

易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券 投资基金

2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 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。

本报告中财务资料已经审计。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§ 2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	6
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	7
§ 3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1	主要会计数据和财务指标	7
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4	管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
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	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9	报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§ 5	托管人报告	15
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2	托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3	托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§ 6	审计报告	15
6.1	审计意见	15
6.2	形成审计意见的基础	16
6.3	其他信息	16
6.4	管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5	注册会计师对财务报表审计的责任	16
§ 7	年度财务报表	17
7.1	资产负债表	17
7.2	利润表	19
7.3	净资产（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	23
§ 8	投资组合报告	187
8.1	期末基金资产组合情况	187
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	187
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	188

8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	190
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	192
8.6	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	192
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	192
8.8	报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	192
8.9	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	192
8.10	本基金投资股指期货的投资政策	192
8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	192
8.12	投资组合报告附注	192
§ 9	基金份额持有人信息	193
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	193
9.2	期末上市基金前十名持有人	194
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	194
9.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	195
§ 10	开放式基金份额变动	195
§ 11	重大事件揭示	195
11.1	基金份额持有人大会决议	195
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	195
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	195
11.4	基金投资策略的改变	195
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	196
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	196
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	196
11.8	其他重大事件	197
§ 12	影响投资者决策的其他重要信息	199
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	199
§ 13	备查文件目录	200
13.1	备查文件目录	200
13.2	存放地点	200
13.3	查阅方式	200

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证科创创业 50ETF
场内简称	双创 50ETF
基金主代码	159781
交易代码	159781
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 6 月 28 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	10,240,860,533.00 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	2021 年 7 月 5 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。为更好地实现投资目标，本基金管理人可投资具有较高投资价值的资产支持证券；本基金可投资股指期货、股票期权，本基金参与股指期货和股票期权交易，将根据风险管理的原则，并以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的衍生品合约进行交

	易;在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务;在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下,基金管理人可根据相关法律法规,参与融资业务,以提高投资效率及进行风险管理。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率,即中证科创创业 50 指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金,预期风险与预期收益水平高于混合型基金、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		易方达基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	郭明
	联系电话	020-85102688	010-66105799
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400 881 8088	95588
传真		020-38798812	010-66105798
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东 路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		510620	100140
法定代表人		刘晓艳	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金年度报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年 6 月 28 日(基金合同生效日)至 2021 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,349,299,185.39	-329,056,775.03
本期利润	-2,180,197,121.99	-808,992,370.72
加权平均基金份额本期利润	-0.2203	-0.1032
本期加权平均净值利润率	-33.85%	-11.64%
本期基金份额净值增长率	-28.19%	-16.26%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末
期末可供分配利润	-4,083,154,074.15	-1,357,975,200.36
期末可供分配基金份额利润	-0.3987	-0.1626
期末基金资产净值	6,157,706,458.85	6,992,885,332.64
期末基金份额净值	0.6013	0.8374
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末
基金份额累计净值增长率	-39.87%	-16.26%

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，为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。

4.本基金合同于 2021 年 6 月 28 日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标	①—③	②—④
----	----------	------------	------------	------------	-----	-----

		②		准差④		
过去三个月	4.03%	1.46%	4.22%	1.46%	-0.19%	0.00%
过去六个月	-12.54%	1.43%	-12.47%	1.43%	-0.07%	0.00%
过去一年	-28.19%	1.73%	-28.32%	1.73%	0.13%	0.00%
过去三年	-	-	-	-	-	-
过去五年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-39.87%	1.67%	-37.72%	1.69%	-2.15%	-0.02%

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

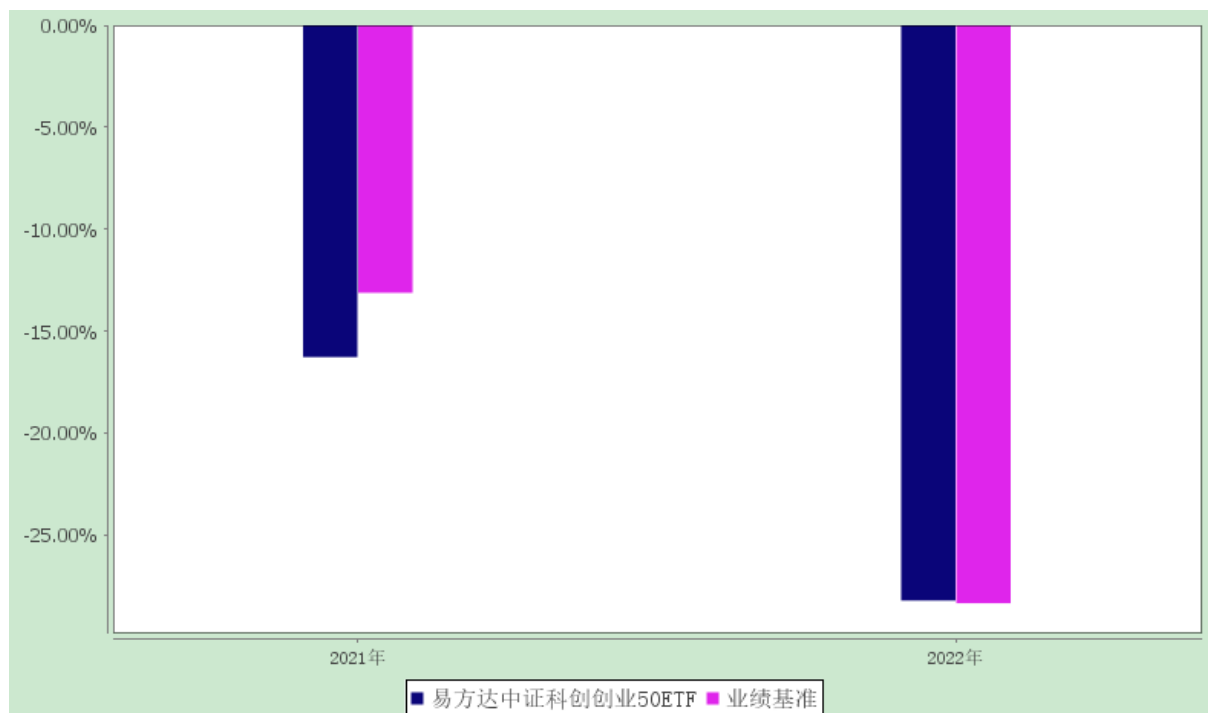
易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2021 年 6 月 28 日至 2022 年 12 月 31 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-39.87%，同期业绩比较基准收益率为-37.72%。

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

易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准历年收益率对比图



注：本基金合同生效日为2021年6月28日，合同生效当年期间的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效日（2021年6月28日）至本报告期末未发生利润分配。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4号文批准，本基金管理人成立于2001年4月17日，注册资本13,244.2万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
成曦	本基金的基金经理，易方达深证 100ETF 联接、易方达创业板 ETF 联接、易方达深证 100ETF、易方达创业板 ETF、易方达恒生国企联接 (QDII)、易方达恒生国企 (QDII-ETF)、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证创新药产业 ETF(自 2021 年 02 月 03 日至 2022 年 10 月 31 日)、易方达上证科创板 50 联接、易方达中证智能电动汽车 ETF(自 2021 年 04 月 29 日至 2022 年 10 月 31 日)、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证沪港深 300ETF、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF、易方达中证港股通中国 100ETF、易方达中证消费 50ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII) 的基金经理	2021-06-28	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华泰联合证券资产管理部研究员，易方达基金管理有限公司集中交易室交易员、指数与量化投资部指数基金运作专员、基金经理助理，易方达中小板指数 (LOF)、易方达银行分级、易方达生物分级、易方达重组分级、易方达深证成指 ETF、易方达深证成指 ETF 联接、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF、易方达原油 (QDII-LOF-FOF)、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)、易方达 MSCI 中国 A 股国际通 ETF 联接发起式、易方达上证 50ETF、易方达上证 50ETF 联接发起式、易方达中证香港证券投资主题 ETF 的基金经理。
伍臣东	本基金的基金经理，易方达中证科创创业 50 联接、易方达中证 500 质量成长 ETF、易方达中证上海环交所碳中和 ETF、易方达中证创新药产业 ETF、易方达中证智能电动汽车 ETF、易方达纳斯达克 100 指数 (QDII-LOF)、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF 的基金经理，易方达上证科创板 50 联接、易方达中证创新药产业 ETF (自 2021 年 04 月 20 日至 2022 年 10 月 31 日)、易方达上证科创板 50ETF、易方达中证稀土产业 ETF、易方达中证智能电动汽车 ETF (自 2021 年 09 月 04 日至 2022 年 10 月 31 日)、易方达中证沪港深 500ETF、易方达中证港股通医药卫生综合 ETF(自 2022 年 01 月 29 日至 2022 年 11 月 28 日)、易方达中证消费电子主题 ETF、易方达中证消费 50ETF、易方达纳斯达克 100 指数(QDII-LOF)(自 2022	2021-10-20	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司研究支持专员、指数研究员。

年 09 月 10 日至 2022 年 11 月 28 日) 的基金经理助理				
---	--	--	--	--

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

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《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，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

公司根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引(试行)》等法规和自律规则制定了《公平交易管理办法》等制度，明确公平交易的适用范围、原则和内容、管控措施、公平交易执行程序 and 分配原则、反向交易控制、公平交易效果评估及报告等。

公平交易制度所规范的范围涵盖旗下各类资产组合，围绕境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易（含银行间市场）、境外投资、衍生品等投资管理活动，贯穿投资授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等各个环节。

公平交易的管控措施和执行程序主要包括：通过建立规范的投资决策机制、共享研究资源和投资品种备选库为投资人员提供公平的投资机会；投资人员应公平对待其管理的不同投资组合，原则上应当做到“同时同价”，合理控制其所管理不同组合对同一证券的同向交易价差；建立并实行集中交易制度，交易系统具备公平交易功能，对于满足公平交易执行条件的同向指令，系统将自动启用公平交易功能，按照交易公平的原则合理分配各投资指令的执行；严格控制不同投资组合之间的同日反向交易；根据交易所场内竞价交易和非公开竞价交易的不同特点分别设定合理的交易执行程序和分配机制，通过系统与人工控制相结合的方式，力求确保所有投资组合在交易机会上得到公平、合理对待；建立事中和事后的同向交易、反向交易、异常交易监控分析机制，对发现的异常问题进行提示，并要求投资组合经理解释说明。

公司严格按照法律法规的要求禁止旗下管理的不同投资组合之间各种可能导致不公平交易和利

益输送的反向交易行为。对于旗下投资组合之间（纯被动指数组合和量化投资组合除外）确因投资策略或流动性管理等需要而进行的反向交易，投资人员须提供充分的投资决策依据，并经审核确认方可执行。

公司通过定期或不定期的公平交易效果评估报告机制，使投资和交易人员能及时了解各组合的公平交易执行状况，持续督促公平交易制度的落实执行，并不断在实践中检验和完善公平交易制度。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，上述公平交易制度和控制方法总体执行情况良好，未发现旗下投资组合之间存在不公平交易现象。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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。

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 42 次，其中 27 次为旗下指数及量化组合因投资策略需要和其他组合发生反向交易，15 次为不同基金经理管理的基金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。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证科创创业 50 指数，该指数由科创板和创业板中市值较大的 50 只新兴产业上市公司证券组成，以反映上述市场中代表性新兴产业上市公司的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。

回顾 2022 年，受国内疫情持续反复的影响，我国社会经济活动有所放缓，经济下行压力增加。同期，全球疫情反复和地缘政治风险加剧导致包括能源、工业原材料在内的关键商品出现供应链短缺，制造业产业链安全稳定运行面临挑战，并且欧美等海外主要经济体通胀水平居高不下，货币政策持续收紧，经济衰退预期上升，对应的资本市场波动显著增大。为应对国内外负面冲击，国内经济政策持续发力，陆续推出地产纾困、扩大内需等刺激政策，有效支持经济稳定运行。从资本市场表现来看，A 股市场全年波动较大，但随着年末经济预期转好和投资者情绪回升，市场在 2022 年四季度有一定修复。科创创业 50 指数是由科创板和创业板中市值较大的 50 只新兴产业上市公司证券组成，主要权重行业为电力设备、医药生物、电子、机械设备等成长性行业，成份股市值风格偏大盘，且业绩成长性较为突出。2022 年，科创创业 50 指数下跌 28.3%。

通常而言，指数的长期涨跌幅与成份股公司的盈利趋势紧密相关，而指数的短期波动则与资金

成本及投资者情绪变化更为紧密。科创创业 50 指数成份股仅选取科创板和创业板的新兴产业上市公司。一方面，新兴产业的市场空间较为广阔，上市企业盈利的成长性通常较高，但相比传统产业也面临着更高的不确定性。另一方面，新兴产业上市企业的大部分利润和净现金流入通常不会体现在早期的成长阶段，企业估值对资金成本变化的敏感性更高。上述特征体现在科创创业 50 指数上，既呈现出有巨大成长空间的长期投资价值，也会呈现出中短期高波动的工具价值，投资者需要结合自身风险偏好和风险承受能力，理解科创创业 50 指数的关键影响因素，以取得更好的投资业绩。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.6013 元，本报告期份额净值增长率为-28.19%，同期业绩比较基准收益率为-28.32%，年化跟踪误差 0.26%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

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 2023 年，疫情对经济冲击有所减弱，海外主要经济体加息进程或接近尾声，全球衰退风险降低。中国将继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策，加大宏观政策调控力度，加强各类政策协调配合，形成高质量发展合力，国内经济有望进入复苏阶段。长期来看，国家强调“自主创新，推动中国从经济大国向经济强国、制造强国转变，推动机制体制改革、汇聚高质量发展的新动能”的大背景下，科技创新、高端制造、自主可控等主题产业将持续发展，成为经济发展的重要动力。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期，基金管理人根据法律法规、监管要求的变化和业务发展的需要，继续围绕严守合规底线、履行合规义务、防控重大风险等完善公司内控，持续审视健全制度流程并强化对法规和制度执行情况的监督检查，有效保障了旗下基金及公司各项业务合法合规、稳健有序运作开展。

本报告期，基金管理人主要监察稽核工作及措施如下：

(1) 不断推进公司合规和廉洁从业文化建设，践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化理念，坚持投资者利益至上的核心价值观，加强员工合规风控、廉洁从业教育培训并完善合规监督考评机制，筑牢廉洁从业的红线认识，不断提高员工合规风控意识。

(2) 坚持投资合规风险闭环管理，认真贯彻落实法律法规、基金合同和公司制度的各项控制要求，持续完善投资合规风控制度流程和系统工具，加强对投资范围、投资比例等各种投资限制的监控提示、情况核查和结果跟踪；持续推动投资、研究、交易等业务部门完善相应内控机制；加强公平交易、异常交易、关联交易和利益冲突等监测管控机制，有效确保旗下基金资产严格按照法律法

规、基金合同和公司制度的要求稳健规范运作。

(3) 持续提升产品合规审查质量，督促健全基金募集申请材料质量内控机制和工具手段；坚持以风险可测可控、投资者有效保护为前提，审慎评估论证各类新产品与新业务方案，全面充分揭示产品风险特征，切实保护投资者合法权益。

(4) 持续贯彻落实基金销售相关法规和监管要求，加强营销宣传、销售、客服等环节的合规管控，深入落实投资者适当性管理，妥善处理客户投诉纠纷，切实加大投资者教育和保护力度，着力提高投资者获得感。

(5) 持续落实法律法规、自律规则、基金合同信息披露相关规定，完善信息披露管理工作机制流程，不断提高信息披露文件制作、审核、报送的系统化水平，做好公司及旗下各基金的信息披露工作，确保真实、准确、完整、及时、简明和易得。

(6) 贯彻落实风险为本的工作方法，进一步修订制度流程、夯实人员队伍、加强信息系统建设与金融科技运用，建立健全洗钱风险自评估工作机制，扎实开展风险自评估，持续完善风险管控措施，不断提高反洗钱合规和风险管理水平。

(7) 以法律法规、基金合同及公司规章制度为依据，有计划、有重点地对投研交易、基金销售、产品运营、信息技术、人员规范、反洗钱等工作领域开展内审检查，同时参考国际标准，聘请外部机构开展内控合规评估和业绩标准鉴证，报告期内通过 ISAE3402（国际鉴证业务准则 3402 号）内控鉴证和 GIPS（全球投资业绩标准）鉴证，通过内外部不同视角审视公司内控机制和执行情况，提升公司合规管理及内控水平。

本基金管理人将一如既往地本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，努力防范和控制重大风险，充分保障基金份额持有人的合法权益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、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。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融

估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——易方达基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对易方达基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60468000_G83 号

易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表和净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

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

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，管理层负责评估易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

执行以下工作：

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

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

(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

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

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

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

昌华 马婧

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室

2023 年 3 月 27 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	15,761,309.10	33,167,218.43
结算备付金		730,149.08	1,583,193.50
存出保证金		387,021.07	1,794,164.31
交易性金融资产	7.4.7.2	6,145,773,035.20	6,967,340,469.49
其中：股票投资		6,145,773,035.20	6,962,411,512.70
基金投资		-	-
债券投资		-	4,928,956.79
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		212,266.84	628,955.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	368,974.71	292,977.06
资产总计		6,163,232,756.00	7,004,806,978.72
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		25,505.28	918,405.67
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,587,328.83	2,966,480.33

应付托管费		517,465.78	593,296.08
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		58,180.99	50,183.08
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	2,337,816.27	7,393,280.92
负债合计		5,526,297.15	11,921,646.08
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	10,240,860,533.00	8,350,860,533.00
未分配利润	7.4.7.8	-4,083,154,074.15	-1,357,975,200.36
净资产合计		6,157,706,458.85	6,992,885,332.64
负债和净资产总计		6,163,232,756.00	7,004,806,978.72

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 6 月 28 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 6 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日。

2.报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.6013 元，基金份额总额 10,240,860,533.00 份。

3.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 6 月 28 日（基 金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-2,141,106,571.99	-778,087,517.61

1.利息收入		20,742,418.69	9,032,135.92
其中：存款利息收入	7.4.7.9	143,417.44	462,213.15
债券利息收入		-	513.34
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		20,599,001.25	8,569,409.43
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,333,525,657.80	-312,916,970.26
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,362,921,501.11	-317,884,300.79
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,299,593.23	970,482.51
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	28,096,250.08	3,996,848.02
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-830,897,936.60	-479,935,595.69
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	2,574,603.72	5,732,912.42
减：二、营业总支出		39,090,550.00	30,904,853.11
1. 管理人报酬		32,218,779.23	17,976,828.07
2. 托管费		6,443,755.88	3,595,365.68
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		74,161.08	30,852.84
8. 其他费用	7.4.7.18	353,853.81	9,301,806.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		-2,180,197,121.99	-808,992,370.72

列)			
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,180,197,121.99	-808,992,370.72
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,180,197,121.99	-808,992,370.72

注：1.本基金合同生效日为 2021 年 6 月 28 日，2021 年度实际报告期间为 2021 年 6 月 28 日至 2021 年 12 月 31 日。

2.上表中以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年度利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

3.上表中以下本期数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的利润表格式的要求进行列示：本年度报告利润表中“投资收益”项目对应品种的投资收益已扣减对应投资品种产生的交易费用。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	8,350,860,533.00	-1,357,975,200.36	6,992,885,332.64
二、本期期初净资产（基金净值）	8,350,860,533.00	-1,357,975,200.36	6,992,885,332.64
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,890,000,000.00	-2,725,178,873.79	-835,178,873.79
（一）、综合收益总额	-	-2,180,197,121.99	-2,180,197,121.99
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,890,000,000.00	-544,981,751.80	1,345,018,248.20
其中：1.基金申购款	8,172,000,000.00	-2,686,596,024.28	5,485,403,975.72

2.基金赎回款	-6,282,000,000.00	2,141,614,272.48	-4,140,385,727.52
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	10,240,860,533.00	-4,083,154,074.15	6,157,706,458.85
项目	上年度可比期间		
	2021年6月28日(基金合同生效日)至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	3,004,860,533.00	-	3,004,860,533.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	5,346,000,000.00	-1,357,975,200.36	3,988,024,799.64
(一)、综合收益总额	-	-808,992,370.72	-808,992,370.72
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	5,346,000,000.00	-548,982,829.64	4,797,017,170.36
其中: 1.基金申购款	14,898,000,000.00	-1,330,001,216.62	13,567,998,783.38
2.基金赎回款	-9,552,000,000.00	781,018,386.98	-8,770,981,613.02
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,350,860,533.00	-1,357,975,200.36	6,992,885,332.64

注:本基金合同生效日为2021年6月28日,2021年度实际报告期间为2021年6月28日至2021年12月31日。

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4,财务报表由下列负责人签署:

基金管理人负责人:刘晓艳,主管会计工作负责人:陈荣,会计机构负责人:王永铿

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2021]2013 号《关于准予易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集,由易方达基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案,《易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 6 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,004,860,533.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 66,167.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

7.4.2 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。

7.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

益工具的合同。

(1) 金融资产分类

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

(2) 金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定

的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

允价值并进行估值：

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

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

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金同时满足下列条件时，金融资产和金融负债以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

(1) 本基金收益分配方式采用现金分红；

(2) 每一基金份额享有同等分配权；

(3)基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，基金管理人可进行收益分配；

(4)本基金收益分配比例根据以下原则确定：使收益分配后基金累计报酬率尽可能贴近标的指数同期累计报酬率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

基金管理人可在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，与基金托管人协商一致后对上述原则进行修改或调整，而无需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1会计政策变更的说明

根据《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《企业会计准则第 23 号——金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号——套期会计》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《关于印发<资产管理产品相关会计处理规定>的通知》（财会[2022]14 号）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期期初未分配利润。

于首次执行日（2022 年 1 月 1 日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 33,167,218.43 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 2,830.05 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 33,170,048.48 元。

结算备付金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,583,193.50 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 538.70 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,583,732.20 元。

存出保证金于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,794,164.31 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 807.40 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 1,794,971.71 元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 292,977.06 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 2,830.05 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 538.70 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 807.40 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 108.03 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 288,692.88 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

其他资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 0.00 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 288,692.88 元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币 0.00 元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 288,692.88 元。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,967,340,469.49 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 108.03 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 6,967,340,577.52 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	15,761,309.10	33,167,218.43

等于：本金	15,759,520.52	33,167,218.43
加：应计利息	1,788.58	-
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	15,761,309.10	33,167,218.43

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,456,606,567.49	-	6,145,773,035.20	-1,310,833,532.29
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	7,456,606,567.49	-	6,145,773,035.20	-1,310,833,532.29
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		7,442,347,108.39	-	6,962,411,512.70	-479,935,595.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,928,956.79	-	4,928,956.79	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,928,956.79	-	4,928,956.79	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		7,447,276,065.18	-	6,967,340,469.49	-479,935,595.69

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末及上年度末无衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末无买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末无买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	292,977.06
其他应收款	368,974.71	-
待摊费用	-	-

合计	368,974.71	292,977.06
----	------------	------------

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	248,884.82	1,168,749.41
其中：交易所市场	248,884.82	1,168,749.41
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	197,000.00	69,863.01
应付替代款	1,891,931.45	6,154,668.50
合计	2,337,816.27	7,393,280.92

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,350,860,533.00	8,350,860,533.00
本期申购	8,172,000,000.00	8,172,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,282,000,000.00	-6,282,000,000.00
本期末	10,240,860,533.00	10,240,860,533.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-347,575,226.50	-1,010,399,973.86	-1,357,975,200.36
本期利润	-1,349,299,185.39	-830,897,936.60	-2,180,197,121.99
本期基金份额交易产生的	-107,414,804.50	-437,566,947.30	-544,981,751.80

变动数			
其中：基金申购款	-778,033,095.47	-1,908,562,928.81	-2,686,596,024.28
基金赎回款	670,618,290.97	1,470,995,981.51	2,141,614,272.48
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,804,289,216.39	-2,278,864,857.76	-4,083,154,074.15

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 28 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	83,761.03	376,657.97
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	46,015.17	75,025.02
其他	13,641.24	10,530.16
合计	143,417.44	462,213.15

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 28 日（基金合同 生效日）至 2021 年 12 月 31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-702,564,779.86	-197,140,751.96
股票投资收益——赎回差价收入	-660,356,721.25	-120,743,548.83
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,362,921,501.11	-317,884,300.79

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12	上年度可比期间 2021 年 6 月 28 日（基金合同
----	---------------------------------	---------------------------------

	月 31 日	生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	2,707,469,561.56	3,673,892,299.00
减: 卖出股票成本总额	3,405,000,747.78	3,871,033,050.96
减: 交易费用	5,033,593.64	-
买卖股票差价收入	-702,564,779.86	-197,140,751.96

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 6 月 28 日 (基金合同 生效日) 至 2021 年 12 月 31 日
赎回基金份额对价总额	4,140,385,727.52	8,770,981,613.02
减: 现金支付赎回款总额	1,042,535,270.52	1,583,124,885.02
减: 赎回股票成本总额	3,758,207,178.25	7,308,600,276.83
减: 交易费用	-	-
赎回差价收入	-660,356,721.25	-120,743,548.83

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年6月28日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	536.71	-
债券投资收益——买卖债券(债转股 及债券到期兑付)差价收入	1,299,056.52	970,482.51
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	1,299,593.23	970,482.51

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年6月28日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期兑付) 成交总额	12,049,718.84	3,626,344.53
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑	10,749,950.77	2,655,395.82

付) 成本总额		
减: 应计利息总额	657.87	466.20
减: 交易费用	53.68	-
买卖债券差价收入	1,299,056.52	970,482.51

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间无衍生工具收益。

7.4.7.14 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月28日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	28,096,250.08	3,996,848.02
其中: 证券出借权益补偿收入	4,119,710.86	176,691.61
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	28,096,250.08	3,996,848.02

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月28日(基金合同生效 日)至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-830,897,936.60	-479,935,595.69
——股票投资	-830,897,936.60	-479,935,595.69
——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	-830,897,936.60	-479,935,595.69

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日）至 2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益收入	2,574,603.72	5,692,042.84
其他	-	40,869.58
合计	2,574,603.72	5,732,912.42

注：替代损益收入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。

7.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
审计费用	57,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
存托服务费	5,127.59	-
银行汇划费	1,726.22	870.76
其他	170,000.00	97,763.01
交易费用	-	9,143,172.75
合计	353,853.81	9,301,806.52

7.4.8或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

7.4.8.2资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
广东粤财信托有限公司	基金管理人股东
广东省广晟控股集团有限公司	基金管理人股东
广州市广永国有资产经营有限公司	基金管理人股东
盈峰集团有限公司	基金管理人股东
珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人股东
易方达资产管理有限公司	基金管理人的子公司
易方达国际控股有限公司	基金管理人的子公司
易方达资产管理（香港）有限公司	基金管理人子公司控制的公司
易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金

注：1. 珠海祺荣宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康股权投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康股权投资合伙企业（有限合伙）自 2022 年 9 月 9 日起名称分别变更为珠海祺荣宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺泰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海祺丰宝投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚莱康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚宁康投资合伙企业（有限合伙）、珠海聚弘康投资合伙企业（有限合伙）。

2. 以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日） 至2021年12月31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	7,464.00	0.00%	569,798,300.45	4.99%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	4.48	0.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣 金总额的比例
广发证券	284,903.86	6.47%	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

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等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年6月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	32,218,779.23	17,976,828.07
其中：支付销售机构的客户维护费	685,599.16	422,428.29

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日
项目		
当期发生的基金应支付的托管费	6,443,755.88	3,595,365.68

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，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（含回购）交易。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

7.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：股)	出借期限 (单位：天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2022010400000736	沪硅产业	2022-01-04	1,819,986.00	71,400.00	14	3.21	2,271.95	0.00	0.00
广发证券	2022010400019543	寒武纪	2022-01-04	1,153,386.00	11,700.00	14	3.21	1,439.81	0.00	0.00
广发证券	2022010700011483	华熙生物	2022-01-07	4,177,880.00	30,100.00	14	3.20	5,199.14	0.00	0.00
广发证券	2022011100012345	贝达药业	2022-01-11	77,050.00	1,000.00	14	3.20	95.88	0.00	0.00
广发证券	2022011100012353	华大基因	2022-01-11	94,140.00	1,000.00	14	3.20	117.15	0.00	0.00
广发证券	2022011100014125	九号公司	2022-01-11	538,730.00	8,500.00	14	4.11	861.07	0.00	0.00
广发证券	2022011200000937	金山办公	2022-01-12	5,237,055.00	20,100.00	14	3.21	6,537.59	0.00	0.00
广发证券	2022011200015381	中伟股份	2022-01-12	492,300.00	3,600.00	14	3.20	612.64	0.00	0.00

