

易方达中证人工智能主题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：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 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 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	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
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	9
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	10
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
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
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1	资产负债表	13
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	17
§ 7	投资组合报告	108
7.1	期末基金资产组合情况	108
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	109
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	110
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	113
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	114
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	115
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	115
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	115
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	115

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	115
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	115
7.12	投资组合报告附注	115
§ 8	基金份额持有人信息	117
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	117
8.2	期末上市基金前十名持有人	117
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	118
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	118
§ 9	开放式基金份额变动	118
§ 10	重大事件揭示	119
10.1	基金份额持有人大会决议	119
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	119
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	119
10.4	基金投资策略的改变	119
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	119
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	119
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	120
10.8	其他重大事件	121
§ 11	备查文件目录	122
11.1	备查文件目录	122
11.2	存放地点	123
11.3	查阅方式	123

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证人工智能主题 ETF
场内简称	人工智能 ETF
基金主代码	159819
交易代码	159819
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 7 月 27 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	4,284,229,669.00 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 年 9 月 23 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。
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（含存托凭证）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。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。此外，本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，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，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。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。
业绩比较基准	中证人工智能主题指数收益率
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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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	198,118,359.48
本期利润	591,008,023.28
加权平均基金份额本期利润	0.1971

本期加权平均净值利润率	22.67%
本期基金份额净值增长率	34.83%
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	-400,290,698.06
期末可供分配基金份额利润	-0.0934
期末基金资产净值	3,883,938,970.94
期末基金份额净值	0.9066
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	-9.34%

