

**国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金**  
**2025 年年度报告**  
**2025 年 12 月 31 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：二〇二六年三月三十日

## §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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信建投证券股份有限公司根据本基金合同约定，于 2026 年 03 月 26 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》。

本报告期自 2025 年 01 月 01 日起至 2025 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

<b>§1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>§2 基金简介</b>	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	7
<b>§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
<b>§4 管理人报告</b>	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
<b>§5 托管人报告</b>	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
<b>§6 审计报告</b>	15
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	17
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
<b>§7 年度财务报表</b>	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
<b>§8 投资组合报告</b>	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69

8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	70
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细 .....	70
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	70
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细 .....	70
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细 .....	70
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 .....	71
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	71
8.12	投资组合报告附注 .....	71
<b>§9</b>	<b>基金份额持有人信息 .....</b>	<b>72</b>
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	72
9.2	期末上市基金前十名持有人 .....	72
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	72
9.4	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 .....	73
<b>§10</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>73</b>
<b>§11</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>73</b>
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	73
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	74
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	74
11.4	基金投资策略的改变 .....	74
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	74
11.6	管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 .....	74
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	75
11.8	其他重大事件 .....	76
<b>§12</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>77</b>
<b>§13</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>77</b>
13.1	备查文件目录 .....	77
13.2	存放地点 .....	77
13.3	查阅方式 .....	77

## §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	<p>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</p>

	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》
----------------	--------

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gtfund.com">http://www.gtfund.com</a>
基金年度报告备置地点	上海市虹口区公平路 18 号 8 号楼嘉昱大厦 15-20 层及基金托管人住所或办公场所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年	2024 年	2023 年 9 月 13 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日
本期已实现收益	5,824,039.55	1,021,938.00	2,434,972.51
本期利润	7,260,744.53	2,260,174.02	2,403,703.57
加权平均基金份额本期利润	0.4086	0.0781	0.0177
本期加权平均净值利润率	33.39%	8.98%	1.76%
本期基金份额净值增长率	39.31%	-2.08%	2.61%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
期末可供分配利润	8,937,698.18	87,268.68	635,272.49
期末可供分配基金份额利润	0.3998	0.0048	0.0261
期末基金资产净值	31,293,698.18	18,443,268.68	24,991,272.49
期末基金份额净值	1.3998	1.0048	1.0261
3.1.3 累计期末指标	2025 年末	2024 年末	2023 年末
基金份额累计净值增长率	39.98%	0.48%	2.61%

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	4.92%	1.20%	3.55%	1.19%	1.37%	0.01%
过去六个月	19.99%	1.12%	18.38%	1.14%	1.61%	-0.02%
过去一年	39.31%	1.55%	36.42%	1.58%	2.89%	-0.03%
自基金合同生效起至今	39.98%	1.88%	34.83%	1.96%	5.15%	-0.08%

#### 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

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2023 年 9 月 13 日至 2025 年 12 月 31 日)

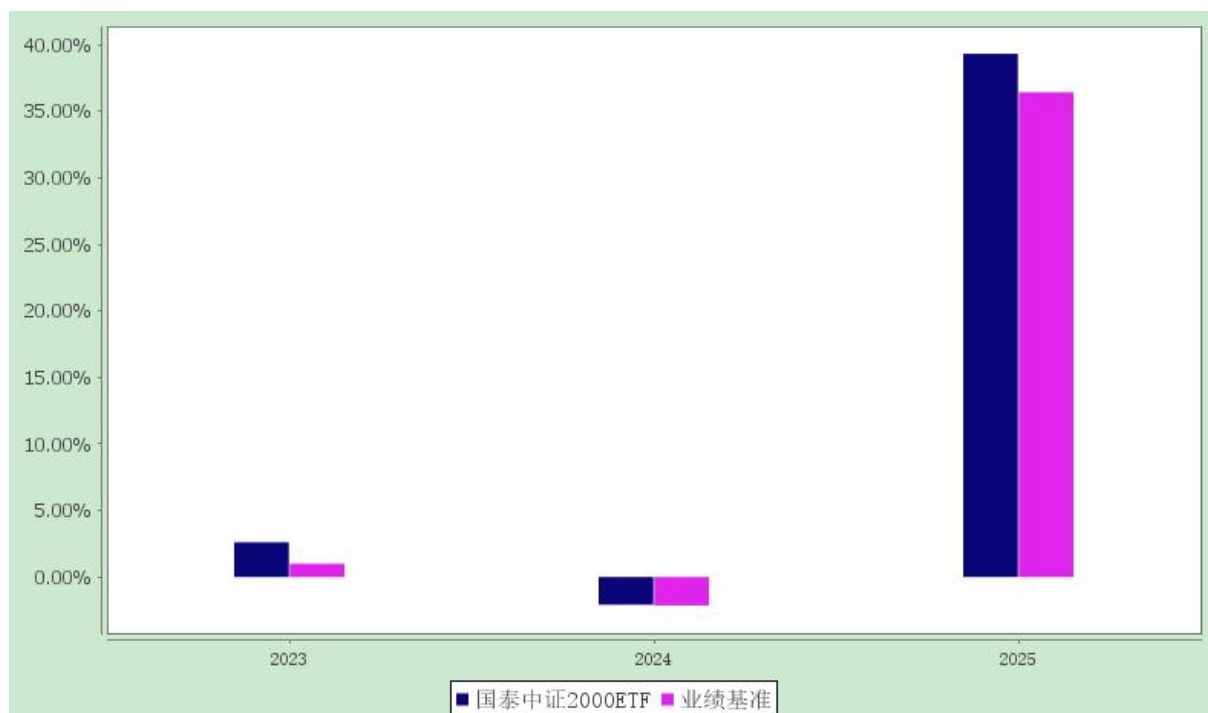


注：本基金合同生效日为 2023 年 9 月 13 日，本基金在六个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：1) 2023 年计算期间为基金合同生效日 2023 年 9 月 13 日至 2023 年 12 月 31 日，未按整个自然年度进行折算。

2) 基金的过往业绩不代表未来表现。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2023 年 9 月 13 日）至本报告期末未发生利润分配。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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 12 月 31 日，本基金管理人共管理 301 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	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

	<p>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</p>				<p>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。</p>
刘昉元	<p>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</p>	2025-04-11	-	6 年	<p>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。</p>

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据相关法规要求，制定了《公平交易管理制度》，制度规范了公司各部门相关岗位职责，适用于公司所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，包括授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节，旨在规范交易行为，严禁利益输送，保证公平交易，保护投资者合法权益。

（一）公司投资和研究部门不断完善研究方法和投资决策流程，提高投资决策的科学性和客观性，确保各投资组合享有公平的投资决策机会，建立公平交易的制度环境。

（二）公司制定投资授权机制，明确各投资决策主体的职责和权限划分，合理确定各投资组合经理的投资权限，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。

（三）公司对各投资组合信息进行有效的保密管理，不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息相互隔离。

（四）公司实行集中交易制度，严格隔离投资管理职能与交易执行职能，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。并在交易执行中对公平交易进行实时监控。

（五）公司严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。

（六）公司相关部门定期对管理的不同投资组合的整体收益率差异、分投资类别的收益率差异、不同时间窗下同向交易和反向交易的交易价差等进行分析，并评估是否符合公平交易原则。

（七）公司相关部门建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估制度，对交易过程进行定期

检查，并将检查结果定期向公司风险管理委员会汇报。

#### 4.3.2 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。

#### 4.3.3 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

2025 年市场总体震荡上行。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。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。

三季度 A 股市场在多重利好共振下大幅走强，主要指数均实现显著上涨，市场活跃度提升。半导体、通信设备等科技板块成为市场上涨主要驱动力，资金持续流入科技成长赛道。尽管季末受外部关税扰动出现短期震荡，市场整体情绪趋于积极。四季度，受高基数效应、补贴退坡等因素影响，A 股市场以震荡为主。板块间出现分化，三季度涨幅较大的科技和新能源方向调整幅度较大，市场活跃度仍维持在较高位置。

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 年全年，小微盘风格延续了相对强势的表现，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 39.31%，同期业绩比较基准收益率为 36.42%。

#### 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 2026 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。国内“稳增长”等政策红利有望延续，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，但在当前环境下小微盘风格可能仍将维持强势。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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人从合规运作、维护基金份额持有人合法利益的角度出发，完善内部控制制度和流程，加强日常监察力度，推动内控体系和制度措施的落实；在对基金投资运作和公司经营管理的合规性监察方面，通过实时监控、报表揭示、定期检查、专项检查等方式，及时发现情况、提出改进建议并跟踪改进落实情况。本期内重点开展的监察稽核工作包括：

1、全面开展对公司各项业务的稽核监察，对公司内控缺失、薄弱环节和风险隐患做到及时发现，提前防范，确保投资管理、基金销售和后台运营等业务领域的稳健合规运作。

2、根据基金监管法律法规的相关要求及业务发展变化，优化公司内控和风险管理，更新完善内控制度和业务流程，推动全员全过程风险管理和风险控制责任制，并进行持续监督，跟踪检查执行情况。

3、注重对员工行为规范和职业素养的教育与监察，并通过开展法规培训、业务学习等形式，提升员工的诚信规范和风险责任意识。

今后本基金管理人将继续以“诚信勤勉为投资人服务”为宗旨，不断提高内部监察稽核和风险控制工作的科学性和实效性，在完善内部控制体系、有效防范风险的基础上，确保基金资产的规范运作，维护基金份额持有人的合法利益，争取以更好的收益回报基金份额持有人。