广发证 券	2022 0112 0001 5393	华润微	2022- 01-12	766,6 25.00	12,500.00	14	3.2 1	957.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0112 0001 5399	天合光 能	2022- 01-12	5,141 ,320. 00	79,000.00	14	3.2 1	6,418 .08	0.00	0.00
广发证 券	2022 0118 0002 2110	沪硅产 业	2022- 01-18	1,955 ,646. 00	71,400.00	14	3.2 1	3,487 .57	0.00	0.00
广发证 券	2022 0118 0002 2116	寒武纪	2022- 01-18	1,080 ,378. 00	11,700.00	14	3.2 1	1,926 .67	0.00	0.00
广发证 券	2022 0121 0001 1530	华熙生 物	2022- 01-21	3,801 ,931. 00	30,100.00	14	3.2 0	5,745 .14	0.00	0.00
广发证 券	2022 0124 0000 0641	乐普医 疗	2022- 01-24	986,1 48.00	41,400.00	14	3.2 0	1,227 .21	0.00	0.00
广发证 券	2022 0125 0000 9020	贝达药 业	2022- 01-25	67,54 0.00	1,000.00	14	3.2 0	84.05	0.00	0.00
广发证 券	2022 0125 0000 9036	华大基 因	2022- 01-25	84,74 0.00	1,000.00	14	3.2 0	105.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0125 0000 9072	九号公 司	2022- 01-25	532,5 25.00	8,500.00	14	4.1 1	851.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0126 0000 9972	天合光 能	2022- 01-26	5,723 ,550. 00	79,000.00	14	3.2 1	7,144 .90	0.00	0.00
广发证 券	2022 0126 0000 9974	华润微	2022- 01-26	718,3 75.00	12,500.00	14	3.2 1	896.7 7	0.00	0.00
广发证	2022	中伟股	2022-	492,4	3,600.00	14	3.2	612.8	0.00	0.00

券	0126 0001 1278	份	01-26	80.00			0	6		
广发证 券	2022 0207 0004 6565	沪硅产 业	2022- 02-07	1,721 ,454. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,148 .95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0207 0005 8929	寒武纪	2022- 02-07	910,7 28.00	11,700.00	14	3.2 1	1,136 .89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0207 0005 8939	华熙生 物	2022- 02-07	3,612 ,301. 00	30,100.00	14	3.2 0	4,495 .31	0.00	0.00
广发证 券	2022 0208 0001 3390	九号公 司	2022- 02-08	516,8 85.00	8,500.00	14	4.1 1	826.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0208 0001 3800	华大基 因	2022- 02-08	86,63 0.00	1,000.00	14	3.2 0	107.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0208 0001 3804	贝达药 业	2022- 02-08	62,37 0.00	1,000.00	14	3.2 0	77.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209 0000 1445	康希诺	2022- 02-09	610,1 90.00	2,300.00	14	3.2 0	759.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209 0000 1449	金山办 公	2022- 02-09	2,632 ,350. 00	11,500.00	14	3.2 0	3,275 .81	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209 0001 7774	中伟股 份	2022- 02-09	432,0 00.00	3,600.00	14	3.2 0	537.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209 0001 7784	华润微	2022- 02-09	703,2 50.00	12,500.00	14	3.2 1	877.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209	天合光 能	2022- 02-09	4,778 ,710.	79,000.00	14	3.2 1	5,965 .42	0.00	0.00

	0001 7798			00						
广发证 券	2022 0216 0000 0649	中微公 司	2022- 02-16	233,5 10.00	1,900.00	14	3.2 0	290.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0221 0004 0917	沪硅产 业	2022- 02-21	1,608 ,642. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,008 .12	0.00	0.00
广发证 券	2022 0221 0004 4721	寒武纪	2022- 02-21	983,3 85.00	11,700.00	14	3.2 1	1,227 .59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0221 0004 4727	华熙生 物	2022- 02-21	3,518 ,690. 00	30,100.00	14	3.2 0	4,378 .81	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0000 0786	石头科 技	2022- 02-22	707,3 80.00	1,000.00	14	3.5 0	962.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0000 0890	君实生 物	2022- 02-22	291,2 82.00	4,300.00	14	3.2 0	362.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0000 0895	金山办 公	2022- 02-22	2,544 ,000. 00	12,000.00	14	3.2 0	3,165 .87	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0001 0965	贝达药 业	2022- 02-22	58,82 0.00	1,000.00	7	3.2 0	36.60	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0001 2149	华大基 因	2022- 02-22	85,57 0.00	1,000.00	14	3.2 0	106.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0222 0001 2197	九号公 司	2022- 02-22	471,3 25.00	8,500.00	14	4.1 1	753.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0223 0000	金山办 公	2022- 02-22	2,544 ,000. 00	12,000.00	2	3.2 0	452.2 7	0.00	0.00

	2445									
广发证 券	2022 0223 0001 1156	金山办 公	2022- 02-23	2,521 ,950. 00	11,500.00	14	3.2 0	3,138 .43	0.00	0.00
广发证 券	2022 0223 0001 1158	康希诺	2022- 02-23	597,3 79.00	2,300.00	14	3.2 0	743.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0223 0001 2286	华润微	2022- 02-23	728,2 50.00	12,500.00	14	3.2 1	909.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0223 0001 2298	天合光 能	2022- 02-23	5,174 ,500. 00	79,000.00	14	3.2 1	6,459 .50	0.00	0.00
广发证 券	2022 0228 0000 0713	天合光 能	2022- 02-28	5,317 ,552. 00	68,800.00	14	3.2 0	6,617 .40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0307 0004 0256	寒武纪	2022- 03-07	996,4 89.00	11,700.00	14	3.2 1	1,243 .95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0307 0004 0258	沪硅产 业	2022- 03-07	1,627 ,206. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,031 .30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0308 0001 2480	华大基 因	2022- 03-08	76,92 0.00	1,000.00	14	3.2 0	95.72	0.00	0.00
广发证 券	2022 0308 0001 2532	石头科 技	2022- 03-08	540,6 60.00	1,000.00	14	3.5 0	735.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0308 0001 2566	九号公 司	2022- 03-08	435,1 15.00	8,500.00	14	4.1 1	695.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0308 0001 2584	君实生 物	2022- 03-08	290,2 50.00	4,300.00	14	3.2 0	361.2 0	0.00	0.00

广发证 券	2022 0309 0001 7541	金山办 公	2022- 03-09	2,093 ,000. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,604 .62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0314 0000 0815	卓胜微	2022- 03-14	4,583 ,800. 00	20,000.00	14	3.2 0	5,704 .28	0.00	0.00
广发证 券	2022 0314 0000 5994	天合光 能	2022- 03-14	4,857 ,280. 00	68,800.00	14	3.2 0	6,044 .62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0316 0000 1049	君实生 物	2022- 03-16	260,8 14.00	3,400.00	14	3.2 0	324.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0317 0000 0898	九号公 司	2022- 03-17	388,2 18.00	8,900.00	14	3.2 0	483.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0318 0000 0703	亿纬锂 能	2022- 03-18	847,0 00.00	10,000.00	14	2.0 0	658.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0318 0000 0749	时代电 气	2022- 03-18	3,759 ,800. 00	55,000.00	14	2.0 0	2,924 .29	0.00	0.00
广发证 券	2022 0321 0003 0023	寒武纪	2022- 03-21	760,5 00.00	11,700.00	14	3.2 1	1,084 .98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0321 0003 0033	沪硅产 业	2022- 03-21	1,827 ,126. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,606 .70	0.00	0.00
广发证 券	2022 0322 0001 2593	华大基 因	2022- 03-22	84,21 0.00	1,000.00	14	3.2 0	112.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0322 0001 2599	九号公 司	2022- 03-22	393,5 50.00	8,500.00	14	4.1 1	673.9 5	0.00	0.00
广发证	2022	君实生	2022-	382,2	4,300.00	14	3.2	509.6	0.00	0.00

券	0322 0001 4201	物	03-22	27.00			0	4		
广发证 券	2022 0323 0001 3335	金山办 公	2022- 03-23	2,186 ,035. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,720 .40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0328 0000 4259	天合光 能	2022- 03-28	4,169 ,280. 00	68,800.00	14	3.2 0	5,188 .44	0.00	0.00
广发证 券	2022 0330 0000 0854	中控技 术	2022- 03-30	352,5 63.00	5,100.00	14	3.2 0	438.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0330 0000 6789	君实生 物	2022- 03-30	292,3 66.00	3,400.00	14	3.2 0	363.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0401 0000 0731	九号公 司	2022- 04-01	507,6 63.00	11,700.00	14	3.2 0	631.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0401 0000 0747	中控技 术	2022- 04-01	109,7 44.00	1,600.00	14	3.2 0	136.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0005 1849	沪硅产 业	2022- 04-06	1,580 ,796. 00	71,400.00	14	3.2 1	1,973 .36	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7569	寒武纪	2022- 04-06	734,1 75.00	11,700.00	14	3.2 1	916.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7571	金山办 公	2022- 04-06	2,124 ,740. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,644 .12	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7577	九号公 司	2022- 04-06	363,7 15.00	8,500.00	14	4.1 1	581.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406	君实生 物	2022- 04-06	346,1 93.00	4,300.00	14	3.2 0	430.8 2	0.00	0.00

	0006 7599									
广发证 券	2022 0406 0006 7623	华大基 因	2022- 04-06	81,81 0.00	1,000.00	14	3.2 0	101.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0408 0000 0983	中控技 术	2022- 04-08	161,6 25.00	2,500.00	14	3.2 0	201.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0411 0000 0661	中控技 术	2022- 04-11	186,3 30.00	3,000.00	14	3.2 0	231.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0411 0000 6551	天合光 能	2022- 04-11	3,440 ,000. 00	68,800.00	14	3.2 0	4,280 .89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0415 0000 0926	时代电 气	2022- 04-15	1,089 ,500. 00	25,000.00	14	2.0 0	847.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0415 0000 0928	中控技 术	2022- 04-15	259,5 20.00	4,000.00	14	2.0 0	201.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0419 0000 1114	寒武纪	2022- 04-19	860,2 88.00	14,300.00	14	3.4 1	1,303 .81	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0000 0774	圣邦股 份	2022- 04-20	7,524 ,264. 00	26,400.00	14	2.0 0	6,270 .22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0000 0798	时代电 气	2022- 04-20	1,021 ,310. 00	23,500.00	14	2.0 0	851.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0004 0424	九号公 司	2022- 04-20	327,8 45.00	8,500.00	14	4.1 1	561.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0004	华大基 因	2022- 04-20	73,07 0.00	1,000.00	14	3.2 0	97.43	0.00	0.00

	0426									
广发证 券	2022 0420 0004 0444	沪硅产 业	2022- 04-20	1,599 ,360. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,139 .14	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0004 0450	金山办 公	2022- 04-20	2,090 ,700. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,787 .60	0.00	0.00
广发证 券	2022 0421 0000 0619	华大基 因	2022- 04-21	469,0 00.00	6,700.00	14	3.2 0	583.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0422 0001 4130	中控技 术	2022- 04-22	155,3 25.00	2,500.00	14	3.2 0	193.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0425 0000 0360	贝达药 业	2022- 04-25	1,781 ,560. 00	44,000.00	14	2.0 0	1,385 .66	0.00	0.00
广发证 券	2022 0425 0000 5965	天合光 能	2022- 04-25	3,012 ,752. 00	68,800.00	14	3.2 0	3,749 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0428 0000 1006	九号公 司	2022- 04-28	244,0 98.00	7,100.00	14	3.2 0	303.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0428 0000 1017	欣旺达	2022- 04-28	1,049 ,000. 00	50,000.00	14	3.2 0	1,305 .42	0.00	0.00
广发证 券	2022 0429 0000 0537	时代电 气	2022- 04-29	236,1 60.00	4,800.00	14	3.2 0	293.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0429 0000 0681	欣旺达	2022- 04-29	344,8 75.00	15,500.00	14	3.2 0	429.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0429 0000 5144	时代电 气	2022- 04-29	1,230 ,000. 00	25,000.00	14	2.0 0	956.6 7	0.00	0.00

广发证 券	2022 0505 0005 5733	华大基 因	2022- 05-05	64,52 0.00	1,000.00	14	3.2 0	80.29	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 2713	华大基 因	2022- 05-05	432,2 84.00	6,700.00	14	3.2 0	537.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 5225	沪硅产 业	2022- 05-05	1,510 ,110. 00	71,400.00	14	3.2 1	1,885 .12	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 6037	圣邦股 份	2022- 05-05	7,642 ,800. 00	26,400.00	14	2.0 0	5,944 .40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0006 8577	金山办 公	2022- 05-05	2,216 ,165. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,757 .89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0506 0000 0802	宁德时代	2022- 05-06	3,383 ,910. 00	9,000.00	14	3.2 0	4,211 .09	0.00	0.00
广发证 券	2022 0506 0001 8073	中控技 术	2022- 05-06	165,6 50.00	2,500.00	14	3.2 0	206.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0001 1025	天合光 能	2022- 05-09	3,645 ,712. 00	68,800.00	14	3.2 0	4,536 .89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0001 1031	贝达药 业	2022- 05-09	1,906 ,080. 00	44,000.00	14	2.0 0	1,482 .51	0.00	0.00
广发证 券	2022 0517 0000 0756	时代电 气	2022- 05-17	1,111 ,000. 00	20,000.00	14	2.0 0	864.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0517 0000 0776	九号公 司	2022- 05-17	216,8 04.00	5,800.00	14	2.0 0	168.6 3	0.00	0.00
广发证	2022	沪硅产	2022-	1,642	71,400.00	7	3.2	1,025	0.00	0.00

券	0519 0004 1945	业	05-19	,200. 00			1	.01		
广发证 券	2022 0519 0004 1955	金山办 公	2022- 05-19	2,387 ,400. 00	11,500.00	7	3.2 0	1,485 .49	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 1967	圣邦股 份	2022- 05-19	7,957 ,224. 00	26,400.00	7	2.0 0	3,094 .48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0520 0001 6242	中控技 术	2022- 05-20	178,5 50.00	2,500.00	7	3.2 0	111.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0523 0000 6725	贝达药 业	2022- 05-23	2,080 ,320. 00	44,000.00	7	2.0 0	809.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0523 0000 6731	天合光 能	2022- 05-23	4,374 ,304. 00	68,800.00	7	3.2 0	2,721 .79	0.00	0.00
广发证 券	2022 0524 0000 0704	大全能 源	2022- 05-24	967,9 28.00	16,400.00	14	3.2 0	1,204 .53	0.00	0.00
广发证 券	2022 0525 0000 0419	康泰生 物	2022- 05-25	4,610 ,200. 00	74,000.00	14	3.2 0	5,737 .14	0.00	0.00
广发证 券	2022 0525 0000 1017	华大基 因	2022- 05-25	7,229 ,250. 00	107,100.0 0	7	3.2 0	4,498 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 6886	沪硅产 业	2022- 05-26	1,601 ,502. 00	71,400.00	7	3.2 1	999.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0000 9478	圣邦股 份	2022- 05-26	7,318 ,608. 00	26,400.00	7	2.0 0	2,846 .13	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526	金山办 公	2022- 05-26	2,302 ,300.	11,500.00	7	3.2 0	1,432 .54	0.00	0.00

	0001 1692			00						
广发证 券	2022 0527 0000 0952	石头科 技	2022- 05-27	565,9 90.00	1,000.00	14	3.4 1	750.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0527 0000 5986	中控技 术	2022- 05-27	174,9 75.00	2,500.00	7	3.2 0	155.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0835	康泰生 物	2022- 05-30	1,565 ,961. 00	24,900.00	14	6.4 1	3,903 .59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0841	阳光电 源	2022- 05-30	76,32 0.00	1,000.00	14	3.2 0	94.98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0853	传音控 股	2022- 05-30	82,56 0.00	1,000.00	14	3.2 0	102.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0857	金山办 公	2022- 05-30	200,4 00.00	1,000.00	14	3.2 0	249.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0859	澜起科 技	2022- 05-30	74,89 2.00	1,200.00	14	3.2 0	93.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 0861	中芯国 际	2022- 05-30	50,47 2.00	1,200.00	14	3.2 0	62.81	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 4956	天合光 能	2022- 05-30	4,265 ,600. 00	68,800.00	7	3.2 0	2,654 .15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0531 0000 9647	时代电 气	2022- 05-31	1,127 ,600. 00	20,000.00	7	2.0 0	438.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0601 0000	汇川技 术	2022- 06-01	300,1 25.00	4,900.00	14	3.2 0	373.4 9	0.00	0.00

	1055									
广发证 券	2022 0601 0000 1063	格科微	2022- 06-01	989,2 30.00	50,600.00	14	3.2 0	1,231 .04	0.00	0.00
广发证 券	2022 0601 0000 4494	华大基 因	2022- 06-01	7,009 ,695. 00	107,100.0 0	14	3.2 0	8,723 .18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 4378	圣邦股 份	2022- 06-02	7,852 ,944. 00	26,400.00	7	2.0 0	3,053 .92	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0001 4384	金山办 公	2022- 06-02	2,417 ,645. 00	11,500.00	7	3.2 0	1,504 .31	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0002 2664	沪硅产 业	2022- 06-02	1,718 ,598. 00	71,400.00	7	3.2 1	1,072 .69	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0000 0878	君实生 物	2022- 06-06	100,1 00.00	1,300.00	14	3.2 0	124.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 1074	中控技 术	2022- 06-06	203,5 00.00	2,500.00	7	3.2 0	126.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 1080	天合光 能	2022- 06-06	4,530 ,480. 00	68,800.00	7	3.2 0	2,818 .97	0.00	0.00
广发证 券	2022 0607 0000 1029	欣旺达	2022- 06-07	155,7 00.00	5,000.00	14	4.4 0	266.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0607 0000 1122	中控技 术	2022- 06-07	491,1 11.00	6,100.00	14	3.2 0	611.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0607 0000 1129	九号公 司	2022- 06-07	316,0 65.00	5,700.00	14	3.2 0	393.3 3	0.00	0.00

广发证 券	2022 0607 0000 7680	大全能 源	2022- 06-07	1,097 ,160. 00	16,400.00	7	3.2 0	682.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0607 0000 9598	时代电 气	2022- 06-07	1,251 ,000. 00	20,000.00	7	2.0 0	486.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0608 0000 0875	阳光电 源	2022- 06-08	7,432 ,000. 00	80,000.00	14	0.8 0	2,312 .18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0608 0000 0941	中控技 术	2022- 06-08	2,703 ,144. 00	33,200.00	14	3.2 0	3,363 .91	0.00	0.00
广发证 券	2022 0608 0000 7549	康泰生 物	2022- 06-08	2,968 ,140. 00	74,000.00	7	3.2 0	1,846 .84	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8147	圣邦股 份	2022- 06-09	7,257 ,624. 00	26,400.00	7	2.0 0	2,822 .41	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 9095	金山办 公	2022- 06-09	2,405 ,455. 00	11,500.00	7	3.2 0	1,496 .73	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 9847	沪硅产 业	2022- 06-09	1,731 ,450. 00	71,400.00	7	3.2 1	1,080 .71	0.00	0.00
广发证 券	2022 0610 0000 3279	石头科 技	2022- 06-10	689,3 40.00	1,000.00	7	3.4 1	457.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0000 2039	沪硅产 业	2022- 06-13	1,977 ,168. 00	81,600.00	14	3.2 0	2,460 .48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0001 9257	中芯国 际	2022- 06-13	54,88 8.00	1,200.00	7	3.2 0	34.15	0.00	0.00
广发证	2022	中控技	2022-	199,2	2,500.00	7	3.2	123.9	0.00	0.00

券	0613 0001 9293	术	06-13	50.00			0	8		
广发证 券	2022 0613 0002 1547	天合光 能	2022- 06-13	4,141 ,760. 00	68,800.00	7	3.2 0	2,577 .10	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1841	金山办 公	2022- 06-13	206,1 70.00	1,000.00	7	3.2 0	128.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1843	传音控 股	2022- 06-13	97,98 0.00	1,000.00	7	3.2 0	60.97	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1851	阳光电 源	2022- 06-13	89,89 0.00	1,000.00	7	3.2 0	55.93	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1853	康泰生 物	2022- 06-13	976,5 78.00	24,900.00	7	6.4 1	1,217 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0002 1855	澜起科 技	2022- 06-13	75,51 6.00	1,200.00	7	3.2 0	46.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614 0000 0652	中科创 达	2022- 06-14	131,5 10.00	1,000.00	14	3.2 0	163.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614 0000 0667	深信服	2022- 06-14	100,3 10.00	1,000.00	14	3.2 0	124.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614 0000 0767	中控技 术	2022- 06-14	9,424 ,140. 00	119,900.0 0	14	3.2 0	11,72 7.82	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614 0000 0943	容百科 技	2022- 06-14	104,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	129.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614	时代电 气	2022- 06-14	1,151 ,000.	20,000.00	14	2.0 0	895.2 2	0.00	0.00

	0000 6920			00						
广发证 券	2022 0614 0000 8028	大全能 源	2022- 06-14	1,150 ,952. 00	16,400.00	14	3.2 0	1,432 .30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0615 0002 3077	康泰生 物	2022- 06-15	2,976 ,280. 00	74,000.00	14	3.2 0	3,703 .82	0.00	0.00
广发证 券	2022 0615 0002 3605	华大基 因	2022- 06-15	7,109 ,298. 00	107,100.0 0	14	3.2 0	8,847 .13	0.00	0.00
广发证 券	2022 0616 0001 3703	圣邦股 份	2022- 06-16	6,732 ,000. 00	26,400.00	14	2.0 0	5,236 .00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0616 0001 5099	沪硅产 业	2022- 06-16	1,719 ,312. 00	71,400.00	14	3.2 1	2,146 .27	0.00	0.00
广发证 券	2022 0616 0001 8039	金山办 公	2022- 06-16	2,381 ,305. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,963 .40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0617 0001 2834	石头科 技	2022- 06-17	673,1 30.00	1,000.00	7	3.4 1	446.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 1004	天合光 能	2022- 06-20	4,370 ,176. 00	68,800.00	14	3.2 0	5,438 .44	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 2606	康泰生 物	2022- 06-20	1,070 ,451. 00	24,900.00	14	6.4 1	2,668 .40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5034	君实生 物	2022- 06-20	104,4 81.00	1,300.00	14	3.2 0	130.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001	澜起科 技	2022- 06-20	70,09 2.00	1,200.00	14	3.2 0	87.23	0.00	0.00

	5042									
广发证 券	2022 0620 0001 5046	中芯国 际	2022- 06-20	54,81 6.00	1,200.00	14	3.2 0	68.22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5050	阳光电 源	2022- 06-20	93,19 0.00	1,000.00	14	3.2 0	115.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5054	传音控 股	2022- 06-20	98,30 0.00	1,000.00	14	3.2 0	122.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5076	金山办 公	2022- 06-20	201,4 50.00	1,000.00	14	3.2 0	250.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0621 0000 0237	大全能 源	2022- 06-21	229,4 25.00	3,500.00	14	3.5 1	313.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0621 0000 7462	九号公 司	2022- 06-21	251,4 84.00	5,700.00	14	3.2 0	312.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0621 0000 7482	欣旺达	2022- 06-21	154,1 00.00	5,000.00	14	4.4 0	263.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0622 0001 2871	阳光电 源	2022- 06-22	7,485 ,600. 00	80,000.00	14	0.8 0	2,328 .85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0623 0000 0659	沃森生 物	2022- 06-23	287,6 15.00	6,100.00	14	3.2 0	357.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0624 0000 1023	九号公 司	2022- 06-24	221,5 20.00	4,800.00	14	3.2 0	275.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0624 0000 7858	石头科 技	2022- 06-24	641,0 00.00	1,000.00	14	3.4 1	850.0 4	0.00	0.00

广发证 券	2022 0627 0001 4312	沪硅产 业	2022- 06-27	1,842 ,528. 00	81,600.00	14	3.2 0	2,292 .92	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 8754	大全能 源	2022- 06-28	1,124 ,712. 00	16,400.00	14	3.2 0	1,399 .64	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 8850	时代电 气	2022- 06-28	613,3 00.00	10,000.00	14	2.0 0	477.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 8864	中科创 达	2022- 06-28	138,0 40.00	1,000.00	14	3.2 0	171.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 8880	中控技 术	2022- 06-28	8,848 ,620. 00	119,900.0 0	14	3.2 0	11,01 1.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 9878	容百科 技	2022- 06-28	134,6 50.00	1,000.00	14	3.2 0	167.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0628 0000 9892	深信服	2022- 06-28	101,6 10.00	1,000.00	14	3.2 0	126.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0629 0002 2290	华大基 因	2022- 06-29	7,493 ,787. 00	107,100.0 0	14	3.2 0	9,325 .60	0.00	0.00
广发证 券	2022 0629 0002 2294	康泰生 物	2022- 06-29	3,269 ,320. 00	74,000.00	14	3.2 0	4,068 .49	0.00	0.00
广发证 券	2022 0630 0000 1054	乐普医 疗	2022- 06-30	133,7 04.00	7,200.00	14	3.2 1	166.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0630 0002 1315	金山办 公	2022- 06-30	2,266 ,880. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,821 .01	0.00	0.00
广发证	2022	圣邦股	2022-	4,805	26,400.00	14	2.0	3,737	0.00	0.00

券	0630 0002 1343	份	06-30	,328. 00			0	.48		
广发证 券	2022 0704 0000 0513	沃森生 物	2022- 07-04	136,0 53.00	2,700.00	14	3.2 0	169.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0000 0515	卓胜微	2022- 07-04	387,2 95.00	2,900.00	14	4.4 0	662.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 2182	康泰生 物	2022- 07-04	1,151 ,874. 00	24,900.00	14	6.4 1	2,871 .37	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6064	天合光 能	2022- 07-04	4,151 ,392. 00	68,800.00	14	3.2 0	5,166 .18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6196	君实生 物	2022- 07-04	99,77 5.00	1,300.00	14	3.2 0	124.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6198	中芯国 际	2022- 07-04	52,93 2.00	1,200.00	14	3.2 0	65.87	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6204	澜起科 技	2022- 07-04	67,76 4.00	1,200.00	14	3.2 0	84.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6218	阳光电 源	2022- 07-04	93,34 0.00	1,000.00	14	3.2 0	116.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6220	传音控 股	2022- 07-04	88,10 0.00	1,000.00	14	3.2 0	109.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0704 0001 6256	金山办 公	2022- 07-04	190,4 90.00	1,000.00	14	3.2 0	237.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0705	九号公 司	2022- 07-05	246,1 26.00	5,700.00	14	3.2 0	306.2 9	0.00	0.00

	0000 8444									
广发证 券	2022 0705 0000 8754	欣旺达	2022- 07-05	152,0 00.00	5,000.00	14	4.4 0	260.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0705 0000 8756	大全能 源	2022- 07-05	269,6 05.00	3,500.00	14	3.5 1	368.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0706 0001 1405	阳光电 源	2022- 07-06	7,396 ,000. 00	80,000.00	14	0.8 0	2,300 .98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0707 0000 0698	中微公 司	2022- 07-07	7,786 ,580. 00	62,000.00	14	3.0 0	9,084 .34	0.00	0.00
广发证 券	2022 0707 0000 0714	中控技 术	2022- 07-07	1,541 ,980. 00	21,500.00	14	3.2 0	1,918 .91	0.00	0.00
广发证 券	2022 0707 0000 0720	沪硅产 业	2022- 07-07	310,4 82.00	14,100.00	14	3.2 0	386.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0707 0000 7596	沃森生 物	2022- 07-07	293,4 10.00	6,100.00	14	3.2 0	365.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0708 0000 7298	九号公 司	2022- 07-08	201,0 24.00	4,800.00	14	3.2 0	250.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0708 0000 8666	石头科 技	2022- 07-08	382,9 80.00	1,000.00	14	3.4 1	507.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0711 0000 0674	华大基 因	2022- 07-11	372,3 50.00	5,500.00	14	3.2 0	463.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0711 0001	沪硅产 业	2022- 07-11	1,760 ,112. 00	81,600.00	14	3.2 0	2,190 .36	0.00	0.00

	9592									
广发证 券	2022 0712 0001 0001	时代电 气	2022- 07-12	654,1 00.00	10,000.00	14	2.0 0	508.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0712 0001 0411	中控技 术	2022- 07-12	8,265 ,906. 00	119,900.0 0	14	3.2 0	10,28 6.46	0.00	0.00
广发证 券	2022 0712 0001 0835	容百科 技	2022- 07-12	129,9 30.00	1,000.00	14	3.2 0	161.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0712 0001 1893	中科创 达	2022- 07-12	127,4 80.00	1,000.00	14	3.2 0	158.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0712 0001 1895	深信服	2022- 07-12	91,73 0.00	1,000.00	14	3.2 0	114.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0712 0001 1899	大全能 源	2022- 07-12	1,132 ,420. 00	16,400.00	14	3.2 0	1,409 .23	0.00	0.00
广发证 券	2022 0713 0000 0634	卓胜微	2022- 07-13	2,937 ,870. 00	27,000.00	14	3.2 0	3,656 .02	0.00	0.00
广发证 券	2022 0713 0000 0682	沪硅产 业	2022- 07-13	315,4 00.00	15,200.00	14	3.2 0	392.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0713 0003 0238	华大基 因	2022- 07-13	7,132 ,860. 00	107,100.0 0	14	3.2 0	8,876 .45	0.00	0.00
广发证 券	2022 0714 0000 0758	阳光电 源	2022- 07-14	138,6 00.00	1,100.00	14	3.2 0	172.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0714 0000 3357	卓胜微	2022- 07-13	2,937 ,870. 00	27,000.00	2	3.2 0	522.2 9	0.00	0.00

