

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	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遵规守信情况的说明	11
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	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
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	14
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	14
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	38
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	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.12 投资组合报告附注	53

8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	54
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	54
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	55
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.....	55
9 开放式基金份额变动	55
10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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.....	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变.....	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	56
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	56
10.8 其他重大事件.....	58
11 影响投资者决策的其他重要信息	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
12 备查文件目录	60
12.1 备查文件目录.....	60
12.2 存放地点.....	60
12.3 查阅方式.....	60

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发国证 2000ETF
场内简称	2000ETF
基金主代码	159907
交易代码	159907
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 6 月 12 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	233,197,694.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2011-08-10

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最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取抽样复制法，基金管理人将综合考虑代表性、相关性、估值、流动性等因素挑选标的指数中成份股或备选成份股构建指数化投资组合，使构建的投资组合与标的指数在风险收益特征上尽可能相似，达到复制标的指数、降低交易成本的目的。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股（含存托凭证）的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。 具体投资策略包括：1、股票（含存托凭证）投资策略；2、债券投资策略；3、资产支持证券投资策略；4、股指期货投资策略；5、股票期权投资策略；6、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	国证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用抽样复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	广发基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	项军	任航
	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95105828	95599
传真		020-34281105	010-68121816
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		510308	100031
法定代表人		葛长伟	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

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（2024年1月1日至2024年6月30日）
本期已实现收益	-14,255,344.63
本期利润	-20,937,831.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1083
本期加权平均净值利润率	-12.29%

本期基金份额净值增长率	-15.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	13,199,488.78
期末可供分配基金份额利润	0.0566
期末基金资产净值	141,535,989.45
期末基金份额净值	0.6069
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-19.82%

注：（1）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。

（2）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。

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

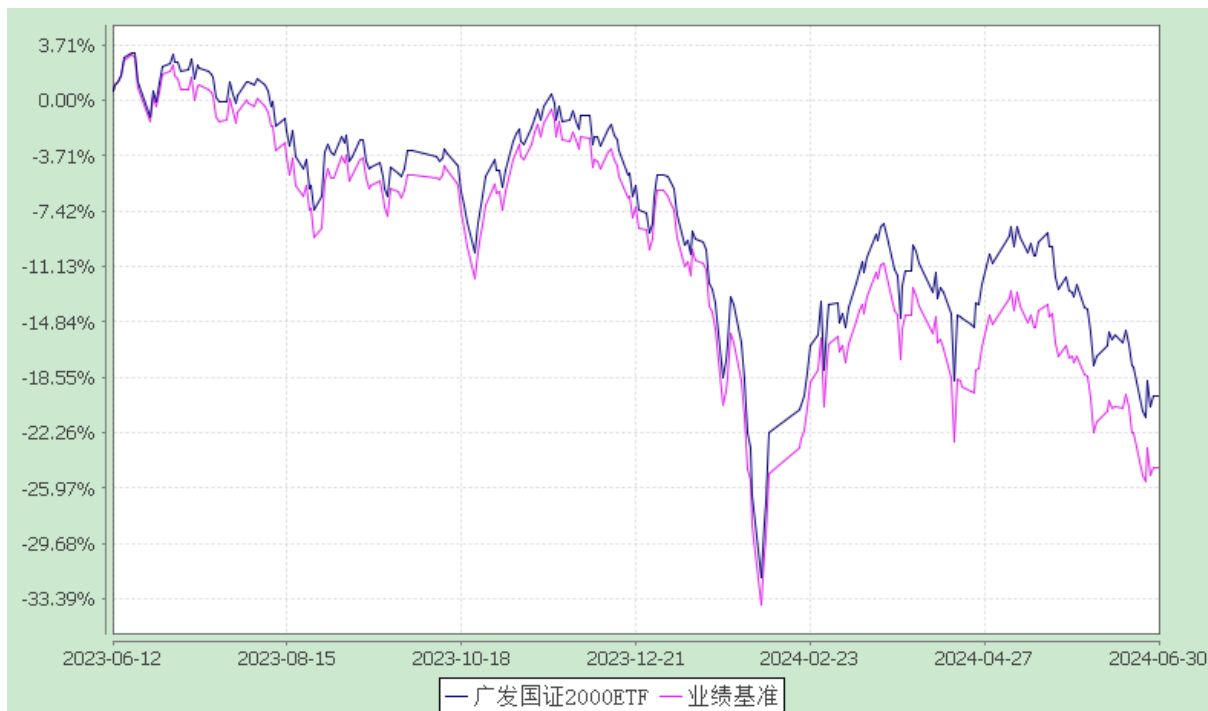
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.48%	1.56%	-8.98%	1.58%	0.50%	-0.02%
过去三个月	-9.49%	1.65%	-11.89%	1.68%	2.40%	-0.03%
过去六个月	-15.59%	2.11%	-19.67%	2.12%	4.08%	-0.01%
过去一年	-21.56%	1.63%	-25.85%	1.65%	4.29%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-19.82%	1.61%	-24.55%	1.63%	4.73%	-0.02%

3.2.2 自基金转型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

广发国证 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 6 月 12 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2023 年 6 月 12 日正式转型为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

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

经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准，本基金管理人于 2003 年 8 月 5 日成立。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、基金投资顾问、社保基金境内投资管理人、基本养老保险基金证券投资管理机构、保险资金投资管理人、保险保障基金委托资产管理投资管理人、QDII、QDLP 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、固定收益、海外投资、被动投资、量化投资、FOF 投资、另类投资等类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
霍华明	本基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投	2023-07-24	-	16 年	霍华明先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF 基金助理兼研究员、广

	<p>资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证全指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；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证建筑工程交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证军工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；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证建筑工程交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发恒生科技交易型开放式指数证券投资基金联接基金(QDII)的基金经理；广发中</p>				<p>发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 6 月 29 日)、广发中证建筑工程指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 2 月 1 日至 2021 年 7 月 26 日)、广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 11 月 23 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2021 年 11 月 23 日)、广发恒生科技指数证券投资基金(QDII)基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 3 月 7 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 5 月 15 日)、广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2023 年 5 月 15 日)、广发上海金交易型开放式证券投资基金基金经理(自 2020 年 7 月 8 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金基金经理(自 2020 年 8 月 5 日至 2023 年 7 月 24 日)、广发中证医疗指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2022 年 11 月 15 日至 2023 年 9 月 14 日)、广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2019 年 11 月 14 日至 2024 年 3 月 30 日)。</p>
--	--	--	--	--	---

	<p>证医疗交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金 (LOF) 的基金经理； 广发沪深 300 交易型开放式 指数证券投资 基金联接基金 的基金经理； 广发沪深 300 交易型开放式 指数证券投资 基金的基金经 理；广发国证 2000 交易型 开放式指数证 券投资基金联 接基金的基金 经理；广发中 证医疗交易型 开放式指数证 券投资基金的 基金经理；广 发国证信息技 术创新主题交 易型开放式指 数证券投资基金 的基金经 理；广发中证 云计算与大数 据主题交易型 开放式指数证 券投资基金的 基金经理；广 发中证国新港 股通央企红利 交易型开放式 指数证券投资 基金的基金经 理</p>				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》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投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公司通过建立科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过实时的行为监控与及时的分析评估，保证公平交易原则的实现。

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的投资标的必须来源于公司备选库，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易过程中，中央交易部按照“时间优先、价格优先、比例分配、综合平衡”的原则，公平分配投资指令。金融工程与风险管理部风险控制岗通过投资交易系统对投资交易过程进行实时监控及预警，实现投资风险的事中风险控制；稽核岗通过对投资、研究及交易等全流程的独立监察稽核，实现投资风险的事后控制。