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，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。

#### 4.8 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。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中财务指标、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 审计报告

毕马威华振审字第 2605310 号

国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

我们审计了后附的国泰中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表,2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则(以下简称“审计准则”)的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

## 6.3 其他信息

该基金管理人国泰基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2025 年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。

#### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

#### 6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如

果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

(5) 评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师  
 王国蓓 叶凯韵  
 北京市东长安街 1 号东方广场毕马威大楼 8 层  
 2026 年 3 月 26 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	591,626.78	399,817.55
结算备付金		-	33,703.91
存出保证金		16,332.19	160,093.88
交易性金融资产	7.4.7.2	30,703,380.91	17,873,402.76
其中：股票投资		30,703,380.91	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
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	7.4.7.5	-	-
资产总计		31,311,339.88	18,467,018.10
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2024 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		13,037.24	8,387.49
应付托管费		2,607.44	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	7.4.7.6	1,997.02	13,684.45
负债合计		17,641.70	23,749.42
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	22,356,000.00	18,356,000.00
未分配利润	7.4.7.8	8,937,698.18	87,268.68
净资产合计		31,293,698.18	18,443,268.68
负债和净资产总计		31,311,339.88	18,467,018.10

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3998 元，基金份额总额 22,356,000.00 份。

## 7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注	本期	上年度可比期间
----	----	----	---------

	号	2025 年 1 月 1 日 至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日 至 2024 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		7,390,979.96	2,422,556.23
1.利息收入		3,846.33	14,443.50
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,846.33	14,443.50
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）		5,878,108.47	1,628,941.65
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,772,203.03	1,314,683.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	105,905.44	314,258.15
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	1,436,704.98	1,238,236.02
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	72,320.18	-459,064.94
<b>减：二、营业总支出</b>		130,235.43	162,382.21
1. 管理人报酬		108,529.45	128,215.33
2. 托管费		21,705.98	25,643.04
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	7.4.7.16	-	8,523.84
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>7,260,744.53</b>	<b>2,260,174.02</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>7,260,744.53</b>	<b>2,260,174.02</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>7,260,744.53</b>	<b>2,260,174.02</b>

### 7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	4,000,000.00	8,850,429.50	12,850,429.50
（一）、综合收益总额	-	7,260,744.53	7,260,744.53
（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）	4,000,000.00	1,589,684.97	5,589,684.97
其中：1. 基金申购款	36,000,000.00	5,860,860.88	41,860,860.88
2. 基金赎回款	-32,000,000.00	-4,271,175.91	-36,271,175.91
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	22,356,000.00	8,937,698.18	31,293,698.18
项目	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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）	-6,000,000.00	-548,003.81	-6,548,003.81

号填列)			
(一)、综合收益总额	-	2,260,174.02	2,260,174.02
(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)	-6,000,000.00	-2,808,177.83	-8,808,177.83
其中: 1. 基金申购款	296,000,000.00	-53,595,299.61	242,404,700.39
2. 基金赎回款	-302,000,000.00	50,787,121.78	-251,212,878.22
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	18,356,000.00	87,268.68	18,443,268.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：李昇 主管会计工作负责人：李昇 会计机构负责人：吴洪涛

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 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 3 月 26 日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(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 7.4.4 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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 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要求,真实、完整地反映了本基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况、2025 年度的经营成果和净资产变动情况。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

#### (2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中的其他负债科目下列示。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3) 衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申

购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。在收益评价日，当基金净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可进行收益分配。收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的

指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财税[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》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。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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

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

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴

纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	591,626.78	399,817.55
等于：本金	591,498.52	399,729.81
加：应计利息	128.26	87.74
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	591,626.78	399,817.55

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	28,059,708.85	-	30,703,380.91	2,643,672.06
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		28,059,708.85	-	30,703,380.91	2,643,672.06
项目		上年度末			
		2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		16,666,435.68	-	17,873,402.76	1,206,967.08
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		16,666,435.68	-	17,873,402.76	1,206,967.08

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末均未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末均未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末均未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末均未持有其他资产。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	1,997.02	5,160.61
其中：交易所市场	1,997.02	5,160.61
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	-	8,523.84
合计	1,997.02	13,684.45

#### 7.4.7.7 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 12 月 31 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	36,000,000.00	36,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-32,000,000.00	-32,000,000.00
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。

#### 7.4.7.8 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	5,824,039.55	1,436,704.98	7,260,744.53
本期基金份额交易产生的变动数	4,031,369.63	-2,441,684.66	1,589,684.97
其中：基金申购款	14,803,082.72	-8,942,221.84	5,860,860.88
基金赎回款	-10,771,713.09	6,500,537.18	-4,271,175.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,728,103.93	-3,790,405.75	8,937,698.18

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	3,544.20	5,537.26
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	158.91	4,028.29
其他	143.22	4,877.95
合计	3,846.33	14,443.50

#### 7.4.7.10 股票投资收益

##### 7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,738,252.58	1,182,496.01
股票投资收益——赎回差价收入	1,033,950.45	132,187.49
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	5,772,203.03	1,314,683.50

##### 7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025 年 1 月 1 日至 2025 年 12 月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

	月 31 日	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	47,600,155.18	205,230,770.87
减：卖出股票成本总额	42,815,787.37	203,827,770.82
减：交易费用	46,115.23	220,504.04
买卖股票差价收入	4,738,252.58	1,182,496.01

#### 7.4.7.10.3 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	36,271,175.91	251,212,878.22
减：现金支付赎回款总额	25,090,476.91	174,921,196.22
减：赎回股票成本总额	10,146,748.55	76,159,494.51
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	1,033,950.45	132,187.49

#### 7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无债券投资收益。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间均无衍生工具收益。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年1月1日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	105,905.44	314,258.15
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	105,905.44	314,258.15

#### 7.4.7.14 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12月31日	上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日

1.交易性金融资产	1,436,704.98	1,238,236.02
——股票投资	1,436,704.98	1,238,236.02
——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	1,436,704.98	1,238,236.02

#### 7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
基金赎回费收入	-	-
ETF 替代损益	72,320.18	-459,064.94
合计	72,320.18	-459,064.94

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。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
审计费用	-	8,523.84

信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
合计	-	8,523.84

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

##### 7.4.9.1 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。

##### 7.4.9.2 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
国泰全球投资管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国泰元鑫资产管理有限公司	基金管理人的控股子公司
国网英大国际控股集团有限公司	基金管理人的股东
意大利忠利集团(Assicurazioni Generali S.p.A.)	基金管理人的股东
中国建银投资有限责任公司(“中国建投”)	基金管理人的控股股东
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。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年1月1日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年1月1日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总	成交金额	占当期股票成交总

		额的比例		额的比例
中信建投证券	7,638,162.65	7.65%	5,512,945.13	1.33%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 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。

#### 7.4.10.1.4 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。

#### 7.4.10.1.5 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 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信建投证券	1,035.84	6.51%	3.16	0.16%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
中信建投证券	748.01	0.82%	745.31	14.44%

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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	108,529.45	128,215.33
其中：应支付销售机构的客户维护费	13,972.75	1,824.10
应支付基金管理人的净管理费	94,556.70	126,391.23

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	21,705.98	25,643.04

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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2025年1月1日至2025年12月31日	2024年1月1日至2024年12月31日
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	16,245,500.00	-
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%	-

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 7.4.10.4.2 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。

#### 7.4.10.5 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12月31日		2024年1月1日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信建投证券	591,626.78	3,544.20	399,817.55	5,537.26

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。

#### 7.4.10.6 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。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期及上年度可比期间内，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，本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，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。

##### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出

现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放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 12 月 31 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2024 年 12 月 31 日：0.00%)。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同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。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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

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，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2025 年 12 月 31 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）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	30,703,380.91	98.11	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	-	-	-	-
合计	30,703,380.91	98.11	17,873,402.76	96.91

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 1,540,310.48	增加约 881,022.90
	业绩比较基准下降 5%	减少约 1,540,310.48	减少约 881,022.90

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

#### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

##### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	30,703,380.91	17,819,238.76
第二层次	-	54,164.00
第三层次	-	-
合计	30,703,380.91	17,873,402.76

##### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

##### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

##### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 7.4.15 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 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 41,860,860.88 元，其中包括以股票支付的申购款 12,174,122.00 元和以现金支付的申购款 29,686,738.88 元(2024 年度：本基金申购基金份额的对价总额为 242,404,700.39 元，其中包括以股票支付的申购款 64,952,718.42 元和以现金支付的申购款 177,451,981.97 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。

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	30,703,380.91	98.06
	其中：股票	30,703,380.91	98.06
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	591,626.78	1.89
8	其他各项资产	16,332.19	0.05
9	合计	31,311,339.88	100.00

注：上述股票投资包括可退替代款估值增值。

### 8.2 期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

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	190,965.00	0.61
B	采矿业	261,897.00	0.84
C	制造业	22,562,273.49	72.10

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	570,760.75	1.82
E	建筑业	428,900.00	1.37
F	批发和零售业	983,526.80	3.14
G	交通运输、仓储和邮政业	360,638.00	1.15
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,663,157.03	8.51
J	金融业	61,156.00	0.20
K	房地产业	556,137.00	1.78
L	租赁和商务服务业	612,606.04	1.96
M	科学研究和技术服务业	513,436.80	1.64
N	水利、环境和公共设施管理业	449,822.00	1.44
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	195,006.00	0.62
Q	卫生和社会工作	33,592.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	228,879.00	0.73
S	综合	30,628.00	0.10
	合计	30,703,380.91	98.11

