

**广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转  
型)**

**2023 年中期报告**

**2023 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

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## 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 2023 年 8 月 25 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。

根据 2023 年 5 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份额持有人大会会议审议通过的《关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，自 2023 年 6 月 12 日起，《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，广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金正式变更为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

本报告中财务资料未经审计。

本报告中，原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 11 日止，广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金报告期自 2023 年 6 月 12 日起至 2023 年 6 月 30 日止。

如无特殊说明，本报告中“本基金”指广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金及原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b> .....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
<b>2 基金简介</b> .....	6
2.1 基金基本情况.....	6
<b>2.1.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金</b> .....	6
2.1.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金.....	6
2.2 基金产品说明.....	7
2.2.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金.....	7
2.2.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金.....	7
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	8
2.5 其他相关资料.....	8
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b> .....	8
3.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金.....	8
3.1.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.1.2 基金净值表现.....	9
3.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金.....	10
3.2.1 主要会计数据和财务指标.....	10
3.2.2 基金净值表现.....	11
<b>4 管理人报告</b> .....	12
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	15
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.....	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	17
<b>5 托管人报告</b> .....	17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	17
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.....	17
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.....	17
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b> .....	17
6.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金.....	17
6.1.1 资产负债表.....	17
6.1.2 利润表.....	19
6.1.3 净资产（基金净值）变动表.....	20
6.1.4 报表附注.....	21
6.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金.....	44
6.2.1 资产负债表.....	44
6.2.2 利润表.....	45
6.2.3 净资产（基金净值）变动表.....	46

6.2.4 报表附注 .....	48
<b>7 投资组合报告 .....</b>	<b>67</b>
7.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 .....	67
7.1.1 期末基金资产组合情况 .....	67
7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	67
7.1.3 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 .....	68
7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	75
7.1.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	78
7.1.6 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 .....	78
7.1.7 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 .....	79
7.1.8 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 .....	79
7.1.9 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 .....	79
7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	79
7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	79
7.1.12 投资组合报告附注 .....	79
7.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金 .....	80
7.2.1 期末基金资产组合情况 .....	80
7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	81
7.2.3 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 .....	81
7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	92
7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	94
7.2.6 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 .....	94
7.2.7 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 .....	94
7.2.8 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 .....	94
7.2.9 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 .....	94
7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	94
7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	94
7.2.12 投资组合报告附注 .....	95
<b>8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>95</b>
8.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 .....	95
8.1.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	95
8.1.2 期末上市基金前十名持有人 .....	96
8.1.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	96
8.1.4 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 .....	96
8.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金 .....	97
8.2.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	97
8.2.2 期末上市基金前十名持有人 .....	97
8.2.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	98
8.2.4 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 .....	98
<b>9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>98</b>
9.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 .....	98
9.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金 .....	98
<b>10 重大事件揭示 .....</b>	<b>99</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	99
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 .....	99

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	99
10.4 基金投资策略的改变 .....	99
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	99
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 .....	99
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	99
10.7.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金 .....	99
10.7.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金 .....	101
10.8 其他重大事件 .....	102
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>104</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>106</b>
12.1 备查文件目录 .....	106
12.2 存放地点 .....	106
12.3 查阅方式 .....	106

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

#### 2.1.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

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	350,598,847.00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年8月10日

#### 2.1.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

基金名称	广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中小企业300ETF
场内简称	中小300ETF
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	2011年6月3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	64,098,847.00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年8月10日

## 2.2 基金产品说明

### 2.2.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

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。

### 2.2.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

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。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。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小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。在法律法规允许的情况下，基金管理人在履行相应程序后可以使用相关金融衍生工具，以更好地实现基金的投资目标。但基金管理人使用相关金融衍生工具必须是以提高投资效率、降低交易成本、缩小跟踪误差等为目的，而非用于投机或用作杠杆工具放大基金的投资。
业绩比较基准	中小企业 300 价格指数
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，主要采用完全复制法跟踪标的指数中小企业 300 价格指数的表现，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	程才良	秦一楠
	联系电话	020-83936666	010-66060069
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话	95105828	95599	
传真	020-89899158	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	孙树明	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

### 2.5.1 广发国证2000交易型开放式指数证券投资基金

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

### 2.5.2 广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金

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 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.1.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元



3.1.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 6 月 12 日 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	2,110,467.33
本期利润	13,285,349.78
加权平均基金份额本期利润	0.0829
本期加权平均净值利润率	5.44%
本期基金份额净值增长率	2.21%
3.1.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	156,633,657.75
期末可供分配基金份额利润	0.4468
期末基金资产净值	542,526,231.38
期末基金份额净值	1.5474
3.1.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	2.21%

注：（1）本基金转型日期为 2023 年 6 月 12 日，至披露时点不满半年。

（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）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。

（4）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）。

### 3.1.2 基金净值表现

#### 3.1.2.1 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
自基金合同生效起至今	2.21%	1.18%	1.76%	1.16%	0.45%	0.02%

注：自 2023 年 6 月 12 日起，本基金的业绩比较基准由“中小企业 300 价格指数”变更为“国证 2000 指数收益率”。

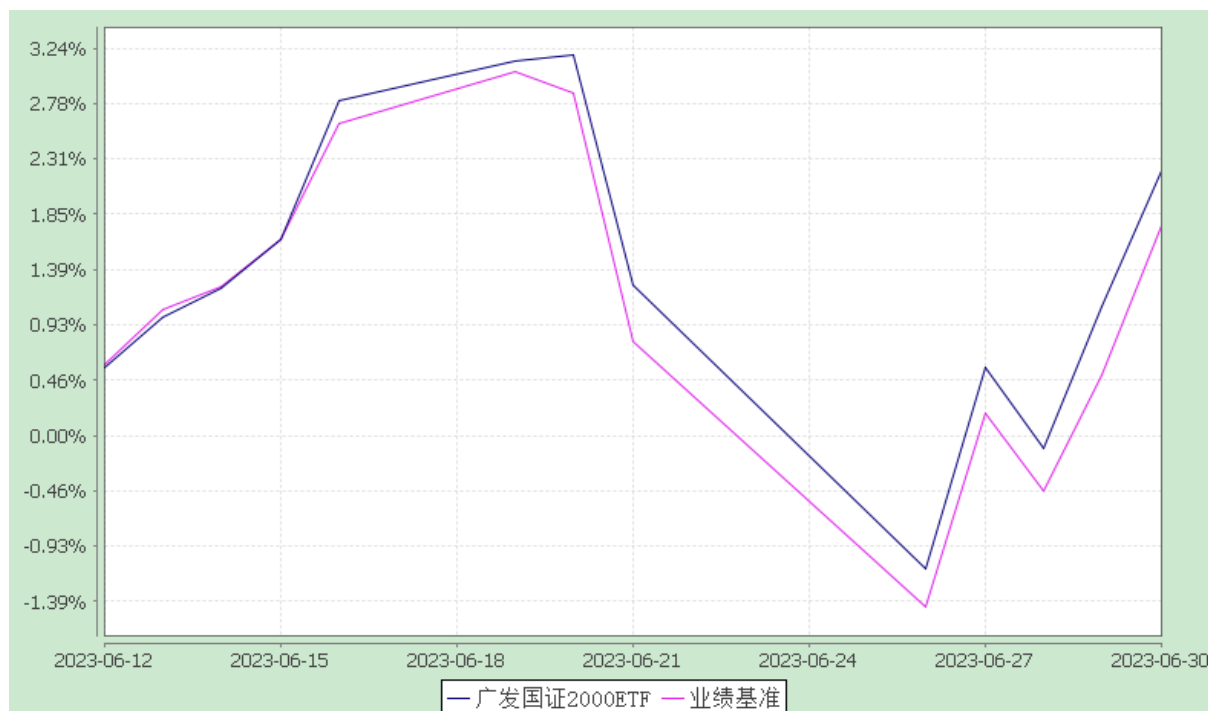
#### 3.1.2.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

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 (基金合同生效日) 至 2023 年 6 月 30 日)

第 9 页，共 106 页



注：（1）本基金转型日期为 2023 年 6 月 12 日，至披露时点未满一年。

（2）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。

（3）自 2023 年 6 月 12 日起，本基金的业绩比较基准由“中小企业 300 价格指数”变更为“国证 2000 指数收益率”。

### 3.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

#### 3.2.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.2.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日)
本期已实现收益	4,368,714.17
本期利润	-2,142,371.27
加权平均基金份额本期利润	-0.0316
本期加权平均净值利润率	-1.97%
本期基金份额净值增长率	-1.43%
3.2.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 11 日)
期末可供分配利润	26,485,703.35
期末可供分配基金份额利润	0.4132
期末基金资产净值	97,037,187.61
期末基金份额净值	1.5139

3.2.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 11 日)
基金份额累计净值增长率	37.54%

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）。

### 3.2.2 基金净值表现

#### 3.2.2.1 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	-2.44%	0.78%	-2.46%	0.80%	0.02%	-0.02%
过去三个月	-4.38%	0.86%	-4.43%	0.88%	0.05%	-0.02%
过去六个月	-5.85%	0.86%	-5.73%	0.88%	-0.12%	-0.02%
过去一年	-11.44%	1.07%	-11.27%	1.08%	-0.17%	-0.01%
过去三年	3.08%	1.32%	-0.76%	1.33%	3.84%	-0.01%
自基金合同生效起至今	37.54%	1.60%	37.43%	1.60%	0.11%	0.00%

注：过去一个月为 2023 年 5 月 12 日至 2023 年 6 月 11 日，过去三个月为 2023 年 3 月 12 日至 2023 年 6 月 11 日，过去六个月为 2022 年 12 月 12 日至 2023 年 6 月 11 日，过去一年为 2022 年 6 月 12 日至 2023 年 6 月 11 日，过去三年为 2020 年 6 月 12 日至 2023 年 6 月 11 日，自基金合同生效起至今为 2011 年 6 月 3 日至 2023 年 6 月 11 日。

#### 3.2.2.2 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

广发中小企业 300 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  
(2011 年 6 月 3 日至 2023 年 6 月 11 日)



## 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		
姚曦	本基金的 基金经 理；广发 港股通恒 生综合中	2023-06-12	-	8 年	姚曦，商科硕士，持有中国证 券投资基金业从业证书。曾任 广发期货有限公司发展研究 中心研究员、广发基金管理有 限公司指数投资部研究员、广

	<p>型股指数 证券投资 基金 (LOF)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 主要消费 交易型开 放式指数 证券投资 基金的基 金经理； 广发道琼 斯美国石 油开发与 生产指数 证券投资 基金 (QDII-LO F)的基金 经理；广 发中证全 指能源交 易型开放 式指数证 券投资基 金的基金 经理；广 发中证全 指原材料 交易型开 放式指数 证券投资 基金的基 金经理； 广发中证 光伏龙头</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 基金基金经理(自 2021 年 11 月 23 日至 2022 年 12 月 21 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 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 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 2021 年 11 月 23 日至 2023 年 6 月 11 日)。</p>
--	------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------	--	--	--	--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------

	<p>30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证稀有金属主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指可选消费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.“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 34 次，均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，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

本基金跟踪标的指数为国证 2000 指数，该指数由剔除 A 股市值排名前 1000 只股票后的 2000 只成份股组成，用于反映 A 股市场小盘股票的价格变动趋势。

2023 年上半年，A 股市场震荡走强，但结构分化明显，其中上证指数上涨 3.65%，深证成指上涨 0.10%，创业板指下跌 5.61%。市场风格方面，小盘风格优于大盘，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%。

2023 年上半年，国证 2000 指数累计上涨 7.08%，表现明显优于其他主流宽基指数，这也反映出小盘风格的领先。指数的上涨主要受到我国经济复苏预期以及宽松的流动性的推动。经济方面，自 2022 年底我国防疫政策优化后，消费场景快速复苏，2023 年 1-6 月我国社会消费零售总额累计同比增长 8.20%，相对 2022 年同期增加 8.90 个百分点。同时，国内流动性环境处于持续宽松的过程中。截至 2023 年 6 月 30 日，我国十年期国债到期收益率为 2.63%，相对 2022 年底降低了 0.20%，持续

下行的利率为小盘风格的上涨提供了动力。

报告期内，本基金主要采取完全复制法跟踪指数，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。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。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，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为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金，2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日，广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金份额净值增长率为-1.43%，同期业绩比较基准收益率为-1.29%；2023 年 6 月 12 日至 2023 年 6 月 30 日，广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金份额净值增长率为 2.21%，同期业绩比较基准收益率为 1.76%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，国内经济的持续复苏以及宽松的利率环境预计将继续利好以国证 2000 指数为代表的小盘风格股票。从经济复苏节奏来看，截至 2023 年 6 月底我国 GDP 同比增速为 5.50%，相对去年年底提升 2.50 个百分点。持续出台的稳增长政策为我国经济的复苏提供了动力。此外，国内利率环境持续处于底部，加之海外美联储加息见顶，宽松的利率环境也有望推动小盘风格股票的继续上涨。