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。

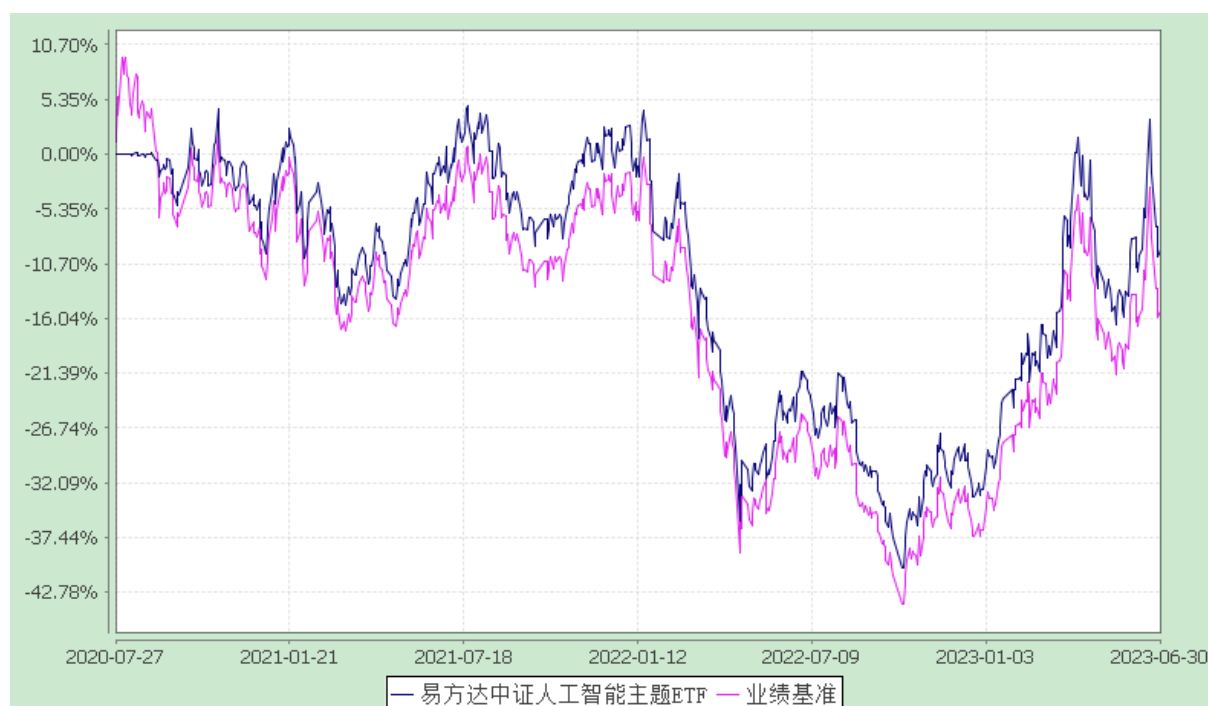
3.2 基金净值表现

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	0.24%	2.62%	-0.39%	2.62%	0.63%	0.00%
过去三个月	-2.91%	2.38%	-3.82%	2.40%	0.91%	-0.02%
过去六个月	34.83%	2.16%	33.79%	2.17%	1.04%	-0.01%
过去一年	15.12%	1.88%	13.62%	1.89%	1.50%	-0.01%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	-9.34%	1.64%	-15.29%	1.70%	5.95%	-0.06%

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

易方达中证人工智能主题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 7 月 27 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为-9.34%，同期业绩比较基准收益率为-15.29%。

§ 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		
张湛	本基金的基金经理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证全指证券公司 ETF（自 2020 年 04 月 30 日至 2023 年 05 月 19 日）、易方达中证万得生物科技指数（LOF）、易方达	2020-07-27	-	14 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数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证

	中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证物联网主题 ETF(自 2021 年 10 月 13 日至 2023 年 05 月 19 日)、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF (QDII)、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接 (QDII) 的基金经理助理				券公司指数 (LOF) 的基金经理。
李树建	本基金的基金经理助理，研究员	2023-04-15	-	5 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任国泰君安证券股份有限公司研究助理、分析师。

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遵规守信情况的说明

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 公平交易制度的执行情况

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，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 23 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，3 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。

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

本基金跟踪中证人工智能主题指数，该指数从沪深市场中选取 50 只业务涉及为人工智能提供基础资源、技术以及应用支持的上市公司证券作为指数样本，以反映人工智能主题上市公司证券的整体表现。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。

2023 年上半年，欧美主要国家的货币政策依然趋紧，但对美国加息力度缓和、货币政策走向宽松的预期一度对海外市场情绪有所提振。然而，美国经济运行状况及美联储货币政策趋向等因素依然为海外市场带来不确定性。我国在度过疫情高峰后，国内社会经济活动逐步恢复，但居民消费的恢复相对缓慢，消费意愿仍有待进一步修复。年初以来国内上市企业盈利小幅增长，增速逐步改善。随着生成式人工智能等先进技术的逐步成熟和各类新应用的不断涌现，人工智能板块焕发出前所未有的活力。人工智能相关的投资机会得到投资者的持续关注，指数在经历大幅攀涨后维持震荡。本报告期内，中证人工智能主题指数上涨 33.8%。

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 0.9066 元，本报告期份额净值增长率为 34.83%，同期业绩比较基准收益率为 33.79%，年化跟踪误差 0.83%，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

展望下一阶段，“推动经济运行整体好转，实现质的有效提升和量的合理增长”仍将是我国在经济工作方面的重要目标之一。6 月中的国务院常务会议指出要“加大宏观政策调控力度、着力扩大有效需求”，强调“具备条件的政策措施要及时出台、抓紧实施，同时加强政策措施的储备，最大限度发挥政策综合效应”。利率下调等一系列政策支持措施的逐步推出有望进一步提振企业和消费者的信心。与此同时，欧美等发达国家经济衰退的风险仍不可忽视，中国经济发展所面临的国际环境也将不断变化，国内外市场的波动仍可能持续。人工智能作为“十四五”规划中的国家重大科技项目之一，是我国实现高水平科技自立自强的重要一环，也是我国发展数字经济的重要载体之一。人工智能正在全球范围内引领新一轮科学技术、新兴产业的变革，人工智能的应用场景也将不断拓宽。我国目前已处在全球人工智能产业发展的第一梯队，在算法、算力和数据积累方面均拥有一定优势，随着人工智能技术的不断演进，内生驱动力不断形成，产业发展进入良性循环，我国人工智能市场规模也将迎来高速增长期，人工智能产业的投资价值将进一步凸显。作为前沿的新兴产业，人工智能各个相关领域的企业多处于探索、成长期，未来单个企业的突破方向和发展轨迹仍将存在变化，产业内部的结构和合作模式也有待确定。投资者在面临新兴产业的上述不确定性时，可以通过指数化的投资方式，借助指数分散化、规则化、自我更替等特性，分散风险、全面覆盖投资机会，从而更有效地分享该领域成长过程中的投资红利。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好人工智能领域投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