### 8.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002969	嘉美包装	15,500	196,230.00	0.63
2	000592	平潭发展	9,800	150,920.00	0.48
3	688239	航宇科技	1,720	116,392.40	0.37

4	002759	天际股份	2,200	102,146.00	0.33
5	603067	振华股份	3,220	92,768.20	0.30
6	002169	智光电气	7,800	90,246.00	0.29
7	688627	精智达	400	89,436.00	0.29
8	605305	中际联合	2,040	84,986.40	0.27
9	300842	帝科股份	1,420	84,163.40	0.27
10	002284	亚太股份	5,500	82,115.00	0.26
11	605196	华通线缆	2,300	79,902.00	0.26
12	300469	信息发展	1,200	74,160.00	0.24
13	688388	嘉元科技	1,800	73,764.00	0.24
14	300018	中元股份	6,700	73,700.00	0.24
15	000036	华联控股	11,000	72,600.00	0.23
16	300217	东方电热	13,900	72,002.00	0.23
17	002792	通宇通讯	1,660	70,882.00	0.23
18	600960	渤海汽车	12,000	66,960.00	0.21
19	603929	亚翔集成	700	66,850.00	0.21
20	601113	华鼎股份	14,200	66,456.00	0.21
21	000973	佛塑科技	4,500	66,150.00	0.21
22	688049	炬芯科技	1,246	65,539.60	0.21
23	002102	能特科技	19,500	64,935.00	0.21
24	000551	创元科技	4,400	64,680.00	0.21
25	002483	润邦股份	8,900	63,546.00	0.20
26	002009	天奇股份	2,800	63,336.00	0.20
27	300756	金马游乐	1,100	62,568.00	0.20
28	002115	三维通信	4,900	62,426.00	0.20
29	688510	航亚科技	2,300	61,870.00	0.20
30	002033	丽江股份	6,700	61,305.00	0.20
31	688160	步科股份	400	61,000.00	0.19
32	300420	五洋自控	15,200	60,648.00	0.19
33	688416	恒烁股份	1,100	60,643.00	0.19
34	301080	百普赛斯	1,120	60,480.00	0.19
35	002527	新时达	3,400	60,316.00	0.19
36	688191	智洋创新	1,847	59,436.46	0.19
37	300984	金沃股份	700	59,416.00	0.19
38	603686	福龙马	2,000	59,380.00	0.19
39	603040	新坐标	643	59,149.57	0.19
40	300382	斯莱克	3,800	59,128.00	0.19
41	300684	中石科技	1,200	59,064.00	0.19
42	688598	金博股份	2,000	58,720.00	0.19
43	002838	道恩股份	2,400	57,792.00	0.18
44	300435	中泰股份	2,600	57,772.00	0.18
45	300503	昊志机电	900	57,348.00	0.18
46	002448	中原内配	4,400	56,892.00	0.18
47	002255	海陆重工	4,500	56,790.00	0.18

48	300278	华昌达	9,300	56,730.00	0.18
49	688025	杰普特	400	56,628.00	0.18
50	603626	科森科技	2,700	56,538.00	0.18
51	301368	丰立智能	900	56,403.00	0.18
52	002376	新北洋	7,300	56,356.00	0.18
53	002587	奥拓电子	8,300	56,108.00	0.18
54	002067	景兴纸业	9,900	55,935.00	0.18
55	603936	博敏电子	4,400	55,880.00	0.18
56	300304	云意电气	4,800	55,872.00	0.18
57	300680	隆盛科技	1,000	55,870.00	0.18
58	301246	宏源药业	2,200	55,000.00	0.18
59	600558	大西洋	9,000	54,900.00	0.18
60	002290	禾盛新材	1,200	54,840.00	0.18
61	300241	瑞丰光电	9,800	54,782.00	0.18
62	300164	通源石油	9,900	54,648.00	0.17
63	002546	新联电子	7,800	54,522.00	0.17
64	002467	二六三	8,900	54,201.00	0.17
65	688031	星环科技	500	54,095.00	0.17
66	603703	盛洋科技	3,700	53,946.00	0.17
67	688222	成都先导	2,300	53,935.00	0.17
68	301413	安培龙	400	53,920.00	0.17
69	300790	宇瞳光学	1,800	53,838.00	0.17
70	002210	飞马国际	14,900	53,640.00	0.17
71	002160	常铝股份	10,300	53,560.00	0.17
72	603111	康尼机电	7,800	53,430.00	0.17
73	300138	晨光生物	4,300	53,363.00	0.17
74	300219	鸿利智汇	7,400	53,354.00	0.17
75	300342	天银机电	1,600	53,008.00	0.17
76	300909	汇创达	1,100	52,910.00	0.17
77	000962	东方钨业	1,600	52,896.00	0.17
78	688531	日联科技	800	52,824.00	0.17
79	002106	莱宝高科	4,800	52,608.00	0.17
80	300412	迦南科技	9,800	52,430.00	0.17
81	002293	罗莱生活	5,100	52,377.00	0.17
82	002206	海利得	8,900	52,065.00	0.17
83	300145	南方泵业	11,000	51,920.00	0.17
84	000863	三湘印象	8,200	51,086.00	0.16
85	688195	腾景科技	300	50,865.00	0.16
86	002250	联化科技	3,800	50,844.00	0.16
87	300057	万顺新材	8,900	50,641.00	0.16
88	000419	通程控股	7,900	50,481.00	0.16
89	300228	富瑞特装	5,100	50,439.00	0.16
90	688636	智明达	1,168	50,037.12	0.16
91	300206	理邦仪器	3,900	49,881.00	0.16

92	301387	光大同创	900	49,860.00	0.16
93	301486	致尚科技	400	49,620.00	0.16
94	688668	鼎通科技	400	49,600.00	0.16
95	002703	浙江世宝	2,400	49,440.00	0.16
96	300806	斯迪克	1,600	49,184.00	0.16
97	002666	德联集团	8,900	49,039.00	0.16
98	301280	珠城科技	920	48,999.20	0.16
99	002437	誉衡药业	15,900	48,813.00	0.16
100	000850	华茂股份	8,900	48,683.00	0.16
101	002283	天润工业	7,800	48,672.00	0.16
102	301007	德迈仕	1,200	48,624.00	0.16
103	002392	北京利尔	6,500	48,620.00	0.16
104	688518	联赢激光	2,000	48,580.00	0.16
105	300139	晓程科技	1,600	48,576.00	0.16
106	000548	湖南投资	8,900	48,416.00	0.15
107	002639	雪人集团	2,600	48,360.00	0.15
108	603319	美湖股份	1,320	48,285.60	0.15
109	002919	名臣健康	2,096	48,187.04	0.15
110	001267	汇绿生态	2,200	48,180.00	0.15
111	300976	达瑞电子	800	48,056.00	0.15
112	300771	智莱科技	3,100	48,050.00	0.15
113	002956	西麦食品	1,700	47,804.00	0.15
114	603859	能科科技	1,136	47,768.80	0.15
115	000726	鲁泰 A	6,700	47,704.00	0.15
116	000510	新金路	4,100	47,478.00	0.15
117	603660	苏州科达	4,300	47,429.00	0.15
118	603011	合锻智能	2,000	47,420.00	0.15
119	002560	通达股份	4,700	47,376.00	0.15
120	002471	中超控股	5,900	47,318.00	0.15
121	600071	凤凰光学	2,200	47,300.00	0.15
122	300709	精研科技	1,000	47,160.00	0.15
123	688207	格灵深瞳	3,100	47,120.00	0.15
124	300900	广联航空	1,200	46,884.00	0.15
125	002057	中钢天源	4,600	46,874.00	0.15
126	002549	凯美特气	2,200	46,684.00	0.15
127	000534	万泽股份	2,100	46,200.00	0.15
128	688108	赛诺医疗	2,400	46,176.00	0.15
129	688656	浩欧博	300	46,140.00	0.15
130	002196	方正电机	2,900	46,023.00	0.15
131	002922	伊戈尔	1,500	45,930.00	0.15
132	301096	百诚医药	800	45,712.00	0.15
133	603380	易德龙	1,200	45,600.00	0.15
134	603633	徕木股份	4,500	45,585.00	0.15
135	688066	航天宏图	1,400	45,584.00	0.15