本报告期内，上述公平交易制度总体执行情况良好，不同的投资组合受到了公平对待，未发生任何不公平的交易事项。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本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% 的交易共有 14 次，其中 13 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，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

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

报告期内，本基金主要采取抽样方式跟踪指数。报告期内，本基金交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

2024 年上半年，部分国家继续采取措施应对通胀压力，利率维持在高位，部分地区存在冲突升级的风险。尽管如此，全球经济仍处在复苏阶段，主要经济体增长动能有所分化，整体趋势向好。国内经济方面，政府实施的稳健货币政策和积极财政政策逐渐显现出效果。通过减税降费、增加公共投资等措施，有效地支持了实体经济的发展，促进了就业和消费。产业结构持续优化，新兴产业快速发展，成为经济增长的新动力。同时，国内市场消费潜力进一步释放，消费对经济增长的贡献率稳步提升。在政策效应的持续显现下，投资、出口等关键领域也表现出强劲韧性，为经济增长提供了有力支撑。总体来看，我国经济基本面稳健，发展势头良好。

A 股市场方面，2024 年上半年，上证指数下跌 0.25%，深证成指下跌 7.10%，创业板指数下跌 10.99%，沪深 300 指数上涨 0.89%，国证 2000 指数下跌 19.67%。

国证 2000 指数选取 2000 个小市值的公司，以反映小市值公司在二级市场的表现。国证 2000 指数具有较为广泛的行业分布，包括了科技、医药、新能源、消费等多个行业领域。2024 年上半年，中小盘股票经历了显著的市场波动和政策调整。政策方面，新国九条发布，A 股市场出现了积极的新变化，上市公司更加注重提升业务科技含量和公司投资价值。同时，退市监管力度加大，不合格上市公司加速出清，这有助于净化市场环境，提升中小股票的整体质量。这一政策旨在清理劣质公司，改善 A 股的供需关系，提升流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-15.59%，同期业绩比较基准收益率为-19.67%。

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 2024 年下半年，全球经济将延续缓慢复苏的步伐，但面临的不确定性依然较多。主要经济体之间的政策分化、地缘政治紧张以及贸易摩擦等因素，都可能对全球经济复苏进程产生干扰。在此背景下，国际货币基金组织和世界银行等机构可能会继续调整全球经济增长预期，以反映当前复杂多变的经济环境。国内经济方面，预计将保持稳定增长态势。随着宏观政策的持续实施，经济增长的内生动力将进一步增强。同时，扩大内需政策的深入推进，将有助于提振消费信心、稳定投资增长，推动经济实现高质量发展。国内经济虽然仍面临一些挑战，如房地产市场调整、地方债务问题等，但我国的宏观政策依然有很大发挥空间，我国中央政府债务水平和通胀率较低，财政、货币以及其他政策依然有比较大的回旋余地。下半年，预计政府将继续加强宏观调控和政策引导，确保经济平稳健康发展。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、资产管理产品相关会计处理规定、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。

本基金管理人设有估值委员会，负责制订健全、有效的估值政策和程序，定期对估值政策和程序的执行情况进行评价，确保基金估值的公平、合理。估值委员会配备投资、研究、会计和风控等岗位资深人员。为保证基金估值的客观独立，基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。

本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。本报告期内，参与估值流程各方之间不存在重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按合同约定提供相关投资品种的估值数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同中“基金收益与分配”之“基金收益分配原则”的相关规定，本基金本报告期内未进行利润分配，符合合同规定。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—广发基金管理有限公司 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为, 广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上, 不存在损害基金份额持有人利益的行为; 在报告期内, 严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规, 在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为, 广发基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定, 基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整, 未发现有损害基金持有人利益的行为。

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：广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	6,103,663.04	3,477,775.34
结算备付金		89,671.83	62,608.05
存出保证金		109,932.96	357,788.13
交易性金融资产	6.4.7.2	136,006,113.30	177,748,533.75
其中：股票投资		136,002,164.35	177,631,218.59
基金投资		-	-
债券投资		3,948.95	117,315.16
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	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.12	-
资产总计		142,384,790.25	181,646,705.27
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	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		60,222.87	71,241.58
应付托管费		12,044.56	14,248.32
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.19	0.35
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	776,533.18	962,444.53
负债合计		848,800.80	1,047,934.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	128,336,500.67	138,242,503.45
未分配利润	6.4.7.9	13,199,488.78	42,356,267.04
净资产合计		141,535,989.45	180,598,770.49
负债和净资产总计		142,384,790.25	181,646,705.27

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.6069 元，基金份额总额 233,197,694.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 6 月 12 日（基 金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-20,264,313.61	13,363,650.47
1.利息收入		20,199.14	2,412.16
其中：存款利息收入	6.4.7.10	20,199.14	2,412.16
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）		-13,765,299.45	1,431,203.61
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-15,508,261.91	1,053,520.70
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	19,269.63	3.44
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	1,723,692.83	377,679.47
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	-6,682,486.46	11,174,882.45
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	163,273.16	755,152.25
减：二、营业总支出		673,517.48	78,300.69
1. 管理人报酬		425,259.54	59,334.38
2. 托管费		85,051.92	11,866.87
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	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		0.22	0.02
8. 其他费用	6.4.7.21	163,205.80	7,099.42
三、利润总额（亏损总额以“-”号填 列）		-20,937,831.09	13,285,349.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-20,937,831.09	13,285,349.78
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-20,937,831.09	13,285,349.78

注：（1）本基金合同生效日为 2023 年 6 月 12 日，上年度可比期间不完整。

（2）比较数据已根据更新发布的《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>》中的利润表格式的要求进行重新列示：即将上年度利润表中的“证券出借利息收入”合并于“其他利息收入”中列示。

6.3 净资产变动表

会计主体：广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	138,242,503.45	42,356,267.04	180,598,770.49
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	138,242,503.45	42,356,267.04	180,598,770.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-9,906,002.78	-29,156,778.26	-39,062,781.04
（一）、综合收益总额	-	-20,937,831.09	-20,937,831.09
（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）	-9,906,002.78	-8,218,947.17	-18,124,949.95
其中：1. 基金申购款	82,550,023.42	7,004,467.35	89,554,490.77
2. 基金赎回款	-92,456,026.20	-15,223,414.52	-107,679,440.72
（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	128,336,500.67	13,199,488.78	141,535,989.45

项目	上年度可比期间 2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 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	70,551,484.26	26,485,703.35	97,037,187.61
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	70,551,484.26	26,485,703.35	97,037,187.61
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	315,341,089.37	130,147,954.40	445,489,043.77
（一）、综合收益总额	-	13,285,349.78	13,285,349.78
（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）	315,341,089.37	116,862,604.62	432,203,693.99
其中：1.基金申购款	363,220,102.94	136,165,926.39	499,386,029.33
2.基金赎回款	-47,879,013.57	-19,303,321.77	-67,182,335.34
（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	385,892,573.63	156,633,657.75	542,526,231.38

注：本基金合同生效日为 2023 年 6 月 12 日，上年度可比期间不完整。

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：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）由广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型而成。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据本基金的管理人于 2023 年 6 月 12 日发布的《关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效暨基金更名、复牌及恢复办理申购赎回业务的公告》，自 2023 年 6 月 12 日起，广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金变更为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。自同日起，《广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等法律文件失效，《广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》等法律文件生效。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度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

本基金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 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实

施减半征收。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中

债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%和 2%缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

基金从上市公司分配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，减按 50%计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，减按 25%计入应纳税所得额；自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

(5) 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2024 年 6 月 30 日
活期存款	6,103,663.04
等于：本金	6,102,598.16
加：应计利息	1,064.88
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	6,103,663.04

