205,926.56	-5,571,184.12
本期已分配利润	-	-	-
本期末	18,512,110.31	-6,752,153.53	11,759,956.78

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	1,904.35
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	130.22

其他	19.85
合计	2,054.42

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,299,244.77
股票投资收益——赎回差价收入	444,685.66
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	5,743,930.43

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	57,143,408.34
减：卖出股票成本总额	51,787,138.30
减：交易费用	57,025.27
买卖股票差价收入	5,299,244.77

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	15,571,184.12
减：现金支付赎回款总额	10,457,280.12
减：赎回股票成本总额	4,669,218.34
减：交易费用	-
赎回差价收入	444,685.66

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.20
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	599.70

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	599.90

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,600.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,000.00
减：应计利息总额	0.20
减：交易费用	0.10
买卖债券差价收入	599.70

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 2026年1月1日至2026年6月30日
股票投资产生的股利收益	147,756.32
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	147,756.32

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年1月1日至2026年6月30日
1.交易性金融资产	-3,278,785.79
——股票投资	-3,278,785.79
——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	-3,278,785.79

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 2026年1月1日至2026年6月30日
基金赎回费收入	-
ETF 替代损益	-24,723.39
合计	-24,723.39

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、关联关系

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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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	8,968.00	0.01%	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			
	2026年1月1日至2026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	1.21	0.01%	1.21	0.01%
关联方名称	上年度可比期间			
	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%

注：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。

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	83,917.60	37,375.47
其中：应支付销售机构的客户维护费	16,390.78	944.25
应支付基金管理人的净管理费	67,526.82	36,431.22

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 2026年1月1日至2026年6月 30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,783.46	7,475.18

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

份额单位：份

项目	本期 2026年1月1日至2026年6月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年6月30日
期初持有的基金份额	16,245,500.00	-
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份	-	-

额		
减：期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	16,245,500.00	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	72.67%	-

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

本基金本报告期末及上年度末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	
	2026年1月1日至2026年6月30日		2025年1月1日至2025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	586,744.42	1,904.35	720,094.26	1,476.56

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

本报告期内，本基金在迷你期间如涉及信息披露费、审计费等固定费用的，上述费用由基金管理人承担，不再从基金资产中列支。除前述事项外，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（2026 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
000524	岭南控股	2026-06-24	重大事项停牌	8.95	2026-07-08	9.85	1,800.00	20,551.56	16,110.00	-
300332	天壕能源	2026-06-26	重大事项停牌	4.30	2026-07-09	4.64	14,000.00	74,159.46	60,200.00	-

注：本基金截至 2026 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 2026 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2025 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 2026 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，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 2026 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	586,744.42	-	-	-	586,744.42
结算备付金	151,902.74	-	-	-	151,902.74
存出保证金	17,941.85	-	-	-	17,941.85
交易性金融资产	-	-	-	33,386,892.43	33,386,892.43

资产总计	756,589.01	-	-	33,386,892.43	34,143,481.44
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	14,007.35	14,007.35
应付托管费	-	-	-	2,801.46	2,801.46
其他负债	-	-	-	10,715.85	10,715.85
负债总计	-	-	-	27,524.66	27,524.66
利率敏感度缺口	756,589.01	-	-	33,359,367.77	34,115,956.78
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	591,626.78	-	-	-	591,626.78
存出保证金	16,332.19	-	-	-	16,332.19
交易性金融资产	-	-	-	30,703,380.91	30,703,380.91
资产总计	607,958.97	-	-	30,703,380.91	31,311,339.88
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	13,037.24	13,037.24
应付托管费	-	-	-	2,607.44	2,607.44
其他负债	-	-	-	1,997.02	1,997.02
负债总计	-	-	-	17,641.70	17,641.70
利率敏感度缺口	607,958.97	-	-	30,685,739.21	31,293,698.18

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 2026 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%（2025 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（2025 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025 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	33,386,892.43	97.86	30,703,380.91	98.11
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	33,386,892.43	97.86	30,703,380.91	98.11

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,667,275.90	增加约 1,540,310.48
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,667,275.90	减少约 1,540,310.48

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	33,310,582.43	30,703,380.91
第二层次	76,310.00	-
第三层次	-	-
合计	33,386,892.43	30,703,380.91

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 2026 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(2025 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 2026 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 15,903,311.89 元(2025 年上半年度：12,028,392.43 元)，其中包括以股票支付的申购款 5,303,731.00 元和以现金支付的申购款 10,599,580.89 元(2025 年上半年度：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)。

(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	33,386,892.43	97.78
	其中：股票	33,386,892.43	97.78
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	738,647.16	2.16
8	其他各项资产	17,941.85	0.05
9	合计	34,143,481.44	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	178,757.00	0.52
B	采矿业	452,625.00	1.33
C	制造业	25,954,503.91	76.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	567,881.00	1.66
E	建筑业	515,201.00	1.51
F	批发和零售业	1,138,259.46	3.34
G	交通运输、仓储和邮政业	327,121.00	0.96
H	住宿和餐饮业	70,478.00	0.21
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,260,284.03	6.63
J	金融业	23,478.00	0.07
K	房地产业	295,630.00	0.87
L	租赁和商务服务业	468,508.28	1.37
M	科学研究和技术服务业	511,076.75	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	360,107.00	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	66,634.00	0.20
Q	卫生和社会工作	34,374.00	0.10
R	文化、体育和娱乐业	149,884.00	0.44
S	综合	12,090.00	0.04
	合计	33,386,892.43	97.86

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	300903	科翔股份	1,500	151,965.00	0.45
2	603629	利通电子	800	143,048.00	0.42

3	603186	华正新材	600	135,180.00	0.40
4	688257	新锐股份	1,296	132,062.40	0.39
5	300201	海伦哲	6,000	126,420.00	0.37
6	300489	光智科技	400	124,780.00	0.37
7	002491	通鼎互联	3,800	123,120.00	0.36
8	301086	鸿富瀚	520	108,825.60	0.32
9	688233	神工股份	500	107,210.00	0.31
10	002975	博杰股份	720	102,240.00	0.30
11	002655	共达电声	2,200	101,200.00	0.30
12	603738	泰晶科技	1,600	96,080.00	0.28
13	603061	金海通	190	95,421.80	0.28
14	301093	华兰股份	700	94,941.00	0.28
15	600367	红星发展	1,500	94,395.00	0.28
16	688028	沃尔德	600	93,522.00	0.27
17	300975	商络电子	1,800	93,150.00	0.27
18	300842	帝科股份	1,020	90,953.40	0.27
19	300179	四方达	1,500	89,145.00	0.26
20	300005	探路者	3,900	88,140.00	0.26
21	300263	隆华科技	5,400	88,020.00	0.26
22	603538	美诺华	2,700	87,885.00	0.26
23	300139	晓程科技	2,400	87,720.00	0.26
24	605289	罗曼股份	580	84,100.00	0.25
25	688143	长盈通	460	80,904.80	0.24
26	688378	奥来德	1,300	80,600.00	0.24
27	301150	中一科技	1,260	79,518.60	0.23
28	000510	新金路	3,200	79,488.00	0.23
29	002937	兴瑞科技	1,800	79,074.00	0.23
30	300843	胜蓝股份	500	78,125.00	0.23
31	603031	安孚科技	1,460	77,745.00	0.23
32	301285	鸿日达	700	77,231.00	0.23
33	300164	通源石油	9,600	76,800.00	0.23
34	300302	同有科技	1,500	76,755.00	0.22
35	002587	奥拓电子	9,800	76,538.00	0.22
36	688653	康希通信	4,377	76,072.26	0.22
37	688090	瑞松科技	707	75,260.15	0.22
38	002446	盛路通信	6,900	74,106.00	0.22
39	301369	联动科技	300	73,500.00	0.22
40	688662	富信科技	434	72,912.00	0.21
41	688308	欧科亿	400	72,724.00	0.21
42	300277	汽轮科技	4,800	72,192.00	0.21
43	688383	新益昌	383	72,019.32	0.21
44	002348	高乐股份	6,800	71,672.00	0.21
45	600722	金牛化工	8,800	71,456.00	0.21
46	300452	山河药辅	6,100	71,248.00	0.21