#### 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 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遵规守信、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，未发现有关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 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

##### 6.1.1 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：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末
----	-----	-----

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

		2023 年 6 月 30 日
<b>资产：</b>		-
银行存款	6.1.4.7.1	12,176,006.38
结算备付金		149,460.89
存出保证金		57,098.60
交易性金融资产	6.1.4.7.2	538,136,823.54
其中：股票投资		538,104,519.93
基金投资		-
债券投资		32,303.61
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.1.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.1.4.7.4	-
债权投资	6.1.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
应收清算款		22,860,659.11
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.1.4.7.6	-
<b>资产总计</b>		<b>573,380,048.52</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>
<b>负债：</b>		-
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.1.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		20,507,673.37
应付赎回款		-
应付管理人报酬		74,056.25
应付托管费		14,811.23
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		0.19
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.1.4.7.7	10,257,276.10
<b>负债合计</b>		<b>30,853,817.14</b>

<b>净资产：</b>		
实收基金	6.1.4.7.8	385,892,573.63
未分配利润	6.1.4.7.9	156,633,657.75
<b>净资产合计</b>		<b>542,526,231.38</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>573,380,048.52</b>

注：（1）报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.5474 元，基金份额总额 350,598,847.00 份。

（2）本会计期间为 2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日。

## 6.1.2 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：2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>13,363,650.47</b>
1.利息收入		2,412.16
其中：存款利息收入	6.1.4.7.10	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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		1,431,203.61
其中：股票投资收益	6.1.4.7.11	1,053,520.70
基金投资收益	6.1.4.7.12	-
债券投资收益	6.1.4.7.13	3.44
资产支持证券投资收益	6.1.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.1.4.7.15	-
衍生工具收益	6.1.4.7.16	-
股利收益	6.1.4.7.17	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）	6.1.4.7.18	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）	6.1.4.7.19	755,152.25
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>78,300.69</b>

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

1. 管理人报酬		59,334.38
2. 托管费		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	6.1.4.7.20	-
7. 税金及附加		0.02
8. 其他费用	6.1.4.7.21	7,099.42
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>13,285,349.78</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>13,285,349.78</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>13,285,349.78</b>

### 6.1.3 净资产（基金净值）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：2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期		
	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（基金净值）	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（基金净值）	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基金净值变动数（净值减少以“-”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基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期末净资产(基金净值)	385,892,573.63	156,633,657.75	542,526,231.38

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1.1 至 6.1.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.1.4 报表附注

### 6.1.4.1 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。

本基金的财务报表于 2023 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.1.4.2 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。

#### 6.1.4.3 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.1.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.1.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度为公历年度，即每年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本会计期间为 2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止。

##### 6.1.4.4.2 记账本位币

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

##### 6.1.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### （1）金融资产分类

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

###### （2）金融负债分类

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

##### 6.1.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产

生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

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

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

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

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

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

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

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

融负债进行终止确认。

#### 6.1.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。



#### 6.1.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 6.1.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。基金份额拆分/折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分/折算日根据拆分/折算前的基金份额数及确定的拆分/折算比例计算认列。

#### 6.1.4.4.8 损益平准金

损益平准金指申购、赎回等事项导致基金份额变动时，相关款项中包含的未分配利润。根据交易申请日利润分配（未分配利润）已实现与未实现部分各自占基金净值的比例，损益平准金分为已实现损益平准金和未实现损益平准金。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入利润分配（未分配利润）。

#### 6.1.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

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

(7) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(8) 黄金租借的租金收入，在租约持有期间按租赁合同约定的费率和计算方法逐日确认；

(9) 黄金质押的利息收入，在质押期间按质押合同约定的费率和计算方法逐日确认；

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

#### 6.1.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

#### 6.1.4.4.11 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。基金管理人在基金满足基金合同约定的收益分配条件后，方可进行收益分配。本基金收益分配比例的确定原则为，使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，且本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后可能使除息后的基金份额净值低于面值。经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.1.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币金额。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.1.4.4.13 分部报告

根据本基金的内部组织机构、管理要求及内部报告制度，本基金整体为一个报告分部，且向管理层报告时采用的会计政策及计量基础与编制财务报表时的会计政策及计量基础一致。

#### 6.1.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 6.1.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.1.4.5.1 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。

##### 6.1.4.5.2 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。

##### 6.1.4.5.3 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。

#### 6.1.4.6 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。

##### (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。

#### 6.1.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.1.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	12,176,006.38
等于：本金	12,174,201.37
加：应计利息	1,805.01
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	12,176,006.38

##### 6.1.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	526,728,611.94	-	538,104,519.93	11,375,907.99	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	32,300.00	3.61	32,303.61	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	32,300.00	3.61	32,303.61	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	526,760,911.94	3.61	538,136,823.54	11,375,907.99	

##### 6.1.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.1.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.1.4.7.4.1 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。

##### 6.1.4.7.4.2 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。

#### 6.1.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.1.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.1.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 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	308,726.59
其中：交易所市场	308,726.59
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	133,109.28
应付指数使用费	27,692.31
应付替代款	9,287,744.32
可退替代款	3.60
合计	10,257,276.10

#### 6.1.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年6月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额	账面金额
基金合同生效日	64,098,847.00	70,551,484.26
本期申购	330,000,000.00	363,220,102.94
本期赎回（以“-”号填列）	-43,500,000.00	-47,879,013.57

本期末	350,598,847.00	385,892,573.63
-----	----------------	----------------

#### 6.1.4.7.9 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
基金合同生效日	57,956,902.10	-31,471,198.75	26,485,703.35
本期利润	2,110,467.33	11,174,882.45	13,285,349.78
本期基金份额交易产生的变动数	262,174,984.67	-145,312,380.05	116,862,604.62
其中：基金申购款	302,033,293.40	-165,867,367.01	136,165,926.39
基金赎回款	-39,858,308.73	20,554,986.96	-19,303,321.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	322,242,354.10	-165,608,696.35	156,633,657.75

#### 6.1.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	2,353.51
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	9.92
其他	48.73
合计	2,412.16

#### 6.1.4.7.11 股票投资收益

##### 6.1.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	193,292.53
股票投资收益——赎回差价收入	860,228.17
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	1,053,520.70

##### 6.1.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	28,671,863.08
减：卖出股票成本总额	28,258,163.39
减：交易费用	220,407.16
买卖股票差价收入	193,292.53

#### 6.1.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	67,182,335.34
减：现金支付赎回款总额	27,720,541.34
减：赎回股票成本总额	38,601,565.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	860,228.17

#### 6.1.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.1.4.7.13 债券投资收益

##### 6.1.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 6 月 12 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	3.44
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	3.44

##### 6.1.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.1.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.1.4.7.14.1 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。

#### 6.1.4.7.14.2 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。

#### 6.1.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.1.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.1.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年6月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	377,679.47
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	377,679.47

#### 6.1.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年6月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	11,174,090.45
——股票投资	11,174,090.45
——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	792.00
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	11,174,882.45
----	---------------

注：其他为可退替代款公允价值变动收益。

#### 6.1.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年6月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	755,152.25
合计	755,152.25

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。

#### 6.1.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.1.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年6月12日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费	1,301.31
信息披露费	4,164.42
证券出借违约金	-
银行汇划费	592.68
指数使用费	-
其他	1,041.01
合计	7,099.42

#### 6.1.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.1.4.8.1 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。

##### 6.1.4.8.2 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。

#### 6.1.4.9 关联方关系

##### 6.1.4.9.1 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。

#### 6.1.4.9.2 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、申购赎回代办证券公司
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

#### 6.1.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.1.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.1.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

###### 6.1.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 6.1.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
广发证券股份有限公司	32,300.00	100.00%

###### 6.1.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

本基金本报告期内无应支付关联方的佣金，本报告期末无应付关联方佣金余额。

##### 6.1.4.10.2 关联方报酬

###### 6.1.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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	59,334.38
其中：支付销售机构的客户维护费	1,507.44

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。

#### 6.1.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	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。

#### 6.1.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.1.4.10.4 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

##### 6.1.4.10.4.1 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。

##### 6.1.4.10.4.2 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。

#### 6.1.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.1.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

##### 6.1.4.10.5.2 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 2023年6月30日	
	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	50,213,709.00	14.32%
广发证券股份有限公司	22,169,497.00	6.32%

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。

#### 6.1.4.10.6 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 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
中国农业银行股份有限公司	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。

#### 6.1.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.1.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.1.4.12 期末（2023年6月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.1.4.12.1 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

6.1.4.12.1.1 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
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	新股流通	43.99	51.57	69.00	3,035.31	3,558.33	-

				受限						
301382	蜂助手	2023-05-17	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	108.00	2,570.40	3,546.72	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	35.66	33.26	93.00	3,316.38	3,093.18	-
301332	德尔玛	2023-05-18	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	205.00	3,036.05	2,814.65	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	167.00	2,930.85	2,797.25	-
301428	世纪恒通	2023-05-19	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	86.00	2,266.10	2,631.60	-
001380	华纬科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	28.84	30.78	55.00	1,586.20	1,692.90	-
001328	登康口腔	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	41.00	847.88	1,045.09	-

**6.1.4.12.1.2 受限证券类别：债券**

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
127087	星帅转2	2023-06-14	1 个月内(含)	新债流通受限	100.00	100.01	323.00	32,300.00	32,303.61	-

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 2023 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权证。

**6.1.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票**

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
00056	烽火电	2023-06	重大事	11.57	2023-0	12.73	206,800.00	2,204,279.17	2,392,676.00	-

1	子	-30	项停牌		7-14					
---	---	-----	-----	--	------	--	--	--	--	--

### 6.1.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.1.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

#### 6.1.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 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。

#### 6.1.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.1.4.13 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。

#### 6.1.4.13.1 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。

#### 6.1.4.13.2 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。

#### 6.1.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.1.4.13.2.2 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 2023 年 6 月 30 日
AAA	-
AAA 以下	32,303.61
未评级	-
合计	32,303.61

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。

#### 6.1.4.13.3 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 6.1.4.12 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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

##### 6.1.4.13.3.1 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。

#### 6.1.4.13.4 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的，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。

#### 6.1.4.13.4.1 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、风险价值模型（VaR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.1.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	12,176,006.38	-	-	-	12,176,006.38
结算备付金	149,460.89	-	-	-	149,460.89
存出保证金	57,098.60	-	-	-	57,098.60
交易性金融资产	32,303.61	-	-	538,104,519.93	538,136,823.54
应收清算款	-	-	-	22,860,659.11	22,860,659.11
资产总计	12,414,869.48	-	-	560,965,179.04	573,380,048.52
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	20,507,673.37	20,507,673.37
应付管理人报酬	-	-	-	74,056.25	74,056.25
应付托管费	-	-	-	14,811.23	14,811.23
应交税费	-	-	-	0.19	0.19
其他负债	-	-	-	10,257,276.10	10,257,276.10
负债总计	-	-	-	30,853,817.14	30,853,817.14
利率敏感度缺口	12,414,869.48	-	-	530,111,361.90	542,526,231.38

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。

##### 6.1.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末未持有债券资产（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。

#### 6.1.4.13.4.2 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。

#### 6.1.4.13.4.3 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、风险价值模型（VaR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.1.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	538,104,519.93	99.18
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	32,303.61	0.01
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	538,136,823.54	99.19

##### 6.1.4.13.4.3.2 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 2023年6月30日
	上升 5%	26,001,466.45
	下降 5%	-26,001,466.45

#### 6.1.5 公允价值

##### 6.1.5.1 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。

### 6.1.5.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.1.5.2.1 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	535,690,664.21
第二层次	2,424,979.61
第三层次	21,179.72
合计	538,136,823.54

#### 6.1.5.2.2 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。

#### 6.1.5.3 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。

#### 6.1.5.4 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。

#### 6.1.5.5 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。

## 6.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

### 6.2.1 资产负债表

会计主体：广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 11 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 11 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.2.4.7.1	4,088,580.52	2,281,502.99
结算备付金		506.98	-
存出保证金		57,180.61	4,228.72
交易性金融资产	6.2.4.7.2	94,613,545.92	96,905,263.85
其中：股票投资		94,613,545.92	96,905,263.85
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.2.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.2.4.7.4	-	-
债权投资	6.2.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		18,059,805.13	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.2.4.7.6	-	-
<b>资产总计</b>		<b>116,819,619.16</b>	<b>99,190,995.56</b>
<b>负债和净资产</b>			
	附注号	本期末 2023 年 6 月 11 日	上期末 2022 年 12 月 31 日
<b>负债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.2.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		18,940,849.48	-