广发证 券	2022 0714 0001 6106	圣邦股 份	2022- 07-14	4,504 ,104. 00	26,400.00	14	2.0 0	3,503 .19	0.00	0.00
广发证 券	2022 0714 0001 6120	乐普医 疗	2022- 07-14	125,9 28.00	7,200.00	14	3.2 1	157.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0714 0001 6134	金山办 公	2022- 07-14	2,012 ,845. 00	11,500.00	14	3.2 0	2,504 .87	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 3169	天合光 能	2022- 07-18	5,179 ,952. 00	68,800.00	14	3.2 0	6,446 .16	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 3237	康泰生 物	2022- 07-18	1,005 ,960. 00	24,900.00	14	6.4 1	2,507 .63	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 5423	卓胜微	2022- 07-18	303,5 72.00	2,900.00	14	4.4 0	519.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 6581	澜起科 技	2022- 07-18	63,99 6.00	1,200.00	14	3.2 0	79.64	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 6585	中芯国 际	2022- 07-18	49,93 2.00	1,200.00	14	3.2 0	62.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 6589	金山办 公	2022- 07-18	175,9 10.00	1,000.00	14	3.2 0	218.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 6595	传音控 股	2022- 07-18	72,96 0.00	1,000.00	14	3.2 0	90.79	0.00	0.00
广发证 券	2022 0718 0001 6601	阳光电 源	2022- 07-18	126,5 60.00	1,000.00	14	3.2 0	157.5 0	0.00	0.00
广发证	2022	九号公	2022-	262,7	5,700.00	14	3.2	327.0	0.00	0.00

券	0719 0000 8860	司	07-19	70.00			0	0		
广发证 券	2022 0719 0001 0462	欣旺达	2022- 07-19	154,3 00.00	5,000.00	14	4.4 0	264.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0719 0001 0472	大全能 源	2022- 07-19	234,1 50.00	3,500.00	14	3.5 1	319.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0720 0001 4499	阳光电 源	2022- 07-20	9,656 ,000. 00	80,000.00	14	0.8 0	3,004 .09	0.00	0.00
广发证 券	2022 0721 0000 8934	中微公 司	2022- 07-21	7,514 ,400. 00	62,000.00	14	3.0 0	8,766 .80	0.00	0.00
广发证 券	2022 0721 0000 9496	中控技 术	2022- 07-21	1,156 ,200. 00	15,000.00	14	3.2 0	1,438 .83	0.00	0.00
广发证 券	2022 0721 0000 9498	沪硅产 业	2022- 07-21	298,4 97.00	14,100.00	14	3.2 0	371.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0722 0000 7037	九号公 司	2022- 07-22	237,8 40.00	4,800.00	14	3.2 0	295.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0722 0000 7047	石头科 技	2022- 07-22	336,1 50.00	1,000.00	14	3.4 1	445.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0725 0000 1164	北京君 正	2022- 07-25	328,5 86.00	3,800.00	14	3.2 0	408.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0725 0000 1213	大全能 源	2022- 07-25	602,9 00.00	10,000.00	14	2.0 0	468.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0725	沪硅产 业	2022- 07-25	1,688 ,304.	81,600.00	14	3.2 0	2,101 .00	0.00	0.00

	0001 4236			00						
广发证 券	2022 0725 0001 6354	华大基 因	2022- 07-25	363,1 65.00	5,500.00	14	3.2 0	451.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0000 0664	金山办 公	2022- 07-26	452,7 50.00	2,500.00	14	3.2 0	563.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0001 0290	中科创 达	2022- 07-26	136,2 50.00	1,000.00	14	3.2 0	169.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0001 0292	深信服	2022- 07-26	95,00 0.00	1,000.00	14	3.2 0	118.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0001 1682	容百科 技	2022- 07-26	145,0 20.00	1,000.00	14	3.2 0	180.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0001 1692	中控技 术	2022- 07-26	9,580 ,010. 00	119,900.0 0	14	3.2 0	11,92 1.79	0.00	0.00
广发证 券	2022 0726 0001 1700	大全能 源	2022- 07-26	992,5 28.00	16,400.00	14	3.2 0	1,235 .15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0727 0002 2296	沪硅产 业	2022- 07-27	310,6 88.00	15,200.00	14	3.2 0	386.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0727 0002 6904	华大基 因	2022- 07-27	6,852 ,258. 00	107,100.0 0	14	3.2 0	8,527 .25	0.00	0.00
广发证 券	2022 0728 0001 1833	圣邦股 份	2022- 07-28	4,416 ,192. 00	26,400.00	14	2.0 0	3,434 .82	0.00	0.00
广发证 券	2022 0728 0001	乐普医 疗	2022- 07-28	134,4 24.00	7,200.00	14	3.2 1	167.8 1	0.00	0.00

	1835									
广发证 券	2022 0801 0001 2873	金山办 公	2022- 08-01	174,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	216.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 6067	传音控 股	2022- 08-01	70,89 0.00	1,000.00	14	3.2 0	88.22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 6121	中芯国 际	2022- 08-01	48,21 6.00	1,200.00	14	3.2 0	60.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 6133	康泰生 物	2022- 08-01	817,7 16.00	24,900.00	14	6.4 1	2,038 .38	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 6197	阳光电 源	2022- 08-01	128,0 40.00	1,000.00	14	3.2 0	159.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 6409	卓胜微	2022- 08-01	280,6 91.00	2,900.00	14	4.4 0	480.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 7207	天合光 能	2022- 08-01	5,627 ,840. 00	68,800.00	14	3.2 0	7,003 .53	0.00	0.00
广发证 券	2022 0801 0001 7319	澜起科 技	2022- 08-01	69,90 0.00	1,200.00	14	3.2 0	86.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 0802 0000 9525	九号公 司	2022- 08-02	302,6 70.00	5,700.00	14	3.2 0	376.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0802 0001 1505	大全能 源	2022- 08-02	207,3 40.00	3,500.00	14	3.5 1	283.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0803 0000 1133	沪硅产 业	2022- 08-03	155,4 90.00	7,100.00	14	3.4 1	206.2 0	0.00	0.00

广发证 券	2022 0803 0001 4709	阳光电 源	2022- 08-03	9,616 ,000. 00	80,000.00	14	0.8 0	2,991 .64	0.00	0.00
广发证 券	2022 0804 0000 1324	阳光电 源	2022- 08-04	330,6 24.00	2,800.00	14	3.4 0	437.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0804 0000 1337	奇安信	2022- 08-04	177,6 60.00	3,500.00	14	3.2 0	221.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0804 0001 2646	中微公 司	2022- 08-04	8,432 ,000. 00	62,000.00	14	3.0 0	9,837 .33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0804 0001 2648	中控技 术	2022- 08-04	1,199 ,400. 00	15,000.00	14	3.2 0	1,492 .59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0804 0001 4468	沪硅产 业	2022- 08-04	308,2 26.00	14,100.00	14	3.2 0	383.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0805 0000 8637	九号公 司	2022- 08-05	261,3 60.00	4,800.00	14	3.2 0	325.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0808 0000 0804	卓胜微	2022- 08-08	240,3 50.00	2,300.00	14	3.2 0	299.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0808 0002 1353	沪硅产 业	2022- 08-08	1,829 ,472. 00	81,600.00	14	3.2 0	2,276 .68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0808 0002 2519	大全能 源	2022- 08-08	593,2 00.00	10,000.00	14	2.0 0	461.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0808 0002 2523	北京君 正	2022- 08-08	368,5 62.00	3,800.00	14	3.2 0	458.6 5	0.00	0.00
广发证	2022	华大基	2022-	336,1	5,500.00	14	3.2	418.2	0.00	0.00

券	0808 0002 2569	因	08-08	05.00			0	6		
广发证 券	2022 0809 0001 1934	大全能 源	2022- 08-09	1,009 ,420. 00	16,400.00	14	3.2 0	1,256 .17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0809 0001 2352	容百科 技	2022- 08-09	128,5 00.00	1,000.00	14	3.2 0	159.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0809 0001 2636	中控技 术	2022- 08-09	9,889 ,352. 00	119,900.0 0	14	3.2 0	12,30 6.75	0.00	0.00
广发证 券	2022 0809 0001 5388	深信服	2022- 08-09	103,9 00.00	1,000.00	14	3.2 0	129.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0809 0001 5390	中科创 达	2022- 08-09	147,4 00.00	1,000.00	14	3.2 0	183.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0810 0002 9704	沪硅产 业	2022- 08-10	341,6 96.00	15,200.00	14	3.2 0	425.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0811 0001 5292	圣邦股 份	2022- 08-11	4,771 ,272. 00	26,400.00	14	2.0 0	3,710 .99	0.00	0.00
广发证 券	2022 0811 0001 6042	乐普医 疗	2022- 08-11	130,8 96.00	7,200.00	14	3.2 1	163.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 6239	中芯国 际	2022- 08-15	50,20 8.00	1,200.00	14	3.2 0	62.48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 6273	澜起科 技	2022- 08-15	70,21 2.00	1,200.00	14	3.2 0	87.37	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815	传音控 股	2022- 08-15	71,63 0.00	1,000.00	14	3.2 0	89.14	0.00	0.00

	0001 6853									
广发证 券	2022 0815 0001 6863	金山办 公	2022- 08-15	186,6 60.00	1,000.00	14	3.2 0	232.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 6869	阳光电 源	2022- 08-15	130,9 80.00	1,000.00	14	3.2 0	163.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 8517	卓胜微	2022- 08-15	284,2 00.00	2,900.00	14	4.4 0	486.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 8827	康泰生 物	2022- 08-15	882,9 54.00	24,900.00	14	6.4 1	2,201 .01	0.00	0.00
广发证 券	2022 0815 0001 8891	天合光 能	2022- 08-15	5,812 ,224. 00	68,800.00	14	3.2 0	7,232 .99	0.00	0.00
广发证 券	2022 0816 0001 1276	大全能 源	2022- 08-16	219,6 95.00	3,500.00	14	3.5 1	299.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0816 0001 1384	九号公 司	2022- 08-16	305,5 20.00	5,700.00	14	3.2 0	380.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0817 0001 7755	阳光电 源	2022- 08-17	10,80 0,000 .00	80,000.00	14	0.8 0	3,360 .00	0.00	0.00
广发证 券	2022 0817 0001 7793	沪硅产 业	2022- 08-17	153,7 15.00	7,100.00	14	3.4 1	203.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1280	中科创 达	2022- 08-18	218,1 44.00	1,600.00	14	2.5 0	212.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000	华大基 因	2022- 08-18	73,63 2.00	1,200.00	14	2.5 0	71.59	0.00	0.00

	1281									
广发证 券	2022 0818 0000 1284	北京君 正	2022- 08-18	89,40 0.00	1,000.00	14	2.5 0	86.92	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1292	卓胜微	2022- 08-18	164,6 08.00	1,600.00	14	2.5 0	160.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1293	汇川技 术	2022- 08-18	559,1 72.00	8,600.00	14	2.5 0	543.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1296	亿纬锂 能	2022- 08-18	610,9 02.00	5,400.00	14	2.5 0	593.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1297	晶盛机 电	2022- 08-18	252,0 30.00	3,000.00	14	2.5 0	245.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1300	三环集 团	2022- 08-18	155,9 52.00	5,400.00	14	2.5 0	151.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1308	先导智 能	2022- 08-18	325,5 20.00	5,200.00	14	2.5 0	316.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1310	沃森生 物	2022- 08-18	319,8 08.00	7,600.00	14	2.5 0	310.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1312	迈瑞医 疗	2022- 08-18	649,8 80.00	2,200.00	14	2.5 0	631.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1316	容百科 技	2022- 08-18	135,3 60.00	1,200.00	14	2.5 0	131.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1318	康泰生 物	2022- 08-18	109,7 92.00	3,200.00	14	2.5 0	106.7 4	0.00	0.00

广发证 券	2022 0818 0000 1320	凯赛生 物	2022- 08-18	80,08 0.00	1,000.00	14	2.5 0	77.86	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1322	金山办 公	2022- 08-18	172,3 30.00	1,000.00	14	2.5 0	167.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1323	亿联网 络	2022- 08-18	117,8 40.00	1,600.00	14	2.5 0	114.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1325	智飞生 物	2022- 08-18	352,6 40.00	3,800.00	14	2.5 0	342.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1328	君实生 物	2022- 08-18	97,39 2.00	1,600.00	14	2.5 0	94.69	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1330	泰格医 药	2022- 08-18	251,5 68.00	2,400.00	14	2.5 0	244.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1332	奇安信	2022- 08-18	65,16 0.00	1,200.00	14	2.5 0	63.35	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1336	康龙化 成	2022- 08-18	174,0 96.00	2,400.00	14	2.5 0	169.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1338	中芯国 际	2022- 08-18	385,2 96.00	9,200.00	14	2.5 0	374.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1340	和辉光 电	2022- 08-18	35,36 0.00	13,000.00	14	2.5 0	34.38	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1344	中国通 号	2022- 08-18	53,80 2.00	12,200.00	14	2.5 0	52.31	0.00	0.00
广发证	2022	天能股	2022-	46,45	1,000.00	14	2.5	45.16	0.00	0.00

券	0818 0000 1346	份	08-18	0.00			0			
广发证 券	2022 0818 0000 1828	宁德时 代	2022- 08-18	1,089 ,600. 00	2,000.00	14	2.5 0	1,059 .33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1832	中伟股 份	2022- 08-18	112,5 60.00	1,000.00	14	2.5 0	109.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1834	欣旺达	2022- 08-18	185,0 80.00	5,600.00	14	2.5 0	179.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1836	圣邦股 份	2022- 08-18	204,8 28.00	1,200.00	14	2.5 0	199.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1837	深信服	2022- 08-18	119,9 76.00	1,200.00	14	2.5 0	116.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1838	蓝思科 技	2022- 08-18	119,0 04.00	9,400.00	14	2.5 0	115.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1841	乐普医 疗	2022- 08-18	105,7 80.00	6,000.00	14	2.5 0	102.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1847	阳光电 源	2022- 08-18	672,1 92.00	4,800.00	14	2.5 0	653.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1859	锦浪科 技	2022- 08-18	282,9 80.00	1,000.00	14	2.5 0	275.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1871	澜起科 技	2022- 08-18	123,0 90.00	2,200.00	14	2.5 0	119.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818	九号公 司	2022- 08-18	85,72 8.00	1,600.00	14	2.5 0	83.35	0.00	0.00

	0000 1882									
广发证 券	2022 0818 0000 1886	中控技 术	2022- 08-18	115,9 48.00	1,400.00	14	2.5 0	112.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1890	天合光 能	2022- 08-18	425,0 00.00	5,000.00	14	2.5 0	413.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1894	传音控 股	2022- 08-18	95,83 2.00	1,200.00	14	2.5 0	93.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1898	华润微	2022- 08-18	139,0 80.00	2,400.00	14	2.5 0	135.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1900	沪硅产 业	2022- 08-18	115,7 52.00	5,200.00	14	2.5 0	112.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1904	大全能 源	2022- 08-18	62,69 0.00	1,000.00	14	2.5 0	60.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1908	晶科能 源	2022- 08-18	120,7 80.00	6,600.00	14	2.5 0	117.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1912	时代电 气	2022- 08-18	66,62 0.00	1,000.00	14	2.5 0	64.77	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1916	中微公 司	2022- 08-18	251,6 40.00	1,800.00	14	2.5 0	244.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0000 1920	格科微	2022- 08-18	20,67 0.00	1,000.00	14	2.5 0	20.10	0.00	0.00
广发证 券	2022 0818 0001	中控技 术	2022- 08-18	1,242 ,300. 00	15,000.00	14	3.2 0	1,545 .97	0.00	0.00

	3293									
广发证 券	2022 0818 0001 3511	中微公 司	2022- 08-18	8,667 ,600. 00	62,000.00	14	3.0 0	10,11 2.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0819 0000 8738	九号公 司	2022- 08-19	247,4 88.00	4,800.00	14	3.2 0	307.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0822 0001 8067	华大基 因	2022- 08-22	332,3 10.00	5,500.00	14	3.2 0	413.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0822 0001 8083	北京君 正	2022- 08-22	328,7 00.00	3,800.00	14	3.2 0	409.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0822 0001 8089	沪硅产 业	2022- 08-22	1,747 ,872. 00	81,600.00	14	3.2 0	2,175 .13	0.00	0.00
广发证 券	2022 0822 0001 8105	大全能 源	2022- 08-22	606,2 00.00	10,000.00	14	2.0 0	471.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0822 0001 8571	卓胜微	2022- 08-22	229,7 70.00	2,300.00	14	3.2 0	285.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0823 0001 2758	深信服	2022- 08-23	99,00 0.00	1,000.00	14	3.2 0	123.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0823 0001 2852	中科创 达	2022- 08-23	130,4 80.00	1,000.00	14	3.2 0	162.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0823 0001 2862	中控技 术	2022- 08-23	10,02 2,441 .00	119,900.0 0	14	3.2 0	12,47 2.37	0.00	0.00
广发证 券	2022 0823 0001 3608	大全能 源	2022- 08-23	982,0 32.00	16,400.00	14	3.2 0	1,222 .08	0.00	0.00

广发证 券	2022 0823 0001 3748	容百科 技	2022- 08-23	114,3 10.00	1,000.00	7	3.2 0	71.13	0.00	0.00
广发证 券	2022 0824 0003 1437	沪硅产 业	2022- 08-24	308,5 60.00	15,200.00	7	3.2 0	191.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0825 0001 0742	圣邦股 份	2022- 08-25	4,332 ,504. 00	26,400.00	7	2.0 0	1,684 .86	0.00	0.00
广发证 券	2022 0825 0001 4464	乐普医 疗	2022- 08-25	124,5 60.00	7,200.00	7	3.2 1	77.75	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0000 1049	卓胜微	2022- 08-29	4,817 ,016. 00	52,200.00	14	4.4 0	8,831 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 5201	中芯国 际	2022- 08-29	48,09 6.00	1,200.00	7	3.2 0	29.93	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 5211	传音控 股	2022- 08-29	70,63 0.00	1,000.00	7	3.2 0	43.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 5257	金山办 公	2022- 08-29	163,0 00.00	1,000.00	7	3.2 0	101.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 6489	康泰生 物	2022- 08-29	820,7 04.00	24,900.00	7	6.4 1	1,022 .92	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 8235	阳光电 源	2022- 08-29	132,1 50.00	1,000.00	7	3.2 0	82.23	0.00	0.00
广发证 券	2022 0829 0001 8305	澜起科 技	2022- 08-29	65,61 6.00	1,200.00	7	3.2 0	40.83	0.00	0.00
广发证	2022	卓胜微	2022-	267,6	2,900.00	7	4.4	228.9	0.00	0.00

券	0829 0001 8313		08-29	12.00			0	6		
广发证 券	2022 0830 0001 2618	容百科 技	2022- 08-30	105,8 00.00	1,000.00	7	3.2 0	65.83	0.00	0.00
广发证 券	2022 0830 0001 4598	大全能 源	2022- 08-30	200,9 00.00	3,500.00	7	3.5 1	137.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0830 0001 4604	九号公 司	2022- 08-30	249,9 45.00	5,700.00	7	3.2 0	155.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0831 0000 0919	天合光 能	2022- 08-31	7,263 ,384. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,914 .52	0.00	0.00
广发证 券	2022 0831 0001 7854	沪硅产 业	2022- 08-31	146,2 60.00	7,100.00	7	3.4 1	96.98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0831 0001 7902	沪硅产 业	2022- 08-31	313,1 20.00	15,200.00	7	3.2 0	194.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0831 0001 8118	阳光电 源	2022- 08-31	8,912 ,000. 00	80,000.00	7	0.8 0	1,386 .31	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 3182	三环集 团	2022- 09-01	144,4 50.00	5,400.00	7	2.5 0	70.22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 3184	亿纬锂 能	2022- 09-01	510,7 86.00	5,400.00	7	2.5 0	248.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 3186	先导智 能	2022- 09-01	279,8 12.00	5,200.00	7	2.5 0	136.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901	乐普医 疗	2022- 09-01	116,8 80.00	6,000.00	7	2.5 0	56.82	0.00	0.00

	0001 3228									
广发证 券	2022 0901 0001 3232	欣旺达	2022- 09-01	149,5 20.00	5,600.00	7	2.5 0	72.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 3234	沪硅产 业	2022- 09-01	104,2 60.00	5,200.00	7	2.5 0	50.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4426	汇川技 术	2022- 09-01	492,1 78.00	8,600.00	7	2.5 0	239.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4428	沃森生 物	2022- 09-01	329,0 80.00	7,600.00	7	2.5 0	159.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4430	中芯国 际	2022- 09-01	367,5 40.00	9,200.00	7	2.5 0	178.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4508	中微公 司	2022- 09-01	219,0 60.00	1,800.00	7	2.5 0	106.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4512	晶科能 源	2022- 09-01	115,2 36.00	6,600.00	7	2.5 0	56.02	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4514	蓝思科 技	2022- 09-01	100,2 98.00	9,400.00	7	2.5 0	48.76	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4516	乐普医 疗	2022- 09-01	140,2 56.00	7,200.00	7	3.2 1	87.54	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4630	康泰生 物	2022- 09-01	108,1 60.00	3,200.00	7	2.5 0	52.58	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001	迈瑞医 疗	2022- 09-01	649,0 00.00	2,200.00	7	2.5 0	315.4 9	0.00	0.00

	4632									
广发证 券	2022 0901 0001 4636	康龙化 成	2022- 09-01	157,9 20.00	2,400.00	7	2.5 0	76.77	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4640	晶盛机 电	2022- 09-01	223,4 10.00	3,000.00	7	2.5 0	108.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4642	和辉光 电	2022- 09-01	33,28 0.00	13,000.00	7	2.5 0	16.18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4644	中国通 号	2022- 09-01	52,82 6.00	12,200.00	7	2.5 0	25.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 4718	澜起科 技	2022- 09-01	124,2 56.00	2,200.00	7	2.5 0	60.40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 7564	中微公 司	2022- 09-01	7,545 ,400. 00	62,000.00	7	3.0 0	4,401 .48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 7616	天合光 能	2022- 09-01	365,6 00.00	5,000.00	7	2.5 0	177.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 8774	中控技 术	2022- 09-01	1,162 ,200. 00	15,000.00	7	3.2 0	723.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 8986	时代电 气	2022- 09-01	61,88 0.00	1,000.00	7	2.5 0	30.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 8992	中科创 达	2022- 09-01	190,4 16.00	1,600.00	7	2.5 0	92.56	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 8994	亿联网 络	2022- 09-01	114,0 80.00	1,600.00	7	2.5 0	55.46	0.00	0.00

广发证 券	2022 0901 0001 8996	圣邦股 份	2022- 09-01	4,116 ,816. 00	26,400.00	7	2.0 0	1,600 .98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 8998	泰格医 药	2022- 09-01	260,2 56.00	2,400.00	7	2.5 0	126.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9000	奇安信	2022- 09-01	59,64 0.00	1,200.00	7	2.5 0	28.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9002	北京君 正	2022- 09-01	80,53 0.00	1,000.00	7	2.5 0	39.15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9004	容百科 技	2022- 09-01	120,3 84.00	1,200.00	7	2.5 0	58.52	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9006	凯赛生 物	2022- 09-01	69,40 0.00	1,000.00	7	2.5 0	33.74	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9008	金山办 公	2022- 09-01	190,6 10.00	1,000.00	7	2.5 0	92.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9010	智飞生 物	2022- 09-01	375,2 50.00	3,800.00	7	2.5 0	182.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9012	君实生 物	2022- 09-01	84,49 6.00	1,600.00	7	2.5 0	41.07	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9014	卓胜微	2022- 09-01	157,8 40.00	1,600.00	7	2.5 0	76.73	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9016	天能股 份	2022- 09-01	37,65 0.00	1,000.00	7	2.5 0	18.30	0.00	0.00
广发证	2022	深信服	2022-	119,0	1,200.00	7	2.5	57.89	0.00	0.00

券	0901 0001 9180		09-01	88.00			0			
广发证 券	2022 0901 0001 9182	宁德时代	2022- 09-01	935,0 80.00	2,000.00	7	2.5 0	454.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9184	格科微	2022- 09-01	16,77 0.00	1,000.00	7	2.5 0	8.15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9190	中伟股 份	2022- 09-01	92,26 0.00	1,000.00	7	2.5 0	44.85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9192	传音控 股	2022- 09-01	80,55 6.00	1,200.00	7	2.5 0	39.16	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9194	华润微	2022- 09-01	122,7 84.00	2,400.00	7	2.5 0	59.69	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9200	锦浪科 技	2022- 09-01	232,4 60.00	1,000.00	7	2.5 0	113.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9212	九号公 司	2022- 09-01	68,48 0.00	1,600.00	7	2.5 0	33.29	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9214	中控技 术	2022- 09-01	108,4 72.00	1,400.00	7	2.5 0	52.73	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9222	阳光电 源	2022- 09-01	536,6 40.00	4,800.00	7	2.5 0	260.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901 0001 9224	圣邦股 份	2022- 09-01	187,1 28.00	1,200.00	7	2.5 0	90.97	0.00	0.00
广发证 券	2022 0901	大全能 源	2022- 09-01	54,95 0.00	1,000.00	7	2.5 0	26.71	0.00	0.00

	0001 9236									
广发证 券	2022 0902 0000 1137	卓胜微	2022- 09-02	224,5 10.00	2,200.00	14	3.2 0	279.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0902 0000 1154	三环集 团	2022- 09-02	444,1 12.00	16,400.00	14	3.4 0	587.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0902 0000 1192	格科微	2022- 09-02	937,8 48.00	55,200.00	14	3.3 0	1,203 .57	0.00	0.00
广发证 券	2022 0902 0000 9373	九号公 司	2022- 09-02	206,2 56.00	4,800.00	7	3.2 0	128.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 0603	大全能 源	2022- 09-05	557,7 00.00	10,000.00	14	2.0 0	433.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 1223	卓胜微	2022- 09-05	226,7 80.00	2,300.00	14	3.2 0	282.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 1335	阳光电 源	2022- 09-05	116,9 70.00	1,000.00	7	3.2 0	83.18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 1357	金山办 公	2022- 09-05	188,8 80.00	1,000.00	7	3.2 0	134.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 1927	中芯国 际	2022- 09-05	47,92 8.00	1,200.00	7	3.2 0	34.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 1943	传音控 股	2022- 09-05	62,75 0.00	1,000.00	7	3.2 0	44.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002	澜起科 技	2022- 09-05	67,71 6.00	1,200.00	7	3.2 0	48.15	0.00	0.00

	1983									
广发证 券	2022 0905 0002 3277	卓胜微	2022- 09-05	285,9 40.00	2,900.00	7	4.4 0	279.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0905 0002 3941	康泰生 物	2022- 09-05	815,7 24.00	24,900.00	7	6.4 1	1,161 .95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 3419	中控技 术	2022- 09-06	8,277 ,500. 00	110,000.0 0	14	3.2 0	10,30 0.89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 4845	大全能 源	2022- 09-06	947,5 92.00	16,400.00	14	3.2 0	1,179 .23	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 4925	九号公 司	2022- 09-06	255,3 60.00	5,700.00	14	3.2 0	317.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 8829	中科创 达	2022- 09-06	125,4 90.00	1,000.00	14	3.2 0	156.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 8879	深信服	2022- 09-06	105,5 20.00	1,000.00	14	3.2 0	131.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 9389	容百科 技	2022- 09-06	100,7 20.00	1,000.00	14	3.2 0	125.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0906 0001 9447	大全能 源	2022- 09-06	202,2 30.00	3,500.00	14	3.5 1	276.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0907 0000 0761	传音控 股	2022- 09-07	1,006 ,105. 00	15,500.00	14	3.2 0	1,252 .04	0.00	0.00
广发证 券	2022 0907 0002 9168	阳光电 源	2022- 09-07	9,772 ,800. 00	80,000.00	14	0.8 0	3,040 .43	0.00	0.00

广发证 券	2022 0907 0003 4842	沪硅产 业	2022- 09-07	309,4 72.00	15,200.00	14	3.2 0	385.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0907 0003 5470	沪硅产 业	2022- 09-07	144,5 56.00	7,100.00	14	3.4 1	191.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 2920	晶科能 源	2022- 09-08	121,2 42.00	6,600.00	14	2.5 0	117.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 2978	中控技 术	2022- 09-08	109,9 84.00	1,400.00	14	2.5 0	106.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3022	迈瑞医 疗	2022- 09-08	635,5 36.00	2,200.00	14	2.5 0	617.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3036	智飞生 物	2022- 09-08	337,7 82.00	3,800.00	14	2.5 0	328.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3060	蓝思科 技	2022- 09-08	101,9 90.00	9,400.00	14	2.5 0	99.16	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3062	深信服	2022- 09-08	127,3 56.00	1,200.00	14	2.5 0	123.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3068	华润微	2022- 09-08	124,8 48.00	2,400.00	14	2.5 0	121.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3078	九号公 司	2022- 09-08	68,84 8.00	1,600.00	14	2.5 0	66.94	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 3082	中微公 司	2022- 09-08	230,8 68.00	1,800.00	14	2.5 0	224.4 6	0.00	0.00
广发证	2022	宁德时代	2022-	899,0	2,000.00	14	2.5	874.0	0.00	0.00

