

# 广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

## 2024 年中期报告

### 2024 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：二〇二四年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>14</b>
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>33</b>
7.1 期末基金资产组合情况	33
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	34
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	35
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	57
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	58

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	58
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	59
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	59
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	59
<b>10 重大事件揭示</b> .....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
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.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	63
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	64
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
<b>12 备查文件目录</b> .....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	65

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证 2000ETF
场内简称	2000 基金
基金主代码	560220
交易代码	560220
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023 年 9 月 8 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	45,717,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2023-09-18

注：本基金的扩位证券简称为“中证 2000ETF 广发”。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金可采取抽样复制法或完全复制法。如采取抽样复制法，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。如采取完全复制法，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、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、金融衍生品投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 2000 指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，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，采用抽样复制法或完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	项军	张姗
	联系电话	020-83936666	400-61-95555
	电子邮箱	xiangj@gffunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95105828	400-61-95555
传真		020-34281105	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		510308	518040
法定代表人		葛长伟	缪建民

## 2.4 信息披露方式

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

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-5,033,754.09
本期利润	-6,234,873.12
加权平均基金份额本期利润	-0.1172
本期加权平均净值利润率	-13.06%
本期基金份额净值增长率	-18.61%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-7,898,733.20
期末可供分配基金份额利润	-0.1728
期末基金资产净值	37,818,266.80
期末基金份额净值	0.8272
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-17.28%

注：（1）所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（2）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

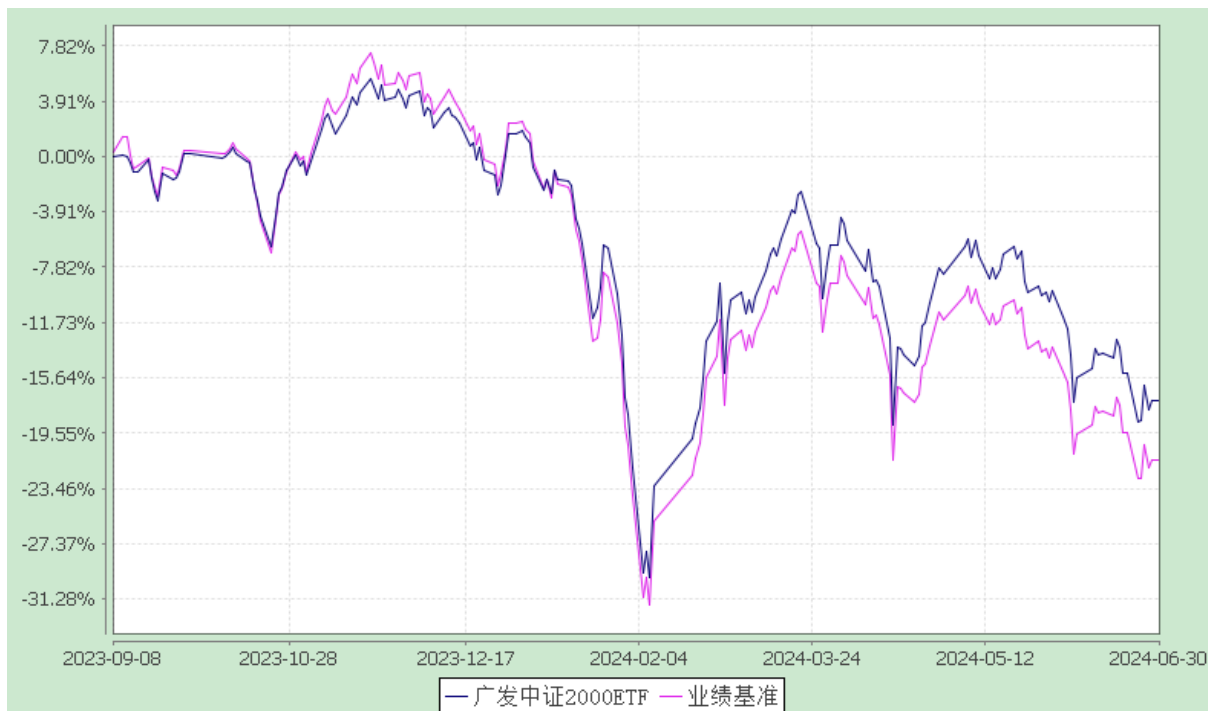
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-8.60%	1.85%	-9.15%	1.85%	0.55%	0.00%
过去三个月	-11.74%	2.03%	-13.75%	2.01%	2.01%	0.02%
过去六个月	-18.61%	2.51%	-23.28%	2.50%	4.67%	0.01%
自基金合同生效起至今	-17.28%	2.05%	-21.44%	2.06%	4.16%	-0.01%

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

广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 （2023 年 9 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日）



注：（1）本基金合同生效日期为 2023 年 9 月 8 日，至披露时点未满一年。

（2）本基金建仓期为基金合同生效后 6 个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合本基金合同有关规定。

## 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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		
夏浩洋	本基金的基金经理；广发中	2023-09-08	-	6.9 年	夏浩洋先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广



	<p>证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证海外中国互联网 30 交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理；广发中证光伏龙头 30 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证环保产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证通信交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证通信交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资</p>				<p>发基金管理有限公司指数投资部研究员、投资经理、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、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基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 2 月 22 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2021 年 5 月 20 日至 2023 年 12 月 13 日)、广发中证科创创业 50 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2022 年 12 月 28 日至 2024 年 2 月 22 日)。</p>
--	---	--	--	--	---

	基金发起式联接基金的基金经理；广发中证港股通互联网指数型发起式证券投资基金的基金经理				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

2.证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 14 次，其中 13 次为指数量化投资组合因投资

策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 1 次为不同投资经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年，国内经济运行稳健。1 季度，宏观组合政策靠前发力，经济运行持续恢复，加上春节假期的有力带动，国民经济稳中有升。进入 2 季度，国内经济整体延续了 1 季度以来的回升向好态势，新旧动能加速切换。

海外方面，美联储并未在上半年开展降息操作，3 月会议释放中性信号，进入 2 季度后美联储关于降息的论述依然反复不定，鹰派和鸽派相互交织。

A 股市场方面，上半年市场整体保持震荡，主要宽基指数涨跌不一，其中，上证指数下跌 0.25%，深证成指下跌 7.10%，沪深 300 指数上涨 0.89%，中证 500 指数下跌 8.96%，中证 1000 指数下跌 16.84%，中证 2000 指数下跌 23.28%，创业板指数下跌 10.99%，科创板 50 指数下跌 16.42%。

行业方面，相对强势的行业主要有银行、煤炭、公用事业等，银行指数（申万一级）上涨 17.02%，煤炭指数（申万一级）上涨 11.96%，公用事业指数（申万一级）上涨 11.76%；而综合、计算机、商贸零售（申万一级）行业表现较差，分别下跌 33.34%、24.88%、24.59%。

报告期内，本基金主要采取抽样复制法或完全复制法跟踪指数，本基金遵循指数化投资理念，在有效分散风险的基础上以较低的成本获得标的指数所代表的证券市场的平均收益率，为投资者提供一个跟踪标的指数的投资工具。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。

报告期内，中证 2000 指数下跌 23.28%。截至 2024 年 6 月 28 日，中证 2000 指数成份股平均市值 36 亿，成份股整体具有典型的微盘股特征。此外，中证 2000 指数前 5 大、前 10 大、前 50 大成份股权重合计分别为 1.19%、2.07%、7.55%，权重非常分散，有利于分散风险。

值得注意的是，上半年微盘股曾出现一定的流动性危机，短时间内急跌，而后随着市场回稳迅速拉升，这表明微盘股具有显著的高弹性、资金高敏感性等特点。投资者在投资微盘股时，需要充分关注其波动性较大的特点，结合自身风险偏好，采取合适的投资策略。

中证 2000 指数选取市值规模较小且流动性较好的 2000 只证券作为指数样本。中证 2000、沪深 300、中证 500 和中证 1000 指数共同构成中证规模指数系列，反映不同市值规模上市公司证券的整体表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为-18.61%，同期业绩比较基准收益率为-23.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，当前市场预计美联储大概率在 9 月降息，但过程或许仍有拉锯。加拿大和欧洲央行在 2 季度率先降息，预计后续或有更多的国家跟进，这将在一定程度上对美联储降息形成刺激作用。在美联储大概率降息成为市场一致预期的背景下，国内经济运行情况或将成为影响 A 股涨跌的最重要因素。我们认为在当前外需旺盛带动国内出口高增、内需待政策持续发力的情况下，投资者对于国内经济增长和高质量发展可以再多一些信心。考虑到全年 GDP 增长目标仍然保持在 5% 的水平，下半年货币和财政政策或将更加积极。同时，下半年全球市场或将受美国大选、海外地缘冲突等诸多不确定因素影响而波动放大，投资者需注意相关风险。

就投资风格而言，大小盘方面，受益于新“国九条”政策的利好，大盘股或因在市值管理、股东回报等方面具备优势而受到市场欢迎。而小盘则将在经济反弹阶段表现相对强势。成长价值方面，红利类资产或因市场缺乏主线而出现聚集效应，价值风格中顺周期板块或将在下半年受益于经济刺激政策的出台。而成长板块或将受益于美联储降息带来的估值提升机会，其中部分行业还将受益于自身产业周期向上带来的业绩提升机会，从而形成戴维斯双击。投资者可以通过哑铃式的配置策略来应对市场波动。

#### 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

本报告期内，本基金于 2024 年 5 月 8 日至 2024 年 6 月 30 日出现了基金资产净值低于五千万元的情形。基金管理人已发布基金资产净值低于 5000 万元人民币的提示性公告。

### 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

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

#### 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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 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