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	145,616,658.79	-	136,002,164.35	-9,614,494.44	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所	4,000.00	14.95	3,948.95	-66.00
	银行间	-	-	-	-
	合计	4,000.00	14.95	3,948.95	-66.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	145,620,658.79	14.95	136,006,113.30	-9,614,560.44	

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工具。

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	75,409.12
合计	75,409.12

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	191,004.10
其中：交易所市场	191,004.10
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,529.08
合计	776,533.18

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	125,598,847.00	138,242,503.45
本期申购	60,000,000.00	66,040,018.74
本期赎回（以“-”号填列）	-45,000,000.00	-49,530,014.04
2024 年 3 月 29 日基金拆分/份额折算前	140,598,847.00	154,752,508.15
基金拆分/份额折算调整	140,598,847.00	—
本期申购	30,000,000.00	16,510,004.68
本期赎回（以“-”号填列）	-78,000,000.00	-42,926,012.16
本期末	233,197,694.00	128,336,500.67

注：本基金已于 2024 年 3 月 29 日进行了基金份额拆分，拆分比例为 2，即每一份基金份额拆分成 2 份。

6.4.7.9 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	116,339,967.99	-73,983,700.95	42,356,267.04
本期期初	116,339,967.99	-73,983,700.95	42,356,267.04

本期利润	-14,255,344.63	-6,682,486.46	-20,937,831.09
本期基金份额交易产生的变动数	-7,115,768.79	-1,103,178.38	-8,218,947.17
其中：基金申购款	68,193,511.96	-61,189,044.61	7,004,467.35
基金赎回款	-75,309,280.75	60,085,866.23	-15,223,414.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	94,968,854.57	-81,769,365.79	13,199,488.78

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	16,872.51
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	2,456.69
其他	869.94
合计	20,199.14

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-11,026,563.91
股票投资收益——赎回差价收入	-4,481,698.00
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	-15,508,261.91

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	154,753,590.98
减：卖出股票成本总额	165,456,951.35
减：交易费用	323,203.54
买卖股票差价收入	-11,026,563.91

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	107,679,440.72

减：现金支付赎回款总额	39,482,323.72
减：赎回股票成本总额	72,678,815.00
减：交易费用	-
赎回差价收入	-4,481,698.00

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	94.97
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	19,174.66
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	19,269.63

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	110,027.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	90,700.00
减：应计利息总额	148.31
减：交易费用	4.41
买卖债券差价收入	19,174.66

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	1,723,692.83
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,723,692.83

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-6,682,486.46
——股票投资	-6,659,871.91
——债券投资	-22,614.55
——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	-6,682,486.46

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	163,273.16
合计	163,273.16

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购（赎回）本基金时，补入（卖出）被替代成分证券的实际买入成本（实际卖出金额）与申购（赎回）确认日估值的差额或强制退款的被替代成分证券在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	15,912.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行汇划费	3,085.84
其他	84,535.36
合计	163,205.80

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，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金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
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国农业银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构
广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 2023年6月12日（基金合同生效日） 至2023年6月30日
-------	----------------------------	---

	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	-	-	32,300.00	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内及上年度可比期间内无应支付关联方的佣金，本报告期末及上年度可比期间末无应付关联方佣金余额。

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 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年6月12日（基金合同 生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	425,259.54	59,334.38
其中：应支付销售机构的客户维护费	9,192.58	1,507.44
应支付基金管理人的净管理费	416,066.96	57,826.94

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.50% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人依据基金管理人的指令或按照双方协商一致的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月 30日	上年度可比期间 2023年6月12日（基金合同 生效日）至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	85,051.92	11,866.87

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，逐日累计至每个月月末，按月支付。经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人依据基金管理人的指令或按照双方协商一致的方式于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间内无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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	118,067,018.00	50.63%	55,713,709.00	44.36%
广发证券股份有限公司	2,750,798.00	1.18%	4,953,297.00	3.94%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 2023年6月12日（基金合同生效日）至2023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
中国农业银行股份有限公司	6,103,663.04	16,872.51	12,176,006.38	2,412.16

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	320.00	22,586.42	60,163.20	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	136.00	5,414.54	12,408.64	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	330.00	5,332.80	10,649.10	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股流通受限	19.86	42.51	216.00	4,289.76	9,182.16	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219.00	2,671.80	9,123.54	-

301539	宏鑫科技	2024-04-03	6 个月	新股流通受限	10.64	19.82	361.00	3,841.04	7,155.02	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6 个月	新股流通受限	19.43	36.98	188.00	3,652.84	6,952.24	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6 个月	新股流通受限	11.88	18.98	325.00	3,861.00	6,168.50	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6 个月	新股流通受限	21.73	25.26	230.00	4,997.90	5,809.80	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6 个月	新股流通受限	44.95	65.93	87.00	3,910.65	5,735.91	-
688695	中创股份	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	22.43	31.55	180.00	4,037.40	5,679.00	-
001389	广合科技	2024-03-26	6 个月	新股流通受限	17.43	34.56	164.00	2,858.52	5,667.84	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6 个月	新股流通受限	9.60	16.10	344.00	3,302.40	5,538.40	-
688709	成都华微	2024-01-31	6 个月	新股流通受限	15.69	18.79	293.00	4,597.17	5,505.47	-
301588	美新科技	2024-03-06	6 个月	新股流通受限	14.50	21.25	257.00	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6 个月	新股流通受限	28.01	37.83	132.00	3,697.32	4,993.56	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6 个月	新股流通受限	22.66	15.89	237.00	5,370.42	3,765.93	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.20	15.96	184.00	2,980.80	2,936.64	-
001359	平安电工	2024-03-19	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	133.00	2,312.87	2,739.80	-
603082	北自科技	2024-01-23	6 个月	新股流通	21.28	29.49	76.00	1,617.28	2,241.24	-

				受限						
001387	雪祺电气	2024-01-04	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	135.00	1,599.52	2,058.75	-
603375	盛景微	2024-01-17	6 个月	新股流通受限	38.18	38.90	47.00	1,794.46	1,828.30	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	95.00	1,613.10	1,280.60	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股等，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002308	*ST 威创	2024-05-06	重大事项停牌	1.97	2024-07-09	1.87	159,800.00	660,991.64	314,806.00	-

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

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2024 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人奉行全面风险管理的理念，在董事会下设立合规及风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由合规稽核部、金融工程与风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。合规稽核部、金融工程与风险管理部对公司总经理负责。本基金管理人建立了以合规及风险管理委员会为核心的、由总经理和风险控制委员会、督察长、合规稽核部、金融工程与风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险指由于在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或所投资证券之发行人出现违约、无法支付到期本息，或由于债券发行人信用等级降低导致债券价格下降，将对基金资产造成的损失。为了防范信用风险，本基金管理人建立了内部信用评级制度与交易对手库，对证券发行人的信用等级进行评估与控制，并分散化投资，对交易对手的资信情况进行充分评估。

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年6月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	3,948.95	117,315.16
未评级	-	-
合计	3,948.95	117,315.16

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

本基金主要投资于具有良好流动性的金融工具，除在附注 6.4.12 中列示的流通暂时受限的证券外，本基金所持大部分投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，资产变现能力强。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理，因此无重大流动性风险。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金投资标的为具有良好流动性的金融工具，主要投资品种均可在证券交易所或银行间同业市场进行交易，本身具有较好的流动性；在投资限制中采取多种措施保障本基金分散投资；同时，本基金投资策略成熟，能够支持不同市场情形下的投资者赎回要求。实际投资中，本基金投资组合的流动性能够与本基金申购和赎回的安排相匹配。

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见，也是最难防范的风险，其他如流动性风险最终是因为市场风险在起作用。市场风险包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金管理人通过久期、凸性等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024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	6,103,663.04	-	-	-	6,103,663.04
结算备付金	89,671.83	-	-	-	89,671.83
存出保证金	109,932.96	-	-	-	109,932.96
交易性金融资产	3,948.95	-	-	136,002,164.35	136,006,113.30
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12
资产总计	6,307,216.78	-	-	136,077,573.47	142,384,790.2