券	0908 0001 3108	代	09-08	00.00			0	3		
广发证 券	2022 0908 0001 3112	中伟股 份	2022- 09-08	93,40 0.00	1,000.00	14	2.5 0	90.81	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4390	格科微	2022- 09-08	16,81 0.00	1,000.00	14	2.5 0	16.34	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4396	中控技 术	2022- 09-08	1,021 ,280. 00	13,000.00	14	3.2 0	1,270 .93	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4416	乐普医 疗	2022- 09-08	144,7 20.00	7,200.00	14	3.2 1	180.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4446	锦浪科 技	2022- 09-08	263,0 10.00	1,000.00	14	2.5 0	255.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4452	大全能 源	2022- 09-08	56,75 0.00	1,000.00	14	2.5 0	55.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4454	金山办 公	2022- 09-08	187,9 90.00	1,000.00	14	2.5 0	182.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4478	阳光电 源	2022- 09-08	582,6 72.00	4,800.00	14	2.5 0	566.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4482	时代电 气	2022- 09-08	60,41 0.00	1,000.00	14	2.5 0	58.73	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 4488	天合光 能	2022- 09-08	374,8 50.00	5,000.00	14	2.5 0	364.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908	乐普医 疗	2022- 09-08	120,6 00.00	6,000.00	14	2.5 0	117.2 5	0.00	0.00

	0001 4534									
广发证 券	2022 0908 0001 6662	康泰生 物	2022- 09-08	101,1 84.00	3,200.00	14	2.5 0	98.37	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 6946	卓胜微	2022- 09-08	152,6 40.00	1,600.00	14	2.5 0	148.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7034	中芯国 际	2022- 09-08	367,4 48.00	9,200.00	14	2.5 0	357.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7042	中国通 号	2022- 09-08	54,16 8.00	12,200.00	14	2.5 0	52.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7044	澜起科 技	2022- 09-08	128,4 58.00	2,200.00	14	2.5 0	124.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7046	中微公 司	2022- 09-08	7,952 ,120. 00	62,000.00	14	3.0 0	9,277 .47	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7424	亿联网 络	2022- 09-08	115,6 80.00	1,600.00	14	2.5 0	112.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7426	圣邦股 份	2022- 09-08	188,7 72.00	1,200.00	14	2.5 0	183.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7430	和辉光 电	2022- 09-08	34,06 0.00	13,000.00	14	2.5 0	33.11	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7444	沪硅产 业	2022- 09-08	105,7 16.00	5,200.00	14	2.5 0	102.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001	亿纬锂 能	2022- 09-08	513,0 00.00	5,400.00	14	2.5 0	498.7 5	0.00	0.00

	7456									
广发证 券	2022 0908 0001 7480	中科创 达	2022- 09-08	191,0 72.00	1,600.00	14	2.5 0	185.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7494	天能股 份	2022- 09-08	41,62 0.00	1,000.00	14	2.5 0	40.46	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7520	容百科 技	2022- 09-08	120,6 00.00	1,200.00	14	2.5 0	117.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7546	欣旺达	2022- 09-08	149,4 64.00	5,600.00	14	2.5 0	145.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7548	北京君 正	2022- 09-08	77,62 0.00	1,000.00	14	2.5 0	75.46	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7552	晶盛机 电	2022- 09-08	248,7 00.00	3,000.00	14	2.5 0	241.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7556	泰格医 药	2022- 09-08	237,7 20.00	2,400.00	14	2.5 0	231.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7560	三环集 团	2022- 09-08	144,1 80.00	5,400.00	14	2.5 0	140.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7564	先导智 能	2022- 09-08	280,1 76.00	5,200.00	14	2.5 0	272.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7566	君实生 物	2022- 09-08	83,10 4.00	1,600.00	14	2.5 0	80.80	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7610	汇川技 术	2022- 09-08	499,0 58.00	8,600.00	14	2.5 0	485.2 0	0.00	0.00

广发证 券	2022 0908 0001 7612	沃森生 物	2022- 09-08	315,2 48.00	7,600.00	14	2.5 0	306.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7616	传音控 股	2022- 09-08	79,90 8.00	1,200.00	14	2.5 0	77.69	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7618	凯赛生 物	2022- 09-08	64,75 0.00	1,000.00	14	2.5 0	62.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7640	康龙化 成	2022- 09-08	148,3 20.00	2,400.00	14	2.5 0	144.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0908 0001 7644	奇安信	2022- 09-08	59,04 0.00	1,200.00	14	2.5 0	57.40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0909 0000 0655	中科创 达	2022- 09-09	422,4 85.00	3,500.00	14	3.5 1	576.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0909 0000 0657	乐普医 疗	2022- 09-09	1,071 ,616. 00	51,200.00	7	3.4 1	710.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0909 0001 9619	九号公 司	2022- 09-09	209,7 60.00	4,800.00	14	3.2 0	261.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0002 2735	传音控 股	2022- 09-13	66,65 0.00	1,000.00	14	3.2 0	82.94	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0002 9627	金山办 公	2022- 09-13	193,5 90.00	1,000.00	14	3.2 0	240.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0002 9857	康泰生 物	2022- 09-13	810,9 93.00	24,900.00	14	6.4 1	2,021 .63	0.00	0.00
广发证	2022	卓胜微	2022-	4,964	52,200.00	14	4.4	8,494	0.00	0.00

券	0913 0002 9927		09-13	,220. 00			0	.33		
广发证 券	2022 0913 0003 0401	卓胜微	2022- 09-13	275,7 90.00	2,900.00	14	4.4 0	471.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0003 0765	澜起科 技	2022- 09-13	69,85 2.00	1,200.00	14	3.2 0	86.93	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0003 0817	阳光电 源	2022- 09-13	118,3 60.00	1,000.00	14	3.2 0	147.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0913 0003 0825	中芯国 际	2022- 09-13	48,48 0.00	1,200.00	14	3.2 0	60.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0914 0000 1157	三环集 团	2022- 09-14	439,8 48.00	16,400.00	14	3.2 0	547.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0914 0000 1275	石头科 技	2022- 09-14	518,6 70.00	1,700.00	14	3.2 0	645.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0914 0001 7218	天合光 能	2022- 09-14	7,270 ,496. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,924 .23	0.00	0.00
广发证 券	2022 0915 0000 0705	卓胜微	2022- 09-15	1,787 ,940. 00	17,200.00	14	3.2 1	2,231 .95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0916 0000 1174	亿联网 络	2022- 09-16	1,224 ,000. 00	18,000.00	14	3.2 0	1,523 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0916 0001 1260	卓胜微	2022- 09-16	224,8 40.00	2,200.00	14	3.2 0	279.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0916	格科微	2022- 09-16	883,2 00.00	55,200.00	14	3.3 0	1,133 .44	0.00	0.00

	0001 1280									
广发证 券	2022 0916 0001 1282	三环集 团	2022- 09-16	437,5 52.00	16,400.00	14	3.4 0	578.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0919 0002 1860	大全能 源	2022- 09-19	520,1 00.00	10,000.00	14	2.0 0	606.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0919 0002 1882	卓胜微	2022- 09-19	229,1 95.00	2,300.00	14	3.2 0	427.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0000 0564	亿联网 络	2022- 09-20	724,3 50.00	11,000.00	14	3.4 0	1,368 .22	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5777	大全能 源	2022- 09-20	183,6 80.00	3,500.00	14	3.5 1	358.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5787	九号公 司	2022- 09-20	227,2 02.00	5,700.00	14	3.2 0	403.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5825	深信服	2022- 09-20	111,5 00.00	1,000.00	14	3.2 0	198.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5827	中科创 达	2022- 09-20	112,3 90.00	1,000.00	14	3.2 0	199.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5847	中控技 术	2022- 09-20	8,728 ,500. 00	110,000.0 0	14	3.2 0	15,51 7.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001 5883	大全能 源	2022- 09-20	860,6 72.00	16,400.00	14	3.2 0	1,530 .08	0.00	0.00
广发证 券	2022 0920 0001	容百科 技	2022- 09-20	93,45 0.00	1,000.00	14	3.2 0	166.1 3	0.00	0.00

	6539									
广发证 券	2022 0921 0000 0869	汇川技 术	2022- 09-21	57,55 0.00	1,000.00	14	3.2 0	97.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0921 0002 5464	阳光电 源	2022- 09-21	9,024 ,000. 00	80,000.00	14	0.8 0	3,810 .13	0.00	0.00
广发证 券	2022 0921 0002 6870	沪硅产 业	2022- 09-21	137,3 85.00	7,100.00	14	3.4 1	247.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 0079	三环集 团	2022- 09-22	136,6 20.00	5,400.00	14	2.5 0	170.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 0083	蓝思科 技	2022- 09-22	92,12 0.00	9,400.00	14	2.5 0	115.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 0169	中国通 号	2022- 09-22	51,24 0.00	12,200.00	14	2.5 0	64.05	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 0189	北京君 正	2022- 09-22	73,64 0.00	1,000.00	14	2.5 0	92.05	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1651	乐普医 疗	2022- 09-22	136,5 84.00	7,200.00	14	3.2 1	219.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1653	乐普医 疗	2022- 09-22	113,8 20.00	6,000.00	14	2.5 0	142.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1691	智飞生 物	2022- 09-22	310,9 16.00	3,800.00	14	2.5 0	388.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1699	晶科能 源	2022- 09-22	119,0 64.00	6,600.00	14	2.5 0	148.8 3	0.00	0.00

广发证 券	2022 0922 0001 1717	金山办 公	2022- 09-22	216,7 60.00	1,000.00	14	2.5 0	270.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1723	容百科 技	2022- 09-22	111,2 04.00	1,200.00	14	2.5 0	139.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1725	澜起科 技	2022- 09-22	120,4 06.00	2,200.00	14	2.5 0	150.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1747	欣旺达	2022- 09-22	144,4 24.00	5,600.00	14	2.5 0	180.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1757	阳光电 源	2022- 09-22	547,9 20.00	4,800.00	14	2.5 0	684.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 1763	宁德时代	2022- 09-22	829,9 80.00	2,000.00	14	2.5 0	1,037 .48	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2555	中芯国 际	2022- 09-22	353,7 40.00	9,200.00	14	2.5 0	442.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2559	天能股 份	2022- 09-22	35,91 0.00	1,000.00	14	2.5 0	44.89	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2579	传音控 股	2022- 09-22	70,14 0.00	1,200.00	14	2.5 0	87.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2591	深信服	2022- 09-22	129,8 64.00	1,200.00	14	2.5 0	162.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2595	先导智 能	2022- 09-22	261,5 60.00	5,200.00	14	2.5 0	326.9 5	0.00	0.00
广发证	2022	和辉光	2022-	33,67	13,000.00	14	2.5	42.09	0.00	0.00

券	0922 0001 2613	电	09-22	0.00			0			
广发证 券	2022 0922 0001 2625	奇安信	2022- 09-22	61,80 0.00	1,200.00	14	2.5 0	77.25	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2627	君实生 物	2022- 09-22	76,94 4.00	1,600.00	14	2.5 0	96.18	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2689	天合光 能	2022- 09-22	334,7 00.00	5,000.00	14	2.5 0	418.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 2705	大全能 源	2022- 09-22	52,08 0.00	1,000.00	14	2.5 0	65.10	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3119	康龙化 成	2022- 09-22	123,6 72.00	2,400.00	14	2.5 0	154.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3121	迈瑞医 疗	2022- 09-22	574,0 90.00	2,200.00	14	2.5 0	717.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3125	锦浪科 技	2022- 09-22	237,9 60.00	1,000.00	14	2.5 0	297.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3129	卓胜微	2022- 09-22	146,6 24.00	1,600.00	14	2.5 0	183.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3583	中控技 术	2022- 09-22	1,015 ,950. 00	13,000.00	14	3.2 0	1,625 .52	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3589	九号公 司	2022- 09-22	62,25 6.00	1,600.00	14	2.5 0	77.82	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922	中伟股 份	2022- 09-22	88,39 0.00	1,000.00	14	2.5 0	110.4 9	0.00	0.00

	0001 3593									
广发证 券	2022 0922 0001 3599	亿纬锂 能	2022- 09-22	478,4 40.00	5,400.00	14	2.5 0	598.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3603	泰格医 药	2022- 09-22	209,5 68.00	2,400.00	14	2.5 0	261.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3617	中科创 达	2022- 09-22	176,1 92.00	1,600.00	14	2.5 0	220.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3621	汇川技 术	2022- 09-22	494,0 70.00	8,600.00	14	2.5 0	617.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3625	凯赛生 物	2022- 09-22	67,16 0.00	1,000.00	14	2.5 0	83.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3627	时代电 气	2022- 09-22	55,67 0.00	1,000.00	14	2.5 0	69.59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3637	华润微	2022- 09-22	116,1 60.00	2,400.00	14	2.5 0	145.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3653	沪硅产 业	2022- 09-22	99,89 2.00	5,200.00	14	2.5 0	124.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3659	中微公 司	2022- 09-22	210,2 22.00	1,800.00	14	2.5 0	262.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3661	中微公 司	2022- 09-22	7,240 ,980. 00	62,000.00	14	3.0 0	10,86 1.47	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001	中控技 术	2022- 09-22	109,4 10.00	1,400.00	14	2.5 0	136.7 6	0.00	0.00

	3667									
广发证 券	2022 0922 0001 3669	格科微	2022- 09-22	15,88 0.00	1,000.00	14	2.5 0	19.85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3677	晶盛机 电	2022- 09-22	215,4 30.00	3,000.00	14	2.5 0	269.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3679	康泰生 物	2022- 09-22	97,08 8.00	3,200.00	14	2.5 0	121.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3683	亿联网 络	2022- 09-22	101,5 68.00	1,600.00	14	2.5 0	126.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3685	圣邦股 份	2022- 09-22	165,6 36.00	1,200.00	14	2.5 0	207.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 0922 0001 3697	沃森生 物	2022- 09-22	287,6 60.00	7,600.00	14	2.5 0	359.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0923 0000 0545	乐普医 疗	2022- 09-23	785,6 28.00	41,700.00	14	2.5 0	927.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0923 0001 9522	中科创 达	2022- 09-23	379,9 60.00	3,500.00	14	3.5 1	629.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0923 0001 9620	九号公 司	2022- 09-23	182,9 76.00	4,800.00	14	3.2 0	276.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0926 0000 0496	深信服	2022- 09-26	429,7 21.00	4,100.00	14	3.2 0	534.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0000 0466	乐普医 疗	2022- 09-27	819,7 20.00	40,500.00	14	4.4 1	1,405 .82	0.00	0.00

广发证 券	2022 0927 0002 2805	卓胜微	2022- 09-27	5,045 ,130. 00	52,200.00	14	4.4 0	8,632 .78	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 3735	传音控 股	2022- 09-27	58,68 0.00	1,000.00	14	3.2 0	73.02	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 4429	康泰生 物	2022- 09-27	769,6 59.00	24,900.00	14	6.4 1	1,918 .59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 4817	卓胜微	2022- 09-27	280,2 85.00	2,900.00	14	4.4 0	479.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 4897	阳光电 源	2022- 09-27	119,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	148.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 6137	金山办 公	2022- 09-27	209,8 90.00	1,000.00	14	3.2 0	261.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0002 6141	澜起科 技	2022- 09-27	63,46 8.00	1,200.00	14	3.2 0	78.98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0927 0003 0297	中芯国 际	2022- 09-27	46,04 4.00	1,200.00	14	3.2 0	57.30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0928 0001 4241	石头科 技	2022- 09-28	455,3 96.00	1,700.00	14	3.2 0	566.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0928 0001 7345	三环集 团	2022- 09-28	404,9 16.00	16,400.00	14	3.2 0	503.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0928 0001 7391	天合光 能	2022- 09-28	6,783 ,832. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,259 .93	0.00	0.00
广发证	2022	金山办	2022-	430,5	2,100.00	14	3.2	535.7	0.00	0.00

券	0929 0000 0633	公	09-29	00.00			0	3		
广发证 券	2022 0929 0001 8729	卓胜微	2022- 09-29	1,576 ,896. 00	17,200.00	14	3.2 1	1,968 .49	0.00	0.00
广发证 券	2022 0930 0000 0317	汇川技 术	2022- 09-30	431,3 25.00	7,500.00	14	3.2 0	536.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0930 0000 0368	亿联网 络	2022- 09-30	157,5 00.00	2,500.00	14	3.2 0	196.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0930 0001 1383	卓胜微	2022- 09-30	194,5 02.00	2,200.00	14	3.2 0	242.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5679	深信服	2022- 10-10	362,2 76.00	4,100.00	14	3.2 0	450.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5743	先导智 能	2022- 10-10	242,1 12.00	5,200.00	14	2.5 0	235.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5765	智飞生 物	2022- 10-10	310,0 80.00	3,800.00	14	2.5 0	301.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5785	中科创 达	2022- 10-10	358,9 25.00	3,500.00	14	3.5 1	489.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5797	九号公 司	2022- 10-10	180,0 00.00	4,800.00	14	3.2 0	224.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 5835	沪硅产 业	2022- 10-10	88,66 0.00	5,200.00	14	2.5 0	86.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010	阳光电 源	2022- 10-10	539,6 64.00	4,800.00	14	2.5 0	524.6 7	0.00	0.00

	0008 7367									
广发证 券	2022 1010 0008 7381	晶盛机 电	2022- 10-10	197,7 00.00	3,000.00	14	2.5 0	192.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 7391	康泰生 物	2022- 10-10	92,76 8.00	3,200.00	14	2.5 0	90.19	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 8477	天合光 能	2022- 10-10	313,6 00.00	5,000.00	14	2.5 0	304.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 8531	大全能 源	2022- 10-10	165,7 95.00	3,500.00	14	3.5 1	226.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 8563	阳光电 源	2022- 10-10	8,994 ,400. 00	80,000.00	14	0.8 0	2,798 .26	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0008 8907	三环集 团	2022- 10-10	137,4 30.00	5,400.00	14	2.5 0	133.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0297	时代电 气	2022- 10-10	50,24 0.00	1,000.00	14	2.5 0	48.84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0305	君实生 物	2022- 10-10	75,00 8.00	1,600.00	14	2.5 0	72.92	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0335	卓胜微	2022- 10-10	186,5 76.00	2,300.00	14	3.2 0	232.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0357	深信服	2022- 10-10	106,0 32.00	1,200.00	14	2.5 0	103.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009	中科创 达	2022- 10-10	164,0 80.00	1,600.00	14	2.5 0	159.5 2	0.00	0.00

	0381									
广发证 券	2022 1010 0009 0439	奇安信	2022- 10-10	49,65 6.00	1,200.00	14	2.5 0	48.28	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0453	中伟股 份	2022- 10-10	80,20 0.00	1,000.00	14	2.5 0	77.97	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 0603	乐普医 疗	2022- 10-10	870,2 79.00	41,700.00	14	2.5 0	846.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1425	容百科 技	2022- 10-10	98,11 2.00	1,200.00	14	2.5 0	95.39	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1427	澜起科 技	2022- 10-10	97,02 0.00	2,200.00	14	2.5 0	94.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1437	中微公 司	2022- 10-10	156,4 92.00	1,800.00	14	2.5 0	152.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1475	北京君 正	2022- 10-10	66,09 0.00	1,000.00	14	2.5 0	64.25	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1495	亿联网 络	2022- 10-10	99,68 0.00	1,600.00	14	2.5 0	96.91	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1499	圣邦股 份	2022- 10-10	163,3 20.00	1,200.00	14	2.5 0	158.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1515	泰格医 药	2022- 10-10	189,8 88.00	2,400.00	14	2.5 0	184.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1517	宁德时代	2022- 10-10	785,7 20.00	2,000.00	14	2.5 0	763.8 9	0.00	0.00

广发证 券	2022 1010 0009 1519	康龙化 成	2022- 10-10	124,8 48.00	2,400.00	14	2.5 0	121.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1523	迈瑞医 疗	2022- 10-10	658,4 60.00	2,200.00	14	2.5 0	640.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1529	卓胜微	2022- 10-10	129,7 92.00	1,600.00	14	2.5 0	126.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1535	格科微	2022- 10-10	15,26 0.00	1,000.00	14	2.5 0	14.84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1537	中控技 术	2022- 10-10	103,5 72.00	1,400.00	14	2.5 0	100.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1551	九号公 司	2022- 10-10	60,00 0.00	1,600.00	14	2.5 0	58.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1569	华润微	2022- 10-10	107,2 56.00	2,400.00	14	2.5 0	104.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 1579	金山办 公	2022- 10-10	198,9 20.00	1,000.00	14	2.5 0	193.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 2151	晶科能 源	2022- 10-10	106,3 92.00	6,600.00	14	2.5 0	103.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 3023	凯赛生 物	2022- 10-10	57,49 0.00	1,000.00	14	2.5 0	55.89	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 3031	传音控 股	2022- 10-10	68,28 0.00	1,200.00	14	2.5 0	66.38	0.00	0.00
广发证	2022	深信服	2022-	88,36	1,000.00	14	3.2	109.9	0.00	0.00

券	1010 0009 3191		10-10	0.00			0	6		
广发证 券	2022 1010 0009 3199	容百科 技	2022- 10-10	81,76 0.00	1,000.00	14	3.2 0	101.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 3781	沪硅产 业	2022- 10-10	121,0 55.00	7,100.00	14	3.4 1	160.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0009 3837	大全能 源	2022- 10-10	776,8 68.00	16,400.00	14	3.2 0	966.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 2421	中控技 术	2022- 10-10	8,137 ,800. 00	110,000.0 0	14	3.2 0	10,12 7.04	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 2515	蓝思科 技	2022- 10-10	85,72 8.00	9,400.00	14	2.5 0	83.35	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 2523	汇川技 术	2022- 10-10	498,2 84.00	8,600.00	14	2.5 0	484.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 2561	和辉光 电	2022- 10-10	33,28 0.00	13,000.00	14	2.5 0	32.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3233	亿联网 络	2022- 10-10	685,3 00.00	11,000.00	14	3.4 0	906.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3309	中国通 号	2022- 10-10	50,63 0.00	12,200.00	14	2.5 0	49.22	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3345	大全能 源	2022- 10-10	473,7 00.00	10,000.00	14	2.0 0	368.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010	欣旺达	2022- 10-10	127,2 32.00	5,600.00	14	2.5 0	123.7 0	0.00	0.00

	0010 3353									
广发证 券	2022 1010 0010 3363	乐普医 疗	2022- 10-10	150,2 64.00	7,200.00	14	3.2 1	187.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3365	乐普医 疗	2022- 10-10	125,2 20.00	6,000.00	14	2.5 0	121.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3371	亿纬锂 能	2022- 10-10	443,3 40.00	5,400.00	14	2.5 0	431.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3387	中控技 术	2022- 10-10	961,7 40.00	13,000.00	14	3.2 0	1,196 .83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 3399	中芯国 际	2022- 10-10	347,0 24.00	9,200.00	14	2.5 0	337.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 4243	锦浪科 技	2022- 10-10	215,1 00.00	1,000.00	14	2.5 0	209.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 4681	沃森生 物	2022- 10-10	283,3 28.00	7,600.00	14	2.5 0	275.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 5467	天能股 份	2022- 10-10	32,09 0.00	1,000.00	14	2.5 0	31.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 5499	大全能 源	2022- 10-10	47,37 0.00	1,000.00	14	2.5 0	46.05	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010 6385	中科创 达	2022- 10-10	102,5 50.00	1,000.00	14	3.2 0	127.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1010 0010	九号公 司	2022- 10-10	213,7 50.00	5,700.00	14	3.2 0	266.0 0	0.00	0.00

	6511									
广发证 券	2022 1010 0010 7221	中微公 司	2022- 10-10	5,390 ,280. 00	62,000.00	14	3.0 0	6,288 .66	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 3661	中芯国 际	2022- 10-11	44,19 6.00	1,200.00	14	3.2 0	55.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 3813	卓胜微	2022- 10-11	230,2 60.00	2,900.00	14	4.4 0	394.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 3819	卓胜微	2022- 10-11	4,144 ,680. 00	52,200.00	14	4.4 0	7,092 .01	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 3941	澜起科 技	2022- 10-11	51,55 2.00	1,200.00	14	3.2 0	64.15	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 6149	乐普医 疗	2022- 10-11	833,4 90.00	40,500.00	14	4.4 1	1,429 .44	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 6163	阳光电 源	2022- 10-11	116,6 00.00	1,000.00	14	3.2 0	145.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0002 6227	康泰生 物	2022- 10-11	691,2 24.00	24,900.00	14	6.4 1	1,723 .07	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0003 0019	传音控 股	2022- 10-11	54,89 0.00	1,000.00	14	3.2 0	68.31	0.00	0.00
广发证 券	2022 1011 0003 0405	金山办 公	2022- 10-11	198,5 50.00	1,000.00	14	3.2 0	247.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1012 0000 1409	时代电 气	2022- 10-12	1,069 ,600. 00	19,100.00	14	3.2 0	1,331 .06	0.00	0.00

广发证 券	2022 1012 0001 8560	天合光 能	2022- 10-12	6,786 ,880. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,264 .09	0.00	0.00
广发证 券	2022 1012 0001 9868	石头科 技	2022- 10-12	424,1 67.00	1,700.00	14	3.2 0	527.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1012 0001 9964	三环集 团	2022- 10-12	446,9 00.00	16,400.00	14	3.2 0	556.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1013 0000 0827	晶科能 源	2022- 10-13	1,226 ,001. 00	73,900.00	14	3.2 0	1,525 .69	0.00	0.00
广发证 券	2022 1013 0001 5282	金山办 公	2022- 10-13	492,6 81.00	2,100.00	14	3.2 0	613.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1013 0001 5286	卓胜微	2022- 10-13	1,412 ,120. 00	17,200.00	14	3.2 1	1,762 .80	0.00	0.00
广发证 券	2022 1019 0000 0745	奇安信	2022- 10-19	989,8 74.00	20,700.00	14	3.2 0	1,231 .84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1020 0000 0743	格科微	2022- 10-20	121,1 80.00	7,300.00	14	3.2 0	150.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1021 0000 0790	三环集 团	2022- 10-21	484,4 00.00	17,500.00	14	3.2 0	602.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0000 0805	格科微	2022- 10-24	65,20 0.00	4,000.00	14	2.5 0	63.39	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 6103	阳光电 源	2022- 10-24	10,08 0,000 .00	80,000.00	14	0.8 0	3,136 .00	0.00	0.00
广发证	2022	晶盛机	2022-	206,1	3,000.00	14	2.5	200.4	0.00	0.00

券	1024 0007 6123	电	10-24	90.00			0	6		
广发证 券	2022 1024 0007 6147	欣旺达	2022- 10-24	136,0 80.00	5,600.00	14	2.5 0	132.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 6177	中微公 司	2022- 10-24	6,016 ,480. 00	62,000.00	14	3.0 0	7,019 .23	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 6199	中科创 达	2022- 10-24	372,4 00.00	3,500.00	14	3.5 1	508.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 7771	亿纬锂 能	2022- 10-24	482,4 90.00	5,400.00	14	2.5 0	469.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 7885	智飞生 物	2022- 10-24	347,2 06.00	3,800.00	14	2.5 0	337.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 7891	九号公 司	2022- 10-24	211,0 56.00	4,800.00	14	3.2 0	262.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 9583	阳光电 源	2022- 10-24	604,8 00.00	4,800.00	14	2.5 0	588.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 9587	康泰生 物	2022- 10-24	98,91 2.00	3,200.00	14	2.5 0	96.16	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0007 9603	大全能 源	2022- 10-24	171,3 25.00	3,500.00	14	3.5 1	233.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0008 6011	中芯国 际	2022- 10-24	344,9 08.00	9,200.00	14	2.5 0	335.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024	中控技 术	2022- 10-24	1,183 ,260.	13,000.00	14	3.2 0	1,472 .50	0.00	0.00

	0008 6073			00						
广发证 券	2022 1024 0008 7361	中国通 号	2022- 10-24	53,31 4.00	12,200.00	14	2.5 0	51.83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0008 7407	汇川技 术	2022- 10-24	553,9 26.00	8,600.00	14	2.5 0	538.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0008 8703	和辉光 电	2022- 10-24	33,93 0.00	13,000.00	14	2.5 0	32.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0008 9345	乐普医 疗	2022- 10-24	1,017 ,480. 00	41,700.00	14	2.5 0	989.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 0409	大全能 源	2022- 10-24	489,5 00.00	10,000.00	14	2.0 0	380.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 0431	蓝思科 技	2022- 10-24	88,17 2.00	9,400.00	14	2.5 0	85.72	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 0475	大全能 源	2022- 10-24	802,7 80.00	16,400.00	14	3.2 0	999.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 1001	沃森生 物	2022- 10-24	293,7 40.00	7,600.00	14	2.5 0	285.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3323	锦浪科 技	2022- 10-24	195,5 00.00	1,000.00	14	2.5 0	190.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3327	迈瑞医 疗	2022- 10-24	714,3 40.00	2,200.00	14	2.5 0	694.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009	天能股 份	2022- 10-24	39,65 0.00	1,000.00	14	2.5 0	38.55	0.00	0.00