本年度中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

## 6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	829,267.66	1,775,676.50
结算备付金		11,630.09	239,233.97
存出保证金		33,141.61	135,157.40
交易性金融资产	6.4.7.2	37,012,711.04	47,568,044.24
其中：股票投资		37,012,711.04	47,568,044.24
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.12	-
资产总计		37,962,159.52	49,718,112.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		70.94	-
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		16,913.33	18,048.93
应付托管费		3,382.68	3,609.78
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	123,525.77	178,082.92
负债合计		143,892.72	199,741.63
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	45,717,000.00	48,717,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-7,898,733.20	801,370.48
净资产合计		37,818,266.80	49,518,370.48
负债和净资产总计		37,962,159.52	49,718,112.11

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.8272 元，基金份额总额 45,717,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期
		2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-5,970,944.93</b>
1.利息收入		5,807.70
其中：存款利息收入	6.4.7.10	5,807.70
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-4,689,841.63
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-5,056,641.42
基金投资收益	6.4.7.12	-
债券投资收益	6.4.7.13	86.10
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-
股利收益	6.4.7.17	366,713.69
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-

其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	-1,201,119.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	-85,791.97
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>263,928.19</b>
1. 管理人报酬		121,093.24
2. 托管费		24,218.65
3. 销售服务费		-
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.21	118,616.30
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-6,234,873.12</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-6,234,873.12</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>-6,234,873.12</b>

### 6.3 净资产变动表

会计主体：广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	48,717,000.00	801,370.48	49,518,370.48
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产	48,717,000.00	801,370.48	49,518,370.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-3,000,000.00	-8,700,103.68	-11,700,103.68
（一）、综合收益总额	-	-6,234,873.12	-6,234,873.12
（二）、本期基金	-3,000,000.00	-2,465,230.56	-5,465,230.56



份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	75,000,000.00	-13,837,959.38	61,162,040.62
2. 基金赎回款	-78,000,000.00	11,372,728.82	-66,627,271.18
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	45,717,000.00	-7,898,733.20	37,818,266.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：葛长伟，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发中证 2000 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[2023]1938 号《关于准予广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2023 年 9 月 1 日向社会公开发行募集并于 2023 年 9 月 8 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2023 年 9 月 1 日至 2023 年 9 月 5 日，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 312,717,000.00 元，有效认购户数为 6,272 户。其中，网上现金认购资金在募集期间的利息为人民币 36,896.94 元，按照基金合同的有关约定计入基金财产，不折算为投资者基金份额；募集期间无网下现金认购。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计

准则”)编制,同时,在信息披露和估值方面,也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金于 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及 2024 年上半年度的经营成果和净资产变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

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

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

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

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

#### （5）境外投资

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

### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

#### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	829,267.66
等于：本金	829,143.38
加：应计利息	124.28
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	829,267.66

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	38,860,445.04	-	37,012,711.04	-1,847,734.00

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		38,860,445.04	-	37,012,711.04	-1,847,734.00

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

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

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日
----	-------------------

应付券商交易单元保证金	
应付赎回费	
应付证券出借违约金	
应付交易费用	72,499.15
其中：交易所市场	72,499.15
银行间市场	
应付利息	
预提费用	48,268.62
可退替代款	2,758.00
合计	123,525.77

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	48,717,000.00	48,717,000.00
本期申购	75,000,000.00	75,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-78,000,000.00	-78,000,000.00
本期末	45,717,000.00	45,717,000.00

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,987,780.32	-1,186,409.84	801,370.48
本期期初	1,987,780.32	-1,186,409.84	801,370.48
本期利润	-5,033,754.09	-1,201,119.03	-6,234,873.12
本期基金份额交易产生的变动数	657,779.88	-3,123,010.44	-2,465,230.56
其中：基金申购款	-4,908,642.47	-8,929,316.91	-13,837,959.38
基金赎回款	5,566,422.35	5,806,306.47	11,372,728.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,388,193.89	-5,510,539.31	-7,898,733.20

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,629.69
其他	772.69
合计	5,807.70

### 6.4.7.11 股票投资收益

#### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,855,689.77
股票投资收益——赎回差价收入	-200,951.65
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-5,056,641.42

#### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	116,155,051.05
减：卖出股票成本总额	120,766,525.21
减：交易费用	244,215.61
买卖股票差价收入	-4,855,689.77

#### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	66,627,271.18
减：现金支付赎回款总额	50,695,701.18
减：赎回股票成本总额	16,132,521.65
减：交易费用	-
赎回差价收入	-200,951.65

### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

### 6.4.7.13 债券投资收益

#### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	0.38
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	85.72
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	86.10

#### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,586.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,500.00
减：应计利息总额	0.38
减：交易费用	0.10
买卖债券差价收入	85.72

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

##### 6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	366,713.69
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	366,713.69

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1.交易性金融资产	-1,201,119.03
——股票投资	-1,201,119.03



——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-1,201,119.03

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-85,791.97
合计	-85,791.97

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

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
审计费用	7,707.70
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
银行汇划费	1,510.22
其他	84,535.36
合计	118,616.30

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
招商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、基金销售机构

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的股票交易。

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日	
	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	2,500.00	49.15%

**6.4.10.1.4 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。

**6.4.10.2 关联方报酬**

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	121,093.24
其中：应支付销售机构的客户维护费	22,931.11
应支付基金管理人的净管理费	98,162.13

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	24,218.65

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，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在次月前 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

份额单位：份

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
报告期初持有的基金份额	28,918,200.00
报告期间申购/买入总份额	-
报告期间因拆分变动份额	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-

报告期末持有的基金份额	28,918,200.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	63.25%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及相关法律文件有关规定支付。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本报告期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方未投资本基金。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2024年1月1日至2024年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	829,267.66	3,405.32

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

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

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002308	*ST 威创	2024-05-06	重大事项停牌	1.97	2024-07-09	1.87	11,500.00	35,964.00	22,655.00	-

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

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

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险指因市场交易不活跃，基金资产无法以适当价格及时变现的风险或基金无法应付基金赎回支付的要求所引起的风险。本基金坚持组合持有、分散投资的原则，基金管理人根据市场运

行情况和基金运行情况制订本基金的风险控制目标和方法，具体计算与分析各类风险控制指标，从而对流动性风险进行监控和防范。

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

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

基金的市场风险是指由于证券市场价格受到经济因素、政治因素、投资心理等各种因素的影响，导致基金收益水平变化而产生的风险，反映了基金资产中金融工具或证券价值对市场参数变化的敏感性。一般来讲，市场风险是开放式基金面临的重大风险，也往往是众多风险中最基本和最常见的，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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	829,267.66	-	-	-	829,267.66
结算备付金	11,630.09	-	-	-	11,630.09
存出保证金	33,141.61	-	-	-	33,141.61
交易性金融资产	-	-	-	37,012,711.04	37,012,711.04
其他资产	-	-	-	75,409.12	75,409.12

资产总计	874,039.36	-	-	37,088,120.16	37,962,159.52
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	70.94	70.94
应付管理人报酬	-	-	-	16,913.33	16,913.33
应付托管费	-	-	-	3,382.68	3,382.68
其他负债	-	-	-	123,525.77	123,525.77
负债总计	-	-	-	143,892.72	143,892.72
利率敏感度缺口	874,039.36	-	-	36,944,227.44	37,818,266.80
<b>上年度末</b>					
<b>2023 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>					
货币资金	1,775,676.50	-	-	-	1,775,676.50
结算备付金	239,233.97	-	-	-	239,233.97
存出保证金	135,157.40	-	-	-	135,157.40
交易性金融资产	-	-	-	47,568,044.24	47,568,044.24
资产总计	2,150,067.87	-	-	47,568,044.24	49,718,112.11
<b>负债</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	18,048.93	18,048.93
应付托管费	-	-	-	3,609.78	3,609.78
其他负债	-	-	-	178,082.92	178,082.92
负债总计	-	-	-	199,741.63	199,741.63
利率敏感度缺口	2,150,067.87	-	-	47,368,302.61	49,518,370.48

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值

变动均直接反映在当期损益中。本基金管理人通过采用 Barra 风险管理系统，以及标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	37,012,711.04	97.87	47,568,044.24	96.06
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	37,012,711.04	97.87	47,568,044.24	96.06

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	上升 5%	1,871,580.25	2,281,538.56
	下降 5%	-1,871,580.25	-2,281,538.56

### 6.4.14 公允价值

#### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。



### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日
第一层次	36,990,056.04
第二层次	22,655.00
第三层次	-
合计	37,012,711.04

#### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	37,012,711.04	97.50
	其中：普通股	37,012,711.04	97.50
	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	840,897.75	2.22
8	其他各项资产	108,550.73	0.29
9	合计	37,962,159.52	100.00

注：上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	305,382.00	0.81
B	采矿业	308,290.00	0.82
C	制造业	25,084,719.96	66.33
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	878,707.00	2.32
E	建筑业	781,717.00	2.07
F	批发和零售业	1,527,652.20	4.04
G	交通运输、仓储和邮政业	425,313.90	1.12
H	住宿和餐饮业	159,750.00	0.42
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,307,846.94	8.75
J	金融业	123,857.00	0.33
K	房地产业	959,700.00	2.54
L	租赁和商务服务业	754,987.70	2.00
M	科学研究和技术服务业	722,219.34	1.91
N	水利、环境和公共设施管理业	742,826.00	1.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	315,234.00	0.83

Q	卫生和社会工作	76,014.00	0.20
R	文化、体育和娱乐业	452,868.00	1.20
S	综合	85,626.00	0.23
	合计	37,012,711.04	97.87

