

# 广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资 基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 25 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>2 基金简介</b>	<b>5</b>
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	<b>8</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	12
<b>5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	<b>77</b>
7.1 期末基金资产组合情况	77
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	78
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	78
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	81
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	81
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	82
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	82
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	82
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	82
7.12 投资组合报告附注	82

<b>8 基金份额持有人信息</b> .....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	84
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	84
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	85
<b>9 开放式基金份额变动</b> .....	85
<b>10 重大事件揭示</b> .....	85
10.1 基金份额持有人大会决议.....	85
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	85
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
10.4 基金投资策略的改变.....	85
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
10.8 其他重大事件.....	90
<b>11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	90
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	90
<b>12 备查文件目录</b> .....	91
12.1 备查文件目录.....	91
12.2 存放地点.....	91
12.3 查阅方式.....	91

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发国证半导体芯片 ETF
场内简称	芯片 ETF 龙头
基金主代码	159801
交易代码	159801
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
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	2,357,560,086.00 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	2020-02-18

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。本基金投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90% 且不低于非现金基金资产的 80%。
业绩比较基准	国证半导体芯片指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	程才良	郭明
	联系电话	020-83936666	010-66105799
	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		95105828	95588

传真	020-89899158	010-66105798
注册地址	广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址	广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码	510308	100140
法定代表人	孙树明	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	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

## 2.5 其他相关资料

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

## 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	-81,020,157.74
本期利润	173,231,145.74
加权平均基金份额本期利润	0.0766
本期加权平均净值利润率	7.06%
本期基金份额净值增长率	5.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	100,711,328.90
期末可供分配基金份额利润	0.0427
期末基金资产净值	2,458,271,414.90
期末基金份额净值	1.0427

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	4.27%

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

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

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

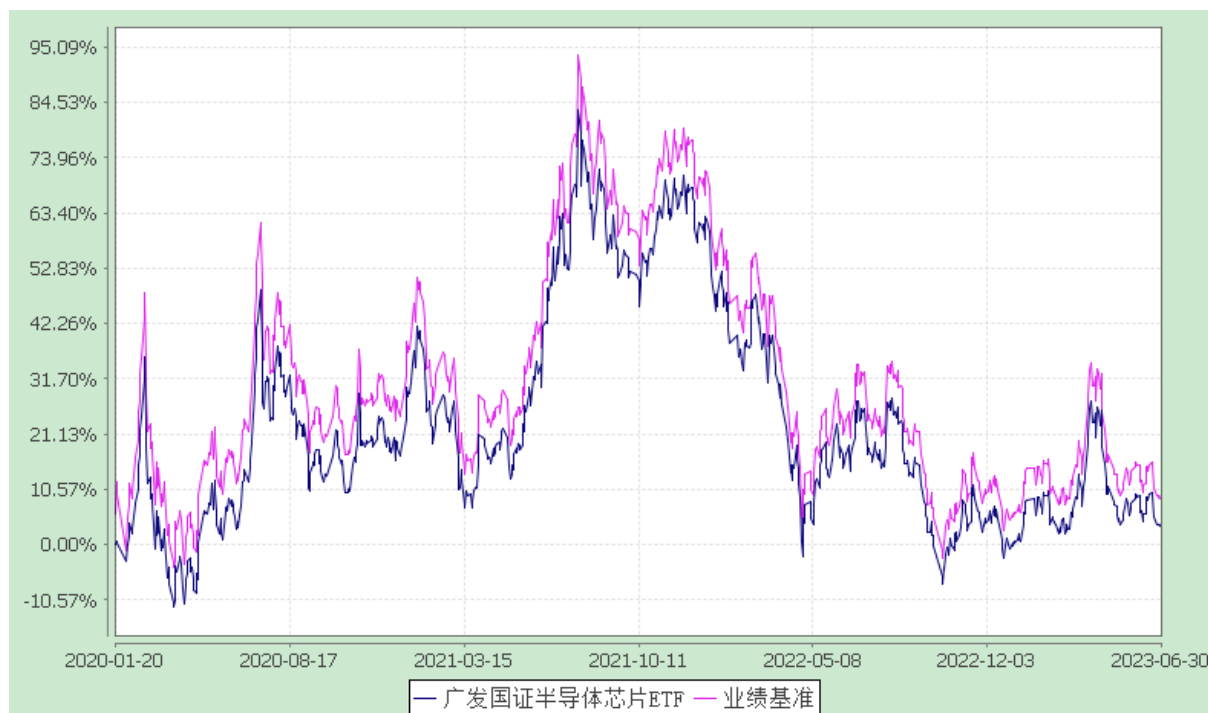
### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-4.90%	1.50%	-5.13%	1.51%	0.23%	-0.01%
过去三个月	-8.14%	1.97%	-8.51%	1.99%	0.37%	-0.02%
过去六个月	5.10%	1.81%	4.90%	1.83%	0.20%	-0.02%
过去一年	-18.10%	1.81%	-18.36%	1.82%	0.26%	-0.01%
过去三年	-9.12%	2.13%	-11.97%	2.15%	2.85%	-0.02%
自基金合同生效起至今	4.27%	2.28%	9.72%	2.35%	-5.45%	-0.07%

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

广发国证半导体芯片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  
 （2020年1月20日至2023年6月30日）



#### 4 管理人报告

##### 4.1 基金管理人及基金经理情况

###### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

###### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
罗国庆	本基金的基金经理；广发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广	2020-01-20	-	14年	罗国庆先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任深圳证券信息有限公司研究员，华富基金管理有限公司产品设计研究员，广发基金管理有限公司产品经理及量化研究员、广发深证100



	<p>发中证传媒交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证 100 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证创新药产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发国证新能源车电池交易型开放式指数</p>				<p>指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 5 月 25 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 10 月 13 日至 2020 年 8 月 25 日)、广发中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2020 年 4 月 13 日至 2020 年 11 月 30 日)、广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 7 月 31 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 8 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2017 年 9 月 13 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2018 年 11 月 2 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发深证 100 指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 5 月 26 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证医疗指数证券投资基金(LOF)基金经理(自 2020 年 8 月 26 日至 2023 年 2 月 22 日)。</p>
--	---	--	--	--	--

	证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证国新央企股东回报交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；指数投资部副总经理				
--	--	--	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

在投资决策的内部控制方面，公司建立了严格的投资备选库制度及投资授权制度，投资组合的

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 34 次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，有关投资经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的是国证半导体芯片指数，该指数从芯片产业的材料、设备、设计、制造、封装和测试等 A 股上市公司中选取样本股，综合反映 A 股市场芯片产业相关上市公司的市场表现。作为 ETF 基金，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制方法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

在宏观预期不确定性的扰动下，叠加国内经济修复低于预期以及美国终端利率预期不断上修的背景，2023 年上半年 A 股主要指数整体呈先强后弱的走势。其中，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，创业板指数下跌 5.61%，国证半导体芯片指数上涨 4.9%。从自下而上的角度，AI 技术加速迭代引领新一轮科技产业周期，在新订单、新应用的催化下，通信、计算机、传媒、芯片等 TMT 板块领涨。

基金投资运作方面，报告期内，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，运作过程中未发生任何风险事件。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 5.10%，同期业绩比较基准收益率为 4.90%。

#### 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 年下半年，在美国通胀快速回落以及加息周期临近见顶的背景下，外资作为边际增量资金进场，有望带动市场情绪企稳和指数上涨。从行业层面来看，下半年随着通信、计算和数据存储市场的复苏以及汽车电子的进一步增长，可以关注销售周期反转在即的半导体产业链的投资机会。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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——广发基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对广发基金管理有限公司编制和披露的本基金 2023 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	14,723,393.37	7,295,251.43
结算备付金		2,334,153.18	404,882.80
存出保证金		782,832.99	292,743.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,447,618,911.29	1,911,694,904.95
其中：股票投资		2,447,618,911.29	1,911,694,904.95

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		36,828,245.48	3,275,838.87
应收股利		19,013.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	185,324.39	142,575.50
资产总计		2,502,491,874.50	1,923,106,196.74
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		32,215,862.94	2,910,043.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		982,912.21	821,788.75
应付托管费		196,582.42	164,357.72
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,554.65	15,221.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	10,802,547.38	1,405,420.01
负债合计		44,220,459.60	5,316,831.64
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.8	2,357,560,086.00	1,933,060,086.00
未分配利润	6.4.7.9	100,711,328.90	-15,270,720.90
净资产合计		2,458,271,414.90	1,917,789,365.10
负债和净资产总计		2,502,491,874.50	1,923,106,196.74

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 1.0427 元，基金份额总额 2,357,560,086.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>181,074,868.28</b>	<b>-418,261,064.94</b>
1.利息收入		4,131,532.83	581,556.66
其中：存款利息收入	6.4.7.10	63,287.44	35,989.59
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		4,068,245.39	545,567.07
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-80,101,125.52	-146,692,075.94
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-84,361,250.75	-150,369,798.25
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,260,125.23	3,677,722.31
以摊余成本计量的金融资产 终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号 填列）	6.4.7.18	254,251,303.48	-274,064,648.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	2,793,157.49	1,914,103.08
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>7,843,722.54</b>	<b>5,575,609.14</b>
1. 管理人报酬		6,069,923.38	4,279,953.98
2. 托管费		1,213,984.67	855,990.78
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		14,646.01	1,964.11
8. 其他费用	6.4.7.21	545,168.48	437,700.27
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填</b>		<b>173,231,145.74</b>	<b>-423,836,674.08</b>

列)			
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>173,231,145.74</b>	<b>-423,836,674.08</b>
五、其他综合收益的税后净额		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>173,231,145.74</b>	<b>-423,836,674.08</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,933,060,086.00	-15,270,720.90	1,917,789,365.10
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,933,060,086.00	-15,270,720.90	1,917,789,365.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	424,500,000.00	115,982,049.80	540,482,049.80
（一）、综合收益总额	-	173,231,145.74	173,231,145.74
（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）	424,500,000.00	-57,249,095.94	367,250,904.06
其中：1. 基金申购款	1,614,000,000.00	109,439,135.24	1,723,439,135.24
2. 基金赎回款	-1,189,500,000.00	-166,688,231.18	-1,356,188,231.18
（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）	2,357,560,086.00	100,711,328.90	2,458,271,414.90



项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,205,560,086.00	750,394,861.31	1,955,954,947.31
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,205,560,086.00	750,394,861.31	1,955,954,947.31
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	292,500,000.00	-341,290,560.66	-48,790,560.66
（一）、综合收益总额	-	-423,836,674.08	-423,836,674.08
（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）	292,500,000.00	82,546,113.42	375,046,113.42
其中：1.基金申购款	607,500,000.00	156,392,705.86	763,892,705.86
2.基金赎回款	-315,000,000.00	-73,846,592.44	-388,846,592.44
（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）	1,498,060,086.00	409,104,300.65	1,907,164,386.65

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2019]2881 号《关于准予广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公

开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2020 年 1 月 6 日向社会公开发行人募集并于 2020 年 1 月 20 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2020 年 1 月 6 日至 2020 年 1 月 14 日，为交易型开放式基金，存续期限不定，募集金额总额为人民币 2,524,060,086.00 元，有效认购户数为 39,065 户。其中，认购资金在募集期间的利息为人民币 137,056.00 元，折合基金份额 137,056.00 份。认购资金在募集期间产生的利息按照基金合同的有关约定计入基金份额持有人的基金账户。本基金募集金额经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年上半年度的经营成果和基金净值变动情况。