	3341									
广发证 券	2022 1024 0009 3345	中科创 达	2022- 10-24	106,4 00.00	1,000.00	14	3.2 0	132.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3347	凯赛生 物	2022- 10-24	64,57 0.00	1,000.00	14	2.5 0	62.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3363	容百科 技	2022- 10-24	78,94 0.00	1,000.00	14	3.2 0	98.24	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3369	深信服	2022- 10-24	134,1 48.00	1,200.00	14	2.5 0	130.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3419	卓胜微	2022- 10-24	135,7 60.00	1,600.00	14	2.5 0	131.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 3425	格科微	2022- 10-24	16,30 0.00	1,000.00	14	2.5 0	15.85	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4337	中控技 术	2022- 10-24	127,4 28.00	1,400.00	14	2.5 0	123.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4459	奇安信	2022- 10-24	62,02 8.00	1,200.00	14	2.5 0	60.31	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4463	北京君 正	2022- 10-24	69,97 0.00	1,000.00	14	2.5 0	68.03	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4531	华润微	2022- 10-24	117,1 20.00	2,400.00	14	2.5 0	113.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4831	时代电 气	2022- 10-24	60,49 0.00	1,000.00	14	2.5 0	58.81	0.00	0.00

广发证 券	2022 1024 0009 4843	金山办 公	2022- 10-24	286,0 10.00	1,000.00	14	2.5 0	278.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4857	君实生 物	2022- 10-24	86,08 0.00	1,600.00	14	2.5 0	83.69	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4867	大全能 源	2022- 10-24	48,95 0.00	1,000.00	14	2.5 0	47.59	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4889	中微公 司	2022- 10-24	174,6 72.00	1,800.00	14	2.5 0	169.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4891	容百科 技	2022- 10-24	94,72 8.00	1,200.00	14	2.5 0	92.10	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4893	澜起科 技	2022- 10-24	109,3 62.00	2,200.00	14	2.5 0	106.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4933	沪硅产 业	2022- 10-24	100,8 80.00	5,200.00	14	2.5 0	98.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4941	先导智 能	2022- 10-24	260,0 52.00	5,200.00	14	2.5 0	252.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 4997	深信服	2022- 10-24	111,7 90.00	1,000.00	14	3.2 0	139.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 5017	康龙化 成	2022- 10-24	116,6 64.00	2,400.00	14	2.5 0	113.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 5023	九号公 司	2022- 10-24	70,35 2.00	1,600.00	14	2.5 0	68.40	0.00	0.00
广发证	2022	中伟股	2022-	75,56	1,000.00	14	2.5	73.46	0.00	0.00

券	1024 0009 5047	份	10-24	0.00			0				
广发证 券	2022 1024 0009 5049	亿联网 络	2022- 10-24	104,1 60.00	1,600.00	14	2.5 0	101.2 7	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5051	圣邦股 份	2022- 10-24	184,6 80.00	1,200.00	14	2.5 0	179.5 5	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5055	乐普医 疗	2022- 10-24	175,6 80.00	7,200.00	14	3.2 1	219.3 1	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5057	乐普医 疗	2022- 10-24	146,4 00.00	6,000.00	14	2.5 0	142.3 3	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5099	中科创 达	2022- 10-24	170,2 40.00	1,600.00	14	2.5 0	165.5 1	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5119	传音控 股	2022- 10-24	72,74 4.00	1,200.00	14	2.5 0	70.72	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5155	晶科能 源	2022- 10-24	108,9 00.00	6,600.00	14	2.5 0	105.8 8	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5159	泰格医 药	2022- 10-24	194,8 08.00	2,400.00	14	2.5 0	189.4 0	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5161	宁德时代	2022- 10-24	808,0 40.00	2,000.00	14	2.5 0	785.5 9	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024 0009 5169	卓胜微	2022- 10-24	195,1 55.00	2,300.00	14	3.2 0	242.8 6	0.00	0.00	
广发证 券	2022 1024	天合光 能	2022- 10-24	313,0 00.00	5,000.00	14	2.5 0	304.3 1	0.00	0.00	

	0009 5477									
广发证 券	2022 1024 0009 5515	沪硅产 业	2022- 10-24	137,7 40.00	7,100.00	14	3.4 1	182.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 5527	三环集 团	2022- 10-24	149,4 18.00	5,400.00	14	2.5 0	145.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 5601	中控技 术	2022- 10-24	10,01 2,200 .00	110,000.0 0	14	3.2 0	12,45 9.63	0.00	0.00
广发证 券	2022 1024 0009 6197	九号公 司	2022- 10-24	250,6 29.00	5,700.00	14	3.2 0	311.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 2616	卓胜微	2022- 10-25	240,4 68.00	2,900.00	14	4.4 0	411.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 2684	卓胜微	2022- 10-25	4,328 ,424. 00	52,200.00	14	4.4 0	7,406 .41	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 2738	康泰生 物	2022- 10-25	722,1 00.00	24,900.00	14	6.4 1	1,800 .03	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 2754	中芯国 际	2022- 10-25	45,12 0.00	1,200.00	14	3.2 0	56.15	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 7888	阳光电 源	2022- 10-25	129,6 60.00	1,000.00	14	3.2 0	161.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 7916	传音控 股	2022- 10-25	59,41 0.00	1,000.00	14	3.2 0	73.93	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002	乐普医 疗	2022- 10-25	981,7 20.00	40,500.00	14	4.4 1	1,683 .65	0.00	0.00

	8726									
广发证 券	2022 1025 0002 8788	金山办 公	2022- 10-25	265,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	329.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1025 0002 8824	澜起科 技	2022- 10-25	59,46 0.00	1,200.00	14	3.2 0	73.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 1026 0000 1523	中国通 号	2022- 10-26	4,430 .00	1,000.00	14	3.2 0	5.51	0.00	0.00
广发证 券	2022 1026 0001 9952	天合光 能	2022- 10-26	6,834 ,632. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,329 .27	0.00	0.00
广发证 券	2022 1026 0002 3432	石头科 技	2022- 10-26	411,6 04.00	1,700.00	14	3.2 0	512.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1027 0001 5529	晶科能 源	2022- 10-27	1,121 ,250. 00	65,000.00	14	3.2 0	1,395 .33	0.00	0.00
广发证 券	2022 1027 0002 0113	卓胜微	2022- 10-27	1,488 ,660. 00	17,200.00	14	3.2 1	1,858 .34	0.00	0.00
广发证 券	2022 1028 0000 0875	亿联网 络	2022- 10-28	411,9 28.00	6,200.00	14	3.2 0	512.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1031 0000 1063	欣旺达	2022- 10-31	2,796 ,000. 00	120,000.0 0	14	4.4 1	4,795 .14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1101 0000 0630	阳光电 源	2022- 11-01	1,349 ,900. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,679 .88	0.00	0.00
广发证 券	2022 1102 0000 0793	欣旺达	2022- 11-02	4,012 ,800. 00	160,000.0 0	14	4.4 1	6,881 .95	0.00	0.00

广发证 券	2022 1102 0000 0797	泰格医 药	2022- 11-02	639,7 30.00	7,000.00	14	3.2 0	796.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1102 0000 0825	奇安信	2022- 11-02	972,2 85.00	15,900.00	14	3.2 0	1,209 .95	0.00	0.00
广发证 券	2022 1102 0000 9996	奇安信	2022- 11-02	1,265 ,805. 00	20,700.00	14	3.2 0	1,575 .22	0.00	0.00
广发证 券	2022 1103 0000 0702	深信服	2022- 11-03	976,7 94.00	7,800.00	14	3.2 0	1,215 .57	0.00	0.00
广发证 券	2022 1103 0000 0709	三环集 团	2022- 11-03	465,8 54.00	16,300.00	14	3.2 0	579.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1103 0000 0744	石头科 技	2022- 11-03	908,3 13.00	3,700.00	14	3.2 0	1,130 .35	0.00	0.00
广发证 券	2022 1103 0000 5823	格科微	2022- 11-03	125,6 33.00	7,300.00	14	3.2 0	156.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1104 0000 7041	三环集 团	2022- 11-04	503,8 25.00	17,500.00	14	3.2 0	626.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 5487	时代电 气	2022- 11-07	61,86 0.00	1,000.00	14	2.5 0	60.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 5653	和辉光 电	2022- 11-07	34,84 0.00	13,000.00	14	2.5 0	33.87	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 5789	中控技 术	2022- 11-07	125,1 60.00	1,400.00	14	2.5 0	121.6 8	0.00	0.00
广发证	2022	天合光	2022-	373,5	5,000.00	14	2.5	363.1	0.00	0.00

券	1107 0007 5869	能	11-07	00.00			0	3		
广发证 券	2022 1107 0007 5873	九号公 司	2022- 11-07	163,6 80.00	4,800.00	14	3.2 0	203.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7405	金山办 公	2022- 11-07	274,9 70.00	1,000.00	14	2.5 0	267.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7407	中科创 达	2022- 11-07	416,5 00.00	3,500.00	14	3.5 1	568.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7411	沃森生 物	2022- 11-07	323,9 12.00	7,600.00	14	2.5 0	314.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7473	中科创 达	2022- 11-07	119,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	148.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7521	深信服	2022- 11-07	151,9 68.00	1,200.00	14	2.5 0	147.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7741	阳光电 源	2022- 11-07	10,72 4,800 .00	80,000.00	14	0.8 0	3,336 .60	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7791	中微公 司	2022- 11-07	6,772 ,260. 00	62,000.00	14	3.0 0	7,900 .97	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 7837	乐普医 疗	2022- 11-07	1,044 ,585. 00	41,700.00	14	2.5 0	1,015 .57	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 8657	欣旺达	2022- 11-07	148,2 32.00	5,600.00	14	2.5 0	144.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107	中控技 术	2022- 11-07	9,834 ,000.	110,000.0 0	14	3.2 0	12,23 7.87	0.00	0.00

	0007 8877			00						
广发证 券	2022 1107 0007 9665	容百科 技	2022- 11-07	107,1 48.00	1,200.00	14	2.5 0	104.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9667	澜起科 技	2022- 11-07	142,7 36.00	2,200.00	14	2.5 0	138.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9713	凯赛生 物	2022- 11-07	67,14 0.00	1,000.00	14	2.5 0	65.28	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9787	中国通 号	2022- 11-07	55,14 4.00	12,200.00	14	2.5 0	53.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9793	容百科 技	2022- 11-07	89,29 0.00	1,000.00	14	3.2 0	111.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9807	康龙化 成	2022- 11-07	169,3 20.00	2,400.00	14	2.5 0	164.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9809	晶盛机 电	2022- 11-07	229,9 50.00	3,000.00	14	2.5 0	223.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9879	宁德时代	2022- 11-07	821,0 00.00	2,000.00	14	2.5 0	798.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9883	圣邦股 份	2022- 11-07	193,9 32.00	1,200.00	14	2.5 0	188.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9887	迈瑞医 疗	2022- 11-07	697,3 78.00	2,200.00	14	2.5 0	678.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007	锦浪科 技	2022- 11-07	222,4 40.00	1,000.00	14	2.5 0	216.2 6	0.00	0.00

	9889									
广发证 券	2022 1107 0007 9899	卓胜微	2022- 11-07	166,0 16.00	1,600.00	14	2.5 0	161.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9939	智飞生 物	2022- 11-07	369,7 40.00	3,800.00	14	2.5 0	359.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9981	深信服	2022- 11-07	126,6 40.00	1,000.00	14	3.2 0	157.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9991	先导智 能	2022- 11-07	276,6 40.00	5,200.00	14	2.5 0	268.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0007 9997	汇川技 术	2022- 11-07	594,4 32.00	8,600.00	14	2.5 0	577.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1045	阳光电 源	2022- 11-07	643,4 88.00	4,800.00	14	2.5 0	625.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1133	亿纬锂 能	2022- 11-07	525,7 44.00	5,400.00	14	2.5 0	511.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1211	蓝思科 技	2022- 11-07	96,82 0.00	9,400.00	14	2.5 0	94.13	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1253	传音控 股	2022- 11-07	82,56 0.00	1,200.00	14	2.5 0	80.27	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1281	泰格医 药	2022- 11-07	231,1 68.00	2,400.00	14	2.5 0	224.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1297	北京君 正	2022- 11-07	72,45 0.00	1,000.00	14	2.5 0	70.44	0.00	0.00

广发证 券	2022 1107 0008 1299	亿联网 络	2022- 11-07	109,9 68.00	1,600.00	14	2.5 0	106.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1301	乐普医 疗	2022- 11-07	180,3 60.00	7,200.00	14	3.2 1	225.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1915	乐普医 疗	2022- 11-07	150,3 00.00	6,000.00	14	2.5 0	146.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1923	沪硅产 业	2022- 11-07	106,3 40.00	5,200.00	14	2.5 0	103.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 1997	大全能 源	2022- 11-07	54,69 0.00	1,000.00	14	2.5 0	53.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 2203	康泰生 物	2022- 11-07	114,0 48.00	3,200.00	14	2.5 0	110.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 2205	中科创 达	2022- 11-07	190,4 00.00	1,600.00	14	2.5 0	185.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 2219	卓胜微	2022- 11-07	238,6 48.00	2,300.00	14	3.2 0	296.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 4129	中微公 司	2022- 11-07	196,6 14.00	1,800.00	14	2.5 0	191.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 5227	天能股 份	2022- 11-07	42,87 0.00	1,000.00	14	2.5 0	41.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 7153	九号公 司	2022- 11-07	54,56 0.00	1,600.00	14	2.5 0	53.04	0.00	0.00
广发证	2022	中控技	2022-	1,162	13,000.00	14	3.2	1,446	0.00	0.00

券	1107 0008 7185	术	11-07	,200. 00			0	.29		
广发证 券	2022 1107 0008 7247	晶科能 源	2022- 11-07	123,6 84.00	6,600.00	14	2.5 0	120.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 7251	奇安信	2022- 11-07	77,46 0.00	1,200.00	14	2.5 0	75.31	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 7259	格科微	2022- 11-07	17,31 0.00	1,000.00	14	2.5 0	16.83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 7261	三环集 团	2022- 11-07	157,0 86.00	5,400.00	14	2.5 0	152.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 7279	大全能 源	2022- 11-07	191,4 15.00	3,500.00	14	3.5 1	261.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 9617	大全能 源	2022- 11-07	546,9 00.00	10,000.00	14	2.0 0	425.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 9655	君实生 物	2022- 11-07	112,2 56.00	1,600.00	14	2.5 0	109.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0008 9813	沪硅产 业	2022- 11-07	145,1 95.00	7,100.00	14	3.4 1	192.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0009 2337	中伟股 份	2022- 11-07	89,03 0.00	1,000.00	14	2.5 0	86.56	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0009 2365	中芯国 际	2022- 11-07	385,2 96.00	9,200.00	14	2.5 0	374.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107	九号公 司	2022- 11-07	194,3 70.00	5,700.00	14	3.2 0	241.8 8	0.00	0.00

	0009 8051									
广发证 券	2022 1107 0009 8061	大全能 源	2022- 11-07	896,9 16.00	16,400.00	14	3.2 0	1,116 .16	0.00	0.00
广发证 券	2022 1107 0009 9931	华润微	2022- 11-07	126,0 24.00	2,400.00	14	2.5 0	122.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 4619	卓胜微	2022- 11-08	296,6 70.00	2,900.00	14	4.4 0	507.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7201	中芯国 际	2022- 11-08	49,63 2.00	1,200.00	14	3.2 0	61.76	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7233	金山办 公	2022- 11-08	281,3 00.00	1,000.00	14	3.2 0	350.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7407	卓胜微	2022- 11-08	5,340 ,060. 00	52,200.00	14	4.4 0	9,137 .44	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7413	乐普医 疗	2022- 11-08	972,8 10.00	40,500.00	14	4.4 1	1,668 .37	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7895	澜起科 技	2022- 11-08	75,84 0.00	1,200.00	14	3.2 0	94.38	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7899	传音控 股	2022- 11-08	69,26 0.00	1,000.00	14	3.2 0	86.19	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002 7977	阳光电 源	2022- 11-08	128,9 00.00	1,000.00	14	3.2 0	160.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1108 0002	康泰生 物	2022- 11-08	872,7 45.00	24,900.00	14	6.4 1	2,175 .56	0.00	0.00

	8257									
广发证 券	2022 1109 0001 8435	天合光 能	2022- 11-09	7,234 ,936. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	9,875 .69	0.00	0.00
广发证 券	2022 1109 0001 8587	石头科 技	2022- 11-09	423,5 55.00	1,700.00	14	3.2 0	527.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1109 0002 1801	中国通 号	2022- 11-09	4,510 .00	1,000.00	14	3.2 0	5.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 1110 0000 1700	阳光电 源	2022- 11-10	4,884 ,000. 00	40,000.00	14	0.8 0	1,519 .47	0.00	0.00
广发证 券	2022 1110 0000 1705	亿联网 络	2022- 11-10	67,29 0.00	1,000.00	14	3.2 0	83.74	0.00	0.00
广发证 券	2022 1110 0000 1730	奇安信	2022- 11-10	67,50 0.00	1,000.00	14	3.2 0	84.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 1110 0001 4698	晶科能 源	2022- 11-10	1,150 ,500. 00	65,000.00	14	3.2 0	1,431 .73	0.00	0.00
广发证 券	2022 1110 0001 7924	卓胜微	2022- 11-10	1,716 ,216. 00	17,200.00	14	3.2 1	2,142 .41	0.00	0.00
广发证 券	2022 1111 0001 5417	亿联网 络	2022- 11-11	418,9 96.00	6,200.00	7	3.2 0	260.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1114 0000 8931	欣旺达	2022- 11-14	3,027 ,600. 00	120,000.0 0	7	4.4 1	2,596 .17	0.00	0.00
广发证 券	2022 1115 0000 8282	阳光电 源	2022- 11-15	1,189 ,900. 00	10,000.00	7	3.2 0	740.3 8	0.00	0.00

广发证 券	2022 1116 0000 1358	亿联网 络	2022- 11-16	2,972 ,790. 00	43,500.00	14	3.2 0	3,699 .47	0.00	0.00
广发证 券	2022 1116 0000 6895	欣旺达	2022- 11-16	4,000 ,000. 00	160,000.0 0	7	4.4 1	3,430 .00	0.00	0.00
广发证 券	2022 1117 0000 0913	思瑞浦	2022- 11-17	1,088 ,000. 00	3,400.00	14	3.2 0	1,353 .96	0.00	0.00
广发证 券	2022 1117 0000 6964	格科微	2022- 11-17	130,9 62.00	7,300.00	7	3.2 0	81.49	0.00	0.00
广发证 券	2022 1117 0000 7782	石头科 技	2022- 11-17	995,4 48.00	3,700.00	7	3.2 0	619.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1118 0000 8850	亿联网 络	2022- 11-18	429,0 40.00	6,200.00	7	3.2 0	266.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1118 0000 9300	三环集 团	2022- 11-18	536,2 00.00	17,500.00	7	3.2 0	333.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0000 0706	亿联网 络	2022- 11-21	74,25 0.00	1,100.00	14	3.2 0	92.40	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0000 0747	九号公 司	2022- 11-21	705,7 95.00	21,100.00	14	3.2 0	878.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 2724	中芯国 际	2022- 11-21	382,5 36.00	9,200.00	7	2.5 0	185.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 4996	中科创 达	2022- 11-21	121,9 90.00	1,000.00	7	3.2 0	75.90	0.00	0.00
广发证	2022	和辉光	2022-	34,45	13,000.00	7	2.5	16.75	0.00	0.00

券	1121 0006 5010	电	11-21	0.00			0			
广发证 券	2022 1121 0006 5126	中控技 术	2022- 11-21	137,8 30.00	1,400.00	7	2.5 0	67.00	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 5132	大全能 源	2022- 11-21	560,8 00.00	10,000.00	7	2.0 0	218.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 5150	北京君 正	2022- 11-21	77,35 0.00	1,000.00	7	2.5 0	37.60	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 5782	奇安信	2022- 11-21	83,19 6.00	1,200.00	7	2.5 0	40.44	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6168	中控技 术	2022- 11-21	1,279 ,850. 00	13,000.00	7	3.2 0	796.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6424	中科创 达	2022- 11-21	195,1 84.00	1,600.00	7	2.5 0	94.88	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6430	先导智 能	2022- 11-21	241,9 04.00	5,200.00	7	2.5 0	117.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6470	君实生 物	2022- 11-21	113,7 60.00	1,600.00	7	2.5 0	55.30	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6518	锦浪科 技	2022- 11-21	195,8 20.00	1,000.00	7	2.5 0	95.19	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 6522	沪硅产 业	2022- 11-21	106,3 40.00	5,200.00	7	2.5 0	51.69	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121	澜起科 技	2022- 11-21	149,2 04.00	2,200.00	7	2.5 0	72.53	0.00	0.00

	0006 6538									
广发证 券	2022 1121 0006 6614	宁德时 代	2022- 11-21	764,8 00.00	2,000.00	7	2.5 0	371.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7268	大全能 源	2022- 11-21	196,2 80.00	3,500.00	7	3.5 1	133.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7372	中国通 号	2022- 11-21	55,14 4.00	12,200.00	7	2.5 0	26.81	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7382	圣邦股 份	2022- 11-21	220,0 32.00	1,200.00	7	2.5 0	106.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7720	汇川技 术	2022- 11-21	621,5 22.00	8,600.00	7	2.5 0	302.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7766	中微公 司	2022- 11-21	6,376 ,080. 00	62,000.00	7	3.0 0	3,719 .38	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7768	华润微	2022- 11-21	128,7 84.00	2,400.00	7	2.5 0	62.60	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 7790	大全能 源	2022- 11-21	56,08 0.00	1,000.00	7	2.5 0	27.26	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 8758	卓胜微	2022- 11-21	189,9 20.00	1,600.00	7	2.5 0	92.32	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 8772	中科创 达	2022- 11-21	426,9 65.00	3,500.00	7	3.5 1	291.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006	金山办 公	2022- 11-21	268,6 20.00	1,000.00	7	2.5 0	130.5 8	0.00	0.00

	8776									
广发证 券	2022 1121 0006 8902	晶科能 源	2022- 11-21	112,1 34.00	6,600.00	7	2.5 0	54.51	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0006 9972	沪硅产 业	2022- 11-21	145,1 95.00	7,100.00	7	3.4 1	96.27	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 0062	卓胜微	2022- 11-21	273,0 10.00	2,300.00	7	3.2 0	169.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 0078	中控技 术	2022- 11-21	10,82 9,500 .00	110,000.0 0	7	3.2 0	6,738 .36	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 2084	康龙化 成	2022- 11-21	165,6 00.00	2,400.00	7	2.5 0	80.50	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 2626	中微公 司	2022- 11-21	185,1 12.00	1,800.00	7	2.5 0	89.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 2664	天合光 能	2022- 11-21	327,0 50.00	5,000.00	7	2.5 0	158.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 4498	迈瑞医 疗	2022- 11-21	715,0 00.00	2,200.00	7	2.5 0	347.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 4750	三环集 团	2022- 11-21	162,5 40.00	5,400.00	7	2.5 0	79.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 5812	九号公 司	2022- 11-21	53,52 0.00	1,600.00	7	2.5 0	26.02	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 5882	欣旺达	2022- 11-21	2,962 ,800. 00	120,000.0 0	7	4.4 1	2,540 .60	0.00	0.00

广发证 券	2022 1121 0007 6610	天能股 份	2022- 11-21	38,76 0.00	1,000.00	7	2.5 0	18.84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7100	阳光电 源	2022- 11-21	9,184 ,000. 00	80,000.00	7	0.8 0	1,428 .62	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7102	格科微	2022- 11-21	17,71 0.00	1,000.00	7	2.5 0	8.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7122	乐普医 疗	2022- 11-21	171,3 60.00	7,200.00	7	3.2 1	106.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7124	乐普医 疗	2022- 11-21	142,8 00.00	6,000.00	7	2.5 0	69.42	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7154	欣旺达	2022- 11-21	138,2 64.00	5,600.00	7	2.5 0	67.21	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7200	时代电 气	2022- 11-21	56,40 0.00	1,000.00	7	2.5 0	27.42	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7218	九号公 司	2022- 11-21	160,5 60.00	4,800.00	7	3.2 0	99.90	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7290	泰格医 药	2022- 11-21	232,2 72.00	2,400.00	7	2.5 0	112.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 7304	智飞生 物	2022- 11-21	373,4 26.00	3,800.00	7	2.5 0	181.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 8116	晶盛机 电	2022- 11-21	205,0 80.00	3,000.00	7	2.5 0	99.69	0.00	0.00
广发证	2022	蓝思科	2022-	99,54	9,400.00	7	2.5	48.39	0.00	0.00

券	1121 0007 8236	技	11-21	6.00			0			
广发证 券	2022 1121 0007 8472	阳光电 源	2022- 11-21	551,0 40.00	4,800.00	7	2.5 0	267.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9016	亿联网 络	2022- 11-21	108,0 00.00	1,600.00	7	2.5 0	52.50	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9076	康泰生 物	2022- 11-21	117,6 96.00	3,200.00	7	2.5 0	57.21	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9090	沃森生 物	2022- 11-21	348,7 64.00	7,600.00	7	2.5 0	169.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9352	容百科 技	2022- 11-21	94,17 6.00	1,200.00	7	2.5 0	45.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9554	凯赛生 物	2022- 11-21	66,46 0.00	1,000.00	7	2.5 0	32.31	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9576	九号公 司	2022- 11-21	190,6 65.00	5,700.00	7	3.2 0	118.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9834	亿纬锂 能	2022- 11-21	459,3 24.00	5,400.00	7	2.5 0	223.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0007 9836	容百科 技	2022- 11-21	78,48 0.00	1,000.00	7	3.2 0	48.83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0008 0152	乐普医 疗	2022- 11-21	992,4 60.00	41,700.00	7	2.5 0	482.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121	深信服	2022- 11-21	141,9 24.00	1,200.00	7	2.5 0	68.99	0.00	0.00

	0008 3758									
广发证 券	2022 1121 0008 4450	深信服	2022- 11-21	118,2 70.00	1,000.00	7	3.2 0	73.59	0.00	0.00
广发证 券	2022 1121 0008 4788	传音控 股	2022- 11-21	90,06 0.00	1,200.00	7	2.5 0	43.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 1122 0000 1267	思瑞浦	2022- 11-22	313,6 20.00	1,000.00	14	3.2 0	390.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1122 0001 8011	阳光电 源	2022- 11-22	1,108 ,800. 00	10,000.00	7	3.2 0	689.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1122 0001 8049	卓胜微	2022- 11-22	340,3 15.00	2,900.00	7	4.4 0	291.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1122 0001 8051	卓胜微	2022- 11-22	6,125 ,670. 00	52,200.00	7	4.4 0	5,240 .85	0.00	0.00
广发证 券	2022 1122 0002 2049	乐普医 疗	2022- 11-22	926,6 40.00	40,500.00	7	4.4 1	794.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1123 0000 1058	传音控 股	2022- 11-23	72,85 0.00	1,000.00	14	3.2 0	90.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 1123 0001 9906	天合光 能	2022- 11-23	6,733 ,032. 00	101,600.0 0	7	3.5 1	4,595 .29	0.00	0.00
广发证 券	2022 1123 0001 9948	欣旺达	2022- 11-23	3,883 ,200. 00	160,000.0 0	7	4.4 1	3,329 .84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1123 0002	石头科 技	2022- 11-23	429,8 45.00	1,700.00	7	3.2 0	267.4 6	0.00	0.00

	0000									
广发证 券	2022 1124 0000 1210	深信服	2022- 11-24	112,7 50.00	1,000.00	14	3.4 0	149.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0000 1216	德方纳 米	2022- 11-24	1,036 ,266. 00	4,200.00	14	3.2 0	1,289 .58	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0000 1217	亿联网 络	2022- 11-24	7,858 ,179. 00	121,100.0 0	14	3.2 0	9,779 .07	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0001 3818	阳光电 源	2022- 11-24	4,761 ,200. 00	40,000.00	7	0.8 0	740.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0001 4040	石头科 技	2022- 11-24	924,2 60.00	3,700.00	7	3.2 0	575.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0001 4726	格科微	2022- 11-24	128,4 07.00	7,300.00	7	3.2 0	79.90	0.00	0.00
广发证 券	2022 1124 0001 8398	卓胜微	2022- 11-24	1,928 ,808. 00	17,200.00	7	3.2 1	1,203 .90	0.00	0.00
广发证 券	2022 1125 0000 0805	宁德时代	2022- 11-25	1,191 ,040. 00	3,200.00	14	2.0 0	926.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1125 0000 7446	三环集 团	2022- 11-25	509,9 50.00	17,500.00	7	3.2 0	317.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1125 0000 7828	亿联网 络	2022- 11-25	403,4 96.00	6,200.00	7	3.2 0	251.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8373	智飞生 物	2022- 11-28	339,5 30.00	3,800.00	7	2.5 0	165.0 5	0.00	0.00