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300664	鹏鹞环保	46,900	208,705.00	0.55
2	002161	远望谷	42,000	194,040.00	0.51
3	600736	苏州高新	45,000	187,200.00	0.49
4	300048	合康新能	40,400	187,052.00	0.49
5	300145	中金环境	72,800	182,000.00	0.48
6	002519	银河电子	35,700	175,287.00	0.46
7	300194	福安药业	42,300	158,202.00	0.42
8	002707	众信旅游	27,300	156,702.00	0.41
9	000897	津滨发展	72,200	148,010.00	0.39
10	000589	贵州轮胎	28,600	145,002.00	0.38
11	002277	友阿股份	65,600	141,696.00	0.37
12	002062	宏润建设	39,900	138,852.00	0.37
13	301096	百诚医药	2,300	133,584.00	0.35
14	600180	瑞茂通	34,800	132,588.00	0.35
15	600284	浦东建设	24,800	132,432.00	0.35
16	600351	亚宝药业	23,600	132,396.00	0.35
17	000576	甘化科工	22,000	132,000.00	0.35
18	002536	飞龙股份	13,700	130,424.00	0.34
19	300110	华仁药业	42,200	130,398.00	0.34
20	000551	创元科技	14,800	129,204.00	0.34
21	300569	天能重工	31,000	128,960.00	0.34
22	002662	京威股份	42,400	128,896.00	0.34
23	000612	焦作万方	19,800	128,700.00	0.34
24	000926	福星股份	39,900	126,483.00	0.33
25	300842	帝科股份	3,220	124,936.00	0.33
26	300217	东方电热	32,800	123,656.00	0.33
27	688621	阳光诺和	2,753	117,553.10	0.31
28	000593	德龙汇能	24,800	115,568.00	0.31

29	600133	东湖高新	10,900	113,796.00	0.30
30	300174	元力股份	8,300	113,295.00	0.30
31	000797	中国武夷	47,900	111,607.00	0.30
32	300278	华昌达	38,800	111,356.00	0.29
33	300184	力源信息	24,000	111,120.00	0.29
34	300840	酷特智能	12,000	111,000.00	0.29
35	002398	垒知集团	29,500	109,740.00	0.29
36	603275	众辰科技	3,600	108,000.00	0.29
37	600609	金杯汽车	31,100	107,917.00	0.29
38	603867	新化股份	4,600	107,318.00	0.28
39	000680	山推股份	11,500	106,605.00	0.28
40	300872	天阳科技	8,000	106,000.00	0.28
41	000523	红棉股份	40,600	105,154.00	0.28
42	002540	亚太科技	19,400	102,626.00	0.27
43	601020	华钰矿业	8,000	102,400.00	0.27
44	300011	鼎汉技术	20,500	102,295.00	0.27
45	300138	晨光生物	12,100	102,003.00	0.27
46	688766	普冉股份	1,046	101,639.82	0.27
47	300790	宇瞳光学	7,500	101,250.00	0.27
48	300181	佐力药业	6,600	99,792.00	0.26
49	300173	福能东方	26,400	99,528.00	0.26
50	600590	泰豪科技	25,900	98,679.00	0.26
51	300490	华自科技	13,700	98,092.00	0.26
52	301149	隆华新材	10,600	97,944.00	0.26
53	002420	毅昌科技	21,400	97,584.00	0.26
54	002521	齐峰新材	8,300	97,525.00	0.26
55	300094	国联水产	38,000	96,520.00	0.26
56	000707	双环科技	14,100	96,444.00	0.26
57	600226	亨通股份	48,900	96,333.00	0.25
58	301203	国泰环保	3,400	96,254.00	0.25
59	002392	北京利尔	30,500	96,075.00	0.25
60	000501	武商集团	14,400	96,048.00	0.25
61	600359	新农开发	17,100	95,589.00	0.25
62	300453	三鑫医疗	14,700	93,933.00	0.25
63	002303	美盈森	38,600	93,026.00	0.25
64	000526	学大教育	1,500	92,400.00	0.24
65	600846	同济科技	13,500	92,205.00	0.24
66	002937	兴瑞科技	3,900	90,909.00	0.24
67	002045	国光电器	6,600	89,958.00	0.24
68	300396	迪瑞医疗	4,400	89,364.00	0.24
69	002659	凯文教育	27,300	89,271.00	0.24
70	301061	匠心家居	1,900	89,224.00	0.24
71	002106	莱宝高科	8,100	88,290.00	0.23
72	300227	光韵达	16,100	88,067.00	0.23

73	603496	恒为科技	3,600	88,020.00	0.23
74	600186	莲花控股	25,600	87,808.00	0.23
75	002580	圣阳股份	14,200	87,330.00	0.23
76	000521	长虹美菱	11,500	87,170.00	0.23
77	301101	明月镜片	3,900	87,126.00	0.23
78	300005	探路者	17,200	86,172.00	0.23
79	300532	今天国际	7,000	86,030.00	0.23
80	603031	安孚科技	3,800	85,804.00	0.23
81	000532	华金资本	7,100	85,626.00	0.23
82	688486	龙迅股份	1,488	85,262.40	0.23
83	000548	湖南投资	21,000	84,420.00	0.22
84	003000	劲仔食品	7,000	84,350.00	0.22
85	603359	东珠生态	23,000	83,490.00	0.22
86	300360	炬华科技	4,900	83,300.00	0.22
87	002381	双箭股份	12,400	83,204.00	0.22
88	000533	顺钠股份	25,200	82,908.00	0.22
89	301030	仕净科技	3,360	82,723.20	0.22
90	300307	慈星股份	13,900	82,705.00	0.22
91	600354	敦煌种业	17,100	81,567.00	0.22
92	603708	家家悦	10,000	81,100.00	0.21
93	300056	中创环保	10,200	81,090.00	0.21
94	002947	恒铭达	2,300	80,960.00	0.21
95	603859	能科科技	3,844	80,800.88	0.21
96	002642	荣联科技	15,500	79,980.00	0.21
97	601500	通用股份	14,800	79,032.00	0.21
98	300879	大叶股份	5,900	78,942.00	0.21
99	300193	佳士科技	10,600	78,652.00	0.21
100	688159	有方科技	2,077	78,635.22	0.21
101	000936	华西股份	13,700	78,364.00	0.21
102	002296	辉煌科技	7,600	78,356.00	0.21
103	600858	银座股份	19,900	78,207.00	0.21
104	300435	中泰股份	6,600	77,682.00	0.21
105	002766	索菱股份	16,000	77,440.00	0.20
106	603617	君禾股份	13,100	77,290.00	0.20
107	301382	蜂助手	4,260	77,063.40	0.20
108	002922	伊戈尔	3,500	76,510.00	0.20
109	300239	东宝生物	16,200	76,302.00	0.20
110	000700	模塑科技	14,500	76,125.00	0.20
111	300131	英唐智控	17,100	76,095.00	0.20
112	688148	芳源股份	18,058	76,024.18	0.20
113	002172	澳洋健康	30,900	76,014.00	0.20
114	600114	东睦股份	5,263	75,734.57	0.20
115	603399	永杉锂业	12,200	75,518.00	0.20
116	000815	美利云	10,500	75,495.00	0.20

117	000541	佛山照明	15,500	75,485.00	0.20
118	003019	宸展光电	2,970	75,230.10	0.20
119	000892	欢瑞世纪	30,000	75,000.00	0.20
120	002763	汇洁股份	11,300	74,919.00	0.20
121	688601	力芯微	1,714	74,884.66	0.20
122	002334	英威腾	12,400	74,152.00	0.20
123	300081	恒信东方	16,700	73,814.00	0.20
124	300280	紫天科技	4,800	73,152.00	0.19
125	300304	云意电气	11,200	72,912.00	0.19
126	300710	万隆光电	4,800	72,816.00	0.19
127	002515	金字火腿	19,200	72,768.00	0.19
128	003038	鑫铂股份	4,900	72,373.00	0.19
129	688590	新致软件	5,609	72,356.10	0.19
130	000505	京粮控股	13,300	72,352.00	0.19
131	002286	保龄宝	13,000	71,630.00	0.19
132	300007	汉威科技	5,200	71,344.00	0.19
133	002073	软控股份	9,600	70,944.00	0.19
134	603738	泰晶科技	5,200	70,928.00	0.19
135	300631	久吾高科	3,700	70,855.00	0.19
136	000670	盈方微	16,200	70,794.00	0.19
137	300862	蓝盾光电	3,100	70,556.00	0.19
138	605108	同庆楼	3,300	70,488.00	0.19
139	002686	亿利达	16,800	70,392.00	0.19
140	300548	博创科技	3,600	70,164.00	0.19
141	301111	粤万年青	5,000	69,750.00	0.18
142	000078	海王生物	32,900	69,748.00	0.18
143	300441	鲍斯股份	11,700	69,381.00	0.18
144	000570	苏常柴 A	15,500	69,285.00	0.18
145	002849	威星智能	6,200	69,192.00	0.18
146	002639	雪人股份	13,800	69,138.00	0.18
147	300165	天瑞仪器	32,500	68,900.00	0.18
148	002668	TCL 智家	7,600	68,856.00	0.18
149	688313	仕佳光子	7,230	68,829.60	0.18
150	600251	冠农股份	9,400	68,056.00	0.18
151	300337	银邦股份	8,400	68,040.00	0.18
152	001205	盛航股份	4,200	67,872.00	0.18
153	300328	宜安科技	15,800	67,624.00	0.18
154	300559	佳发教育	7,000	66,990.00	0.18
155	002565	顺灏股份	28,000	66,920.00	0.18
156	002559	亚威股份	8,700	66,642.00	0.18
157	002031	巨轮智能	29,300	66,511.00	0.18
158	603223	恒通股份	10,200	66,504.00	0.18
159	002298	中电兴发	15,000	66,300.00	0.18
160	603322	超讯通信	2,500	66,275.00	0.18