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1%，由出让方缴纳。

##### (2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2017]90 号文《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息

及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

### （3）企业所得税

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

### （4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

### （5）境外投资

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	14,723,393.37
等于：本金	14,721,977.48
加：应计利息	1,415.89
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	14,723,393.37

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,699,036,268.17	-	2,447,618,911.29	-251,417,356.88
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	2,699,036,268.17	-	2,447,618,911.29	-251,417,356.88

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	109,708.15
待摊费用	75,616.24
合计	185,324.39

#### 6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	529,375.38
其中：交易所市场	529,375.38
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	106,120.30
应付指数使用费	181,576.44
应付替代款	9,950,544.06
可退替代款	34,931.20
合计	10,802,547.38

#### 6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,933,060,086.00	1,933,060,086.00
本期申购	1,614,000,000.00	1,614,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,189,500,000.00	-1,189,500,000.00
本期末	2,357,560,086.00	2,357,560,086.00

#### 6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,042,108,815.65	-1,057,379,536.55	-15,270,720.90
本期利润	-81,020,157.74	254,251,303.48	173,231,145.74
本期基金份额交易产生的	229,545,259.64	-286,794,355.58	-57,249,095.94

变动数			
其中：基金申购款	849,495,218.19	-740,056,082.95	109,439,135.24
基金赎回款	-619,949,958.55	453,261,727.37	-166,688,231.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,190,633,917.55	-1,089,922,588.65	100,711,328.90

#### 6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	36,604.07
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	22,560.58
其他	4,122.79
合计	63,287.44

#### 6.4.7.11 股票投资收益

##### 6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-69,930,973.15
股票投资收益——赎回差价收入	-14,430,277.60
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	-84,361,250.75

##### 6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	1,108,137,635.44
减：卖出股票成本总额	1,175,995,350.12
减：交易费用	2,073,258.47
买卖股票差价收入	-69,930,973.15

##### 6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	1,356,188,231.18
减：现金支付赎回款总额	889,250,862.18
减：赎回股票成本总额	481,367,646.60

减：交易费用	-
赎回差价收入	-14,430,277.60

#### 6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

#### 6.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

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

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

#### 6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

#### 6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,260,125.23
其中：证券出借权益补偿收入	687,316.02
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,260,125.23

#### 6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	254,251,303.48
——股票投资	254,251,303.48
——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	254,251,303.48

#### 6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	2,793,157.49
合计	2,793,157.49

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

#### 6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	36,695.94
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	469.00
指数使用费	364,195.42
其他	84,300.75
合计	545,168.48

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国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	基金管理人控股股东、申购赎回代办证券公司
广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

#### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	2,180,568,164.85	88.45%	771,940,320.41	60.64%

##### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

##### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
广发证券股份有限公司	504,369.04	65.68%	269,975.58	51.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
广发证券股份有限公司	178,552.36	27.69%	121,149.77	21.28%

注：1、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；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,069,923.38	4,279,953.98
其中：支付销售机构的客户维护费	19,764.08	16,079.22

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,213,984.67	855,990.78

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，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 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

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

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

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	266,094,468.00	178,156.53	-	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	108,960,112.00	121,741.04	7,110,500.00	3,355.42

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30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
广发证券股份有限公司	2023010300032411	晶晨股份	2023-01-03	178,750.00	2,500.00	14	3.20	222.44	-	-
广发证券股份有限公司	2023010300032509	澜起科技	2023-01-03	625,900.00	10,000.00	14	3.20	778.90	-	-
广发证券股份有限公司	2023010300034333	晶晨股份	2023-01-03	164,450.00	2,300.00	14	3.20	204.65	-	-
广发证券股份有限公司	20230103	晶盛机电	2023-01-03	639,900.00	10,000.00	14	3.20	796.32	-	-

有限公司	0003 4389									
广发证 券股份 有限公司	2023 0103 0003 4469	卓胜微	2023- 01-03	603,1 93.00	5,300.00	14	3.2 0	750.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0105 0000 1454	格科微	2023- 01-05	18,01 0.00	1,000.00	14	3.2 0	22.41	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0105 0001 7217	圣邦股 份	2023- 01-05	571,7 10.00	3,400.00	14	3.2 0	711.4 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0109 0000 2053	晶晨股 份	2023- 01-09	302,2 80.00	4,400.00	14	3.2 0	564.2 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0109 0000 2058	格科微	2023- 01-09	18,25 0.00	1,000.00	14	3.2 0	34.07	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0109 0003 4750	澜起科 技	2023- 01-09	638,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	1,191 .87	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0110 0000 1654	晶晨股 份	2023- 01-10	69,78 0.00	1,000.00	14	3.2 0	124.0 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0110 0000 1657	格科微	2023- 01-10	18,36 0.00	1,000.00	14	3.2 0	32.64	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0110 0001 7881	澜起科 技	2023- 01-10	634,6 00.00	10,000.00	14	3.2 0	1,128 .18	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0111 0000 1076	格科微	2023- 01-11	17,88 0.00	1,000.00	14	3.2 0	30.20	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0111 0000	卓胜微	2023- 01-11	4,279 ,898. 00	34,700.00	14	3.2 0	7,228 .27	-	-

司	1080									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0112 0001 4189	中微公 司	2023- 01-12	14,25 2,300 .00	143,600.0 0	14	3.2 0	22,80 3.68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0116 0000 1014	卓胜微	2023- 01-16	296,0 32.00	2,200.00	14	3.2 0	368.4 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0117 0002 3623	晶盛机 电	2023- 01-17	670,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	833.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0117 0002 7923	澜起科 技	2023- 01-17	621,4 00.00	10,000.00	14	3.2 0	773.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0118 0000 0488	卓胜微	2023- 01-18	480,0 24.00	3,600.00	14	3.2 0	597.3 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0119 0000 1050	中微公 司	2023- 01-19	3,365 ,937. 00	30,900.00	14	3.2 0	4,188 .72	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0119 0000 1067	沪硅产 业	2023- 01-19	9,241 ,020. 00	490,500.0 0	14	3.2 0	11,49 9.94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0119 0001 4962	圣邦股 份	2023- 01-19	636,4 80.00	3,400.00	14	3.2 0	792.0 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0120 0000 0446	中微公 司	2023- 01-20	877,6 35.00	8,100.00	14	3.2 0	1,092 .17	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0120 0000 0450	晶晨股 份	2023- 01-20	8,039 ,600. 00	99,500.00	14	3.2 0	10,00 4.84	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0007 4251	卓胜微	2023- 01-30	310,9 70.00	2,200.00	14	3.2 0	386.9 8	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0007 4555	格科微	2023- 01-30	19,51 0.00	1,000.00	14	3.2 0	24.28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0007 5409	格科微	2023- 01-30	19,51 0.00	1,000.00	14	3.2 0	24.28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0007 6413	格科微	2023- 01-30	19,51 0.00	1,000.00	14	3.2 0	24.28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0008 4317	澜起科 技	2023- 01-30	598,4 00.00	10,000.00	14	3.2 0	744.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0008 4381	晶晨股 份	2023- 01-30	353,2 32.00	4,400.00	14	3.2 0	439.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0008 9891	晶晨股 份	2023- 01-30	80,28 0.00	1,000.00	14	3.2 0	99.90	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0130 0009 3471	澜起科 技	2023- 01-30	598,4 00.00	10,000.00	14	3.2 0	744.6 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0131 0000 3014	格科微	2023- 01-31	35,81 5.00	1,900.00	14	3.2 0	44.57	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0131 0000 3031	沪硅产 业	2023- 01-31	2,887 ,704. 00	138,300.0 0	14	3.2 0	3,593 .59	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0131 0000 3036	中微公 司	2023- 01-31	6,157 ,043. 00	58,700.00	14	3.2 0	7,662 .10	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0131 0002 4677	澜起科 技	2023- 01-31	554,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	689.5 5	-	-
广发证	2023	卓胜微	2023-	742,2	5,500.00	14	3.2	923.6	-	-

券股份 有限公司	0201 0000 1194		02-01	25.00			0	6		
广发证 券股份 有限公司	2023 0201 0002 0656	卓胜微	2023- 02-01	485,8 20.00	3,600.00	14	3.2 0	604.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0000 0901	中微公 司	2023- 02-02	2,113 ,242. 00	19,400.00	14	3.2 0	2,629 .81	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0000 0909	晶晨股 份	2023- 02-02	1,268 ,820. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,578 .98	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0001 3031	中微公 司	2023- 02-02	3,365 ,937. 00	30,900.00	14	3.2 0	4,188 .72	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0001 3229	沪硅产 业	2023- 02-02	10,24 1,640 .00	490,500.0 0	14	3.2 0	12,74 5.15	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0001 6787	圣邦股 份	2023- 02-02	619,1 06.00	3,400.00	14	3.2 0	770.4 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0203 0000 1010	晶晨股 份	2023- 02-03	242,7 90.00	3,000.00	14	3.2 0	302.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0203 0000 9886	中微公 司	2023- 02-03	876,4 20.00	8,100.00	14	3.2 0	1,090 .66	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0203 0000 9890	晶晨股 份	2023- 02-03	8,052 ,535. 00	99,500.00	14	3.2 0	10,02 0.93	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0208 0000 0613	景嘉微	2023- 02-08	716,4 56.00	10,400.00	14	3.2 0	891.5 9	-	-
广发证 券股份	2023 0213	澜起科 技	2023- 02-13	628,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	782.1 3	-	-



有限公司	0007 1930									
广发证 券股份 有限公司	2023 0213 0007 7644	澜起科 技	2023- 02-13	628,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	782.1 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0214 0002 1547	格科微	2023- 02-14	36,30 9.00	1,900.00	14	3.2 0	45.18	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0214 0002 1595	澜起科 技	2023- 02-14	628,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	781.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0215 0000 1088	晶晨股 份	2023- 02-15	85,27 0.00	1,000.00	14	3.2 0	106.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0215 0000 1142	卓胜微	2023- 02-15	131,5 40.00	1,000.00	14	3.2 0	163.6 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0215 0001 9058	卓胜微	2023- 02-15	723,4 70.00	5,500.00	14	3.2 0	900.3 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0216 0001 2945	晶晨股 份	2023- 02-16	1,319 ,700. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,642 .29	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0000 1438	北京君 正	2023- 02-17	1,214 ,395. 00	15,700.00	14	3.2 0	1,511 .25	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0001 8736	晶晨股 份	2023- 02-17	8,241 ,585. 00	99,500.00	14	3.2 0	10,25 6.19	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0222 0000 0796	晶晨股 份	2023- 02-22	118,6 64.00	1,400.00	14	3.2 0	147.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0222 0000	景嘉微	2023- 02-22	773,2 40.00	10,400.00	14	3.2 0	962.2 5	-	-