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、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。

4.7 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。

4.8 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——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

本托管人依法对易方达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：易方达中证人工智能主题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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	39,499,149.33	12,286,591.67
结算备付金		7,050,593.42	97,846.33
存出保证金		860,087.27	83,174.58
交易性金融资产	6.4.7.2	3,861,964,958.56	1,367,183,406.59
其中：股票投资		3,861,964,958.56	1,367,183,406.59
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	-	-
应收清算款		9,496,652.81	-
应收股利		68,942.38	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	308,167.64	99,485.56
资产总计		3,919,248,551.41	1,379,750,504.73
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		7,638,199.17	498,096.24
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		520,061.72	179,715.89
应付托管费		173,353.92	59,905.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		41,026.84	11,541.02
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	26,936,938.82	495,465.07
负债合计		35,309,580.47	1,244,723.49
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,284,229,669.00	2,050,229,669.00
未分配利润	6.4.7.8	-400,290,698.06	-671,723,887.76
净资产合计		3,883,938,970.94	1,378,505,781.24
负债和净资产总计		3,919,248,551.41	1,379,750,504.73

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.9066 元，基金份额总额 4,284,229,669.00 份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证人工智能主题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
一、营业总收入		594,153,889.93	-383,471,817.61
1.利息收入		4,087,134.41	1,700,400.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	79,572.02	39,788.79
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		4,007,562.39	1,660,611.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		194,808,860.05	-114,174,629.97
其中：股票投资收益	6.4.7.10	181,333,048.37	-121,778,739.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	319,366.96

资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	13,475,811.68	7,284,742.71
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	392,889,663.80	-271,953,951.71
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	2,368,231.67	956,363.73
减：二、营业总支出		3,145,866.65	1,833,532.45
1. 管理人报酬		1,922,301.44	1,071,917.36
2. 托管费		640,767.18	357,305.76
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		14,428.05	5,979.11
8. 其他费用	6.4.7.18	568,369.98	398,330.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		591,008,023.28	-385,305,350.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		591,008,023.28	-385,305,350.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		591,008,023.28	-385,305,350.06

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证人工智能主题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）	2,050,229,669.00	-671,723,887.76	1,378,505,781.24
二、本期期初净资产（基金净值）	2,050,229,669.00	-671,723,887.76	1,378,505,781.24
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,234,000,000.00	271,433,189.70	2,505,433,189.70

(一)、综合收益总额	-	591,008,023.28	591,008,023.28
(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)	2,234,000,000.00	-319,574,833.58	1,914,425,166.42
其中: 1.基金申购款	6,253,000,000.00	-656,892,461.41	5,596,107,538.59
2.基金赎回款	-4,019,000,000.00	337,317,627.83	-3,681,682,372.17
(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)	4,284,229,669.00	-400,290,698.06	3,883,938,970.94
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)	1,673,229,669.00	43,417,843.63	1,716,647,512.63
二、本期期初净资产(基金净值)	1,673,229,669.00	43,417,843.63	1,716,647,512.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	203,000,000.00	-442,135,662.10	-239,135,662.10
(一)、综合收益总额	-	-385,305,350.06	-385,305,350.06
(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)	203,000,000.00	-56,830,312.04	146,169,687.96
其中: 1.基金申购款	1,023,000,000.00	-179,133,472.68	843,866,527.32
2.基金赎回款	-820,000,000.00	122,303,160.64	-697,696,839.36
(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)	1,876,229,669.00	-398,717,818.47	1,477,511,850.53

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：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证人工智能主题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[2020]1123 号《关于准予易方达中证人工智能主题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《易方达中证人工智能主题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，《易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 7 月 27 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 6,155,229,669.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 118,669.00 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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》《易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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净资产变动情况等有关信息。

