

# 广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券 投资基金

## 2021 年中期报告

### 2021 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：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二一年八月三十日

## 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。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2021 年 8 月 26 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2021 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	5
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
<b>5 托管人报告</b>	<b>14</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
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	15
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	15
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>15</b>
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
<b>7 投资组合报告</b>	<b>49</b>
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	66
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	66
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
<b>8 基金份额持有人信息</b>	<b>67</b>

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	67
8.2 期末上市基金前十名持有人 .....	68
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	68
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 .....	68
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>69</b>
<b>10 重大事件揭示</b> .....	<b>69</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	69
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 .....	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	69
10.4 基金投资策略的改变 .....	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	69
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 .....	69
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	69
10.8 其他重大事件 .....	71
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>72</b>
<b>12 备查文件目录</b> .....	<b>73</b>
12.1 备查文件目录 .....	73
12.2 存放地点 .....	73
12.3 查阅方式 .....	73

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发中证全指信息技术 ETF
基金主代码	159939
交易代码	159939
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2015 年 1 月 8 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,248,828,053.00 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	2015-02-05

注：本基金的扩位证券简称为“信息技术 ETF”。

### 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。
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%。
业绩比较基准	中证全指信息技术指数
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66594319
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fcid@bankofchina.com
客户服务电话		95105828	95566

传真	020-89899158	010-66594942
注册地址	广东省珠海市横琴新区宝华路6号105室-49848（集中办公区）	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码	510308	100818
法定代表人	孙树明	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	<a href="http://www.gffunds.com.cn">http://www.gffunds.com.cn</a>
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

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（2021年1月1日至2021年6月30日）
本期已实现收益	62,496,924.73
本期利润	170,664,015.32
加权平均基金份额本期利润	0.1309
本期加权平均净值利润率	9.75%
本期基金份额净值增长率	6.79%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2021年6月30日)
期末可供分配利润	183,928,533.58
期末可供分配基金份额利润	0.1473
期末基金资产净值	1,859,383,627.89
期末基金份额净值	1.4889
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2021年6月30日)
基金份额累计净值增长率	48.89%

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	9.00%	1.38%	8.66%	1.38%	0.34%	0.00%
过去三个月	18.19%	1.22%	17.41%	1.22%	0.78%	0.00%
过去六个月	6.79%	1.42%	5.72%	1.43%	1.07%	-0.01%
过去一年	5.50%	1.62%	2.71%	1.64%	2.79%	-0.02%
过去三年	56.68%	1.95%	49.13%	1.97%	7.55%	-0.02%
自基金合同生效起至今	48.89%	2.09%	61.39%	2.13%	-12.50%	-0.04%

#### 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

广发中证全指信息技术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  
 （2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 30 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，总部设在广州，在北京、上海、广州、香港等地设有分公司或子公司。本基金管理人拥有公募基金管理、特定客户资产管理、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 等业务资格，旗下产品覆盖主动权益、债券、货币、海外投资、被动投资、量化对冲、另类投资等不同类别，为境内外客户提供标准化和定制化的资产管理服务。

##### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
霍华明	本基金的基金经理；广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式	2017-04-20	-	13 年	霍华明先生，理学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任广发基金管理有限公司注册登记部核算专员、数量投资部数据分析员、ETF 基金助理兼研究员、广发中证京津冀协同发展主题交易



	<p>联接基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证建设工程指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证京津冀协同发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；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；广发中证军工交易型</p>				<p>型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2018 年 4 月 19 日至 2021 年 6 月 29 日)。</p>
--	---	--	--	--	---

	开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证军工交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证养老产业指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金的基金经理；广发上海金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证建筑工程交易型开放式指数证券投资基金的基金经理				
陆志明	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；	2015-01-08	2021-06-17	22 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投资部副总经理、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 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 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 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发

	<p>广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理</p>			<p>中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源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 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指原材料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 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要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 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 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基金经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术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 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发</p>
--	----------------------------------	--	--	--

					中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 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 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)。
--	--	--	--	--	---

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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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 13 次，其中 7 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 6 次为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本组合有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金主要采取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。

2021 年上半年，全球疫情形势依然严峻，世界经济复苏出现分化，部分发达经济体大规模刺激政策外溢效应明显，国际大宗商品价格快速上涨，然而国内经济随着统筹疫情防控和经济社会发展成效的持续显现，在同期基数较低以及“就地过年”等因素共同作用下，延续了稳定恢复的态势，经济循环日益畅通，企业生产经营活动运行良好。A 股市场方面，上证指数上涨 3.40%，深证成指上涨 4.78%，创业板指数上涨 17.22%，中证全指信息技术指数上涨 5.72%。上半年，芯片供给依然偏紧，芯片价格持续上涨，半导体芯片行业的高景气度延续；另外，消费电子板块受苹果新机型的利好，基本面得以改善，估值迎来了修复。

##### 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 6.79%，同期业绩比较基准收益率为 5.72%。

#### 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，全球接种新冠疫苗的人数快速增加，随着疫苗的普及，经济恢复成为主题。但由于变异病毒的存在，全球经济不太可能在短时间内恢复至疫情前的水平。就国内而言，虽然原材料价格上涨对小微企业，尤其是中下游企业带来了生产经营压力，但从上半年经济运行的情况来看，经济内生动力依然在增强。随着政府对实体经济加大支持，尤其是对小微企业和个体工商户利好政策的不断落地，预计下半年中国经济有望保持稳定复苏的态势。信息技术广泛应用在三大产业，为

经济效率的提高、质量的提升以及生态环境的改善提供了强大动能，对改善居民生活发挥着至关重要的作用。信息技术产业已经成为推动经济社会发展的标志性产业，在整个国民经济发展过程中具有不可替代的地位。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设有估值委员会，按照相关法律法规和证监会的相关规定，负责制定旗下基金投资品种的估值原则和估值程序，并选取适当的估值方法，经公司管理层批准后方可实施。估值委员会的成员包括：公司分管投研、估值的公司领导、督察长、各投资部门负责人、研究发展部负责人、合规稽核部负责人、金融工程与风险管理部负责人和基金会计部负责人。估值委员会定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后及时修订估值方法，以保证其持续适用。基金日常估值由基金会计部具体执行，并确保和托管行核对一致。投资研究人员积极关注市场变化、证券发行机构重大事件等可能对估值产生重大影响的因素，向估值委员会提出估值建议，确保估值的公允性。合规稽核部负责定期对基金估值程序和方法进行核查，确保估值委员会的各项决策得以有效执行。以上所有相关人员具备较高的专业能力和丰富的行业从业经验。为保证基金估值的客观独立，基金经理不参与估值的具体流程，但若存在对相关投资品种估值有失公允的情况，可向估值委员会提出意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以维护基金持有人利益为准则。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、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债券品种的估值数据。

#### 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。

### 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

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有

关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

# 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：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	7,858,362.67	10,908,601.00
结算备付金		1,262,748.84	230,617.29
存出保证金		111,098.05	107,650.84
交易性金融资产	6.4.7.2	1,851,346,437.81	1,518,469,883.58
其中：股票投资		1,850,389,880.53	1,517,435,618.48
基金投资		-	-
债券投资		956,557.28	1,034,265.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-

买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		14,233,222.92	1,570,672.31
应收利息	6.4.7.5	78,974.13	59,020.46
应收股利		27,722.07	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,874,918,566.49	1,531,346,445.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2020 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		-	-
应付证券清算款		10,603,825.43	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		831,938.03	638,293.16
应付托管费		166,387.60	127,658.64
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	606,752.72	388,107.61
应交税费		4,757.11	5,840.07
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	3,321,277.71	998,025.16
负债合计		15,534,938.60	2,157,924.64
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	1,248,828,053.00	1,096,828,053.00
未分配利润	6.4.7.10	610,555,574.89	432,360,467.84
所有者权益合计		1,859,383,627.89	1,529,188,520.84
负债和所有者权益总计		1,874,918,566.49	1,531,346,445.48

注：报告截止日 2021 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.4889 元，基金份额总额 1,248,828,053.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

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



		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日
<b>一、收入</b>		<b>177,755,943.07</b>	<b>329,257,855.65</b>
1.利息收入		646,617.36	411,609.45
其中：存款利息收入	6.4.7.11	32,556.95	107,742.74
债券利息收入		588.39	753.84
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		613,472.02	303,112.87
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		67,420,728.20	206,834,129.60
其中：股票投资收益	6.4.7.12	58,288,311.54	199,575,451.44
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	303,351.87	376,058.30
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	8,829,064.79	6,882,619.86
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	108,167,090.59	122,070,599.56
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,521,506.92	-58,482.96
<b>减：二、费用</b>		<b>7,091,927.75</b>	<b>7,874,620.84</b>
1. 管理人报酬		4,334,458.98	4,718,039.27
2. 托管费		866,891.80	943,607.85
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.18	1,526,996.23	1,827,562.57
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,211.28	1,094.34
7. 其他费用	6.4.7.19	361,369.46	384,316.81
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>170,664,015.32</b>	<b>321,383,234.81</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>170,664,015.32</b>	<b>321,383,234.81</b>

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,096,828,053.00	432,360,467.84	1,529,188,520.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	170,664,015.32	170,664,015.32
三、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）	152,000,000.00	7,531,091.73	159,531,091.73
其中：1.基金申购款	746,000,000.00	248,778,797.58	994,778,797.58
2.基金赎回款	-594,000,000.00	-241,247,705.85	-835,247,705.85
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,248,828,053.00	610,555,574.89	1,859,383,627.89
项目	上年度可比期间		
	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,242,828,053.00	192,294,292.38	1,435,122,345.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	321,383,234.81	321,383,234.81
三、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）	36,000,000.00	12,315,789.83	48,315,789.83
其中：1.基金申购款	1,496,000,000.00	427,815,517.91	1,923,815,517.91
2.基金赎回款	-1,460,000,000.00	-415,499,728.08	-1,875,499,728.08
四、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）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	1,278,828,053.00	525,993,317.02	1,804,821,370.02

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：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发中证全指信息技术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[2014]1269号《关于核准广发中证全指信息技术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《广发中证全指信息技术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2015年1月8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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期为2014年12月15日至2014年12月26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354,828,053.00元，有效认购户数为3,988户。其中，认购资金在募集期间产生的利息共计人民币22,681.00元，折合基金份额22,681.00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。本基金募集资金经德勤华永会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