应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		14,721.87	42,664.76
应付托管费		2,944.36	8,532.93
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.2.4.7.7	823,915.84	689,100.84
<b>负债合计</b>		<b>19,782,431.55</b>	<b>740,298.53</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.2.4.7.8	70,551,484.26	70,551,484.26
未分配利润	6.2.4.7.9	26,485,703.35	27,899,212.77
<b>净资产合计</b>		<b>97,037,187.61</b>	<b>98,450,697.03</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>116,819,619.16</b>	<b>99,190,995.56</b>

(1) 报告截止日 2023 年 6 月 11 日, 基金份额净值人民币 1.5139 元, 基金份额总额 64,098,847.00 份。

(2) 本会计期间为 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日。

## 6.2.2 利润表

会计主体：广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-1,725,327.58</b>	<b>-13,859,726.54</b>
1. 利息收入		7,200.82	4,923.98
其中：存款利息收入	6.2.4.7.10	7,200.82	4,923.98
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,731,653.04	1,586,260.01
其中：股票投资收益	6.2.4.7.11	4,179,960.98	774,171.61
基金投资收益	6.2.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.2.4.7.13	5,166.81	1.77
资产支持证券投资收益	6.2.4.7.14	-	-

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

贵金属投资收益	6.2.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.2.4.7.16	-	-
股利收益	6.2.4.7.17	546,525.25	812,086.63
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）	6.2.4.7.18	-6,511,085.44	-15,449,073.35
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.2.4.7.19	46,904.00	-1,837.18
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>417,043.69</b>	<b>458,319.59</b>
1. 管理人报酬		239,187.53	259,476.71
2. 托管费		47,837.50	51,895.36
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	6.2.4.7.20	-	-
7.税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.2.4.7.21	130,018.66	146,947.52
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-2,142,371.27</b>	<b>-14,318,046.13</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-2,142,371.27</b>	<b>-14,318,046.13</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-2,142,371.27</b>	<b>-20,015,638.91</b>

### 6.2.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	70,551,484.26	27,899,212.77	98,450,697.03
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期末初净资产（基金净值）	70,551,484.26	27,899,212.77	98,450,697.03

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-	-1,413,509.42	-1,413,509.42
(一)、综合收益总额	-	-2,142,371.27	-2,142,371.27
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-	728,861.85	728,861.85
其中: 1.基金申购款	74,295,021.05	37,911,102.40	112,206,123.45
2.基金赎回款	-74,295,021.05	-37,182,240.55	-111,477,261.60
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	70,551,484.26	26,485,703.35	97,037,187.61
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 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(基金净值)	65,598,482.85	56,423,763.86	122,022,246.71
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	65,598,482.85	56,423,763.86	122,022,246.71
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,651,000.47	-13,582,979.14	-11,931,978.67
(一)、综合收益总额	-	-14,318,046.13	-14,318,046.13
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,651,000.47	735,066.99	2,386,067.46
其中: 1.基金申购款	4,953,001.41	2,615,521.87	7,568,523.28
2.基金赎回款	-3,302,000.94	-1,880,454.88	-5,182,455.82
(三)、本期向基	-	-	-

金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产（基金净值）	67,249,483.32	42,840,784.72	110,090,268.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.2.1 至 6.2.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.2.4 报表附注

### 6.2.4.1 基金基本情况

广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2011]424 号《关于核准广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《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》等有关规定和《广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）发起，于 2011 年 6 月 3 日募集成立。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。

本基金募集期为 2011 年 5 月 3 日至 2011 年 5 月 27 日，本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 718,294,002.00 元，有效认购户数为 9,415 户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币 59,530.17 元，折合基金份额 55,268.00 份，按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户，折算差额人民币 4,262.17 元计入基金资产。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所有限公司验资。

根据《关于广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金变更基金名称的公告》，广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金自主板与中小板两板合并日（2021 年 4 月 6 日）起名称变更为广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金。

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正式转为广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金。

本基金的财务报表于 2023 年 8 月 25 日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。



#### 6.2.4.2 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。

#### 6.2.4.3 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 2023 年 6 月 11 日（基金转型前一日）的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日（基金转型前一日）的经营成果和基金净值变动情况。

#### 6.2.4.4 重要会计政策和会计估计

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。

#### 6.2.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.2.4.5.1 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。

##### 6.2.4.5.2 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。

##### 6.2.4.5.3 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。

#### 6.2.4.6 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。

##### (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。

## 6.2.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.2.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 11 日
活期存款	4,088,580.52
等于：本金	4,084,984.91
加：应计利息	3,595.61
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	4,088,580.52

### 6.2.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 6 月 11 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		94,412,520.38	-	94,613,545.92	201,025.54
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		94,412,520.38	-	94,613,545.92	201,025.54

#### 6.2.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.2.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.2.4.7.4.1 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。

##### 6.2.4.7.4.2 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。

#### 6.2.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.2.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.2.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 11 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	-

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

应付交易费用	135,620.99
其中：交易所市场	135,620.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	160,602.54
应付指数使用费	27,692.31
合计	823,915.84

#### 6.2.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2023年1月1日至2023年6月11日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	64,098,847.00	70,551,484.26
本期申购	67,500,000.00	74,295,021.05
本期赎回（以“-”号填列）	-67,500,000.00	-74,295,021.05
本期末	64,098,847.00	70,551,484.26

#### 6.2.4.7.9 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	54,431,142.73	-26,531,929.96	27,899,212.77
本期利润	4,368,714.17	-6,511,085.44	-2,142,371.27
本期基金份额交易产生的变动数	-842,954.80	1,571,816.65	728,861.85
其中：基金申购款	57,198,722.87	-19,287,620.47	37,911,102.40
基金赎回款	-58,041,677.67	20,859,437.12	-37,182,240.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	57,956,902.10	-31,471,198.75	26,485,703.35

#### 6.2.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月11日
活期存款利息收入	6,877.18
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	210.86

其他	112.78
合计	7,200.82

#### 6.2.4.7.11 股票投资收益

##### 6.2.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,813,493.92
股票投资收益——赎回差价收入	6,993,454.90
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	4,179,960.98

##### 6.2.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日
卖出股票成交总额	93,602,171.83
减：卖出股票成本总额	96,170,567.31
减：交易费用	245,098.44
买卖股票差价收入	-2,813,493.92

##### 6.2.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 11 日
赎回基金份额对价总额	111,477,261.60
减：现金支付赎回款总额	932,177.60
减：赎回股票成本总额	103,551,629.10
减：交易费用	-
赎回差价收入	6,993,454.90

#### 6.2.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.2.4.7.13 债券投资收益

##### 6.2.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
债券投资收益——利息收入	6.75
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,160.06
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	5,166.81

#### 6.2.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	31,268.06
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	26,100.00
减：应计利息总额	6.75
减：交易费用	1.25
买卖债券差价收入	5,160.06

#### 6.2.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.2.4.7.14.1 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。

##### 6.2.4.7.14.2 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。

#### 6.2.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.2.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.2.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
----	----------------------------

股票投资产生的股利收益	546,525.25
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	546,525.25

#### 6.2.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
1.交易性金融资产	-6,511,085.44
——股票投资	-6,511,085.44
——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	-6,511,085.44

#### 6.2.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
基金赎回费收入	-
替代损益	46,904.00
合计	46,904.00

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。



#### 6.2.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.2.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月11日
审计费	11,095.38
信息披露费	35,507.16
证券出借违约金	-
银行汇划费	723.81
指数使用费	62,692.31
其他	20,000.00
合计	130,018.66

#### 6.2.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.2.4.8.1 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。

##### 6.2.4.8.2 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。

#### 6.2.4.9 关联方关系

##### 6.2.4.9.1 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。

##### 6.2.4.9.2 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、申购赎回代办证券公司
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	本基金的联接基金

#### 6.2.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.2.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.2.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月11日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	-	-	12,000.00	0.11%

#### 6.2.4.10.1.2 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。

#### 6.2.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月11日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	26,100.00	45.50%	9,400.00	100.00%

#### 6.2.4.10.1.4 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。

#### 6.2.4.10.2 关联方报酬

##### 6.2.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 11日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	239,187.53	259,476.71
其中：支付销售机构的客户维护费	5,191.74	5,128.62

注：在通常情况下，基金管理费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年管理费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年管理费率为 0.5%

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

#### 6.2.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月 11日	2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	47,837.50	51,895.36

注：在通常情况下，基金托管费按前一日基金资产净值的年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times \text{年托管费率} \div \text{当年天数}$ ，本基金年托管费率为 0.1%

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 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、休息日，支付日期顺延。

#### 6.2.4.10.3 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。

#### 6.2.4.10.4 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

##### 6.2.4.10.4.1 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。

##### 6.2.4.10.4.2 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。

#### 6.2.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.2.4.10.5.1 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。

#### 6.2.4.10.5.2 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2023年6月11日		上年度末 2022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
广发证券股份有限公司	885,778.00	1.38%	713,800.00	1.11%
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	50,594,409.00	78.93%	52,884,509.00	82.50%

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。

#### 6.2.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月11日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022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	4,088,580.52	7,200.82	2,039,907.69	4,824.66

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。

#### 6.2.4.10.7 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。

#### 6.2.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.2.4.12 期末（2023年6月11日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.2.4.12.1 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

6.2.4.12.1.1 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
301225	恒勃股份	2023-06-08	1 个月内(含)	新股流通受限	35.66	35.66	837.00	29,847.42	29,847.42	-
301355	南王科技	2023-06-02	1 个月内(含)	新股流通受限	17.55	17.55	1,499.00	26,307.45	26,307.45	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	43.99	63.53	69.00	3,035.31	4,383.57	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	38.65	108.00	2,570.40	4,174.20	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	35.66	35.66	93.00	3,316.38	3,316.38	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股流通受限	26.35	36.35	86.00	2,266.10	3,126.10	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	17.55	167.00	2,930.85	2,930.85	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.31	205.00	3,036.05	2,728.55	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	28.84	26.58	55.00	1,586.20	1,461.90	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	27.82	41.00	847.88	1,140.62	-

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 2023 年 6 月 11 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。

#### 6.2.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2023 年 6 月 11 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

### 6.2.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.2.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 11 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。

#### 6.2.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 11 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。

#### 6.2.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

截至本报告期末 2023 年 6 月 11 日止, 本基金无参与转融通证券出借业务的证券。

### 6.2.4.13 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。

#### 6.2.4.13.1 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。

#### 6.2.4.13.2 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。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支

持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

### 6.2.4.13.3 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 6.2.4.12 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。

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

#### 6.2.4.13.3.1 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。

### 6.2.4.13.4 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的，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。

#### 6.2.4.13.4.1 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、风险价值模型（VaR）等方法来评估投资组合中债券的利率风险。

##### 6.2.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-----	-------	-------	-------	-----	----

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

<b>2023 年 6 月 11 日</b>					
<b>资产</b>					
银行存款	4,088,580.52	-	-	-	4,088,580.52
结算备付金	506.98	-	-	-	506.98
存出保证金	57,180.61	-	-	-	57,180.61
交易性金融资产	-	-	-	94,613,545.92	94,613,545.92
应收清算款	-	-	-	18,059,805.13	18,059,805.13
资产总计	4,146,268.11	-	-	112,673,351.05	116,819,619.16
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	18,940,849.48	18,940,849.48
应付管理人报酬	-	-	-	14,721.87	14,721.87
应付托管费	-	-	-	2,944.36	2,944.36
其他负债	-	-	-	823,915.84	823,915.84
负债总计	-	-	-	19,782,431.55	19,782,431.55
利率敏感度缺口	4,146,268.11	-	-	92,890,919.50	97,037,187.61
<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>1 年以内</b>	<b>1-5 年</b>	<b>5 年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	2,281,502.99	-	-	-	2,281,502.99
存出保证金	4,228.72	-	-	-	4,228.72
交易性金融资产	-	-	-	96,905,263.85	96,905,263.85
资产总计	2,285,731.71	-	-	96,905,263.85	99,190,995.56
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	42,664.76	42,664.76
应付托管费	-	-	-	8,532.93	8,532.93
其他负债	-	-	-	689,100.84	689,100.84
负债总计	-	-	-	740,298.53	740,298.53
利率敏感度缺口	2,285,731.71	-	-	96,164,965.32	98,450,697.03

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。



#### 6.2.4.13.4.1.2 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。

#### 6.2.4.13.4.2 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。

#### 6.2.4.13.4.3 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、风险价值模型（VaR）等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 6.2.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月11日		上年度末 2022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	94,613,545.92	97.50	96,905,263.85	98.43
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	94,613,545.92	97.50	96,905,263.85	98.43

##### 6.2.4.13.4.3.2 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 2023年6月11日	上年度末 2022年12月31日
	上升 5%	4,366,188.26	4,829,055.58
下降 5%	-4,366,188.26	-4,829,055.58	