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 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《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》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《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》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。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，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。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。

对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，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，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。资管产品管理人运营资管产品转让 2017 年 12 月 31 日前取得的基金、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。

(2) 对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，股票的股息、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。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴 20% 的个人所得税。对基金从上市公司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，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按 50% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	39,499,149.33
等于：本金	39,494,793.17
加：应计利息	4,356.16
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	39,499,149.33

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		3,848,710,291.04	-	3,861,964,958.56	13,254,667.52
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	3,848,710,291.04	-	3,861,964,958.56	13,254,667.52

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

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 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	232,551.40
待摊费用	75,616.24
合计	308,167.64

6.4.7.6 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	1,146,539.94
其中：交易所市场	1,146,539.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
应付替代款	25,309,044.92
可退替代款	21,866.40
其他应付款	250,391.62
合计	26,936,938.82

6.4.7.7 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	2,050,229,669.00	2,050,229,669.00
本期申购	6,253,000,000.00	6,253,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,019,000,000.00	-4,019,000,000.00
本期末	4,284,229,669.00	4,284,229,669.00

6.4.7.8 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	-142,302,650.09	-529,421,237.67	-671,723,887.76
本期利润	198,118,359.48	392,889,663.80	591,008,023.28
本期基金份额交易产生的变动数	-95,322,929.72	-224,251,903.86	-319,574,833.58
其中：基金申购款	-264,248,705.63	-392,643,755.78	-656,892,461.41
基金赎回款	168,925,775.91	168,391,851.92	337,317,627.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-39,507,220.33	-360,783,477.73	-400,290,698.06

6.4.7.9 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	45,711.19
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	31,060.61
其他	2,800.22
合计	79,572.02

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 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	22,873,659.35
股票投资收益——赎回差价收入	158,459,389.02
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	181,333,048.37

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,499,147,082.71
减：卖出股票成本总额	2,471,538,494.97
减：交易费用	4,734,928.39
买卖股票差价收入	22,873,659.35

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	3,681,682,372.17
减：现金支付赎回款总额	1,503,409,346.17
减：赎回股票成本总额	2,019,813,636.98
减：交易费用	-
赎回差价收入	158,459,389.02

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 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	13,475,811.68
其中：证券出借权益补偿收入	707,440.00
基金投资产生的股利收益	-
合计	13,475,811.68

6.4.7.15 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	392,889,663.80
——股票投资	392,889,663.80
——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	392,889,663.80

6.4.7.16 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	-
替代损益收入	2,368,231.67
合计	2,368,231.67

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。

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 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	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	384,460.28
银行汇划费	430.00
其他	84,300.75
合计	568,369.98

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，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 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。

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

本报告期内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
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
易方达中证人工智能主题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：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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	926,903,779.74	15.94%	5,640.00	0.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 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。

6.4.10.1.4 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。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	92,690.75	5.22%	92,690.75	8.08%
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	3.38	0.00%	-	-
------	------	-------	---	---

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。

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	1,922,301.44	1,071,917.36
其中：支付销售机构的客户维护费	36,354.57	22,203.16

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，经基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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	640,767.18	357,305.76

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

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，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首日起 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日或不可抗力致使无法按时支付的，顺延至法定节假日、休息日结束之日起 3 个工作日内或不可抗力情形消除之日起 3 个工作日内支付。

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。

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	262,414,747.00	174,653.93	0.00	0.00
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	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	160,669,285.00	103,990.95	15,306,562.00	4,545.63

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	202301030000903	深信服	2023-01-03	312,500.00	2,500.00	14	3.20	388.89	0.00	0.00
广发证券	2023010300031225	芯原股份	2023-01-03	1,130,750.00	25,000.00	14	2.50	1,099.34	0.00	0.00