司	5138									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0227 0000 0786	景嘉微	2023- 02-27	850,4 93.00	11,900.00	14	3.2 0	1,058 .39	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0227 0006 0176	澜起科 技	2023- 02-27	580,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	721.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0227 0006 0204	澜起科 技	2023- 02-27	580,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	721.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0228 0000 1096	景嘉微	2023- 02-28	708,1 48.00	9,800.00	14	3.2 0	881.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0228 0002 6092	格科微	2023- 02-28	32,68 0.00	1,900.00	14	3.2 0	40.67	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0228 0002 7126	澜起科 技	2023- 02-28	577,7 00.00	10,000.00	14	3.2 0	718.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0302 0001 1509	晶晨股 份	2023- 03-02	1,225 ,095. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,524 .56	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0303 0000 9607	晶晨股 份	2023- 03-03	7,621 ,700. 00	99,500.00	14	3.2 0	9,484 .78	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0306 0000 0749	圣邦股 份	2023- 03-06	172,9 75.00	1,100.00	14	3.2 0	215.2 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0307 0000 1691	圣邦股 份	2023- 03-07	198,7 70.00	1,300.00	14	3.2 0	247.3 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0307 0000 1751	中微公 司	2023- 03-07	977,8 50.00	8,200.00	14	3.2 0	1,216 .88	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0308 0000 6974	景嘉微	2023- 03-08	776,9 84.00	10,400.00	14	3.2 0	966.9 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0308 0000 6984	晶晨股 份	2023- 03-08	103,7 40.00	1,400.00	14	3.2 0	129.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0309 0000 1082	圣邦股 份	2023- 03-09	4,037 ,810. 00	25,900.00	14	3.2 0	5,024 .83	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0310 0000 0990	卓胜微	2023- 03-10	661,4 28.00	5,700.00	14	3.2 0	823.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0000 1235	沪硅产 业	2023- 03-13	206,8 80.00	9,600.00	14	3.2 0	257.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0005 1298	澜起科 技	2023- 03-13	555,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	690.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0005 1434	景嘉微	2023- 03-13	907,0 18.00	11,900.00	14	3.2 0	1,128 .73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0005 3626	澜起科 技	2023- 03-13	555,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	690.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0314 0000 1334	沪硅产 业	2023- 03-14	823,4 04.00	35,400.00	14	3.2 0	1,024 .68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0314 0002 1856	景嘉微	2023- 03-14	758,3 24.00	9,800.00	14	3.2 0	943.6 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0314 0002 3268	澜起科 技	2023- 03-14	559,9 00.00	10,000.00	7	3.2 0	348.3 8	-	-
广发证	2023	卓胜微	2023-	1,084	8,600.00	14	3.2	1,349	-	-

券股份 有限公司	0316 0000 0837		03-16	,116. 00			0	.12		
广发证 券股份 有限公司	2023 0316 0000 0847	沪硅产 业	2023- 03-16	747,5 22.00	32,700.00	14	3.2 0	930.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0316 0001 2280	晶晨股 份	2023- 03-16	1,175 ,646. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,463 .03	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0317 0001 1153	晶晨股 份	2023- 03-17	7,456 ,530. 00	99,500.00	14	3.2 0	9,279 .24	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0321 0000 0866	中芯国 际	2023- 03-21	646,1 64.00	12,400.00	14	3.2 0	804.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0322 0000 8075	景嘉微	2023- 03-22	876,3 04.00	10,400.00	14	3.2 0	1,168 .41	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0323 0000 1226	北京君 正	2023- 03-23	85,36 0.00	1,000.00	14	3.2 0	106.2 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0323 0000 5846	圣邦股 份	2023- 03-23	4,069 ,926. 00	25,900.00	14	3.2 0	5,064 .80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0324 0000 0573	北京君 正	2023- 03-24	7,022 ,346. 00	82,200.00	14	3.2 0	8,738 .92	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0324 0000 5619	卓胜微	2023- 03-24	698,6 49.00	5,700.00	14	3.2 0	869.4 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0327 0005 7075	澜起科 技	2023- 03-27	685,9 00.00	10,000.00	14	3.2 0	853.5 6	-	-
广发证 券股份	2023 0327	沪硅产 业	2023- 03-27	216,0 96.00	9,600.00	14	3.2 0	268.9 2	-	-

有限公司	00058939									
广发证券股份有限公司	2023032700060363	澜起科技	2023-03-27	685,900.00	10,000.00	14	3.20	853.56	-	-
广发证券股份有限公司	2023032700064311	景嘉微	2023-03-27	1,416,100.00	11,900.00	14	3.20	1,762.26	-	-
广发证券股份有限公司	2023032800019541	沪硅产业	2023-03-28	781,986.00	35,400.00	14	3.20	973.14	-	-
广发证券股份有限公司	2023033000012133	沪硅产业	2023-03-30	748,176.00	32,700.00	14	3.20	931.06	-	-
广发证券股份有限公司	2023033000014769	晶晨股份	2023-03-30	1,357,860.00	15,900.00	14	3.20	1,689.78	-	-
广发证券股份有限公司	2023033000016637	卓胜微	2023-03-30	1,058,488.00	8,600.00	14	3.20	1,317.23	-	-
广发证券股份有限公司	2023033100010009	晶晨股份	2023-03-31	8,369,940.00	99,500.00	14	3.20	10,415.93	-	-
广发证券股份有限公司	2023040400001636	中微公司	2023-04-04	1,027,960.00	6,200.00	14	3.20	1,279.24	-	-
广发证券股份有限公司	2023040600013532	景嘉微	2023-04-06	1,326,728.00	10,400.00	14	3.20	1,651.04	-	-
广发证券股份有限公司	2023040600013852	圣邦股份	2023-04-06	4,274,018.00	25,900.00	14	3.20	5,318.78	-	-
广发证券股份有限公司	202304060001	北京君正	2023-04-06	109,380.00	1,000.00	14	3.20	136.12	-	-

司	3988									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0407 0000 7037	北京君 正	2023- 04-07	9,286 ,956. 00	82,200.00	14	3.2 0	11,55 7.10	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0000 4674	紫光国 微	2023- 04-10	10,69 7,760 .00	91,200.00	14	3.2 0	13,31 2.77	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0000 4678	沪硅产 业	2023- 04-10	79,79 8.00	3,400.00	14	3.2 0	99.30	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0001 7285	兆易创 新	2023- 04-10	1,308 ,600. 00	10,000.00	14	1.7 0	865.1 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0002 5153	三安光 电	2023- 04-10	712,5 04.00	33,800.00	14	1.7 0	471.0 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0003 6305	紫光国 微	2023- 04-10	1,173 ,000. 00	10,000.00	14	1.7 0	775.4 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0003 7435	华天科 技	2023- 04-10	105,4 00.00	10,000.00	14	1.7 0	69.68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0005 0031	澜起科 技	2023- 04-10	717,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	892.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0005 1957	澜起科 技	2023- 04-10	717,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	892.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0410 0006 7377	景嘉微	2023- 04-10	1,283 ,891. 00	11,900.00	14	3.2 0	1,597 .73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0000 3498	扬杰科 技	2023- 04-11	1,482 ,000. 00	26,000.00	14	3.2 0	1,844 .27	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0000 3532	中芯国 际	2023- 04-11	2,348 ,886. 00	40,200.00	14	3.2 0	2,923 .06	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0001 6130	兆易创 新	2023- 04-11	1,327 ,200. 00	10,000.00	14	1.7 0	877.4 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0001 6416	立昂微	2023- 04-11	570,7 00.00	10,000.00	14	1.7 0	377.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0412 0001 8516	通富微 电	2023- 04-12	311,4 40.00	13,600.00	14	1.7 0	205.9 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0413 0000 6391	韦尔股 份	2023- 04-13	11,13 4,800 .00	108,000.0 0	14	1.7 0	7,361 .34	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0413 0000 7265	北方华 创	2023- 04-13	2,860 ,100. 00	10,000.00	14	1.7 0	1,890 .84	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0413 0001 1405	韦尔股 份	2023- 04-13	15,64 0,270 .00	151,700.0 0	14	1.7 0	10,33 9.96	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0413 0001 8013	晶晨股 份	2023- 04-13	1,416 ,054. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,762 .20	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0414 0000 3877	兆易创 新	2023- 04-14	1,354 ,100. 00	10,000.00	14	1.7 0	895.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0414 0000 4513	长电科 技	2023- 04-14	361,2 00.00	10,000.00	14	1.7 0	238.7 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0414 0000 8199	晶晨股 份	2023- 04-14	9,128 ,130. 00	99,500.00	14	3.2 0	11,35 9.45	-	-
广发证	2023	紫光国	2023-	4,089	35,800.00	14	3.2	6,179	-	-

券股份 有限公司	0417 0000 8248	微	04-17	,076. 00			0	.05		
广发证 券股份 有限公司	2023 0417 0000 8294	瑞芯微	2023- 04-17	4,727 ,772. 00	51,400.00	14	3.2 0	7,144 .19	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0417 0000 9886	长电科 技	2023- 04-17	779,8 86.00	22,200.00	14	3.2 0	1,178 .49	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0418 0000 7237	中微公 司	2023- 04-18	1,140 ,428. 00	6,200.00	14	3.2 0	1,621 .94	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0418 0000 8067	三安光 电	2023- 04-18	643,5 45.00	31,500.00	14	3.2 0	915.2 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0000 7511	圣邦股 份	2023- 04-20	3,882 ,669. 00	25,900.00	14	3.2 0	4,831 .77	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0001 2013	立昂微	2023- 04-20	1,354 ,050. 00	22,500.00	14	3.2 0	1,685 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0001 2047	三安光 电	2023- 04-20	678,0 40.00	33,500.00	14	3.2 0	843.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0001 2051	三安光 电	2023- 04-20	1,167 ,848. 00	57,700.00	14	3.2 0	1,453 .32	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0001 2077	景嘉微	2023- 04-20	1,219 ,816. 00	10,400.00	14	3.2 0	1,517 .99	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0420 0001 2369	北京君 正	2023- 04-20	105,4 80.00	1,000.00	14	3.2 0	131.2 6	-	-
广发证 券股份	2023 0421	雅克科 技	2023- 04-21	504,0 00.00	7,000.00	14	3.2 0	627.2 0	-	-



有限公司	0000 1991									
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 6765	北京君 正	2023- 04-21	7,870 ,650. 00	82,200.00	14	3.2 0	9,794 .59	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 6983	北方华 创	2023- 04-21	8,802 ,747. 00	26,100.00	14	3.2 0	10,95 4.53	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 6985	紫光国 微	2023- 04-21	1,979 ,586. 00	18,900.00	14	3.2 0	2,463 .48	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 7053	兆易创 新	2023- 04-21	1,264 ,100. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,573 .10	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 7081	紫光国 微	2023- 04-21	2,566 ,130. 00	24,500.00	14	3.2 0	3,193 .41	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 7087	长电科 技	2023- 04-21	1,626 ,912. 00	50,400.00	14	3.2 0	2,024 .60	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0421 0000 7817	兆易创 新	2023- 04-21	5,637 ,886. 00	44,600.00	14	3.2 0	7,016 .04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0424 0000 4525	雅克科 技	2023- 04-24	682,7 00.00	10,000.00	14	3.2 0	849.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0424 0000 4634	沪硅产 业	2023- 04-24	178,2 00.00	7,500.00	14	3.2 0	221.7 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0424 0000 4642	沪硅产 业	2023- 04-24	484,7 04.00	20,400.00	14	3.2 0	603.1 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0003	澜起科 技	2023- 04-24	692,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	861.1 6	-	-