47	300331	苏大维格	1,000	71,110.00	0.21
48	300951	博硕科技	1,400	70,700.00	0.21
49	002079	苏州固锴	4,700	70,641.00	0.21
50	605222	起帆电缆	3,000	69,960.00	0.21
51	300191	潜能恒信	2,500	69,125.00	0.20
52	603281	江瀚新材	1,700	69,071.00	0.20
53	300835	龙磁科技	300	68,847.00	0.20
54	688268	华特气体	257	68,747.50	0.20
55	002342	巨力索具	6,500	68,315.00	0.20
56	600397	江钨装备	2,500	68,075.00	0.20
57	001314	亿道信息	1,100	67,980.00	0.20
58	301248	杰创智能	800	67,144.00	0.20
59	002134	天津普林	2,200	66,924.00	0.20
60	002206	海利得	12,900	66,693.00	0.20
61	688510	航亚科技	2,787	66,553.56	0.20
62	002361	神剑股份	4,400	66,220.00	0.19
63	300905	宝丽迪	1,300	65,780.00	0.19
64	688620	安凯微	4,059	65,755.80	0.19
65	600590	泰豪科技	6,500	65,650.00	0.19
66	688202	美迪西	809	65,294.39	0.19
67	300055	万邦达	10,100	64,943.00	0.19
68	300516	久之洋	1,980	64,864.80	0.19
69	300790	宇瞳光学	2,480	64,752.80	0.19
70	002066	瑞泰科技	3,100	64,573.00	0.19
71	688456	有研粉材	462	64,495.20	0.19
72	300909	汇创达	1,100	64,042.00	0.19
73	301186	超达装备	1,560	63,960.00	0.19
74	688275	万润新能	501	63,902.55	0.19
75	688661	和林微纳	400	63,592.00	0.19
76	688677	海泰新光	628	63,509.64	0.19
77	300745	欣锐科技	1,500	63,330.00	0.19
78	300938	信测标准	1,261	62,898.68	0.18
79	002943	宇晶股份	1,410	62,364.30	0.18
80	300429	强力新材	3,500	62,020.00	0.18
81	300709	精研科技	1,100	61,875.00	0.18
82	002645	华宏科技	2,240	61,622.40	0.18
83	688319	欧林生物	1,401	61,615.98	0.18
84	300272	开能健康	11,700	61,542.00	0.18
85	688239	航宇科技	1,023	61,206.09	0.18
86	301021	英诺激光	500	60,950.00	0.18
87	605056	咸亨国际	3,800	60,800.00	0.18
88	688535	华海诚科	325	60,775.00	0.18
89	000070	特发信息	2,900	60,436.00	0.18
90	002448	中原内配	4,900	60,270.00	0.18

91	300332	天壕能源	14,000	60,200.00	0.18
92	300756	金马游乐	1,820	60,151.00	0.18
93	688508	芯朋微	647	60,145.12	0.18
94	605366	宏柏新材	4,600	59,938.00	0.18
95	688059	华锐精密	300	59,913.00	0.18
96	002876	三利谱	1,700	59,857.00	0.18
97	603618	杭电股份	1,200	59,856.00	0.18
98	002533	金杯电工	5,600	59,752.00	0.18
99	300700	岱勒新材	2,800	59,584.00	0.17
100	002210	飞马国际	28,100	59,572.00	0.17
101	002803	吉宏股份	2,300	59,432.00	0.17
102	603931	格林达	1,000	59,400.00	0.17
103	300461	田中精机	1,600	59,264.00	0.17
104	301128	强瑞技术	380	59,242.00	0.17
105	688046	药康生物	2,436	58,951.20	0.17
106	000922	佳电股份	4,220	58,911.20	0.17
107	600724	宁波富达	11,600	58,812.00	0.17
108	600396	华电辽能	3,900	58,344.00	0.17
109	002787	华源控股	1,800	57,960.00	0.17
110	301013	利和兴	800	57,800.00	0.17
111	300786	国林科技	2,300	57,661.00	0.17
112	300053	航宇微	3,500	57,575.00	0.17
113	000968	蓝焰控股	9,600	57,504.00	0.17
114	002167	东方锆业	2,600	57,382.00	0.17
115	603938	三孚股份	800	57,320.00	0.17
116	002559	亚威股份	4,500	57,195.00	0.17
117	301328	维峰电子	800	56,960.00	0.17
118	688428	诺诚健华	1,985	56,512.95	0.17
119	002969	嘉美包装	4,000	56,320.00	0.17
120	603011	合锻智能	1,700	56,236.00	0.16
121	688381	帝奥微	1,051	56,228.50	0.16
122	603936	博敏电子	2,100	56,091.00	0.16
123	002833	弘亚数控	2,900	55,941.00	0.16
124	603507	振江股份	1,700	55,913.00	0.16
125	300467	迅游科技	1,500	55,770.00	0.16
126	603125	常青科技	1,700	55,658.00	0.16
127	603002	宏昌电子	2,300	55,591.00	0.16
128	603626	科森科技	3,000	55,500.00	0.16
129	688556	高测股份	4,177	55,470.56	0.16
130	300382	斯莱克	2,400	55,464.00	0.16
131	002455	百川股份	7,700	55,440.00	0.16
132	688711	宏微科技	1,219	55,403.55	0.16
133	603990	麦迪科技	2,600	55,354.00	0.16
134	002990	盛视科技	700	55,300.00	0.16

135	688719	爱科赛博	718	55,286.00	0.16
136	300740	水羊股份	3,000	55,230.00	0.16
137	000509	华塑控股	14,800	55,204.00	0.16
138	002284	亚太股份	5,800	55,042.00	0.16
139	301382	蜂助手	1,195	54,970.00	0.16
140	002957	科瑞技术	1,000	54,840.00	0.16
141	603823	百合花	1,000	54,570.00	0.16
142	688507	索辰科技	202	54,475.36	0.16
143	603078	江化微	1,100	54,362.00	0.16
144	688311	盟升电子	2,071	54,239.49	0.16
145	002169	智光电气	3,700	54,168.00	0.16
146	002283	天润工业	5,600	54,040.00	0.16
147	002741	光华科技	1,500	53,610.00	0.16
148	688173	希荻微	2,800	53,592.00	0.16
149	603181	皇马科技	3,300	53,526.00	0.16
150	301188	力诺药包	800	53,520.00	0.16
151	300042	朗科科技	700	53,319.00	0.16
152	688518	联赢激光	1,720	53,148.00	0.16
153	301060	兰卫医学	6,500	53,105.00	0.16
154	688663	新风光	600	53,076.00	0.16
155	002796	世嘉科技	1,300	53,014.00	0.16
156	301183	东田微	200	52,974.00	0.16
157	600152	维科技术	5,300	52,947.00	0.16
158	300041	回天新材	3,400	52,836.00	0.15
159	300940	南极光	3,500	52,780.00	0.15
159	688416	恒烁股份	377	52,780.00	0.15
161	300739	明阳电路	1,500	52,710.00	0.15
162	688176	亚虹医药	5,309	52,665.28	0.15
163	300731	科创新源	900	52,524.00	0.15
164	300596	利安隆	1,000	52,480.00	0.15
165	002328	新朋股份	7,100	52,114.00	0.15
166	002515	金字火腿	5,200	52,052.00	0.15
167	600103	青山纸业	16,900	51,883.00	0.15
168	002810	山东赫达	2,100	51,870.00	0.15
169	300132	青松股份	9,100	51,688.00	0.15
170	002437	誉衡药业	19,100	51,570.00	0.15
171	300681	英搏尔	1,800	51,516.00	0.15
172	688609	九联科技	4,678	51,504.78	0.15
173	688087	英科再生	1,541	51,500.22	0.15
174	688135	利扬芯片	1,223	51,463.84	0.15
175	688199	久日新材	1,490	51,449.70	0.15
176	601886	江河集团	6,400	51,392.00	0.15
177	002052	同洲电子	6,600	51,282.00	0.15
178	300647	超频三	8,600	51,170.00	0.15