136	688353	华盛锂电	400	45,480.00	0.15
137	002827	高争民爆	1,200	45,276.00	0.14
138	300990	同飞股份	500	45,075.00	0.14
139	605016	百龙创园	2,086	45,057.60	0.14
140	300267	尔康制药	13,200	45,012.00	0.14
141	002478	常宝股份	5,300	44,891.00	0.14
142	688535	华海诚科	400	44,832.00	0.14
143	002296	辉煌科技	4,000	44,800.00	0.14
144	601929	吉视传媒	13,000	44,720.00	0.14
145	300292	吴通控股	9,900	44,649.00	0.14
145	300586	美联新材	4,100	44,649.00	0.14
147	300189	神农种业	6,000	44,640.00	0.14
147	688512	慧智微	4,000	44,640.00	0.14
149	300436	广生堂	500	44,575.00	0.14
150	601789	宁波建工	8,900	44,411.00	0.14
151	601218	吉鑫科技	8,700	44,022.00	0.14
152	300162	雷曼光电	5,400	43,902.00	0.14
153	300389	艾比森	2,700	43,821.00	0.14
154	300335	迪森股份	7,600	43,776.00	0.14
155	002970	锐明技术	900	43,650.00	0.14
156	688458	美芯晟	1,100	43,604.00	0.14
157	300540	蜀道装备	2,180	43,600.00	0.14
158	600067	冠城新材	10,500	43,575.00	0.14
159	600351	亚宝药业	6,700	43,483.00	0.14
160	688418	震有科技	1,000	43,480.00	0.14
161	603112	华翔股份	2,500	43,425.00	0.14
162	000554	泰山石油	6,700	43,416.00	0.14
163	300154	瑞凌股份	4,400	43,340.00	0.14
163	300547	川环科技	1,100	43,340.00	0.14
165	300872	天阳科技	2,100	43,176.00	0.14
166	301525	儒竞科技	500	43,170.00	0.14
167	300973	立高食品	1,000	43,000.00	0.14
168	603200	上海洗霸	600	42,684.00	0.14
169	300893	松原安全	1,800	42,552.00	0.14
170	002175	东方智造	9,600	42,528.00	0.14
171	603969	银龙股份	4,200	42,462.00	0.14
172	300355	蒙草生态	10,500	42,420.00	0.14
173	002177	御银股份	4,500	42,345.00	0.14
174	603301	振德医疗	600	42,300.00	0.14
175	300111	向日葵	6,900	42,297.00	0.14
176	600713	南京医药	7,700	42,042.00	0.13
177	001283	豪鹏科技	600	42,000.00	0.13
178	002167	东方锆业	3,400	41,990.00	0.13
179	300404	博济医药	4,500	41,985.00	0.13

180	300520	科大国创	1,200	41,868.00	0.13
181	000523	红棉股份	11,100	41,847.00	0.13
182	002358	森源电气	7,700	41,734.00	0.13
183	600962	国投中鲁	1,900	41,667.00	0.13
184	600496	精工钢构	10,000	41,500.00	0.13
185	003040	楚天龙	2,000	41,360.00	0.13
186	600609	金杯汽车	8,900	41,207.00	0.13
187	002787	华源控股	3,300	41,085.00	0.13
188	600103	青山纸业	9,800	41,062.00	0.13
189	000659	珠海中富	10,100	41,006.00	0.13
190	688589	力合微	1,800	40,950.00	0.13
191	600973	宝胜股份	5,600	40,880.00	0.13
192	300032	金龙机电	7,600	40,812.00	0.13
193	600255	鑫科材料	10,600	40,810.00	0.13
194	002515	金字火腿	6,700	40,803.00	0.13
195	002298	中电鑫龙	3,900	40,716.00	0.13
196	002297	博云新材	3,400	40,698.00	0.13
197	002334	英威腾	4,500	40,590.00	0.13
198	603167	渤海轮渡	4,300	40,549.00	0.13
199	300421	力星股份	1,100	40,458.00	0.13
200	300291	百纳千成	5,400	40,446.00	0.13
201	688788	科思科技	600	40,404.00	0.13
202	688593	新相微	2,000	40,360.00	0.13
203	600237	铜峰电子	4,500	40,320.00	0.13
204	603668	天马科技	2,420	40,317.20	0.13
205	000700	模塑科技	2,800	40,264.00	0.13
206	300465	高伟达	2,000	40,260.00	0.13
207	688143	长盈通	800	40,168.00	0.13
208	688507	索辰科技	400	40,116.00	0.13
209	000803	山高环能	5,600	40,040.00	0.13
210	605128	上海沿浦	1,086	40,029.96	0.13
211	002769	普路通	3,400	39,950.00	0.13
212	300148	天舟文化	9,100	39,949.00	0.13
213	300053	航宇微	2,100	39,942.00	0.13
214	300499	高澜股份	1,300	39,884.00	0.13
215	301489	思泉新材	200	39,800.00	0.13
216	002339	积成电子	4,500	39,690.00	0.13
217	002552	宝鼎科技	2,400	39,624.00	0.13
218	688651	盛邦安全	900	39,618.00	0.13
219	688201	信安世纪	2,700	39,501.00	0.13
220	605289	罗曼股份	600	39,456.00	0.13
221	002870	香山股份	1,000	39,320.00	0.13
222	300328	宜安科技	2,300	39,261.00	0.13
223	300980	祥源新材	1,200	39,156.00	0.13

224	300938	信测标准	1,201	39,152.60	0.13
225	000949	新乡化纤	7,100	39,050.00	0.12
226	002805	丰元股份	2,200	39,006.00	0.12
227	688428	诺诚健华	1,900	38,988.00	0.12
228	002785	万里石	1,100	38,852.00	0.12
229	000957	中通客车	3,400	38,828.00	0.12
230	688225	亚信安全	2,000	38,800.00	0.12
231	688609	九联科技	3,800	38,798.00	0.12
232	300258	精锻科技	2,700	38,664.00	0.12
233	002638	勤上股份	12,500	38,625.00	0.12
234	002975	博杰股份	500	38,500.00	0.12
235	002606	大连电瓷	4,400	38,456.00	0.12
236	300201	海伦哲	5,600	38,248.00	0.12
237	300740	水羊股份	1,600	38,144.00	0.12
238	002449	国星光电	4,500	38,070.00	0.12
239	688311	盟升电子	834	38,030.40	0.12
240	002062	宏润建设	4,100	37,925.00	0.12
241	000404	长虹华意	5,600	37,912.00	0.12
242	002246	北化股份	2,100	37,842.00	0.12
243	002523	天桥起重	8,800	37,752.00	0.12
244	603861	白云电器	3,100	37,727.00	0.12
245	002829	星网宇达	1,200	37,704.00	0.12
246	002374	中锐股份	10,400	37,440.00	0.12
247	002765	蓝黛科技	2,800	37,436.00	0.12
248	002997	瑞鹄模具	1,000	37,400.00	0.12
249	002066	瑞泰科技	2,000	37,360.00	0.12
250	300647	超频三	5,400	37,206.00	0.12
251	002613	北玻股份	10,000	37,200.00	0.12
252	300222	科大智能	3,400	37,196.00	0.12
253	300667	必创科技	2,100	37,128.00	0.12
254	603901	永创智能	2,600	36,920.00	0.12
255	688093	世华科技	1,000	36,850.00	0.12
256	600846	同济科技	2,800	36,820.00	0.12
257	300071	福石控股	5,600	36,568.00	0.12
258	002346	柘中股份	1,800	36,558.00	0.12
259	300120	经纬辉开	4,300	36,550.00	0.12
260	603758	秦安股份	2,100	36,519.00	0.12
261	300815	玉禾田	1,600	36,448.00	0.12
262	000859	国风新材	3,600	36,432.00	0.12
263	301013	利和兴	1,300	36,413.00	0.12
264	002526	山东矿机	10,100	36,360.00	0.12
265	300288	朗玛信息	2,700	36,342.00	0.12
266	600106	重庆路桥	5,800	36,308.00	0.12
267	002766	索菱股份	6,000	36,300.00	0.12

268	002263	大东南	10,900	36,297.00	0.12
269	300302	同有科技	2,000	36,280.00	0.12
270	600708	光明地产	9,300	36,177.00	0.12
271	300112	万讯自控	4,200	36,162.00	0.12
272	600501	航天晨光	1,200	36,156.00	0.12
273	300745	欣锐科技	1,400	36,064.00	0.12
274	600203	福日电子	2,700	36,018.00	0.12
275	002631	德尔未来	6,000	35,880.00	0.11
276	600855	航天长峰	1,700	35,768.00	0.11
277	300317	珈伟新能	9,300	35,712.00	0.11
278	688095	福昕软件	400	35,708.00	0.11
279	300400	劲拓股份	1,800	35,640.00	0.11
280	003002	壶化股份	1,100	35,607.00	0.11
281	605088	冠盛股份	1,000	35,600.00	0.11
282	301210	金杨精密	978	35,599.20	0.11
283	300264	佳创视讯	5,300	35,563.00	0.11
284	002642	荣联科技	4,300	35,561.00	0.11
285	688378	奥来德	1,300	35,490.00	0.11
286	300322	硕贝德	1,300	35,477.00	0.11
287	603618	杭电股份	4,400	35,464.00	0.11
288	300403	汉宇集团	2,460	35,448.60	0.11
289	002181	粤传媒	4,100	35,342.00	0.11
290	002640	跨境通	7,800	35,334.00	0.11
291	300918	南山智尚	1,900	35,321.00	0.11
292	000526	学大教育	900	35,298.00	0.11
293	300557	理工光科	1,000	35,290.00	0.11
294	301382	蜂助手	995	35,262.80	0.11
295	301160	翔楼新材	490	35,226.10	0.11
296	002164	宁波东力	2,200	35,222.00	0.11
297	688722	同益中	1,800	35,190.00	0.11
298	600724	宁波富达	6,100	35,136.00	0.11
299	603665	康隆达	1,100	35,112.00	0.11
300	600880	博瑞传播	7,100	35,074.00	0.11
301	002757	南兴股份	1,800	35,046.00	0.11
302	301370	国科恒泰	3,000	35,040.00	0.11
303	688167	炬光科技	200	35,014.00	0.11
304	600730	中国高科	3,200	35,008.00	0.11
305	600367	红星发展	2,000	34,940.00	0.11
306	002134	天津普林	1,300	34,827.00	0.11
307	002082	万邦德	2,500	34,825.00	0.11
308	002277	友阿股份	5,000	34,800.00	0.11
309	300424	航新科技	1,900	34,789.00	0.11
310	300840	酷特智能	1,700	34,765.00	0.11
311	603186	华正新材	700	34,720.00	0.11