广发证 券	2023 0103 0003 3923	奥普特	2023- 01-03	275,5 60.00	2,000.00	14	3.2 0	342.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0103 0003 5213	澜起科 技	2023- 01-03	500,7 20.00	8,000.00	14	3.4 1	664.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0103 0003 5225	晶晨股 份	2023- 01-03	3,575 ,000. 00	50,000.00	14	3.4 1	4,740 .85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0103 0003 6901	万达信 息	2023- 01-03	369,2 50.00	42,200.00	14	3.2 0	459.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0103 0004 0193	万达信 息	2023- 01-03	437,5 00.00	50,000.00	14	2.0 0	340.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0105 0000 0845	光环新 网	2023- 01-05	172,9 00.00	19,000.00	14	3.2 0	215.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0105 0000 0848	深信服	2023- 01-05	625,0 00.00	5,000.00	14	3.2 0	777.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0106 0000 0984	晶晨股 份	2023- 01-06	83,40 0.00	1,200.00	14	3.2 0	103.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0110 0000 1088	晶晨股 份	2023- 01-10	69,78 0.00	1,000.00	14	3.2 0	124.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0111 0002 4441	万达信 息	2023- 01-11	1,130 ,883. 00	139,100.0 0	14	3.2 0	1,909 .94	0.00	0.00
广发证 券	2023 0112 0001 1877	澜起科 技	2023- 01-12	951,4 50.00	15,000.00	14	2.5 0	1,189 .31	0.00	0.00
广发证	2023	深信服	2023-	128,5	1,000.00	14	3.2	205.6	0.00	0.00

券	0112 0001 1879		01-12	00.00			0	0		
广发证 券	2023 0112 0001 4705	万达信 息	2023- 01-12	243,9 00.00	30,000.00	14	2.5 0	304.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0002 6951	万达信 息	2023- 01-17	434,5 00.00	50,000.00	6	2.0 0	313.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0003 1165	万达信 息	2023- 01-17	366,7 18.00	42,200.00	14	3.2 0	456.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0003 1489	晶晨股 份	2023- 01-17	3,824 ,000. 00	50,000.00	14	3.4 1	5,071 .05	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0003 4495	深信服	2023- 01-17	342,5 00.00	2,500.00	14	3.2 0	426.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0003 4749	澜起科 技	2023- 01-17	497,1 20.00	8,000.00	14	3.4 1	659.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0119 0000 0997	中科创 达	2023- 01-19	1,060 ,000. 00	10,000.00	14	1.8 0	742.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0119 0000 1007	全志科 技	2023- 01-19	197,8 24.00	8,800.00	14	3.4 0	261.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0120 0000 0338	晶晨股 份	2023- 01-20	2,706 ,800. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,578 .99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0120 0000 6677	晶晨股 份	2023- 01-20	96,96 0.00	1,200.00	14	3.2 0	120.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130	晶晨股 份	2023- 01-30	88,30 8.00	1,100.00	14	3.2 0	109.8 9	0.00	0.00

	0000 2327									
广发证 券	2023 0130 0008 4913	万达信 息	2023- 01-30	290,7 00.00	30,000.00	14	2.5 0	282.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8367	万达信 息	2023- 01-30	1,309 ,119. 00	135,100.0 0	14	3.2 0	1,629 .13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8375	澜起科 技	2023- 01-30	897,6 00.00	15,000.00	14	2.5 0	872.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8377	深信服	2023- 01-30	161,0 10.00	1,000.00	14	3.2 0	200.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8469	晶晨股 份	2023- 01-30	80,28 0.00	1,000.00	14	3.2 0	99.90	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0000 2050	寒武纪	2023- 01-31	217,3 50.00	3,500.00	14	3.2 0	270.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0000 2070	恒玄科 技	2023- 01-31	258,4 38.00	1,900.00	14	3.2 0	321.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0002 4675	澜起科 技	2023- 01-31	443,2 80.00	8,000.00	7	3.4 1	293.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0002 7001	万达信 息	2023- 01-31	402,5 88.00	42,200.00	14	3.2 0	501.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0002 8511	晶晨股 份	2023- 01-31	3,881 ,000. 00	50,000.00	7	3.4 1	2,573 .32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0201 0000	万达信 息	2023- 02-01	1,191 ,600. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	1,626 .53	0.00	0.00