179	688020	方邦股份	205	51,168.00	0.15
180	605060	联德股份	900	51,066.00	0.15
181	300048	合康新能	10,900	50,903.00	0.15
182	600838	上海九百	7,100	50,765.00	0.15
183	688562	航天软件	3,368	50,722.08	0.15
184	300863	卡倍亿	660	50,575.80	0.15
185	300499	高澜股份	1,300	50,310.00	0.15
186	603660	苏州科达	4,100	50,225.00	0.15
187	301319	唯特偶	300	50,199.00	0.15
188	603112	华翔股份	3,000	50,190.00	0.15
189	300900	广联航空	1,300	50,141.00	0.15
190	300389	艾比森	3,900	49,998.00	0.15
191	605389	长龄液压	520	49,920.00	0.15
192	000850	华茂股份	14,200	49,842.00	0.15
193	603528	多伦科技	8,500	49,810.00	0.15
194	002565	顺灏股份	3,900	49,413.00	0.14
195	000554	泰山石油	8,800	49,368.00	0.14
196	300541	先进数通	5,100	49,215.00	0.14
197	600288	大恒科技	3,700	49,210.00	0.14
198	301366	一博科技	800	48,936.00	0.14
199	002708	光洋股份	3,700	48,803.00	0.14
200	002552	宝鼎科技	800	48,800.00	0.14
201	002805	丰元股份	1,700	48,603.00	0.14
202	300222	科大智能	3,500	48,475.00	0.14
203	002161	远望谷	9,000	48,420.00	0.14
204	002935	天奥电子	2,200	48,268.00	0.14
205	688359	三孚新科	243	48,220.92	0.14
206	300507	苏奥传感	6,400	48,192.00	0.14
207	301529	福赛科技	500	48,180.00	0.14
208	300401	花园生物	2,200	48,158.00	0.14
209	002255	海陆重工	4,900	48,118.00	0.14
210	300720	海川智能	500	48,100.00	0.14
211	603977	国泰集团	2,900	47,879.00	0.14
212	002886	沃特股份	1,700	47,753.00	0.14
213	688210	统联精密	1,172	47,477.72	0.14
214	688513	苑东生物	1,079	47,432.84	0.14
215	600530	交大昂立	9,600	47,328.00	0.14
216	002649	博彦科技	5,800	47,212.00	0.14
217	688488	艾迪药业	3,669	47,146.65	0.14
218	300752	隆利科技	3,500	47,145.00	0.14
219	300587	天铁科技	12,200	46,970.00	0.14
220	300480	光力科技	1,100	46,948.00	0.14
221	688277	天智航	2,745	46,939.50	0.14
222	000419	通程控股	10,400	46,904.00	0.14

223	002111	威海广泰	5,200	46,800.00	0.14
223	002660	茂硕电源	7,200	46,800.00	0.14
225	300016	北陆药业	6,100	46,787.00	0.14
226	603199	九华旅游	1,500	46,740.00	0.14
227	688334	西高院	2,576	46,728.64	0.14
228	600336	澳柯玛	7,500	46,725.00	0.14
229	002980	华盛昌	400	46,616.00	0.14
230	300252	金信诺	2,700	46,575.00	0.14
231	300420	五洋自控	4,900	46,354.00	0.14
232	002154	报喜鸟	13,000	46,280.00	0.14
233	001298	好上好	2,230	46,272.50	0.14
234	688499	利元亨	880	46,244.00	0.14
235	000153	丰原药业	9,120	46,238.40	0.14
236	300129	泰胜风能	5,400	46,170.00	0.14
237	605016	百龙创园	1,786	46,168.10	0.14
238	603131	上海沪工	2,700	45,954.00	0.13
239	300508	维宏股份	800	45,944.00	0.13
240	300590	移为通信	3,200	45,920.00	0.13
241	300228	富瑞特装	6,200	45,880.00	0.13
242	300520	科大国创	1,700	45,798.00	0.13
243	301280	珠城科技	900	45,513.00	0.13
244	688598	金博股份	919	45,444.55	0.13
245	300572	安车检测	1,600	45,392.00	0.13
246	300586	美联新材	2,900	45,356.00	0.13
247	300569	天能重工	9,400	45,308.00	0.13
248	301117	佳缘科技	1,940	45,299.00	0.13
249	603600	永艺股份	5,100	45,237.00	0.13
250	300145	南方泵业	8,300	45,235.00	0.13
251	002471	中超控股	7,500	45,225.00	0.13
252	000655	金岭矿业	7,100	45,156.00	0.13
253	688539	高华科技	1,416	45,142.08	0.13
254	300629	新劲刚	2,100	45,066.00	0.13
255	600203	福日电子	3,700	44,955.00	0.13
256	002986	宇新股份	3,800	44,954.00	0.13
257	301568	思泰克	400	44,640.00	0.13
258	002627	三峡旅游	7,800	44,538.00	0.13
259	688697	纽威数控	3,273	44,480.07	0.13
260	603703	盛洋科技	4,000	44,400.00	0.13
261	002467	二六三	9,500	44,365.00	0.13
262	300959	线上线下	300	44,343.00	0.13
263	002785	万里石	1,000	44,310.00	0.13
264	000700	模塑科技	3,000	44,280.00	0.13
265	603601	再升科技	3,600	44,208.00	0.13
266	301080	百普赛斯	920	44,160.00	0.13

267	300227	光韵达	3,700	44,030.00	0.13
268	600973	宝胜股份	6,200	43,958.00	0.13
269	002330	得利斯	12,700	43,942.00	0.13
270	301379	天山电子	1,540	43,797.60	0.13
271	002218	拓日新能	11,400	43,776.00	0.13
272	002445	中南文化	15,400	43,736.00	0.13
273	600189	泉阳泉	5,800	43,674.00	0.13
274	603085	天成自控	4,000	43,480.00	0.13
275	688636	智明达	1,200	43,476.00	0.13
276	300946	恒而达	1,100	43,329.00	0.13
277	605133	嵘泰股份	1,100	43,307.00	0.13
278	002765	蓝黛科技	6,200	43,152.00	0.13
279	688196	卓越新能	1,200	43,080.00	0.13
280	002440	闰土股份	4,200	43,050.00	0.13
281	301629	矽电股份	100	43,040.00	0.13
282	002150	正泰电源	1,700	42,993.00	0.13
283	601121	宝地矿业	7,600	42,864.00	0.13
284	300304	云意电气	2,400	42,840.00	0.13
284	301007	德迈仕	1,400	42,840.00	0.13
286	300444	双杰电气	3,500	42,735.00	0.13
287	601339	百隆东方	6,300	42,651.00	0.13
288	002564	天沃科技	9,900	42,570.00	0.12
289	688222	成都先导	1,324	42,513.64	0.12
290	603187	海容冷链	3,700	42,513.00	0.12
291	603998	方盛制药	4,700	42,441.00	0.12
292	300248	新开普	5,500	42,405.00	0.12
293	300358	楚天科技	5,300	42,400.00	0.12
294	688117	圣诺生物	1,567	42,356.01	0.12
295	002849	威星智能	2,500	42,300.00	0.12
296	688085	三友医疗	3,532	42,278.04	0.12
297	300996	普联软件	3,880	42,253.20	0.12
298	002546	新联电子	5,800	42,224.00	0.12
299	688049	炬芯科技	898	42,125.18	0.12
300	688269	凯立新材	1,325	42,015.75	0.12
301	002376	新北洋	7,300	41,975.00	0.12
302	600571	信雅达	4,300	41,925.00	0.12
303	603197	保隆科技	1,500	41,910.00	0.12
304	601700	风范股份	9,600	41,856.00	0.12
305	300447	全信股份	2,800	41,804.00	0.12
306	003002	壶化股份	2,400	41,736.00	0.12
307	300862	蓝盾光电	2,000	41,680.00	0.12
308	002358	森源电气	7,500	41,625.00	0.12
309	300206	理邦仪器	3,400	41,582.00	0.12
310	603686	福龙马	3,200	41,344.00	0.12