## 6.2.5 公允价值

### 6.2.5.1 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。

### 6.2.5.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.2.5.2.1 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 2023 年 6 月 11 日
第一层次	94,534,128.88
第二层次	62,402.10
第三层次	17,014.94
合计	94,613,545.92

#### 6.2.5.2.2 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。

#### 6.2.5.3 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。

#### 6.2.5.4 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。

## 6.2.6 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 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2023年6月12日-2023年6月30日)

#### 7.1.1 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	538,104,519.93	93.85
	其中: 普通股	538,104,519.93	93.85
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	32,303.61	0.01
	其中: 债券	32,303.61	0.01
	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	12,325,467.27	2.15
8	其他各项资产	22,917,757.71	4.00
9	合计	573,380,048.52	100.00

注: 上表中的权益投资项含可退替代款估值增值, 而7.1.2的合计项不含可退替代款估值增值。

#### 7.1.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	4,749,010.00	0.88
B	采矿业	8,588,251.00	1.58
C	制造业	355,362,146.40	65.50
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,076,227.00	3.15
E	建筑业	11,356,155.00	2.09
F	批发和零售业	13,786,810.00	2.54
G	交通运输、仓储和邮政业	9,334,515.60	1.72

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	66,320,386.63	12.22
J	金融业	5,728,786.30	1.06
K	房地产业	13,245,905.00	2.44
L	租赁和商务服务业	10,737,528.00	1.98
M	科学研究和技术服务业	6,790,796.00	1.25
N	水利、环境和公共设施管理业	3,990,406.00	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,859,868.00	0.34
R	文化、体育和娱乐业	9,176,937.00	1.69
S	综合	-	-
T	合计	538,103,727.93	99.18

### 7.1.2.1 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。

### 7.1.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	300002	神州泰岳	244,400	3,421,600.00	0.63
2	688326	经纬恒润-W	22,065	3,185,965.35	0.59
3	688556	高测股份	58,303	3,098,221.42	0.57
4	002139	拓邦股份	233,775	3,050,763.75	0.56
5	002240	盛新锂能	91,500	2,916,105.00	0.54
6	603083	剑桥科技	45,800	2,880,362.00	0.53
7	688095	福昕软件	22,657	2,863,391.66	0.53
8	002698	博实股份	162,500	2,842,125.00	0.52
9	688018	乐鑫科技	21,818	2,832,412.76	0.52
10	600211	西藏药业	45,600	2,708,640.00	0.50
11	688608	恒玄科技	22,321	2,701,510.63	0.50
12	002605	姚记科技	58,000	2,692,940.00	0.50
13	300624	万兴科技	22,800	2,671,020.00	0.49
14	002068	黑猫股份	221,400	2,628,018.00	0.48
15	600835	上海机电	150,900	2,592,462.00	0.48
16	600151	航天机电	290,800	2,591,028.00	0.48
17	300456	赛微电子	105,500	2,582,640.00	0.48
18	002548	金新农	336,900	2,580,654.00	0.48

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

19	300170	汉得信息	220,200	2,541,108.00	0.47
20	002428	云南锗业	208,300	2,532,928.00	0.47
21	002424	贵州百灵	279,368	2,508,724.64	0.46
22	300161	华中数控	46,800	2,504,736.00	0.46
23	688022	瀚川智能	69,040	2,494,415.20	0.46
24	600199	金种子酒	104,800	2,487,952.00	0.46
25	688208	道通科技	81,425	2,467,991.75	0.45
26	688033	天宜上佳	129,041	2,467,263.92	0.45
27	688333	铂力特	23,267	2,460,252.58	0.45
28	002338	奥普光电	58,200	2,453,130.00	0.45
29	688088	虹软科技	57,356	2,451,969.00	0.45
30	300833	浩洋股份	22,400	2,451,232.00	0.45
31	600933	爱柯迪	105,100	2,447,779.00	0.45
32	300855	图南股份	69,000	2,437,080.00	0.45
33	002351	漫步者	117,500	2,429,900.00	0.45
34	300008	天海防务	478,200	2,405,346.00	0.44
35	688311	盟升电子	34,255	2,395,794.70	0.44
36	000561	烽火电子	206,800	2,392,676.00	0.44
37	601965	中国汽研	115,700	2,389,205.00	0.44
38	600490	鹏欣资源	640,300	2,356,304.00	0.43
39	688277	天智航-U	127,289	2,347,209.16	0.43
40	002048	宁波华翔	174,164	2,333,797.60	0.43
41	603477	巨星农牧	69,300	2,311,155.00	0.43
42	002121	科陆电子	315,100	2,309,683.00	0.43
43	002270	华明装备	210,700	2,307,165.00	0.43
44	600750	江中药业	105,000	2,302,650.00	0.42
45	603990	麦迪科技	104,300	2,299,815.00	0.42
46	601975	招商南油	803,700	2,298,582.00	0.42
47	300729	乐歌股份	127,700	2,278,168.00	0.42
48	300551	古鳌科技	104,100	2,277,708.00	0.42
49	300353	东土科技	174,400	2,268,944.00	0.42
50	000065	北方国际	150,800	2,265,016.00	0.42
51	688318	财富趋势	22,654	2,264,720.38	0.42
52	300116	保力新	1,628,400	2,263,476.00	0.42
53	002212	天融信	233,300	2,263,010.00	0.42
54	600525	长园集团	384,100	2,258,508.00	0.42
55	000901	航天科技	209,700	2,243,790.00	0.41
56	600963	岳阳林纸	303,600	2,237,532.00	0.41
57	600277	亿利洁能	687,700	2,228,148.00	0.41
58	688357	建龙微纳	34,419	2,226,565.11	0.41
59	600225	卓朗科技	362,000	2,219,060.00	0.41
60	000650	仁和药业	360,300	2,212,242.00	0.41

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

61	002737	葵花药业	90,800	2,210,072.00	0.41
62	600729	重庆百货	70,200	2,207,088.00	0.41
63	600987	航民股份	267,800	2,203,994.00	0.41
64	600197	伊力特	81,100	2,203,487.00	0.41
65	002488	金固股份	317,800	2,192,820.00	0.40
66	300470	中密控股	47,300	2,186,206.00	0.40
67	600268	国电南自	291,400	2,182,586.00	0.40
68	603686	福龙马	209,200	2,181,956.00	0.40
69	600187	国中水务	744,800	2,167,368.00	0.40
70	605599	莱百股份	163,700	2,162,477.00	0.40
71	603619	中曼石油	127,800	2,162,376.00	0.40
72	000534	万泽股份	128,900	2,161,653.00	0.40
73	600590	泰豪科技	303,100	2,161,103.00	0.40
74	002483	润邦股份	372,500	2,160,500.00	0.40
75	600351	亚宝药业	303,600	2,155,560.00	0.40
76	300323	华灿光电	314,300	2,152,955.00	0.40
77	688266	泽璟制药-U	46,208	2,150,982.40	0.40
78	000962	东方钨业	174,900	2,142,525.00	0.39
79	605077	华康股份	80,900	2,142,232.00	0.39
80	000767	晋控电力	675,300	2,140,701.00	0.39
81	600864	哈投股份	418,700	2,139,557.00	0.39
82	300158	振东制药	373,300	2,139,009.00	0.39
83	300634	彩讯股份	81,000	2,138,400.00	0.39
83	600979	广安爱众	594,000	2,138,400.00	0.39
84	300706	阿石创	72,300	2,124,174.00	0.39
85	002448	中原内配	302,800	2,119,600.00	0.39
86	002154	报喜鸟	383,800	2,118,576.00	0.39
87	300494	盛天网络	85,380	2,116,570.20	0.39
88	002169	智光电气	255,000	2,113,950.00	0.39
89	300206	理邦仪器	139,900	2,109,692.00	0.39
90	000685	中山公用	278,500	2,108,245.00	0.39
91	000881	中广核技	255,900	2,106,057.00	0.39
92	301089	拓新药业	34,000	2,105,960.00	0.39
93	002234	民和股份	115,500	2,103,255.00	0.39
94	000680	山推股份	373,500	2,102,805.00	0.39
95	002919	名臣健康	46,600	2,101,660.00	0.39
96	002163	海南发展	210,000	2,100,000.00	0.39
97	300180	华峰超纤	581,700	2,099,937.00	0.39
98	300228	富瑞特装	328,000	2,099,200.00	0.39
99	002491	通鼎互联	302,600	2,093,992.00	0.39
100	603012	创力集团	338,600	2,089,162.00	0.39
101	688639	华恒生物	23,089	2,089,092.72	0.39

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

102	002782	可立克	136,600	2,088,614.00	0.38
103	000731	四川美丰	256,000	2,086,400.00	0.38
104	002022	科华生物	196,600	2,083,960.00	0.38
105	603556	海兴电力	82,500	2,082,300.00	0.38
106	603663	三祥新材	138,900	2,076,555.00	0.38
107	301051	信濠光电	34,200	2,068,758.00	0.38
108	300853	申昊科技	58,900	2,067,390.00	0.38
109	300102	乾照光电	314,000	2,066,120.00	0.38
110	002190	成飞集成	93,300	2,065,662.00	0.38
111	603421	鼎信通讯	197,600	2,064,920.00	0.38
112	002895	川恒股份	104,700	2,062,590.00	0.38
113	600736	苏州高新	406,800	2,062,476.00	0.38
114	002928	华夏航空	244,000	2,061,800.00	0.38
115	300322	硕贝德	243,700	2,061,702.00	0.38
116	000822	山东海化	302,500	2,060,025.00	0.38
117	600771	广誉远	58,400	2,059,768.00	0.38
118	300581	晨曦航空	185,520	2,049,996.00	0.38
119	688262	国芯科技	50,369	2,049,514.61	0.38
120	002449	国星光电	230,300	2,047,367.00	0.38
121	600744	华银电力	569,700	2,045,223.00	0.38
122	000990	诚志股份	267,400	2,037,588.00	0.38
123	000601	韶能股份	443,900	2,037,501.00	0.38
124	002935	天奥电子	102,900	2,035,362.00	0.38
125	600619	海立股份	313,600	2,035,264.00	0.38
126	600876	凯盛新能	127,500	2,034,900.00	0.38
127	000070	特发信息	210,100	2,029,566.00	0.37
128	002141	贤丰控股	616,600	2,028,614.00	0.37
129	002847	盐津铺子	23,850	2,028,442.50	0.37
130	688711	宏微科技	34,753	2,027,490.02	0.37
131	002261	拓维信息	104,906	2,025,734.86	0.37
132	002707	众信旅游	268,700	2,023,311.00	0.37
133	603363	傲农生物	220,600	2,022,902.00	0.37
134	300066	三川智慧	370,300	2,021,838.00	0.37
135	603227	雪峰科技	244,000	2,020,320.00	0.37
136	002819	东方中科	59,200	2,018,720.00	0.37
137	603949	雪龙集团	127,700	2,015,106.00	0.37
138	300443	金雷股份	56,800	2,013,560.00	0.37
139	603871	嘉友国际	128,160	2,013,393.60	0.37
140	300113	顺网科技	116,900	2,011,849.00	0.37
141	002349	精华制药	222,300	2,007,369.00	0.37
142	000008	神州高铁	850,500	2,007,180.00	0.37
143	688677	海泰新光	35,314	2,003,716.36	0.37

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

144	000151	中成股份	152,600	2,000,586.00	0.37
145	600449	宁夏建材	128,500	1,999,460.00	0.37
146	600251	冠农股份	221,300	1,998,339.00	0.37
147	600198	大唐电信	291,700	1,998,145.00	0.37
148	300125	聆达股份	118,200	1,995,216.00	0.37
149	300602	飞荣达	128,700	1,993,563.00	0.37
150	603318	水发燃气	232,800	1,990,440.00	0.37
151	002840	华统股份	127,100	1,987,844.00	0.37
152	002550	千红制药	384,900	1,986,084.00	0.37
153	603439	贵州三力	116,100	1,980,666.00	0.37
154	002912	中新赛克	45,000	1,980,450.00	0.37
155	300444	双杰电气	256,900	1,978,130.00	0.36
156	002937	兴瑞科技	80,400	1,977,840.00	0.36
157	600130	波导股份	454,500	1,977,075.00	0.36
158	300384	三联虹普	116,300	1,975,937.00	0.36
159	000912	泸天化	430,900	1,973,522.00	0.36
160	002948	青岛银行	629,610	1,970,679.30	0.36
161	603366	日出东方	338,400	1,966,104.00	0.36
162	600207	安彩高科	325,800	1,964,574.00	0.36
163	300882	万胜智能	69,200	1,963,896.00	0.36
164	300314	戴维医疗	92,500	1,955,450.00	0.36
165	002657	中科金财	117,500	1,954,025.00	0.36
166	002480	新筑股份	417,200	1,952,496.00	0.36
167	301179	泽宇智能	57,900	1,951,230.00	0.36
168	002783	凯龙股份	233,900	1,950,726.00	0.36
169	601069	西部黄金	151,600	1,946,544.00	0.36
170	000550	江铃汽车	140,600	1,945,904.00	0.36
171	688029	南微医学	23,839	1,944,308.84	0.36
172	300765	新诺威	150,800	1,943,812.00	0.36
173	002334	英威腾	152,400	1,941,576.00	0.36
174	603367	辰欣药业	127,500	1,935,450.00	0.36
175	688206	概伦电子	68,996	1,934,647.84	0.36
176	002096	易普力	163,500	1,934,205.00	0.36
177	300698	万马科技	68,100	1,933,359.00	0.36
178	002746	仙坛股份	243,700	1,920,356.00	0.35
179	600815	厦工股份	711,200	1,920,240.00	0.35
180	300951	博硕科技	35,100	1,917,513.00	0.35
181	002302	西部建设	268,300	1,915,662.00	0.35
182	603800	道森股份	70,400	1,914,880.00	0.35
183	600565	迪马股份	1,211,800	1,914,644.00	0.35
184	000025	特力 A	104,700	1,912,869.00	0.35
185	300127	银河磁体	105,400	1,910,902.00	0.35