	1110									
广发证 券	2023 0202 0001 3711	全志科 技	2023- 02-02	206,2 72.00	8,800.00	14	3.4 0	272.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0202 0001 4037	中科创 达	2023- 02-02	398,8 60.00	3,500.00	8	1.8 0	159.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0203 0000 0846	晶晨股 份	2023- 02-03	242,7 90.00	3,000.00	14	3.2 0	302.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0203 0001 0836	晶晨股 份	2023- 02-03	2,711 ,155. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,584 .75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0208 0000 0806	晶晨股 份	2023- 02-08	3,866 ,404. 00	50,200.00	14	3.5 1	5,277 .64	0.00	0.00
广发证 券	2023 0210 0000 1095	澜起科 技	2023- 02-10	109,6 20.00	1,800.00	14	2.5 0	106.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0210 0000 4050	中科创 达	2023- 02-10	358,8 20.00	3,500.00	14	1.8 0	251.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213 0000 1622	深信服	2023- 02-13	184,9 64.00	1,300.00	14	3.2 0	230.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213 0007 1958	万达信 息	2023- 02-13	298,8 00.00	30,000.00	14	2.5 0	290.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213 0007 1968	万达信 息	2023- 02-13	1,345 ,596. 00	135,100.0 0	14	3.2 0	1,674 .52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213 0007 3130	澜起科 技	2023- 02-13	942,7 50.00	15,000.00	14	2.5 0	916.5 6	0.00	0.00

广发证 券	2023 0213 0007 3132	深信服	2023- 02-13	142,2 80.00	1,000.00	14	3.2 0	177.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0214 0002 1611	万达信 息	2023- 02-14	415,6 70.00	42,200.00	14	3.2 0	517.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0214 0002 4663	恒玄科 技	2023- 02-14	257,1 65.00	1,900.00	14	3.2 0	320.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0214 0002 6433	寒武纪	2023- 02-14	299,1 80.00	3,500.00	14	3.2 0	372.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0215 0001 9532	万达信 息	2023- 02-15	1,224 ,000. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	1,670 .76	0.00	0.00
广发证 券	2023 0216 0001 3815	全志科 技	2023- 02-16	209,9 68.00	8,800.00	14	3.4 0	277.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0217 0001 9672	晶晨股 份	2023- 02-17	2,774 ,805. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,668 .91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0221 0000 0890	富瀚微	2023- 02-21	69,88 3.00	1,100.00	14	3.2 0	86.97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0222 0000 0758	全志科 技	2023- 02-22	32,46 6.00	1,400.00	14	3.2 0	40.40	0.00	0.00
广发证 券	2023 0222 0000 0767	芯原股 份	2023- 02-22	441,5 04.00	7,200.00	14	3.2 0	549.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0222 0000 5368	晶晨股 份	2023- 02-22	4,254 ,952. 00	50,200.00	14	3.5 1	5,808 .01	0.00	0.00
广发证	2023	全志科	2023-	82,83	3,600.00	14	3.2	103.0	0.00	0.00

券	0223 0000 1367	技	02-23	6.00			0	8		
广发证 券	2023 0224 0000 3372	澜起科 技	2023- 02-24	104,9 94.00	1,800.00	14	2.5 0	102.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0224 0000 3382	中科创 达	2023- 02-24	325,5 00.00	3,500.00	14	1.8 0	227.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0005 8278	澜起科 技	2023- 02-27	870,0 00.00	15,000.00	14	2.5 0	845.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0005 8330	万达信 息	2023- 02-27	281,4 00.00	30,000.00	14	2.5 0	273.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0006 1852	万达信 息	2023- 02-27	1,267 ,238. 00	135,100.0 0	14	3.2 0	1,577 .01	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0006 2754	深信服	2023- 02-27	137,2 10.00	1,000.00	14	3.2 0	170.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0228 0002 0324	万达信 息	2023- 02-28	407,6 52.00	42,200.00	7	3.2 0	253.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0228 0002 1900	寒武纪	2023- 02-28	293,8 95.00	3,500.00	14	3.2 0	365.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0301 0001 6037	万达信 息	2023- 03-01	1,231 ,200. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	1,680 .59	0.00	0.00
广发证 券	2023 0302 0000 0982	美亚柏 科	2023- 03-02	308,5 44.00	19,200.00	14	2.5 0	299.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0302	万达信 息	2023- 03-02	78,50 8.00	7,600.00	14	2.5 0	76.33	0.00	0.00