311	002562	兄弟科技	9,500	41,325.00	0.12
311	300805	电声股份	5,700	41,325.00	0.12
313	301320	豪江智能	3,200	41,280.00	0.12
314	002115	三维通信	4,000	41,200.00	0.12
315	002579	中京电子	1,900	41,192.00	0.12
316	002956	西麦食品	1,980	41,104.80	0.12
317	002483	润邦股份	8,300	41,002.00	0.12
318	002885	京泉华	1,000	40,860.00	0.12
319	301257	普蕊斯	900	40,842.00	0.12
320	000886	海南高速	10,000	40,800.00	0.12
321	002177	御银股份	7,200	40,752.00	0.12
322	688339	亿华通	2,172	40,616.40	0.12
323	603380	易德龙	900	40,581.00	0.12
324	002441	众业达	5,200	40,560.00	0.12
325	300279	和晶科技	6,700	40,535.00	0.12
326	603980	吉华集团	6,100	40,504.00	0.12
327	603052	可川科技	500	40,495.00	0.12
328	603611	诺力股份	2,500	40,475.00	0.12
329	600731	湖南海利	7,900	40,448.00	0.12
330	688155	先惠技术	500	40,445.00	0.12
331	300434	金石亚药	3,600	40,428.00	0.12
332	000989	九芝堂	5,200	40,404.00	0.12
333	000782	恒申新材	5,000	40,400.00	0.12
334	000017	深中华 A	6,600	40,392.00	0.12
335	688667	菱电电控	302	40,362.30	0.12
336	002438	江苏神通	2,700	40,311.00	0.12
337	002666	德联集团	10,200	40,290.00	0.12
338	300046	台基股份	1,100	40,216.00	0.12
339	603271	永杰新材	900	40,005.00	0.12
340	300213	佳讯飞鸿	6,600	39,996.00	0.12
340	301201	诚达药业	1,100	39,996.00	0.12
342	603239	浙江仙通	2,700	39,987.00	0.12
343	002119	康强电子	1,000	39,920.00	0.12
344	601599	浙文影业	14,300	39,897.00	0.12
345	301292	海科新源	500	39,865.00	0.12
346	000751	锌业股份	6,500	39,780.00	0.12
347	605188	国光连锁	3,400	39,746.00	0.12
348	002478	常宝股份	6,400	39,552.00	0.12
349	002339	积成电子	5,700	39,501.00	0.12
350	002279	久其软件	6,900	39,468.00	0.12
351	300004	南风股份	3,900	39,390.00	0.12
352	603387	基蛋生物	5,200	39,312.00	0.12
353	002009	天奇股份	1,900	39,292.00	0.12
354	002272	川润股份	1,600	39,248.00	0.12

355	002908	德生科技	6,200	39,246.00	0.12
356	002899	英派斯	1,800	39,240.00	0.12
357	002560	通达股份	5,260	39,134.40	0.11
358	300696	爱乐达	1,500	39,045.00	0.11
359	603897	长城科技	1,200	38,952.00	0.11
360	600106	重庆路桥	8,500	38,930.00	0.11
361	600966	博汇纸业	8,100	38,718.00	0.11
362	603168	莎普爱思	8,200	38,704.00	0.11
363	603890	春秋电子	1,400	38,668.00	0.11
364	002842	翔鹭钨业	800	38,560.00	0.11
365	002375	亚厦股份	11,400	38,532.00	0.11
366	000823	超声电子	1,500	38,475.00	0.11
367	002638	勤上股份	8,700	38,454.00	0.11
368	300486	东杰智能	1,800	38,430.00	0.11
369	601956	东贝集团	8,300	38,346.00	0.11
370	300612	宣亚国际	3,500	38,255.00	0.11
371	688219	会通股份	2,956	38,250.64	0.11
372	603399	永杉锂业	1,700	38,216.00	0.11
373	600477	杭萧钢构	16,500	38,115.00	0.11
374	688231	隆达股份	1,036	38,052.28	0.11
375	000905	厦门港务	4,900	38,024.00	0.11
376	300161	华中数控	1,300	37,856.00	0.11
377	002523	天桥起重	12,700	37,846.00	0.11
378	300708	聚灿光电	4,400	37,752.00	0.11
379	002297	博云新材	1,300	37,687.00	0.11
380	301116	益客食品	4,400	37,664.00	0.11
381	301307	美利信	500	37,645.00	0.11
382	002866	传艺科技	2,300	37,605.00	0.11
383	001376	百通能源	3,600	37,440.00	0.11
384	000949	新乡化纤	5,900	37,406.00	0.11
385	300079	数码视讯	8,900	37,380.00	0.11
386	000570	苏常柴 A	8,000	37,360.00	0.11
387	605287	德才股份	900	37,341.00	0.11
388	002971	和远气体	600	37,200.00	0.11
389	605100	华丰股份	920	37,186.40	0.11
390	688710	益诺思	553	37,161.60	0.11
391	301566	达利凯普	1,000	37,080.00	0.11
392	300471	厚普股份	4,300	37,023.00	0.11
393	603416	信捷电气	700	37,009.00	0.11
394	603918	金桥信息	3,900	36,972.00	0.11
395	301070	开勒股份	420	36,960.00	0.11
396	300483	首华燃气	2,100	36,918.00	0.11
397	002912	中新赛克	2,000	36,880.00	0.11
398	002301	齐心集团	5,100	36,873.00	0.11

399	605488	福莱新材	1,300	36,868.00	0.11
400	300067	安诺其	6,800	36,856.00	0.11
401	300553	集智股份	600	36,834.00	0.11
402	301362	民爆光电	200	36,784.00	0.11
403	603989	艾华集团	700	36,750.00	0.11
404	300547	川环科技	1,100	36,729.00	0.11
405	300785	值得买	1,000	36,670.00	0.11
406	605088	冠盛股份	1,300	36,634.00	0.11
407	002391	长青股份	7,500	36,525.00	0.11
408	300890	翔丰华	1,100	36,487.00	0.11
409	600230	沧州大化	2,800	36,456.00	0.11
410	301073	君亭酒店	2,000	36,400.00	0.11
411	000726	鲁 泰 A	6,700	36,381.00	0.11
412	002772	众兴菌业	3,200	36,352.00	0.11
413	002903	宇环数控	800	36,336.00	0.11
414	300792	壹网壹创	1,400	36,316.00	0.11
415	300424	航新科技	2,300	36,202.00	0.11
416	002918	蒙娜丽莎	3,600	36,180.00	0.11
417	601616	广电电气	10,600	36,146.00	0.11
418	301069	凯盛新材	1,800	36,072.00	0.11
419	300963	中洲特材	2,680	35,992.40	0.11
420	000912	泸天化	11,200	35,952.00	0.11
421	688553	汇宇制药	3,373	35,854.99	0.11
422	002955	鸿合科技	1,000	35,750.00	0.10
423	300032	金龙机电	9,400	35,720.00	0.10
424	002067	景兴纸业	9,700	35,696.00	0.10
425	002394	联发股份	4,000	35,680.00	0.10
426	300662	科锐国际	2,100	35,658.00	0.10
427	605169	洪通燃气	4,000	35,560.00	0.10
428	603615	茶花股份	2,200	35,530.00	0.10
429	002476	新叶股份	7,300	35,478.00	0.10
430	002769	普路通	5,400	35,262.00	0.10
431	601133	柏诚股份	800	35,232.00	0.10
432	300991	创益通	1,000	35,210.00	0.10
433	002553	南方精工	2,200	35,178.00	0.10
434	002132	恒星科技	6,500	35,165.00	0.10
435	000735	罗 牛 山	7,400	35,150.00	0.10
436	300328	宜安科技	2,500	35,100.00	0.10
437	002062	宏润建设	4,900	35,084.00	0.10
437	301330	熵基科技	1,400	35,084.00	0.10
439	601226	华电科工	5,500	34,980.00	0.10
440	688678	福立旺	1,447	34,973.99	0.10
441	301246	宏源药业	1,300	34,970.00	0.10
442	603966	法兰泰克	4,290	34,963.50	0.10