司	5401									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0004 6575	华天科 技	2023- 04-24	93,70 0.00	10,000.00	14	3.2 0	116.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0005 1233	紫光国 微	2023- 04-24	9,420 ,048. 00	91,200.00	14	3.2 0	11,72 2.73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0005 2109	三安光 电	2023- 04-24	671,2 68.00	33,800.00	14	3.2 0	835.3 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0005 8255	紫光国 微	2023- 04-24	1,032 ,900. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,285 .39	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0005 9271	澜起科 技	2023- 04-24	692,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	861.1 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0000 3187	雅克科 技	2023- 04-25	117,0 54.00	1,800.00	14	3.2 0	145.6 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0000 3388	沪硅产 业	2023- 04-25	85,50 0.00	3,800.00	14	3.2 0	106.4 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 2669	扬杰科 技	2023- 04-25	1,143 ,480. 00	26,000.00	14	3.2 0	1,423 .00	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 6075	立昂微	2023- 04-25	463,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	576.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 8281	中芯国 际	2023- 04-25	2,467 ,074. 00	40,200.00	14	3.2 0	3,070 .14	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0426 0000 2961	长电科 技	2023- 04-26	6,600 ,386. 00	232,900.0 0	14	3.2 0	8,213 .81	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0426 0001 5292	通富微 电	2023- 04-26	248,2 00.00	13,600.00	14	3.2 0	308.8 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0000 5608	圣邦股 份	2023- 04-27	124,1 00.00	1,000.00	14	3.2 0	154.4 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0000 5781	闻泰科 技	2023- 04-27	10,32 6,487 .00	199,700.0 0	14	3.2 0	12,85 0.74	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0000 9822	北方华 创	2023- 04-27	3,363 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	4,185 .07	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0001 5158	韦尔股 份	2023- 04-27	9,745 ,920. 00	108,000.0 0	14	3.2 0	12,12 8.26	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0001 5160	韦尔股 份	2023- 04-27	13,68 9,408 .00	151,700.0 0	14	3.2 0	17,03 5.71	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0427 0001 5178	晶晨股 份	2023- 04-27	1,320 ,813. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,643 .68	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0428 0001 0418	晶晨股 份	2023- 04-28	8,325 ,165. 00	99,500.00	14	3.2 0	10,36 0.21	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0428 0001 0444	兆易创 新	2023- 04-28	1,084 ,700. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,349 .85	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0428 0001 3904	长电科 技	2023- 04-28	275,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	342.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0504 0000 5146	北方华 创	2023- 05-04	8,025 ,768. 00	24,900.00	14	3.2 0	9,987 .62	-	-
广发证	2023	立昂微	2023-	994,2	22,500.00	14	3.2	1,237	-	-

券股份 有限公司	0504 0002 5551		05-04	75.00			0	.32		
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0003 6927	北京君 正	2023- 05-04	84,05 0.00	1,000.00	14	3.2 0	104.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0004 4285	三安光 电	2023- 05-04	557,8 65.00	31,500.00	14	3.2 0	694.2 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0004 4345	三安光 电	2023- 05-04	1,021 ,867. 00	57,700.00	14	3.2 0	1,271 .66	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0004 9799	景嘉微	2023- 05-04	880,0 48.00	10,400.00	14	3.2 0	1,095 .17	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0005 0389	中微公 司	2023- 05-04	1,045 ,878. 00	6,200.00	14	3.2 0	1,301 .54	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0005 1837	圣邦股 份	2023- 05-04	3,222 ,219. 00	25,900.00	14	3.2 0	4,009 .87	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0505 0001 0859	雅克科 技	2023- 05-05	475,9 30.00	7,000.00	14	3.2 0	592.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0505 0001 0867	北京君 正	2023- 05-05	6,777 ,390. 00	82,200.00	14	3.2 0	8,434 .09	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0000 3194	澜起科 技	2023- 05-08	4,752 ,800. 00	80,000.00	14	3.1 0	5,729 .76	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0001 0427	华天科 技	2023- 05-08	89,00 0.00	10,000.00	14	3.2 0	110.7 6	-	-
广发证 券股份	2023 0508	沪硅产 业	2023- 05-08	463,6 92.00	20,400.00	14	3.2 0	577.0 4	-	-

有限公司	0001 5097									
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0001 5463	澜起科 技	2023- 05-08	594,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	739.3 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0003 0377	沪硅产 业	2023- 05-08	170,4 75.00	7,500.00	14	3.2 0	212.1 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0003 1803	雅克科 技	2023- 05-08	686,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	853.6 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0004 3207	紫光国 微	2023- 05-08	9,198 ,432. 00	91,200.00	14	3.2 0	11,44 6.94	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0005 8821	澜起科 技	2023- 05-08	594,1 00.00	10,000.00	8	3.2 0	422.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0508 0006 2207	紫光国 微	2023- 05-08	1,008 ,600. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,255 .15	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0509 0000 3764	澜起科 技	2023- 05-09	6,365 ,700. 00	110,000.0 0	14	3.1 0	7,674 .21	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0509 0001 8963	雅克科 技	2023- 05-09	124,1 82.00	1,800.00	14	3.2 0	154.5 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0509 0002 4609	扬杰科 技	2023- 05-09	1,076 ,140. 00	26,000.00	14	3.2 0	1,339 .20	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0509 0002 6053	立昂微	2023- 05-09	413,8 00.00	10,000.00	14	3.2 0	514.9 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0509 0002	中芯国 际	2023- 05-09	2,121 ,756. 00	40,200.00	14	3.2 0	2,640 .41	-	-

司	6203									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0509 0002 6573	沪硅产 业	2023- 05-09	85,65 2.00	3,800.00	14	3.2 0	106.5 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0510 0003 0018	通富微 电	2023- 05-10	249,9 68.00	13,600.00	14	3.2 0	311.0 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0511 0001 2575	韦尔股 份	2023- 05-11	9,752 ,400. 00	108,000.0 0	14	3.2 0	12,13 6.32	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0511 0001 2577	韦尔股 份	2023- 05-11	13,69 8,510 .00	151,700.0 0	14	3.2 0	17,04 7.03	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0511 0001 2649	晶晨股 份	2023- 05-11	1,233 ,840. 00	15,900.00	14	3.2 0	1,535 .45	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0000 1810	士兰微	2023- 05-12	313,2 48.00	9,600.00	14	3.1 0	377.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0000 1820	格科微	2023- 05-12	29,69 7.00	1,900.00	14	3.1 0	35.80	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0001 1236	兆易创 新	2023- 05-12	1,005 ,200. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,250 .92	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0001 1288	晶晨股 份	2023- 05-12	7,924 ,180. 00	99,500.00	14	3.2 0	9,861 .20	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0515 0000 1974	闻泰科 技	2023- 05-15	59,73 0.00	1,100.00	14	3.1 0	72.01	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0515 0000 2077	华润微	2023- 05-15	90,10 5.00	1,500.00	14	3.1 0	108.6 3	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0516 0000 3331	闻泰科 技	2023- 05-16	245,9 25.00	4,500.00	14	3.1 0	296.4 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0517 0000 3053	雅克科 技	2023- 05-17	2,720 ,344. 00	41,800.00	14	3.1 0	3,279 .53	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0517 0000 3157	闻泰科 技	2023- 05-17	247,4 10.00	4,500.00	14	3.1 0	298.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0517 0000 3173	长电科 技	2023- 05-17	273,1 48.00	9,200.00	14	3.1 0	329.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 2667	北方华 创	2023- 05-18	1,114 ,588. 00	3,700.00	14	3.1 0	1,343 .70	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 7442	立昂微	2023- 05-18	895,5 00.00	22,500.00	14	3.2 0	1,114 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0002 6350	三安光 电	2023- 05-18	578,3 40.00	31,500.00	14	3.2 0	719.7 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0003 0536	圣邦股 份	2023- 05-18	3,103 ,856. 00	25,900.00	14	3.2 0	3,862 .58	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0003 0650	三安光 电	2023- 05-18	1,059 ,372. 00	57,700.00	14	3.2 0	1,318 .33	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0519 0000 4139	兆易创 新	2023- 05-19	179,2 16.00	1,600.00	14	3.1 0	216.0 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0519 0000 4159	晶晨股 份	2023- 05-19	1,286 ,400. 00	15,000.00	14	3.1 0	1,550 .83	-	-
广发证	2023	雅克科	2023-	491,0	7,000.00	14	3.2	611.0	-	-

券股份 有限公司	0519 0001 1019	技	05-19	50.00			0	8		
广发证 券股份 有限公司	2023 0522 0002 1816	澜起科 技	2023- 05-22	4,752 ,800. 00	80,000.00	14	3.1 0	5,729 .76	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0522 0004 4814	雅克科 技	2023- 05-22	697,7 00.00	10,000.00	14	3.2 0	868.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0000 3437	紫光国 微	2023- 05-23	141,3 90.00	1,500.00	14	3.1 0	170.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0000 3442	北京君 正	2023- 05-23	3,088 ,650. 00	34,900.00	14	3.1 0	3,723 .54	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0001 0806	澜起科 技	2023- 05-23	6,347 ,000. 00	110,000.0 0	14	3.1 0	7,651 .66	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0001 3076	扬杰科 技	2023- 05-23	1,093 ,300. 00	26,000.00	14	3.2 0	1,360 .55	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 7274	沪硅产 业	2023- 05-23	78,05 2.00	3,800.00	14	3.2 0	97.13	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 7294	立昂微	2023- 05-23	404,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	503.0 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 7478	雅克科 技	2023- 05-23	126,6 30.00	1,800.00	14	3.2 0	157.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0524 0001 8086	通富微 电	2023- 05-24	281,1 12.00	13,600.00	14	3.2 0	349.8 3	-	-
广发证 券股份	2023 0525	景嘉微	2023- 05-25	5,565 ,274.	67,100.00	14	3.2 0	6,925 .67	-	-



有限公司	0000 3643			00						
广发证 券股份 有限公司	2023 0525 0000 3694	雅克科 技	2023- 05-25	273,0 68.00	3,800.00	14	3.2 0	339.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0529 0000 4292	长电科 技	2023- 05-29	4,458 ,480. 00	142,900.0 0	14	3.2 0	5,548 .33	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0530 0001 7270	瑞芯微	2023- 05-30	106,0 93.00	1,300.00	14	3.2 0	132.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0531 0000 7354	闻泰科 技	2023- 05-31	224,5 50.00	4,500.00	14	3.1 0	270.7 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0531 0000 8370	长电科 技	2023- 05-31	287,0 40.00	9,200.00	14	3.1 0	346.0 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0002 2047	立昂微	2023- 06-01	910,5 75.00	22,500.00	14	3.2 0	1,133 .16	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0002 4257	三安光 电	2023- 06-01	1,106 ,686. 00	57,700.00	14	3.2 0	1,377 .21	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0002 7355	三安光 电	2023- 06-01	604,1 70.00	31,500.00	14	3.2 0	751.8 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0003 2773	圣邦股 份	2023- 06-01	2,838 ,899. 00	25,900.00	14	3.2 0	3,532 .85	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0602 0001 4476	兆易创 新	2023- 06-02	174,2 24.00	1,600.00	14	3.1 0	210.0 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0602 0001	晶晨股 份	2023- 06-02	1,376 ,850. 00	15,000.00	14	3.1 0	1,659 .87	-	-