	0000 0985									
广发证 券	2023 0303 0001 2131	晶晨股 份	2023- 03-03	2,566 ,100. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,392 .95	0.00	0.00
广发证 券	2023 0306 0000 0823	景嘉微	2023- 03-06	746,1 12.00	9,600.00	14	3.4 0	986.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0308 0000 6980	全志科 技	2023- 03-08	32,35 4.00	1,400.00	14	3.2 0	40.26	0.00	0.00
广发证 券	2023 0308 0000 6982	晶晨股 份	2023- 03-08	3,719 ,820. 00	50,200.00	14	3.5 1	5,077 .55	0.00	0.00
广发证 券	2023 0309 0000 0823	景嘉微	2023- 03-09	985,7 04.00	13,400.00	14	3.4 0	1,303 .32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0309 0000 7026	全志科 技	2023- 03-09	84,31 2.00	3,600.00	14	3.2 0	104.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0310 0000 1375	万达信 息	2023- 03-10	63,83 0.00	6,500.00	14	3.2 0	79.43	0.00	0.00
广发证 券	2023 0310 0000 1391	芯原股 份	2023- 03-10	189,1 68.00	2,800.00	14	3.2 0	235.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0310 0000 5579	澜起科 技	2023- 03-10	100,5 84.00	1,800.00	14	2.5 0	97.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0313 0005 9288	万达信 息	2023- 03-13	1,384 ,775. 00	135,100.0 0	14	3.2 0	1,723 .28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0313 0006	深信服	2023- 03-13	147,6 00.00	1,000.00	14	3.2 0	183.6 8	0.00	0.00

	3884									
广发证 券	2023 0314 0002 0868	寒武纪	2023- 03-14	360,1 15.00	3,500.00	14	3.2 0	448.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0315 0001 7535	万达信 息	2023- 03-15	1,192 ,800. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	1,628 .17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0316 0001 4904	美亚柏 科	2023- 03-16	323,3 28.00	19,200.00	14	2.5 0	314.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0317 0001 0443	晶晨股 份	2023- 03-17	2,510 ,490. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,319 .43	0.00	0.00
广发证 券	2023 0322 0000 0698	美亚柏 科	2023- 03-22	61,48 8.00	3,600.00	14	3.2 0	81.98	0.00	0.00
广发证 券	2023 0322 0000 8171	晶晨股 份	2023- 03-22	4,196 ,720. 00	50,200.00	14	3.5 1	6,137 .70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0323 0000 0805	美亚柏 科	2023- 03-23	18,84 3.00	1,100.00	14	3.4 0	24.91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0323 0000 6660	景嘉微	2023- 03-23	1,354 ,874. 00	13,400.00	14	3.4 0	1,791 .44	0.00	0.00
广发证 券	2023 0324 0000 0993	奥普特	2023- 03-24	136,9 70.00	1,000.00	14	3.4 1	181.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0324 0000 0997	芯原股 份	2023- 03-24	733,9 10.00	7,900.00	14	3.2 0	913.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0324 0000 5425	澜起科 技	2023- 03-24	126,3 06.00	1,800.00	14	2.5 0	122.8 0	0.00	0.00