本基金的财务报表于2021年8月26日已经本基金的基金管理人及基金托管人批准报出。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布的企业会计准则（以下简称“企业会计准则”）和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金2021年6月30日的财务状况以及2021年上半年的经营成果和基金净值变动情况。

### 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

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。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
活期存款	7,858,362.67
定期存款	-
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	-
合计	7,858,362.67

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	1,648,441,093.18	1,850,389,880.53	201,948,787.35
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	855,200.00	956,557.28
	银行间市场	-	-
	合计	855,200.00	956,557.28
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,649,296,293.18	1,851,346,437.81	202,050,144.63

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
应收活期存款利息	759.73
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	45.00
应收结算备付金利息	1,431.41
应收债券利息	167.93
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	76,570.06
其他	-
合计	78,974.13

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日
交易所市场应付交易费用	606,752.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	606,752.72

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 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	-
预提费用	96,203.31
应付替代款	3,048,193.39
可退替代款	37,004.05
应付指数使用费	139,876.96
合计	3,321,277.71

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,096,828,053.00	1,096,828,053.00
本期申购	746,000,000.00	746,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-594,000,000.00	-594,000,000.00
本期末	1,248,828,053.00	1,248,828,053.00

#### 6.4.7.10 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	107,230,669.62	325,129,798.22	432,360,467.84
本期利润	62,496,924.73	108,167,090.59	170,664,015.32
本期基金份额交易产生的变动数	14,200,939.23	-6,669,847.50	7,531,091.73
其中：基金申购款	86,234,519.14	162,544,278.44	248,778,797.58
基金赎回款	-72,033,579.91	-169,214,125.94	-241,247,705.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	183,928,533.58	426,627,041.31	610,555,574.89

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	22,228.16
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	682.82
结算备付金利息收入	9,645.97
其他	-
合计	32,556.95

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	17,019,623.41
股票投资收益——赎回差价收入	41,268,688.13
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	58,288,311.54

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	584,051,800.54
减：卖出股票成本总额	567,032,177.13
买卖股票差价收入	17,019,623.41

##### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	835,247,705.85
减：现金支付赎回款总额	232,760,356.85
减：赎回股票成本总额	561,218,660.87
赎回差价收入	41,268,688.13

#### 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 2021年1月1日至2021年6月30日
----	----------------------------



债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	303,351.87
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	303,351.87

#### 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
	2021年1月1日至2021年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,186,215.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,882,300.00
减：应收利息总额	563.61
买卖债券差价收入	303,351.87

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
股票投资产生的股利收益	8,829,064.79
其中：证券出借权益补偿收入	222,020.86
基金投资产生的股利收益	-
合计	8,829,064.79

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年1月1日至2021年6月30日
1.交易性金融资产	108,167,346.59
——股票投资	108,077,354.41
——债券投资	89,992.18
——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	-256.00

减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	108,167,090.59

注：其他为可退替代款公允价值变动损益。

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	1,521,506.92
合计	1,521,506.92

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）被替代股票的实际买入成本（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股票在强制退款计算日与申购（赎回）确认日估值的差额。

#### 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
交易所市场交易费用	1,526,996.23
银行间市场交易费用	-
合计	1,526,996.23

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	5,098.61
指数使用费	260,067.54
合计	361,369.46

### 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
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、代销机构
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	17,803.44	-	176,260,464.09	12.71%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年6月30日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	1,215,600.00	31.16%	3,057,184.30	69.34%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券股份有限公司	16.59	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 6 月 30 日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例
广发证券股份有限公司	163,531.38	15.60%	131,814.83	21.41%

注：1、股票交易佣金的计提标准：支付佣金=股票成交金额×佣金比例-证管费-经手费-结算风险金（含债券交易）；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

3、本基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2021年1月1日至2021年6月 30日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年6月 30日
	当期发生的基金应支付的管理费	4,334,458.98
其中：支付销售机构的客户维护费	34,801.49	48,292.76

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

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021年1月1日至2021年6月 30日	2020年1月1日至2020年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	866,891.80	943,607.85

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

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

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

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

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

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

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

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人无运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联	826,488,937.00	66.18%	634,752,980.00	57.87%

接基金				
-----	--	--	--	--

#### 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		上年度可比期间	
	2021年1月1日至2021年6月30日		2020年1月1日至2020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
中国银行股份有限公司	7,858,362.67	22,228.16	8,151,725.57	96,012.62

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

#### 6.4.11 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（2021年6月30日）本基金持有的流通受限证券

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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
600905	三峡能源	2021-06-02	2021-12-10	新股流通受限	2.65	5.67	907,763.00	2,405,571.95	5,147,016.21	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	47.33	251.96	787.00	37,248.71	198,292.52	20210624除权除息,派息比例0.4500(含税)
688609	九联科技	2021-03-15	2021-09-23	新股流通受限	3.99	15.29	10,372.00	41,384.28	158,587.88	-
688345	博力威	2021-06-03	2021-12-13	新股流通受限	25.91	55.53	2,332.00	60,422.12	129,495.96	-

300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	新股流通受限	24.60	163.00	610.00	15,006.00	99,430.00	-
688499	利元亨	2021-06-23	2021-07-01	新股流通受限	38.85	38.85	2,149.00	83,488.65	83,488.65	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	新股流通受限	33.22	87.50	925.00	30,728.50	80,937.50	-
688676	金盘科技	2021-03-02	2021-09-09	新股流通受限	10.10	16.24	3,750.00	37,875.00	60,900.00	20210429 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
688117	圣诺生物	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	17.90	35.97	1,672.00	29,928.80	60,141.84	-
301018	申菱环境	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	8.29	8.29	7,029.00	58,270.41	58,270.41	-
688087	英科再生	2021-06-30	2022-01-10	新股流通受限	21.96	21.96	2,469.00	54,219.24	54,219.24	-
688195	腾景科技	2021-03-18	2021-09-27	新股流通受限	13.60	19.87	2,693.00	36,624.80	53,509.91	20210603 除权除息,派息比例 0.1700 (含税)
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	48.59	90.39	515.00	25,023.85	46,550.85	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	新股流通受限	28.28	115.71	360.00	10,180.80	41,655.60	20210622 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)

301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	9.46	9.46	2,609.00	24,681.14	24,681.14	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	新股流通受限	28.77	99.85	240.00	6,904.80	23,964.00	20210617 除权除息,派息比例 0.1400 (含税)
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	新股流通受限	12.54	27.89	801.00	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	21.31	49.94	399.00	8,502.69	19,926.06	20210629 除权除息,派息比例 0.3000 (含税)
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股流通受限	6.42	6.42	2,693.00	17,289.06	17,289.06	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	新股流通受限	15.83	45.29	317.00	5,018.11	14,356.93	20210618 除权除息,派息比例 0.5000 (含税)
300968	格林精密	2021-04-06	2021-10-15	新股流通受限	6.87	12.07	1,162.00	7,982.94	14,025.34	-
300940	南极光	2021-01-27	2021-08-03	新股流通受限	12.76	43.38	307.00	3,917.32	13,317.66	20210618 除权除息,派息比例 0.0790 (含税)
30061	百川	2021-0	2021-1	新股	9.19	40.38	329.00	3,023.	13,285	-



4	畅银	5-18	1-25	流通受限				51	.02	
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	新股流通受限	12.25	53.71	244.00	2,989.00	13,105.24	20210521 除权除息,派息比例 0.2000 (含税)
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	新股流通受限	5.31	28.52	443.00	2,352.33	12,634.36	20210602 除权除息,派息比例 0.0450 (含税)
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	新股流通受限	4.94	13.05	928.00	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	新股流通受限	3.37	10.44	1,112.00	3,747.44	11,609.28	20210618 除权除息,派息比例 0.0300 (含税)
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股流通受限	31.56	31.56	349.00	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	新股流通受限	16.53	46.07	232.00	3,834.96	10,688.24	20210628 除权除息,派息比例 0.4100 (含税)
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	新股流通受限	20.81	42.23	241.00	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	新股流通	12.85	25.80	371.00	4,767.35	9,571.80	20210527 除

				受限						权除 息,派 息比 例 0.3000 (含税)
30096 2	中金 辐照	2021-0 3-29	2021-1 0-11	新股 流通 受限	3.40	16.37	576.00	1,958. 40	9,429. 12	2021 610 除 权除 息,派 息比 例 0.1600 (含税)
30095 2	恒辉 安防	2021-0 3-03	2021-0 9-13	新股 流通 受限	11.72	27.08	340.00	3,984. 80	9,207. 20	2021 603 除 权除 息,派 息比 例 0.2200 (含税)
30101 6	雷尔 伟	2021-0 6-23	2021-1 2-30	新股 流通 受限	13.75	32.98	275.00	3,781. 25	9,069. 50	-
30096 6	共同 药业	2021-0 3-31	2021-1 0-11	新股 流通 受限	8.24	31.54	286.00	2,356. 64	9,020. 44	-
30094 5	曼卡 龙	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	4.56	18.88	474.00	2,161. 44	8,949. 12	2021 609 除 权除 息,派 息比 例 0.0950 (含税)
30094 8	冠中 生态	2021-0 2-18	2021-0 8-24	新股 流通 受限	13.00	27.42	324.00	2,808. 00	8,884. 08	2021 604 除 权除 息,派 息比 例 0.0800 (含 税),转

										增比例 0.5000
30093 1	通用 电梯	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 流通 受限	4.31	13.11	672.00	2,896. 32	8,809. 92	-
30096 1	深水 海纳	2021-0 3-23	2021-0 9-30	新股 流通 受限	8.48	22.07	394.00	3,341. 12	8,695. 58	20210 611 除 权除 息,派 息比 例 0.0530 (含税)
30095 0	德固 特	2021-0 2-24	2021-0 9-03	新股 流通 受限	8.41	39.13	219.00	1,841. 79	8,569. 47	20210 601 除 权除 息,派 息比 例 0.1000 (含税)
60516 2	新中 港	2021-0 6-29	2021-0 7-07	新股 流通 受限	6.07	6.07	1,377. 00	8,358. 39	8,358. 39	-
30098 6	志特 新材	2021-0 4-21	2021-1 1-01	新股 流通 受限	14.79	30.57	264.00	3,904. 56	8,070. 48	-
30098 7	川网 传媒	2021-0 4-28	2021-1 1-11	新股 流通 受限	6.79	26.81	301.00	2,043. 79	8,069. 81	-
30092 6	博俊 科技	2020-1 2-29	2021-0 7-12	新股 流通 受限	10.76	22.20	359.00	3,862. 84	7,969. 80	20210 519 除 权除 息,派 息比 例 0.0500 (含税)
30093 0	屹通 新材	2021-0 1-13	2021-0 7-21	新股 流通 受限	13.11	24.48	322.00	4,221. 42	7,882. 56	20210 528 除 权除 息,派 息比 例