					5
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	60,222.87	60,222.87
应付托管费	-	-	-	12,044.56	12,044.56
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	776,533.18	776,533.18
负债总计	-	-	-	848,800.80	848,800.80
利率敏感度缺口	6,307,216.78	-	-	135,228,772.67	141,535,989.45
上年度末					
2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,477,775.34	-	-	-	3,477,775.34
结算备付金	62,608.05	-	-	-	62,608.05
存出保证金	357,788.13	-	-	-	357,788.13
交易性金融资产	117,315.16	-	-	177,631,218.59	177,748,533.75
资产总计	4,015,486.68	-	-	177,631,218.59	181,646,705.27
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	71,241.58	71,241.58
应付托管费	-	-	-	14,248.32	14,248.32
应交税费	-	-	-	0.35	0.35
其他负债	-	-	-	962,444.53	962,444.53
负债总计	-	-	-	1,047,934.78	1,047,934.78
利率敏感度缺口	4,015,486.68	-	-	176,583,283.81	180,598,770.49

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有债券资产（不含可转债、可交换债），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

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 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	136,002,164.35	96.09	177,631,218.59	98.36
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,948.95	0.00	117,315.16	0.06
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	136,006,113.30	96.09	177,748,533.75	98.42

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	6,852,633.94	9,072,106.27
	下降 5%	-6,852,633.94	-9,072,106.27

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 2024 年 6 月 30 日
第一层次	135,508,262.41
第二层次	314,806.00
第三层次	183,044.89
合计	136,006,113.30

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的金融工具，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关金融工具的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

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	136,002,164.35	95.52
	其中：普通股	136,002,164.35	95.52
	存托凭证	-	-

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,948.95	0.00
	其中：债券	3,948.95	0.00
	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	6,193,334.87	4.35
8	其他各项资产	185,342.08	0.13
9	合计	142,384,790.25	100.00

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含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 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	431,808.00	0.31
B	采矿业	3,027,576.00	2.14
C	制造业	88,469,953.88	62.51
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,373,237.00	1.68
E	建筑业	362,385.00	0.26
F	批发和零售业	3,794,530.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	798,665.40	0.56
H	住宿和餐饮业	333,216.00	0.24
I	信息传输、软件和信息技术服务业	18,367,269.01	12.98
J	金融业	50,694.00	0.04
K	房地产业	5,858,797.00	4.14
L	租赁和商务服务业	3,197,604.80	2.26
M	科学研究和技术服务业	1,303,198.62	0.92

N	水利、环境和公共设施管理业	2,603,055.64	1.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	511,280.00	0.36
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	3,820,320.00	2.70
S	综合	698,574.00	0.49
	合计	136,002,164.35	96.09

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601918	新集能源	104,300	1,016,925.00	0.72
2	002139	拓邦股份	89,675	952,348.50	0.67
3	600601	方正科技	307,300	921,900.00	0.65
4	300679	电连技术	22,600	909,198.00	0.64
5	600285	羚锐制药	36,600	886,086.00	0.63
6	600363	联创光电	31,900	877,888.00	0.62
7	000758	中色股份	170,500	866,140.00	0.61
8	600971	恒源煤电	70,900	846,546.00	0.60
9	600761	安徽合力	39,000	843,960.00	0.60
10	600201	生物股份	116,700	841,407.00	0.59
11	688484	南芯科技	22,589	838,051.90	0.59
12	600888	新疆众和	117,700	832,139.00	0.59
13	603599	广信股份	67,100	813,923.00	0.58
14	603588	高能环境	128,900	809,492.00	0.57
15	000589	贵州轮胎	159,300	807,651.00	0.57
16	300303	聚飞光电	166,000	806,760.00	0.57
17	600167	联美控股	154,600	805,466.00	0.57
18	002296	辉煌科技	77,900	803,149.00	0.57
19	300872	天阳科技	60,000	795,000.00	0.56
20	603031	安孚科技	35,125	793,122.50	0.56
21	300463	迈克生物	69,500	790,910.00	0.56
22	002215	诺普信	105,200	783,740.00	0.55
23	601900	南方传媒	62,400	775,632.00	0.55

24	300194	福安药业	207,000	774,180.00	0.55
25	002681	奋达科技	212,000	773,800.00	0.55
26	600351	亚宝药业	136,900	768,009.00	0.54
27	600776	东方通信	78,000	766,740.00	0.54
28	603281	江瀚新材	34,100	765,545.00	0.54
29	000795	英洛华	137,900	763,966.00	0.54
30	603299	苏盐井神	80,300	762,850.00	0.54
31	300428	立中集团	41,000	762,190.00	0.54
32	600929	雪天盐业	143,800	762,140.00	0.54
33	688239	航宇科技	21,900	762,120.00	0.54
34	300634	彩讯股份	45,100	759,033.00	0.54
35	002011	盾安环境	77,200	758,876.00	0.54
36	300226	上海钢联	44,700	757,218.00	0.54
37	300435	中泰股份	64,300	756,811.00	0.53
38	300770	新媒股份	22,600	754,388.00	0.53
39	002519	银河电子	153,500	753,685.00	0.53
40	603358	华达科技	26,100	752,985.00	0.53
41	300307	慈星股份	126,400	752,080.00	0.53
42	300065	海兰信	113,700	751,557.00	0.53
43	300110	华仁药业	242,700	749,943.00	0.53
44	002421	达实智能	321,700	749,561.00	0.53
45	688486	龙迅股份	13,052	747,879.60	0.53
46	600662	外服控股	186,300	747,063.00	0.53
47	603039	泛微网络	23,500	746,360.00	0.53
48	603187	海容冷链	63,900	745,074.00	0.53
49	002662	京威股份	245,000	744,800.00	0.53
50	600736	苏州高新	178,800	743,808.00	0.53
51	600251	冠农股份	102,700	743,548.00	0.53
52	000897	津滨发展	361,400	740,870.00	0.52
53	603859	能科科技	35,140	738,642.80	0.52
54	601038	一拖股份	46,600	736,746.00	0.52
55	300664	鹏鹞环保	164,900	733,805.00	0.52
56	300569	天能重工	175,900	731,744.00	0.52
57	300687	赛意信息	52,500	730,800.00	0.52
58	300174	元力股份	53,500	730,275.00	0.52
59	300231	银信科技	99,300	729,855.00	0.52
60	601512	中新集团	95,700	729,234.00	0.52
61	600586	金晶科技	125,700	729,060.00	0.52
62	600229	城市传媒	105,800	728,962.00	0.52
63	603100	川仪股份	31,000	728,810.00	0.51
64	000707	双环科技	106,500	728,460.00	0.51
65	300318	博晖创新	149,100	727,608.00	0.51
66	300011	鼎汉技术	145,700	727,043.00	0.51
67	600211	西藏药业	22,300	726,534.00	0.51