161	300740	水羊股份	4,500	66,060.00	0.17
162	300331	苏大维格	4,100	65,928.00	0.17
163	002026	山东威达	7,900	65,570.00	0.17
164	002935	天奥电子	5,400	65,232.00	0.17
165	002367	康力电梯	11,300	65,201.00	0.17
166	002876	三利谱	2,700	65,124.00	0.17
167	600510	黑牡丹	17,500	65,100.00	0.17
168	002786	银宝山新	8,100	64,962.00	0.17
169	000509	华塑控股	25,200	64,764.00	0.17
170	002667	威领股份	13,700	64,527.00	0.17
171	605305	中际联合	2,500	64,475.00	0.17
172	300250	初灵信息	5,900	64,310.00	0.17
173	002654	万润科技	5,900	64,015.00	0.17
174	002833	弘亚数控	3,500	63,840.00	0.17
175	002919	名臣健康	5,480	63,622.80	0.17
176	002094	青岛金王	35,500	63,545.00	0.17
177	603619	中曼石油	2,700	63,234.00	0.17
178	300426	唐德影视	9,300	63,054.00	0.17
179	300560	中富通	5,800	62,756.00	0.17
179	300286	安科瑞	2,900	62,756.00	0.17
180	002379	宏创控股	10,700	62,702.00	0.17
181	600053	九鼎投资	4,500	62,415.00	0.17
182	688150	莱特光电	3,213	62,332.20	0.16
183	301062	上海艾录	6,100	62,281.00	0.16
184	300228	富瑞特装	11,400	62,244.00	0.16
185	300354	东华测试	2,000	62,140.00	0.16
186	688550	瑞联新材	2,669	61,894.11	0.16
187	002419	天虹股份	14,800	61,864.00	0.16
187	002122	汇洲智能	29,600	61,864.00	0.16
188	000822	山东海化	10,600	61,798.00	0.16
189	002570	贝因美	26,400	61,776.00	0.16
190	301011	华立科技	4,000	61,640.00	0.16
191	300318	博晖创新	12,600	61,488.00	0.16
192	002510	天汽模	15,600	60,684.00	0.16
193	002520	日发精机	16,000	60,640.00	0.16
194	002406	远东传动	12,300	60,639.00	0.16
195	002729	好利科技	6,500	60,320.00	0.16
196	300434	金石亚药	8,000	60,000.00	0.16
197	000973	佛塑科技	16,200	59,778.00	0.16
198	002401	中远海科	4,000	59,760.00	0.16
199	600105	永鼎股份	16,000	59,520.00	0.16
200	603987	康德莱	9,600	58,656.00	0.16
201	300494	盛天网络	5,800	58,290.00	0.15
202	300578	会畅通讯	3,900	57,720.00	0.15

203	600249	两面针	15,700	57,619.00	0.15
204	300708	聚灿光电	6,400	57,600.00	0.15
205	300047	天源迪科	8,800	57,552.00	0.15
206	002997	瑞鹄模具	1,800	57,546.00	0.15
207	002881	美格智能	2,900	57,536.00	0.15
208	300291	百纳千成	13,500	57,510.00	0.15
209	605368	蓝天燃气	4,200	57,288.00	0.15
210	002858	力盛体育	5,500	57,200.00	0.15
211	300806	斯迪克	5,100	57,120.00	0.15
212	002476	宝莫股份	15,500	56,885.00	0.15
213	002897	意华股份	1,500	56,490.00	0.15
214	002029	七匹狼	11,200	56,448.00	0.15
215	301263	泰恩康	4,500	56,385.00	0.15
216	601065	江盐集团	6,500	56,355.00	0.15
217	002224	三力士	14,600	56,210.00	0.15
218	300985	致远新能	3,500	56,070.00	0.15
219	301391	卡莱特	1,280	56,038.40	0.15
220	002552	宝鼎科技	4,300	55,986.00	0.15
221	002300	太阳电缆	10,600	55,968.00	0.15
222	002462	嘉事堂	5,100	55,794.00	0.15
223	300833	浩洋股份	1,200	55,680.00	0.15
224	300997	欢乐家	4,700	55,554.00	0.15
225	688143	长盈通	2,582	55,306.44	0.15
226	300969	恒帅股份	800	55,304.00	0.15
227	300350	华鹏飞	11,700	55,224.00	0.15
227	603165	荣晟环保	5,200	55,224.00	0.15
228	300192	科德教育	5,600	54,992.00	0.15
229	002933	新兴装备	2,400	54,984.00	0.15
230	002116	中国海诚	5,900	54,929.00	0.15
231	002630	华西能源	25,900	54,908.00	0.15
232	000922	佳电股份	4,600	54,878.00	0.15
233	301004	嘉益股份	600	54,600.00	0.14
234	688300	联瑞新材	1,134	54,545.40	0.14
235	603611	诺力股份	3,200	54,528.00	0.14
236	002165	红宝丽	16,400	54,120.00	0.14
237	600121	郑州煤电	16,600	54,116.00	0.14
238	600730	中国高科	13,500	53,865.00	0.14
239	688332	中科蓝讯	912	53,798.88	0.14
240	000099	中信海直	3,300	53,592.00	0.14
241	688025	杰普特	1,326	53,557.14	0.14
242	300681	英搏尔	4,100	53,464.00	0.14
243	300351	永贵电器	3,600	53,280.00	0.14
244	300472	新元科技	12,000	53,160.00	0.14
245	300249	依米康	8,200	53,136.00	0.14



246	300231	银信科技	7,200	52,920.00	0.14
247	300424	航新科技	4,300	52,589.00	0.14
248	600300	维维股份	21,900	52,560.00	0.14
249	002611	东方精工	10,000	52,500.00	0.14
250	300326	凯利泰	13,800	52,440.00	0.14
251	603639	海利尔	4,300	52,331.00	0.14
252	603053	成都燃气	5,400	52,164.00	0.14
253	688510	航亚科技	2,830	52,100.30	0.14
254	000677	恒天海龙	18,600	51,894.00	0.14
255	300950	德固特	3,400	51,816.00	0.14
256	002757	南兴股份	4,300	51,815.00	0.14
257	688677	海泰新光	1,318	51,705.14	0.14
258	603629	利通电子	2,800	51,688.00	0.14
259	000949	新乡化纤	15,200	51,680.00	0.14
260	603601	再升科技	18,700	51,612.00	0.14
261	688533	上声电子	1,990	51,481.30	0.14
262	002703	浙江世宝	4,600	51,244.00	0.14
263	300815	玉禾田	4,400	51,216.00	0.14
264	002716	湖南白银	16,400	51,004.00	0.13
265	300499	高澜股份	4,700	50,948.00	0.13
266	300437	清水源	6,300	50,778.00	0.13
267	300511	雪榕生物	19,600	50,764.00	0.13
268	600088	中视传媒	3,100	50,747.00	0.13
269	300796	贝斯美	3,500	50,645.00	0.13
270	603315	福鞍股份	5,300	50,562.00	0.13
271	300042	朗科科技	2,500	50,475.00	0.13
272	002788	鹭燕医药	6,400	50,432.00	0.13
273	300607	拓斯达	3,700	50,394.00	0.13
274	300566	激智科技	3,600	50,364.00	0.13
275	688095	福昕软件	1,099	50,345.19	0.13
276	688253	英诺特	1,318	50,228.98	0.13
277	300606	金太阳	2,700	50,112.00	0.13
278	300926	博俊科技	2,500	50,050.00	0.13
279	002512	达华智能	14,500	50,025.00	0.13
280	688628	优利德	1,526	50,007.02	0.13
281	002730	电光科技	7,100	49,984.00	0.13
282	688205	德科立	1,729	49,812.49	0.13
283	002112	三变科技	5,600	49,728.00	0.13
284	002375	亚厦股份	15,300	49,725.00	0.13
285	300580	贝斯特	3,370	49,539.00	0.13
286	000409	云鼎科技	6,100	49,227.00	0.13
287	000042	中洲控股	12,400	48,980.00	0.13
288	002965	祥鑫科技	1,600	48,912.00	0.13
289	300825	阿尔特	5,000	48,450.00	0.13

290	000899	赣能股份	5,000	48,350.00	0.13
291	601700	风范股份	11,000	48,290.00	0.13
292	002033	丽江股份	5,500	48,180.00	0.13
293	002589	瑞康医药	21,800	47,960.00	0.13
294	300870	欧陆通	1,100	47,718.00	0.13
295	002584	西陇科学	8,400	47,208.00	0.12
296	300900	广联航空	2,520	47,199.60	0.12
297	001331	胜通能源	3,400	47,090.00	0.12
298	002771	真视通	2,900	47,009.00	0.12
299	002852	道道全	6,500	46,800.00	0.12
300	605007	五洲特纸	3,700	46,731.00	0.12
301	603662	柯力传感	2,000	46,680.00	0.12
302	600228	返利科技	9,600	46,656.00	0.12
303	300225	金力泰	9,500	46,645.00	0.12
304	002551	尚荣医疗	20,000	46,600.00	0.12
305	603217	元利科技	3,300	46,530.00	0.12
306	300972	万辰集团	2,200	46,486.00	0.12
307	300160	秀强股份	9,900	46,332.00	0.12
308	002441	众业达	6,100	46,238.00	0.12
309	600629	华建集团	10,600	46,216.00	0.12
310	002731	萃华珠宝	5,500	46,145.00	0.12
311	603138	海量数据	4,400	46,112.00	0.12
312	300353	东土科技	6,300	46,053.00	0.12
313	300032	金龙机电	14,800	46,028.00	0.12
314	300629	新劲刚	2,600	45,916.00	0.12
315	688195	腾景科技	1,873	45,907.23	0.12
316	600973	宝胜股份	12,700	45,847.00	0.12
317	600721	百花医药	7,900	45,820.00	0.12
318	002533	金杯电工	4,600	45,770.00	0.12
319	300893	松原股份	1,600	45,712.00	0.12
320	002523	天桥起重	21,100	45,365.00	0.12
321	001378	德冠新材	1,900	45,334.00	0.12
322	600866	星湖科技	8,200	45,264.00	0.12
323	688236	春立医疗	3,152	44,695.36	0.12
324	603110	东方材料	4,000	44,520.00	0.12
325	300098	高新兴	10,000	44,300.00	0.12
326	300758	七彩化学	4,100	44,075.00	0.12
327	600468	百利电气	10,200	43,962.00	0.12
328	300994	久祺股份	4,000	43,960.00	0.12
329	300258	精锻科技	5,400	43,902.00	0.12
330	300071	福石控股	21,200	43,884.00	0.12
331	002104	恒宝股份	8,300	43,824.00	0.12
331	002543	万和电气	4,400	43,824.00	0.12
332	002133	广宇集团	19,500	43,485.00	0.11