										0.1000 (含税)
30098 5	致远 新能	2021-0 4-21	2021-1 0-29	新股 流通 受限	24.90	24.81	295.00	7,345. 50	7,318. 95	-
30097 1	博亚 精工	2021-0 4-07	2021-1 0-15	新股 流通 受限	18.24	28.29	245.00	4,468. 80	6,931. 05	20210 611 除 权除 息,派 息比 例 0.4000 (含税)
30092 7	江天 化学	2020-1 2-29	2021-0 7-07	新股 流通 受限	13.39	30.10	217.00	2,905. 63	6,531. 70	20210 621 除 权除 息,派 息比 例 0.2100 (含税)
30101 8	申菱 环境	2021-0 6-28	2022-0 1-07	新股 流通 受限	8.29	8.29	782.00	6,482. 78	6,482. 78	-
30097 5	商络 电子	2021-0 4-14	2021-1 0-21	新股 流通 受限	5.48	13.03	492.00	2,696. 16	6,410. 76	20210 608 除 权除 息,派 息比 例 0.0360 (含税)
30096 3	中洲 特材	2021-0 3-30	2021-1 0-11	新股 流通 受限	12.13	22.49	283.00	3,432. 79	6,364. 67	20210 611 除 权除 息,派 息比 例 0.1500 (含税)
30094 3	春晖 智控	2021-0 2-03	2021-0 8-10	新股 流通 受限	9.79	23.01	255.00	2,496. 45	5,867. 55	20210 617 除 权除 息,派 息比

										例 0.1000 (含税)
30097 2	万辰 生物	2021-0 4-08	2021-1 0-19	新股 流通 受限	7.19	12.65	430.00	3,091. 70	5,439. 50	-
30092 9	华骐 环保	2021-0 1-12	2021-0 7-21	新股 流通 受限	13.87	29.55	183.00	2,538. 21	5,407. 65	20210 618 除 权除 息,派 息比 例 0.1200 (含税)
30096 0	通业 科技	2021-0 3-22	2021-0 9-29	新股 流通 受限	12.08	23.06	234.00	2,826. 72	5,396. 04	20210 623 除 权除 息,派 息比 例 0.4000 (含税)
30099 5	奇德 新材	2021-0 5-17	2021-1 1-26	新股 流通 受限	14.72	23.32	191.00	2,811. 52	4,454. 12	-
30100 7	德迈 仕	2021-0 6-04	2021-1 2-16	新股 流通 受限	5.29	14.44	303.00	1,602. 87	4,375. 32	-
30099 8	宁波 方正	2021-0 5-25	2021-1 2-02	新股 流通 受限	6.02	21.32	201.00	1,210. 02	4,285. 32	-
30101 2	扬电 科技	2021-0 6-15	2021-1 2-22	新股 流通 受限	8.05	24.26	170.00	1,368. 50	4,124. 20	-
30099 2	泰福 泵业	2021-0 5-17	2021-1 1-25	新股 流通 受限	9.36	20.32	200.00	1,872. 00	4,064. 00	-
30102 1	英诺 激光	2021-0 6-28	2022-0 1-06	新股 流通 受限	9.46	9.46	290.00	2,743. 40	2,743. 40	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流 通日	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：张)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
----------	----------	-----------	----------	--------------------	----------	------------	--------------	----------------	----------------	----

127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债流通受限	100.00	100.00	4,733.00	473,300.00	473,300.00	-
123116	万兴转债	2021-06-09	2021-07-01	新债流通受限	100.00	100.00	1,223.00	122,300.00	122,300.00	-

注：截至本报告期末 2021 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。

#### 6.4.12.2 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	复牌开盘价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688368	晶丰明源	2021-06-21	重大事项停牌	335.26	2021-07-05	402.31	7,485.00	1,371,158.82	2,509,421.10	-
600460	士兰微	2021-06-30	重大事项停牌	56.35	2021-07-01	59.49	267,100.00	6,063,973.74	15,051,085.00	-

#### 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 2021 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 2021 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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	300782	卓胜微	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 16 日	537.50	27,000.00	14,512,500.00
2	600584	长电科技	2021 年 7 月 16 日	37.68	140,000.00	5,275,200.00
3	601360	三六零	2021 年 7 月 6 日	12.21	249,900.00	3,051,279.00
4	300339	润和软件	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	43.36	68,000.00	2,948,480.00
5	002371	北方华创	2021 年 7 月 2 日	277.3	10,000.00	2,773,800.00

				8		0
6	002138	顺络电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 27 日	38.77	62,400.00	2,419,248.0 0
7	002212	天融信	2021 年 7 月 21 日	19.77	110,000.00	2,174,700.0 0
8	002456	欧菲光	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	8.88	213,000.00	1,891,440.0 0
9	300458	全志科技	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	87.66	20,000.00	1,753,200.0 0
10	002558	巨人网络	2021 年 7 月 14 日	13.30	130,000.00	1,729,000.0 0
11	600460	士兰微	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	56.35	30,000.00	1,690,500.0 0
12	688012	中微公司	2021 年 7 月 2 日	165.9 2	10,000.00	1,659,200.0 0
13	002241	歌尔股份	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 7 日	42.74	32,500.00	1,389,050.0 0
14	603678	火炬电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 6 日	67.50	20,000.00	1,350,000.0 0
15	300379	东方通	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	28.49	44,600.00	1,270,654.0 0
16	300373	扬杰科技	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 22 日	60.54	20,000.00	1,210,800.0 0
17	002036	联创电子	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	13.15	80,000.00	1,052,000.0 0
18	300346	南大光电	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 14 日	38.68	26,000.00	1,005,680.0 0
19	300773	拉卡拉	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 21 日	28.23	33,700.00	951,351.00
20	002405	四维图新	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	14.70	64,000.00	940,800.00
21	688396	华润微	2021 年 7 月 2 日	91.02	10,000.00	910,200.00
22	002079	苏州固锝	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 14 日	12.60	70,000.00	882,000.00
23	002415	海康威视	2021 年 7 月 1 日	64.50	12,400.00	799,800.00
24	600536	中国软件	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 21 日	56.93	14,000.00	797,020.00
25	000977	浪潮信息	2021 年 7 月 9 日	28.13	27,000.00	759,510.00
26	600330	天通股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 22 日	9.81	77,400.00	759,294.00
27	002152	广电运通	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 28 日	13.03	51,800.00	674,954.00
28	002261	拓维信息	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 28 日	10.17	65,000.00	661,050.00

29	300036	超图软件	2021年7月2日 -2021年7月7日	21.86	30,000.00	655,800.00
30	002185	华天科技	2021年7月8日 -2021年7月9日	15.39	40,600.00	624,834.00
31	300085	银之杰	2021年7月7日 -2021年7月14日	17.65	35,000.00	617,750.00
32	300567	精测电子	2021年7月1日	61.40	10,000.00	614,000.00
33	300352	北信源	2021年7月1日 -2021年7月9日	6.96	86,300.00	600,648.00
34	300226	上海钢联	2021年7月13日	59.55	10,000.00	595,500.00
35	603005	晶方科技	2021年7月2日	59.23	10,000.00	592,300.00
36	600360	华微电子	2021年7月1日 -2021年7月15日	9.06	65,000.00	588,900.00
37	002439	启明星辰	2021年7月2日	29.01	20,000.00	580,200.00
38	000158	常山北明	2021年7月7日 -2021年7月22日	11.49	50,000.00	574,500.00
39	002177	御银股份	2021年7月2日 -2021年7月15日	7.59	75,000.00	569,250.00
40	300348	长亮科技	2021年7月2日 -2021年7月6日	18.30	30,000.00	549,000.00
41	002600	领益智造	2021年7月13日 -2021年7月28日	9.19	56,000.00	514,640.00
42	002055	得润电子	2021年7月2日 -2021年7月14日	12.98	35,000.00	454,300.00
43	300502	新易盛	2021年7月2日	31.25	14,003.00	437,593.75
44	000034	神州数码	2021年7月2日 -2021年7月6日	21.85	20,000.00	437,000.00
45	300679	电连技术	2021年7月2日	28.82	15,000.00	432,300.00
46	300378	鼎捷软件	2021年7月1日 -2021年7月7日	21.47	20,000.00	429,400.00
47	002474	榕基软件	2021年7月7日 -2021年7月14日	6.43	65,000.00	417,950.00
48	300735	光弘科技	2021年7月1日 -2021年7月6日	12.16	34,000.00	413,440.00
49	300287	飞利信	2021年7月2日 -2021年7月21日	5.51	72,600.00	400,026.00
50	002288	超华科技	2021年7月20日	7.26	55,000.00	399,300.00
51	000503	国新健康	2021年7月1日 -2021年7月7日	7.41	52,500.00	389,025.00
52	603025	大豪科技	2021年7月15日	38.42	10,000.00	384,200.00
53	300663	科蓝软件	2021年7月28日	38.41	10,000.00	384,100.00
54	002174	游族网络	2021年7月5日 -2021年7月20日	17.17	22,300.00	382,891.00
55	300130	新国都	2021年7月13日	11.44	31,000.00	354,640.00