312	300046	台基股份	1,000	34,700.00	0.11
313	300005	探路者	3,200	34,656.00	0.11
314	000153	丰原药业	5,520	34,610.40	0.11
315	301195	北路智控	1,000	34,530.00	0.11
316	601226	华电科工	4,400	34,496.00	0.11
317	600736	苏州高新	5,100	34,476.00	0.11
318	600288	大恒科技	2,300	34,454.00	0.11
319	301110	青木科技	520	34,413.60	0.11
320	688258	卓易信息	449	34,379.93	0.11
321	300247	融捷健康	6,700	34,371.00	0.11
322	300423	昇辉科技	4,100	34,358.00	0.11
323	601616	广电电气	8,900	34,354.00	0.11
324	605488	福莱新材	1,000	34,350.00	0.11
325	002272	川润股份	2,100	34,335.00	0.11
326	600184	光电股份	1,800	34,308.00	0.11
327	688299	长阳科技	2,024	34,246.08	0.11
328	002949	华阳国际	2,200	34,210.00	0.11
329	605319	无锡振华	1,620	34,084.80	0.11
330	002843	泰嘉股份	1,700	34,068.00	0.11
331	600135	乐凯胶片	3,300	34,056.00	0.11
332	300546	雄帝科技	1,300	34,047.00	0.11
332	300559	佳发教育	2,700	34,047.00	0.11
334	301076	新瀚新材	690	34,023.90	0.11
335	002540	亚太科技	4,800	33,984.00	0.11
336	000506	招金黄金	2,600	33,956.00	0.11
337	301391	卡莱特	400	33,940.00	0.11
338	300817	双飞股份	1,600	33,936.00	0.11
339	301209	联合化学	300	33,867.00	0.11
340	002522	浙江众成	6,000	33,840.00	0.11
340	688202	美迪西	600	33,840.00	0.11
342	600262	北方股份	1,300	33,839.00	0.11
343	300192	科德教育	1,600	33,808.00	0.11
344	688035	德邦科技	700	33,775.00	0.11
345	300991	创益通	800	33,744.00	0.11
346	300731	科创新源	600	33,732.00	0.11
347	601388	怡球资源	11,200	33,712.00	0.11
348	002685	华东重机	4,500	33,705.00	0.11
349	002908	德生科技	3,200	33,696.00	0.11
350	300143	盈康生命	3,400	33,592.00	0.11
351	301086	鸿富瀚	300	33,567.00	0.11
352	002734	利民股份	2,100	33,474.00	0.11
353	688259	创耀科技	800	33,440.00	0.11
354	688277	天智航	2,200	33,418.00	0.11
355	000919	金陵药业	4,200	33,390.00	0.11

355	002438	江苏神通	2,100	33,390.00	0.11
357	603098	森特股份	2,400	33,384.00	0.11
358	603977	国泰集团	2,400	33,360.00	0.11
359	600626	申达股份	6,900	33,327.00	0.11
360	300048	合康新能	5,600	33,320.00	0.11
360	603966	法兰泰克	2,800	33,320.00	0.11
362	301328	维峰电子	700	33,299.00	0.11
363	002955	鸿合科技	1,100	33,297.00	0.11
364	688685	迈信林	600	33,288.00	0.11
365	688210	统联精密	600	33,192.00	0.11
366	603085	天成自控	2,800	33,180.00	0.11
367	600756	浪潮软件	1,800	33,156.00	0.11
368	002117	东港股份	2,400	33,144.00	0.11
369	688084	晶品特装	400	33,120.00	0.11
370	603088	宁波精达	3,200	33,056.00	0.11
371	000753	漳州发展	4,200	33,054.00	0.11
372	301330	熵基科技	1,000	33,050.00	0.11
373	002367	康力电梯	4,100	33,046.00	0.11
374	002090	金智科技	2,800	33,040.00	0.11
375	300221	银禧科技	3,200	33,024.00	0.11
376	601339	百隆东方	5,700	33,003.00	0.11
377	002590	万安科技	2,200	33,000.00	0.11
378	300652	雷迪克	600	32,916.00	0.11
379	002971	和远气体	1,100	32,868.00	0.11
380	600592	龙溪股份	1,200	32,772.00	0.10
381	000042	中洲控股	4,300	32,766.00	0.10
382	000026	飞亚达	2,000	32,760.00	0.10
383	000816	智慧农业	8,900	32,752.00	0.10
384	301326	捷邦科技	300	32,748.00	0.10
384	301389	隆扬电子	600	32,748.00	0.10
386	301266	宇邦新材	900	32,715.00	0.10
387	603538	美诺华	1,700	32,708.00	0.10
388	603429	集友股份	3,300	32,703.00	0.10
389	300491	通合科技	1,300	32,669.00	0.10
390	301199	迈赫股份	1,400	32,648.00	0.10
391	002380	科远智慧	1,200	32,640.00	0.10
391	300488	恒锋工具	1,000	32,640.00	0.10
393	002886	沃特股份	1,500	32,580.00	0.10
394	002393	力生制药	1,500	32,565.00	0.10
395	002783	凯龙股份	3,400	32,538.00	0.10
396	603938	三孚股份	1,700	32,487.00	0.10
397	001212	中旗新材	640	32,448.00	0.10
398	603270	金帝股份	1,200	32,436.00	0.10
399	002559	亚威股份	3,200	32,384.00	0.10

400	300331	苏大维格	1,000	32,360.00	0.10
401	000925	众合科技	3,600	32,328.00	0.10
402	600251	冠农股份	3,500	32,305.00	0.10
403	301348	蓝箭电子	1,600	32,304.00	0.10
404	002655	共达电声	2,500	32,300.00	0.10
405	300905	宝丽迪	1,000	32,230.00	0.10
406	002337	赛象科技	4,900	32,193.00	0.10
407	002208	合肥城建	2,600	32,188.00	0.10
408	002161	远望谷	4,400	32,164.00	0.10
408	300272	开能健康	4,300	32,164.00	0.10
410	600503	华丽家族	12,000	32,160.00	0.10
411	002094	青岛金王	4,200	32,130.00	0.10
411	002983	芯瑞达	1,400	32,130.00	0.10
413	600121	郑州煤电	7,700	32,109.00	0.10
414	002741	光华科技	1,600	32,096.00	0.10
415	300727	润禾材料	900	32,076.00	0.10
416	603600	永艺股份	2,700	32,049.00	0.10
417	603629	利通电子	1,200	31,980.00	0.10
418	688556	高测股份	2,800	31,976.00	0.10
419	603520	司太立	3,400	31,960.00	0.10
420	002349	精华制药	4,400	31,944.00	0.10
420	300161	华中数控	1,100	31,944.00	0.10
422	300733	西菱动力	1,700	31,943.00	0.10
423	300582	英飞特	2,000	31,940.00	0.10
424	603275	众辰科技	700	31,906.00	0.10
425	002554	惠博普	10,000	31,900.00	0.10
425	300617	安靠智电	1,000	31,900.00	0.10
427	600510	黑牡丹	3,800	31,882.00	0.10
428	002708	光洋股份	2,400	31,872.00	0.10
429	603058	永吉股份	3,400	31,858.00	0.10
430	002915	中欣氟材	1,300	31,850.00	0.10
431	600576	祥源文旅	5,100	31,824.00	0.10
432	603158	腾龙股份	3,000	31,800.00	0.10
433	603611	诺力股份	1,300	31,785.00	0.10
434	000561	烽火电子	2,600	31,772.00	0.10
435	002406	远东传动	4,000	31,760.00	0.10
435	600571	信雅达	2,000	31,760.00	0.10
437	002996	顺博合金	4,200	31,752.00	0.10
437	688186	广大特材	1,400	31,752.00	0.10
439	002636	金安国纪	1,900	31,749.00	0.10
440	002350	北京科锐	3,900	31,746.00	0.10
440	300011	鼎汉技术	3,700	31,746.00	0.10
442	300639	凯普生物	5,900	31,742.00	0.10
443	603121	华培动力	1,500	31,740.00	0.10