333	002042	华孚时尚	11,400	43,434.00	0.11
334	603590	康辰药业	1,700	43,418.00	0.11
335	688378	奥来德	1,850	43,401.00	0.11
336	601599	浙文影业	14,900	42,912.00	0.11
337	688377	迪威尔	3,269	42,823.90	0.11
338	000955	欣龙控股	14,600	42,778.00	0.11
339	300586	美联新材	6,800	42,772.00	0.11
340	605186	健麾信息	1,900	42,674.00	0.11
341	002527	新时达	7,100	42,529.00	0.11
342	301012	扬电科技	1,700	42,092.00	0.11
343	688359	三孚新科	1,051	42,040.00	0.11
344	300053	航宇微	4,600	41,906.00	0.11
345	301073	君亭酒店	2,300	41,860.00	0.11
346	300729	乐歌股份	2,700	41,823.00	0.11
347	688325	赛微微电	1,332	41,784.84	0.11
348	300404	博济医药	5,200	41,652.00	0.11
348	301013	利和兴	3,900	41,652.00	0.11
349	002360	同德化工	8,200	41,492.00	0.11
350	300465	高伟达	5,700	41,439.00	0.11
351	301218	华是科技	2,000	41,420.00	0.11
352	002358	森源电气	12,100	41,382.00	0.11
353	002451	摩恩电气	7,700	41,349.00	0.11
354	301383	天键股份	1,580	41,269.60	0.11
355	000524	岭南控股	5,100	41,106.00	0.11
356	603689	皖天然气	5,000	41,100.00	0.11
357	603018	华设集团	4,500	40,905.00	0.11
358	603779	威龙股份	4,800	40,800.00	0.11
359	603727	博迈科	3,100	40,796.00	0.11
360	300063	天龙集团	10,700	40,767.00	0.11
361	600229	城市传媒	5,900	40,651.00	0.11
362	300121	阳谷华泰	5,200	40,560.00	0.11
363	605158	华达新材	6,300	40,509.00	0.11
364	002825	纳尔股份	6,500	40,495.00	0.11
365	300709	精研科技	1,600	40,448.00	0.11
366	301507	民生健康	3,200	40,384.00	0.11
367	600613	神奇制药	7,500	40,125.00	0.11
368	002093	国脉科技	6,600	40,062.00	0.11
369	300913	兆龙互连	1,200	39,864.00	0.11
370	600605	汇通能源	1,600	39,808.00	0.11
371	688108	赛诺医疗	4,433	39,631.02	0.10
372	603686	福龙马	5,200	39,624.00	0.10
373	002455	百川股份	4,300	39,474.00	0.10
374	002186	全聚德	4,600	39,422.00	0.10
375	603508	思维列控	2,100	39,375.00	0.10

376	688522	纳睿雷达	839	39,332.32	0.10
377	000965	天保基建	15,000	39,300.00	0.10
378	688292	浩瀚深度	2,539	39,252.94	0.10
379	688103	国力股份	1,129	39,244.04	0.10
380	603990	麦迪科技	4,500	39,195.00	0.10
381	003015	日久光电	4,300	39,044.00	0.10
382	301183	东田微	900	38,934.00	0.10
383	300662	科锐国际	2,400	38,712.00	0.10
384	001223	欧克科技	1,100	38,709.00	0.10
385	300898	熊猫乳品	2,300	38,433.00	0.10
386	600826	兰生股份	7,140	38,413.20	0.10
387	300460	惠伦晶体	4,500	38,385.00	0.10
388	002577	雷柏科技	3,100	38,347.00	0.10
389	600640	国脉文化	3,700	38,295.00	0.10
390	600794	保税科技	12,000	38,040.00	0.10
391	300276	三丰智能	10,800	38,016.00	0.10
392	300941	创识科技	2,100	37,926.00	0.10
393	000788	北大医药	7,600	37,924.00	0.10
394	002345	潮宏基	8,000	37,760.00	0.10
395	002878	元隆雅图	3,000	37,710.00	0.10
396	002708	光洋股份	5,200	37,492.00	0.10
397	600222	太龙药业	8,900	37,380.00	0.10
398	300925	法本信息	3,700	37,333.00	0.10
399	002785	万里石	1,500	37,275.00	0.10
400	002615	哈尔斯	6,000	37,200.00	0.10
401	688678	福立旺	3,431	37,157.73	0.10
402	002319	乐通股份	4,300	37,066.00	0.10
403	603681	永冠新材	2,900	36,975.00	0.10
404	301215	中汽股份	6,300	36,918.00	0.10
405	301368	丰立智能	800	36,864.00	0.10
406	688258	卓易信息	1,097	36,639.80	0.10
407	000518	四环生物	18,500	36,630.00	0.10
408	301297	富乐德	1,800	36,558.00	0.10
409	002177	御银股份	11,300	36,499.00	0.10
410	001207	联科科技	2,500	36,300.00	0.10
411	301058	中粮科工	3,800	35,986.00	0.10
412	300718	长盛轴承	2,600	35,932.00	0.10
413	300592	华凯易佰	3,140	35,890.20	0.09
414	300401	花园生物	2,500	35,850.00	0.09
415	002819	东方中科	1,700	35,836.00	0.09
416	002915	中欣氟材	3,600	35,820.00	0.09
417	300378	鼎捷软件	2,200	35,794.00	0.09
418	002082	万邦德	8,500	35,785.00	0.09
419	603230	内蒙新华	3,100	35,774.00	0.09

420	002685	华东重机	15,200	35,720.00	0.09
421	603396	金辰股份	1,100	35,717.00	0.09
422	300940	南极光	2,800	35,672.00	0.09
423	002590	万安科技	2,700	35,586.00	0.09
424	002578	闽发铝业	13,500	35,505.00	0.09
425	300245	天玑科技	6,600	35,442.00	0.09
426	300505	川金诺	2,900	35,351.00	0.09
427	002469	三维化学	6,200	35,340.00	0.09
428	002843	泰嘉股份	2,300	35,213.00	0.09
429	000920	沃顿科技	4,800	35,184.00	0.09
430	688787	海天瑞声	634	34,793.92	0.09
431	002117	东港股份	4,900	34,692.00	0.09
432	300137	先河环保	8,100	34,506.00	0.09
433	300107	建新股份	3,500	34,475.00	0.09
434	002824	和胜股份	2,700	34,452.00	0.09
435	300975	商络电子	3,800	34,352.00	0.09
436	002103	广博股份	6,900	34,224.00	0.09
437	600658	电子城	10,400	34,216.00	0.09
438	002140	东华科技	4,400	34,100.00	0.09
439	688401	路维光电	1,297	33,981.40	0.09
440	688259	创耀科技	850	33,966.00	0.09
441	002225	濮耐股份	8,300	33,947.00	0.09
442	301322	绿通科技	1,800	33,786.00	0.09
443	300922	天秦装备	2,600	33,774.00	0.09
444	002988	豪美新材	2,200	33,770.00	0.09
445	300617	安靠智电	1,200	33,660.00	0.09
446	000912	泸天化	9,700	33,659.00	0.09
447	600318	新力金融	5,300	33,602.00	0.09
448	301299	卓创资讯	800	33,600.00	0.09
448	300543	朗科智能	4,200	33,600.00	0.09
449	002474	榕基软件	7,700	33,572.00	0.09
450	002438	江苏神通	3,100	33,511.00	0.09
451	603538	美诺华	3,000	33,510.00	0.09
452	603099	长白山	1,500	33,390.00	0.09
453	301168	通灵股份	1,200	33,336.00	0.09
454	605128	上海沿浦	1,192	33,244.88	0.09
455	600212	绿能慧充	5,300	33,072.00	0.09
456	300255	常山药业	3,300	33,066.00	0.09
457	002331	皖通科技	4,500	33,030.00	0.09
458	688551	科威尔	1,046	32,949.00	0.09
459	600789	鲁抗医药	4,700	32,900.00	0.09
460	603189	网达软件	3,000	32,820.00	0.09
461	300547	川环科技	2,000	32,700.00	0.09
462	688311	盟升电子	1,594	32,661.06	0.09

463	002365	永安药业	4,500	32,490.00	0.09
464	002369	卓翼科技	8,800	32,472.00	0.09
465	300809	华辰装备	1,600	32,416.00	0.09
466	688662	富信科技	1,328	32,403.20	0.09
467	002478	常宝股份	6,500	32,370.00	0.09
468	300731	科创新源	2,200	32,208.00	0.09
469	301211	亨迪药业	2,200	32,142.00	0.08
470	002835	同为股份	1,900	32,091.00	0.08
471	002722	物产金轮	2,800	31,640.00	0.08
472	002362	汉王科技	1,900	31,635.00	0.08
473	300172	中电环保	7,000	31,570.00	0.08
474	300381	溢多利	5,100	31,314.00	0.08
475	002235	安妮股份	7,900	31,284.00	0.08
476	300905	宝丽迪	1,100	31,251.00	0.08
477	300148	天舟文化	13,500	31,185.00	0.08
478	603929	亚翔集成	1,300	31,070.00	0.08
479	000558	莱茵体育	14,400	30,816.00	0.08
480	002896	中大力德	1,100	30,690.00	0.08
481	688606	奥泰生物	650	30,634.50	0.08
482	603009	北特科技	1,700	30,481.00	0.08
483	605289	罗曼股份	1,200	30,480.00	0.08
484	300176	派生科技	6,900	30,429.00	0.08
485	301141	中科磁业	940	30,315.00	0.08
486	300945	曼卡龙	3,400	30,294.00	0.08
487	688022	瀚川智能	2,205	30,230.55	0.08
488	603239	浙江仙通	2,200	30,162.00	0.08
489	300480	光力科技	1,900	30,077.00	0.08
490	301213	观想科技	1,100	30,041.00	0.08
491	300139	晓程科技	2,500	29,950.00	0.08
492	600106	重庆路桥	6,900	29,670.00	0.08
493	301261	恒工精密	800	29,656.00	0.08
494	605162	新中港	4,100	29,643.00	0.08
495	000948	南天信息	2,400	29,640.00	0.08
496	688478	晶升股份	1,016	29,585.92	0.08
497	600200	江苏吴中	3,300	29,568.00	0.08
498	603960	克来机电	1,400	29,540.00	0.08
499	301046	能辉科技	1,500	29,505.00	0.08
500	000036	华联控股	9,100	29,484.00	0.08
501	000888	峨眉山 A	2,700	29,403.00	0.08
502	300996	普联软件	2,000	29,340.00	0.08
503	603918	金桥信息	2,800	29,260.00	0.08
504	300302	同有科技	3,200	29,216.00	0.08
505	603258	电魂网络	1,800	29,070.00	0.08
506	301085	亚康股份	700	29,064.00	0.08