			-2021 年 7 月 21 日			
56	300666	江丰电子	2021 年 7 月 8 日	49.87	7,100.00	354,077.00
57	002425	凯撒文化	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 9 日	8.37	42,100.00	352,377.00
58	300205	天喻信息	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	12.31	28,000.00	344,680.00
59	002017	东信和平	2021 年 7 月 14 日 -2021 年 7 月 22 日	11.43	30,000.00	342,900.00
60	300327	中颖电子	2021 年 7 月 1 日	85.23	4,000.00	340,920.00
61	300297	蓝盾股份	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 22 日	4.24	79,800.00	338,352.00
62	300377	赢时胜	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 13 日	11.14	30,000.00	334,200.00
63	603989	艾华集团	2021 年 7 月 22 日	32.59	10,000.00	325,900.00
64	002222	福晶科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 13 日	16.21	20,000.00	324,200.00
65	300324	旋极信息	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 28 日	4.26	76,000.00	323,760.00
66	300302	同有科技	2021 年 7 月 8 日 -2021 年 7 月 14 日	10.79	30,000.00	323,700.00
67	300300	海峡创新	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 14 日	6.26	50,000.00	313,000.00
68	002436	兴森科技	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	11.00	27,900.00	306,900.00
69	002402	和而泰	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 2 日	23.97	12,700.00	304,419.00
70	000636	风华高科	2021 年 7 月 2 日	30.22	10,000.00	302,200.00
71	300315	掌趣科技	2021 年 7 月 9 日 -2021 年 7 月 22 日	4.25	70,700.00	300,475.00
72	002104	恒宝股份	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	5.92	50,000.00	296,000.00
73	600271	航天信息	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 13 日	13.03	22,500.00	293,175.00
74	002635	安洁科技	2021 年 7 月 13 日 -2021 年 7 月 14 日	14.63	20,000.00	292,600.00
75	603000	人民网	2021 年 7 月 6 日 -2021 年 7 月 20 日	17.19	16,900.00	290,511.00
76	000555	神州信息	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 8 日	14.47	20,000.00	289,400.00
77	603888	新华网	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 13 日	21.17	13,300.00	281,561.00
78	600363	联创光电	2021 年 7 月 13 日	27.85	10,000.00	278,500.00
79	600855	航天长峰	2021 年 7 月 1 日 -2021 年 7 月 8 日	13.32	20,400.00	271,728.00

80	600756	浪潮软件	2021年7月14日 -2021年7月28日	13.46	20,000.00	269,200.00
81	002063	远光软件	2021年7月1日 -2021年7月13日	7.91	34,000.00	268,940.00
82	300366	创意信息	2021年7月2日 -2021年7月13日	8.92	30,000.00	267,600.00
83	000970	中科三环	2021年7月2日 -2021年7月9日	9.55	27,600.00	263,580.00
84	603890	春秋电子	2021年7月1日 -2021年7月13日	12.92	20,000.00	258,400.00
85	300394	天孚通信	2021年7月13日	25.32	10,000.00	253,200.00
86	002180	纳思达	2021年7月20日	32.20	7,700.00	247,940.00
87	300333	兆日科技	2021年7月1日 -2021年7月13日	8.19	30,000.00	245,700.00
88	600640	号百控股	2021年7月13日 -2021年7月14日	12.19	20,000.00	243,800.00
89	002156	通富微电	2021年7月8日 -2021年7月9日	24.04	9,900.00	237,996.00
90	603936	博敏电子	2021年7月2日 -2021年7月21日	11.85	20,000.00	237,000.00
91	300349	金卡智能	2021年7月2日 -2021年7月15日	11.73	20,000.00	234,600.00
92	002579	中京电子	2021年7月1日 -2021年7月13日	10.55	22,000.00	232,100.00
93	002106	莱宝高科	2021年7月1日 -2021年7月6日	11.25	20,000.00	225,000.00
94	000823	超声电子	2021年7月1日 -2021年7月13日	11.23	20,000.00	224,600.00
95	300065	海兰信	2021年7月1日 -2021年7月22日	11.17	20,000.00	223,400.00
96	300078	思创医惠	2021年7月1日 -2021年7月13日	7.40	30,000.00	222,000.00
97	300476	胜宏科技	2021年7月2日	21.85	10,000.00	218,500.00
98	600797	浙大网新	2021年7月2日 -2021年7月16日	6.68	32,500.00	217,100.00
99	300115	长盈精密	2021年7月9日	20.60	10,000.00	206,000.00
100	002368	太极股份	2021年7月13日	20.06	10,000.00	200,600.00
101	000851	高鸿股份	2021年7月6日 -2021年7月13日	6.65	30,000.00	199,500.00
102	300232	洲明科技	2021年7月2日 -2021年7月14日	8.93	22,300.00	199,139.00
103	002214	大立科技	2021年7月2日	19.14	10,000.00	191,400.00
104	300053	欧比特	2021年7月2日 -2021年7月22日	9.29	20,000.00	185,800.00

105	300310	宜通世纪	2021年7月6日 -2021年7月22日	4.62	40,000.00	184,800.00
106	002273	水晶光电	2021年7月13日	14.69	12,400.00	182,156.00
107	300493	润欣科技	2021年7月8日 -2021年7月14日	7.98	22,600.00	180,348.00
108	300602	飞荣达	2021年7月13日	17.80	10,000.00	178,000.00
109	300311	任子行	2021年7月13日 -2021年7月15日	5.91	30,000.00	177,300.00
110	300383	光环新网	2021年7月2日	14.39	12,300.00	176,997.00
111	300188	美亚柏科	2021年7月2日	17.40	10,000.00	174,000.00
112	002657	中科金财	2021年7月8日	11.36	15,000.00	170,400.00
113	300010	豆神教育	2021年7月1日 -2021年7月2日	5.67	30,000.00	170,100.00
114	002065	东华软件	2021年7月2日	7.93	21,300.00	168,909.00
115	300418	昆仑万维	2021年7月1日	16.38	10,000.00	163,800.00
116	300099	精准信息	2021年7月1日 -2021年7月28日	7.94	20,000.00	158,800.00
117	002189	中光学	2021年7月1日	16.25	9,700.00	157,625.00
118	300256	星星科技	2021年7月2日 -2021年7月15日	5.17	30,000.00	155,100.00
119	300128	锦富技术	2021年7月1日 -2021年7月22日	3.82	40,000.00	152,800.00
120	300066	三川智慧	2021年7月6日 -2021年7月13日	5.09	30,000.00	152,700.00
121	002195	二三四五	2021年7月7日	2.03	75,000.00	152,250.00
122	600571	信雅达	2021年7月2日 -2021年7月13日	7.34	20,000.00	146,800.00
123	600100	同方股份	2021年7月2日	6.11	23,500.00	143,585.00
124	600206	有研新材	2021年7月2日	14.30	10,000.00	143,000.00
125	000050	深天马 A	2021年7月9日	14.18	10,000.00	141,800.00
126	002095	生意宝	2021年7月6日	13.86	10,000.00	138,600.00
127	600552	凯盛科技	2021年7月6日 -2021年7月13日	6.92	20,000.00	138,400.00
128	000021	深科技	2021年7月20日	19.14	6,900.00	132,066.00
129	002093	国脉科技	2021年7月9日 -2021年7月13日	6.27	20,000.00	125,400.00
130	300166	东方国信	2021年7月28日	12.36	10,000.00	123,600.00
131	300299	富春股份	2021年7月7日 -2021年7月13日	5.77	20,000.00	115,400.00
132	300017	网宿科技	2021年7月9日	5.85	19,500.00	114,075.00
133	002161	远望谷	2021年7月1日 -2021年7月2日	5.48	20,000.00	109,600.00
134	002449	国星光电	2021年7月1日	10.10	10,000.00	101,000.00
135	600718	东软集团	2021年7月9日	9.78	10,000.00	97,800.00

136	603636	南威软件	2021 年 7 月 6 日	9.63	10,000.00	96,300.00
137	300113	顺网科技	2021 年 7 月 1 日	12.94	7,200.00	93,168.00
138	300020	银江股份	2021 年 7 月 2 日	8.54	10,000.00	85,400.00
139	600410	华胜天成	2021 年 7 月 28 日	7.76	10,500.00	81,480.00
140	603328	依顿电子	2021 年 7 月 2 日	7.45	10,000.00	74,500.00
141	002217	合力泰	2021 年 7 月 2 日 -2021 年 7 月 6 日	3.57	19,600.00	69,972.00
142	603660	苏州科达	2021 年 7 月 6 日	6.96	10,000.00	69,600.00
143	600751	海航科技	2021 年 7 月 7 日 -2021 年 7 月 9 日	2.78	20,000.00	55,600.00
144	300212	易华录	2021 年 7 月 8 日	26.91	500.00	13,455.00
合计	-	-	-	-	4,626,403.00	89,251,513.75

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

### 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，本基金主要投资于信用等级较高的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。但是，随着短期资金市场的发展，本基金的投资范围扩大以后，可能会在一定程度上增加信用风险。

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均无按短期信用评级列示的债券投资。

#### 6.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年6月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA 以下	956,557.28	1,034,265.10
未评级	-	-
合计	956,557.28	1,034,265.10

注：1、债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2、以上未评级的债券为期限在一年以上的国债、政策性金融债、央行票据。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

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。

##### 6.4.13.3.1 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、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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	7,858,362.67	-	-	-	7,858,362.67
结算备付金	1,262,748.84	-	-	-	1,262,748.84
存出保证金	111,098.05	-	-	-	111,098.05
交易性金融资产	956,557.28	-	-	1,850,389,880.53	1,851,346,437.81
应收证券清算款	-	-	-	14,233,222.92	14,233,222.92
应收利息	-	-	-	78,974.13	78,974.13
应收股利	-	-	-	27,722.07	27,722.07
资产总计	10,188,766.84	-	-	1,864,729,799.65	1,874,918,566.49
<b>负债：</b>					
应付证券清算款	-	-	-	10,603,825.43	10,603,825.43
应付管理人报酬	-	-	-	831,938.03	831,938.03
应付托管费	-	-	-	166,387.60	166,387.60
应付交易费用	-	-	-	606,752.72	606,752.72
应交税费	-	-	-	4,757.11	4,757.11
其他负债	-	-	-	3,321,277.71	3,321,277.71
负债总计	-	-	-	15,534,938.60	15,534,938.60
利率敏感度缺口	10,188,766.84	-	-	1,849,194,861.05	1,859,383,627.89
<b>上年度末 2020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	10,908,601.00	-	-	-	10,908,601.00
结算备付金	230,617.29	-	-	-	230,617.29
存出保证金	107,650.84	-	-	-	107,650.84
交易性金融资产	1,034,265.10	-	-	1,517,435,618.48	1,518,469,883.58
应收证券清算款	-	-	-	1,570,672.31	1,570,672.31
应收利息	-	-	-	59,020.46	59,020.46
资产总计	12,281,134.23	-	-	1,519,065,311.25	1,531,346,445.48
<b>负债：</b>					
应付管理人报酬	-	-	-	638,293.16	638,293.16
应付托管费	-	-	-	127,658.64	127,658.64
应付交易费用	-	-	-	388,107.61	388,107.61
应交税费	-	-	-	5,840.07	5,840.07
其他负债	-	-	-	998,025.16	998,025.16
负债总计	-	-	-	2,157,924.64	2,157,924.64
利率敏感度缺口	12,281,134.23	-	-	1,516,907,386.61	1,529,188,520.84