广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

186	300663	科蓝软件	140,600	1,910,754.00	0.35
187	002445	中南文化	789,300	1,910,106.00	0.35
188	300147	香雪制药	361,800	1,906,686.00	0.35
189	688155	先惠技术	35,103	1,904,688.78	0.35
190	603167	渤海轮渡	268,000	1,902,800.00	0.35
191	002210	飞马国际	1,022,700	1,902,222.00	0.35
192	301095	广立微	23,000	1,900,950.00	0.35
193	603515	欧普照明	93,600	1,900,080.00	0.35
194	300085	银之杰	161,500	1,899,240.00	0.35
195	601101	昊华能源	325,400	1,893,828.00	0.35
196	601900	南方传媒	92,200	1,891,022.00	0.35
197	600639	浦东金桥	152,200	1,888,802.00	0.35
198	300869	康泰医学	82,000	1,882,720.00	0.35
199	300120	经纬辉开	244,100	1,882,011.00	0.35
200	002860	星帅尔	139,600	1,881,808.00	0.35
201	002329	皇氏集团	289,500	1,881,750.00	0.35
202	000524	岭南控股	175,500	1,879,605.00	0.35
203	002275	桂林三金	104,000	1,873,040.00	0.35
204	600658	电子城	338,300	1,870,799.00	0.34
205	601929	吉视传媒	1,014,700	1,867,048.00	0.34
206	002524	光正眼科	303,900	1,859,868.00	0.34
207	002970	锐明技术	59,000	1,857,910.00	0.34
208	600569	安阳钢铁	932,900	1,856,471.00	0.34
209	600996	贵广网络	187,300	1,839,286.00	0.34
210	300128	锦富技术	440,600	1,837,302.00	0.34
211	300708	聚灿光电	185,900	1,834,833.00	0.34
212	301155	海力风电	23,700	1,826,796.00	0.34
213	002584	西陇科学	336,600	1,817,640.00	0.34
214	300241	瑞丰光电	361,800	1,812,618.00	0.33
215	002735	王子新材	129,800	1,810,710.00	0.33
216	601019	山东出版	197,300	1,809,241.00	0.33
217	002314	南山控股	548,200	1,809,060.00	0.33
218	300910	瑞丰新材	35,900	1,805,770.00	0.33
219	000159	国际实业	254,100	1,804,110.00	0.33
220	600757	长江传媒	209,700	1,803,420.00	0.33
221	600054	黄山旅游	140,300	1,795,840.00	0.33
222	000815	美利云	149,500	1,791,010.00	0.33
223	603508	思维列控	104,900	1,788,545.00	0.33
224	002753	永东股份	243,900	1,778,031.00	0.33
225	688091	上海谊众	24,139	1,777,354.57	0.33
226	002344	海宁皮城	373,100	1,764,763.00	0.33
227	603103	横店影视	104,700	1,763,148.00	0.32

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

228	600135	乐凯胶片	233,100	1,757,574.00	0.32
229	688190	云路股份	23,979	1,750,467.00	0.32
230	601068	中铝国际	326,500	1,750,040.00	0.32
231	603567	珍宝岛	116,900	1,748,824.00	0.32
232	002431	棕榈股份	719,000	1,747,170.00	0.32
233	002122	汇洲智能	407,900	1,737,654.00	0.32
234	002990	盛视科技	47,200	1,736,960.00	0.32
235	300520	科大国创	79,400	1,734,890.00	0.32
236	300693	盛弘股份	46,700	1,724,164.00	0.32
237	002315	焦点科技	43,000	1,720,000.00	0.32
238	688580	伟思医疗	23,624	1,708,015.20	0.31
239	300404	博济医药	163,100	1,704,395.00	0.31
240	300546	雄帝科技	92,400	1,702,932.00	0.31
241	300440	运达科技	239,100	1,690,437.00	0.31
242	000717	中南股份	606,500	1,686,070.00	0.31
243	000652	泰达股份	408,000	1,680,960.00	0.31
244	600790	轻纺城	383,700	1,661,421.00	0.31
245	600971	恒源煤电	209,300	1,630,447.00	0.30
246	603032	德新科技	46,120	1,592,984.80	0.29
247	002229	鸿博股份	43,500	1,525,980.00	0.28
248	002181	粤传媒	304,900	1,506,206.00	0.28
249	600683	京投发展	244,400	1,481,064.00	0.27
250	601200	上海环境	151,800	1,440,582.00	0.27
251	603378	亚士创能	152,400	1,388,364.00	0.26
252	002839	张家港行	313,020	1,324,074.60	0.24
253	300394	天孚通信	12,100	1,292,643.00	0.24
254	601163	三角轮胎	70,600	1,120,422.00	0.21
255	600033	福建高速	338,000	1,057,940.00	0.20
256	603887	城地香江	115,800	1,009,776.00	0.19
257	603727	博迈科	80,800	955,056.00	0.18
258	000928	中钢国际	93,900	906,135.00	0.17
259	002033	丽江股份	69,300	753,984.00	0.14
260	301096	百诚医药	11,900	721,259.00	0.13
261	300976	达瑞电子	11,300	572,910.00	0.11
262	300762	上海瀚讯	47,100	554,367.00	0.10
263	002227	奥特迅	34,900	501,862.00	0.09
264	000791	甘肃能源	92,500	483,775.00	0.09
265	002517	恺英网络	22,100	347,854.00	0.06
266	600975	新五丰	35,000	334,600.00	0.06
267	000567	海德股份	22,970	294,475.40	0.05
268	000503	国新健康	22,500	269,775.00	0.05
269	300536	农尚环境	12,600	182,448.00	0.03

270	688027	国盾量子	500	79,160.00	0.01
271	301399	英特科技	69	3,558.33	0.00
272	301382	蜂助手	108	3,546.72	0.00
273	301225	恒勃股份	93	3,093.18	0.00
274	301332	德尔玛	205	2,814.65	0.00
275	301355	南王科技	167	2,797.25	0.00
276	301428	世纪恒通	86	2,631.60	0.00
277	001380	华纬科技	55	1,692.90	0.00
278	001328	登康口腔	41	1,045.09	0.00

#### 7.1.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.1.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	688326	经纬恒润-W	3,773,791.44	3.83
2	603083	剑桥科技	3,473,651.26	3.53
3	688018	乐鑫科技	3,442,936.56	3.50
4	688095	福昕软件	3,409,363.80	3.46
5	688608	恒玄科技	3,259,116.81	3.31
6	688556	高测股份	3,241,621.65	3.29
7	600199	金种子酒	2,852,346.00	2.90
8	688088	虹软科技	2,841,846.75	2.89
9	600151	航天机电	2,837,201.78	2.88
10	688208	道通科技	2,803,270.86	2.85
11	600211	西藏药业	2,790,825.00	2.83
12	688318	财富趋势	2,730,657.29	2.77
13	601975	招商南油	2,665,279.00	2.71
14	601965	中国汽研	2,653,485.00	2.70
15	688333	铂力特	2,620,454.62	2.66
16	600933	爱柯迪	2,616,695.00	2.66
17	688311	盟升电子	2,616,585.63	2.66
18	688033	天宜上佳	2,611,636.48	2.65
19	600835	上海机电	2,597,692.39	2.64
20	603477	巨星农牧	2,560,241.00	2.60
21	600750	江中药业	2,555,654.00	2.60
22	688022	瀚川智能	2,553,468.46	2.59
23	688639	华恒生物	2,550,729.30	2.59
24	688277	天智航-U	2,543,541.36	2.58
25	600197	伊力特	2,522,742.00	2.56
26	600490	鹏欣资源	2,500,742.00	2.54

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

27	688266	泽璟制药-U	2,477,500.67	2.52
28	600277	亿利洁能	2,459,755.00	2.50
29	600979	广安爱众	2,432,947.00	2.47
30	600225	卓朗科技	2,425,560.00	2.46
31	603990	麦迪科技	2,415,581.00	2.45
32	688357	建龙微纳	2,414,679.33	2.45
33	600525	长园集团	2,412,663.00	2.45
34	600864	哈投股份	2,382,558.00	2.42
35	603619	中曼石油	2,372,735.00	2.41
36	600351	亚宝药业	2,369,297.00	2.41
37	600268	国电南自	2,368,199.80	2.41
38	605599	菜百股份	2,352,051.00	2.39
39	600187	国中水务	2,349,682.00	2.39
40	603686	福龙马	2,342,264.00	2.38
41	600590	泰豪科技	2,339,494.00	2.38
42	600736	苏州高新	2,338,664.00	2.38
43	600449	宁夏建材	2,333,805.00	2.37
44	688262	国芯科技	2,321,707.44	2.36
45	688711	宏微科技	2,312,581.46	2.35
46	600729	重庆百货	2,301,614.00	2.34
47	600744	华银电力	2,301,117.00	2.34
48	600771	广誉远	2,300,150.00	2.34
49	601900	南方传媒	2,296,761.00	2.33
50	600963	岳阳林纸	2,286,051.00	2.32
51	600987	航民股份	2,281,595.65	2.32
52	603012	创力集团	2,273,365.00	2.31
53	605077	华康股份	2,253,040.80	2.29
54	603421	鼎信通讯	2,248,950.00	2.28
55	603556	海兴电力	2,247,557.00	2.28
56	688677	海泰新光	2,247,433.65	2.28
57	600876	凯盛新能	2,245,278.00	2.28
58	603663	三祥新材	2,243,505.00	2.28
59	603227	雪峰科技	2,242,535.00	2.28
60	603363	傲农生物	2,229,752.70	2.26
61	600619	海立股份	2,229,252.00	2.26
62	603949	雪龙集团	2,200,178.00	2.23
63	600251	冠农股份	2,192,957.00	2.23
64	600198	大唐电信	2,188,954.00	2.22
65	603318	水发燃气	2,172,892.16	2.21
66	601929	吉视传媒	2,166,414.00	2.20
67	603439	贵州三力	2,166,156.00	2.20
68	688029	南微医学	2,154,032.62	2.19

69	600207	安彩高科	2,152,359.89	2.19
70	688206	概伦电子	2,137,157.82	2.17
71	601069	西部黄金	2,133,855.92	2.17
72	600130	波导股份	2,123,027.80	2.16
73	601019	山东出版	2,112,380.78	2.15
74	600815	厦工股份	2,110,664.00	2.14
75	603367	辰欣药业	2,094,800.00	2.13
76	603366	日出东方	2,092,896.00	2.13
77	603871	嘉友国际	2,092,308.80	2.13
78	603167	渤海轮渡	2,092,056.00	2.12
79	600639	浦东金桥	2,089,701.00	2.12
80	601101	昊华能源	2,085,782.24	2.12
81	600757	长江传媒	2,082,148.00	2.11
82	603515	欧普照明	2,075,364.00	2.11
83	600658	电子城	2,073,106.00	2.11
84	600996	贵广网络	2,073,077.76	2.11
85	600569	安阳钢铁	2,070,969.00	2.10
86	603800	道森股份	2,057,594.44	2.09
87	603508	思维列控	2,051,573.60	2.08
88	600565	迪马股份	2,048,317.00	2.08
89	600054	黄山旅游	2,044,734.00	2.08
90	601068	中铝国际	1,991,695.00	2.02
91	603103	横店影视	1,980,920.00	2.01
92	603567	珍宝岛	1,970,332.30	2.00

注：本项及下项 7.1.4.2、7.1.4.3 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。

#### 7.1.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例（%）
1	002594	比亚迪	4,348,559.56	4.42
2	002415	海康威视	2,517,996.16	2.56
3	002475	立讯精密	2,447,862.08	2.49
4	002230	科大讯飞	2,229,770.36	2.26
5	002352	顺丰控股	2,137,833.96	2.17