司	4482									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0605 0000 2236	北方华 创	2023- 06-05	4,976 ,900. 00	15,700.00	14	3.2 1	6,212 .83	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0605 0002 7790	澜起科 技	2023- 06-05	4,822 ,400. 00	80,000.00	14	3.1 0	5,813 .67	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0000 3291	沪硅产 业	2023- 06-06	66,68 1.00	3,100.00	14	3.2 1	83.24	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0001 4280	澜起科 技	2023- 06-06	6,499 ,900. 00	110,000.0 0	14	3.1 0	7,835 .99	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0001 7976	北京君 正	2023- 06-06	2,966 ,500. 00	34,900.00	14	3.1 0	3,576 .28	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0001 8601	立昂微	2023- 06-06	391,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	486.7 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0002 0557	扬杰科 技	2023- 06-06	1,072 ,760. 00	26,000.00	14	3.2 0	1,334 .99	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0607 0000 2872	圣邦股 份	2023- 06-07	4,387 ,740. 00	42,000.00	14	3.2 1	5,477 .36	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0607 0001 8179	通富微 电	2023- 06-07	337,2 80.00	13,600.00	14	3.2 0	419.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0608 0001 9287	景嘉微	2023- 06-08	6,483 ,202. 00	67,100.00	14	3.2 0	10,37 3.12	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0609 0000 2285	北方华 创	2023- 06-09	307,0 00.00	1,000.00	14	3.2 1	465.3 6	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0609 0000 2411	长电科 技	2023- 06-09	146,2 80.00	4,600.00	14	3.2 1	221.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1114	北方华 创	2023- 06-12	1,547 ,420. 00	4,900.00	14	3.2 1	1,931 .70	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1193	通富微 电	2023- 06-12	1,816 ,115. 00	66,500.00	14	3.2 1	2,267 .12	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1350	立昂微	2023- 06-12	91,17 6.00	2,400.00	14	3.2 1	113.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1033	卓胜微	2023- 06-13	1,017 ,738. 00	9,400.00	14	1.7 0	672.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1036	华大九 天	2023- 06-13	286,3 50.00	2,300.00	14	1.7 0	189.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1037	卓胜微	2023- 06-13	1,017 ,738. 00	9,400.00	14	1.7 0	672.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1041	圣邦股 份	2023- 06-13	356,6 31.00	3,300.00	14	1.7 0	235.7 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1042	华大九 天	2023- 06-13	286,3 50.00	2,300.00	14	1.7 0	189.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1045	圣邦股 份	2023- 06-13	356,6 31.00	3,300.00	14	1.7 0	235.7 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1047	景嘉微	2023- 06-13	382,0 40.00	4,000.00	14	1.7 0	252.5 7	-	-
广发证	2023	景嘉微	2023-	382,0	4,000.00	14	1.7	252.5	-	-

券股份 有限公司	0613 0001 1050		06-13	40.00			0	7		
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1244	通富微 电	2023- 06-13	547,0 00.00	20,000.00	14	1.7 0	361.6 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1245	华天科 技	2023- 06-13	705,1 90.00	72,700.00	14	1.7 0	466.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1247	北方华 创	2023- 06-13	2,371 ,700. 00	7,400.00	14	1.7 0	1,567 .96	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1275	通富微 电	2023- 06-13	547,0 00.00	20,000.00	14	1.7 0	361.6 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1276	华天科 技	2023- 06-13	705,1 90.00	72,700.00	14	1.7 0	466.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1277	北方华 创	2023- 06-13	2,371 ,700. 00	7,400.00	14	1.7 0	1,567 .96	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1301	北京君 正	2023- 06-13	772,6 86.00	8,200.00	14	1.7 0	510.8 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1306	北京君 正	2023- 06-13	772,6 86.00	8,200.00	14	1.7 0	510.8 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1307	晶盛机 电	2023- 06-13	1,110 ,987. 00	17,100.00	14	1.7 0	734.4 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1310	斯达半 导	2023- 06-13	473,0 00.00	2,200.00	14	1.7 0	312.7 1	-	-
广发证 券股份	2023 0613	晶盛机 电	2023- 06-13	1,110 ,987.	17,100.00	14	1.7 0	734.4 9	-	-

有限公司	0001 1326			00						
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1350	晶盛机 电	2023- 06-13	1,000 ,538. 00	15,400.00	14	1.7 0	661.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1357	晶盛机 电	2023- 06-13	1,000 ,538. 00	15,400.00	14	1.7 0	661.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1364	中微公 司	2023- 06-13	1,885 ,912. 00	11,900.00	14	1.7 0	1,246 .80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1373	兆易创 新	2023- 06-13	1,925 ,368. 00	17,200.00	14	1.7 0	1,272 .88	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1392	士兰微	2023- 06-13	711,0 80.00	23,200.00	14	1.7 0	470.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1399	斯达半 导	2023- 06-13	473,0 00.00	2,200.00	14	1.7 0	312.7 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1400	思瑞浦	2023- 06-13	463,3 91.00	1,900.00	14	1.7 0	306.3 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1417	沪硅产 业	2023- 06-13	860,3 10.00	39,500.00	14	1.7 0	568.7 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1419	华润微	2023- 06-13	692,2 24.00	12,800.00	14	1.7 0	457.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1444	中微公 司	2023- 06-13	1,965 ,152. 00	12,400.00	14	1.7 0	1,299 .18	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001	韦尔股 份	2023- 06-13	2,094 ,960. 00	21,000.00	14	1.7 0	1,385 .00	-	-

司	1450									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1473	寒武纪	2023- 06-13	1,211 ,080. 00	5,200.00	14	1.7 0	800.6 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1475	盛美上 海	2023- 06-13	278,7 84.00	2,200.00	14	1.7 0	184.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1477	士兰微	2023- 06-13	711,0 80.00	23,200.00	14	1.7 0	470.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1479	盛美上 海	2023- 06-13	316,8 00.00	2,500.00	14	1.7 0	209.4 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1489	思瑞浦	2023- 06-13	512,1 69.00	2,100.00	14	1.7 0	338.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1496	沪硅产 业	2023- 06-13	860,3 10.00	39,500.00	14	1.7 0	568.7 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1500	华润微	2023- 06-13	692,2 24.00	12,800.00	14	1.7 0	457.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1521	中微公 司	2023- 06-13	1,885 ,912. 00	11,900.00	14	1.7 0	1,246 .80	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1524	韦尔股 份	2023- 06-13	2,094 ,960. 00	21,000.00	14	1.7 0	1,385 .00	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1535	华润微	2023- 06-13	816,6 08.00	15,100.00	14	1.7 0	539.8 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1536	寒武纪	2023- 06-13	1,374 ,110. 00	5,900.00	14	1.7 0	908.4 4	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1537	盛美上 海	2023- 06-13	316,8 00.00	2,500.00	14	1.7 0	209.4 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1545	思瑞浦	2023- 06-13	463,3 91.00	1,900.00	14	1.7 0	306.3 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1551	华润微	2023- 06-13	816,6 08.00	15,100.00	14	1.7 0	539.8 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1564	中微公 司	2023- 06-13	1,965 ,152. 00	12,400.00	14	1.7 0	1,299 .18	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1568	闻泰科 技	2023- 06-13	1,219 ,680. 00	24,000.00	14	1.7 0	806.3 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1578	寒武纪	2023- 06-13	1,211 ,080. 00	5,200.00	14	1.7 0	800.6 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1579	盛美上 海	2023- 06-13	278,7 84.00	2,200.00	14	1.7 0	184.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1587	复旦微 电	2023- 06-13	217,4 00.00	4,000.00	14	1.7 0	143.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1595	中芯国 际	2023- 06-13	3,069 ,160. 00	55,400.00	14	1.7 0	2,029 .06	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1605	澜起科 技	2023- 06-13	628,5 00.00	10,000.00	14	1.7 0	415.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1609	闻泰科 技	2023- 06-13	1,219 ,680. 00	24,000.00	14	1.7 0	806.3 4	-	-
广发证	2023	寒武纪	2023-	1,374	5,900.00	14	1.7	908.4	-	-

券股份 有限公司	0613 0001 1617		06-13	,110. 00			0	4		
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1630	复旦微 电	2023- 06-13	217,4 00.00	4,000.00	14	1.7 0	143.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1632	中芯国 际	2023- 06-13	2,947 ,280. 00	53,200.00	14	1.7 0	1,948 .48	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1639	澜起科 技	2023- 06-13	628,5 00.00	10,000.00	14	1.7 0	415.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1642	长电科 技	2023- 06-13	1,278 ,554. 00	38,200.00	14	1.7 0	845.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1662	格科微	2023- 06-13	241,6 32.00	14,400.00	14	1.7 0	159.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1663	中芯国 际	2023- 06-13	2,947 ,280. 00	53,200.00	14	1.7 0	1,948 .48	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1668	澜起科 技	2023- 06-13	942,7 50.00	15,000.00	14	1.7 0	623.2 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1671	长电科 技	2023- 06-13	1,278 ,554. 00	38,200.00	14	1.7 0	845.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1690	格科微	2023- 06-13	239,9 54.00	14,300.00	14	1.7 0	158.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1691	中芯国 际	2023- 06-13	3,069 ,160. 00	55,400.00	14	1.7 0	2,029 .06	-	-
广发证 券股份	2023 0613	澜起科 技	2023- 06-13	942,7 50.00	15,000.00	14	1.7 0	623.2 6	-	-



有限公司	0001 1696									
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1697	思瑞浦	2023- 06-13	512,1 69.00	2,100.00	14	1.7 0	338.6 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1714	格科微	2023- 06-13	241,6 32.00	14,400.00	14	1.7 0	159.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1716	沪硅产 业	2023- 06-13	849,4 20.00	39,000.00	14	1.7 0	561.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1722	兆易创 新	2023- 06-13	1,925 ,368. 00	17,200.00	14	1.7 0	1,272 .88	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1740	格科微	2023- 06-13	239,9 54.00	14,300.00	14	1.7 0	158.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1744	沪硅产 业	2023- 06-13	849,4 20.00	39,000.00	14	1.7 0	561.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0002 2020	瑞芯微	2023- 06-13	104,6 37.00	1,300.00	14	3.2 0	130.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0614 0004 9534	闻泰科 技	2023- 06-14	228,2 40.00	4,500.00	14	3.1 0	275.1 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0002 7323	圣邦股 份	2023- 06-15	2,886 ,555. 00	25,900.00	14	3.2 0	3,592 .16	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0002 8413	立昂微	2023- 06-15	850,5 00.00	22,500.00	14	3.2 0	1,058 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0616 0002	晶晨股 份	2023- 06-16	1,367 ,250. 00	15,000.00	14	3.1 0	1,648 .30	-	-