443	300858	科拓生物	2,300	34,937.00	0.10
444	300830	金现代	4,400	34,936.00	0.10
445	300151	昌红科技	1,400	34,930.00	0.10
446	000731	四川美丰	6,800	34,748.00	0.10
447	603200	上海洗霸	800	34,688.00	0.10
448	300351	永贵电器	2,100	34,650.00	0.10
449	300706	阿石创	400	34,540.00	0.10
450	002931	锋龙股份	500	34,490.00	0.10
451	688253	英诺特	572	34,480.16	0.10
452	300025	华星创业	8,200	34,440.00	0.10
453	002112	三变科技	2,100	34,419.00	0.10
454	300143	盈康生命	5,100	34,374.00	0.10
455	688489	三未信安	1,510	34,277.00	0.10
456	000421	南京公用	6,900	34,224.00	0.10
457	688148	芳源股份	3,981	34,156.98	0.10
458	603967	中创物流	3,300	34,155.00	0.10
459	002783	凯龙股份	4,800	34,128.00	0.10
459	300189	神农种业	7,900	34,128.00	0.10
461	002919	名臣健康	1,796	34,106.04	0.10
462	603058	永吉股份	3,900	33,969.00	0.10
463	300400	劲拓股份	900	33,885.00	0.10
464	300249	依米康	2,200	33,880.00	0.10
465	605167	利柏特	2,100	33,810.00	0.10
466	002782	可立克	1,600	33,680.00	0.10
467	002685	华东重机	5,200	33,592.00	0.10
468	600313	农发种业	6,400	33,536.00	0.10
469	002108	沧州明珠	8,100	33,534.00	0.10
470	002298	中电鑫龙	4,400	33,528.00	0.10
471	002377	国创高新	13,300	33,516.00	0.10
472	002695	煌上煌	3,300	33,495.00	0.10
473	300473	德尔股份	1,100	33,440.00	0.10
474	600054	黄山旅游	3,100	33,387.00	0.10
475	688373	盟科药业	7,368	33,377.04	0.10
476	002632	道明光学	3,700	33,337.00	0.10
477	688418	震有科技	693	33,319.44	0.10
478	300374	中铁装配	3,300	33,231.00	0.10
479	603191	望变电气	2,100	33,159.00	0.10
480	002343	慈文传媒	7,600	33,136.00	0.10
481	001311	多利科技	2,050	33,066.50	0.10
482	301265	华新科技	1,200	33,060.00	0.10
483	600501	航天晨光	2,100	33,033.00	0.10
484	300063	天龙集团	3,800	32,984.00	0.10
485	600828	茂业商业	9,200	32,936.00	0.10
486	002357	富临运业	3,700	32,930.00	0.10

487	300879	大叶股份	2,100	32,928.00	0.10
487	600785	新华百货	3,360	32,928.00	0.10
489	300933	中辰股份	5,400	32,832.00	0.10
490	603012	创力集团	4,000	32,800.00	0.10
491	600468	百利电气	5,400	32,778.00	0.10
492	000601	韶能股份	5,600	32,760.00	0.10
493	000045	深纺织 A	3,100	32,674.00	0.10
494	002707	众信旅游	6,800	32,640.00	0.10
495	001208	华菱线缆	2,300	32,637.00	0.10
496	300172	中电环保	7,900	32,627.00	0.10
497	002734	利民股份	1,900	32,623.00	0.10
498	688330	宏力达	964	32,612.12	0.10
499	603901	永创智能	3,000	32,610.00	0.10
500	002369	卓翼科技	6,000	32,580.00	0.10
501	300317	珈伟新能	8,100	32,562.00	0.10
502	301162	国能日新	740	32,375.00	0.09
503	688212	澳华内镜	1,100	32,340.00	0.09
504	000753	漳州发展	7,200	32,328.00	0.09
505	601579	会稽山	2,200	32,318.00	0.09
506	300631	久吾高科	1,400	32,270.00	0.09
507	002021	中捷资源	12,700	32,004.00	0.09
507	002609	捷顺科技	4,200	32,004.00	0.09
509	688108	赛诺医疗	1,727	32,001.31	0.09
510	002039	黔源电力	1,700	31,994.00	0.09
511	301266	宇邦新材	1,400	31,976.00	0.09
512	300095	华伍股份	3,700	31,894.00	0.09
513	002793	罗欣药业	8,300	31,872.00	0.09
514	003040	楚天龙	3,000	31,860.00	0.09
515	300968	格林精密	3,300	31,812.00	0.09
516	603167	渤海轮渡	3,700	31,709.00	0.09
517	601388	怡球资源	11,200	31,696.00	0.09
518	301348	蓝箭电子	1,000	31,580.00	0.09
519	300941	创识科技	2,300	31,579.00	0.09
520	600868	梅雁吉祥	12,000	31,560.00	0.09
521	301370	国科恒泰	3,900	31,551.00	0.09
522	300427	红相股份	4,700	31,537.00	0.09
523	000576	甘化科工	4,800	31,536.00	0.09
524	688221	前沿生物	1,400	31,360.00	0.09
525	301607	富特科技	600	31,350.00	0.09
526	001207	联科科技	2,100	31,332.00	0.09
527	603969	银龙股份	4,300	31,261.00	0.09
528	300817	双飞股份	2,000	31,200.00	0.09
529	300217	东方电热	7,300	31,171.00	0.09
530	605305	中际联合	740	31,020.80	0.09

531	002337	赛象科技	7,000	31,010.00	0.09
532	002640	跨境通	10,300	31,003.00	0.09
533	688602	康鹏科技	3,929	30,960.52	0.09
534	600603	广汇物流	7,100	30,885.00	0.09
535	605598	上海港湾	800	30,744.00	0.09
536	603203	快克智能	400	30,712.00	0.09
537	300703	创源股份	2,400	30,648.00	0.09
538	300221	银禧科技	1,900	30,533.00	0.09
539	603859	能科科技	636	30,515.28	0.09
540	600860	京城股份	3,700	30,488.00	0.09
541	605168	三人行	600	30,384.00	0.09
542	002662	峰璟股份	8,200	30,340.00	0.09
543	300121	阳谷华泰	2,400	30,240.00	0.09
544	002148	北纬科技	5,200	30,212.00	0.09
545	301608	博实结	600	30,156.00	0.09
546	601218	吉鑫科技	7,000	30,100.00	0.09
547	002274	华昌化工	6,500	30,095.00	0.09
548	603926	铁流股份	1,700	30,073.00	0.09
549	000957	中通客车	3,200	29,952.00	0.09
550	002703	浙江世宝	2,100	29,883.00	0.09
551	301251	威尔高	560	29,836.80	0.09
552	002057	中钢天源	2,400	29,832.00	0.09
553	300267	尔康制药	9,000	29,700.00	0.09
554	300819	聚杰微纤	400	29,608.00	0.09
555	300022	吉峰科技	3,800	29,526.00	0.09
556	688258	卓易信息	249	29,516.46	0.09
557	603367	辰欣药业	2,300	29,509.00	0.09
558	605319	无锡振华	1,300	29,497.00	0.09
559	002540	亚太科技	6,300	29,421.00	0.09
560	001338	永顺泰	3,500	29,365.00	0.09
561	002365	永安药业	2,900	29,348.00	0.09
562	002264	新华都	5,200	29,328.00	0.09
563	603336	宏辉果蔬	3,700	29,304.00	0.09
564	002758	浙农股份	3,700	29,230.00	0.09
565	300174	元力股份	1,000	29,220.00	0.09
566	600855	航天长峰	2,100	29,211.00	0.09
567	688707	振华新材	2,273	29,208.05	0.09
568	000560	我爱我家	14,100	29,187.00	0.09
569	002614	奥佳华	6,600	29,172.00	0.09
570	300986	志特新材	1,700	29,155.00	0.09
571	600513	联环药业	2,000	29,080.00	0.09
572	300099	尤洛卡	4,600	29,072.00	0.09
573	600354	敦煌种业	6,100	29,036.00	0.09
574	002029	七匹狼	3,800	29,032.00	0.09