507	002575	群兴玩具	6,600	29,040.00	0.08
508	300238	冠昊生物	3,200	28,800.00	0.08
508	002892	科力尔	3,000	28,800.00	0.08
509	300766	每日互动	2,900	28,681.00	0.08
510	300127	银河磁体	1,900	28,595.00	0.08
511	300444	双杰电气	4,500	28,575.00	0.08
512	002479	富春环保	8,100	28,512.00	0.08
513	300653	正海生物	1,400	28,490.00	0.08
514	002864	盘龙药业	1,100	28,468.00	0.08
515	688160	步科股份	710	28,392.90	0.08
516	002787	华源控股	4,200	28,392.00	0.08
517	002364	中恒电气	5,100	28,050.00	0.07
518	301191	菲菱科思	400	27,988.00	0.07
519	003037	三和管桩	4,400	27,984.00	0.07
520	301139	元道通信	1,300	27,963.00	0.07
521	605555	德昌股份	1,500	27,915.00	0.07
522	603035	常熟汽饰	2,200	27,896.00	0.07
523	600982	宁波能源	7,800	27,846.00	0.07
524	600830	香溢融通	4,000	27,840.00	0.07
525	002995	天地在线	2,100	27,720.00	0.07
526	002284	亚太股份	4,100	27,716.00	0.07
527	600237	铜峰电子	5,300	27,666.00	0.07
528	688663	新风光	1,178	27,412.06	0.07
529	301362	民爆光电	800	27,248.00	0.07
530	300571	平治信息	1,300	27,222.00	0.07
531	300545	联得装备	1,100	27,005.00	0.07
532	688371	菲沃泰	2,686	26,967.44	0.07
533	603199	九华旅游	900	26,820.00	0.07
534	301099	雅创电子	600	26,790.00	0.07
535	300639	凯普生物	5,800	26,680.00	0.07
536	688566	吉贝尔	1,184	26,640.00	0.07
537	600628	新世界	4,900	26,558.00	0.07
538	600130	波导股份	8,300	26,477.00	0.07
539	688609	九联科技	2,995	26,415.90	0.07
540	601089	福元医药	1,900	26,315.00	0.07
541	600368	五洲交通	7,370	26,310.90	0.07
542	300779	惠城环保	540	26,136.00	0.07
543	002908	德生科技	3,400	26,078.00	0.07
544	300448	浩云科技	6,200	25,978.00	0.07
545	000779	甘咨询	3,700	25,937.00	0.07
546	688507	索辰科技	527	25,612.20	0.07
547	301318	维海德	930	25,547.10	0.07
548	003013	地铁设计	1,800	25,524.00	0.07
549	300355	蒙草生态	11,600	25,520.00	0.07

550	300880	迦南智能	1,300	25,519.00	0.07
551	300818	耐普矿机	1,000	25,500.00	0.07
552	301393	昊帆生物	600	25,482.00	0.07
553	002829	星网宇达	1,900	25,441.00	0.07
554	688252	天德钰	1,750	25,427.50	0.07
555	300719	安达维尔	1,500	25,425.00	0.07
556	301018	申菱环境	1,300	25,272.00	0.07
557	300400	劲拓股份	2,200	25,168.00	0.07
558	688668	鼎通科技	639	25,106.31	0.07
559	603367	辰欣药业	1,800	25,092.00	0.07
560	688535	华海诚科	364	24,941.28	0.07
561	600052	东望时代	5,800	24,882.00	0.07
562	001299	美能能源	2,100	24,780.00	0.07
563	600661	昂立教育	2,200	24,706.00	0.07
564	301281	科源制药	1,100	24,695.00	0.07
565	000701	厦门信达	6,600	24,684.00	0.07
566	002166	莱茵生物	3,600	24,624.00	0.07
567	300982	苏文电能	1,300	24,518.00	0.06
568	301266	宇邦新材	800	24,512.00	0.06
569	300469	信息发展	1,600	24,480.00	0.06
570	300636	同和药业	2,400	24,408.00	0.06
571	600540	新赛股份	7,100	24,211.00	0.06
571	605167	利柏特	3,100	24,211.00	0.06
572	688698	伟创电气	892	24,057.24	0.06
573	300875	捷强装备	1,300	24,011.00	0.06
574	603330	天洋新材	5,000	23,950.00	0.06
575	000014	沙河股份	2,500	23,925.00	0.06
576	601188	龙江交通	8,100	23,895.00	0.06
577	002664	信质集团	2,000	23,800.00	0.06
578	002845	同兴达	1,800	23,796.00	0.06
579	002380	科远智慧	1,300	23,790.00	0.06
580	300771	智莱科技	2,700	23,733.00	0.06
581	301201	诚达药业	1,300	23,660.00	0.06
582	002560	通达股份	4,300	23,650.00	0.06
583	000962	东方钨业	2,300	23,483.00	0.06
584	603912	佳力图	3,900	23,400.00	0.06
585	003025	思进智能	1,900	23,389.00	0.06
586	002588	史丹利	3,100	23,343.00	0.06
587	603067	振华股份	2,000	23,320.00	0.06
588	002150	通润装备	1,900	23,237.00	0.06
589	301519	舜禹股份	1,400	23,184.00	0.06
590	600035	楚天高速	5,300	22,737.00	0.06
591	002308	*ST 威创	11,500	22,655.00	0.06
592	600860	京城股份	2,800	22,596.00	0.06



593	603998	方盛制药	2,200	22,594.00	0.06
594	300468	四方精创	2,600	22,516.00	0.06
595	002282	博深股份	3,500	22,365.00	0.06
596	301160	翔楼新材	600	22,350.00	0.06
597	603970	中农立华	1,300	22,204.00	0.06
598	002248	华东数控	3,700	22,163.00	0.06
599	301323	新莱福	700	22,106.00	0.06
600	301345	涛涛车业	400	22,040.00	0.06
601	600769	祥龙电业	3,500	22,015.00	0.06
602	002712	思美传媒	6,200	22,010.00	0.06
603	603800	道森股份	1,100	22,000.00	0.06
604	603040	新坐标	1,100	21,923.00	0.06
605	300795	米奥会展	1,250	21,912.50	0.06
606	300649	园林股份	2,100	21,903.00	0.06
607	300349	金卡智能	1,800	21,456.00	0.06
608	002907	华森制药	1,700	21,454.00	0.06
609	688238	和元生物	4,629	21,432.27	0.06
610	002953	日丰股份	2,730	21,403.20	0.06
611	603106	恒银科技	5,000	21,300.00	0.06
612	603901	永创智能	3,000	21,270.00	0.06
613	600152	维科技术	4,400	21,120.00	0.06
614	603703	盛洋科技	2,100	21,063.00	0.06
615	301285	鸿日达	800	20,872.00	0.06
616	300503	昊志机电	1,700	20,757.00	0.05
617	300486	东杰智能	3,600	20,664.00	0.05
618	002329	皇氏集团	7,600	20,596.00	0.05
619	688418	震有科技	1,200	20,556.00	0.05
620	000731	四川美丰	3,100	20,553.00	0.05
621	601579	会稽山	2,000	20,480.00	0.05
622	002886	沃特股份	1,500	20,430.00	0.05
623	300835	龙磁科技	700	20,335.00	0.05
624	301428	世纪恒通	700	20,090.00	0.05
625	603855	华荣股份	900	19,899.00	0.05
626	603569	长久物流	2,900	19,894.00	0.05
627	603329	上海雅仕	1,800	19,836.00	0.05
628	002022	科华生物	3,500	19,775.00	0.05
629	600262	北方股份	1,200	19,716.00	0.05
630	300430	诚益通	1,300	19,604.00	0.05
631	002448	中原内配	3,400	19,516.00	0.05
632	301332	德尔玛	2,200	19,448.00	0.05
633	001339	智微智能	700	19,327.00	0.05
634	300445	康斯特	1,200	19,320.00	0.05
635	000722	湖南发展	2,100	19,299.00	0.05
636	301380	挖金客	600	19,224.00	0.05