444	002579	中京电子	2,600	31,668.00	0.10
445	000533	顺钠股份	3,800	31,654.00	0.10
446	002659	凯文教育	5,400	31,644.00	0.10
447	002026	山东威达	2,100	31,605.00	0.10
448	002599	盛通股份	3,700	31,598.00	0.10
449	003037	三和管桩	3,900	31,590.00	0.10
450	001328	登康口腔	800	31,584.00	0.10
451	603507	振江股份	1,200	31,572.00	0.10
452	002140	东华科技	2,800	31,528.00	0.10
453	002510	天汽模	4,300	31,519.00	0.10
454	002418	康盛股份	6,600	31,482.00	0.10
454	688588	凌志软件	2,200	31,482.00	0.10
456	603181	皇马科技	2,200	31,438.00	0.10
457	688678	福立旺	1,300	31,434.00	0.10
458	600523	贵航股份	2,000	31,420.00	0.10
459	300213	佳讯飞鸿	3,300	31,416.00	0.10
460	603289	泰瑞机器	3,100	31,372.00	0.10
461	001314	亿道信息	700	31,367.00	0.10
462	301383	天键股份	880	31,363.20	0.10
463	605228	神通科技	2,100	31,353.00	0.10
464	000655	金岭矿业	3,300	31,350.00	0.10
464	002225	濮耐股份	5,500	31,350.00	0.10
464	600843	上工申贝	2,500	31,350.00	0.10
467	301397	溯联股份	900	31,347.00	0.10
468	300505	川金诺	1,400	31,346.00	0.10
469	300277	海联讯	2,400	31,320.00	0.10
470	300227	光韵达	3,400	31,314.00	0.10
471	000936	华西股份	3,800	31,274.00	0.10
471	002452	长高电新	3,800	31,274.00	0.10
473	603767	中马传动	1,300	31,265.00	0.10
474	600858	银座股份	5,000	31,250.00	0.10
475	300781	因赛集团	898	31,232.44	0.10
476	601177	杭齿前进	1,800	31,230.00	0.10
477	002491	通鼎互联	5,200	31,200.00	0.10
477	600794	保税科技	8,000	31,200.00	0.10
479	000823	超声电子	2,300	31,188.00	0.10
480	002148	北纬科技	3,500	31,150.00	0.10
480	002512	ST 达华	5,000	31,150.00	0.10
482	002664	信质集团	1,300	31,148.00	0.10
483	002876	三利谱	1,300	31,122.00	0.10
484	301617	博苑股份	400	31,108.00	0.10
484	603325	博隆技术	400	31,108.00	0.10
486	301566	达利凯普	1,600	31,088.00	0.10
487	600052	东望时代	6,600	31,086.00	0.10

488	601599	浙文影业	7,800	31,044.00	0.10
489	300248	新开普	2,500	31,025.00	0.10
490	002825	纳尔股份	2,700	31,023.00	0.10
491	300067	安诺其	6,200	31,000.00	0.10
491	300481	濮阳惠成	2,000	31,000.00	0.10
493	002878	元隆雅图	1,700	30,974.00	0.10
494	002662	峰璟股份	7,700	30,954.00	0.10
495	603579	荣泰健康	1,300	30,953.00	0.10
496	002198	嘉应制药	4,400	30,932.00	0.10
497	002707	众信旅游	4,300	30,917.00	0.10
498	000509	华塑控股	8,900	30,883.00	0.10
499	300218	安利股份	1,900	30,875.00	0.10
500	301149	隆华新材	2,900	30,856.00	0.10
501	300063	天龙集团	3,600	30,852.00	0.10
502	688023	安恒信息	600	30,846.00	0.10
503	300042	朗科科技	1,200	30,840.00	0.10
504	600694	大商股份	1,720	30,839.60	0.10
505	000819	岳阳兴长	1,900	30,837.00	0.10
506	002976	瑞玛精密	1,100	30,833.00	0.10
507	002455	百川股份	4,300	30,831.00	0.10
508	300656	民德电子	1,400	30,828.00	0.10
509	000717	中南股份	11,900	30,821.00	0.10
510	603318	水发燃气	4,600	30,820.00	0.10
511	002556	辉隆股份	5,100	30,804.00	0.10
511	600824	益民集团	6,800	30,804.00	0.10
513	688513	苑东生物	500	30,775.00	0.10
514	002917	金奥博	2,300	30,774.00	0.10
515	003010	若羽臣	880	30,773.60	0.10
516	300873	海晨股份	1,400	30,758.00	0.10
517	300963	中洲特材	1,480	30,754.40	0.10
518	600749	西藏旅游	1,800	30,744.00	0.10
519	300249	依米康	2,100	30,723.00	0.10
520	301507	民生健康	2,000	30,720.00	0.10
521	002609	捷顺科技	3,300	30,657.00	0.10
522	603032	德新科技	1,600	30,656.00	0.10
523	600628	新世界	3,900	30,654.00	0.10
524	000532	华金资本	1,900	30,628.00	0.10
524	300532	今天国际	2,600	30,628.00	0.10
526	600830	香溢融通	3,200	30,624.00	0.10
527	002042	华孚时尚	7,200	30,600.00	0.10
528	688212	澳华内镜	700	30,597.00	0.10
529	688691	灿芯股份	300	30,594.00	0.10
530	002474	榕基软件	3,100	30,566.00	0.10
531	600108	亚盛集团	9,700	30,555.00	0.10

532	000045	深纺织 A	2,500	30,550.00	0.10
533	301320	豪江智能	1,800	30,546.00	0.10
534	000576	甘化科工	2,900	30,537.00	0.10
534	300231	银信科技	2,900	30,537.00	0.10
534	300448	浩云科技	3,900	30,537.00	0.10
537	000852	石化机械	4,200	30,534.00	0.10
538	600318	新力金融	3,400	30,532.00	0.10
539	000070	特发信息	2,600	30,524.00	0.10
539	002695	煌上煌	2,600	30,524.00	0.10
541	002323	雅博股份	18,600	30,504.00	0.10
542	002112	三变科技	2,300	30,498.00	0.10
543	002676	顺威股份	3,700	30,488.00	0.10
544	300484	蓝海华腾	1,600	30,480.00	0.10
544	300489	光智科技	600	30,480.00	0.10
546	002480	新筑股份	4,900	30,478.00	0.10
547	300881	盛德鑫泰	900	30,474.00	0.10
548	603018	华设集团	4,000	30,440.00	0.10
549	300399	天利科技	1,200	30,420.00	0.10
550	002386	天原股份	5,600	30,408.00	0.10
551	000421	南京公用	4,400	30,404.00	0.10
552	002037	保利联合	3,200	30,400.00	0.10
552	600650	锦江在线	2,000	30,400.00	0.10
554	300662	科锐国际	1,200	30,396.00	0.10
555	603615	茶花股份	1,300	30,394.00	0.10
556	002451	摩恩电气	3,000	30,390.00	0.10
557	002035	华帝股份	4,900	30,380.00	0.10
558	002562	兄弟科技	4,700	30,362.00	0.10
559	002746	仙坛股份	5,000	30,350.00	0.10
560	603990	麦迪科技	2,000	30,340.00	0.10
561	300507	苏奥传感	3,300	30,327.00	0.10
562	601008	连云港	5,700	30,324.00	0.10
563	002362	汉王科技	1,400	30,296.00	0.10
564	001338	永顺泰	2,500	30,275.00	0.10
565	603916	苏博特	3,200	30,272.00	0.10
566	300565	科信技术	2,400	30,264.00	0.10
566	688089	嘉必优	1,300	30,264.00	0.10
568	301337	亚华电子	1,100	30,261.00	0.10
569	600512	腾达建设	12,500	30,250.00	0.10
570	002520	日发精机	4,800	30,240.00	0.10
570	300179	四方达	2,000	30,240.00	0.10
572	002869	金溢科技	1,300	30,238.00	0.10
573	000815	美利云	2,700	30,213.00	0.10
574	688677	海泰新光	700	30,212.00	0.10
575	300494	盛天网络	2,480	30,206.40	0.10

576	603989	艾华集团	1,800	30,204.00	0.10
577	301220	亚香股份	800	30,200.00	0.10
578	000715	中兴商业	4,800	30,192.00	0.10
579	300858	科拓生物	1,800	30,186.00	0.10
580	300016	北陆药业	3,800	30,172.00	0.10
581	002912	中新赛克	1,000	30,140.00	0.10
582	300203	聚光科技	1,900	30,134.00	0.10
583	300784	利安科技	600	30,132.00	0.10
584	603015	弘讯科技	2,400	30,120.00	0.10
585	600590	泰豪科技	3,200	30,112.00	0.10
586	002184	海得控制	2,300	30,107.00	0.10
586	002899	英派斯	1,100	30,107.00	0.10
588	688620	安凯微	2,500	30,100.00	0.10
589	300345	华民股份	4,800	30,096.00	0.10
590	002232	启明信息	1,600	30,080.00	0.10
590	002441	众业达	3,200	30,080.00	0.10
590	002730	电光科技	2,000	30,080.00	0.10
593	300681	英搏尔	1,200	30,072.00	0.10
593	603421	鼎信通讯	4,200	30,072.00	0.10
595	301310	鑫宏业	700	30,065.00	0.10
596	688168	安博通	400	30,064.00	0.10
597	002469	三维化学	3,600	30,060.00	0.10
598	605388	均瑶健康	4,040	30,057.60	0.10
599	002016	世荣兆业	5,200	30,056.00	0.10
599	301580	爱迪特	680	30,056.00	0.10
601	002553	南方精工	1,100	30,041.00	0.10
602	002121	科陆电子	3,900	30,030.00	0.10
603	003038	鑫铂股份	1,900	30,020.00	0.10
603	300135	宝利国际	7,600	30,020.00	0.10
605	300359	全通教育	5,600	30,016.00	0.10
606	300176	鸿特科技	4,500	30,015.00	0.10
607	002330	得利斯	6,200	30,008.00	0.10
608	600605	汇通能源	1,000	30,000.00	0.10
609	300381	溢多利	4,600	29,992.00	0.10
610	002570	贝因美	4,900	29,988.00	0.10
611	000524	岭南控股	2,500	29,975.00	0.10
612	603173	福斯达	700	29,974.00	0.10
613	300911	亿田智能	900	29,970.00	0.10
614	601956	东贝集团	4,200	29,946.00	0.10
615	603527	众源新材	2,700	29,943.00	0.10
616	600293	三峡新材	9,500	29,925.00	0.10
617	300041	回天新材	2,700	29,916.00	0.10
618	002615	哈尔斯	3,900	29,913.00	0.10
619	301270	汉仪股份	800	29,904.00	0.10