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末未持有外汇资产，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、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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 6 月 30 日		上年度末 2020 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	1,850,389,880.53	99.52	1,517,435,618.48	99.23
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	956,557.28	0.05	1,034,265.10	0.07
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	1,851,346,437.81	99.57	1,518,469,883.58	99.30

#### 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 2021 年 6 月 30 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
	上升 5%	96,566,436.07	76,669,325.52
	下降 5%	-96,566,436.07	-76,669,325.52

注：上年度末的假设条件为“除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变”。

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 1、公允价值

###### (1) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值接近于公允价值。

###### (2) 以公允价值计量的金融工具

###### (i) 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。

(ii) 各层次金融工具公允价值

于 2021 年 6 月 30 日，本基金持有的以公允价值计量的金融工具中属于第一层次的余额为人民币 1,826,555,986.37 元，属于第二层次的余额为人民币 24,790,451.44 元，无属于第三层次的金额(2020 年 12 月 31 日：属于第一层次的余额为人民币 1,515,210,460.83 元，属于第二层次的余额为人民币 3,259,422.75 元，无属于第三层次的金额)。

(iii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃、或属于非公开发行等情况，本基金分别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证券的公允价值列入第二层次或第三层次，上述事项解除时将相关证券的公允价值列入第一层次。

2、除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,850,389,880.53	98.69
	其中：股票	1,850,389,880.53	98.69
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	956,557.28	0.05
	其中：债券	956,557.28	0.05
	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	9,121,111.51	0.49
8	其他各项资产	14,451,017.17	0.77

9	合计	1,874,918,566.49	100.00
---	----	------------------	--------

注：（1）上表中的股票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。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 89,251,513.75 元，占基金资产净值比例 4.80%。

## 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	5,439.50	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,242,006,115.63	66.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,160,036.60	0.28
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	12,178,085.64	0.65
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	586,698,724.88	31.55
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	1,984,113.30	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	144,367.61	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	1,181,950.00	0.06
S	综合	1,005,676.00	0.05
	合计	1,850,389,880.53	99.52

### 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	002415	海康威视	1,543,534	99,557,943.00	5.35
2	002475	立讯精密	1,615,676	74,321,096.00	4.00
3	000725	京东方 A	11,188,600	69,816,864.00	3.75
4	603501	韦尔股份	174,836	56,297,192.00	3.03
5	300782	卓胜微	77,864	41,851,900.00	2.25
6	002230	科大讯飞	586,557	39,639,522.06	2.13
7	000100	TCL 科技	4,636,000	35,465,400.00	1.91
8	002241	歌尔股份	789,560	33,745,794.40	1.81
9	603986	兆易创新	175,188	32,917,825.20	1.77
10	600703	三安光电	888,976	28,491,680.80	1.53
11	600570	恒生电子	277,192	25,848,154.00	1.39
12	002371	北方华创	82,943	23,006,729.34	1.24
13	688111	金山办公	58,200	22,977,360.00	1.24
14	002049	紫光国微	141,082	21,753,433.58	1.17
15	002410	广联达	313,982	21,413,572.40	1.15
16	600588	用友网络	539,620	17,947,761.20	0.97
17	300454	深信服	68,671	17,818,751.08	0.96
18	600584	长电科技	410,663	15,473,781.84	0.83
19	300408	三环集团	359,700	15,258,474.00	0.82
20	300496	中科创达	96,772	15,199,010.32	0.82
21	600460	士兰微	267,100	15,051,085.00	0.81
22	300433	蓝思科技	492,937	14,497,277.17	0.78
23	688012	中微公司	86,813	14,404,012.96	0.77
24	002179	中航光电	181,558	14,346,713.16	0.77
25	300661	圣邦股份	53,989	13,644,639.97	0.73
26	002841	视源股份	109,771	13,643,437.59	0.73
27	002236	大华股份	592,797	12,508,016.70	0.67
28	002185	华天科技	723,552	11,135,465.28	0.60
29	002555	三七互娱	440,000	10,568,800.00	0.57
30	000938	紫光股份	471,526	10,316,988.88	0.55
31	603160	汇顶科技	76,234	9,882,213.42	0.53
32	000977	浪潮信息	337,454	9,492,581.02	0.51
33	002384	东山精密	452,800	9,436,352.00	0.51
34	688008	澜起科技	150,600	9,394,428.00	0.51
35	603019	中科曙光	336,708	9,296,507.88	0.50

36	002624	完美世界	385,243	9,211,160.13	0.50
37	300339	润和软件	211,600	9,174,976.00	0.49
38	600183	生益科技	378,850	8,868,878.50	0.48
39	002405	四维图新	602,335	8,854,324.50	0.48
40	601360	三六零	709,500	8,662,995.00	0.47
41	002600	领益智造	932,840	8,572,799.60	0.46
42	000066	中国长城	581,547	8,490,586.20	0.46
43	002138	顺络电子	214,389	8,311,861.53	0.45
44	002938	鹏鼎控股	228,301	8,191,439.88	0.44
45	000988	华工科技	338,784	7,968,199.68	0.43
46	002602	世纪华通	1,230,980	7,902,891.60	0.43
47	603444	吉比特	14,861	7,876,330.00	0.42
48	688396	华润微	85,481	7,780,480.62	0.42
49	300458	全志科技	88,655	7,771,497.30	0.42
50	002212	天融信	392,161	7,753,022.97	0.42
51	603893	瑞芯微	54,800	7,642,408.00	0.41
52	600845	宝信软件	148,475	7,557,377.50	0.41
53	688099	晶晨股份	65,500	7,349,100.00	0.40
54	000733	振华科技	118,857	7,258,596.99	0.39
55	002402	和而泰	301,710	7,231,988.70	0.39
56	002916	深南电路	64,768	7,197,667.84	0.39
57	002439	启明星辰	246,768	7,158,739.68	0.39
58	000636	风华高科	236,200	7,137,964.00	0.38
59	688002	睿创微纳	71,318	7,119,675.94	0.38
60	600563	法拉电子	43,846	6,943,452.56	0.37
61	002180	纳思达	214,257	6,899,075.40	0.37
62	603613	国联股份	68,504	6,848,344.88	0.37
63	300088	长信科技	811,493	6,702,932.18	0.36
64	300327	中颖电子	75,355	6,422,506.65	0.35
65	002456	欧菲光	711,050	6,314,124.00	0.34
66	300223	北京君正	62,009	6,257,948.28	0.34
67	603678	火炬电子	92,400	6,237,000.00	0.34
68	002463	沪电股份	400,067	6,189,036.49	0.33
69	300671	富满电子	46,776	6,157,592.64	0.33
70	000021	深科技	309,400	5,921,916.00	0.32
71	002139	拓邦股份	328,076	5,902,087.24	0.32
72	002273	水晶光电	401,042	5,891,306.98	0.32
73	603267	鸿远电子	45,360	5,802,451.20	0.31
74	300168	万达信息	393,340	5,742,764.00	0.31
75	000050	深天马 A	404,850	5,740,773.00	0.31
76	600171	上海贝岭	188,500	5,736,055.00	0.31
77	300390	天华超净	115,241	5,535,025.23	0.30
78	600536	中国软件	96,902	5,516,630.86	0.30
79	002436	兴森科技	491,542	5,406,962.00	0.29

80	002558	巨人网络	402,621	5,354,859.30	0.29
81	002152	广电运通	409,339	5,333,687.17	0.29
82	603290	斯达半导	16,600	5,312,000.00	0.29
83	300271	华宇软件	275,122	5,296,098.50	0.28
84	300296	利亚德	671,815	5,253,593.30	0.28
85	002156	通富微电	218,333	5,248,725.32	0.28
86	002373	千方科技	313,609	5,237,270.30	0.28
87	300373	扬杰科技	85,613	5,183,011.02	0.28
88	600905	三峡能源	907,763	5,147,016.21	0.28
89	300383	光环新网	356,297	5,127,113.83	0.28
90	688208	道通科技	56,700	4,932,333.00	0.27
91	002065	东华软件	617,600	4,897,568.00	0.26
92	300115	长盈精密	237,671	4,896,022.60	0.26
93	603005	晶方科技	81,771	4,843,296.33	0.26
94	600271	航天信息	367,190	4,784,485.70	0.26
95	600100	同方股份	782,600	4,781,686.00	0.26
96	688126	沪硅产业-U	163,000	4,756,340.00	0.26
97	300623	捷捷微电	121,612	4,600,581.96	0.25
98	688188	柏楚电子	10,400	4,534,400.00	0.24
99	300418	昆仑万维	272,100	4,456,998.00	0.24
100	300379	东方通	151,210	4,307,972.90	0.23
101	300604	长川科技	62,186	4,241,707.06	0.23
102	300502	新易盛	134,514	4,203,562.50	0.23
103	002174	游族网络	241,887	4,153,199.79	0.22
104	300346	南大光电	106,833	4,132,300.44	0.22
105	000997	新大陆	242,812	4,028,251.08	0.22
106	688200	华峰测控	8,500	4,023,305.00	0.22
107	300476	胜宏科技	179,599	3,924,238.15	0.21
108	300672	国科微	34,560	3,923,596.80	0.21
109	300315	掌趣科技	910,426	3,869,310.50	0.21
110	688023	安恒信息	15,290	3,853,080.00	0.21
111	002195	二三四五	1,890,469	3,837,652.07	0.21
112	002268	卫士通	196,226	3,822,482.48	0.21
113	300017	网宿科技	649,263	3,798,188.55	0.20
114	300773	拉卡拉	132,500	3,740,475.00	0.20
115	601231	环旭电子	217,760	3,660,545.60	0.20
116	603927	中科软	85,000	3,650,750.00	0.20
117	000158	常山北明	317,300	3,645,777.00	0.20
118	688088	虹软科技	64,600	3,601,450.00	0.19
119	300212	易华录	132,391	3,562,641.81	0.19
120	002153	石基信息	149,720	3,519,917.20	0.19
121	300348	长亮科技	190,975	3,494,842.50	0.19
122	600728	佳都科技	462,646	3,428,206.86	0.18
123	600363	联创光电	122,500	3,411,625.00	0.18