637	600738	丽尚国潮	5,200	19,084.00	0.05
638	603516	淳中科技	600	18,942.00	0.05
639	000957	中通客车	1,800	18,936.00	0.05
640	002132	恒星科技	8,900	18,868.00	0.05
641	300375	鹏翎股份	4,800	18,576.00	0.05
642	002115	三维通信	3,800	18,468.00	0.05
643	300380	安硕信息	1,200	18,432.00	0.05
644	603628	清源股份	1,500	18,405.00	0.05
645	002046	国机精工	1,800	18,306.00	0.05
646	603066	音飞储存	2,000	18,260.00	0.05
647	002178	延华智能	5,000	18,150.00	0.05
648	002943	宇晶股份	870	17,982.90	0.05
649	002264	新华都	3,500	17,885.00	0.05
650	601218	吉鑫科技	6,400	17,856.00	0.05
651	002554	惠博普	8,200	17,794.00	0.05
652	603219	富佳股份	1,200	17,712.00	0.05
653	000906	浙商中拓	2,600	17,524.00	0.05
654	002055	得润电子	2,600	17,498.00	0.05
655	688049	炬芯科技	791	17,496.92	0.05
656	605377	华旺科技	1,320	17,490.00	0.05
657	300508	维宏股份	900	17,487.00	0.05
658	603107	上海汽配	1,100	17,479.00	0.05
659	603051	鹿山新材	800	17,464.00	0.05
660	301162	国能日新	400	17,424.00	0.05
661	300788	中信出版	700	17,367.00	0.05
662	300933	中辰股份	2,800	17,220.00	0.05
663	688073	毕得医药	574	17,093.72	0.05
664	605577	龙版传媒	1,100	17,083.00	0.05
665	002481	双塔食品	4,400	17,028.00	0.05
666	002009	天奇股份	1,500	17,010.00	0.04
667	688059	华锐精密	374	16,972.12	0.04
668	300374	中铁装配	1,100	16,808.00	0.04
669	300105	龙源技术	2,600	16,796.00	0.04
670	300290	荣科科技	1,800	16,758.00	0.04
671	688182	灿勤科技	1,257	16,642.68	0.04
672	300335	迪森股份	4,300	16,641.00	0.04
673	000852	石化机械	3,100	16,616.00	0.04
674	300691	联合光电	1,100	16,555.00	0.04
675	301337	亚华电子	600	16,548.00	0.04
676	002395	双象股份	1,100	16,533.00	0.04
677	688222	成都先导	1,455	16,514.25	0.04
678	688356	键凯科技	280	16,458.40	0.04
679	001317	三羊马	700	16,443.00	0.04
680	002090	金智科技	1,900	16,416.00	0.04

681	300247	融捷健康	6,700	16,281.00	0.04
682	603158	腾龙股份	2,300	16,192.00	0.04
683	605218	伟时电子	1,000	16,150.00	0.04
684	605399	晨光新材	1,500	16,125.00	0.04
685	603916	苏博特	2,400	16,104.00	0.04
686	002322	理工能科	1,000	16,020.00	0.04
687	600851	海欣股份	3,500	15,995.00	0.04
688	301128	强瑞技术	400	15,920.00	0.04
689	688071	华依科技	731	15,840.77	0.04
690	002039	黔源电力	900	15,840.00	0.04
691	688496	清越科技	1,702	15,726.48	0.04
692	300264	佳创视讯	4,000	15,720.00	0.04
693	301307	美利信	800	15,664.00	0.04
694	300781	因赛集团	300	15,654.00	0.04
695	301161	唯万密封	1,000	15,530.00	0.04
696	603933	睿能科技	1,200	15,432.00	0.04
697	600818	中路股份	1,100	15,378.00	0.04
698	600630	龙头股份	1,900	15,352.00	0.04
699	603266	天龙股份	900	15,228.00	0.04
700	301439	泓淋电力	1,200	15,204.00	0.04
701	603687	大胜达	2,100	15,036.00	0.04
702	002682	龙洲股份	4,200	14,952.00	0.04
703	300798	锦鸡股份	2,400	14,904.00	0.04
704	300688	创业黑马	600	14,880.00	0.04
705	002083	孚日股份	3,500	14,805.00	0.04
706	688579	山大地纬	1,882	14,773.70	0.04
707	600218	全柴动力	2,200	14,762.00	0.04
708	003027	同兴环保	1,200	14,760.00	0.04
709	301172	君逸数码	500	14,690.00	0.04
710	000421	南京公用	3,300	14,652.00	0.04
711	000777	中核科技	956	14,607.68	0.04
712	301270	汉仪股份	600	14,478.00	0.04
713	000880	潍柴重机	1,800	14,382.00	0.04
714	300522	世名科技	1,300	14,365.00	0.04
715	301138	华研精机	600	14,334.00	0.04
716	300359	全通教育	3,500	14,280.00	0.04
717	301221	光庭信息	400	14,272.00	0.04
717	000838	财信发展	6,400	14,272.00	0.04
718	003029	吉大正元	800	14,232.00	0.04
719	688733	壹石通	946	14,142.70	0.04
720	688089	嘉必优	1,060	14,034.40	0.04
721	001238	浙江正特	700	13,874.00	0.04
722	301349	信德新材	500	13,820.00	0.04
723	600526	菲达环保	3,700	13,727.00	0.04

724	688488	艾迪药业	1,340	13,694.80	0.04
725	300962	中金辐照	1,000	13,640.00	0.04
726	301051	信濠光电	520	13,639.60	0.04
727	002805	丰元股份	1,300	13,611.00	0.04
728	002962	五方光电	900	13,608.00	0.04
729	300654	世纪天鸿	1,600	13,600.00	0.04
730	600571	信雅达	1,300	13,572.00	0.04
731	688382	益方生物-U	1,873	13,541.79	0.04
732	002799	环球印务	2,300	13,524.00	0.04
733	301330	熵基科技	600	13,488.00	0.04
734	688246	嘉和美康	654	13,315.44	0.04
735	688287	观典防务	2,513	13,218.38	0.03
736	002338	奥普光电	400	13,208.00	0.03
737	688121	卓然股份	1,088	13,077.76	0.03
738	603081	大丰实业	1,400	13,048.00	0.03
739	300745	欣锐科技	900	13,014.00	0.03
740	300061	旗天科技	2,900	12,992.00	0.03
741	600814	杭州解百	2,200	12,980.00	0.03
742	688228	开普云	339	12,936.24	0.03
743	688697	纽威数控	824	12,928.56	0.03
744	688305	科德数控	200	12,892.00	0.03
745	300288	朗玛信息	1,200	12,684.00	0.03
746	688117	圣诺生物	511	12,539.94	0.03
747	301386	未来电器	600	12,444.00	0.03
748	603211	晋拓股份	900	12,339.00	0.03
749	300902	国安达	620	12,319.40	0.03
750	002095	生意宝	1,000	12,240.00	0.03
751	603222	济民医疗	2,200	12,100.00	0.03
752	603186	华正新材	500	11,890.00	0.03
753	603318	水发燃气	2,100	11,886.00	0.03
754	603811	诚意药业	1,900	11,875.00	0.03
755	605208	永茂泰	1,900	11,837.00	0.03
756	002887	绿茵生态	1,800	11,718.00	0.03
757	301226	祥明智能	700	11,648.00	0.03
758	301076	新瀚新材	600	11,622.00	0.03
759	001314	亿道信息	300	11,529.00	0.03
760	000633	合金投资	2,900	11,426.00	0.03
761	000715	中兴商业	2,400	11,424.00	0.03
762	001319	铭科精技	700	11,410.00	0.03
763	000068	华控赛格	4,200	11,340.00	0.03
764	300161	华中数控	500	11,245.00	0.03
765	300990	同飞股份	400	11,244.00	0.03
766	300968	格林精密	1,200	11,112.00	0.03
767	688577	浙海德曼	278	11,097.76	0.03

768	301121	紫建电子	300	11,079.00	0.03
769	002875	安奈儿	1,000	11,030.00	0.03
770	603273	天元智能	600	11,010.00	0.03
771	002238	天威视讯	1,400	10,990.00	0.03
772	001217	华尔泰	1,200	10,980.00	0.03
773	002979	雷赛智能	600	10,920.00	0.03
774	002671	龙泉股份	3,000	10,770.00	0.03
775	688035	德邦科技	334	10,761.48	0.03
776	603178	圣龙股份	500	10,715.00	0.03
777	603360	百傲化学	900	10,575.00	0.03
778	600796	钱江生化	2,400	10,464.00	0.03
779	000045	深纺织 A	1,300	10,426.00	0.03
780	300230	永利股份	3,100	10,416.00	0.03
781	301120	新特电气	1,000	10,390.00	0.03
782	603739	蔚蓝生物	800	10,336.00	0.03
783	301117	佳缘科技	400	10,320.00	0.03
784	603648	畅联股份	1,300	10,296.00	0.03
785	000544	中原环保	1,300	10,231.00	0.03
786	300429	强力新材	900	10,224.00	0.03
787	300847	中船汉光	700	10,143.00	0.03
788	600694	大商股份	600	10,086.00	0.03
789	600558	大西洋	2,800	10,080.00	0.03
790	300916	朗特智能	400	10,072.00	0.03
791	600215	派斯林	1,400	9,982.00	0.03
792	601968	宝钢包装	2,100	9,828.00	0.03
793	688039	当虹科技	381	9,825.99	0.03
794	002823	凯中精密	800	9,760.00	0.03
795	002471	中超控股	5,000	9,750.00	0.03
796	002218	拓日新能	3,400	9,690.00	0.03
797	000554	泰山石油	1,900	9,633.00	0.03
798	000886	海南高速	2,300	9,614.00	0.03
799	002976	瑞玛精密	400	9,600.00	0.03
800	688626	翔宇医疗	301	9,553.74	0.03
801	002066	瑞泰科技	1,200	9,540.00	0.03
802	001896	豫能控股	2,200	9,504.00	0.03
803	002454	松芝股份	1,700	9,503.00	0.03
804	002483	润邦股份	2,100	9,471.00	0.03
805	300341	麦克奥迪	1,100	9,438.00	0.02
806	002111	威海广泰	900	9,378.00	0.02
807	300572	安车检测	800	9,296.00	0.02
808	300057	万顺新材	2,300	9,292.00	0.02
809	001219	青岛食品	780	9,180.60	0.02
810	000404	长虹华意	1,700	9,061.00	0.02
811	603167	渤海轮渡	1,100	8,987.00	0.02