620	300701	森霸传感	2,300	29,900.00	0.10
620	605080	浙江自然	1,300	29,900.00	0.10
622	002479	富春环保	6,100	29,890.00	0.10
623	002547	春兴精工	6,400	29,888.00	0.10
624	300880	迦南智能	1,700	29,886.00	0.10
625	002918	蒙娜丽莎	2,100	29,883.00	0.10
626	002535	林州重机	7,700	29,876.00	0.10
627	002344	海宁皮城	6,300	29,862.00	0.10
628	002580	圣阳股份	2,400	29,856.00	0.10
628	688320	禾川科技	800	29,856.00	0.10
630	002561	徐家汇	3,400	29,852.00	0.10
631	600594	益佰制药	7,500	29,850.00	0.10
632	600101	明星电力	3,227	29,849.75	0.10
633	002953	日丰股份	2,600	29,848.00	0.10
634	300690	双一科技	900	29,835.00	0.10
634	600300	维维股份	8,500	29,835.00	0.10
636	603166	福达股份	1,900	29,830.00	0.10
637	600283	钱江水利	3,260	29,829.00	0.10
638	300622	博士眼镜	960	29,817.60	0.10
639	603918	金桥信息	1,900	29,811.00	0.10
640	002641	公元股份	6,900	29,808.00	0.10
641	300890	翔丰华	1,000	29,800.00	0.10
642	301099	雅创电子	700	29,792.00	0.10
643	603366	日出东方	3,100	29,791.00	0.10
644	600610	中毅达	3,000	29,790.00	0.10
645	600731	湖南海利	4,400	29,788.00	0.10
646	300504	天邑股份	2,000	29,780.00	0.10
646	300968	格林精密	2,000	29,780.00	0.10
648	002688	金河生物	5,000	29,750.00	0.10
649	301302	华如科技	1,300	29,731.00	0.10
650	600868	梅雁吉祥	8,900	29,726.00	0.09
651	300950	德固特	1,300	29,718.00	0.09
652	600540	新赛股份	6,500	29,705.00	0.09
653	300365	恒华科技	4,700	29,704.00	0.09
654	300425	中建环能	6,000	29,700.00	0.09
655	600796	钱江生化	4,900	29,694.00	0.09
656	300194	福安药业	6,700	29,681.00	0.09
657	600527	江南高纤	13,800	29,670.00	0.09
658	000882	华联股份	14,400	29,664.00	0.09
659	002021	中捷资源	12,000	29,640.00	0.09
659	002445	中南文化	11,400	29,640.00	0.09
659	002962	五方光电	2,000	29,640.00	0.09
659	600278	东方创业	3,900	29,640.00	0.09
663	600187	国中水务	11,900	29,631.00	0.09

664	603779	威龙股份	4,600	29,624.00	0.09
665	002628	成都路桥	7,200	29,592.00	0.09
666	300988	津荣天宇	1,300	29,575.00	0.09
667	300293	蓝英装备	1,400	29,568.00	0.09
667	300340	科恒股份	2,400	29,568.00	0.09
669	605066	天正电气	4,050	29,565.00	0.09
670	603002	宏昌电子	4,000	29,560.00	0.09
671	605218	伟时电子	1,600	29,520.00	0.09
672	603339	四方科技	2,300	29,509.00	0.09
673	300916	朗特智能	900	29,502.00	0.09
674	300040	九洲集团	4,900	29,498.00	0.09
675	000531	穗恒运 A	4,600	29,486.00	0.09
676	002165	红宝丽	3,900	29,484.00	0.09
677	000521	长虹美菱	4,500	29,475.00	0.09
678	000912	泸天化	7,100	29,465.00	0.09
679	600479	千金药业	2,900	29,464.00	0.09
680	600622	光大嘉宝	10,300	29,458.00	0.09
681	300174	元力股份	1,900	29,450.00	0.09
682	002733	雄韬股份	1,500	29,445.00	0.09
683	603367	辰欣药业	1,700	29,444.00	0.09
684	002988	豪美新材	800	29,440.00	0.09
685	301499	维科精密	1,000	29,430.00	0.09
686	300486	东杰智能	1,500	29,415.00	0.09
686	600162	香江控股	15,900	29,415.00	0.09
688	603697	有友食品	2,400	29,400.00	0.09
688	603811	诚意药业	2,800	29,400.00	0.09
688	688173	希荻微	2,000	29,400.00	0.09
691	002178	延华智能	4,600	29,394.00	0.09
692	002877	智能自控	3,200	29,376.00	0.09
692	300160	秀强股份	5,400	29,376.00	0.09
694	600439	瑞贝卡	10,600	29,362.00	0.09
695	300566	激智科技	1,600	29,360.00	0.09
696	300793	佳禾智能	1,800	29,358.00	0.09
696	603727	博迈科	2,100	29,358.00	0.09
698	300105	龙源技术	4,100	29,356.00	0.09
699	000558	天府文旅	5,700	29,355.00	0.09
700	300563	神宇股份	800	29,344.00	0.09
701	300562	乐心医疗	2,200	29,326.00	0.09
702	300708	聚灿光电	3,300	29,304.00	0.09
703	600513	联环药业	1,600	29,296.00	0.09
704	300275	梅安森	2,200	29,282.00	0.09
705	603122	合富中国	1,200	29,280.00	0.09
706	605179	一鸣食品	1,400	29,274.00	0.09
707	688665	四方光电	600	29,262.00	0.09

708	002661	克明食品	3,200	29,248.00	0.09
709	002614	奥佳华	4,000	29,240.00	0.09
709	002786	银宝山新	3,400	29,240.00	0.09
711	605098	行动教育	700	29,232.00	0.09
712	688315	诺禾致源	2,200	29,216.00	0.09
713	600684	珠江股份	6,700	29,212.00	0.09
714	000560	我爱我家	10,000	29,200.00	0.09
715	300688	创业黑马	1,000	29,190.00	0.09
716	002578	闽发铝业	6,500	29,185.00	0.09
717	002103	广博股份	3,200	29,184.00	0.09
717	600545	卓郎智能	11,400	29,184.00	0.09
719	600405	动力源	5,600	29,176.00	0.09
720	301396	宏景科技	440	29,172.00	0.09
721	000812	陕西金叶	6,100	29,158.00	0.09
722	001896	豫能控股	5,600	29,120.00	0.09
722	600467	好当家	11,200	29,120.00	0.09
722	603602	纵横通信	2,000	29,120.00	0.09
725	600354	敦煌种业	4,500	29,115.00	0.09
726	600722	金牛化工	4,900	29,106.00	0.09
727	001205	盛航股份	1,700	29,070.00	0.09
727	300153	科泰电源	1,000	29,070.00	0.09
727	600653	申华控股	15,300	29,070.00	0.09
730	000900	现代投资	7,100	29,039.00	0.09
731	603890	春秋电子	1,800	29,034.00	0.09
732	603855	华荣股份	1,500	29,025.00	0.09
733	600742	富维股份	2,900	29,000.00	0.09
734	300694	蠡湖股份	2,400	28,992.00	0.09
735	300307	慈星股份	4,100	28,987.00	0.09
736	002055	ST 得润	4,300	28,982.00	0.09
737	300380	安硕信息	700	28,959.00	0.09
738	000897	津滨发展	12,700	28,956.00	0.09
738	002692	远程股份	5,700	28,956.00	0.09
740	002616	长青集团	5,300	28,938.00	0.09
741	300447	全信股份	1,600	28,928.00	0.09
742	000570	苏常柴 A	5,200	28,912.00	0.09
743	300510	金冠股份	7,000	28,910.00	0.09
744	603110	东方材料	1,800	28,908.00	0.09
745	002377	国创高新	10,100	28,886.00	0.09
746	300172	中电环保	5,300	28,885.00	0.09
747	600798	宁波海运	8,200	28,864.00	0.09
748	600860	京城股份	2,300	28,842.00	0.09
749	002866	传艺科技	1,600	28,816.00	0.09
750	002054	德美化工	3,900	28,782.00	0.09
751	300583	赛托生物	2,100	28,749.00	0.09