124	300567	精测电子	54,800	3,364,720.00	0.18
125	000034	神州数码	153,800	3,360,530.00	0.18
126	300166	东方国信	268,614	3,320,069.04	0.18
127	002387	维信诺	316,665	3,302,815.95	0.18
128	300036	超图软件	150,662	3,293,471.32	0.18
129	002745	木林森	245,100	3,284,340.00	0.18
130	002036	联创电子	245,860	3,233,059.00	0.17
131	300613	富瀚微	20,692	3,225,468.96	0.17
132	688018	乐鑫科技	13,800	3,221,196.00	0.17
133	300456	赛微电子	104,779	3,159,086.85	0.17
134	300002	神州泰岳	649,286	3,149,037.10	0.17
135	603000	人民网	182,502	3,137,209.38	0.17
136	000413	东旭光电	1,449,815	3,015,615.20	0.16
137	300226	上海钢联	49,970	2,975,713.50	0.16
138	300369	绿盟科技	184,633	2,944,896.35	0.16
139	300077	国民技术	184,200	2,943,516.00	0.16
140	002261	拓维信息	286,500	2,913,705.00	0.16
141	600410	华胜天成	362,674	2,814,350.24	0.15
142	603039	泛微网络	42,241	2,811,138.55	0.15
143	600206	有研新材	196,300	2,807,090.00	0.15
144	600718	东软集团	286,414	2,801,128.92	0.15
145	300663	科蓝软件	72,350	2,778,963.50	0.15
146	603068	博通集成	33,600	2,765,280.00	0.15
147	300188	美亚柏科	158,788	2,762,911.20	0.15
148	002063	远光软件	348,810	2,759,087.10	0.15
149	300323	华灿光电	245,800	2,703,800.00	0.15
150	002368	太极股份	134,539	2,698,852.34	0.15
151	600446	金证股份	186,708	2,696,063.52	0.14
152	300131	英唐智控	352,608	2,693,925.12	0.14
153	000970	中科三环	280,329	2,677,141.95	0.14
154	300352	北信源	383,779	2,671,101.84	0.14
155	002214	大立科技	139,207	2,664,421.98	0.14
156	605111	新洁能	14,700	2,649,969.00	0.14
157	688158	优刻得-W	67,459	2,647,765.75	0.14
158	600850	电科数字	97,621	2,626,981.11	0.14
159	600330	天通股份	264,140	2,591,213.40	0.14
160	300666	江丰电子	51,500	2,568,305.00	0.14
161	002876	三利谱	39,274	2,541,027.80	0.14
162	300598	诚迈科技	30,089	2,514,537.73	0.14
163	002484	江海股份	162,361	2,513,348.28	0.14
164	688368	晶丰明源	7,485	2,509,421.10	0.13
165	300674	宇信科技	131,400	2,455,866.00	0.13
166	300679	电连技术	84,432	2,433,330.24	0.13
167	688007	光峰科技	57,100	2,391,348.00	0.13

168	002079	苏州固锴	186,900	2,354,940.00	0.13
169	603025	大豪科技	61,200	2,351,304.00	0.13
170	300866	安克创新	14,000	2,344,580.00	0.13
171	000555	神州信息	160,261	2,318,976.67	0.12
172	600360	华微电子	254,135	2,302,463.10	0.12
173	600797	浙大网新	340,844	2,276,837.92	0.12
174	603228	景旺电子	85,571	2,241,960.20	0.12
175	300377	赢时胜	199,387	2,221,171.18	0.12
176	002217	合力泰	617,816	2,205,603.12	0.12
177	300102	乾照光电	233,132	2,165,796.28	0.12
178	688037	芯源微	14,529	2,164,821.00	0.12
179	002517	恺英网络	498,044	2,151,550.08	0.12
180	002803	吉宏股份	75,600	2,145,528.00	0.12
181	002859	洁美科技	68,000	2,126,360.00	0.11
182	002106	莱宝高科	186,635	2,099,643.75	0.11
183	300287	飞利信	379,786	2,092,620.86	0.11
184	600131	国网信通	156,800	2,076,032.00	0.11
185	300113	顺网科技	159,526	2,064,266.44	0.11
186	300085	银之杰	116,473	2,055,748.45	0.11
187	300184	力源信息	311,500	1,981,140.00	0.11
188	603881	数据港	54,044	1,956,392.80	0.11
189	002421	达实智能	509,320	1,955,788.80	0.11
190	300319	麦捷科技	159,885	1,926,614.25	0.10
191	300232	洲明科技	215,560	1,924,950.80	0.10
192	002177	御银股份	251,700	1,910,403.00	0.10
193	600556	天下秀	178,900	1,889,184.00	0.10
194	300459	金科文化	581,954	1,879,711.42	0.10
195	300219	鸿利智汇	141,100	1,862,520.00	0.10
196	600633	浙数文化	258,559	1,856,453.62	0.10
197	002649	博彦科技	175,389	1,841,584.50	0.10
198	002222	福晶科技	112,500	1,823,625.00	0.10
199	000851	高鸿股份	269,156	1,789,887.40	0.10
200	000503	国新健康	237,200	1,757,652.00	0.09
201	605358	立昂微	15,200	1,756,816.00	0.09
202	300303	聚飞光电	344,600	1,754,014.00	0.09
203	300170	汉得信息	233,053	1,740,905.91	0.09
204	300053	欧比特	185,650	1,724,688.50	0.09
205	300324	旋极信息	400,821	1,707,497.46	0.09
206	002913	奥士康	21,900	1,707,105.00	0.09
207	603989	艾华集团	52,172	1,700,285.48	0.09
208	300078	思创医惠	229,027	1,694,799.80	0.09
209	688299	长阳科技	62,730	1,692,455.40	0.09
210	300682	朗新科技	100,200	1,685,364.00	0.09
211	300624	万兴科技	28,680	1,680,074.40	0.09

212	300046	台基股份	54,360	1,673,200.80	0.09
213	600751	海航科技	594,100	1,651,598.00	0.09
214	300525	博思软件	92,750	1,646,312.50	0.09
215	002449	国星光电	162,543	1,641,684.30	0.09
216	300031	宝通科技	104,100	1,640,616.00	0.09
217	300394	天孚通信	64,657	1,637,115.24	0.09
218	002119	康强电子	98,159	1,627,476.22	0.09
219	002425	凯撒文化	189,840	1,588,960.80	0.09
220	300738	奥飞数据	76,292	1,586,110.68	0.09
221	002288	超华科技	216,800	1,573,968.00	0.08
222	300735	光弘科技	128,142	1,558,206.72	0.08
223	300708	聚灿光电	49,300	1,557,387.00	0.08
224	002636	金安国纪	94,973	1,540,462.06	0.08
225	000676	智度股份	253,360	1,537,895.20	0.08
226	300378	鼎捷软件	70,843	1,520,999.21	0.08
227	300602	飞荣达	84,569	1,505,328.20	0.08
228	300075	数字政通	127,461	1,500,215.97	0.08
229	002544	杰赛科技	112,395	1,499,349.30	0.08
230	300566	激智科技	53,487	1,497,101.13	0.08
231	300768	迪普科技	38,700	1,494,981.00	0.08
232	002960	青鸟消防	56,878	1,487,928.48	0.08
233	300687	赛意信息	69,520	1,485,642.40	0.08
234	300659	中孚信息	44,200	1,483,794.00	0.08
235	300020	银江股份	172,840	1,476,053.60	0.08
236	300114	中航电测	96,500	1,466,800.00	0.08
237	002605	姚记科技	66,700	1,458,729.00	0.08
238	603888	新华网	68,850	1,457,554.50	0.08
239	300572	安车检测	44,720	1,450,716.80	0.08
240	002815	崇达技术	115,400	1,440,192.00	0.08
241	300007	汉威科技	78,147	1,434,778.92	0.08
242	600756	浪潮软件	106,405	1,432,211.30	0.08
243	300806	斯迪克	30,020	1,422,948.00	0.08
244	002376	新北洋	155,319	1,419,615.66	0.08
245	002055	得润电子	108,901	1,413,534.98	0.08
246	600552	凯盛科技	202,600	1,401,992.00	0.08
247	000823	超声电子	124,209	1,394,867.07	0.08
248	300790	宇瞳光学	40,800	1,384,344.00	0.07
249	002912	中新赛克	33,530	1,373,724.10	0.07
250	300582	英飞特	58,600	1,367,724.00	0.07
251	300657	弘信电子	79,816	1,352,881.20	0.07
252	002635	安洁科技	92,453	1,352,587.39	0.07
253	300579	数字认证	28,350	1,345,774.50	0.07
254	300331	苏大维格	51,901	1,326,589.56	0.07
255	300709	精研科技	30,808	1,314,577.36	0.07