6	002714	牧原股份	1,955,175.16	1.99
7	002142	宁波银行	1,884,828.20	1.91
8	002129	TCL 中环	1,718,921.56	1.75
9	002304	洋河股份	1,623,950.28	1.65
10	002371	北方华创	1,568,070.00	1.59
11	002466	天齐锂业	1,528,182.00	1.55
12	002460	赣锋锂业	1,414,858.06	1.44
13	002027	分众传媒	1,346,723.92	1.37
14	002049	紫光国微	1,113,990.30	1.13
15	002271	东方雨虹	1,105,497.73	1.12
16	002459	晶澳科技	1,074,977.72	1.09
17	002709	天赐材料	949,622.00	0.96
18	002410	广联达	924,265.60	0.94
19	002812	恩捷股份	914,161.80	0.93
20	002050	三花智控	901,246.44	0.92

#### 7.1.4.3 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	301,582,958.70
卖出股票的收入（成交）总额	28,671,863.08

#### 7.1.5 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）	32,303.61	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	32,303.61	0.01

#### 7.1.6 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	127087	星帅转 2	323	32,303.61	0.01

#### 7.1.7 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。

#### 7.1.8 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。

#### 7.1.9 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。

#### 7.1.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

#### 7.1.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.1.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

##### 7.1.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.1.12 投资组合报告附注

7.1.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，哈尔滨博实自动化股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方应急管理局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.1.12.2 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。

##### 7.1.12.3 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	57,098.60
2	应收清算款	22,860,659.11
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	22,917,757.71

#### 7.1.12.4 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处于转股期的可转换债券。

#### 7.1.12.5 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。

### 7.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2023年1月1日-2023年6月11日)

#### 7.2.1 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	94,613,545.92	80.99
	其中：普通股	94,613,545.92	80.99
	存托凭证	-	-
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	4,089,087.50	3.50
8	其他各项资产	18,116,985.74	15.51
9	合计	116,819,619.16	100.00

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2.2 的合计项不含可退替代款估值增值。



## 7.2.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.2.1 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	832,830.76	0.86
B	采矿业	1,517,584.14	1.56
C	制造业	61,646,791.46	63.53
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,923,976.20	3.01
E	建筑业	2,060,930.50	2.12
F	批发和零售业	2,412,992.82	2.49
G	交通运输、仓储和邮政业	1,682,658.97	1.73
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,890,119.56	12.25
J	金融业	1,053,688.08	1.09
K	房地产业	2,407,400.10	2.48
L	租赁和商务服务业	2,054,095.36	2.12
M	科学研究和技术服务业	1,197,414.00	1.23
N	水利、环境和公共设施管理业	731,849.50	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	354,853.47	0.37
R	文化、体育和娱乐业	1,846,361.00	1.90
S	综合	-	-
T	合计	94,613,545.92	97.50

### 7.2.2.2 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。

### 7.2.3 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	占基金资产净值比例（%）
1	300002	神州泰岳	45,900	645,813.00	0.67
2	002240	盛新锂能	16,600	575,190.00	0.59
3	603083	剑桥科技	7,600	494,988.00	0.51
4	002229	鸿博股份	12,500	475,000.00	0.49

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

5	300624	万兴科技	3,500	458,500.00	0.47
6	600199	金种子酒	18,700	458,150.00	0.47
7	601975	招商南油	146,200	448,834.00	0.46
8	688639	华恒生物	4,089	447,745.50	0.46
9	688556	高测股份	10,603	445,644.09	0.46
10	002139	拓邦股份	41,875	439,268.75	0.45
11	300456	赛微电子	19,200	432,000.00	0.45
12	688088	虹软科技	9,356	430,376.00	0.44
13	002212	天融信	40,700	429,792.00	0.44
14	688608	恒玄科技	3,321	428,375.79	0.44
15	688333	铂力特	4,267	427,382.72	0.44
16	300170	汉得信息	40,400	425,412.00	0.44
17	688262	国芯科技	7,093	419,550.95	0.43
18	688266	泽璟制药-U	8,008	417,056.64	0.43
19	002605	姚记科技	10,200	416,670.00	0.43
20	603477	巨星农牧	12,500	416,125.00	0.43
21	600750	江中药业	18,900	415,989.00	0.43
22	300113	顺网科技	21,000	414,540.00	0.43
23	301155	海力风电	4,800	413,664.00	0.43
24	300910	瑞丰新材	7,100	410,735.00	0.42
25	002121	科陆电子	56,700	410,508.00	0.42
26	688208	道通科技	14,025	408,969.00	0.42
27	002698	博实股份	27,500	408,650.00	0.42
28	002424	贵州百灵	49,568	403,483.52	0.42
29	688033	天宜上佳	24,041	403,407.98	0.42
30	688018	乐鑫科技	2,818	402,974.00	0.42
31	688091	上海谊众	5,339	402,026.70	0.41
32	688029	南微医学	4,839	400,959.54	0.41
33	300855	图南股份	11,900	399,602.00	0.41
34	688326	经纬恒润-W	3,065	398,450.00	0.41
35	002315	焦点科技	10,100	397,233.00	0.41
36	300443	金雷股份	10,600	396,334.00	0.41
37	300008	天海防务	87,300	393,723.00	0.41
38	688095	福昕软件	2,412	393,324.84	0.41
39	600963	岳阳林纸	55,000	393,250.00	0.41
40	600933	爱柯迪	18,500	393,125.00	0.41
41	300494	盛天网络	9,400	392,732.00	0.40
42	300470	中密控股	8,900	392,579.00	0.40
43	000065	北方国际	26,000	391,820.00	0.40
44	601900	南方传媒	15,500	389,360.00	0.40
45	000650	仁和药业	62,900	389,351.00	0.40
46	600151	航天机电	50,100	388,776.00	0.40

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

47	002351	漫步者	21,200	385,628.00	0.40
48	300551	古鳌科技	18,600	384,462.00	0.40
49	300634	彩讯股份	14,100	383,379.00	0.39
50	002048	宁波华翔	30,364	382,586.40	0.39
51	002163	海南发展	37,200	382,044.00	0.39
52	000901	航天科技	37,800	381,024.00	0.39
53	002948	青岛银行	111,410	381,022.20	0.39
54	600757	长江传媒	37,200	380,556.00	0.39
55	600729	重庆百货	12,600	380,520.00	0.39
56	000767	晋控电力	120,600	379,890.00	0.39
57	600211	西藏药业	7,100	377,791.00	0.39
58	002270	华明装备	38,500	377,300.00	0.39
59	002338	奥普光电	11,200	377,216.00	0.39
60	600525	长园集团	68,300	377,016.00	0.39
61	688711	宏微科技	6,153	376,625.13	0.39
62	600225	卓朗科技	67,000	376,540.00	0.39
63	002737	葵花药业	15,000	376,500.00	0.39
64	000680	山推股份	67,500	375,975.00	0.39
65	002491	通鼎互联	55,000	375,650.00	0.39
66	002840	华统股份	23,600	375,004.00	0.39
67	002707	众信旅游	48,400	374,616.00	0.39
68	002428	云南锗业	36,500	374,125.00	0.39
69	300353	东土科技	30,900	373,890.00	0.39
70	600277	亿利洁能	117,200	373,868.00	0.39
71	002847	盐津铺子	4,650	373,348.50	0.38
72	600490	鹏欣资源	113,800	373,264.00	0.38
73	688318	财富趋势	2,610	372,316.50	0.38
74	300323	华灿光电	55,300	372,169.00	0.38
75	603871	嘉友国际	16,600	372,006.00	0.38
76	600864	哈投股份	71,900	371,723.00	0.38
77	002154	报喜鸟	66,700	371,519.00	0.38
78	601019	山东出版	34,400	371,176.00	0.38
79	002169	智光电气	48,300	370,461.00	0.38
80	300085	银之杰	28,800	370,368.00	0.38
81	600351	亚宝药业	54,500	369,510.00	0.38
82	000685	中山公用	48,300	369,495.00	0.38
83	688311	盟升电子	5,655	369,158.40	0.38
84	600835	上海机电	26,500	368,350.00	0.38
85	000534	万泽股份	23,300	367,907.00	0.38
86	600771	广誉远	10,100	367,640.00	0.38
87	000990	诚志股份	46,900	367,227.00	0.38
88	600198	大唐电信	53,100	366,390.00	0.38

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

89	002122	汇洲智能	75,500	366,175.00	0.38
90	002349	精华制药	39,000	365,820.00	0.38
91	000070	特发信息	36,800	364,688.00	0.38
92	002022	科华生物	35,400	364,620.00	0.38
93	300161	华中数控	8,100	364,500.00	0.38
94	000731	四川美丰	45,400	364,108.00	0.38
95	601965	中国汽研	18,200	363,818.00	0.37
96	301089	拓新药业	5,200	363,584.00	0.37
97	600251	冠农股份	39,700	363,255.00	0.37
98	603556	海兴电力	15,700	363,141.00	0.37
99	300102	乾照光电	55,300	362,215.00	0.37
100	002445	中南文化	143,100	362,043.00	0.37
101	002657	中科金财	21,600	361,800.00	0.37
102	601929	吉视传媒	178,200	361,746.00	0.37
103	300180	华峰超纤	101,300	361,641.00	0.37
104	688277	天智航-U	21,689	360,904.96	0.37
105	603619	中曼石油	22,300	360,814.00	0.37
106	603227	雪峰科技	42,800	360,804.00	0.37
107	300206	理邦仪器	24,900	360,054.00	0.37
108	300444	双杰电气	46,500	359,910.00	0.37
109	002550	千红制药	68,400	359,784.00	0.37
110	000881	中广核技	45,300	359,682.00	0.37
111	688677	海泰新光	4,653	358,885.89	0.37
112	000008	神州高铁	151,400	358,818.00	0.37
113	300158	振东制药	66,200	358,804.00	0.37
114	300125	聆达股份	23,000	358,800.00	0.37
115	002919	名臣健康	8,400	358,764.00	0.37
116	603990	麦迪科技	18,200	358,722.00	0.37
117	601101	昊华能源	58,300	358,545.00	0.37
118	688022	瀚川智能	11,740	358,539.60	0.37
119	300116	保力新	303,800	358,484.00	0.37
120	002068	黑猫股份	39,300	358,416.00	0.37
121	300663	科蓝软件	24,500	358,190.00	0.37
122	603032	德新科技	7,800	357,864.00	0.37
123	600197	伊力特	13,300	357,770.00	0.37
124	600744	华银电力	101,900	357,669.00	0.37
125	688206	概伦电子	11,696	357,663.68	0.37
126	300520	科大国创	14,300	357,357.00	0.37
127	601069	西部黄金	27,500	356,950.00	0.37
128	000822	山东海化	53,500	356,845.00	0.37
129	600987	航民股份	46,700	356,788.00	0.37
130	002819	东方中科	11,300	356,741.00	0.37

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

131	300066	三川智慧	67,400	356,546.00	0.37
132	002935	天奥电子	19,500	356,460.00	0.37
133	000815	美利云	31,200	356,304.00	0.37
134	002895	川恒股份	17,800	355,288.00	0.37
135	000561	烽火电子	36,700	354,889.00	0.37
136	002329	皇氏集团	60,500	354,530.00	0.37
137	002302	西部建设	47,700	354,411.00	0.37
138	600187	国中水务	131,900	353,492.00	0.36
139	301095	广立微	3,800	353,400.00	0.36
140	002210	飞马国际	190,700	352,795.00	0.36
141	002912	中新赛克	8,000	352,480.00	0.36
142	300708	聚灿光电	34,500	352,245.00	0.36
143	688190	云路股份	4,979	351,965.51	0.36
144	002548	金新农	59,600	351,640.00	0.36
145	300869	康泰医学	14,700	351,624.00	0.36
146	002937	兴瑞科技	14,900	351,491.00	0.36
147	002746	仙坛股份	41,300	351,463.00	0.36
148	603567	珍宝岛	20,800	351,312.00	0.36
149	600736	苏州高新	71,500	351,065.00	0.36
150	002261	拓维信息	19,906	350,942.78	0.36
151	605077	华康股份	13,700	350,857.00	0.36
152	000601	韶能股份	80,800	350,672.00	0.36
153	603686	福龙马	36,400	350,532.00	0.36
154	000912	泸天化	76,200	349,758.00	0.36
155	300128	锦富技术	81,700	349,676.00	0.36
156	603421	鼎信通讯	35,000	349,650.00	0.36
157	002344	海宁皮城	66,200	349,536.00	0.36
158	300322	硕贝德	42,500	349,350.00	0.36
159	600658	电子城	59,700	349,245.00	0.36
160	600979	广安爱众	106,100	349,069.00	0.36
161	300228	富瑞特装	62,400	348,816.00	0.36
162	603508	思维列控	18,600	348,564.00	0.36
163	603367	辰欣药业	22,100	348,296.00	0.36
164	002448	中原内配	53,400	348,168.00	0.36
165	300120	经纬辉开	47,100	348,069.00	0.36
166	300853	申昊科技	11,000	348,040.00	0.36
167	600130	波导股份	81,300	347,964.00	0.36
168	605599	莱百股份	30,100	347,655.00	0.36
169	002190	成飞集成	16,100	347,599.00	0.36
170	000962	东方钽业	31,800	347,256.00	0.36
171	603012	创力集团	60,800	347,168.00	0.36
172	002483	润邦股份	66,500	347,130.00	0.36