68	300532	今天国际	59,000	725,110.00	0.51
69	300453	三鑫医疗	113,100	722,709.00	0.51
70	603601	再升科技	261,600	722,016.00	0.51
71	002642	荣联科技	139,800	721,368.00	0.51
72	300145	中金环境	288,400	721,000.00	0.51
73	600861	北京人力	44,100	719,712.00	0.51
74	600609	金杯汽车	207,000	718,290.00	0.51
75	300451	创业慧康	205,400	710,684.00	0.50
76	600510	黑牡丹	190,900	710,148.00	0.50
77	600488	津药药业	207,000	710,010.00	0.50
78	300426	唐德影视	104,500	708,510.00	0.50
79	300278	华昌达	246,500	707,455.00	0.50
80	002006	精工科技	52,400	703,208.00	0.50
81	688621	阳光诺和	16,452	702,500.40	0.50
82	688590	新致软件	54,334	700,908.60	0.50
83	000973	佛塑科技	189,800	700,362.00	0.49
84	601975	招商南油	194,200	697,178.00	0.49
85	300790	宇瞳光学	51,600	696,600.00	0.49
86	000576	甘化科工	115,900	695,400.00	0.49
87	603339	四方科技	76,600	694,762.00	0.49
88	000532	华金资本	57,500	693,450.00	0.49
89	000505	京粮控股	127,400	693,056.00	0.49
90	600826	兰生股份	127,960	688,424.80	0.49
91	688556	高测股份	57,736	686,481.04	0.49
92	300842	帝科股份	17,460	677,448.00	0.48
93	301071	力量钻石	24,200	670,582.00	0.47
94	002580	圣阳股份	105,600	649,440.00	0.46
95	688601	力芯微	14,802	646,699.38	0.46
96	300857	协创数据	11,300	644,100.00	0.46
97	600503	华丽家族	358,600	641,894.00	0.45
98	300718	长盛轴承	46,400	641,248.00	0.45
99	300566	激智科技	45,400	635,146.00	0.45
100	603766	隆鑫通用	93,600	634,608.00	0.45
101	002277	友阿股份	291,400	629,424.00	0.44
102	000926	福星股份	198,500	629,245.00	0.44
103	002126	银轮股份	36,100	628,501.00	0.44
104	301149	隆华新材	67,700	625,548.00	0.44
105	688586	江航装备	67,053	623,592.90	0.44
106	300193	佳士科技	83,800	621,796.00	0.44
107	000822	山东海化	105,900	617,397.00	0.44
108	002937	兴瑞科技	26,400	615,384.00	0.43
109	002467	二六三	183,300	612,222.00	0.43
110	688403	汇成股份	71,728	608,253.44	0.43
111	688800	瑞可达	21,409	601,164.72	0.42

112	600391	航发科技	39,100	596,275.00	0.42
113	688088	虹软科技	20,490	591,341.40	0.42
114	002334	英威腾	98,800	590,824.00	0.42
115	000523	红棉股份	225,100	583,009.00	0.41
116	301096	百诚医药	10,000	580,800.00	0.41
117	300239	东宝生物	122,700	577,917.00	0.41
118	600475	华光环能	65,800	573,118.00	0.40
119	600973	宝胜股份	158,200	571,102.00	0.40
120	001309	德明利	6,600	570,240.00	0.40
121	688439	振华风光	8,510	565,489.50	0.40
122	300079	数码视讯	137,700	559,062.00	0.39
123	603867	新化股份	23,900	557,587.00	0.39
124	688208	道通科技	23,022	555,751.08	0.39
125	603230	内蒙新华	48,000	553,920.00	0.39
126	603738	泰晶科技	40,400	551,056.00	0.39
127	002536	飞龙股份	57,700	549,304.00	0.39
128	000922	佳电股份	46,000	548,780.00	0.39
129	300559	佳发教育	57,200	547,404.00	0.39
130	002891	中宠股份	25,800	538,446.00	0.38
131	002801	微光股份	28,300	536,568.00	0.38
132	688579	山大地纬	67,624	530,848.40	0.38
133	300170	汉得信息	86,300	529,882.00	0.37
134	000526	学大教育	8,300	511,280.00	0.36
135	300820	英杰电气	12,900	507,486.00	0.36
136	002446	盛路通信	89,400	505,110.00	0.36
137	002441	众业达	66,400	503,312.00	0.36
138	000810	创维数字	57,700	495,066.00	0.35
139	002583	海能达	119,800	487,586.00	0.34
140	300249	依米康	75,000	486,000.00	0.34
141	002852	道道全	67,100	483,120.00	0.34
142	601801	皖新传媒	69,300	480,249.00	0.34
143	603360	百傲化学	40,200	472,350.00	0.33
144	002135	东南网架	118,900	470,844.00	0.33
145	300587	天铁股份	115,000	464,600.00	0.33
146	300217	东方电热	122,300	461,071.00	0.33
147	300131	英唐智控	100,600	447,670.00	0.32
148	601065	江盐集团	51,300	444,771.00	0.31
149	688007	光峰科技	27,542	443,426.20	0.31
150	300119	瑞普生物	32,400	441,288.00	0.31
151	002020	京新药业	41,500	434,505.00	0.31
152	688252	天德钰	29,813	433,182.89	0.31
153	600371	万向德农	62,400	431,808.00	0.31
154	603315	福鞍股份	45,000	429,300.00	0.30
155	600658	电子城	128,600	423,094.00	0.30

156	688766	普冉股份	4,323	420,065.91	0.30
157	603267	鸿远电子	12,300	419,430.00	0.30
158	688401	路维光电	15,925	417,235.00	0.29
159	002788	鹭燕医药	52,600	414,488.00	0.29
160	000036	华联控股	125,900	407,916.00	0.29
161	300049	福瑞股份	8,100	407,754.00	0.29
162	000676	智度股份	66,300	402,441.00	0.28
163	300578	会畅通讯	26,700	395,160.00	0.28
164	600713	南京医药	92,200	389,084.00	0.27
165	000700	模塑科技	73,000	383,250.00	0.27
166	688639	华恒生物	4,979	380,345.81	0.27
167	002292	奥飞娱乐	62,600	374,348.00	0.26
168	300434	金石亚药	49,700	372,750.00	0.26
169	300396	迪瑞医疗	18,300	371,673.00	0.26
170	000061	农产品	76,100	369,846.00	0.26
171	688205	德科立	12,730	366,751.30	0.26
172	688313	仕佳光子	38,076	362,483.52	0.26
173	605599	菜百股份	27,600	351,348.00	0.25
174	603496	恒为科技	13,700	334,965.00	0.24
175	605108	同庆楼	15,600	333,216.00	0.24
176	603399	永杉锂业	53,500	331,165.00	0.23
177	688498	源杰科技	2,526	330,880.74	0.23
178	002026	山东威达	39,400	327,020.00	0.23
179	000811	冰轮环境	33,800	326,170.00	0.23
180	603508	思维列控	17,300	324,375.00	0.23
181	002398	垒知集团	86,300	321,036.00	0.23
182	300596	利安隆	11,800	320,134.00	0.23
183	605305	中际联合	12,280	316,701.20	0.22
184	002308	*ST 威创	159,800	314,806.00	0.22
185	000551	创元科技	35,800	312,534.00	0.22
186	301316	慧博云通	21,100	309,748.00	0.22
187	688409	富创精密	8,326	307,562.44	0.22
188	002270	华明装备	13,800	306,912.00	0.22
189	600237	铜峰电子	58,300	304,326.00	0.22
190	600067	冠城大通	173,100	302,925.00	0.21
191	300352	北信源	78,300	300,672.00	0.21
192	600757	长江传媒	37,300	300,638.00	0.21
193	000680	山推股份	31,900	295,713.00	0.21
194	605186	健麾信息	13,100	294,226.00	0.21
195	600771	广誉远	15,400	289,982.00	0.20
196	002093	国脉科技	47,600	288,932.00	0.20
197	002534	西子洁能	28,600	286,286.00	0.20
198	601702	华峰铝业	15,600	284,856.00	0.20
199	002332	仙琚制药	24,900	284,109.00	0.20