575	600846	同济科技	2,900	29,000.00	0.09
576	000523	红棉股份	11,200	28,896.00	0.08
577	300952	恒辉安防	1,660	28,884.00	0.08
578	688588	凌志软件	3,177	28,878.93	0.08
579	601789	宁波建工	7,200	28,872.00	0.08
580	688799	华纳药厂	642	28,806.54	0.08
581	002034	旺能环境	1,900	28,785.00	0.08
582	301172	君逸数码	1,100	28,545.00	0.08
583	300485	赛升药业	3,000	28,530.00	0.08
584	600594	益佰制药	9,600	28,512.00	0.08
585	600644	乐山电力	3,600	28,440.00	0.08
586	002682	龙洲股份	6,700	28,408.00	0.08
587	603687	大胜达	1,400	28,406.00	0.08
588	300563	神宇股份	1,000	28,390.00	0.08
589	300619	金银河	910	28,310.10	0.08
590	300359	全通教育	7,900	28,282.00	0.08
591	002392	北京利尔	3,500	28,245.00	0.08
592	600191	华资实业	3,100	28,210.00	0.08
593	603665	康隆达	1,100	28,171.00	0.08
594	000428	华天酒店	9,200	27,968.00	0.08
595	300043	星辉娱乐	6,400	27,840.00	0.08
596	002346	柘中股份	1,300	27,807.00	0.08
597	300853	申昊科技	900	27,801.00	0.08
598	002374	中锐股份	8,300	27,722.00	0.08
599	002398	垒知集团	7,328	27,480.00	0.08
600	600523	贵航股份	2,600	27,430.00	0.08
601	603286	日盈电子	600	27,378.00	0.08
602	300546	雄帝科技	1,800	27,288.00	0.08
603	603088	宁波精达	2,700	27,162.00	0.08
604	002996	顺博合金	4,600	27,140.00	0.08
605	603421	鼎信通讯	4,400	27,060.00	0.08
606	300973	立高食品	1,100	27,027.00	0.08
607	002659	凯文教育	7,200	26,928.00	0.08
608	688787	海天瑞声	200	26,890.00	0.08
609	300950	德固特	1,600	26,832.00	0.08
610	603216	梦天家居	1,300	26,741.00	0.08
611	002970	锐明技术	500	26,715.00	0.08
612	301148	嘉戎技术	500	26,630.00	0.08
613	001380	华纬科技	1,700	26,588.00	0.08
614	300539	横河精密	1,300	26,481.00	0.08
615	301378	通达海	1,100	26,378.00	0.08
616	002829	星网宇达	1,500	26,340.00	0.08
617	002208	合肥城建	1,300	26,286.00	0.08
618	603878	武进不锈	5,100	26,214.00	0.08

619	001288	运机集团	1,100	26,169.00	0.08
620	300578	会畅科技	1,500	26,085.00	0.08
621	688733	壹石通	630	26,050.50	0.08
622	000812	陕西金叶	8,400	26,040.00	0.08
623	300421	力星股份	1,400	25,914.00	0.08
624	300818	耐普矿机	1,370	25,893.00	0.08
625	000670	盈方微	3,400	25,806.00	0.08
626	300774	倍杰特	2,400	25,800.00	0.08
627	002213	大为股份	700	25,718.00	0.08
628	000863	三湘印象	6,100	25,620.00	0.08
629	000014	沙河股份	2,800	25,564.00	0.07
630	002452	长高电气	2,000	25,540.00	0.07
631	002615	哈尔斯	3,700	25,530.00	0.07
632	000659	珠海中富	8,200	25,502.00	0.07
633	603111	康尼机电	4,500	25,470.00	0.07
634	688590	新致软件	2,033	25,270.19	0.07
635	002757	南兴股份	1,400	25,270.00	0.07
636	000404	长虹华意	3,200	25,152.00	0.07
637	301082	久盛电气	2,800	25,088.00	0.07
638	000803	山高环能	3,700	25,086.00	0.07
639	605338	巴比食品	1,400	25,060.00	0.07
640	603037	凯众股份	2,500	25,050.00	0.07
641	601929	吉视传媒	11,200	24,976.00	0.07
642	600610	中毅达	3,800	24,890.00	0.07
643	688225	亚信安全	1,988	24,690.96	0.07
644	301026	浩通科技	1,220	24,668.40	0.07
645	603683	晶华新材	800	24,656.00	0.07
646	600510	黑牡丹	3,300	24,618.00	0.07
647	603916	苏博特	1,800	24,588.00	0.07
648	600960	渤海汽车	6,100	24,583.00	0.07
649	300071	福石控股	7,000	24,500.00	0.07
650	000892	欢瑞世纪	7,300	24,309.00	0.07
651	300138	晨光生物	2,700	24,300.00	0.07
651	300893	松原安全	1,500	24,300.00	0.07
653	300258	精锻科技	2,200	24,266.00	0.07
654	603098	森特股份	2,300	24,265.00	0.07
655	002664	信质集团	1,400	24,206.00	0.07
656	002580	圣阳股份	1,200	24,192.00	0.07
657	002606	大连电瓷	1,800	24,138.00	0.07
658	000859	国风新材	2,400	24,072.00	0.07
659	002103	广博股份	4,100	24,067.00	0.07
660	301507	民生健康	2,000	24,060.00	0.07
661	000036	华联控股	5,500	24,035.00	0.07
662	600425	青松建化	7,300	23,871.00	0.07

663	688238	和元生物	4,400	23,848.00	0.07
664	002140	东华科技	2,600	23,842.00	0.07
665	002443	金洲管道	2,500	23,825.00	0.07
666	600262	北方股份	1,200	23,748.00	0.07
667	300781	因赛集团	898	23,671.28	0.07
668	603016	新宏泰	700	23,632.00	0.07
669	300867	圣元环保	1,300	23,556.00	0.07
670	603121	华培动力	2,000	23,500.00	0.07
671	300515	三德科技	1,800	23,490.00	0.07
672	600318	新力金融	3,900	23,478.00	0.07
672	600684	珠江股份	7,800	23,478.00	0.07
674	300622	博士眼镜	1,684	23,474.96	0.07
675	002269	美邦服饰	17,900	23,449.00	0.07
676	600251	冠农股份	2,700	23,328.00	0.07
677	600681	百川能源	7,200	23,256.00	0.07
678	300403	汉宇集团	2,460	23,173.20	0.07
679	002522	浙江众成	2,900	23,113.00	0.07
680	002527	新时达	1,800	23,094.00	0.07
681	002135	东南网架	3,400	23,086.00	0.07
682	300092	科新机电	2,000	23,080.00	0.07
683	300061	旗天科技	3,300	23,067.00	0.07
684	301136	招标股份	2,100	23,058.00	0.07
685	002350	北京科锐	1,700	22,967.00	0.07
686	300491	通合科技	600	22,914.00	0.07
687	603222	济民健康	2,700	22,815.00	0.07
688	300922	天秦装备	1,500	22,725.00	0.07
689	300218	安利股份	1,900	22,610.00	0.07
689	300801	泰和科技	700	22,610.00	0.07
691	300057	万顺新材	2,600	22,568.00	0.07
692	300299	富春股份	4,600	22,540.00	0.07
693	002235	安妮股份	2,900	22,475.00	0.07
694	002037	保利联合	3,600	22,464.00	0.07
695	301076	新瀚新材	857	22,436.26	0.07
696	000925	众合科技	2,400	22,416.00	0.07
697	600284	浦东建设	4,600	22,356.00	0.07
698	000852	石化机械	4,500	22,320.00	0.07
699	002090	金智科技	2,500	22,100.00	0.06
700	600467	好当家	11,200	22,064.00	0.06
701	002988	豪美新材	1,000	22,060.00	0.06
702	603135	中重科技	1,800	21,780.00	0.06
703	002232	启明信息	1,600	21,696.00	0.06
704	002733	雄韬股份	700	21,686.00	0.06
705	600880	博瑞传播	5,800	21,460.00	0.06
706	688410	山外山	1,490	21,396.40	0.06