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

173	000025	特力 A	19,600	347,116.00	0.36
173	600054	黄山旅游	25,300	347,116.00	0.36
174	300602	飞荣达	23,200	346,840.00	0.36
175	600996	贵广网络	33,900	346,797.00	0.36
176	600268	国电南自	52,300	346,749.00	0.36
177	002782	可立克	24,100	346,076.00	0.36
178	301051	信濠光电	4,200	345,576.00	0.36
179	300404	博济医药	30,600	345,474.00	0.36
180	000159	国际实业	46,800	344,916.00	0.36
181	002449	国星光电	38,300	344,317.00	0.35
182	600449	宁夏建材	22,300	344,312.00	0.35
183	300147	香雪制药	64,400	343,896.00	0.35
184	002431	棕榈股份	135,100	343,154.00	0.35
185	002480	新筑股份	77,800	343,098.00	0.35
186	688357	建龙微纳	5,619	343,096.14	0.35
187	002990	盛视科技	8,900	342,650.00	0.35
188	300241	瑞丰光电	68,500	342,500.00	0.35
189	603363	傲农生物	36,900	342,432.00	0.35
190	600619	海立股份	54,500	342,260.00	0.35
191	002524	光正眼科	54,800	341,952.00	0.35
192	600639	浦东金桥	26,400	341,616.00	0.35
193	603439	贵州三力	20,200	341,582.00	0.35
194	002275	桂林三金	18,400	341,504.00	0.35
195	600815	厦工股份	127,100	340,628.00	0.35
196	603515	欧普照明	16,700	340,179.00	0.35
197	300765	新诺威	25,400	340,106.00	0.35
198	002234	民和股份	18,500	339,290.00	0.35
199	603167	渤海轮渡	47,900	339,132.00	0.35
200	300384	三联虹普	20,100	339,087.00	0.35
201	002783	凯龙股份	42,100	338,905.00	0.35
202	300314	戴维医疗	15,900	338,670.00	0.35
203	603800	道森股份	12,800	338,560.00	0.35
204	300546	雄帝科技	17,300	338,388.00	0.35
205	002181	粤传媒	60,100	338,363.00	0.35
206	300581	晨曦航空	31,720	338,135.20	0.35
207	002735	王子新材	24,900	337,395.00	0.35
208	300706	阿石创	13,800	336,996.00	0.35
209	603318	水发燃气	41,500	336,980.00	0.35
210	000550	江铃汽车	25,500	336,600.00	0.35
211	600207	安彩高科	57,700	335,814.00	0.35
212	600569	安阳钢铁	166,200	335,724.00	0.35
213	002141	贤丰控股	107,600	335,712.00	0.35

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

214	002584	西陇科学	64,800	335,664.00	0.35
215	000151	中成股份	29,200	335,508.00	0.35
216	300729	乐歌股份	22,100	335,036.00	0.35
217	000524	岭南控股	31,600	334,960.00	0.35
218	300833	浩洋股份	3,200	334,400.00	0.34
219	601068	中铝国际	58,400	333,464.00	0.34
220	002928	华夏航空	39,900	332,766.00	0.34
221	300698	万马科技	12,500	332,500.00	0.34
222	300127	银河磁体	19,400	332,322.00	0.34
223	603366	日出东方	60,200	332,304.00	0.34
224	688155	先惠技术	6,503	332,303.30	0.34
225	300440	运达科技	45,300	332,049.00	0.34
226	002314	南山控股	97,200	331,452.00	0.34
227	300882	万胜智能	11,700	331,344.00	0.34
228	002096	南岭民爆	29,400	331,338.00	0.34
229	600876	凯盛新能	21,400	331,272.00	0.34
230	300951	博硕科技	6,400	330,944.00	0.34
231	688580	伟思医疗	4,624	330,292.32	0.34
232	301179	泽宇智能	9,800	330,260.00	0.34
233	002970	锐明技术	11,000	329,670.00	0.34
234	002334	英威腾	28,100	329,613.00	0.34
235	600565	迪马股份	208,600	329,588.00	0.34
236	002488	金固股份	51,200	327,680.00	0.34
237	002753	永东股份	46,200	327,558.00	0.34
238	600683	京投发展	42,200	327,472.00	0.34
239	603103	横店影视	18,300	325,740.00	0.34
240	002860	星帅尔	24,600	321,768.00	0.33
241	603949	雪龙集团	22,200	321,012.00	0.33
242	600590	泰豪科技	49,100	320,132.00	0.33
243	300693	盛弘股份	8,500	319,175.00	0.33
244	603663	三祥新材	22,200	311,022.00	0.32
245	000717	中南股份	108,100	308,085.00	0.32
246	600790	轻纺城	67,700	301,265.00	0.31
247	000652	泰达股份	72,800	299,208.00	0.31
248	600971	恒源煤电	36,700	297,270.00	0.31
249	600135	乐凯胶片	41,100	292,221.00	0.30
250	603378	亚士创能	27,600	252,264.00	0.26
251	601200	上海环境	26,400	251,592.00	0.26
252	002839	张家港行	56,320	244,428.80	0.25
253	300394	天孚通信	2,800	218,960.00	0.23
254	601163	三角轮胎	13,300	202,958.00	0.21
255	600033	福建高速	60,000	188,400.00	0.19

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

256	000928	中钢国际	17,500	164,325.00	0.17
257	603887	城地香江	19,800	158,004.00	0.16
258	301096	百诚医药	2,300	142,715.00	0.15
259	603727	博迈科	12,700	142,240.00	0.15
260	002033	丽江股份	11,900	133,042.00	0.14
261	300976	达瑞电子	2,200	107,954.00	0.11
262	300762	上海瀚讯	8,900	103,329.00	0.11
263	000791	甘肃能源	16,700	86,339.00	0.09
264	688027	国盾量子	500	79,645.00	0.08
265	002227	奥特迅	6,100	79,361.00	0.08
266	600975	新五丰	6,500	73,190.00	0.08
267	002517	恺英网络	3,300	57,090.00	0.06
268	000567	海德股份	2,600	50,752.00	0.05
269	000503	国新健康	3,600	46,404.00	0.05
270	300536	农尚环境	3,000	43,170.00	0.04
271	301225	恒勃股份	930	33,163.80	0.03
272	301355	南王科技	1,666	29,238.30	0.03
273	002865	钧达股份	197	25,152.96	0.03
274	002600	领益智造	3,876	24,690.12	0.03
275	002353	杰瑞股份	964	23,386.64	0.02
276	002506	协鑫集成	7,500	21,750.00	0.02
277	002594	比亚迪	78	20,124.00	0.02
278	002456	欧菲光	3,845	18,609.80	0.02
279	002436	兴森科技	1,184	17,996.80	0.02
280	002463	沪电股份	818	17,840.58	0.02
281	002739	万达电影	1,400	17,486.00	0.02
282	002044	美年健康	1,851	12,901.47	0.01
283	002850	科达利	100	11,920.00	0.01
284	002262	恩华药业	364	11,400.48	0.01
285	002078	太阳纸业	1,056	11,066.88	0.01
286	002080	中材科技	544	10,455.68	0.01
287	002294	信立泰	274	9,157.08	0.01
288	002422	科伦药业	293	8,819.30	0.01
289	002304	洋河股份	64	8,720.64	0.01
290	002557	洽洽食品	200	8,420.00	0.01
291	002821	凯莱英	60	8,088.00	0.01
292	002583	海能达	1,360	8,010.40	0.01
293	002531	天顺风能	500	7,790.00	0.01
294	002311	海大集团	160	7,526.40	0.01
295	002430	杭氧股份	215	7,499.20	0.01
296	002243	力合科创	800	7,056.00	0.01
297	002008	大族激光	278	6,983.36	0.01



广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

298	002791	坚朗五金	100	6,646.00	0.01
299	003035	南网能源	1,000	6,320.00	0.01
300	002061	浙江交科	1,360	6,106.40	0.01
301	002230	科大讯飞	88	5,838.80	0.01
302	002544	普天科技	200	4,406.00	0.00
303	301399	英特科技	69	4,383.57	0.00
304	002156	通富微电	169	4,326.40	0.00
305	301382	蜂助手	108	4,174.20	0.00
306	002916	深南电路	52	3,967.60	0.00
307	002756	永兴材料	60	3,929.40	0.00
308	002841	视源股份	60	3,840.00	0.00
309	002812	恩捷股份	40	3,695.20	0.00
310	002459	晶澳科技	88	3,256.00	0.00
311	002541	鸿路钢构	110	3,205.40	0.00
312	002129	TCL 中环	86	3,129.54	0.00
313	301428	世纪恒通	86	3,126.10	0.00
314	002714	牧原股份	73	2,977.67	0.00
315	002049	紫光国微	33	2,872.98	0.00
316	002051	中工国际	245	2,797.90	0.00
317	301332	德尔玛	205	2,728.55	0.00
318	002038	双鹭药业	259	2,628.85	0.00
319	002939	长城证券	300	2,544.00	0.00
320	002706	良信股份	240	2,479.20	0.00
321	002993	奥海科技	80	2,467.20	0.00
322	002025	航天电器	43	2,427.78	0.00
323	002123	梦网科技	170	2,373.20	0.00
324	002911	佛燃能源	190	2,354.10	0.00
325	002439	启明星辰	68	2,220.20	0.00
326	002276	万马股份	184	2,204.32	0.00
327	002407	多氟多	113	2,187.68	0.00
328	002271	东方雨虹	73	2,105.32	0.00
329	002384	东山精密	88	2,091.76	0.00
330	002226	江南化工	380	1,976.00	0.00
331	002101	广东鸿图	100	1,900.00	0.00
332	002532	天山铝业	300	1,899.00	0.00
333	002624	完美世界	95	1,741.35	0.00
334	002368	太极股份	43	1,703.66	0.00
335	002985	北摩高科	40	1,695.20	0.00
336	002534	西子洁能	100	1,663.00	0.00
337	003039	顺控发展	100	1,640.00	0.00
338	002056	横店东磁	92	1,547.44	0.00
339	001380	华纬科技	55	1,461.90	0.00

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

340	002545	东方铁塔	200	1,440.00	0.00
341	002831	裕同科技	60	1,425.00	0.00
342	002317	众生药业	80	1,398.40	0.00
343	002216	三全食品	80	1,256.80	0.00
344	002837	英维克	40	1,234.00	0.00
345	002818	富森美	90	1,206.00	0.00
346	002508	老板电器	49	1,201.97	0.00
347	002568	百润股份	36	1,194.48	0.00
348	002558	巨人网络	60	1,187.40	0.00
349	002475	立讯精密	43	1,168.74	0.00
350	002145	中核钛白	185	1,154.40	0.00
351	001328	登康口腔	41	1,140.62	0.00
352	002373	千方科技	83	1,135.44	0.00
353	002002	鸿达兴业	480	1,070.40	0.00
354	002153	石基信息	55	1,044.45	0.00
355	002415	海康威视	32	1,035.52	0.00
356	002372	伟星新材	48	1,023.84	0.00
357	002128	电投能源	76	1,023.72	0.00
358	002028	思源电气	21	981.54	0.00
359	002202	金风科技	89	954.97	0.00
360	002120	韵达股份	90	903.60	0.00
361	002410	广联达	25	847.50	0.00
362	002958	青农商行	300	834.00	0.00
363	002867	周大生	50	831.00	0.00
364	002242	九阳股份	57	823.08	0.00
365	002273	水晶光电	71	806.56	0.00
366	002402	和而泰	50	777.50	0.00
367	002405	四维图新	67	776.53	0.00
368	002074	国轩高科	30	768.30	0.00
369	002023	海特高新	88	752.40	0.00
370	002155	湖南黄金	54	741.42	0.00
371	002050	三花智控	29	701.80	0.00
372	002738	中矿资源	12	693.00	0.00
373	002030	达安基因	56	692.72	0.00
374	002091	江苏国泰	89	685.30	0.00
375	002555	三七互娱	20	684.20	0.00
376	002396	星网锐捷	31	676.73	0.00
377	002027	分众传媒	96	648.96	0.00
378	002493	荣盛石化	54	622.62	0.00
379	002736	国信证券	67	612.38	0.00
380	002281	光迅科技	21	604.59	0.00
381	002625	光启技术	40	579.20	0.00