752	002269	美邦服饰	15,200	28,728.00	0.09
753	603168	莎普爱思	3,900	28,704.00	0.09
754	300149	睿智医药	3,000	28,680.00	0.09
755	301230	泓博医药	960	28,675.20	0.09
756	603718	海利生物	4,700	28,670.00	0.09
757	688602	康鹏科技	3,300	28,644.00	0.09
758	688799	华纳药厂	600	28,620.00	0.09
759	301172	君逸数码	1,300	28,613.00	0.09
760	605277	新亚电子	1,300	28,600.00	0.09
761	002213	大为股份	1,100	28,578.00	0.09
762	002442	龙星科技	4,600	28,566.00	0.09
763	600400	红豆股份	12,000	28,560.00	0.09
764	600979	广安爱众	6,500	28,535.00	0.09
765	002577	雷柏科技	1,600	28,496.00	0.09
766	300805	电声股份	2,700	28,485.00	0.09
767	002369	卓翼科技	3,300	28,479.00	0.09
768	605266	健之佳	1,480	28,445.60	0.09
769	600825	新华传媒	4,600	28,428.00	0.09
770	300061	旗天科技	2,700	28,404.00	0.09
771	002950	奥美医疗	2,600	28,392.00	0.09
772	601579	会稽山	1,400	28,378.00	0.09
773	300310	宜通世纪	4,800	28,368.00	0.09
774	002365	永安药业	1,900	28,348.00	0.09
775	002137	实益达	3,300	28,314.00	0.09
776	300025	华星创业	4,900	28,224.00	0.09
777	600396	华电辽能	9,900	28,215.00	0.09
778	603999	读者传媒	4,000	28,120.00	0.09
779	002481	双塔食品	5,500	28,105.00	0.09
780	002995	天地在线	1,700	28,084.00	0.09
781	600630	龙头股份	3,100	27,993.00	0.09
782	605398	新炬网络	980	27,959.40	0.09
783	600613	神奇制药	4,600	27,922.00	0.09
784	603223	恒通股份	3,000	27,900.00	0.09
785	688319	欧林生物	1,100	27,896.00	0.09
786	300375	鹏翎股份	5,300	27,878.00	0.09
787	002321	华英农业	12,100	27,830.00	0.09
788	301520	万邦医药	700	27,811.00	0.09
789	002593	日上集团	4,700	27,777.00	0.09
790	300121	阳谷华泰	2,200	27,764.00	0.09
791	301060	兰卫医学	3,000	27,750.00	0.09
792	000601	韶能股份	5,900	27,730.00	0.09
792	300683	海特生物	1,000	27,730.00	0.09
794	300471	厚普股份	2,200	27,720.00	0.09
795	300571	平治信息	1,000	27,650.00	0.09

796	000701	厦门信达	4,200	27,594.00	0.09
797	601010	文峰股份	10,100	27,573.00	0.09
798	000788	北大医药	4,500	27,495.00	0.09
799	300862	蓝盾光电	1,200	27,456.00	0.09
800	688399	硕世生物	400	27,400.00	0.09
801	000078	海王生物	7,900	27,334.00	0.09
802	300094	国联水产	7,670	27,305.20	0.09
803	301030	仕净科技	2,300	27,209.00	0.09
804	688221	前沿生物	1,500	27,075.00	0.09
805	300299	富春股份	3,800	26,980.00	0.09
806	688244	永信至诚	1,100	26,884.00	0.09
807	002589	瑞康医药	8,300	26,726.00	0.09
808	300461	田中精机	1,400	26,712.00	0.09
809	600981	苏豪汇鸿	8,500	26,690.00	0.09
810	301102	兆讯传媒	2,540	26,644.60	0.09
811	300245	天玑科技	2,200	26,598.00	0.08
812	002398	垒知集团	4,728	26,571.36	0.08
813	002285	世联行	9,300	26,505.00	0.08
814	688719	爱科赛博	600	26,490.00	0.08
815	002229	鸿博股份	1,700	26,265.00	0.08
816	002632	道明光学	2,100	26,145.00	0.08
817	603386	骏亚科技	1,700	26,061.00	0.08
818	688227	品高股份	400	26,004.00	0.08
819	002575	群兴玩具	4,200	25,956.00	0.08
820	002348	高乐股份	4,500	25,875.00	0.08
821	002235	安妮股份	2,500	25,850.00	0.08
822	002343	慈文传媒	3,600	25,776.00	0.08
823	600530	交大昂立	4,000	25,760.00	0.08
824	002682	龙洲股份	3,000	25,710.00	0.08
825	300081	恒信东方	4,900	25,431.00	0.08
826	603931	格林达	800	25,264.00	0.08
827	002752	昇兴股份	3,800	25,232.00	0.08
828	300215	电科院	3,900	24,804.00	0.08
829	300831	派瑞股份	2,200	24,244.00	0.08
830	300056	中创环保	2,900	23,838.00	0.08
831	300941	创识科技	1,000	23,610.00	0.08
831	688059	华锐精密	300	23,610.00	0.08
833	688787	海天瑞声	200	23,198.00	0.07
834	688228	开普云	100	19,461.00	0.06

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002896	中大力德	164,060.00	0.89
2	002102	能特科技	138,054.00	0.75
3	300436	广生堂	134,502.00	0.73
4	002250	联化科技	133,542.00	0.72
5	002376	新北洋	132,442.00	0.72
6	002515	金字火腿	128,190.00	0.70
7	301550	斯菱智驱	125,322.00	0.68
8	002033	丽江股份	124,657.00	0.68
9	300098	高新兴	121,678.00	0.66
10	300766	每日互动	121,132.00	0.66
11	300131	英唐智控	116,875.00	0.63
12	002552	宝鼎科技	113,966.00	0.62
13	000419	通程控股	113,436.00	0.62
14	001283	豪鹏科技	113,389.00	0.61
15	301413	安培龙	113,113.00	0.61
16	002483	润邦股份	110,980.00	0.60
17	000962	东方钨业	110,655.00	0.60
18	300217	东方电热	110,247.00	0.60
19	002379	宏创控股	109,739.00	0.60
20	300842	帝科股份	108,844.00	0.59

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

### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688313	仕佳光子	213,888.45	1.16
2	002896	中大力德	202,390.80	1.10
3	301550	斯菱智驱	200,558.85	1.09
4	300131	英唐智控	197,673.00	1.07
5	002379	宏创控股	188,310.00	1.02
6	300098	高新兴	167,742.00	0.91
7	300766	每日互动	160,521.00	0.87
8	300972	万辰集团	156,929.00	0.85

9	002250	联化科技	143,356.00	0.78
10	002170	芭田股份	139,361.00	0.76
11	300436	广生堂	132,604.00	0.72
12	300007	汉威科技	132,048.00	0.72
13	002031	巨轮智能	128,439.00	0.70
14	301018	申菱环境	127,453.00	0.69
15	600410	华胜天成	124,511.00	0.68
16	300353	东土科技	122,662.00	0.67
17	002536	飞龙股份	119,833.00	0.65
18	300378	鼎捷数智	119,071.00	0.65
19	002965	祥鑫科技	114,943.60	0.62
20	600105	永鼎股份	112,273.00	0.61

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

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	52,181,687.09
卖出股票的收入（成交）总额	47,600,155.18

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

### 8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资股指期货。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体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。

8.12.2 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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	16,332.19
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	16,332.19

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有可转换债券。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
427	52,355.97	19,503,498.00	87.24%	2,852,502.00	12.76%

### 9.2 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	国泰基金管理有限公司	16,245,500.00	72.67%
2	招商证券股份有限公司	1,395,244.00	6.24%
3	上海万丰友方投资管理有限公司	919,500.00	4.11%
4	BARCLAYS BANK PLC	453,254.00	2.03%
5	马玉明	448,100.00	2.00%
6	上海雁丰投资管理有限公司—雁丰 稳进天泽 9 号私募基金	231,900.00	1.04%
7	上海雁丰投资管理有限公司—雁丰 祥佑 1 号私募证券投资基金	214,700.00	0.96%
8	殷善林	200,000.00	0.89%
9	丁永清	156,700.00	0.70%
10	刘壮	145,000.00	0.65%

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。

### 9.3 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%

9.4 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

§10 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	36,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	32,000,000.00
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

§11 重大事件揭示

11.1 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。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

2025 年 12 月 2 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三十九次会议审议通过，倪莹女士离任公司首席信息官，转任公司督察长。

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 2025 年 12 月起，中信建投证券股份有限公司托管部高级管理人员增加邱珂磊为托管部联席负责人。

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。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，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。

## 11.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自 2024 年起改聘毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度应支付给聘任会计师事务所的报酬为 6,000.00 元。

## 11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	国泰基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2025 年 5 月 9 日
采取调查或处罚等措施的机构	中国证监会上海监管局
受到调查或处罚等措施类型	行政监管措施
受到的具体措施类型	责令改正
受到调查或处罚等措施的原因	投资运作

受到处罚的依据	《公开募集证券投资基金管理人监督管理办法》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司已采取完善管控机制、加强管理等整改措施，现已完成整改，并经中国证监会上海监管局验收通过。
其他	无

### 11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内基金管理人高级管理人员及相关从业人员无受调查或处罚等情况。

### 11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内基金托管人无受调查或处罚等情况。

### 11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华金证券	1	53,141,689.75	53.26%	7,223.18	45.43%	-
申万宏源证券	3	39,001,989.87	39.09%	7,640.50	48.05%	-
中信建投	6	7,638,162.65	7.65%	1,035.84	6.51%	-

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。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

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

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	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告	《中国证券报》	2025-05-30
7	国泰基金管理有限公司关于旗下部分上交所 ETF 申购赎回清单版本更新的公告	《中国证券报》、《上海证券报》、《证券时报》、《证券日报》	2025-11-10
8	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》	2025-12-02

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2025年07月25日至2025年12月31日	-	16,245,500.00	-	16,245,500.00	72.67%
	2	2025年01月01日至2025年07月09日, 2025年07月11日至2025年07月28日	8,150,644.00	25,220,100.00	31,975,500.00	1,395,244.00	6.24%
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。							

## §13 备查文件目录

### 13.1 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

### 13.2 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。

基金托管人住所或办公场所。

### 13.3 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

二〇二六年三月三十日