广发证 券	2022 1128 0000 8387	三环集 团	2022- 11-28	158,2 20.00	5,400.00	7	2.5 0	76.91	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8437	乐普医 疗	2022- 11-28	134,4 00.00	6,000.00	7	2.5 0	65.33	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8443	大全能 源	2022- 11-28	186,0 25.00	3,500.00	7	3.5 1	126.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8469	康泰生 物	2022- 11-28	108,8 00.00	3,200.00	7	2.5 0	52.89	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8803	大全能 源	2022- 11-28	531,5 00.00	10,000.00	7	2.0 0	206.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8841	凯赛生 物	2022- 11-28	61,27 0.00	1,000.00	7	2.5 0	29.78	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8853	传音控 股	2022- 11-28	88,75 2.00	1,200.00	7	2.5 0	43.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8859	大全能 源	2022- 11-28	53,15 0.00	1,000.00	7	2.5 0	25.84	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8883	泰格医 药	2022- 11-28	213,2 88.00	2,400.00	7	2.5 0	103.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8947	乐普医 疗	2022- 11-28	161,2 80.00	7,200.00	7	3.2 1	100.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8949	迈瑞医 疗	2022- 11-28	717,2 00.00	2,200.00	7	2.5 0	348.6 4	0.00	0.00
广发证	2022	欣旺达	2022-	132,6	5,600.00	7	2.5	64.49	0.00	0.00

券	1128 0000 8951		11-28	64.00			0			
广发证 券	2022 1128 0000 8967	九号公 司	2022- 11-28	158,4 00.00	4,800.00	7	3.2 0	98.56	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8987	奇安信	2022- 11-28	74,53 2.00	1,200.00	7	2.5 0	36.23	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8989	汇川技 术	2022- 11-28	588,4 98.00	8,600.00	7	2.5 0	286.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8991	金山办 公	2022- 11-28	253,7 00.00	1,000.00	7	2.5 0	123.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8995	乐普医 疗	2022- 11-28	934,0 80.00	41,700.00	7	2.5 0	454.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 8997	君实生 物	2022- 11-28	101,5 20.00	1,600.00	7	2.5 0	49.35	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9013	华润微	2022- 11-28	123,3 36.00	2,400.00	7	2.5 0	59.96	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9025	中科创 达	2022- 11-28	111,1 10.00	1,000.00	7	3.2 0	69.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9031	和辉光 电	2022- 11-28	34,32 0.00	13,000.00	7	2.5 0	16.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9043	卓胜微	2022- 11-28	262,6 14.00	2,300.00	7	3.2 0	163.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128	九号公 司	2022- 11-28	188,1 00.00	5,700.00	7	3.2 0	117.0 4	0.00	0.00

	0000 9051									
广发证 券	2022 1128 0000 9069	澜起科 技	2022- 11-28	153,0 76.00	2,200.00	7	2.5 0	74.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9807	先导智 能	2022- 11-28	226,1 48.00	5,200.00	7	2.5 0	109.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9841	蓝思科 技	2022- 11-28	95,50 4.00	9,400.00	7	2.5 0	46.43	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9853	沃森生 物	2022- 11-28	329,9 16.00	7,600.00	7	2.5 0	160.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0000 9859	亿联网 络	2022- 11-28	102,6 72.00	1,600.00	7	2.5 0	49.91	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0095	深信服	2022- 11-28	110,5 00.00	1,000.00	7	3.2 0	68.76	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0213	欣旺达	2022- 11-28	2,842 ,800. 00	120,000.0 0	7	4.4 1	2,437 .70	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0221	康龙化 成	2022- 11-28	155,4 24.00	2,400.00	7	2.5 0	75.55	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0301	阳光电 源	2022- 11-28	9,352 ,800. 00	80,000.00	7	0.8 0	1,454 .88	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0303	格科微	2022- 11-28	18,00 0.00	1,000.00	7	2.5 0	8.75	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001	时代电 气	2022- 11-28	55,28 0.00	1,000.00	7	2.5 0	26.87	0.00	0.00

	0331									
广发证 券	2022 1128 0001 0353	中微公 司	2022- 11-28	176,1 48.00	1,800.00	7	2.5 0	85.63	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0355	中科创 达	2022- 11-28	177,7 76.00	1,600.00	7	2.5 0	86.42	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0517	深信服	2022- 11-28	132,6 00.00	1,200.00	7	2.5 0	64.46	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0549	卓胜微	2022- 11-28	182,6 88.00	1,600.00	7	2.5 0	88.81	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0601	中科创 达	2022- 11-28	388,8 85.00	3,500.00	7	3.5 1	265.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0607	中芯国 际	2022- 11-28	368,7 36.00	9,200.00	7	2.5 0	179.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0609	中国通 号	2022- 11-28	56,73 0.00	12,200.00	7	2.5 0	27.58	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0617	天合光 能	2022- 11-28	324,5 00.00	5,000.00	7	2.5 0	157.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0625	锦浪科 技	2022- 11-28	198,5 80.00	1,000.00	7	2.5 0	96.53	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0627	沪硅产 业	2022- 11-28	99,58 0.00	5,200.00	7	2.5 0	48.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0631	沪硅产 业	2022- 11-28	135,9 65.00	7,100.00	7	3.4 1	90.15	0.00	0.00

广发证 券	2022 1128 0001 0637	圣邦股 份	2022- 11-28	205,9 20.00	1,200.00	7	2.5 0	100.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0661	中微公 司	2022- 11-28	6,067 ,320. 00	62,000.00	7	3.0 0	3,539 .27	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0685	天能股 份	2022- 11-28	38,10 0.00	1,000.00	7	2.5 0	18.52	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0731	晶盛机 电	2022- 11-28	195,8 10.00	3,000.00	7	2.5 0	95.19	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0735	阳光电 源	2022- 11-28	561,1 68.00	4,800.00	7	2.5 0	272.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0755	容百科 技	2022- 11-28	73,94 0.00	1,000.00	7	3.2 0	46.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0761	容百科 技	2022- 11-28	88,72 8.00	1,200.00	7	2.5 0	43.13	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0789	九号公 司	2022- 11-28	52,80 0.00	1,600.00	7	2.5 0	25.67	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0819	宁德时代	2022- 11-28	740,6 20.00	2,000.00	7	2.5 0	360.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0831	中控技 术	2022- 11-28	129,5 00.00	1,400.00	7	2.5 0	62.95	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 0851	北京君 正	2022- 11-28	77,06 0.00	1,000.00	7	2.5 0	37.46	0.00	0.00
广发证	2022	中控技	2022-	10,17	110,000.0	7	3.2	6,331	0.00	0.00

券	1128 0001 0971	术	11-28	5,000 .00	0		0	.11		
广发证 券	2022 1128 0001 0977	中控技 术	2022- 11-28	1,202 ,500. 00	13,000.00	7	3.2 0	748.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 1003	亿纬锂 能	2022- 11-28	440,9 64.00	5,400.00	7	2.5 0	214.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1128 0001 1113	晶科能 源	2022- 11-28	104,9 40.00	6,600.00	7	2.5 0	51.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 1129 0001 6786	卓胜微	2022- 11-29	6,143 ,418. 00	52,200.00	7	4.4 0	5,256 .04	0.00	0.00
广发证 券	2022 1129 0001 7900	卓胜微	2022- 11-29	341,3 01.00	2,900.00	7	4.4 0	292.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1130 0000 8495	亿联网 络	2022- 11-30	2,768 ,340. 00	43,500.00	7	3.2 0	1,722 .52	0.00	0.00
广发证 券	2022 1130 0000 8519	欣旺达	2022- 11-30	3,872 ,000. 00	160,000.0 0	7	4.4 1	3,320 .24	0.00	0.00
广发证 券	2022 1130 0000 8737	石头科 技	2022- 11-30	440,1 30.00	1,700.00	7	3.2 0	273.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1130 0000 8759	天合光 能	2022- 11-30	6,553 ,200. 00	101,600.0 0	7	3.5 1	4,472 .56	0.00	0.00
广发证 券	2022 1201 0000 0899	传音控 股	2022- 12-01	210,7 89.00	2,700.00	14	3.2 0	262.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1201	卓胜微	2022- 12-01	2,046 ,800.	17,200.00	7	3.2 1	1,277 .54	0.00	0.00

	0000 7866			00						
广发证 券	2022 1201 0000 8208	阳光电 源	2022- 12-01	4,636 ,400. 00	40,000.00	7	0.8 0	721.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1201 0000 8402	思瑞浦	2022- 12-01	1,096 ,092. 00	3,400.00	7	3.2 0	682.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1201 0000 8876	格科微	2022- 12-01	131,4 73.00	7,300.00	7	3.2 0	81.81	0.00	0.00
广发证 券	2022 1202 0000 1200	思瑞浦	2022- 12-02	322,5 10.00	1,000.00	14	3.2 0	401.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1202 0000 1202	石头科 技	2022- 12-02	989,9 72.00	3,700.00	14	3.4 0	1,308 .96	0.00	0.00
广发证 券	2022 1202 0000 7022	三环集 团	2022- 12-02	529,3 75.00	17,500.00	7	3.2 0	329.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1202 0000 7798	亿联网 络	2022- 12-02	398,0 40.00	6,200.00	7	3.2 0	247.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0001 8270	智飞生 物	2022- 12-05	326,3 44.00	3,800.00	7	2.5 0	158.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0001 8304	阳光电 源	2022- 12-05	521,1 84.00	4,800.00	7	2.5 0	253.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0001 8322	晶盛机 电	2022- 12-05	196,1 70.00	3,000.00	7	2.5 0	95.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002	传音控 股	2022- 12-05	98,32 8.00	1,200.00	7	2.5 0	47.80	0.00	0.00

	0456									
广发证 券	2022 1205 0002 0484	金山办 公	2022- 12-05	256,4 60.00	1,000.00	7	2.5 0	124.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0492	沪硅产 业	2022- 12-05	103,2 20.00	5,200.00	7	2.5 0	50.18	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0494	沪硅产 业	2022- 12-05	140,9 35.00	7,100.00	7	3.4 1	93.45	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0540	大全能 源	2022- 12-05	542,8 00.00	10,000.00	7	2.0 0	211.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0556	天合光 能	2022- 12-05	323,3 50.00	5,000.00	7	2.5 0	157.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0558	奇安信	2022- 12-05	77,28 0.00	1,200.00	7	2.5 0	37.57	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0570	格科微	2022- 12-05	18,03 0.00	1,000.00	7	2.5 0	8.76	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0576	中控技 术	2022- 12-05	128,9 12.00	1,400.00	7	2.5 0	62.67	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0578	中控技 术	2022- 12-05	1,197 ,040. 00	13,000.00	7	3.2 0	744.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0594	中芯国 际	2022- 12-05	380,5 12.00	9,200.00	7	2.5 0	184.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 0656	凯赛生 物	2022- 12-05	66,01 0.00	1,000.00	7	2.5 0	32.09	0.00	0.00

广发证 券	2022 1205 0002 0716	华润微	2022- 12-05	130,4 64.00	2,400.00	7	2.5 0	63.42	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1242	澜起科 技	2022- 12-05	147,0 26.00	2,200.00	7	2.5 0	71.47	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1270	君实生 物	2022- 12-05	95,36 0.00	1,600.00	7	2.5 0	46.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1288	时代电 气	2022- 12-05	57,02 0.00	1,000.00	7	2.5 0	27.72	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1294	大全能 源	2022- 12-05	54,28 0.00	1,000.00	7	2.5 0	26.39	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1296	大全能 源	2022- 12-05	189,9 80.00	3,500.00	7	3.5 1	129.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1316	和辉光 电	2022- 12-05	35,49 0.00	13,000.00	7	2.5 0	17.25	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1334	中控技 术	2022- 12-05	10,12 8,800 .00	110,000.0 0	7	3.2 0	6,302 .36	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1412	蓝思科 技	2022- 12-05	102,0 84.00	9,400.00	7	2.5 0	49.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1414	深信服	2022- 12-05	115,2 00.00	1,000.00	7	3.2 0	71.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1416	深信服	2022- 12-05	138,2 40.00	1,200.00	7	2.5 0	67.20	0.00	0.00
广发证	2022	康泰生	2022-	109,3	3,200.00	7	2.5	53.14	0.00	0.00

券	1205 0002 1424	物	12-05	12.00			0			
广发证 券	2022 1205 0002 1664	中微公 司	2022- 12-05	182,4 30.00	1,800.00	7	2.5 0	88.68	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1666	中微公 司	2022- 12-05	6,283 ,700. 00	62,000.00	7	3.0 0	3,665 .49	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1724	晶科能 源	2022- 12-05	103,0 26.00	6,600.00	7	2.5 0	50.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1816	中科创 达	2022- 12-05	179,3 92.00	1,600.00	7	2.5 0	87.20	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 1828	迈瑞医 疗	2022- 12-05	717,2 00.00	2,200.00	7	2.5 0	348.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 6498	中科创 达	2022- 12-05	392,4 20.00	3,500.00	7	3.5 1	267.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 6514	亿联网 络	2022- 12-05	102,4 32.00	1,600.00	7	2.5 0	49.79	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 6538	锦浪科 技	2022- 12-05	186,5 00.00	1,000.00	7	2.5 0	90.66	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 6598	容百科 技	2022- 12-05	77,34 0.00	1,000.00	7	3.2 0	48.12	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 6600	容百科 技	2022- 12-05	92,80 8.00	1,200.00	7	2.5 0	45.12	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205	中国通 号	2022- 12-05	59,17 0.00	12,200.00	7	2.5 0	28.76	0.00	0.00

	0002 6608									
广发证 券	2022 1205 0002 7112	亿纬锂 能	2022- 12-05	453,4 92.00	5,400.00	7	2.5 0	220.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7556	汇川技 术	2022- 12-05	621,7 80.00	8,600.00	7	2.5 0	302.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7558	沃森生 物	2022- 12-05	299,6 68.00	7,600.00	7	2.5 0	145.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7570	北京君 正	2022- 12-05	77,92 0.00	1,000.00	7	2.5 0	37.88	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7574	欣旺达	2022- 12-05	133,9 52.00	5,600.00	7	2.5 0	65.12	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7590	欣旺达	2022- 12-05	2,870 ,400. 00	120,000.0 0	7	4.4 1	2,461 .37	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7604	泰格医 药	2022- 12-05	219,4 56.00	2,400.00	7	2.5 0	106.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7610	三环集 团	2022- 12-05	164,6 46.00	5,400.00	7	2.5 0	80.04	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7616	先导智 能	2022- 12-05	222,5 60.00	5,200.00	7	2.5 0	108.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7620	圣邦股 份	2022- 12-05	217,5 36.00	1,200.00	7	2.5 0	105.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002	宁德时代	2022- 12-05	784,6 20.00	2,000.00	7	2.5 0	381.4 1	0.00	0.00

	7638									
广发证 券	2022 1205 0002 7648	康龙化 成	2022- 12-05	157,2 24.00	2,400.00	7	2.5 0	76.43	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7658	卓胜微	2022- 12-05	266,1 79.00	2,300.00	7	3.2 0	165.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1205 0002 7662	卓胜微	2022- 12-05	185,1 68.00	1,600.00	7	2.5 0	90.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 1206 0000 0878	泰格医 药	2022- 12-06	21,68 7,195 .00	235,500.0 0	14	3.3 1	27,91 6.24	0.00	0.00
广发证 券	2022 1206 0001 4438	卓胜微	2022- 12-06	6,140 ,808. 00	52,200.00	7	4.4 0	5,253 .80	0.00	0.00
广发证 券	2022 1206 0001 4462	卓胜微	2022- 12-06	341,1 56.00	2,900.00	7	4.4 0	291.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0000 1018	传音控 股	2022- 12-07	125,2 48.00	1,600.00	14	3.2 0	155.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0001 2354	欣旺达	2022- 12-07	3,947 ,200. 00	160,000.0 0	7	4.4 1	3,384 .72	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0001 3646	天合光 能	2022- 12-07	5,847 ,080. 00	101,600.0 0	7	3.5 1	3,990 .63	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0001 3650	石头科 技	2022- 12-07	462,3 83.00	1,700.00	7	3.2 0	287.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1207 0001 4554	亿联网 络	2022- 12-07	2,764 ,860. 00	43,500.00	7	3.2 0	1,720 .36	0.00	0.00

广发证 券	2022 1208 0001 1691	亿联网 络	2022- 12-08	7,574 ,805. 00	121,100.0 0	7	3.2 0	4,713 .21	0.00	0.00
广发证 券	2022 1208 0001 1695	思瑞浦	2022- 12-08	1,094 ,358. 00	3,400.00	7	3.2 0	680.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1208 0001 1701	阳光电 源	2022- 12-08	4,288 ,800. 00	40,000.00	7	0.8 0	667.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2022 1208 0001 1707	格科微	2022- 12-08	134,3 93.00	7,300.00	7	3.2 0	83.62	0.00	0.00
广发证 券	2022 1208 0001 1929	卓胜微	2022- 12-08	1,921 ,240. 00	17,200.00	7	3.2 1	1,199 .17	0.00	0.00
广发证 券	2022 1209 0000 7160	宁德时 代	2022- 12-09	1,358 ,720. 00	3,200.00	7	2.0 0	528.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1209 0000 7220	三环集 团	2022- 12-09	525,0 00.00	17,500.00	7	3.2 0	326.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1209 0000 7244	亿联网 络	2022- 12-09	389,4 22.00	6,200.00	7	3.2 0	242.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 7515	凯赛生 物	2022- 12-12	65,76 0.00	1,000.00	14	3.2 0	81.83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 7781	北京君 正	2022- 12-12	95,58 0.00	1,200.00	14	3.5 0	130.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 7783	北京君 正	2022- 12-12	79,65 0.00	1,000.00	14	3.2 0	99.12	0.00	0.00
广发证	2022	深信服	2022-	112,8	1,000.00	14	3.2	140.4	0.00	0.00

券	1212 0000 7785		12-12	80.00			0	7		
广发证 券	2022 1212 0000 7806	迈为股 份	2022- 12-12	451,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	561.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 7807	晶盛机 电	2022- 12-12	18,20 0,518 .00	258,200.0 0	14	3.2 0	22,64 9.53	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 8251	中控技 术	2022- 12-12	3,305 ,120. 00	36,400.00	14	3.2 0	4,113 .04	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0000 8256	天合光 能	2022- 12-12	108,7 56.00	1,900.00	14	3.2 0	135.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 7321	智飞生 物	2022- 12-12	321,1 38.00	3,800.00	7	2.5 0	156.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 7405	汇川技 术	2022- 12-12	601,1 40.00	8,600.00	7	2.5 0	292.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 8447	大全能 源	2022- 12-12	53,78 0.00	1,000.00	7	2.5 0	26.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 8449	大全能 源	2022- 12-12	188,2 30.00	3,500.00	7	3.5 1	128.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 8473	中控技 术	2022- 12-12	127,1 20.00	1,400.00	7	2.5 0	61.79	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 8475	中控技 术	2022- 12-12	1,180 ,400. 00	13,000.00	7	3.2 0	734.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212	中控技 术	2022- 12-12	9,988 ,000.	110,000.0 0	1	3.2 0	887.8 2	0.00	0.00

	0003 8479			00						
广发证 券	2022 1212 0003 9675	和辉光 电	2022- 12-12	35,62 0.00	13,000.00	7	2.5 0	17.32	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9703	阳光电 源	2022- 12-12	503,6 16.00	4,800.00	7	2.5 0	244.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9705	泰格医 药	2022- 12-12	217,7 28.00	2,400.00	7	2.5 0	105.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9707	三环集 团	2022- 12-12	166,2 12.00	5,400.00	7	2.5 0	80.80	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9709	蓝思科 技	2022- 12-12	103,4 00.00	9,400.00	7	2.5 0	50.26	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9715	亿联网 络	2022- 12-12	99,85 6.00	1,600.00	7	2.5 0	48.54	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9723	宁德时代	2022- 12-12	828,7 00.00	2,000.00	7	2.5 0	402.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9727	迈瑞医 疗	2022- 12-12	693,9 90.00	2,200.00	7	2.5 0	337.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9741	传音控 股	2022- 12-12	95,88 0.00	1,200.00	7	2.5 0	46.61	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9747	金山办 公	2022- 12-12	260,5 70.00	1,000.00	7	2.5 0	126.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003	君实生 物	2022- 12-12	99,84 0.00	1,600.00	7	2.5 0	48.53	0.00	0.00

	9753									
广发证 券	2022 1212 0003 9759	时代电 气	2022- 12-12	56,77 0.00	1,000.00	7	2.5 0	27.60	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9765	华润微	2022- 12-12	133,4 16.00	2,400.00	7	2.5 0	64.86	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9769	亿纬锂 能	2022- 12-12	487,3 50.00	5,400.00	7	2.5 0	236.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9795	天合光 能	2022- 12-12	286,2 00.00	5,000.00	7	2.5 0	139.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9819	晶盛机 电	2022- 12-12	211,4 70.00	3,000.00	7	2.5 0	102.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0003 9821	康泰生 物	2022- 12-12	109,1 20.00	3,200.00	7	2.5 0	53.04	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0293	深信服	2022- 12-12	112,8 80.00	1,000.00	1	3.2 0	10.03	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0295	深信服	2022- 12-12	135,4 56.00	1,200.00	7	2.5 0	65.85	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0303	欣旺达	2022- 12-12	2,893 ,200. 00	120,000.0 0	7	4.4 1	2,480 .92	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0307	欣旺达	2022- 12-12	135,0 16.00	5,600.00	7	2.5 0	65.63	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0311	北京君 正	2022- 12-12	79,65 0.00	1,000.00	7	2.5 0	38.72	0.00	0.00

广发证 券	2022 1212 0004 0317	先导智 能	2022- 12-12	221,9 36.00	5,200.00	7	2.5 0	107.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0329	康龙化 成	2022- 12-12	151,3 92.00	2,400.00	7	2.5 0	73.59	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0331	锦浪科 技	2022- 12-12	191,5 30.00	1,000.00	7	2.5 0	93.10	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0333	卓胜微	2022- 12-12	187,4 88.00	1,600.00	7	2.5 0	91.14	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0335	卓胜微	2022- 12-12	269,5 14.00	2,300.00	7	3.2 0	167.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0337	大全能 源	2022- 12-12	537,8 00.00	10,000.00	7	2.0 0	209.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0351	中科创 达	2022- 12-12	390,3 90.00	3,500.00	7	3.5 1	266.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0353	中科创 达	2022- 12-12	178,4 64.00	1,600.00	7	2.5 0	86.75	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0359	格科微	2022- 12-12	19,57 0.00	1,000.00	7	2.5 0	9.51	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0375	沃森生 物	2022- 12-12	304,9 88.00	7,600.00	7	2.5 0	148.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0377	圣邦股 份	2022- 12-12	220,3 44.00	1,200.00	7	2.5 0	107.1 1	0.00	0.00
广发证	2022	中微公	2022-	194,7	1,800.00	7	2.5	94.69	0.00	0.00

券	1212 0004 0411	司	12-12	96.00			0			
广发证 券	2022 1212 0004 0413	中微公 司	2022- 12-12	6,709 ,640. 00	62,000.00	7	3.0 0	3,913 .96	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0415	中国通 号	2022- 12-12	57,58 4.00	12,200.00	7	2.5 0	27.99	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0479	容百科 技	2022- 12-12	75,72 0.00	1,000.00	1	3.2 0	6.73	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 0481	容百科 技	2022- 12-12	90,86 4.00	1,200.00	7	2.5 0	44.17	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1343	澜起科 技	2022- 12-12	155,1 22.00	2,200.00	7	2.5 0	75.41	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1361	凯赛生 物	2022- 12-12	65,76 0.00	1,000.00	7	2.5 0	31.97	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1383	晶科能 源	2022- 12-12	92,73 0.00	6,600.00	7	2.5 0	45.08	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1459	中芯国 际	2022- 12-12	385,9 40.00	9,200.00	7	2.5 0	187.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1477	沪硅产 业	2022- 12-12	102,5 96.00	5,200.00	7	2.5 0	49.87	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212 0004 1479	沪硅产 业	2022- 12-12	140,0 83.00	7,100.00	7	3.4 1	92.88	0.00	0.00
广发证 券	2022 1212	奇安信	2022- 12-12	78,57 6.00	1,200.00	7	2.5 0	38.20	0.00	0.00

	0004 1505									
广发证 券	2022 1213 0001 3387	卓胜微	2022- 12-13	6,099 ,048. 00	52,200.00	7	4.4 0	5,218 .07	0.00	0.00
广发证 券	2022 1213 0001 3389	卓胜微	2022- 12-13	338,8 36.00	2,900.00	7	4.4 0	289.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1214 0002 6180	天合光 能	2022- 12-14	5,553 ,456. 00	101,600.0 0	14	3.5 1	7,580 .47	0.00	0.00
广发证 券	2022 1214 0002 7596	亿联网 络	2022- 12-14	2,663 ,070. 00	43,500.00	7	3.2 0	1,657 .02	0.00	0.00
广发证 券	2022 1214 0002 7614	欣旺达	2022- 12-14	3,724 ,800. 00	160,000.0 0	7	4.4 1	3,194 .02	0.00	0.00
广发证 券	2022 1214 0002 8342	石头科 技	2022- 12-14	455,9 40.00	1,700.00	7	3.2 0	283.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0000 2173	石头科 技	2022- 12-15	1,715 ,072. 00	6,400.00	14	3.2 0	2,134 .31	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0000 2191	昱能科 技	2022- 12-15	1,036 ,393. 00	1,900.00	14	3.2 0	1,289 .73	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0001 1715	阳光电 源	2022- 12-15	4,013 ,200. 00	40,000.00	14	0.8 0	1,248 .55	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0001 1717	格科微	2022- 12-15	144,5 40.00	7,300.00	14	3.2 0	179.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0001	卓胜微	2022- 12-15	2,028 ,912. 00	17,200.00	14	3.2 1	2,532 .76	0.00	0.00

	1735									
广发证 券	2022 1215 0001 3715	亿联网 络	2022- 12-15	7,414 ,953. 00	121,100.0 0	14	3.2 0	9,227 .50	0.00	0.00
广发证 券	2022 1215 0001 3717	思瑞浦	2022- 12-15	1,052 ,538. 00	3,400.00	14	3.2 0	1,309 .83	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0000 2493	石头科 技	2022- 12-16	717,5 25.00	2,700.00	14	3.2 0	892.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0001 0261	三环集 团	2022- 12-16	544,2 50.00	17,500.00	14	3.2 0	677.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0001 0263	亿联网 络	2022- 12-16	372,9 92.00	6,200.00	14	3.2 0	464.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0001 0439	思瑞浦	2022- 12-16	303,9 00.00	1,000.00	14	3.2 0	378.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0001 0609	石头科 技	2022- 12-16	983,2 75.00	3,700.00	14	3.4 0	1,300 .11	0.00	0.00
广发证 券	2022 1216 0001 1379	宁德时 代	2022- 12-16	1,337 ,632. 00	3,200.00	14	2.0 0	1,040 .38	0.00	0.00
广发证 券	2022 1219 0000 2629	锦浪科 技	2022- 12-19	11,79 7,100 .00	70,000.00	14	5.4 1	21,27 4.10	12,603,500. 00	21,274.1 0
广发证 券	2022 1219 0000 2739	中控技 术	2022- 12-19	9,088 ,950. 00	102,700.0 0	14	3.2 0	9,694 .88	9,328,241.0 0	9,694.88
广发证 券	2022 1219 0001 9354	先导智 能	2022- 12-19	219,0 24.00	5,200.00	14	2.5 0	182.5 2	209,300.00	182.52

广发证 券	2022 1219 0001 9356	沪硅产 业	2022- 12-19	96,46 0.00	5,200.00	14	2.5 0	80.38	91,572.00	80.38
广发证 券	2022 1219 0001 9384	晶科能 源	2022- 12-19	87,97 8.00	6,600.00	14	2.5 0	73.32	96,690.00	73.32
广发证 券	2022 1219 0001 9388	大全能 源	2022- 12-19	513,2 00.00	10,000.00	14	2.0 0	342.1 3	476,800.00	342.13
广发证 券	2022 1219 0001 9400	泰格医 药	2022- 12-19	223,8 72.00	2,400.00	14	2.5 0	186.5 6	251,520.00	186.56
广发证 券	2022 1219 0001 9418	和辉光 电	2022- 12-19	35,23 0.00	13,000.00	14	2.5 0	29.36	34,840.00	29.36
广发证 券	2022 1219 0001 9422	奇安信	2022- 12-19	75,79 2.00	1,200.00	14	2.5 0	63.16	78,924.00	63.16
广发证 券	2022 1219 0001 9426	中控技 术	2022- 12-19	123,9 00.00	1,400.00	14	2.5 0	103.2 5	127,162.00	103.25
广发证 券	2022 1219 0001 9430	三环集 团	2022- 12-19	162,8 10.00	5,400.00	14	2.5 0	135.6 8	165,834.00	135.68
广发证 券	2022 1219 0001 9440	中芯国 际	2022- 12-19	384,3 76.00	9,200.00	14	2.5 0	320.3 1	378,488.00	320.31
广发证 券	2022 1219 0001 9458	蓝思科 技	2022- 12-19	100,5 80.00	9,400.00	14	2.5 0	83.82	98,982.00	83.82
广发证 券	2022 1219 0001 9492	深信服	2022- 12-19	128,4 24.00	1,200.00	14	2.5 0	107.0 2	135,060.00	107.02
广发证	2022	中科创	2022-	168,0	1,600.00	14	2.5	140.0	160,480.00	140.03