200	300039	上海凯宝	52,100	278,735.00	0.20
201	600480	凌云股份	28,000	275,240.00	0.19
202	688019	安集科技	2,134	268,457.20	0.19
203	000797	中国武夷	114,300	266,319.00	0.19
204	300856	科思股份	8,300	265,683.00	0.19
205	000690	宝新能源	51,500	262,650.00	0.19
206	300332	天壕能源	48,700	258,597.00	0.18
207	600284	浦东建设	48,000	256,320.00	0.18
208	002782	可立克	23,000	254,840.00	0.18
209	688686	奥普特	3,900	249,717.00	0.18
210	603611	诺力股份	14,300	243,672.00	0.17
211	002635	安洁科技	15,600	240,864.00	0.17
212	000409	云鼎科技	29,800	240,486.00	0.17
213	300910	瑞丰新材	5,500	240,460.00	0.17
214	688377	迪威尔	18,283	239,507.30	0.17
215	002521	齐峰新材	19,500	229,125.00	0.16
216	603803	瑞斯康达	31,900	226,490.00	0.16
217	002146	荣盛发展	152,000	226,480.00	0.16
218	603275	众辰科技	7,200	216,000.00	0.15
219	688246	嘉和美康	10,534	214,472.24	0.15
220	300280	紫天科技	14,000	213,360.00	0.15
221	688378	奥来德	9,023	211,679.58	0.15
222	300166	东方国信	34,300	209,916.00	0.15
223	600587	新华医疗	13,100	206,194.00	0.15
224	688676	金盘科技	3,944	205,679.60	0.15
225	300031	宝通科技	14,300	205,491.00	0.15
226	300032	金龙机电	65,900	204,949.00	0.14
227	002224	三力士	53,200	204,820.00	0.14
228	300833	浩洋股份	4,400	204,160.00	0.14
229	600301	华锡有色	10,000	202,200.00	0.14
230	002315	焦点科技	7,400	199,504.00	0.14
231	301382	蜂助手	10,800	195,372.00	0.14
232	002833	弘亚数控	10,600	193,344.00	0.14
233	600986	浙文互联	46,000	193,200.00	0.14
234	603987	康德莱	30,000	183,300.00	0.13
235	688150	莱特光电	9,192	178,324.80	0.13
236	300291	百纳千成	39,600	168,696.00	0.12
237	600228	返利科技	33,800	164,268.00	0.12
238	002919	名臣健康	14,120	163,933.20	0.12
239	002226	江南化工	36,200	162,176.00	0.11
240	603322	超讯通信	6,100	161,711.00	0.11
241	688510	航亚科技	8,749	161,069.09	0.11
242	688668	鼎通科技	4,040	158,731.60	0.11
243	002947	恒铭达	4,500	158,400.00	0.11

244	300925	法本信息	15,300	154,377.00	0.11
245	300693	盛弘股份	6,900	144,486.00	0.10
246	600461	洪城环境	11,900	137,802.00	0.10
247	300465	高伟达	18,500	134,495.00	0.10
248	002130	沃尔核材	9,000	127,080.00	0.09
249	688148	芳源股份	29,760	125,289.60	0.09
250	688123	聚辰股份	2,019	122,815.77	0.09
251	300360	炬华科技	7,200	122,400.00	0.09
252	002322	理工能科	7,600	121,752.00	0.09
253	688776	国光电气	2,126	117,780.40	0.08
254	300841	康华生物	2,300	116,472.00	0.08
255	000543	皖能电力	13,100	115,935.00	0.08
256	000650	仁和药业	19,273	113,710.70	0.08
257	603112	华翔股份	10,800	113,508.00	0.08
258	002106	莱宝高科	10,300	112,270.00	0.08
259	600105	永鼎股份	29,400	109,368.00	0.08
260	002476	宝莫股份	29,800	109,366.00	0.08
261	603368	柳药集团	6,200	108,500.00	0.08
262	300705	九典制药	3,900	104,286.00	0.07
263	002351	漫步者	7,900	103,885.00	0.07
264	603855	华荣股份	4,500	99,495.00	0.07
265	600846	同济科技	14,300	97,669.00	0.07
266	300184	力源信息	21,000	97,230.00	0.07
267	600123	兰花科创	10,700	95,765.00	0.07
268	300138	晨光生物	10,500	88,515.00	0.06
269	601126	四方股份	4,600	88,412.00	0.06
270	603227	雪峰科技	13,800	85,560.00	0.06
271	688630	芯碁微装	1,206	75,459.42	0.05
272	601609	金田股份	13,300	75,278.00	0.05
273	301085	亚康股份	1,800	74,736.00	0.05
274	603165	荣晟环保	7,000	74,340.00	0.05
275	002276	万马股份	10,000	71,700.00	0.05
276	002843	泰嘉股份	4,600	70,426.00	0.05
277	300337	银邦股份	8,200	66,420.00	0.05
278	600180	瑞茂通	17,000	64,770.00	0.05
279	603203	快克智能	2,700	63,666.00	0.04
280	301589	诺瓦星云	320	60,163.20	0.04
281	688127	蓝特光学	3,071	56,475.69	0.04
282	600603	广汇物流	10,800	54,432.00	0.04
283	301307	美利信	2,500	48,950.00	0.03
284	600864	哈投股份	10,200	48,450.00	0.03
285	300624	万兴科技	900	47,763.00	0.03
286	603871	嘉友国际	2,660	47,055.40	0.03
287	600894	广日股份	4,000	46,000.00	0.03

288	600420	国药现代	3,700	39,516.00	0.03
289	000936	华西股份	6,600	37,752.00	0.03
290	300657	弘信电子	2,500	37,550.00	0.03
291	300101	振芯科技	2,500	36,925.00	0.03
292	300441	鲍斯股份	6,100	36,173.00	0.03
293	000682	东方电子	3,200	35,328.00	0.02
294	600602	云赛智联	3,000	33,120.00	0.02
295	000913	钱江摩托	2,000	31,520.00	0.02
296	002452	长高电新	3,600	29,808.00	0.02
297	600551	时代出版	4,100	29,028.00	0.02
298	600866	星湖科技	5,200	28,704.00	0.02
299	300401	花园生物	2,000	28,680.00	0.02
300	000612	焦作万方	4,400	28,600.00	0.02
301	300638	广和通	1,600	27,360.00	0.02
302	000521	长虹美菱	3,600	27,288.00	0.02
303	002170	芭田股份	4,400	26,444.00	0.02
304	002048	宁波华翔	2,000	25,880.00	0.02
305	002668	TCL 智家	2,800	25,368.00	0.02
306	002960	青鸟消防	2,000	25,280.00	0.02
307	000848	承德露露	3,200	25,152.00	0.02
308	600572	康恩贝	5,600	25,032.00	0.02
309	600158	中体产业	3,200	24,608.00	0.02
310	300469	信息发展	1,600	24,480.00	0.02
311	002859	洁美科技	1,200	24,096.00	0.02
312	603730	岱美股份	2,400	23,856.00	0.02
313	002096	易普力	2,000	23,800.00	0.02
314	601199	江南水务	4,800	23,376.00	0.02
314	000950	重药控股	4,800	23,376.00	0.02
315	300102	乾照光电	3,600	23,112.00	0.02
316	002063	远光软件	4,400	23,056.00	0.02
317	300680	隆盛科技	1,200	22,884.00	0.02
318	002539	云图控股	3,200	22,816.00	0.02
319	300292	吴通控股	6,400	22,720.00	0.02
320	002544	普天科技	1,200	22,428.00	0.02
321	600850	电科数字	1,200	21,720.00	0.02
322	300941	创识科技	1,200	21,672.00	0.02
323	001338	永顺泰	2,200	21,560.00	0.02
324	600649	城投控股	6,400	21,248.00	0.02
325	301175	中科环保	4,800	21,072.00	0.01
326	002987	京北方	2,000	21,060.00	0.01
327	300025	华星创业	2,000	21,040.00	0.01
328	300900	广联航空	1,120	20,977.60	0.01
329	688533	上声电子	801	20,721.87	0.01
330	300113	顺网科技	2,000	20,480.00	0.01