256	300256	星星科技	253,451	1,310,341.67	0.07
257	300010	豆神教育	228,757	1,297,052.19	0.07
258	002777	久远银海	73,090	1,292,962.10	0.07
259	688318	财富趋势	6,900	1,290,300.00	0.07
260	300460	惠伦晶体	54,400	1,286,560.00	0.07
261	300541	先进数通	81,863	1,283,611.84	0.07
262	300229	拓尔思	143,004	1,282,745.88	0.07
263	300368	汇金股份	104,701	1,278,399.21	0.07
264	600640	号百控股	104,400	1,272,636.00	0.07
265	300248	新开普	127,327	1,252,897.68	0.07
266	300480	光力科技	48,900	1,251,840.00	0.07
267	002530	金财互联	129,000	1,248,720.00	0.07
268	300468	四方精创	65,641	1,246,522.59	0.07
269	300366	创意信息	139,600	1,245,232.00	0.07
270	300465	高伟达	102,462	1,243,888.68	0.07
271	300551	古鳌科技	81,200	1,240,736.00	0.07
272	688181	八亿时空	23,259	1,236,681.03	0.07
273	300099	精准信息	155,701	1,236,265.94	0.07
274	300047	天源迪科	167,805	1,224,976.50	0.07
275	300297	蓝盾股份	288,198	1,221,959.52	0.07
276	002298	中电兴发	170,600	1,218,084.00	0.07
277	603533	掌阅科技	42,700	1,216,950.00	0.07
278	300766	每日互动	80,132	1,201,178.68	0.06
279	688066	航天宏图	29,014	1,195,086.66	0.06
280	300386	飞天诚信	69,343	1,194,779.89	0.06
281	300455	康拓红外	118,400	1,192,288.00	0.06
282	300364	中文在线	192,500	1,181,950.00	0.06
283	300065	海兰信	104,400	1,166,148.00	0.06
284	300349	金卡智能	98,174	1,151,581.02	0.06
285	603738	泰晶科技	33,200	1,146,064.00	0.06
286	300227	光韵达	114,540	1,133,946.00	0.06
287	300448	浩云科技	137,855	1,130,411.00	0.06
288	603636	南威软件	116,866	1,125,419.58	0.06
289	002655	共达电声	118,700	1,118,154.00	0.06
290	300523	辰安科技	45,430	1,102,131.80	0.06
291	300128	锦富技术	288,367	1,101,561.94	0.06
292	300096	易联众	113,201	1,099,181.71	0.06
293	300130	新国都	95,864	1,096,684.16	0.06
294	002315	焦点科技	60,488	1,094,832.80	0.06
295	002104	恒宝股份	184,200	1,090,464.00	0.06
296	003021	兆威机电	17,780	1,086,002.40	0.06
297	002161	远望谷	196,016	1,074,167.68	0.06
298	300310	宜通世纪	232,381	1,073,600.22	0.06
299	300205	天喻信息	86,325	1,062,660.75	0.06

300	002724	海洋王	78,000	1,061,580.00	0.06
301	002993	奥海科技	24,362	1,060,965.10	0.06
302	002609	捷顺科技	105,702	1,058,077.02	0.06
303	300259	新天科技	232,440	1,057,602.00	0.06
304	002453	华软科技	154,600	1,057,464.00	0.06
305	300066	三川智慧	207,050	1,053,884.50	0.06
306	300299	富春股份	182,590	1,053,544.30	0.06
307	002474	榕基软件	163,501	1,051,311.43	0.06
308	300311	任子行	177,705	1,050,236.55	0.06
309	300552	万集科技	31,379	1,044,293.12	0.06
310	603859	能科股份	28,700	1,040,949.00	0.06
311	002093	国脉科技	165,614	1,038,399.78	0.06
312	002970	锐明技术	23,900	1,037,499.00	0.06
313	300302	同有科技	95,602	1,031,545.58	0.06
314	300520	科大国创	47,740	1,028,797.00	0.06
315	002657	中科金财	90,398	1,026,921.28	0.06
316	688020	方邦股份	11,044	1,026,760.68	0.06
317	002017	东信和平	89,700	1,025,271.00	0.06
318	300359	全通教育	166,700	1,023,538.00	0.06
319	688123	聚辰股份	20,800	1,019,200.00	0.05
320	002331	皖通科技	82,600	1,015,154.00	0.05
321	000948	南天信息	76,120	1,012,396.00	0.05
322	603936	博敏电子	85,376	1,011,705.60	0.05
323	603890	春秋电子	78,012	1,007,915.04	0.05
324	000532	华金资本	68,600	1,005,676.00	0.05
325	002197	证通电子	136,715	1,003,488.10	0.05
326	300120	经纬辉开	106,700	1,001,913.00	0.05
327	600855	航天长峰	74,700	995,004.00	0.05
328	603920	世运电路	70,740	992,482.20	0.05
329	002362	汉王科技	47,900	986,740.00	0.05
330	603328	依顿电子	132,282	985,500.90	0.05
331	300241	瑞丰光电	133,300	982,421.00	0.05
332	002253	川大智胜	58,500	981,630.00	0.05
333	603186	华正新材	26,700	973,482.00	0.05
334	003026	中晶科技	10,300	969,333.00	0.05
335	300300	海峡创新	153,925	963,570.50	0.05
336	603700	宁水集团	39,400	953,086.00	0.05
337	300543	朗科智能	62,000	947,360.00	0.05
338	300081	恒信东方	122,330	943,164.30	0.05
339	688003	天准科技	26,700	938,505.00	0.05
340	300231	银信科技	116,576	927,944.96	0.05
341	300245	天玑科技	102,700	921,219.00	0.05
342	300634	彩讯股份	43,200	917,568.00	0.05
343	300667	必创科技	38,450	913,572.00	0.05

344	002338	奥普光电	47,000	912,740.00	0.05
345	300571	平治信息	25,750	908,975.00	0.05
346	300333	兆日科技	110,503	905,019.57	0.05
347	688025	杰普特	19,129	901,167.19	0.05
348	002308	威创股份	210,672	895,356.00	0.05
349	688233	神工股份	16,525	892,350.00	0.05
350	603626	科森科技	96,200	875,420.00	0.05
351	300785	值得买	9,210	874,950.00	0.05
352	300648	星云股份	27,900	873,828.00	0.05
353	300513	恒实科技	83,860	861,242.20	0.05
354	002579	中京电子	81,480	859,614.00	0.05
355	002642	荣联科技	176,800	859,248.00	0.05
356	688086	紫晶存储	34,000	858,840.00	0.05
357	300494	盛天网络	55,200	854,496.00	0.05
358	600571	信雅达	115,801	849,979.34	0.05
359	300531	优博讯	54,400	848,640.00	0.05
360	002279	久其软件	163,632	847,613.76	0.05
361	002990	盛视科技	26,100	844,596.00	0.05
362	603258	电魂网络	33,000	844,470.00	0.05
363	300872	天阳科技	23,200	842,160.00	0.05
364	002189	中光学	51,614	838,727.50	0.05
365	002869	金溢科技	34,650	820,512.00	0.04
366	300317	珈伟新能	108,300	812,250.00	0.04
367	300365	恒华科技	99,000	811,800.00	0.04
368	300043	星辉娱乐	246,600	811,314.00	0.04
369	300050	世纪鼎利	149,101	802,163.38	0.04
370	603660	苏州科达	115,132	801,318.72	0.04
371	002232	启明信息	67,778	801,135.96	0.04
372	603383	顶点软件	27,456	780,574.08	0.04
373	688258	卓易信息	15,000	777,300.00	0.04
374	600071	凤凰光学	55,600	772,840.00	0.04
375	300603	立昂技术	70,009	770,099.00	0.04
376	300799	左江科技	14,050	769,940.00	0.04
377	300802	矩子科技	22,400	760,480.00	0.04
378	300493	润欣科技	95,250	760,095.00	0.04
379	002845	同兴达	29,600	758,352.00	0.04
380	603232	格尔软件	45,266	755,489.54	0.04
381	300290	荣科科技	148,450	749,672.50	0.04
382	300288	朗玛信息	67,200	747,264.00	0.04
383	002987	京北方	23,280	743,796.00	0.04
384	002782	可立克	63,100	738,901.00	0.04
385	300647	超频三	71,500	735,735.00	0.04
386	600876	洛阳玻璃	38,500	734,965.00	0.04
387	603528	多伦科技	83,700	715,635.00	0.04

388	300686	智动力	43,080	709,096.80	0.04
389	603595	东尼电子	26,700	705,681.00	0.04
390	300249	依米康	100,200	702,402.00	0.04
391	300706	阿石创	24,300	699,111.00	0.04
392	002137	实益达	114,116	690,401.80	0.04
393	002095	生意宝	49,613	687,636.18	0.04
394	000045	深纺织 A	76,100	682,617.00	0.04
395	603220	中贝通信	55,500	681,540.00	0.04
396	002819	东方中科	22,000	672,540.00	0.04
397	688030	山石网科	24,879	671,733.00	0.04
398	300771	智莱科技	27,580	669,642.40	0.04
399	300467	迅游科技	46,400	657,024.00	0.04
400	300870	欧陆通	10,500	656,460.00	0.04
401	300148	天舟文化	194,800	654,528.00	0.04
402	002866	传艺科技	46,630	649,555.90	0.03
403	300449	汉邦高科	79,580	639,823.20	0.03
404	688010	福光股份	21,200	630,700.00	0.03
405	603516	淳中科技	29,420	626,646.00	0.03
406	603189	网达软件	35,400	625,518.00	0.03
407	300518	盛讯达	14,000	623,280.00	0.03
408	300516	久之洋	18,600	617,706.00	0.03
409	002962	五方光电	47,940	612,673.20	0.03
410	002947	恒铭达	22,690	612,630.00	0.03
411	300787	海能实业	21,060	602,105.40	0.03
412	002401	中远海科	50,800	600,964.00	0.03
413	300925	法本信息	22,760	598,360.40	0.03
414	300533	冰川网络	29,600	597,624.00	0.03
415	300857	协创数据	21,400	597,488.00	0.03
416	688051	佳华科技	8,000	594,400.00	0.03
417	300341	麦克奥迪	67,700	593,052.00	0.03
418	300701	森霸传感	24,850	588,199.50	0.03
419	000004	国华网安	31,500	584,640.00	0.03
420	003028	振邦智能	11,300	583,080.00	0.03
421	300042	朗科科技	38,800	574,628.00	0.03
422	688138	清溢光电	27,600	572,700.00	0.03
423	300903	科翔股份	17,800	570,668.00	0.03
424	300277	海联讯	66,600	556,776.00	0.03
425	300127	银河磁体	30,702	537,592.02	0.03
426	300542	新晨科技	38,725	535,566.75	0.03
427	603380	易德龙	22,200	533,244.00	0.03
428	300561	汇金科技	42,602	529,116.84	0.03
429	002881	美格智能	19,100	527,160.00	0.03
430	300678	中科信息	23,060	522,539.60	0.03
431	688001	华兴源创	13,600	516,256.00	0.03