司	1498									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0616 0002 2181	兆易创 新	2023- 06-16	179,0 08.00	1,600.00	14	3.1 0	215.8 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0619 0001 9753	澜起科 技	2023- 06-19	4,968 ,800. 00	80,000.00	14	3.1 0	4,706 .56	4,593,600.0 0	4,706.56
广发证 券股份 有限公 司	2023 0620 0001 4481	圣邦股 份	2023- 06-20	241,6 68.00	2,800.00	14	3.2 1	215.4 9	229,964.00	215.49
广发证 券股份 有限公 司	2023 0620 0003 2885	澜起科 技	2023- 06-20	6,644 ,000. 00	110,000.0 0	14	3.1 0	5,721 .22	6,316,200.0 0	5,721.22
广发证 券股份 有限公 司	2023 0620 0003 4222	立昂微	2023- 06-20	384,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	341.3 3	367,300.00	341.33
广发证 券股份 有限公 司	2023 0620 0003 5710	北京君 正	2023- 06-20	3,221 ,270. 00	34,900.00	14	3.1 0	2,773 .87	3,082,019.0 0	2,773.87
广发证 券股份 有限公 司	2023 0621 0001 4835	通富微 电	2023- 06-21	318,1 04.00	13,600.00	14	3.2 0	254.4 8	307,360.00	254.48
广发证 券股份 有限公 司	2023 0621 0001 5620	圣邦股 份	2023- 06-21	3,586 ,380. 00	42,000.00	14	3.2 1	2,878 .07	3,449,460.0 0	2,878.07
广发证 券股份 有限公 司	2023 0626 0000 3479	士兰微	2023- 06-26	4,795 ,200. 00	160,000.0 0	14	3.1 0	1,651 .68	4,843,200.0 0	1,651.68
广发证 券股份 有限公 司	2023 0626 0003 4516	北方华 创	2023- 06-26	298,1 50.00	1,000.00	14	3.2 1	106.3 4	317,650.00	106.34
广发证 券股份 有限公 司	2023 0626 0004 4045	景嘉微	2023- 06-26	5,971 ,900. 00	67,100.00	14	3.2 0	2,123 .34	6,038,329.0 0	2,123.34

广发证 券股份 有限公 司	2023 0626 0005 1835	通富微 电	2023- 06-26	1,501 ,570. 00	66,500.00	14	3.2 1	535.5 6	1,502,900.0 0	535.56
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 5807	士兰微	2023- 06-27	697,1 60.00	23,200.00	14	1.7 0	98.76	702,264.00	98.76
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 5904	斯达半 导	2023- 06-27	459,5 80.00	2,200.00	14	1.7 0	65.11	473,440.00	65.11
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 5916	思瑞浦	2023- 06-27	479,2 20.00	2,100.00	14	1.7 0	67.89	457,800.00	67.89
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 5925	寒武纪	2023- 06-27	1,022 ,788. 00	5,200.00	14	1.7 0	144.8 9	977,600.00	144.89
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 5981	兆易创 新	2023- 06-27	1,820 ,448. 00	17,200.00	14	1.7 0	257.9 0	1,827,500.0 0	257.90
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6217	斯达半 导	2023- 06-27	459,5 80.00	2,200.00	14	1.7 0	65.11	473,440.00	65.11
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6349	兆易创 新	2023- 06-27	1,820 ,448. 00	17,200.00	14	1.7 0	257.9 0	1,827,500.0 0	257.90
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6366	中芯国 际	2023- 06-27	2,733 ,948. 00	53,200.00	14	1.7 0	387.3 1	2,687,664.0 0	387.31
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6414	北方华 创	2023- 06-27	2,227 ,252. 00	7,400.00	14	1.7 0	315.5 3	2,350,610.0 0	315.53
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6423	华天科 技	2023- 06-27	670,2 94.00	72,700.00	14	1.7 0	94.96	668,840.00	94.96
广发证	2023	晶盛机	2023-	1,041	15,400.00	14	1.7	147.5	1,091,860.0	147.59

券股份 有限公司	0627 0001 6536	电	06-27	,810. 00			0	9	0	
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6544	寒武纪	2023- 06-27	1,022 ,788. 00	5,200.00	14	1.7 0	144.8 9	977,600.00	144.89
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6608	中芯国 际	2023- 06-27	2,733 ,948. 00	53,200.00	14	1.7 0	387.3 1	2,687,664.0 0	387.31
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6665	中微公 司	2023- 06-27	1,878 ,600. 00	12,400.00	14	1.7 0	266.1 4	1,939,980.0 0	266.14
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6728	澜起科 技	2023- 06-27	841,3 50.00	15,000.00	14	1.7 0	119.1 9	861,300.00	119.19
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6732	思瑞浦	2023- 06-27	479,2 20.00	2,100.00	14	1.7 0	67.89	457,800.00	67.89
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6745	格科微	2023- 06-27	226,3 69.00	14,300.00	14	1.7 0	32.07	226,226.00	32.07
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6834	长电科 技	2023- 06-27	1,224 ,310. 00	38,200.00	14	1.7 0	173.4 4	1,190,694.0 0	173.44
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6873	盛美上 海	2023- 06-27	244,6 62.00	2,200.00	14	1.7 0	34.66	242,880.00	34.66
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 6949	格科微	2023- 06-27	227,9 52.00	14,400.00	14	1.7 0	32.29	227,808.00	32.29
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7078	士兰微	2023- 06-27	697,1 60.00	23,200.00	14	1.7 0	98.76	702,264.00	98.76
广发证 券股份	2023 0627	格科微	2023- 06-27	226,3 69.00	14,300.00	14	1.7 0	32.07	226,226.00	32.07

有限公司	0001 7263									
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7296	晶盛机 电	2023- 06-27	1,156 ,815. 00	17,100.00	14	1.7 0	163.8 8	1,212,390.0 0	163.88
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7300	晶盛机 电	2023- 06-27	1,041 ,810. 00	15,400.00	14	1.7 0	147.5 9	1,091,860.0 0	147.59
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7380	通富微 电	2023- 06-27	452,0 00.00	20,000.00	14	1.7 0	64.03	452,000.00	64.03
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7513	思瑞浦	2023- 06-27	433,5 80.00	1,900.00	14	1.7 0	61.42	414,200.00	61.42
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7630	韦尔股 份	2023- 06-27	2,100 ,000. 00	21,000.00	14	1.7 0	297.5 0	2,058,840.0 0	297.50
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7651	闻泰科 技	2023- 06-27	1,188 ,720. 00	24,000.00	14	1.7 0	168.4 0	1,173,600.0 0	168.40
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7738	中微公 司	2023- 06-27	1,878 ,600. 00	12,400.00	14	1.7 0	266.1 4	1,939,980.0 0	266.14
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7808	华天科 技	2023- 06-27	670,2 94.00	72,700.00	14	1.7 0	94.96	668,840.00	94.96
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7869	寒武纪	2023- 06-27	1,160 ,471. 00	5,900.00	14	1.7 0	164.4 0	1,109,200.0 0	164.40
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 7903	中芯国 际	2023- 06-27	2,847 ,006. 00	55,400.00	14	1.7 0	403.3 3	2,798,808.0 0	403.33
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001	中微公 司	2023- 06-27	1,802 ,850. 00	11,900.00	14	1.7 0	255.4 0	1,861,755.0 0	255.40

司	8036									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8057	盛美上 海	2023- 06-27	278,0 25.00	2,500.00	14	1.7 0	39.39	276,000.00	39.39
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8183	澜起科 技	2023- 06-27	560,9 00.00	10,000.00	14	1.7 0	79.46	574,200.00	79.46
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8254	通富微 电	2023- 06-27	452,0 00.00	20,000.00	14	1.7 0	64.03	452,000.00	64.03
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8320	澜起科 技	2023- 06-27	841,3 50.00	15,000.00	14	1.7 0	119.1 9	861,300.00	119.19
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8321	长电科 技	2023- 06-27	1,224 ,310. 00	38,200.00	14	1.7 0	173.4 4	1,190,694.0 0	173.44
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8364	北京君 正	2023- 06-27	711,4 32.00	8,200.00	14	1.7 0	100.7 9	724,142.00	100.79
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8449	北方华 创	2023- 06-27	2,227 ,252. 00	7,400.00	14	1.7 0	315.5 3	2,350,610.0 0	315.53
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8596	华润微	2023- 06-27	672,1 28.00	12,800.00	14	1.7 0	95.22	670,848.00	95.22
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8618	复旦微 电	2023- 06-27	205,9 20.00	4,000.00	14	1.7 0	29.17	200,400.00	29.17
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8661	澜起科 技	2023- 06-27	560,9 00.00	10,000.00	14	1.7 0	79.46	574,200.00	79.46
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9026	寒武纪	2023- 06-27	1,160 ,471. 00	5,900.00	14	1.7 0	164.4 0	1,109,200.0 0	164.40

广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9239	沪硅产 业	2023- 06-27	825,5 50.00	39,500.00	14	1.7 0	116.9 5	825,550.00	116.95
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9330	沪硅产 业	2023- 06-27	825,5 50.00	39,500.00	14	1.7 0	116.9 5	825,550.00	116.95
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9401	沪硅产 业	2023- 06-27	815,1 00.00	39,000.00	14	1.7 0	115.4 7	815,100.00	115.47
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9427	北京君 正	2023- 06-27	711,4 32.00	8,200.00	14	1.7 0	100.7 9	724,142.00	100.79
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9557	思瑞浦	2023- 06-27	433,5 80.00	1,900.00	14	1.7 0	61.42	414,200.00	61.42
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9575	景嘉微	2023- 06-27	357,4 80.00	4,000.00	14	1.7 0	50.64	359,960.00	50.64
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9785	沪硅产 业	2023- 06-27	815,1 00.00	39,000.00	14	1.7 0	115.4 7	815,100.00	115.47
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9821	晶盛机 电	2023- 06-27	1,156 ,815. 00	17,100.00	14	1.7 0	163.8 8	1,212,390.0 0	163.88
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 9836	盛美上 海	2023- 06-27	278,0 25.00	2,500.00	14	1.7 0	39.39	276,000.00	39.39
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002 0004	格科微	2023- 06-27	227,9 52.00	14,400.00	14	1.7 0	32.29	227,808.00	32.29
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002 0043	华润微	2023- 06-27	672,1 28.00	12,800.00	14	1.7 0	95.22	670,848.00	95.22
广发证	2023	华大九	2023-	263,4	2,300.00	14	1.7	37.32	282,532.00	37.32

券股份 有限公司	0627 0002 0336	天	06-27	42.00			0			
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0608	华大九 天	2023- 06-27	263,4 42.00	2,300.00	14	1.7 0	37.32	282,532.00	37.32
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0669	圣邦股 份	2023- 06-27	277,1 67.00	3,300.00	14	1.7 0	39.27	271,029.00	39.27
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0706	卓胜微	2023- 06-27	942,4 44.00	9,400.00	14	1.7 0	133.5 1	908,322.00	133.51
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0787	卓胜微	2023- 06-27	942,4 44.00	9,400.00	14	1.7 0	133.5 1	908,322.00	133.51
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0959	景嘉微	2023- 06-27	357,4 80.00	4,000.00	14	1.7 0	50.64	359,960.00	50.64
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 1232	韦尔股 份	2023- 06-27	2,100 ,000. 00	21,000.00	14	1.7 0	297.5 0	2,058,840.0 0	297.50
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 1233	中芯国 际	2023- 06-27	2,847 ,006. 00	55,400.00	14	1.7 0	403.3 3	2,798,808.0 0	403.33
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 1399	复旦微 电	2023- 06-27	205,9 20.00	4,000.00	14	1.7 0	29.17	200,400.00	29.17
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 1436	圣邦股 份	2023- 06-27	277,1 67.00	3,300.00	14	1.7 0	39.27	271,029.00	39.27
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 1673	闻泰科 技	2023- 06-27	1,188 ,720. 00	24,000.00	14	1.7 0	168.4 0	1,173,600.0 0	168.40
广发证 券股份	2023 0627	华润微	2023- 06-27	792,9 01.00	15,100.00	14	1.7 0	112.3 3	791,391.00	112.33