券	1219 0001 9518	达	12-19	32.00			0	3		
广发证 券	2022 1219 0001 9520	中科创 达	2022- 12-19	367,5 70.00	3,500.00	14	3.5 1	430.0 6	351,050.00	430.06
广发证 券	2022 1219 0001 9580	君实生 物	2022- 12-19	87,12 0.00	1,600.00	14	2.5 0	72.60	100,160.00	72.60
广发证 券	2022 1219 0001 9610	时代电 气	2022- 12-19	55,29 0.00	1,000.00	14	2.5 0	46.08	54,570.00	46.08
广发证 券	2022 1219 0001 9656	天合光 能	2022- 12-19	275,0 50.00	5,000.00	14	2.5 0	229.2 1	318,800.00	229.21
广发证 券	2022 1219 0001 9666	格科微	2022- 12-19	18,73 0.00	1,000.00	14	2.5 0	15.61	17,540.00	15.61
广发证 券	2022 1219 0001 9678	中控技 术	2022- 12-19	1,150 ,500. 00	13,000.00	14	3.2 0	1,227 .20	1,180,790.0 0	1,227.20
广发证 券	2022 1219 0001 9754	传音控 股	2022- 12-19	95,76 0.00	1,200.00	14	2.5 0	79.80	95,424.00	79.80
广发证 券	2022 1219 0001 9764	宁德时代	2022- 12-19	840,8 00.00	2,000.00	14	2.5 0	700.6 7	786,840.00	700.67
广发证 券	2022 1219 0001 9766	康龙化 成	2022- 12-19	142,3 68.00	2,400.00	14	2.5 0	118.6 4	163,200.00	118.64
广发证 券	2022 1219 0001 9768	迈瑞医 疗	2022- 12-19	676,9 62.00	2,200.00	14	2.5 0	564.1 4	695,134.00	564.14
广发证 券	2022 1219	中微公 司	2022- 12-19	191,0 34.00	1,800.00	14	2.5 0	159.2 0	176,418.00	159.20

	0001 9786									
广发证 券	2022 1219 0001 9788	中微公 司	2022- 12-19	6,580 ,060. 00	62,000.00	14	3.0 0	6,580 .06	6,076,620.0 0	6,580.06
广发证 券	2022 1219 0001 9802	容百科 技	2022- 12-19	86,72 4.00	1,200.00	14	2.5 0	72.27	82,500.00	72.27
广发证 券	2022 1219 0001 9808	中国通 号	2022- 12-19	57,82 8.00	12,200.00	14	2.5 0	48.19	58,438.00	48.19
广发证 券	2022 1219 0001 9830	沪硅产 业	2022- 12-19	131,7 05.00	7,100.00	14	3.4 1	149.7 0	125,031.00	149.70
广发证 券	2022 1219 0001 9838	金山办 公	2022- 12-19	247,1 00.00	1,000.00	14	2.5 0	205.9 2	264,490.00	205.92
广发证 券	2022 1219 0002 0882	澜起科 技	2022- 12-19	142,7 80.00	2,200.00	14	2.5 0	118.9 8	137,720.00	118.98
广发证 券	2022 1219 0002 0904	凯赛生 物	2022- 12-19	62,01 0.00	1,000.00	14	2.5 0	51.68	61,290.00	51.68
广发证 券	2022 1219 0002 2258	亿纬锂 能	2022- 12-19	501,6 60.00	5,400.00	14	2.5 0	418.0 5	474,660.00	418.05
广发证 券	2022 1219 0002 2274	智飞生 物	2022- 12-19	308,5 22.00	3,800.00	14	2.5 0	257.1 0	333,754.00	257.10
广发证 券	2022 1219 0002 2276	汇川技 术	2022- 12-19	601,3 12.00	8,600.00	14	2.5 0	501.0 9	597,700.00	501.09
广发证 券	2022 1219 0002	沃森生 物	2022- 12-19	298,9 84.00	7,600.00	14	2.5 0	249.1 5	305,444.00	249.15

	2282									
广发证 券	2022 1219 0002 5708	欣旺达	2022- 12-19	2,798 ,400. 00	120,000.0 0	14	4.4 1	4,113 .65	2,538,000.0 0	4,113.65
广发证 券	2022 1219 0002 5712	欣旺达	2022- 12-19	130,5 92.00	5,600.00	14	2.5 0	108.8 3	118,440.00	108.83
广发证 券	2022 1219 0002 5716	北京君 正	2022- 12-19	74,25 0.00	1,000.00	14	2.5 0	61.88	70,440.00	61.88
广发证 券	2022 1219 0002 6028	阳光电 源	2022- 12-19	467,0 88.00	4,800.00	14	2.5 0	389.2 4	536,640.00	389.24
广发证 券	2022 1219 0002 6092	大全能 源	2022- 12-19	51,32 0.00	1,000.00	14	2.5 0	42.77	47,680.00	42.77
广发证 券	2022 1219 0002 6112	晶盛机 电	2022- 12-19	208,9 50.00	3,000.00	14	2.5 0	174.1 3	190,680.00	174.13
广发证 券	2022 1219 0002 6118	华润微	2022- 12-19	131,5 92.00	2,400.00	14	2.5 0	109.6 6	126,360.00	109.66
广发证 券	2022 1219 0002 7166	康泰生 物	2022- 12-19	99,74 4.00	3,200.00	14	2.5 0	83.12	100,896.00	83.12
广发证 券	2022 1219 0002 7176	亿联网 络	2022- 12-19	95,60 0.00	1,600.00	14	2.5 0	79.67	96,944.00	79.67
广发证 券	2022 1219 0002 7180	圣邦股 份	2022- 12-19	206,3 52.00	1,200.00	14	2.5 0	171.9 6	207,120.00	171.96
广发证 券	2022 1219 0002 7236	锦浪科 技	2022- 12-19	168,5 30.00	1,000.00	14	2.5 0	140.4 4	180,050.00	140.44

广发证 券	2022 1219 0002 7238	卓胜微	2022- 12-19	181,2 00.00	1,600.00	14	2.5 0	151.0 0	182,880.00	151.00
广发证 券	2022 1220 0000 1118	天合光 能	2022- 12-20	10,26 6,417 .00	186,900.0 0	14	3.5 1	11,01 0.73	11,916,744. 00	11,010.7 3
广发证 券	2022 1220 0001 6622	卓胜微	2022- 12-20	6,126 ,192. 00	52,200.00	14	4.4 0	8,236 .32	5,966,460.0 0	8,236.32
广发证 券	2022 1220 0001 6624	卓胜微	2022- 12-20	340,3 44.00	2,900.00	13	4.4 0	457.5 7	331,470.00	457.57
广发证 券	2022 1220 0001 9644	泰格医 药	2022- 12-20	21,19 9,710 .00	235,500.0 0	14	3.3 1	21,44 1.15	24,680,400. 00	21,441.1 5
广发证 券	2022 1221 0002 0457	欣旺达	2022- 12-21	3,568 ,000. 00	160,000.0 0	14	4.4 1	4,370 .80	3,384,000.0 0	4,370.80
广发证 券	2022 1221 0002 2109	石头科 技	2022- 12-21	431,1 20.00	1,700.00	14	3.2 0	383.2 2	421,175.00	383.22
广发证 券	2022 1221 0002 2407	亿联网 络	2022- 12-21	2,569 ,980. 00	43,500.00	14	3.2 0	2,284 .43	2,635,665.0 0	2,284.43
广发证 券	2022 1222 0000 1206	大全能 源	2022- 12-22	3,804 ,054. 00	79,400.00	14	3.4 2	3,252 .47	3,785,792.0 0	3,252.47
广发证 券	2022 1222 0000 1217	三一重 能	2022- 12-22	28,47 0.00	1,000.00	14	2.5 0	17.79	29,290.00	17.79
广发证 券	2022 1222 0000 1372	德方纳 米	2022- 12-22	238,5 00.00	1,000.00	14	2.5 0	149.0 6	229,590.00	149.06
广发证	2022	迈为股	2022-	396,0	1,000.00	14	2.5	247.5	411,840.00	247.50

券	1222 0000 1373	份	12-22	00.00			0	0		
广发证 券	2022 1222 0000 1381	中伟股 份	2022- 12-22	68,11 0.00	1,000.00	14	2.5 0	42.57	65,610.00	42.57
广发证 券	2022 1223 0000 1946	泰格医 药	2022- 12-23	1,609 ,080. 00	16,500.00	7	1.8 0	563.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 1223 0000 1948	中科创 达	2022- 12-23	3,578 ,685. 00	34,500.00	7	1.8 0	1,252 .54	0.00	0.00
广发证 券	2022 1223 0000 1952	德方纳 米	2022- 12-23	4,367 ,223. 00	18,900.00	7	1.8 0	1,528 .53	0.00	0.00
广发证 券	2022 1223 0000 1972	迈为股 份	2022- 12-23	5,640 ,355. 00	14,500.00	7	1.8 0	1,974 .12	0.00	0.00
广发证 券	2022 1226 0002 7905	凯赛生 物	2022- 12-26	62,36 0.00	1,000.00	14	3.2 0	27.72	61,290.00	27.72
广发证 券	2022 1226 0002 7917	北京君 正	2022- 12-26	71,78 0.00	1,000.00	14	3.2 0	31.90	70,440.00	31.90
广发证 券	2022 1226 0002 7925	晶盛机 电	2022- 12-26	15,67 7,904 .00	258,200.0 0	14	3.2 0	6,967 .96	16,411,192. 00	6,967.96
广发证 券	2022 1226 0002 7941	天合光 能	2022- 12-26	112,7 84.00	1,900.00	14	3.2 0	50.13	121,144.00	50.13
广发证 券	2022 1227 0000 1248	中伟股 份	2022- 12-27	1,116 ,504. 00	16,200.00	14	3.2 0	396.9 8	1,062,882.0 0	396.98
广发证 券	2022 1228	天合光 能	2022- 12-28	6,372 ,352.	101,600.0 0	14	3.5 1	1,863 .91	6,478,016.0 0	1,863.91

	0003 1691			00						
广发证 券	2022 1229 0000 1127	中微公 司	2022- 12-29	14,57 8,795 .00	146,300.0 0	14	3.5 1	2,842 .87	14,338,863. 00	2,842.87
广发证 券	2022 1229 0001 1871	卓胜微	2022- 12-29	1,985 ,568. 00	17,200.00	14	3.2 1	354.0 9	1,965,960.0 0	354.09
广发证 券	2022 1229 0001 4313	亿联网 络	2022- 12-29	7,298 ,697. 00	121,100.0 0	14	3.2 0	1,297 .55	7,337,449.0 0	1,297.55
广发证 券	2022 1229 0001 4315	思瑞浦	2022- 12-29	938,2 30.00	3,400.00	14	3.2 0	166.8 0	936,394.00	166.80
广发证 券	2022 1229 0001 4371	石头科 技	2022- 12-29	1,622 ,464. 00	6,400.00	14	3.2 0	288.4 4	1,585,600.0 0	288.44
广发证 券	2022 1230 0001 0885	迈为股 份	2022- 12-30	5,971 ,680. 00	14,500.00	7	1.8 0	298.5 8	5,971,680.0 0	298.58
广发证 券	2022 1230 0001 2693	德方纳 米	2022- 12-30	4,339 ,251. 00	18,900.00	7	1.8 0	216.9 6	4,339,251.0 0	216.96
广发证 券	2022 1230 0001 2725	亿联网 络	2022- 12-30	375,6 58.00	6,200.00	14	3.2 0	33.39	375,658.00	33.39
广发证 券	2022 1230 0001 2741	石头科 技	2022- 12-30	916,6 75.00	3,700.00	14	3.4 0	86.57	916,675.00	86.57
广发证 券	2022 1230 0001 2877	石头科 技	2022- 12-30	668,9 25.00	2,700.00	14	3.2 0	59.46	668,925.00	59.46
广发证 券	2022 1230 0001	泰格医 药	2022- 12-30	1,729 ,200. 00	16,500.00	7	1.8 0	86.46	1,729,200.0 0	86.46

	3069									
广发证 券	2022 1230 0001 3077	中科创 达	2022- 12-30	3,460 ,350. 00	34,500.00	7	1.8 0	173.0 2	3,460,350.0 0	173.02
广发证 券	2022 1230 0001 3835	宁德时 代	2022- 12-30	1,258 ,944. 00	3,200.00	14	2.0 0	69.94	1,258,944.0 0	69.94
上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日）至2021年12月31日										
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成交 时间	交易 金额	交易数量 （单位： 股）	出借期 限（单 位：天）	费 率（ %）	利息 收入	期末证券出 借业务余额	期末应 收利息 余额
广发证 券	2021 0818 0000 1003	康希诺	2021- 08-18	1,201 ,590. 00	3,000.00	14	1.8 0	841.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2021 0818 0000 1006	华润微	2021- 08-18	3,604 ,500. 00	45,000.00	14	1.8 0	2,523 .15	0.00	0.00
广发证 券	2021 0818 0000 1008	天能股 份	2021- 08-18	892,9 20.00	16,800.00	14	1.8 0	625.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 0818 0000 1010	芯原股 份	2021- 08-18	572,8 50.00	6,700.00	14	1.8 0	401.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 0820 0000 0522	沪硅产 业	2021- 08-20	1,610 ,457. 00	51,900.00	14	1.8 0	1,127 .32	0.00	0.00
广发证 券	2021 0820 0000 0698	卓胜微	2021- 08-20	5,070 ,021. 00	12,100.00	14	1.8 0	3,549 .01	0.00	0.00
广发证 券	2021 0820 0000 0704	信维通 信	2021- 08-20	6,345 ,136. 00	253,400.0 0	14	1.8 0	4,441 .60	0.00	0.00
广发证	2021	天能股	2021-	784,8	16,800.00	14	1.8	549.4	0.00	0.00

券	0901 0001 5801	份	09-01	96.00			0	3		
广发证 券	2021 0901 0001 6393	芯原股 份	2021- 09-01	494,6 61.00	6,700.00	14	1.8 0	346.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2021 0901 0001 6395	华润微	2021- 09-01	3,415 ,950. 00	45,000.00	14	1.8 0	2,391 .17	0.00	0.00
广发证 券	2021 0901 0001 6397	康希诺	2021- 09-01	1,172 ,970. 00	3,000.00	14	1.8 0	821.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2021 0903 0000 8997	沪硅产 业	2021- 09-03	1,539 ,354. 00	51,900.00	14	1.8 0	1,077 .55	0.00	0.00
广发证 券	2021 0903 0001 0269	卓胜微	2021- 09-03	4,351 ,160. 00	12,100.00	14	1.8 0	3,045 .81	0.00	0.00
广发证 券	2021 0903 0001 0281	信维通 信	2021- 09-03	6,053 ,726. 00	253,400.0 0	14	1.8 0	4,237 .61	0.00	0.00
广发证 券	2021 0907 0000 0734	华润微	2021- 09-07	81,43 3.00	1,100.00	14	2.0 0	67.86	0.00	0.00
广发证 券	2021 0910 0000 0494	中芯国 际	2021- 09-10	8,251 ,032. 00	141,600.0 0	14	2.0 0	6,417 .47	0.00	0.00
广发证 券	2021 0915 0001 9102	芯原股 份	2021- 09-15	515,6 32.00	6,700.00	14	1.8 0	360.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 0915 0001 9108	天能股 份	2021- 09-15	776,6 64.00	16,800.00	14	1.8 0	543.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2021 0915	康希诺	2021- 09-15	1,025 ,700.	3,000.00	14	1.8 0	717.9 9	0.00	0.00

	0001 9112			00						
广发证 券	2021 0915 0001 9114	华润微	2021- 09-15	3,171 ,150. 00	45,000.00	14	1.8 0	2,219 .81	0.00	0.00
广发证 券	2021 0917 0000 8957	信维通 信	2021- 09-17	5,904 ,220. 00	253,400.0 0	14	1.8 0	6,199 .43	0.00	0.00
广发证 券	2021 0917 0000 8967	卓胜微	2021- 09-17	4,005 ,221. 00	12,100.00	14	1.8 0	4,205 .48	0.00	0.00
广发证 券	2021 0917 0000 8971	沪硅产 业	2021- 09-17	1,468 ,770. 00	51,900.00	14	1.8 0	1,542 .21	0.00	0.00
广发证 券	2021 0922 0002 9961	华润微	2021- 09-22	76,95 6.00	1,100.00	14	2.0 0	68.41	0.00	0.00
广发证 券	2021 0924 0001 4943	中芯国 际	2021- 09-24	7,652 ,064. 00	141,600.0 0	14	2.0 0	5,951 .61	0.00	0.00
广发证 券	2021 0929 0001 7165	芯原股 份	2021- 09-29	454,3 27.00	6,700.00	14	1.8 0	318.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 0929 0001 7167	华润微	2021- 09-29	3,089 ,250. 00	45,000.00	14	1.8 0	2,162 .48	0.00	0.00
广发证 券	2021 0929 0001 7169	天能股 份	2021- 09-29	722,5 68.00	16,800.00	14	1.8 0	505.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 0929 0001 7171	康希诺	2021- 09-29	951,0 00.00	3,000.00	14	1.8 0	665.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000	华熙生 物	2021- 10-08	5,880 ,035. 00	30,100.00	14	3.2 0	7,317 .38	0.00	0.00

	0927									
广发证 券	2021 1008 0000 0963	三环集 团	2021- 10-08	70,52 8.00	1,900.00	14	2.0 0	54.86	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0965	沃森生 物	2021- 10-08	65,62 6.00	1,100.00	14	2.0 0	51.04	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0966	芒果超 媒	2021- 10-08	76,09 6.00	1,600.00	14	2.0 0	59.19	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0979	澜起科 技	2021- 10-08	71,89 2.00	1,200.00	14	2.0 0	55.92	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0981	沪硅产 业	2021- 10-08	69,64 8.00	2,400.00	14	2.0 0	54.17	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0983	中国通 号	2021- 10-08	68,90 4.00	13,200.00	14	2.0 0	53.59	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0985	亿联网 络	2021- 10-08	84,39 0.00	1,000.00	14	2.0 0	65.64	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0987	华大基 因	2021- 10-08	87,11 0.00	1,000.00	14	2.0 0	67.75	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 0999	亿纬锂 能	2021- 10-08	100,6 60.00	1,000.00	14	2.0 0	78.29	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 1000	康泰生 物	2021- 10-08	106,8 70.00	1,000.00	14	2.0 0	83.12	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 1027	智飞生 物	2021- 10-08	146,1 40.00	1,000.00	14	2.0 0	113.6 6	0.00	0.00

广发证 券	2021 1008 0000 1037	华熙生 物	2021- 10-08	195,3 50.00	1,000.00	14	2.0 0	151.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0000 1043	传音控 股	2021- 10-08	138,3 60.00	1,000.00	14	2.0 0	107.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0007 1073	中芯国 际	2021- 10-08	7,897 ,032. 00	141,600.0 0	14	2.0 0	6,142 .14	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0007 1079	卓胜微	2021- 10-08	4,341 ,238. 00	12,100.00	14	1.8 0	3,038 .87	0.00	0.00
广发证 券	2021 1008 0007 1091	信维通 信	2021- 10-08	5,891 ,550. 00	253,400.0 0	14	1.8 0	4,124 .09	0.00	0.00
广发证 券	2021 1011 0000 1758	芯原股 份	2021- 10-11	1,044 ,854. 00	15,800.00	14	1.7 0	690.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2021 1013 0001 9213	康希诺	2021- 10-13	896,1 00.00	3,000.00	14	1.8 0	627.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2021 1013 0001 9215	华润微	2021- 10-13	3,113 ,550. 00	45,000.00	14	1.8 0	2,179 .49	0.00	0.00
广发证 券	2021 1013 0001 9217	芯原股 份	2021- 10-13	432,1 50.00	6,700.00	14	1.8 0	302.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2021 1013 0001 9219	天能股 份	2021- 10-13	764,2 32.00	16,800.00	14	1.8 0	534.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2021 1018 0000 0575	华熙生 物	2021- 10-18	361,2 00.00	2,100.00	14	3.2 0	449.4 9	0.00	0.00
广发证	2021	亿纬锂	2021-	112,6	1,000.00	14	2.0	87.61	0.00	0.00

券	1022 0004 7196	能	10-22	40.00			0			
广发证 券	2021 1022 0004 7208	智飞生 物	2021- 10-22	150,7 30.00	1,000.00	14	2.0 0	117.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7214	沃森生 物	2021- 10-22	66,04 4.00	1,100.00	14	2.0 0	51.37	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7216	信维通 信	2021- 10-22	5,412 ,624. 00	253,400.0 0	14	1.8 0	3,788 .84	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7224	三环集 团	2021- 10-22	75,25 9.00	1,900.00	14	2.0 0	58.53	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7226	芒果超 媒	2021- 10-22	66,19 2.00	1,600.00	14	2.0 0	51.48	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7232	康泰生 物	2021- 10-22	116,5 30.00	1,000.00	14	2.0 0	90.63	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7234	亿联网 络	2021- 10-22	77,33 0.00	1,000.00	14	2.0 0	60.15	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7236	华大基 因	2021- 10-22	85,58 0.00	1,000.00	14	2.0 0	66.56	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7246	卓胜微	2021- 10-22	3,992 ,032. 00	12,100.00	14	1.8 0	2,794 .42	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7248	澜起科 技	2021- 10-22	67,74 0.00	1,200.00	14	2.0 0	52.69	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022	中国通 号	2021- 10-22	67,05 6.00	13,200.00	14	2.0 0	52.15	0.00	0.00

	0004 7250									
广发证 券	2021 1022 0004 7254	传音控 股	2021- 10-22	143,5 20.00	1,000.00	14	2.0 0	111.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7268	沪硅产 业	2021- 10-22	66,76 8.00	2,400.00	14	2.0 0	51.93	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7272	华熙生 物	2021- 10-22	5,236 ,196. 00	30,100.00	14	3.2 0	6,516 .16	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7274	华熙生 物	2021- 10-22	173,9 60.00	1,000.00	14	2.0 0	135.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 1022 0004 7282	中芯国 际	2021- 10-22	7,899 ,864. 00	141,600.0 0	14	2.0 0	6,144 .34	0.00	0.00
广发证 券	2021 1025 0000 0635	寒武纪	2021- 10-25	890,3 70.00	11,700.00	14	3.2 1	1,111 .48	0.00	0.00
广发证 券	2021 1025 0000 0644	芯原股 份	2021- 10-25	242,5 35.00	3,700.00	14	3.2 0	301.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2021 1027 0001 8267	康希诺	2021- 10-27	880,6 20.00	3,000.00	14	1.8 0	616.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1027 0001 8273	华润微	2021- 10-27	2,796 ,300. 00	45,000.00	14	1.8 0	1,957 .41	0.00	0.00
广发证 券	2021 1101 0000 4817	华熙生 物	2021- 11-01	353,8 50.00	2,100.00	14	3.2 0	440.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006	亿纬锂 能	2021- 11-05	113,4 90.00	1,000.00	14	2.0 0	88.27	0.00	0.00

	0479									
广发证 券	2021 1105 0006 0485	澜起科 技	2021- 11-05	89,19 6.00	1,200.00	14	2.0 0	69.37	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 0489	中国通 号	2021- 11-05	64,54 8.00	13,200.00	14	2.0 0	50.20	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 0491	传音控 股	2021- 11-05	148,6 70.00	1,000.00	14	2.0 0	115.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 0493	沪硅产 业	2021- 11-05	68,49 6.00	2,400.00	14	2.0 0	53.27	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 0503	华熙生 物	2021- 11-05	5,063 ,422. 00	30,100.00	14	3.2 0	6,301 .15	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 0505	华熙生 物	2021- 11-05	168,2 20.00	1,000.00	14	2.0 0	130.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6497	沃森生 物	2021- 11-05	56,68 3.00	1,100.00	14	2.0 0	44.09	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6499	智飞生 物	2021- 11-05	132,8 20.00	1,000.00	14	2.0 0	103.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6505	三环集 团	2021- 11-05	78,24 2.00	1,900.00	14	2.0 0	60.85	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6507	芒果超 媒	2021- 11-05	73,28 0.00	1,600.00	14	2.0 0	57.00	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6513	康泰生 物	2021- 11-05	108,8 50.00	1,000.00	14	2.0 0	84.66	0.00	0.00

广发证 券	2021 1105 0006 6515	华大基 因	2021- 11-05	91,70 0.00	1,000.00	14	2.0 0	71.32	0.00	0.00
广发证 券	2021 1105 0006 6517	亿联网 络	2021- 11-05	78,65 0.00	1,000.00	14	2.0 0	61.17	0.00	0.00
广发证 券	2021 1108 0001 6480	寒武纪	2021- 11-08	958,1 13.00	11,700.00	14	3.2 1	1,196 .04	0.00	0.00
广发证 券	2021 1110 0001 7943	康希诺	2021- 11-10	737,4 30.00	3,000.00	14	1.8 0	516.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2021 1115 0000 6721	华熙生 物	2021- 11-15	361,0 11.00	2,100.00	14	3.2 0	449.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2021 1116 0000 0842	九号公 司	2021- 11-16	545,6 15.00	8,500.00	14	4.1 1	872.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6221	亿纬锂 能	2021- 11-19	128,3 20.00	1,000.00	7	2.0 0	49.90	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6233	智飞生 物	2021- 11-19	131,3 50.00	1,000.00	7	2.0 0	51.08	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6235	沃森生 物	2021- 11-19	68,62 9.00	1,100.00	7	2.0 0	26.69	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6241	三环集 团	2021- 11-19	82,04 2.00	1,900.00	7	2.0 0	31.91	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6243	芒果超 媒	2021- 11-19	73,95 2.00	1,600.00	7	2.0 0	28.76	0.00	0.00
广发证	2021	康泰生	2021-	112,7	1,000.00	7	2.0	43.84	0.00	0.00

券	1119 0003 6249	物	11-19	20.00			0			
广发证 券	2021 1119 0003 6251	亿联网 络	2021- 11-19	79,14 0.00	1,000.00	7	2.0 0	30.78	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6253	华大基 因	2021- 11-19	90,75 0.00	1,000.00	7	2.0 0	35.29	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6257	澜起科 技	2021- 11-19	89,83 2.00	1,200.00	7	2.0 0	34.93	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6259	中国通 号	2021- 11-19	65,34 0.00	13,200.00	7	2.0 0	25.41	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6263	传音控 股	2021- 11-19	169,0 00.00	1,000.00	7	2.0 0	65.72	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6267	沪硅产 业	2021- 11-19	68,08 8.00	2,400.00	7	2.0 0	26.48	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6273	华熙生 物	2021- 11-19	4,955 ,965. 00	30,100.00	7	3.2 0	3,083 .71	0.00	0.00
广发证 券	2021 1119 0003 6275	华熙生 物	2021- 11-19	164,6 50.00	1,000.00	7	2.0 0	64.03	0.00	0.00
广发证 券	2021 1122 0000 0839	沃森生 物	2021- 11-22	1,204 ,000. 00	20,000.00	14	3.2 0	1,498 .31	0.00	0.00
广发证 券	2021 1122 0001 6612	寒武纪	2021- 11-22	1,014 ,039. 00	11,700.00	7	3.2 1	632.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1124	康希诺	2021- 11-24	789,6 00.00	3,000.00	7	1.8 0	276.3 6	0.00	0.00

	0001 4929									
广发证 券	2021 1125 0000 0758	亿纬锂 能	2021- 11-25	2,902 ,200. 00	20,000.00	14	3.2 0	3,611 .63	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 2748	亿纬锂 能	2021- 11-26	148,7 50.00	1,000.00	7	2.0 0	57.85	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4808	华熙生 物	2021- 11-26	4,964 ,393. 00	30,100.00	7	3.2 0	3,088 .96	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4810	华熙生 物	2021- 11-26	164,9 30.00	1,000.00	7	2.0 0	64.14	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4814	沪硅产 业	2021- 11-26	69,67 2.00	2,400.00	7	2.0 0	27.09	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4818	传音控 股	2021- 11-26	172,9 00.00	1,000.00	7	2.0 0	67.24	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4822	中国通 号	2021- 11-26	65,20 8.00	13,200.00	7	2.0 0	25.36	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4824	澜起科 技	2021- 11-26	92,89 2.00	1,200.00	7	2.0 0	36.12	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4828	华大基 因	2021- 11-26	89,40 0.00	1,000.00	7	2.0 0	34.77	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4830	亿联网 络	2021- 11-26	74,55 0.00	1,000.00	7	2.0 0	28.99	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000	康泰生 物	2021- 11-26	113,8 00.00	1,000.00	7	2.0 0	44.26	0.00	0.00

	4832									
广发证 券	2021 1126 0000 4838	芒果超 媒	2021- 11-26	73,31 2.00	1,600.00	7	2.0 0	28.51	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4840	三环集 团	2021- 11-26	80,00 9.00	1,900.00	7	2.0 0	31.11	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4844	沃森生 物	2021- 11-26	74,36 0.00	1,100.00	7	2.0 0	28.92	0.00	0.00
广发证 券	2021 1126 0000 4846	智飞生 物	2021- 11-26	128,8 80.00	1,000.00	7	2.0 0	50.12	0.00	0.00
广发证 券	2021 1129 0000 4693	寒武纪	2021- 11-29	1,118 ,520. 00	11,700.00	7	3.2 1	698.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 1129 0000 4701	华熙生 物	2021- 11-29	338,0 16.00	2,100.00	7	3.2 0	210.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2021 1130 0000 4653	九号公 司	2021- 11-30	517,1 40.00	8,500.00	7	4.1 1	413.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2021 1201 0000 0941	中芯国 际	2021- 12-01	3,684 ,200. 00	67,600.00	14	3.2 0	4,584 .78	0.00	0.00
广发证 券	2021 1201 0000 4269	康希诺	2021- 12-01	805,6 80.00	3,000.00	7	1.8 0	281.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0001 7699	华熙生 物	2021- 12-03	4,885 ,230. 00	30,100.00	7	3.2 0	3,039 .70	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0507	亿纬锂 能	2021- 12-03	146,2 00.00	1,000.00	7	2.0 0	56.86	0.00	0.00