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

382	002608	江苏国信	77	562.10	0.00
383	002252	上海莱士	75	531.00	0.00
384	002241	歌尔股份	28	509.04	0.00
385	002214	大立科技	40	508.00	0.00
386	002400	省广集团	97	504.40	0.00
387	002326	永太科技	34	494.36	0.00
388	002191	劲嘉股份	78	478.14	0.00
389	002440	闰土股份	68	476.68	0.00
390	002001	新和成	29	450.95	0.00
391	002092	中泰化学	63	421.47	0.00
392	002602	世纪华通	55	416.35	0.00
393	002007	华兰生物	19	414.20	0.00
394	002773	康弘药业	20	392.40	0.00
395	002352	顺丰控股	8	384.64	0.00
396	002460	赣锋锂业	6	383.46	0.00
397	002925	盈趣科技	20	377.80	0.00
398	002130	沃尔核材	50	375.00	0.00
399	002429	兆驰股份	65	351.00	0.00
400	002152	广电运通	28	350.00	0.00
401	002151	北斗星通	11	331.65	0.00
402	002081	金螳螂	70	326.20	0.00
403	002458	益生股份	27	323.46	0.00
404	002465	海格通信	34	321.64	0.00
405	002142	宁波银行	12	321.12	0.00
406	002709	天赐材料	8	320.24	0.00
407	002648	卫星化学	22	315.48	0.00
408	002390	信邦制药	70	307.30	0.00
409	002416	爱施德	40	306.40	0.00
410	002244	滨江集团	34	306.00	0.00
411	002419	天虹股份	50	305.50	0.00
412	002500	山西证券	53	303.16	0.00
413	002673	西部证券	45	290.70	0.00
414	002299	圣农发展	15	287.40	0.00
415	002399	海普瑞	25	285.25	0.00
416	002340	格林美	40	277.20	0.00
417	002966	苏州银行	40	276.80	0.00
418	002138	顺络电子	12	275.76	0.00
419	002324	普利特	20	272.00	0.00
420	002004	华邦健康	52	267.80	0.00
421	002099	海翔药业	30	267.60	0.00
422	002124	天邦食品	60	267.00	0.00
423	002223	鱼跃医疗	8	262.72	0.00

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

424	002041	登海种业	17	260.61	0.00
425	002195	二三四五	81	248.67	0.00
426	002690	美亚光电	10	244.90	0.00
427	002444	巨星科技	14	238.00	0.00
428	002807	江阴银行	60	232.80	0.00
429	002320	海峡股份	37	232.73	0.00
430	002414	高德红外	23	220.80	0.00
431	002603	以岭药业	8	214.80	0.00
432	002179	中航光电	5	212.25	0.00
433	002127	南极电商	50	201.00	0.00
434	002670	国盛金控	20	159.80	0.00
435	002249	大洋电机	30	154.20	0.00
436	002085	万丰奥威	24	151.92	0.00
437	002385	大北农	23	150.42	0.00
438	002237	恒邦股份	12	138.12	0.00
439	002236	大华股份	7	131.25	0.00
440	002065	东华软件	16	119.84	0.00
441	002146	荣盛发展	90	116.10	0.00
442	002131	利欧股份	48	115.68	0.00
443	002797	第一创业	20	115.40	0.00
444	002157	*ST 正邦	42	109.62	0.00
445	002266	浙富控股	25	99.50	0.00
446	002292	奥飞娱乐	8	89.52	0.00
447	002936	郑州银行	31	71.92	0.00
448	002268	电科网安	2	58.64	0.00
449	002413	雷科防务	10	49.30	0.00
450	002063	远光软件	5	44.60	0.00
451	002019	亿帆医药	3	42.00	0.00
452	002185	华天科技	4	37.16	0.00
453	002601	龙佰集团	2	31.90	0.00
454	002505	鹏都农牧	17	31.62	0.00
455	002408	齐翔腾达	4	26.72	0.00
456	002701	奥瑞金	3	13.59	0.00

## 7.2.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.2.4.1 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	300002	神州泰岳	606,206.00	0.62
2	002240	盛新锂能	564,390.00	0.57

3	603083	剑桥科技	510,069.00	0.52
4	002229	鸿博股份	476,662.00	0.48
5	300624	万兴科技	463,908.00	0.47
6	600199	金种子酒	454,188.00	0.46
7	688639	华恒生物	452,499.81	0.46
8	688556	高测股份	445,817.22	0.45
9	601975	招商南油	437,697.00	0.44
10	300456	赛微电子	433,163.00	0.44
11	688333	铂力特	431,619.97	0.44
12	688608	恒玄科技	428,501.26	0.44
13	688088	虹软科技	427,869.81	0.43
14	300170	汉得信息	420,869.00	0.43
15	600750	江中药业	419,336.00	0.43
16	300910	瑞丰新材	417,896.00	0.42
17	300113	顺网科技	413,859.00	0.42
18	688208	道通科技	413,101.86	0.42
19	688262	国芯科技	412,953.17	0.42
20	002605	姚记科技	411,004.00	0.42

注：本项及下项 7.2.4.2、7.2.4.3 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。

#### 7.2.4.2 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	002594	比亚迪	4,328,278.00	4.40
2	002415	海康威视	2,516,976.00	2.56
3	002475	立讯精密	2,446,677.00	2.49
4	002230	科大讯飞	2,223,701.00	2.26
5	002352	顺丰控股	2,137,445.00	2.17
6	002714	牧原股份	1,952,188.00	1.98
7	002142	宁波银行	1,884,506.00	1.91
8	002129	TCL 中环	1,715,743.00	1.74
9	002304	洋河股份	1,615,117.00	1.64
10	002371	北方华创	1,568,070.00	1.59
11	002466	天齐锂业	1,528,182.00	1.55

12	002460	赣锋锂业	1,414,478.20	1.44
13	002027	分众传媒	1,346,074.00	1.37
14	002049	紫光国微	1,111,149.00	1.13
15	002271	东方雨虹	1,103,307.00	1.12
16	002459	晶澳科技	1,071,617.00	1.09
17	002709	天赐材料	949,308.00	0.96
18	002410	广联达	923,395.60	0.94
19	002812	恩捷股份	910,459.00	0.92
20	002050	三花智控	900,482.00	0.91

### 7.2.4.3 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	93,552,156.92
卖出股票的收入（成交）总额	93,602,171.83

### 7.2.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

### 7.2.7 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。

### 7.2.8 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。

### 7.2.9 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。

### 7.2.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

### 7.2.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.2.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

#### 7.2.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.2.12 投资组合报告附注

7.2.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商局南京油运股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到海事局的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.2.12.2 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。

### 7.2.12.3 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	57,180.61
2	应收证券清算款	18,059,805.13
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	18,116,985.74

### 7.2.12.4 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处于转股期的可转换债券。

### 7.2.12.5 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 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期：2023年6月12日-2023年6月30日)

#### 8.1.1 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
2,421	144,815.7 2	340,881,8 41.00	97.23%	9,717,00 6.00	2.77%	50,213,709. 00	14.32%

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。

### 8.1.2 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	国信证券股份有限公司	46,605,200.00	13.29%
2	中信证券股份有限公司	34,753,300.00	9.91%
3	国泰君安证券股份有限公 司	27,400,000.00	7.82%
4	广发证券股份有限公司	22,169,497.00	6.32%
5	招商证券股份有限公司	14,480,600.00	4.13%
6	东方证券股份有限公司	13,713,100.00	3.91%
7	方正证券股份有限公司	13,154,900.00	3.75%
8	长城证券股份有限公司	13,143,000.00	3.75%
9	华泰证券股份有限公司	13,042,500.00	3.72%
10	青岛鹿秀投资管理有限公司-鹿秀长颈鹿 6 号私募证 券投资基金	13,000,000.00	3.71%
11	广发国证 2000 交易型开放 式指数证券投资基金联接 基金	50,213,709.00	14.32%

### 8.1.3 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	100.00	0.0000%

### 8.1.4 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



## 8.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2023年1月1日-2023年6月11日)

### 8.2.1 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		广发中小企业 300 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
891	71,940.34	55,467,12 2.00	86.53%	8,631,72 5.00	13.47%	50,594,409. 00	78.93%

注: 机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中小企业 300 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。

### 8.2.2 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	海通证券股份有限公司	3,067,431.00	4.79%
2	广发证券股份有限公司	885,778.00	1.38%
3	上海旭兴投资管理有限公司一旭兴六号私募证券投资基金	500,000.00	0.78%
4	芮增璞	483,981.00	0.76%
5	陈江涛	399,785.00	0.62%
6	王迅	350,000.00	0.55%
7	王伟邦	342,464.00	0.53%
8	吉林敖东延边药业股份有限公司	272,574.00	0.43%
9	孙歌娅	215,351.00	0.34%
10	甘伟清	144,470.00	0.23%
11	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	50,594,409.00	78.93%

### 8.2.3 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%

### 8.2.4 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

### 9.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2023年6月12日-2023年6月30日）

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
本报告期基金总申购份额	330,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	43,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	350,598,847.00

### 9.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2023年1月1日-2023年6月11日）

单位：份

本报告期期初基金份额总额	64,098,847.00
本报告期基金总申购份额	67,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	67,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	64,098,847.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本基金管理人于 2023 年 4 月 11 日起至 2023 年 5 月 22 日止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2023 年 5 月 23 日审议并通过了《关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》。

### 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

本报告期内，本基金管理人、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，本基金由广发中小企业 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，并相应调整了投资策略（含股票（含存托凭证）投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略等）。详情可见本基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于以通讯方式召开广发中小企业 300 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》《关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告》及本基金最新法律文件。

### 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在开展基金托管业务过程中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 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

（报告期：2023年6月12日-2023年6月30日）

### 10.7.1.1 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	
国盛证券	1	233,895,253.36	98.81%	171,052.51	98.81%	-
华创证券	2	2,807,411.50	1.19%	2,053.09	1.19%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
金元证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	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。

### 10.7.1.2 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
------	------	--------	------

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

	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
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
五矿证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
金元证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证 券	-	-	-	-	-	-
广发证券	32,300.00	100.00 %	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-

### 10.7.2 广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金

(报告期: 2023年1月1日-2023年6月11日)

#### 10.7.2.1 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	183,453,871.27	98.12%	134,167.43	98.13%	-
金元证券	1	3,505,549.40	1.88%	2,563.59	1.87%	-
五矿证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中航证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-

华西证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
东方证券	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。

#### 10.7.2.2 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	31,268.06	54.50%	-	-	-	-
广发证券	26,100.00	45.50%	-	-	-	-

#### 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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年 第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	关于增加中金公司为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-09

广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
(原广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型)2023 年中期报告

3	关于增加中信建投证券为广发中小企业 300 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	2023-03-14
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
5	关于以通讯方式召开广发中小企业 300 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	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-10
6	关于以通讯方式召开广发中小企业 300 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	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-11
7	关于增加东海证券为广发中小企业 300 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	2023-04-12
8	关于以通讯方式召开广发中小企业 300 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	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-12
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
10	关于增加中金财富证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-17
11	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-23
12	关于广发中小企业 300 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	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
13	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金暂停申购业务的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-24
14	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-31
15	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第一次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-05
16	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的第二次提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-07
17	关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金停牌及暂停办理赎回的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-08
18	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	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-12
19	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的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-21
20	关于广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资	中国证监会规定报	2023-06-26

	资基金流动性服务商的公告	刊及网站	
21	关于增加浙商证券为广发国证 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	2023-06-28
22	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的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-28
23	关于增加招商证券为广发国证 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	2023-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

#### 11.1.1 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	20230612-20230625	50,594,409.00	1,269,300.00	1,650,000.00	50,213,709.00	14.32%

#### 产品特有风险

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：

- 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；
- 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；
- 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；
- 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；
- 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。

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。

### 11.2 广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金



### 11.2.1 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
广发中小企业300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	20230101-20230611	52,884,509.00	54,000,000.00	56,290,100.00	50,594,409.00	78.93%
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>							

### 11.3影响投资者决策的其他重要信息

本基金管理人于 2023 年 4 月 11 日起至 2023 年 5 月 22 日止以通讯方式召开了本基金的基金份额持有人大会，于 2023 年 5 月 23 日审议并通过了《关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金转型有关事项的议案》，基金份额持有人大会同意对本基金实施转型。自 2023 年 6 月 12 日起，本基金基金名称已由“广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金”更名为“广发国证 2000 交易型开放式指数证券投资基金”，场内简称由“中小 300ETF”变更为“2000ETF”，基金代码不变，《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，同日《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。详情可见本基金管理人网

站 (www.gffunds.com.cn) 刊登的《关于以通讯方式召开广发中小企业 300 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》《关于广发中小企业 300 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》《关于广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金实施转型的公告》《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》。

## 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](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日