707	603069	海汽集团	1,700	21,335.00	0.06
708	300062	中能电气	3,800	21,318.00	0.06
709	600792	云煤能源	6,700	21,239.00	0.06
710	002593	日上集团	5,300	21,147.00	0.06
711	002940	昂利康	800	21,128.00	0.06
712	002692	远程股份	5,600	21,112.00	0.06
713	300240	飞力达	4,200	20,958.00	0.06
714	002730	电光科技	700	20,937.00	0.06
715	300219	鸿利智汇	2,000	20,860.00	0.06
716	001212	中旗新材	440	20,847.20	0.06
717	603122	合富中国	1,900	20,824.00	0.06
718	002293	罗莱生活	2,100	20,769.00	0.06
719	002344	海宁皮城	5,900	20,650.00	0.06
720	300307	慈星股份	2,800	20,636.00	0.06
721	002094	青岛金王	4,700	20,586.00	0.06
722	300278	华昌达	5,300	20,564.00	0.06
723	603758	秦安股份	2,300	20,562.00	0.06
724	688227	品高股份	200	20,538.00	0.06
725	002451	摩恩电气	2,900	20,416.00	0.06
726	000819	岳阳兴长	1,800	20,394.00	0.06
727	001300	三柏硕	1,800	20,340.00	0.06
728	300135	宝利国际	6,600	20,130.00	0.06
729	600638	新黄浦	4,600	20,102.00	0.06
730	600824	益民集团	6,100	20,069.00	0.06
731	002016	世荣兆业	5,000	20,000.00	0.06
732	002663	普邦股份	13,400	19,966.00	0.06
733	300148	天舟文化	6,400	19,904.00	0.06
734	002746	仙坛股份	3,900	19,890.00	0.06
735	600168	武汉控股	4,900	19,796.00	0.06
736	301135	瑞德智能	1,200	19,764.00	0.06
737	600121	郑州煤电	5,500	19,690.00	0.06
738	300355	蒙草生态	7,100	19,525.00	0.06
739	300945	曼卡龙	1,800	19,494.00	0.06
740	300162	雷曼光电	1,400	19,334.00	0.06
741	002997	瑞鹄模具	700	19,292.00	0.06
742	600798	宁波海运	6,200	19,282.00	0.06
743	000531	穗恒运 A	3,200	19,168.00	0.06
744	300019	硅宝科技	1,000	19,060.00	0.06
745	300453	三鑫医疗	2,100	18,984.00	0.06
746	300435	中泰股份	700	18,949.00	0.06
747	601008	连云港	4,700	18,894.00	0.06
748	002474	榕基软件	3,300	18,810.00	0.06
748	300318	博晖创新	4,500	18,810.00	0.06
750	601116	三江购物	1,900	18,753.00	0.05

751	688365	光云科技	1,183	18,655.91	0.05
752	002285	世联行	9,100	18,655.00	0.05
753	301025	读客文化	2,400	18,624.00	0.05
754	300094	国联水产	7,570	18,546.50	0.05
755	300283	温州宏丰	900	18,495.00	0.05
756	300215	电科院	2,800	18,452.00	0.05
757	600592	龙溪股份	1,300	18,408.00	0.05
758	002406	远东传动	2,800	18,368.00	0.05
759	002953	日丰股份	2,100	18,312.00	0.05
760	002752	昇兴股份	3,300	18,216.00	0.05
761	600693	东百集团	2,300	18,032.00	0.05
762	600496	精工钢构	5,800	17,980.00	0.05
763	603610	麒盛科技	1,000	17,960.00	0.05
764	300291	百纳千成	3,700	17,871.00	0.05
765	300365	恒华科技	3,900	17,862.00	0.05
766	002404	嘉欣丝绸	3,100	17,732.00	0.05
767	600617	国新能源	6,600	17,688.00	0.05
768	605128	上海沿浦	724	17,549.76	0.05
769	603366	日出东方	2,400	17,448.00	0.05
770	600255	鑫科材料	5,000	17,400.00	0.05
771	300066	三川智慧	3,100	17,298.00	0.05
772	002026	山东威达	1,600	17,280.00	0.05
773	000026	飞亚达	800	17,232.00	0.05
774	603607	京华激光	700	17,220.00	0.05
775	603158	腾龙股份	1,400	17,122.00	0.05
776	600503	华丽家族	8,600	17,114.00	0.05
777	300310	宜通世纪	4,100	17,097.00	0.05
778	002669	康达新材	1,000	17,090.00	0.05
779	000722	湖南发展	1,500	17,040.00	0.05
780	002846	英联股份	1,600	16,944.00	0.05
781	300286	安科瑞	700	16,905.00	0.05
782	002554	惠博普	5,400	16,848.00	0.05
783	000701	厦门信达	3,800	16,834.00	0.05
784	600727	鲁北化工	2,500	16,800.00	0.05
785	300885	海昌新材	700	16,639.00	0.05
786	600630	龙头股份	1,700	16,558.00	0.05
787	300523	辰安科技	900	16,542.00	0.05
788	002164	宁波东力	1,400	16,520.00	0.05
789	002589	瑞康医药	6,700	16,482.00	0.05
790	300349	金卡智能	1,500	16,410.00	0.05
791	002263	大东南	4,900	16,219.00	0.05
792	002641	公元股份	4,200	16,212.00	0.05
793	000524	岭南控股	1,800	16,110.00	0.05
794	300018	中元股份	1,300	16,055.00	0.05

795	301221	光庭信息	540	15,935.40	0.05
796	300611	美力科技	700	15,869.00	0.05
797	600207	安彩高科	2,700	15,822.00	0.05
798	002917	金奥博	1,500	15,810.00	0.05
799	600558	大西洋	3,200	15,808.00	0.05
800	002042	华孚时尚	4,600	15,686.00	0.05
801	002196	方正电机	1,300	15,678.00	0.05
802	000777	中核科技	800	15,632.00	0.05
803	002334	英威腾	2,200	15,598.00	0.05
804	300448	浩云科技	2,700	15,552.00	0.05
805	603861	白云电器	1,200	15,492.00	0.05
806	300758	七彩化学	1,200	15,060.00	0.04
807	300918	南山智尚	1,400	15,008.00	0.04
808	600756	浪潮软件	1,200	14,688.00	0.04
809	300654	世纪天鸿	1,500	14,580.00	0.04
810	002766	索菱股份	4,100	14,473.00	0.04
811	002915	中欣氟材	700	14,357.00	0.04
812	603223	恒通股份	1,100	14,355.00	0.04
813	301305	朗坤科技	500	14,260.00	0.04
814	600527	江南高纤	6,600	14,124.00	0.04
815	002106	莱宝高科	800	14,016.00	0.04
816	002480	新筑股份	2,700	13,905.00	0.04
817	603386	骏亚科技	700	13,811.00	0.04
818	600429	三元股份	3,400	13,736.00	0.04
819	002225	濮耐股份	2,900	13,717.00	0.04
820	603811	诚意药业	1,820	13,686.40	0.04
821	600195	中牧股份	2,300	13,570.00	0.04
822	300292	吴通控股	2,500	13,550.00	0.04
823	002578	闽发铝业	4,300	13,545.00	0.04
824	603032	德新科技	500	13,450.00	0.04
825	002686	亿利达	2,600	13,390.00	0.04
826	002599	盛通股份	2,600	13,260.00	0.04
827	301580	爱迪特	200	12,866.00	0.04
828	000965	天保基建	4,400	12,848.00	0.04
829	300510	金冠股份	4,000	12,480.00	0.04
830	600173	卧龙新能	2,100	12,411.00	0.04
831	300559	佳发教育	1,200	12,276.00	0.04
832	600805	悦达投资	3,000	12,090.00	0.04
833	688207	格灵深瞳	601	12,080.10	0.04
834	603291	联合水务	1,500	12,060.00	0.04
835	300465	高伟达	1,100	12,023.00	0.04
836	002676	顺威股份	2,400	11,952.00	0.04
837	002165	红宝丽	1,900	11,913.00	0.03
838	600108	亚盛集团	4,000	11,840.00	0.03