331	300636	同和药业	2,000	20,340.00	0.01
332	300525	博思软件	1,600	20,320.00	0.01
333	603035	常熟汽饰	1,600	20,288.00	0.01
334	301439	泓淋电力	1,600	20,272.00	0.01
335	000719	中原传媒	2,000	20,220.00	0.01
336	002158	汉钟精机	1,200	20,064.00	0.01
337	603703	盛洋科技	2,000	20,060.00	0.01
338	301263	泰恩康	1,600	20,048.00	0.01
339	002222	福晶科技	880	19,826.40	0.01
340	300455	航天智装	1,600	19,776.00	0.01
341	600063	皖维高新	5,600	19,712.00	0.01
342	301030	仕净科技	800	19,696.00	0.01
343	002675	东诚药业	1,600	19,616.00	0.01
344	600645	中源协和	1,200	19,320.00	0.01
345	301050	雷电微力	400	19,264.00	0.01
346	603966	法兰泰克	2,800	19,236.00	0.01
347	301217	铜冠铜箔	2,000	19,200.00	0.01
348	601606	长城军工	2,000	19,120.00	0.01
349	600664	哈药股份	7,200	19,008.00	0.01
350	002611	东方精工	3,600	18,900.00	0.01
351	002283	天润工业	4,400	18,876.00	0.01
352	600552	凯盛科技	2,000	18,860.00	0.01
353	300232	洲明科技	3,600	18,792.00	0.01
354	600797	浙大网新	4,000	18,520.00	0.01
355	002367	康力电梯	3,200	18,464.00	0.01
356	002908	德生科技	2,400	18,408.00	0.01
357	002386	天原股份	4,800	18,336.00	0.01
358	688636	智明达	801	18,262.80	0.01
359	001208	华菱线缆	2,400	18,192.00	0.01
360	300452	山河药辅	1,600	18,176.00	0.01
361	688711	宏微科技	1,121	18,003.26	0.01
362	600206	有研新材	2,000	17,800.00	0.01
363	300858	科拓生物	1,200	17,664.00	0.01
364	300586	美联新材	2,800	17,612.00	0.01
365	002516	旷达科技	4,800	17,472.00	0.01
366	301162	国能日新	400	17,424.00	0.01
367	000852	石化机械	3,200	17,152.00	0.01
368	002437	誉衡药业	10,000	17,000.00	0.01
369	002206	海利得	4,400	16,808.00	0.01
370	600731	湖南海利	3,600	16,632.00	0.01
371	300348	长亮科技	2,400	16,368.00	0.01
372	600963	岳阳林纸	4,400	16,148.00	0.01
373	002649	博彦科技	2,000	15,920.00	0.01
374	603920	世运电路	800	15,792.00	0.01

375	002434	万里扬	3,200	15,680.00	0.01
375	300263	隆华科技	2,800	15,680.00	0.01
376	600748	上实发展	6,400	15,616.00	0.01
377	300128	锦富技术	5,200	15,444.00	0.01
378	603520	司太立	1,600	15,264.00	0.01
379	300080	易成新能	5,200	14,976.00	0.01
380	002491	通鼎互联	4,400	14,872.00	0.01
381	000737	北方铜业	1,600	14,848.00	0.01
382	600055	万东医疗	1,200	14,820.00	0.01
383	300043	星辉娱乐	6,400	14,592.00	0.01
384	601700	风范股份	3,300	14,487.00	0.01
385	603306	华懋科技	800	14,456.00	0.01
386	002033	丽江股份	1,600	14,016.00	0.01
387	605577	龙版传媒	900	13,977.00	0.01
388	300109	新开源	1,200	13,896.00	0.01
389	301302	华如科技	800	13,800.00	0.01
390	000607	华媒控股	4,400	13,596.00	0.01
391	300674	宇信科技	1,200	13,296.00	0.01
392	300613	富瀚微	400	13,164.00	0.01
393	600710	苏美达	1,600	13,040.00	0.01
394	300379	东方通	1,600	12,928.00	0.01
395	002483	润邦股份	2,800	12,628.00	0.01
396	000600	建投能源	2,000	12,600.00	0.01
397	000159	国际实业	2,400	12,528.00	0.01
398	301538	骏鼎达	136	12,408.64	0.01
399	300850	新强联	800	12,016.00	0.01
400	002478	常宝股份	2,400	11,952.00	0.01
401	300233	金城医药	800	11,936.00	0.01
402	600446	金证股份	1,200	11,916.00	0.01
403	301195	北路智控	400	11,896.00	0.01
404	688258	卓易信息	351	11,723.40	0.01
405	688388	嘉元科技	1,202	11,719.50	0.01
406	002345	潮宏基	2,400	11,328.00	0.01
407	600595	中孚实业	4,400	10,956.00	0.01
408	301536	星辰科技	330	10,649.10	0.01
409	600825	新华传媒	2,800	10,612.00	0.01
410	688259	创耀科技	265	10,589.40	0.01
411	300077	国民技术	1,200	10,476.00	0.01
412	002099	海翔药业	2,000	10,220.00	0.01
413	300709	精研科技	400	10,112.00	0.01
414	300267	尔康制药	4,800	9,984.00	0.01
415	002212	天融信	2,000	9,740.00	0.01
416	300561	汇金科技	1,200	9,672.00	0.01
417	603633	徕木股份	1,200	9,492.00	0.01

418	300183	东软载波	800	9,264.00	0.01
419	688691	灿芯股份	216	9,182.16	0.01
420	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
421	603421	鼎信通讯	2,000	8,920.00	0.01
422	002438	江苏神通	800	8,648.00	0.01
423	600987	航民股份	1,200	8,472.00	0.01
424	688046	药康生物	801	8,186.22	0.01
425	300129	泰胜风能	1,200	8,184.00	0.01
426	600458	时代新材	800	8,080.00	0.01
427	603229	奥翔药业	800	8,040.00	0.01
428	300021	大禹节水	2,400	7,920.00	0.01
429	603718	海利生物	1,200	7,404.00	0.01
430	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.01
431	600422	昆药集团	400	7,132.00	0.01
432	300355	蒙草生态	3,200	7,040.00	0.00
433	301591	肯特股份	188	6,952.24	0.00
434	300513	恒实科技	800	6,520.00	0.00
435	600868	梅雁吉祥	4,000	6,480.00	0.00
436	603098	森特股份	800	6,288.00	0.00
437	603398	沐邦高科	400	6,244.00	0.00
438	301565	中仑新材	325	6,168.50	0.00
439	605222	起帆电缆	400	6,136.00	0.00
440	300181	佐力药业	400	6,048.00	0.00
441	300602	飞荣达	400	6,044.00	0.00
442	300075	数字政通	400	5,900.00	0.00
443	301587	中瑞股份	230	5,809.80	0.00
444	301580	爱迪特	87	5,735.91	0.00
445	688695	中创股份	180	5,679.00	0.00
446	001389	广合科技	164	5,667.84	0.00
447	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
448	688709	成都华微	293	5,505.47	0.00
449	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
450	600576	祥源文旅	1,200	5,268.00	0.00
450	002488	金固股份	1,200	5,268.00	0.00
451	600629	华建集团	1,200	5,232.00	0.00
452	600620	天宸股份	1,200	5,124.00	0.00
453	301502	华阳智能	132	4,993.56	0.00
454	000948	南天信息	400	4,940.00	0.00
455	300389	艾比森	400	4,912.00	0.00
456	002698	博实股份	400	4,908.00	0.00
457	603170	宝立食品	400	4,752.00	0.00
458	300522	世名科技	400	4,420.00	0.00
459	000888	峨眉山 A	400	4,356.00	0.00
460	002104	恒宝股份	800	4,224.00	0.00