812	603191	望变电气	600	8,880.00	0.02
813	605366	宏柏新材	1,500	8,715.00	0.02
814	002977	火箭科技	300	8,676.00	0.02
815	301302	华如科技	500	8,625.00	0.02
816	300213	佳讯飞鸿	1,500	8,550.00	0.02
817	300093	金刚光伏	600	8,430.00	0.02
818	001208	华菱线缆	1,100	8,338.00	0.02
819	600071	凤凰光学	500	8,165.00	0.02
820	002137	实益达	1,700	8,092.00	0.02
821	002538	司尔特	1,800	8,064.00	0.02
822	603227	雪峰科技	1,300	8,060.00	0.02
823	000510	新金路	2,900	8,033.00	0.02
824	688212	澳华内镜	200	8,002.00	0.02
825	002688	金河生物	2,200	7,986.00	0.02
826	300299	富春股份	2,300	7,981.00	0.02
827	002306	中科云网	3,000	7,980.00	0.02
828	300520	科大国创	500	7,975.00	0.02
829	603528	多伦科技	1,100	7,843.00	0.02
830	603353	和顺石油	600	7,776.00	0.02
831	301310	鑫宏业	320	7,712.00	0.02
832	600622	光大嘉宝	4,000	7,400.00	0.02
833	002167	东方锆业	1,300	7,397.00	0.02
834	300342	天银机电	500	7,315.00	0.02
835	603050	科林电气	300	7,278.00	0.02
836	688595	芯海科技	240	7,200.00	0.02
837	300928	华安鑫创	200	7,108.00	0.02
838	002535	林州重机	2,600	7,098.00	0.02
839	605050	福然德	800	7,048.00	0.02
840	002149	西部材料	500	6,980.00	0.02
841	300793	佳禾智能	500	6,930.00	0.02
842	600257	大湖股份	1,500	6,765.00	0.02
843	300219	鸿利智汇	1,200	6,708.00	0.02
844	600560	金自天正	500	6,700.00	0.02
845	688233	神工股份	347	6,686.69	0.02
846	605068	明新旭腾	500	6,590.00	0.02
847	002902	铭普光磁	300	6,501.00	0.02
848	002869	金溢科技	200	6,442.00	0.02
849	300252	金信诺	1,000	6,250.00	0.02
850	001212	中旗新材	300	6,090.00	0.02
851	603767	中马传动	500	6,045.00	0.02
852	002975	博杰股份	200	5,976.00	0.02
853	600742	一汽富维	800	5,960.00	0.02
854	003026	中晶科技	200	5,774.00	0.02
855	300135	宝利国际	2,300	5,773.00	0.02

856	002969	嘉美包装	2,000	5,700.00	0.02
857	002449	国星光电	800	5,696.00	0.02
858	002779	中坚科技	200	5,668.00	0.01
859	002189	中光学	400	5,576.00	0.01
860	300484	蓝海华腾	400	5,516.00	0.01
861	603357	设计总院	600	5,514.00	0.01
862	301208	中亦科技	200	5,472.00	0.01
863	002728	特一药业	700	5,425.00	0.01
864	002388	新亚制程	1,700	5,355.00	0.01
865	600238	海南椰岛	700	5,341.00	0.01
866	301159	三维天地	200	5,334.00	0.01
867	688687	凯因科技	200	5,102.00	0.01
868	001234	泰慕士	300	5,097.00	0.01
869	002547	春兴精工	2,100	5,082.00	0.01
870	688589	力合微	200	5,042.00	0.01
871	002889	东方嘉盛	300	5,010.00	0.01
872	301419	阿莱德	200	4,966.00	0.01
873	300389	艾比森	400	4,912.00	0.01
874	002548	金新农	1,200	4,872.00	0.01
875	300541	先进数通	530	4,759.40	0.01
876	000812	陕西金叶	1,300	4,667.00	0.01
877	300976	达瑞电子	100	4,585.00	0.01
878	002790	瑞尔特	500	4,515.00	0.01
879	300095	华伍股份	800	4,408.00	0.01
880	603917	合力科技	400	4,328.00	0.01
881	688308	欧科亿	216	4,194.72	0.01
882	002725	跃岭股份	500	4,180.00	0.01
883	603131	上海沪工	300	4,152.00	0.01
883	603209	兴通股份	300	4,152.00	0.01
884	301520	万邦医药	100	4,138.00	0.01
885	002290	禾盛新材	300	3,996.00	0.01
886	600279	重庆港	1,100	3,993.00	0.01
887	600853	龙建股份	1,300	3,991.00	0.01
888	300938	信测标准	200	3,976.00	0.01
889	603270	金帝股份	200	3,968.00	0.01
890	000531	穗恒运 A	700	3,745.00	0.01
891	603897	长城科技	200	3,510.00	0.01
892	301518	长华化学	200	3,466.00	0.01
893	301315	威士顿	100	3,259.00	0.01
894	300951	博硕科技	100	3,115.00	0.01

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002570	贝因美	482,143.00	0.97
2	300194	福安药业	458,723.00	0.93
3	002264	新华都	451,309.00	0.91
4	300520	科大国创	446,984.00	0.90
5	300590	移为通信	438,590.00	0.89
6	002342	巨力索具	436,462.00	0.88
7	002707	众信旅游	431,932.00	0.87
8	300193	佳士科技	422,057.00	0.85
9	300066	三川智慧	407,285.00	0.82
10	300569	天能重工	403,257.00	0.81
11	300020	*ST 银江	387,094.00	0.78
12	300900	广联航空	381,037.00	0.77
13	002662	京威股份	376,475.00	0.76
14	300355	蒙草生态	376,463.00	0.76
15	000973	佛塑科技	375,245.00	0.76
16	002225	濮耐股份	374,379.00	0.76
17	000766	通化金马	370,611.00	0.75
18	000707	双环科技	370,073.00	0.75
19	002449	国星光电	367,589.00	0.74
20	300381	溢多利	363,284.00	0.73

注：本项及下项 7.4.2、7.4.3 的买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，此外，“买入金额”（或“买入股票成本”）、“卖出金额”（或“卖出股票收入”）均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用，不包括因投资者申购赎回基金份额导致的基金组合中股票的增减。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300900	广联航空	672,243.00	1.36
2	300292	吴通控股	577,811.00	1.17
3	002170	芭田股份	559,484.00	1.13
4	000973	佛塑科技	546,414.00	1.10
5	300355	蒙草生态	534,225.00	1.08
6	300066	三川智慧	530,559.00	1.07



7	000612	焦作万方	519,962.00	1.05
8	300872	天阳科技	507,916.00	1.03
9	002662	京威股份	489,622.00	0.99
10	002264	新华都	488,980.00	0.99
11	002695	煌上煌	488,129.00	0.99
12	300590	移为通信	486,745.00	0.98
13	300520	科大国创	471,192.00	0.95
14	002367	康力电梯	459,360.00	0.93
15	300706	阿石创	458,789.00	0.93
16	300217	东方电热	449,585.00	0.91
17	300842	帝科股份	447,167.00	0.90
18	000026	飞亚达	445,749.00	0.90
19	000888	峨眉山 A	443,185.00	0.89
20	000777	中核科技	441,092.00	0.89

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	113,629,123.86
卖出股票收入（成交）总额	116,155,051.05

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 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。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	33,141.61
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.12
8	其他	-
9	合计	108,550.73

### 7.12.4 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。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
616	74,215.91	35,900,390.00	78.53%	9,816,610.00	21.47%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	广发基金管理有限公司	28,918,200.00	63.25%
2	招商证券股份有限公司	3,316,900.00	7.26%
3	方正证券股份有限公司	2,067,590.00	4.52%
4	海通证券股份有限公司	942,400.00	2.06%
5	中信证券股份有限公司	644,700.00	1.41%
6	刘建平	350,000.00	0.77%
7	曹红杰	300,100.00	0.66%
8	张涛	300,000.00	0.66%
9	孙彩霞	250,000.00	0.55%
10	陈铭河	223,300.00	0.49%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	0.00	0.0000%

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2023 年 9 月 8 日）基金份额总额	312,717,000.00
本报告期期初基金份额总额	48,717,000.00

本报告期基金总申购份额	75,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	78,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	45,717,000.00

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国投证券	2	136,736,456.72	59.51%	101,991.47	59.51%	-
天风证券	2	93,047,718.19	40.49%	69,405.18	40.49%	-

申港证券	2	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	-	-	-	-	-
财通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国盛证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	4	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	4	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
世纪证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
首创证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
财信证券	1	-	-	-	-	-
中国银河	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

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

2、交易单元选择流程：

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
国投证券	2,586.20	50.85%	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
申港证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,500.00	49.15%	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-

国融证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
中国银河	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于增加华金证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-05
2	关于增加华宝证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-11
3	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-19
4	关于增加民生证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-01-31
5	关于增加财达证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-02-07
6	关于增加山西证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-18
7	关于增加华创证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
8	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-03-29
9	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-19
10	关于增加东兴证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-24
11	关于增加联储证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-04-24
12	关于增加华福证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-06
13	关于增加渤海证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-05-17
14	关于广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金连续 30 个工作日基金资产净值低于 5000 万元人民币的提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2024-06-20

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240101-20240630	28,918,200.00	-	-	28,918,200.00	63.25%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金基金合同约定：“《基金合同》生效后，连续 20 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5,000 万元情形的，基金管理人应当在定期报告中予以披露；连续 50 个工作日出现上述情形的，基金管理人应当终止基金合同并及时通知基金托管人，按照基金合同的约定程序进行清算，不需要召开基金份额持有人大会进行表决。”本基金的基金资产净值曾连续 30 个工作日低于 5,000 万元人民币，可能触发《基金合同》终止情形。详情可见本基金管理人网站（www.gffunds.com.cn）刊登的《关于广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金连续 30 个工作日基金资产净值低于 5000 万元人民币的提示性公告》。



## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发中证 2000 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

### 12.2 存放地点

广东省广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

- 1. 书面查阅：投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件；
- 2. 网站查阅：基金管理人网址 [www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)。

广发基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日