广发证 券	2021 1203 0002 0517	智飞生 物	2021- 12-03	122,2 40.00	1,000.00	7	2.0 0	47.54	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0519	沃森生 物	2021- 12-03	72,46 8.00	1,100.00	7	2.0 0	28.18	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0523	三环集 团	2021- 12-03	83,84 7.00	1,900.00	7	2.0 0	32.61	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0529	康泰生 物	2021- 12-03	110,5 10.00	1,000.00	7	2.0 0	42.98	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0531	亿联网 络	2021- 12-03	75,40 0.00	1,000.00	7	2.0 0	29.32	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0533	华大基 因	2021- 12-03	91,69 0.00	1,000.00	7	2.0 0	35.66	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0537	澜起科 技	2021- 12-03	92,60 4.00	1,200.00	7	2.0 0	36.01	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0539	中国通 号	2021- 12-03	66,13 2.00	13,200.00	7	2.0 0	25.72	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0543	传音控 股	2021- 12-03	161,0 00.00	1,000.00	7	2.0 0	62.61	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0547	沪硅产 业	2021- 12-03	68,59 2.00	2,400.00	7	2.0 0	26.67	0.00	0.00
广发证 券	2021 1203 0002 0603	华熙生 物	2021- 12-03	162,3 00.00	1,000.00	7	2.0 0	63.12	0.00	0.00
广发证	2021	沃森生	2021-	1,254	20,000.00	14	3.2	1,561	0.00	0.00

券	1206 0000 7542	物	12-06	,600. 00			0	.28		
广发证 券	2021 1206 0000 7544	寒武纪	2021- 12-06	1,067 ,040. 00	11,700.00	7	3.2 1	666.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2021 1207 0001 0005	九号公 司	2021- 12-07	484,6 70.00	8,500.00	7	4.1 1	387.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1208 0000 5258	康希诺	2021- 12-08	768,5 40.00	3,000.00	7	1.8 0	268.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2021 1209 0000 6611	亿纬锂 能	2021- 12-09	2,709 ,400. 00	20,000.00	14	3.2 0	3,371 .70	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4689	亿纬锂 能	2021- 12-10	137,2 20.00	1,000.00	7	2.0 0	53.36	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4699	智飞生 物	2021- 12-10	127,2 70.00	1,000.00	7	2.0 0	49.49	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4701	沃森生 物	2021- 12-10	67,65 0.00	1,100.00	7	2.0 0	26.31	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4705	三环集 团	2021- 12-10	88,50 2.00	1,900.00	7	2.0 0	34.42	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4711	康泰生 物	2021- 12-10	112,6 90.00	1,000.00	7	2.0 0	43.82	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4713	亿联网 络	2021- 12-10	84,54 0.00	1,000.00	7	2.0 0	32.88	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210	华大基 因	2021- 12-10	92,21 0.00	1,000.00	7	2.0 0	35.86	0.00	0.00

	0000 4715									
广发证 券	2021 1210 0000 4719	澜起科 技	2021- 12-10	90,00 0.00	1,200.00	7	2.0 0	35.00	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4721	中国通 号	2021- 12-10	66,00 0.00	13,200.00	7	2.0 0	25.67	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4725	传音控 股	2021- 12-10	159,0 80.00	1,000.00	7	2.0 0	61.86	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4761	华熙生 物	2021- 12-10	5,238 ,303. 00	30,100.00	14	3.2 0	6,518 .78	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4829	沪硅产 业	2021- 12-10	67,05 6.00	2,400.00	7	2.0 0	26.08	0.00	0.00
广发证 券	2021 1210 0000 4833	华熙生 物	2021- 12-10	174,0 30.00	1,000.00	7	2.0 0	67.68	0.00	0.00
广发证 券	2021 1213 0000 9707	寒武纪	2021- 12-13	1,238 ,679. 00	11,700.00	7	3.2 1	773.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2021 1214 0000 0831	华大基 因	2021- 12-14	93,20 0.00	1,000.00	14	3.2 0	115.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2021 1214 0000 0835	贝达药 业	2021- 12-14	83,19 0.00	1,000.00	14	3.2 0	103.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2021 1214 0001 1356	九号公 司	2021- 12-14	495,1 25.00	8,500.00	14	4.1 1	791.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2021 1215 0000	中伟股 份	2021- 12-15	595,9 80.00	3,600.00	14	3.2 0	741.6 6	0.00	0.00

	1724									
广发证 券	2021 1215 0000 1757	天合光 能	2021- 12-15	6,478 ,000. 00	79,000.00	14	3.2 1	8,086 .70	0.00	0.00
广发证 券	2021 1215 0000 1769	华润微	2021- 12-15	846,2 50.00	12,500.00	14	3.2 1	1,056 .40	0.00	0.00
广发证 券	2021 1215 0001 6319	康希诺	2021- 12-15	938,1 00.00	3,000.00	14	1.8 0	656.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2021 1215 0001 6333	中芯国 际	2021- 12-15	3,659 ,188. 00	67,600.00	14	3.2 0	4,553 .66	0.00	0.00
广发证 券	2021 1220 0000 9283	寒武纪	2021- 12-20	1,049 ,256. 00	11,700.00	14	3.2 1	1,029 .15	1,112,670.0 0	1,029.15
广发证 券	2021 1224 0000 9860	华熙生 物	2021- 12-24	4,764 ,529. 00	30,100.00	14	3.2 0	2,964 .60	4,674,530.0 0	2,964.60
广发证 券	2021 1228 0001 2094	九号公 司	2021- 12-28	579,2 75.00	8,500.00	14	4.1 1	198.4 0	595,595.00	198.40
广发证 券	2021 1228 0001 3658	贝达药 业	2021- 12-28	79,68 0.00	1,000.00	14	3.2 0	21.25	79,830.00	21.25
广发证 券	2021 1228 0001 3660	华大基 因	2021- 12-28	88,65 0.00	1,000.00	14	3.2 0	23.64	87,800.00	23.64
广发证 券	2021 1229 0001 1112	中伟股 份	2021- 12-29	541,6 56.00	3,600.00	14	3.2 0	96.29	545,436.00	96.29
广发证 券	2021 1229 0001 1120	康希诺	2021- 12-29	908,4 00.00	3,000.00	14	1.8 0	90.84	898,650.00	90.84

广发证券	2021 1229 0001 1128	华润微	2021- 12-29	795,3 75.00	12,500.00	14	3.2 1	141.8 4	807,500.00	141.84
广发证券	2021 1229 0001 1134	天合光 能	2021- 12-29	6,055 ,350. 00	79,000.00	14	3.2 1	1,079 .87	6,233,100.0 0	1,079.87

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

7.4.10.5.2 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 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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
易方达中证科创 创业 50 交易型开 放式指数证券投 资基金联接基金	2,406,630,766.00	23.5003%	1,944,007,733.00	23.2791%
广发证券股份有 限公司	14,281,360.00	0.1395%	17,083,262.00	0.2046%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同等相关法律文件有关规定支付。广发证券持有本基金份额含融资融券业务相关份额。

7.4.10.6 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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年6月28日（基金合同生效日） 至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行-活期存款	15,761,309.10	83,761.03	33,167,218.43	376,657.97

注：本基金的上述银行存款由基金托管人中国工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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301181	标榜股份	新股网下发行	2,564	103,201.00
广发证券股份有限公司	301220	亚香股份	新股网下发行	2,849	102,507.02
广发证券股份有限公司	603057	紫燕食品	新股网下发行	549	8,317.35
广发证券股份有限公司	603255	鼎际得	新股网下发行	489	10,699.32
广发证券股份有限公司	688496	清越科技	新股网下发行	12,000	109,920.00
上年度可比期间 2021 年 6 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
广发证券股份有限公司	301038	深水规院	新股网下发行	2,660	17,768.80

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新股流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6 个月	新股流通受限	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新股流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022-06-30	6 个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新股流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6 个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6 个月	新股流通受限	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6 个月	新股流通受限	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新股流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6 个月	新股流通	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-

				受限						
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新股 流通 受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新股 流通 受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6 个月	新股 流通 受限	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新股 流通 受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6 个月	新股 流通 受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6 个月	新股 流通 受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6 个月	新股 流通 受限	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301297	富乐德	2022-12-23	6 个月	新股 流通 受限	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-
301300	远翔新材	2022-08-09	6 个月	新股 流通 受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股 流通 受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301309	万得凯	2022-09-08	6 个月	新股 流通 受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6 个月	新股 流通 受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新股 流通 受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6 个月	新股 流通 受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-
301319	唯特	2022-09-22	6 个月	新股	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-

	偶			流通受限						
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新股流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301339	通行宝	2022-09-02	6 个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新股流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301359	东南电子	2022-11-02	6 个月	新股流通受限	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301361	众智科技	2022-11-08	6 个月	新股流通受限	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6 个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
688147	微导纳米	2022-12-16	6 个月	新股流通受限	24.21	23.91	6,293	152,353.53	150,465.63	-

688271	联影医疗	2022-08-12	6 个月	新股流通受限	109.88	171.68	7,365	809,266.20	1,264,423.20	-
688439	振华风光	2022-08-19	6 个月	新股流通受限	66.99	114.86	7,096	475,361.04	815,046.56	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

7.4.12.4 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	300014	亿纬锂能	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	87.90	150,800.00	13,255,320.00
2	300122	智飞生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	87.83	303,700.00	26,673,971.00
3	300124	汇川技术	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	69.50	466,100.00	32,393,950.00
4	300142	沃森生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	40.19	503,600.00	20,239,684.00
5	300207	欣旺达	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	21.15	955,700.00	20,213,055.00
6	300223	北京君正	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	70.44	76,800.00	5,409,792.00
7	300274	阳光电源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	111.80	527,200.00	58,940,960.00
8	300316	晶盛机电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	63.56	347,300.00	22,074,388.00

9	300347	泰格医药	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	104.8 0	382,000.00	40,033,600. 00
10	300408	三环集团	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	30.71	191,800.00	5,890,178.0 0
11	300433	蓝思科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	10.53	396,600.00	4,176,198.0 0
12	300450	先导智能	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	40.25	806,800.00	32,473,700. 00
13	300454	深信服	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	112.5 5	114,100.00	12,841,955. 00
14	300496	中科创达	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	100.3 0	239,300.00	24,001,790. 00
15	300601	康泰生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	31.53	93,400.00	2,944,902.0 0
16	300628	亿联网络	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	60.59	244,100.00	14,790,019. 00
17	300661	圣邦股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	172.6 0	107,200.00	18,502,720. 00
18	300750	宁德时代	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	393.4 2	400,100.00	157,407,342 .00
19	300751	迈为股份	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	411.8 4	50,900.00	20,962,656. 00
20	300759	康龙化成	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	68.00	197,300.00	13,416,400. 00
21	300760	迈瑞医疗	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	315.9 7	64,300.00	20,316,871. 00
22	300763	锦浪科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	180.0 5	114,600.00	20,633,730. 00
23	300769	德方纳米	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	229.5 9	92,500.00	21,237,075. 00
24	300782	卓胜微	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	114.3 0	246,500.00	28,174,950. 00
25	300919	中伟股份	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	65.61	147,000.00	9,644,670.0 0
26	301269	华大九天	2023 年 1 月 10 日 -2023 年 1 月 12 日	90.07	36,400.00	3,278,548.0 0
27	688005	容百科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	68.75	147,500.00	10,140,625. 00
28	688008	澜起科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	62.60	592,800.00	37,109,280. 00
29	688009	中国通号	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	4.79	774,500.00	3,709,855.0 0
30	688012	中微公司	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	98.01	328,600.00	32,206,086. 00

31	688036	传音控股	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	79.52	104,400.00	8,301,888.0 0
32	688065	凯赛生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	61.29	133,300.00	8,169,957.0 0
33	688111	金山办公	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	264.4 9	42,900.00	11,346,621. 00
34	688126	沪硅产业	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	17.61	392,200.00	6,906,642.0 0
35	688169	石头科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	247.7 5	37,200.00	9,216,300.0 0
36	688180	君实生物	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	62.60	283,700.00	17,759,620. 00
37	688187	时代电气	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	54.57	49,400.00	2,695,758.0 0
38	688223	晶科能源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	14.65	991,400.00	14,524,010. 00
39	688303	大全能源	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	47.68	223,300.00	10,646,944. 00
40	688348	昱能科技	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 12 日	568.5 0	15,200.00	8,641,200.0 0
41	688349	三一重能	2023 年 1 月 5 日 -2023 年 1 月 12 日	29.29	98,600.00	2,887,994.0 0
42	688396	华润微	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	52.65	286,800.00	15,100,020. 00
43	688536	思瑞浦	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	275.4 1	16,400.00	4,516,724.0 0
44	688538	和辉光电	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	2.68	2,902,500.0 0	7,778,700.0 0
45	688561	奇安信	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	65.77	114,800.00	7,550,396.0 0
46	688599	天合光能	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	63.76	827,800.00	52,780,528. 00
47	688728	格科微	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	17.54	92,000.00	1,613,680.0 0
48	688772	珠海冠宇	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	18.64	11,300.00	210,632.00
49	688777	中控技术	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	90.83	226,000.00	20,527,580. 00
50	688981	中芯国际	2023 年 1 月 3 日 -2023 年 1 月 13 日	41.14	1,023,600.0 0	42,110,904. 00
合计	-	-	-	-	16,972,300. 00	986,380,368 .00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金属股票基金，预期风险与收益水平高于混合基金、债券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，具有与标的指数相似的风险收益特征。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。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，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金的基金管理人约定申报的借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2021 年 12 月 31 日：0.07%)。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.4 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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	4,929,064.82
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	4,929,064.82

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2022 年 12 月 31 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,761,309.10	-	-	-	15,761,309.10
结算备付金	730,149.08	-	-	-	730,149.08
存出保证金	387,021.07	-	-	-	387,021.07
交易性金融资产	-	-	-	6,145,773,035.20	6,145,773,035.20
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	212,266.84	212,266.84

应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	368,974.71	368,974.71
资产总计	16,878,479.25	-	-	6,146,354,276.75	6,163,232,756.00
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	25,505.28	25,505.28
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,587,328.83	2,587,328.83
应付托管费	-	-	-	517,465.78	517,465.78
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	58,180.99	58,180.99
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,337,816.27	2,337,816.27
负债总计	-	-	-	5,526,297.15	5,526,297.15
利率敏感度缺口	16,878,479.25	-	-	6,140,827,979.60	6,157,706,458.85
上年度末					
2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,167,218.43	-	-	-	33,167,218.43
结算备付金	1,583,193.50	-	-	-	1,583,193.50
存出保证金	1,794,164.31	-	-	-	1,794,164.31
交易性金融资产	-	-	4,928,956.79	6,962,411,512.70	6,967,340,469.49
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-

应收证券清算款	-	-	-	628,955.93	628,955.93
应收利息	-	-	-	292,977.06	292,977.06
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	36,544,576.24	-	4,928,956.79	6,963,333,445.69	7,004,806,978.72
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	918,405.67	918,405.67
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	2,966,480.33	2,966,480.33
应付托管费	-	-	-	593,296.08	593,296.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,168,749.41	1,168,749.41
应交税费	-	-	-	50,183.08	50,183.08
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	6,224,531.51	6,224,531.51
负债总计	-	-	-	11,921,646.08	11,921,646.08
利率敏感度缺口	36,544,576.24	-	4,928,956.79	6,951,411,799.61	6,992,885,332.64

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外

的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 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	6,145,773,035.20	99.81	6,962,411,512.70	99.56
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	6,145,773,035.20	99.81	6,962,411,512.70	99.56

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	307,042,633.67	348,168,821.11
2.业绩比较基准下降 5%	-307,042,633.67	-348,168,821.11	

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	6,142,818,761.68	6,964,153,040.98
第二层次	-	3,187,428.51
第三层次	2,954,273.52	-
合计	6,145,773,035.20	6,967,340,469.49

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	6,127,542.33	6,127,542.33
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,842,980.74	4,842,980.74
当期利得或损失总额	-	1,669,711.93	1,669,711.93
其中：计入损益的利得或损失	-	1,669,711.93	1,669,711.93
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	2,954,273.52	2,954,273.52
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	878,082.20	878,082.20
项目	上年度可比期间		

	2021 年 6 月 28 日（基金合同生效日）至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流动性折扣估值处于限售期的股票投资	2,954,273.52	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2063—2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	6,145,773,035.20	99.72
	其中：股票	6,145,773,035.20	99.72
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	16,491,458.18	0.27
8	其他各项资产	968,262.62	0.02
9	合计	6,163,232,756.00	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 986,380,368.00 元，占净值比例 16.02%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	5,324,291,569.07	86.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	552,199,951.18	8.97
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	269,136,568.05	4.37
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,663.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,145,773,035.20	99.81

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	1,593,493	626,912,016.06	10.18
2	300760	迈瑞医疗	1,472,738	465,341,025.86	7.56
3	300124	汇川技术	5,650,441	392,705,649.50	6.38
4	300274	阳光电源	3,156,902	352,941,643.60	5.73
5	300014	亿纬锂能	3,720,040	326,991,516.00	5.31
6	688981	中芯国际	5,943,259	244,505,675.26	3.97
7	300122	智飞生物	2,429,194	213,356,109.02	3.46
8	688599	天合光能	3,293,349	209,983,932.24	3.41
9	300142	沃森生物	4,862,742	195,433,600.98	3.17
10	300347	泰格医药	1,592,519	166,895,991.20	2.71
11	688008	澜起科技	2,408,525	150,773,665.00	2.45
12	688111	金山办公	560,042	148,125,508.58	2.41
13	300450	先导智能	3,329,559	134,014,749.75	2.18
14	300661	圣邦股份	757,188	130,690,648.80	2.12
15	688012	中微公司	1,309,759	128,369,479.59	2.08
16	300316	晶盛机电	1,986,764	126,278,719.84	2.05
17	300408	三环集团	4,073,379	125,093,469.09	2.03
18	300782	卓胜微	972,445	111,150,463.50	1.81
19	300751	迈为股份	262,388	108,061,873.92	1.75
20	300763	锦浪科技	572,250	103,033,612.50	1.67

21	300759	康龙化成	1,503,344	102,227,392.00	1.66
22	300496	中科创达	972,220	97,513,666.00	1.58
23	688777	中控技术	1,056,032	95,919,386.56	1.56
24	300454	深信服	757,382	85,243,344.10	1.38
25	300769	德方纳米	369,386	84,807,331.74	1.38
26	688396	华润微	1,603,220	84,409,533.00	1.37
27	300207	欣旺达	3,959,359	83,740,442.85	1.36
28	688036	传音控股	977,577	77,736,923.04	1.26
29	688180	君实生物	1,159,427	72,580,130.20	1.18
30	300628	亿联网络	1,095,242	66,360,712.78	1.08
31	300601	康泰生物	2,041,179	64,358,373.87	1.05
32	300433	蓝思科技	6,042,344	63,625,882.32	1.03
33	688223	晶科能源	4,255,306	62,340,232.90	1.01
34	688126	沪硅产业	3,319,767	58,461,096.87	0.95
35	688005	容百科技	821,605	56,485,343.75	0.92
36	688561	奇安信	828,615	54,498,008.55	0.89
37	300223	北京君正	731,280	51,511,363.20	0.84
38	688536	思瑞浦	181,844	50,081,656.04	0.81
39	688303	大全能源	908,469	43,315,801.92	0.70
40	688187	时代电气	791,638	43,199,685.66	0.70
41	688169	石头科技	170,885	42,336,758.75	0.69
42	688348	昱能科技	72,960	41,477,760.00	0.67
43	300919	中伟股份	610,704	40,068,289.44	0.65
44	688009	中国通号	7,851,436	37,608,378.44	0.61
45	688538	和辉光电	12,658,699	33,925,313.32	0.55
46	688065	凯赛生物	531,146	32,553,938.34	0.53
47	301269	华大九天	230,468	20,755,764.92	0.34
48	688728	格科微	913,493	16,022,667.22	0.26
49	688349	三一重能	433,121	12,686,114.09	0.21
50	688772	珠海冠宇	340,242	6,342,110.88	0.10
51	688271	联影医疗	7,365	1,264,423.20	0.02
52	688439	振华风光	7,096	815,046.56	0.01
53	688147	微导纳米	6,293	150,465.63	0.00
54	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
55	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
56	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
57	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
58	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
59	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
60	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
61	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
62	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
63	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
64	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00

65	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
66	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
67	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
68	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
69	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
70	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
71	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
72	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
73	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
74	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
75	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
76	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
77	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
78	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
79	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
80	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
81	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
82	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
83	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
84	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
85	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
86	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
87	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
88	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
89	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
90	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
91	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
92	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
93	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
94	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	247,832,040.99	3.54
2	300750	宁德时代	209,163,626.82	2.99
3	688599	天合光能	204,544,199.68	2.93
4	688012	中微公司	162,530,627.90	2.32
5	688008	澜起科技	154,035,620.85	2.20

6	300751	迈为股份	123,952,556.28	1.77
7	688111	金山办公	121,271,592.23	1.73
8	688005	容百科技	119,992,836.58	1.72
9	300769	德方纳米	111,374,556.69	1.59
10	688396	华润微	102,589,213.63	1.47
11	688777	中控技术	99,949,463.14	1.43
12	300763	锦浪科技	98,460,360.09	1.41
13	688223	晶科能源	89,863,258.43	1.29
14	688036	传音控股	83,335,252.45	1.19
15	688126	沪硅产业	78,282,022.60	1.12
16	300223	北京君正	78,207,397.61	1.12
17	688180	君实生物	73,959,689.14	1.06
18	688187	时代电气	72,452,075.61	1.04
19	689009	九号公司	64,350,191.21	0.92
20	300919	中伟股份	62,120,284.80	0.89

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

8.4.2 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	688981	中芯国际	222,816,098.43	3.19
2	688599	天合光能	147,436,989.78	2.11
3	300896	爱美客	138,963,992.71	1.99
4	688111	金山办公	112,539,520.25	1.61
5	300003	乐普医疗	99,429,758.57	1.42
6	688012	中微公司	90,550,768.90	1.29
7	300760	迈瑞医疗	80,766,671.48	1.15
8	688008	澜起科技	74,492,642.52	1.07
9	300750	宁德时代	73,547,808.00	1.05
10	300033	同花顺	71,839,114.70	1.03
11	688180	君实生物	69,163,736.43	0.99
12	300595	欧普康视	63,895,458.35	0.91
13	688521	芯原股份	61,959,514.94	0.89
14	300124	汇川技术	59,213,395.31	0.85
15	688363	华熙生物	56,256,008.50	0.80
16	300274	阳光电源	55,155,629.38	0.79
17	688256	寒武纪	54,687,389.25	0.78
18	688036	传音控股	52,607,531.30	0.75
19	688396	华润微	51,960,903.35	0.74
20	300676	华大基因	51,709,787.81	0.74

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

8.4.3 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	3,292,236,016.91
卖出股票收入（成交）总额	2,707,469,561.56

注：“买入股票成本”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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	387,021.07
2	应收清算款	212,266.84
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	368,974.71
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	968,262.62

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	300750	宁德时代	157,407,342.00	2.56	转融通流通受限
2	300274	阳光电源	58,940,960.00	0.96	转融通流通受限
3	688599	天合光能	52,780,528.00	0.86	转融通流通受限
4	688981	中芯国际	42,110,904.00	0.68	转融通流通受限
5	300347	泰格医药	40,033,600.00	0.65	转融通流通受限
6	300124	汇川技术	32,393,950.00	0.53	转融通流通受限
7	300122	智飞生物	26,673,971.00	0.43	转融通流通受限
8	300760	迈瑞医疗	20,316,871.00	0.33	转融通流通受限
9	300142	沃森生物	20,239,684.00	0.33	转融通流通受限
10	300014	亿纬锂能	13,255,320.00	0.22	转融通流通受限

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	中国工商银行股份有

	额					限公司—易方达中证 科创创业 50 交易型开 放式指数证券投资基 金联接基金	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份额 比例
136,048	75,273.88	3,334,918,8 12.00	32.56%	6,905,941,7 21.00	67.44%	2,406,630, 766.00	23.50%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“中国工商银行股份有限公司—易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	122,950,700.00	1.20%
2	创金合信基金—华夏银行—创金合信华睿 3 号集合资产管理计划	72,049,093.00	0.70%
3	浙江锦田投资管理有限公司—锦田旭日一号私募证券投资基金	64,331,100.00	0.63%
4	信泰人寿保险股份有限公司—传统产品	60,618,398.00	0.59%
5	四川省诚卓投资有限公司	44,112,200.00	0.43%
6	浙江锦田投资管理有限公司—锦田东升一号私募证券投资基金	36,385,300.00	0.36%
7	肖朝华	30,065,647.00	0.29%
8	程绍红	26,026,000.00	0.25%
9	华泰证券股份有限公司	24,060,976.00	0.23%
10	毛淑洁	20,100,000.00	0.20%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,406,630,766.00	23.50%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

本基金		
-----	--	--

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年6月28日)基金份额总额	3,004,860,533.00
本报告期期初基金份额总额	8,350,860,533.00
本报告期基金总申购份额	8,172,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,282,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,240,860,533.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2022 年 4 月 21 日发布公告，自 2022 年 4 月 21 日起聘任刘世军先生为副总经理级高级管理人员（首席数据与风险监测官）；本基金管理人于 2022 年 5 月 13 日发布公告，自 2022 年 5 月 11 日起张南女士不再担任督察长和信息披露负责人，公司聘任其为副总经理级高级管理人员；自 2022 年 5 月 11 日起聘任王玉女士为督察长，并担任信息披露负责人。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金自基金合同生效以来连续 2 年聘请安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）提供审计服务，本报告年度的审计费用为 57,000.00 元。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	2,372,574,579.70	39.76%	474,521.93	27.29%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	7,464.00	0.00%	4.48	0.00%	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	493,801,744.21	8.28%	98,761.46	5.68%	-
恒泰证券	1	58,535,292.68	0.98%	29,269.17	1.68%	-
华创证券	1	1,376,868,702.73	23.08%	275,377.15	15.84%	-
华泰证券	2	193,186,318.11	3.24%	38,638.50	2.22%	-
华西证券	1	572,664,841.09	9.60%	286,337.30	16.47%	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	36,231,995.97	0.61%	18,116.73	1.04%	-
申万宏源	2	862,700,550.98	14.46%	517,620.71	29.77%	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元,新增交易单元的证券公司为西南证券股份有限公司。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；

3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平,包括但不限于:有较好的研究能力和行业分析能力,能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息服务;能根据公司所管理基金的特定要求,提供专门研究报告,具有开发量化投资组合模型的能力;能积极为公司投资业务的开展,投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下:

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	1,067,778.00	8.86%	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	10,981,819.90	91.14%	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-01-01
2	易方达基金管理有限公司关于公司住所变更	证券时报、基金管理人	2022-01-07

	的公告	网站及中国证监会基金 电子披露网站	
3	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 开源证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-01-12
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告提示性公告	证券时报	2022-01-21
5	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购 江阴标榜汽车部件股份有限公司首次公开发 行股票的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-02-12
6	易方达基金管理有限公司旗下基金 2021 年 年度报告提示性公告	证券时报	2022-03-30
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 华安证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-04-08
8	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及 时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-04-11
9	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更 公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-04-21
10	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年 第 1 季度报告提示性公告	证券时报	2022-04-22
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 平安证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-05-10
12	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更 公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-05-13
13	易方达基金管理有限公司关于子公司住所变 更的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-05-14
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 金元证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-05-25
15	易方达基金管理有限公司关于旗下基金申购 昆山亚香香料股份有限公司首次公开发 行股票的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-06-16
16	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 华宝证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-06-21
17	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加 财达证券为申购赎回代办证券公司的公告	证券时报、基金管理人 网站及中国证监会基金 电子披露网站	2022-06-28

18	关于警惕冒用易方达基金管理有限公司名义进行诈骗活动的特别提示公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-07-07
19	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 2 季度报告提示性公告	证券时报	2022-07-20
20	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华金证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-08-22
21	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年中期报告提示性公告	证券时报	2022-08-30
22	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-09-21
23	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 3 季度报告提示性公告	证券时报	2022-10-26
24	易方达基金管理有限公司关于易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-09
25	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-16
26	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-23
27	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加国金证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2022-12-23

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
中国工商银行股份有限公司—易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2022 年 01 月 01 日~2022 年 02 月 13 日,2022 年 02 月 15 日~2022 年 04 月 25 日,2022 年 05 月 10 日~2022 年 12 月 31 日	1,944,007,733.00	692,599,994.00	229,976,961.00	2,406,630,766.00	23.50%

产品特有风险

报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：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；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；若个别投资者大额赎回后本基金出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，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；持有基金份额占比较高的投资者在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

§ 13备查文件目录**13.1 备查文件目录**

- 1.中国证监会准予易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证科创创业 50 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

13.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年三月三十日