有限公司	00021675									
广发证券股份有限公司	2023062700021836	中微公司	2023-06-27	1,802,850.00	11,900.00	14	1.70	255.40	1,861,755.00	255.40
广发证券股份有限公司	2023062700021842	盛美上海	2023-06-27	244,662.00	2,200.00	14	1.70	34.66	242,880.00	34.66
广发证券股份有限公司	2023062700021933	华润微	2023-06-27	792,901.00	15,100.00	14	1.70	112.33	791,391.00	112.33
广发证券股份有限公司	2023062900039390	立昂微	2023-06-29	806,175.00	22,500.00	14	3.20	71.66	826,425.00	71.66
广发证券股份有限公司	2023062900039868	圣邦股份	2023-06-29	2,141,412.00	25,900.00	14	3.20	190.35	2,127,167.00	190.35
广发证券股份有限公司	2023063000015280	晶晨股份	2023-06-30	1,264,800.00	15,000.00	14	3.10	-	1,264,800.00	-
广发证券股份有限公司	2023063000016345	兆易创新	2023-06-30	170,000.00	1,600.00	14	3.10	-	170,000.00	-
上年度可比期间										
2022年1月1日至2022年6月30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
广发证券股份有限公司	2022011400019822	卓胜微	2022-01-14	596,040.00	2,000.00	28	3.10	1,437.12	-	-
广发证券股份有限公司	2022011400019824	卓胜微	2022-01-14	894,060.00	3,000.00	28	3.10	2,155.68	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2022 0118 0000 0771	卓胜微	2022- 01-18	5,830 ,000. 00	20,000.00	28	3.1 0	14,05 6.78	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0127 0001 1107	卓胜微	2022- 01-27	6,599 ,750. 00	25,000.00	28	3.1 0	15,91 2.73	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0215 0000 7005	卓胜微	2022- 02-15	5,081 ,800. 00	20,000.00	28	3.1 0	12,25 2.78	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1039	北京君 正	2022- 02-21	604,7 50.00	5,900.00	28	3.5 0	1,646 .26	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0221 0000 1072	景嘉微	2022- 02-21	514,4 64.00	4,600.00	28	3.5 0	1,400 .49	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0224 0001 0489	卓胜微	2022- 02-24	6,670 ,000. 00	25,000.00	28	3.1 0	16,08 2.11	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0315 0001 1239	卓胜微	2022- 03-15	4,464 ,600. 00	20,000.00	28	3.1 0	10,76 4.65	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1923	景嘉微	2022- 03-21	496,8 00.00	4,600.00	28	3.5 0	1,352 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0321 0003 1933	北京君 正	2022- 03-21	585,9 29.00	5,900.00	28	3.5 0	1,595 .03	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0324 0001 0973	卓胜微	2022- 03-24	5,770 ,750. 00	25,000.00	28	3.1 0	13,91 3.92	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2022 0412 0001 0665	卓胜微	2022- 04-12	3,754 ,000. 00	20,000.00	28	3.1 0	9,051 .31	-	-
广发证	2022	景嘉微	2022-	408,2	4,600.00	28	3.5	1,111	-	-

券股份 有限公司	0418 0000 4195		04-18	50.00			0	.35		
广发证 券股份 有限公司	2022 0418 0000 4197	北京君 正	2022- 04-18	502,0 90.00	5,900.00	28	3.5 0	1,366 .80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0421 0001 0933	卓胜微	2022- 04-21	4,900 ,000. 00	25,000.00	28	3.1 0	11,81 4.44	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0510 0001 3337	卓胜微	2022- 05-10	3,664 ,800. 00	20,000.00	28	3.1 0	8,836 .24	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 0666	卓胜微	2022- 05-16	4,710 ,000. 00	25,000.00	14	3.1 0	5,678 .17	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3919	景嘉微	2022- 05-16	402,3 62.00	4,600.00	28	3.5 0	1,095 .32	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0516 0000 3921	北京君 正	2022- 05-16	464,0 94.00	5,900.00	28	3.5 0	1,263 .37	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0530 0000 3534	卓胜微	2022- 05-30	4,723 ,500. 00	25,000.00	14	3.1 0	5,694 .44	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0607 0000 7178	卓胜微	2022- 06-07	4,239 ,000. 00	20,000.00	28	3.1 0	8,395 .58	2,700,000.0 0	8,395.58
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 8449	卓胜微	2022- 06-13	4,747 ,500. 00	25,000.00	14	3.1 0	5,723 .38	-	-
广发证 券股份 有限公司	2022 0613 0001 8471	北京君 正	2022- 06-13	535,9 56.00	5,900.00	28	3.5 0	885.8 2	626,875.00	885.82
广发证 券股份	2022 0613	景嘉微	2022- 06-13	279,2 66.00	4,600.00	28	3.5 0	461.5 6	314,594.00	461.56

有限公司	0002 1109									
广发证 券股份 有限公司	2022 0627 0001 5392	卓胜微	2022- 06-27	5,162 ,750. 00	25,000.00	14	3.1 0	1,333 .71	3,375,000.0 0	1,333.71

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

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

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发国证半导体 芯片交易型开放 式指数证券投资 基金联接基金	822,367,764.00	34.88%	697,842,964.00	36.10%
广发证券股份有 限公司	8,411,255.00	0.36%	4,864,272.00	0.25%

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

##### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公 司	14,723,393.3 7	36,604.07	23,634,782.6 0	28,096.94

注：本基金的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。

##### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

#### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新股流通受限	19.99	19.99	5,824.00	116,421.76	116,421.76	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新股流通受限	25.82	25.82	3,060.00	79,009.20	79,009.20	-
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新股流通受限	55.00	55.00	1,391.00	76,505.00	76,505.00	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011.00	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206.00	45,984.78	37,422.18	-
688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	39.99	36.71	1,008.00	40,309.92	37,003.68	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767.00	36,163.20	35,447.47	-
688576	西山科技	2023-05-30	6 个月	新股流通受限	135.80	120.41	240.00	32,592.00	28,898.40	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884.00	26,749.84	22,391.72	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472.00	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通	17.80	17.89	628.00	11,178.40	11,234.92	-

				受限						
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875.00	9,065.00	10,360.00	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-

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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因认购新发/增发证券而持有的流通受限债券和权证。

#### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有暂时停牌等流通受限股票。

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款，无抵押债券。

#### 6.4.12.4 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	688008	澜起科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	57.42	451,000.00	25,896,420.00
2	688981	中芯国际	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	50.52	458,000.00	23,138,160.00
3	002371	北方华创	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 28 日	317.65	61,100.00	19,408,415.00
4	688256	寒武纪-U	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	188.00	96,300.00	18,104,400.00
5	600745	闻泰科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	48.90	336,200.00	16,440,180.00
6	600584	长电科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 27 日	31.17	427,500.00	13,325,175.00
7	688099	晶晨股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	84.32	157,200.00	13,255,104.00
8	600460	士兰微	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	30.27	429,400.00	12,997,938.00
9	002156	通富微电	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 27 日	22.60	557,900.00	12,608,540.00
10	300316	晶盛机电	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	70.90	167,300.00	11,861,570.00
11	688012	中微公司	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	156.45	74,600.00	11,671,170.00
12	603986	兆易创新	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	106.25	109,300.00	11,613,125.00
13	300223	北京君正	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	88.31	123,600.00	10,915,116.00
14	300474	景嘉微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	89.99	118,100.00	10,627,819.00
15	300661	圣邦股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	82.13	126,900.00	10,422,297.00
16	605358	立昂微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	36.73	282,300.00	10,368,879.00
17	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	20.90	467,900.00	9,779,110.00
18	002185	华天科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	9.20	906,100.00	8,336,120.00
19	688396	华润微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	52.41	149,900.00	7,856,259.00
20	300782	卓胜微	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	96.63	75,600.00	7,305,228.00
21	002049	紫光国微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	93.25	70,700.00	6,592,775.00
22	603893	瑞芯微	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	72.85	87,000.00	6,337,950.00

23	603501	韦尔股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	98.04	64,200.00	6,294,168.0 0
24	688385	复旦微电	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	50.10	115,700.00	5,796,570.0 0
25	688536	思瑞浦	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	218.0 0	23,600.00	5,144,800.0 0
26	603290	斯达半导	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	215.2 0	22,600.00	4,863,520.0 0
27	688082	盛美上海	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	110.4 0	36,700.00	4,051,680.0 0
28	600703	三安光电	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 5 日	17.24	224,400.00	3,868,656.0 0
29	301269	华大九天	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	122.8 4	28,300.00	3,476,372.0 0
30	688728	格科微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	15.82	151,100.00	2,390,402.0 0
合计	-	-	-	-	6,400,500.0 0	314,747,918 .00

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

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

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

##### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，违约



风险较小；银行间同业市场主要通过对交易对手进行风险评估防范相应的信用风险。本基金管理人认为与应收证券清算款相关的信用风险不重大。本基金本报告期末及上年度末未持有债券、资产支持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

### 6.4.13.4 市场风险

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

#### 6.4.13.4.1 利率风险

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
<b>资产</b>					
银行存款	14,723,393.37	-	-	-	14,723,393.37
结算备付金	2,334,153.18	-	-	-	2,334,153.18
存出保证金	782,832.99	-	-	-	782,832.99
交易性金融资产	-	-	-	2,447,618,911.29	2,447,618,911.29
应收清算款	-	-	-	36,828,245.48	36,828,245.48
应收股利	-	-	-	19,013.80	19,013.80
其他资产	-	-	-	185,324.39	185,324.39
资产总计	17,840,379.54	-	-	2,484,651,494.96	2,502,491,874.50
<b>负债</b>					
应付清算款	-	-	-	32,215,862.94	32,215,862.94
应付管理人报酬	-	-	-	982,912.21	982,912.21
应付托管费	-	-	-	196,582.42	196,582.42
应交税费	-	-	-	22,554.65	22,554.65
其他负债	-	-	-	10,802,547.38	10,802,547.38
负债总计	-	-	-	44,220,459.60	44,220,459.60
利率敏感度缺口	17,840,379.54	-	-	2,440,431,035.36	2,458,271,414.90
<b>上年度末 2022年12月31日</b>	<b>1年以内</b>	<b>1-5年</b>	<b>5年以上</b>	<b>不计息</b>	<b>合计</b>
<b>资产</b>					
银行存款	7,295,251.43	-	-	-	7,295,251.43
结算备付金	404,882.80	-	-	-	404,882.80
存出保证金	292,743.19	-	-	-	292,743.19
交易性金融资产	-	-	-	1,911,694,904.95	1,911,694,904.95
应收清算款	-	-	-	3,275,838.87	3,275,838.87
其他资产	-	-	-	142,575.50	142,575.50
资产总计	7,992,877.42	-	-	1,915,113,319.32	1,923,106,196.74