432	603106	恒银科技	87,035	501,321.60	0.03
433	300884	狄耐克	18,600	499,968.00	0.03
434	002980	华盛昌	13,800	496,110.00	0.03
435	300862	蓝盾光电	13,600	493,136.00	0.03
436	300852	四会富仕	10,540	486,842.60	0.03
437	300831	派瑞股份	30,400	486,704.00	0.03
438	300155	安居宝	72,300	478,626.00	0.03
439	300632	光莆股份	29,040	463,768.80	0.02
440	300812	易天股份	19,240	463,684.00	0.02
441	300939	秋田微	8,300	461,314.00	0.02
442	300559	佳发教育	52,390	459,460.30	0.02
443	300847	中船汉光	27,900	453,654.00	0.02
444	002983	芯瑞达	14,700	448,938.00	0.02
445	300909	汇创达	10,400	448,240.00	0.02
446	300462	华铭智能	36,248	446,937.84	0.02
447	003029	吉大正元	18,700	445,808.00	0.02
448	603138	海量数据	32,830	442,548.40	0.02
449	300822	贝仕达克	16,600	441,560.00	0.02
450	300739	明阳电路	26,175	436,860.75	0.02
451	300916	朗特智能	6,650	435,708.00	0.02
452	003005	竞业达	11,000	430,540.00	0.02
453	002577	雷柏科技	36,300	425,436.00	0.02
454	603133	碳元科技	40,777	421,634.18	0.02
455	300935	盈建科	5,800	421,312.00	0.02
456	300880	迦南智能	16,580	420,468.80	0.02
457	603327	福蓉科技	27,700	417,993.00	0.02
458	300560	中富通	28,560	409,836.00	0.02
459	300895	铜牛信息	12,000	408,120.00	0.02
460	300843	胜蓝股份	15,400	393,470.00	0.02
461	300889	爱克股份	16,146	392,347.80	0.02
462	688058	宝兰德	4,184	387,020.00	0.02
463	300882	万胜智能	21,140	368,893.00	0.02
464	003019	宸展光电	13,200	357,192.00	0.02
465	605058	澳弘电子	14,800	348,392.00	0.02
466	300399	天利科技	27,300	345,891.00	0.02
467	300752	隆利科技	19,900	344,270.00	0.02
468	003015	日久光电	26,400	340,560.00	0.02
469	300846	首都在线	18,400	334,512.00	0.02
470	300902	国安达	13,251	312,193.56	0.02
471	605218	伟时电子	22,000	311,740.00	0.02
472	002992	宝明科技	18,600	307,830.00	0.02
473	002995	天地在线	9,400	292,810.00	0.02
474	605258	协和电子	9,100	292,565.00	0.02
475	300830	金现代	27,000	277,020.00	0.01

476	301009	可靠股份	8,007	265,037.97	0.01
477	002981	朝阳科技	9,900	248,292.00	0.01
478	300897	山科智能	7,000	245,910.00	0.01
479	688365	光云科技	12,400	235,972.00	0.01
480	605118	力鼎光电	15,400	220,528.00	0.01
481	300845	捷安高科	9,600	218,880.00	0.01
482	300957	贝泰妮	787	198,292.52	0.01
483	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.01
484	300996	普联软件	2,410	132,487.34	0.01
485	688345	博力威	2,332	129,495.96	0.01
486	300614	百川畅银	2,283	121,380.30	0.01
487	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
488	688499	利元亨	2,149	83,488.65	0.00
489	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
490	301018	申菱环境	7,811	64,753.19	0.00
491	688676	金盘科技	3,750	60,900.00	0.00
492	688117	圣诺生物	1,672	60,141.84	0.00
493	300992	泰福泵业	1,998	55,828.42	0.00
494	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
495	688195	腾景科技	2,693	53,509.91	0.00
496	300981	中红医疗	515	46,550.85	0.00
497	300894	火星人	628	42,704.00	0.00
498	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
499	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
500	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
501	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
502	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
503	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
504	300968	格林精密	1,162	14,025.34	0.00
505	300940	南极光	307	13,317.66	0.00
506	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
507	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
508	603171	税友股份	637	12,230.40	0.00
509	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
510	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
511	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
512	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
513	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
514	300962	中金辐照	576	9,429.12	0.00
515	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
516	301016	雷尔伟	275	9,069.50	0.00
517	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
518	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
519	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00

520	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
521	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
522	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
523	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
524	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
525	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
526	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
527	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
528	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
529	300971	博亚精工	245	6,931.05	0.00
530	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
531	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
532	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
533	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
534	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
535	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
536	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
537	605011	杭州热电	525	4,662.00	0.00
538	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
539	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
540	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
541	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000100	TCL 科技	42,268,768.91	2.76
2	688111	金山办公	34,666,407.57	2.27
3	603501	韦尔股份	28,688,496.21	1.88
4	600570	恒生电子	12,877,889.02	0.84
5	002415	海康威视	12,361,542.61	0.81
6	600703	三安光电	12,236,518.91	0.80
7	603986	兆易创新	11,538,278.00	0.75
8	300782	卓胜微	11,350,794.00	0.74
9	600588	用友网络	10,377,637.93	0.68
10	688012	中微公司	9,569,214.95	0.63
11	000725	京东方 A	9,535,684.00	0.62
12	002212	天融信	9,385,465.43	0.61

13	688396	华润微	8,708,738.55	0.57
14	600584	长电科技	8,198,693.78	0.54
15	688208	道通科技	7,172,330.66	0.47
16	603893	瑞芯微	6,209,585.00	0.41
17	688002	睿创微纳	6,126,414.24	0.40
18	688008	澜起科技	5,912,213.84	0.39
19	601360	三六零	5,750,618.00	0.38
20	688126	沪硅产业-U	5,659,560.44	0.37

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	603501	韦尔股份	26,457,586.88	1.73
2	600570	恒生电子	16,461,271.20	1.08
3	002008	大族激光	14,390,496.61	0.94
4	600588	用友网络	13,272,561.97	0.87
5	603986	兆易创新	13,035,372.60	0.85
6	600703	三安光电	11,808,153.11	0.77
7	688012	中微公司	10,517,546.82	0.69
8	688111	金山办公	9,116,924.36	0.60
9	300308	中际旭创	8,766,772.80	0.57
10	600584	长电科技	8,484,244.68	0.55
11	688002	睿创微纳	8,147,415.31	0.53
12	688009	中国通号	7,933,740.78	0.52
13	688099	晶晨股份	7,827,599.20	0.51
14	688008	澜起科技	7,142,885.24	0.47
15	600460	士兰微	6,879,014.00	0.45
16	600667	太极实业	6,570,315.00	0.43
17	300747	锐科激光	6,543,517.50	0.43
18	603019	中科曙光	6,398,708.30	0.42
19	002690	美亚光电	6,386,689.00	0.42
20	601360	三六零	6,204,757.04	0.41

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元



买入股票成本（成交）总额	552,180,762.80
卖出股票收入（成交）总额	584,051,800.54

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	956,557.28	0.05
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	956,557.28	0.05

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	127038	国微转债	4,733	473,300.00	0.03
2	123115	捷捷转债	2,176	314,606.08	0.02
3	123116	万兴转债	1,223	122,300.00	0.01
4	128140	润建转债	420	46,351.20	0.00

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有股指期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行股指期货交易。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

- (1) 本基金本报告期末未持有国债期货。
- (2) 本基金本报告期内未进行国债期货交易。

### 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	111,098.05
2	应收证券清算款	14,233,222.92
3	应收股利	27,722.07
4	应收利息	78,974.13
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-

8	其他	-
9	合计	14,451,017.17

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128140	润建转债	46,351.20	0.00

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300782	卓胜微	14,512,500.00	0.78	转融通流通受限
2	002241	歌尔股份	1,389,050.00	0.07	转融通流通受限
3	002415	海康威视	799,800.00	0.04	转融通流通受限

## 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
		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
26,805	46,589.37	905,849,225.00	72.54%	342,978,828.00	27.46%	826,488,937.00	66.18%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国石油天然气集团有限公司企业年金计划-中国工商银行股份有限公司	33,787,000.00	2.71%
2	中华联合财产保险股份有限公司-传统保险产品	20,000,000.00	1.60%
3	方正证券股份有限公司	5,405,733.00	0.43%
4	芦京文	5,000,000.00	0.40%
5	中原农业保险股份有限公司-自有资金	3,617,100.00	0.29%
6	贵阳银行股份有限公司-爽银财富-基金精选(前沿科技)	2,097,900.00	0.17%
7	许利东	1,779,500.00	0.14%
8	中信证券股份有限公司	1,758,854.00	0.14%
9	徐中菊	1,500,000.00	0.12%
10	中国建设银行股份有限公司-长城恒康稳健养老目标一年持有期混合型发起式基金中基金(FOF)	1,242,700.00	0.10%
11	广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	826,488,937.00	66.18%

## 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（2015 年 1 月 8 日）基金份额总额	354,828,053.00
本报告期期初基金份额总额	1,096,828,053.00
本报告期基金总申购份额	746,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	594,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,248,828,053.00

## 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

本报告期内本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

### 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

本报告期内，本基金管理人、托管人的托管业务部门及其相关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	
广发证券	3	17,803.44	0.00%	16.59	0.00%	-

银河证券	2	124,875.22	0.01%	91.32	0.01%	-
海通证券	2	453,540,747.11	40.31%	331,673.40	40.31%	-
粤开证券	3	671,535,184.41	59.68%	491,095.16	59.68%	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
国金证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-

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
广发证券	1,215,600.00	31.16%	-	-	-	-
银河证券	9,424.75	0.24%	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	2,675,790.73	68.60%	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-

### 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	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-01-21
2	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2020 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-30
3	关于增加第一创业证券为旗下部分基金场内	中国证监会规定报刊及	2021-03-31

	申购赎回代理券商的公告	网站	
4	关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-03-31
5	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2021 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-04-21
6	关于广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定报刊及网站	2021-06-17

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20210101-20210630	634,752,980.00	562,773,071.00	371,037,114.00	826,488,937.00	66.18%
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《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》和《公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引》等法律法规的规定和基金合同的约定，经与基金托管人协商一致，并报中国证监会备案，本公司决定自 2021 年 3 月 31 日起，对旗下部分基金的基金合同、托管协议等法律文件进行修订。详情可见基金管理人网站（[www.gffunds.com.cn](http://www.gffunds.com.cn)）刊登的《关于旗下部分基金根据〈公开募集证券投资基金运作指引第 3 号——指数基金指引〉修改基金合同等法律文件的公告》。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1. 中国证监会批准广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
2. 《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
3. 《广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
4. 法律意见书
5. 基金管理人业务资格批件、营业执照
6. 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 <http://www.gffunds.com.cn>。

广发基金管理有限公司

二〇二一年八月三十日