839	300086	康芝药业	2,000	11,800.00	0.03
840	002349	精华制药	1,900	11,799.00	0.03
841	600052	东望时代	3,300	11,682.00	0.03
842	300505	川金诺	500	11,475.00	0.03
843	300560	中富通	600	11,430.00	0.03
844	002418	康盛股份	2,900	11,426.00	0.03
845	300192	科德教育	700	11,424.00	0.03
846	601086	国芳集团	1,700	11,271.00	0.03
847	300791	仙乐健康	700	11,214.00	0.03
848	605208	永茂泰	700	11,165.00	0.03
849	300345	华民股份	1,900	11,096.00	0.03
850	002688	金河生物	2,400	11,088.00	0.03
851	300997	欢乐家	800	10,840.00	0.03
852	002628	成都路桥	2,000	10,700.00	0.03
853	600698	湖南天雁	1,800	10,656.00	0.03
854	300200	高盟新材	900	10,341.00	0.03
855	300265	通光线缆	500	10,340.00	0.03
856	605277	新亚电子	540	10,292.40	0.03
857	002321	华英农业	6,100	10,187.00	0.03
858	300565	科信技术	1,000	10,180.00	0.03
859	600653	申华控股	6,700	10,050.00	0.03
860	002178	延华智能	2,300	9,982.00	0.03
861	603767	中马传动	700	9,954.00	0.03
862	000993	闽东电力	1,000	9,920.00	0.03
862	002386	天原股份	1,600	9,920.00	0.03
864	002033	丽江股份	1,200	9,912.00	0.03
865	001319	铭科精技	500	9,800.00	0.03
866	603697	有友食品	1,000	9,590.00	0.03
867	002786	银宝山新	1,200	9,432.00	0.03
868	002362	汉王科技	600	9,330.00	0.03
869	600250	南京商旅	1,200	9,252.00	0.03
870	600626	申达股份	2,900	9,251.00	0.03
871	002184	海得控制	1,000	9,160.00	0.03
872	300847	中船汉光	700	9,058.00	0.03
873	000409	云鼎科技	1,100	9,053.00	0.03
874	000090	天健集团	3,000	9,030.00	0.03
875	002556	辉隆股份	2,000	8,960.00	0.03
876	600794	保税科技	3,100	8,835.00	0.03
877	603520	司太立	800	8,832.00	0.03
878	000530	冰山冷热	1,600	8,288.00	0.02
879	300293	蓝英装备	400	8,140.00	0.02
880	603668	天马科技	620	7,849.20	0.02
881	600162	香江控股	2,600	7,280.00	0.02
882	002590	万安科技	700	7,000.00	0.02

883	002137	实益达	600	6,900.00	0.02
884	003038	鑫铂股份	600	6,786.00	0.02
885	600300	维维股份	2,200	6,204.00	0.02
886	601007	金陵饭店	1,000	6,110.00	0.02
887	300194	福安药业	1,800	6,084.00	0.02
888	002658	雪迪龙	700	5,915.00	0.02
889	600293	三峡新材	1,900	5,434.00	0.02
890	000558	天府文旅	1,700	5,389.00	0.02
891	002462	嘉事堂	500	5,365.00	0.02
892	300195	长荣股份	900	5,283.00	0.02
893	301333	诺思格	100	5,009.00	0.01
894	002642	荣联科技	800	4,928.00	0.01
895	300264	佳创视讯	600	4,878.00	0.01
896	603633	徕木股份	700	4,767.00	0.01
897	002728	特一药业	500	4,575.00	0.01
898	603081	大丰实业	500	4,325.00	0.01
899	603018	华设集团	840	4,317.60	0.01
900	002367	康力电梯	600	4,146.00	0.01
901	600067	冠城新材	1,400	4,060.00	0.01
902	300247	融捷健康	1,100	4,037.00	0.01
903	600622	光大嘉宝	2,000	3,920.00	0.01
904	002950	奥美医疗	400	3,556.00	0.01
905	002613	北玻股份	900	3,528.00	0.01
906	300011	鼎汉技术	500	3,040.00	0.01
907	002481	双塔食品	800	3,032.00	0.01
908	603036	如通股份	200	2,892.00	0.01
909	300149	睿智医药	300	2,862.00	0.01
910	605580	恒盛能源	100	2,761.00	0.01
911	301501	恒鑫生活	100	2,602.00	0.01
912	600708	光明地产	800	2,568.00	0.01
913	600405	动力源	500	2,260.00	0.01
914	600981	苏豪汇鸿	900	2,025.00	0.01
915	000011	深物业 A	300	1,944.00	0.01
916	001206	依依股份	100	1,876.00	0.01
917	000715	中兴商业	400	1,856.00	0.01
918	002510	天汽模	300	1,626.00	0.00
919	000882	华联股份	1,200	1,548.00	0.00
920	000717	中南股份	700	1,407.00	0.00
921	000025	特力 A	100	1,348.00	0.00
922	002575	群兴玩具	200	1,144.00	0.00
923	603318	水发燃气	100	954.00	0.00
924	600512	腾达建设	500	935.00	0.00
925	600843	上工申贝	100	860.00	0.00
926	600470	六国化工	100	580.00	0.00

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	688508	芯朋微	140,513.22	0.45
2	002833	弘亚数控	137,459.00	0.44
3	300272	开能健康	134,412.00	0.43
4	300048	合康新能	124,157.00	0.40
5	002438	江苏神通	121,656.00	0.39
6	002533	金杯电工	120,412.00	0.38
7	300452	山河药辅	118,214.00	0.38
8	300389	艾比森	117,354.00	0.38
9	000777	中核科技	116,353.00	0.37
10	300055	万邦达	115,251.00	0.37
11	002937	兴瑞科技	114,690.00	0.37
12	002943	宇晶股份	113,881.00	0.36
13	002066	瑞泰科技	113,080.00	0.36
14	300228	富瑞特装	112,605.00	0.36
15	300161	华中数控	111,579.00	0.36
16	002990	盛视科技	110,887.00	0.35
17	300129	泰胜风能	110,838.00	0.35
18	300263	隆华科技	109,781.00	0.35
19	300541	先进数通	109,004.00	0.35
20	688416	恒烁股份	108,841.19	0.35

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	002969	嘉美包装	323,554.00	1.03
2	300806	斯迪克	205,245.00	0.66
3	688167	炬光科技	195,606.26	0.63
4	000551	创元科技	168,088.00	0.54

5	688668	鼎通科技	166,372.00	0.53
6	688627	精智达	164,348.00	0.53
7	001896	豫能控股	163,757.00	0.52
8	002759	ST 天际	160,401.00	0.51
9	002636	金安国纪	159,665.00	0.51
10	300342	天银机电	158,551.00	0.51
11	688416	恒烁股份	155,710.10	0.50
12	603929	亚翔集成	154,700.00	0.49
13	300435	中泰股份	151,424.00	0.48
14	688025	杰普特	146,572.00	0.47
15	001267	汇绿生态	143,690.00	0.46
16	300842	帝科股份	137,652.00	0.44
17	000592	平潭发展	135,340.00	0.43
18	688195	腾景科技	134,917.30	0.43
19	000962	东方钨业	132,676.00	0.42
20	002838	道恩股份	128,235.00	0.41

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	57,114,922.95
卖出股票的收入（成交）总额	57,143,408.34

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中，苏州新锐合金工具股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。

本基金管理人就上述公司受处罚事件进行了及时分析和研究，认为上述公司存在的违规问题对公司经营成果和现金流量未产生重大的实质影响，对该公司投资价值未产生实质影响。本基金管理人将继续对该公司进行跟踪研究。

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约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	17,941.85
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	17,941.85

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

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。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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
501	44,622.75	19,227,598.00	86.01%	3,128,402.00	13.99%

8.2 盈利投资者数量占比

本基金不适用。

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	22,356,000.00
本报告期基金总申购份额	10,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	10,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	22,356,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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：

2026 年 5 月 9 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四十三次会议审议通过，吴洪涛先生任公司首席信息官。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

自 2026 年 1 月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人未受调查或处罚。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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	
申万宏源证券	3	93,245,035.15	81.61%	18,268.21	86.48%	-
华金证券	1	21,004,328.14	18.38%	2,855.10	13.52%	-
中信建投	5	8,968.00	0.01%	1.21	0.01%	-

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
- （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、本基金本报告期内未有交易单元变更情况发生。

10.7.2 基金租用或者通过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	成交金额	占当期回	成交金额	占当期权

		券成交总 额的比例		购成交总 额的比例		证成交总 额的比例
申万宏源证券	4,600.00	100.00%	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
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	国泰基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 变更扩位证券简称的公告	《证券日报》、《上海证券报》、《中国证券报》、《证券时报》	2026-01-30
2	国泰基金管理有限公司关于深圳市分公司办公地址变更的公告	《中国证券报》	2026-04-02
3	国泰基金管理有限公司高级管理人员变更公告	《中国证券报》	2026-05-09

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	2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	16,245,500.00	-	-	16,245,500.00	72.67%
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

二〇二六年八月三十一日