负债					
应付清算款	-	-	-	2,910,043.76	2,910,043.76
应付管理人报酬	-	-	-	821,788.75	821,788.75
应付托管费	-	-	-	164,357.72	164,357.72
应交税费	-	-	-	15,221.40	15,221.40
其他负债	-	-	-	1,405,420.01	1,405,420.01
负债总计	-	-	-	5,316,831.64	5,316,831.64
利率敏感度缺口	7,992,877.42	-	-	1,909,796,487.68	1,917,789,365.10

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,447,618,911.29	99.57	1,911,694,904.95	99.68
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-

交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,447,618,911.29	99.57	1,911,694,904.95	99.68

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	上升 5%	125,528,477.52	99,662,076.07
	下降 5%	-125,528,477.52	-99,662,076.07

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	2,447,087,768.82
第二层次	271,935.96
第三层次	259,206.51
合计	2,447,618,911.29

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

## 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	2,447,618,911.29	97.81
	其中：普通股	2,447,618,911.29	97.81
	存托凭证	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	17,057,546.55	0.68
8	其他各项资产	37,815,416.66	1.51
9	合计	2,502,491,874.50	100.00

注：（1）上表中的权益投资项含可退替代款估值增值，而 7.2 的合计项不含可退替代款估值增值。

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 314,747,918.00 元，占基金资产净值比例 12.80%。

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,249,908,847.18	91.52
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	8,140.64	0.00
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	197,666,476.00	8.04
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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,447,618,911.29	99.57

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
----	------	------	-------	---------	--------

					值比例(%)
1	688981	中芯国际	4,400,728	222,324,778.56	9.04
2	002371	北方华创	612,792	194,653,378.80	7.92
3	603501	韦尔股份	1,738,108	170,404,108.32	6.93
4	688012	中微公司	985,535	154,186,950.75	6.27
5	603986	兆易创新	1,426,763	151,593,568.75	6.17
6	002049	紫光国微	1,513,272	141,112,614.00	5.74
7	688008	澜起科技	1,919,511	110,218,321.62	4.48
8	300316	晶盛机电	1,417,682	100,513,653.80	4.09
9	600584	长电科技	3,159,210	98,472,575.70	4.01
10	600745	闻泰科技	1,989,625	97,292,662.50	3.96
11	600703	三安光电	5,607,387	96,671,351.88	3.93
12	688256	寒武纪-U	430,100	80,858,800.00	3.29
13	300782	卓胜微	778,830	75,258,342.90	3.06
14	688126	沪硅产业	3,265,861	68,256,494.90	2.78
15	300223	北京君正	675,300	59,635,743.00	2.43
16	688099	晶晨股份	694,075	58,524,404.00	2.38
17	600460	士兰微	1,916,523	58,013,151.21	2.36
18	300661	圣邦股份	695,587	57,128,560.31	2.32
19	688396	华润微	1,061,663	55,641,757.83	2.26
20	002156	通富微电	2,452,134	55,418,228.40	2.25
21	002185	华天科技	6,009,556	55,287,915.20	2.25
22	300474	景嘉微	515,828	46,419,361.72	1.89
23	605358	立昂微	1,209,452	44,423,171.96	1.81
24	603290	斯达半导	185,211	39,857,407.20	1.62
25	688536	思瑞浦	161,250	35,152,500.00	1.43
26	688385	复旦微电	574,053	28,760,055.30	1.17
27	603893	瑞芯微	393,117	28,638,573.45	1.16
28	301269	华大九天	188,300	23,130,772.00	0.94
29	688082	盛美上海	182,600	20,159,040.00	0.82
30	688728	格科微	1,195,342	18,910,310.44	0.77
31	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
32	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
33	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
34	001301	尚太科技	1,164	65,544.84	0.00
35	001328	登康口腔	1,445	46,323.05	0.00
36	603125	常青科技	1,596	44,779.00	0.00
37	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
38	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
39	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
40	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
41	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
42	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00

43	301282	金禄电子	434	13,046.04	0.00
44	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
45	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
46	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
47	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
48	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
49	002409	雅克科技	98	7,142.24	0.00
50	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	159,637,986.43	8.32
2	603986	兆易创新	119,081,756.22	6.21
3	603501	韦尔股份	118,222,154.40	6.16
4	688256	寒武纪-U	95,373,439.20	4.97
5	688012	中微公司	89,076,296.00	4.64
6	688008	澜起科技	85,533,897.05	4.46
7	600745	闻泰科技	77,879,869.97	4.06
8	600703	三安光电	77,050,644.12	4.02
9	600584	长电科技	65,238,118.08	3.40
10	688536	思瑞浦	53,479,753.03	2.79
11	600460	士兰微	47,903,966.56	2.50
12	688126	沪硅产业	47,741,296.33	2.49
13	688396	华润微	43,142,310.70	2.25
14	605358	立昂微	39,362,229.76	2.05
15	688099	晶晨股份	36,243,580.69	1.89
16	603290	斯达半导	34,125,300.67	1.78
17	688385	复旦微电	27,979,631.72	1.46
18	603893	瑞芯微	25,706,103.88	1.34
19	688082	盛美上海	22,219,027.33	1.16
20	301269	华大九天	22,036,099.00	1.15

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



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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	144,591,517.41	7.54
2	603986	兆易创新	106,283,420.57	5.54
3	603501	韦尔股份	100,426,190.54	5.24
4	688012	中微公司	76,129,222.41	3.97
5	600703	三安光电	68,138,004.37	3.55
6	600584	长电科技	60,063,610.91	3.13
7	688008	澜起科技	57,914,233.39	3.02
8	600745	闻泰科技	54,447,313.63	2.84
9	688536	思瑞浦	48,748,244.79	2.54
10	603160	汇顶科技	46,471,109.98	2.42
11	600460	士兰微	41,350,791.61	2.16
12	002409	雅克科技	40,481,615.89	2.11
13	688396	华润微	37,023,143.91	1.93
14	688126	沪硅产业	36,159,186.93	1.89
15	605358	立昂微	35,049,700.63	1.83
16	688099	晶晨股份	28,826,397.15	1.50
17	300373	扬杰科技	23,898,346.68	1.25
18	603893	瑞芯微	23,118,145.00	1.21
19	688385	复旦微电	23,068,705.47	1.20
20	603290	斯达半导	22,054,977.22	1.15

## 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,361,212,229.18
卖出股票收入（成交）总额	1,108,137,635.44

## 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

## 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

#### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

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

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	782,832.99
2	应收清算款	36,828,245.48
3	应收股利	19,013.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	109,708.15
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	37,815,416.66

**7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**

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	688008	澜起科技	25,896,420.00	1.05	转融通流通受限
2	688981	中芯国际	23,138,160.00	0.94	转融通流通受限
3	002371	北方华创	19,408,415.00	0.79	转融通流通受限
4	600745	闻泰科技	16,440,180.00	0.67	转融通流通受限
5	600584	长电科技	13,325,175.00	0.54	转融通流通受限
6	300316	晶盛机电	11,861,570.00	0.48	转融通流通受限
7	688012	中微公司	11,671,170.00	0.47	转融通流通受限
8	603986	兆易创新	11,613,125.00	0.47	转融通流通受限
9	002049	紫光国微	6,592,775.00	0.27	转融通流通受限
10	603501	韦尔股份	6,294,168.00	0.26	转融通流通受限

**8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	广发国证半导体芯片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
38,072	61,923.73	1,298,7 17,961. 00	55.09%	1,058,8 42,125. 00	44.91%	822,367,76 4.00	34.88%

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

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	222,572,543.00	9.44%
2	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-个险分红	50,531,300.00	2.14%
3	华润深国投信托有限公司-华润信托 瑞坤 6 号集合资金信托计划	45,672,800.00	1.94%
4	中国人寿资管-工商银行-国寿资产-FOF 优选灵活 1 号保险资产管理产品	45,499,905.00	1.93%
5	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	29,608,800.00	1.26%
6	郭金京	10,030,300.00	0.43%
7	中国人寿资管-广发银行-国寿资产-创安 FOF 优选 2248 保险资产管理产品	10,000,000.00	0.42%
8	东海证券股份有限公司	9,772,904.00	0.41%
9	中国银河证券股份有限公司	8,949,900.00	0.38%
10	广发证券股份有限公司	8,411,255.00	0.36%
11	广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金联接基金	822,367,764.00	34.88%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业	1,000.00	0.0000%

人员持有本基金		
---------	--	--

#### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

### 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020 年 1 月 20 日）基金份额总额	2,524,060,086.00
本报告期期初基金份额总额	1,933,060,086.00
本报告期基金总申购份额	1,614,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,189,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	2,357,560,086.00

### 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人、本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

#### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

#### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	8	2,180,568,164.85	88.45%	504,369.04	65.68%	-
中信建投	4	209,121,254.79	8.48%	194,756.18	25.36%	-
华泰证券	5	67,441,891.80	2.74%	62,811.50	8.18%	-
方正证券	5	8,207,528.54	0.33%	6,002.74	0.78%	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
华福证券	2	-	-	-	-	-
华鑫证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	3	-	-	-	-	-
中金公司	4	-	-	-	-	-
中山证券	1	-	-	-	-	-
中天证券	1	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
诚通证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
中泰证券	4	-	-	-	-	-
财信证券	2	-	-	-	-	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
华菁证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	2	-	-	-	-	-

世纪证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	3	-	-	-	-	-
兴业证券	4	-	-	-	-	-
中原证券	2	-	-	-	-	-
川财证券	2	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
万联证券	4	-	-	-	-	-
西南证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
中信证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	1	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
安信证券	5	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
国元证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	3	-	-	-	-	-
东北证券	4	-	-	-	-	-
东兴证券	3	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
南京证券	1	-	-	-	-	-
中银国际	2	-	-	-	-	-
太平洋证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
粤开证券	2	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
东亚前海证券	1	-	-	-	-	-
中金财富证券	3	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；

(4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；

(5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；

(6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

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

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

**10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况**

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中山证券	-	-	-	-	-	-
中天证券	-	-	-	-	-	-
北京高华	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-



英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
财信证券	-	-	-	-	-	-
东海证券	-	-	-	-	-	-
国海证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
华菁证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
世纪证券	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
中原证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-
华融证券	-	-	-	-	-	-
南京证券	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-

申万宏源	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	关于广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-02-20
3	关于增加中金公司为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-09
4	关于增加东兴证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-14
5	关于广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-22
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
7	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
8	关于增加中金财富证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-17
9	关于增加万联证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-01
10	关于增加华福证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-30

## 11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发国证半导	1	20230101-20230630	697,842,964.0	672,321,100.00	547,796,300.0	822,367,764.00	34.88%

体芯片 交易型 开放式 指数证 券投资 基金联 接基金			0		0		
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响；</p> <p>2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险；</p> <p>3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理；</p> <p>4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形；</p> <p>5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。</p> <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书

### 12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

### 12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日