461	600138	中青旅	400	3,864.00	0.00
462	688584	上海合晶	237	3,765.93	0.00
463	002079	苏州固锝	400	3,408.00	0.00
464	002073	软控股份	400	2,956.00	0.00
465	601033	永兴股份	184	2,936.64	0.00
466	001359	平安电工	133	2,739.80	0.00
467	300083	创世纪	400	2,452.00	0.00
468	000567	海德股份	400	2,244.00	0.00
469	603082	北自科技	76	2,241.24	0.00
470	001267	汇绿生态	400	2,108.00	0.00
471	001387	雪祺电气	135	2,058.75	0.00
472	603375	盛景微	47	1,828.30	0.00
473	300061	旗天科技	400	1,792.00	0.00
474	600869	远东股份	400	1,396.00	0.00
475	835438	戈碧迦	100	1,300.00	0.00
476	001379	腾达科技	95	1,280.60	0.00
477	002689	远大智能	400	856.00	0.00
478	688018	乐鑫科技	1	98.68	0.00
479	688332	中科蓝讯	1	58.99	0.00
480	688508	芯朋微	1	36.37	0.00
481	688391	钜泉科技	1	29.17	0.00
482	688182	灿勤科技	1	13.24	0.00

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	600894	广日股份	1,010,881.00	0.56
2	600285	羚锐制药	933,765.00	0.52
3	600761	安徽合力	878,945.00	0.49
4	601918	新集能源	865,605.00	0.48
5	000758	中色股份	864,246.00	0.48
6	600971	恒源煤电	863,356.00	0.48
7	002011	盾安环境	857,077.00	0.47
8	000589	贵州轮胎	855,857.00	0.47
9	600601	方正科技	846,590.00	0.47
10	300303	聚飞光电	840,431.00	0.47
11	603281	江瀚新材	835,166.40	0.46
12	300463	迈克生物	834,592.00	0.46
13	002215	诺普信	823,211.00	0.46

14	603100	川仪股份	820,459.00	0.45
15	600167	联美控股	820,440.00	0.45
16	300770	新媒股份	815,579.00	0.45
17	688621	阳光诺和	815,491.24	0.45
18	600861	北京人力	806,978.00	0.45
19	002681	奋达科技	804,442.00	0.45
20	300226	上海钢联	803,101.00	0.44

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“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，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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	600894	广日股份	2,562,787.00	1.42
2	601918	新集能源	1,942,372.06	1.08
3	601019	山东出版	1,901,410.00	1.05
4	600572	康恩贝	1,723,241.00	0.95
5	600866	星湖科技	1,700,692.00	0.94
6	002130	沃尔核材	1,699,790.00	0.94
7	600158	中体产业	1,668,248.00	0.92
8	000426	兴业银锡	1,565,356.00	0.87
9	603368	柳药集团	1,546,285.00	0.86
10	600850	电科数字	1,527,591.00	0.85
11	601199	江南水务	1,497,830.00	0.83
12	600649	城投控股	1,491,910.00	0.83
13	000682	东方电子	1,428,366.00	0.79
14	600645	中源协和	1,417,886.00	0.79
15	603227	雪峰科技	1,409,689.00	0.78
16	600552	凯盛科技	1,403,670.00	0.78
17	600206	有研新材	1,384,385.00	0.77
18	600757	长江传媒	1,384,212.91	0.77
19	600675	中华企业	1,359,438.00	0.75
20	600063	皖维高新	1,355,454.00	0.75

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	149,539,645.62
卖出股票收入（成交）总额	154,753,590.98

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	3,948.95	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,948.95	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118040	宏微转债	40	3,948.95	0.00

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 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，报告编制日前一年内未受到公开谴责、处罚。

7.12.2 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 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	109,932.96
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	75,409.12
8	其他	-
9	合计	185,342.08

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	118040	宏微转债	3,948.95	0.00

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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		广发国证 2000 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金	
		持有份 额	占总份额 比例	持有份 额	占总份额 比例	持有份额	占总份额比 例
1,419	164,339.4 6	202,989 ,612.00	87.05%	30,208, 082.00	12.95%	118,067,01 8.00	50.63%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发国证2000交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	17,545,700.00	7.52%
2	招商证券股份有限公司	10,191,623.00	4.37%
3	交通银行股份有限公司-南方养老目标日期2030三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	8,800,000.00	3.77%
4	方正证券股份有限公司	6,755,400.00	2.90%
5	中国建设银行股份有限公司-南方养老目标日期2040三年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	6,500,000.00	2.79%
6	中国平安人寿保险股份有	6,094,900.00	2.61%

	限公司-自有资金		
7	国信证券股份有限公司	5,013,503.00	2.15%
8	中国光大银行股份有限公司-南方养老目标日期 2060 五年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	3,300,000.00	1.42%
9	杭州瑞峰投资管理有限公司	2,910,000.00	1.25%
10	广发证券股份有限公司	2,750,798.00	1.18%
11	广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	118,067,018.00	50.63%

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	0.0000%

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 6 月 12 日）基金份额总额	64,098,847.00
本报告期期初基金份额总额	125,598,847.00
本报告期基金总申购份额	90,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	123,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	140,598,847.00
本报告期期末基金份额总额	233,197,694.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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

本基金管理人于 2024 年 5 月 14 日发布公告，葛长伟先生自 2024 年 5 月 13 日起任公司董事长；于 2024 年 6 月 8 日发布公告，项军先生自 2024 年 6 月 7 日起任公司督察长。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券	2	231,416,702.60	76.26%	172,614.20	76.26%	-
国盛证券	1	72,057,489.23	23.74%	53,747.29	23.74%	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-

中航证券	2	-	-	-	-	-
太平洋	2	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

(1) 对交易单元候选券商的研究服务进行评估。本基金管理人组织相关人员依据交易单元选择标准对交易单元候选券商的服务质量和研究实力进行评估，确定选用交易单元的券商。

(2) 协议签署及通知托管人。本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
华创证券	110,027.38	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
太平洋	-	-	-	-	-	-

华西证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-

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	关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-05
2	关于增加华宝证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-11
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
4	关于增加民生证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-31
5	关于指定证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-01
6	关于增加财达证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-07
7	关于增加华泰证券为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-20
8	关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分并调整最小申购、赎回单位的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-26
9	关于增加华创证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
10	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
11	关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-01
12	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
13	关于增加东兴证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-24
14	关于增加联储证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-24
15	关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-09
16	关于旗下部分 ETF 调整现金替代相关内容并相应修订招募说明书的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-19
17	关于调整证券投资基金主流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-25

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
广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20240101-20240630	55,713,709.00	82,483,309.00	20,130,000.00	118,067,018.00	50.63%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

1、根据本基金基金合同和招募说明书的有关规定，为更好地服务投资者，本基金管理人已于 2024 年 3 月 29 日对本基金进行基金份额拆分，基金份额拆分比例为 1:2，即每 1 份基金份额拆为 2 份；并自 2024 年 4 月 1 日起，将本基金最小申购、赎回单位由 300 万份调整为 600 万份。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分并调整最小申购、赎回单位的公告》《关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》。

2、为更好地满足投资者的投资需求，本基金管理人根据本基金标的指数成份股的定期调整，修订本基金招募说明书中涉及申购赎回现金替代的相关内容。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《广发基金管理有限公司关于旗下部分 ETF 调整现金替代相关内容并相应修订招募说明书的公告》。

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

（一）中国证监会准予广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金变更注册为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金的文件

（二）《广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

（三）《广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》

（四）法律意见书

（五）基金管理人业务资格批件、营业执照

（六）基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；

2. 网站查阅：基金管理人网址 www.gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日