广发证 券	2023 0324 0000 5441	芯原股 份	2023- 03-24	167,2 20.00	1,800.00	14	3.2 0	208.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0327 0005 8383	深信服	2023- 03-27	140,6 90.00	1,000.00	14	3.2 0	175.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0327 0006 7381	万达信 息	2023- 03-27	1,476 ,643. 00	135,100.0 0	14	3.2 0	1,837 .60	0.00	0.00
广发证 券	2023 0328 0002 5447	寒武纪	2023- 03-28	602,0 00.00	3,500.00	14	3.2 0	749.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0329 0001 5912	万达信 息	2023- 03-29	1,342 ,800. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	1,832 .92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0330 0001 6393	美亚柏 科	2023- 03-30	374,4 00.00	19,200.00	14	2.5 0	364.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0331 0001 1735	晶晨股 份	2023- 03-31	2,818 ,020. 00	33,500.00	14	3.4 0	3,726 .05	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 3940	美亚柏 科	2023- 04-06	27,50 0.00	1,000.00	14	3.4 0	36.36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 4112	景嘉微	2023- 04-06	1,709 ,438. 00	13,400.00	14	3.4 0	2,260 .26	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 7072	晶晨股 份	2023- 04-06	4,694 ,704. 00	50,200.00	14	3.5 1	6,408 .27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 7242	美亚柏 科	2023- 04-06	99,00 0.00	3,600.00	14	3.2 0	123.2 0	0.00	0.00
广发证	2023	澜起科	2023-	137,3	1,800.00	14	2.5	133.5	0.00	0.00

券	0407 0000 8593	技	04-07	40.00			0	3		
广发证 券	2023 0407 0000 8601	芯原股 份	2023- 04-07	862,3 64.00	7,900.00	14	3.2 0	1,073 .16	0.00	0.00
广发证 券	2023 0407 0000 8625	芯原股 份	2023- 04-07	196,4 88.00	1,800.00	14	3.2 0	244.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0000 4848	瑞芯微	2023- 04-10	990,8 91.00	9,900.00	14	3.2 0	1,233 .11	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0001 6925	浪潮信 息	2023- 04-10	380,5 00.00	10,000.00	14	1.7 0	251.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0001 6929	科大讯 飞	2023- 04-10	1,208 ,475. 00	20,500.00	14	1.7 0	798.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0001 6931	瑞芯微	2023- 04-10	1,050 ,945. 00	10,500.00	14	1.7 0	694.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0001 8179	浪潮信 息	2023- 04-10	391,9 15.00	10,300.00	14	1.7 0	259.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0003 4069	三六零	2023- 04-10	2,161 ,134. 00	129,100.0 0	14	1.7 0	1,428 .75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0003 4415	佳都科 技	2023- 04-10	71,00 0.00	10,000.00	14	1.7 0	46.94	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0005 6181	深信服	2023- 04-10	147,2 10.00	1,000.00	14	3.2 0	183.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410	万达信 息	2023- 04-10	1,393 ,000.	100,000.0 0	14	3.2 0	1,733 .51	0.00	0.00

	0005 8417			00						
广发证 券	2023 0411 0001 1806	广电运 通	2023- 04-11	883,7 28.00	68,400.00	14	1.7 0	584.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0001 1808	太极股 份	2023- 04-11	677,8 17.00	15,900.00	14	1.7 0	448.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 5386	中国软 件	2023- 04-12	3,928 ,860. 00	58,500.00	14	1.7 0	2,597 .41	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 5470	佳都科 技	2023- 04-12	660,9 28.00	89,800.00	14	1.7 0	436.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 5816	太极股 份	2023- 04-12	135,8 40.00	3,000.00	14	1.7 0	89.81	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 5818	千方科 技	2023- 04-12	547,6 00.00	37,000.00	14	1.7 0	362.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 8046	千方科 技	2023- 04-12	592,0 00.00	40,000.00	14	1.7 0	391.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0002 6908	万达信 息	2023- 04-12	1,749 ,600. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	2,388 .20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 6345	中科曙 光	2023- 04-13	439,1 16.00	11,100.00	14	1.7 0	290.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 6441	浪潮信 息	2023- 04-13	644,5 02.00	16,300.00	14	1.7 0	426.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000	太极股 份	2023- 04-13	444,2 00.00	10,000.00	14	1.7 0	293.6 7	0.00	0.00

	7261									
广发证 券	2023 0413 0001 6299	美亚柏 科	2023- 04-13	81,57 0.00	3,000.00	14	2.5 0	79.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 4557	佳都科 技	2023- 04-14	58,00 0.00	8,000.00	14	1.7 0	38.34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 5075	浪潮信 息	2023- 04-14	392,8 90.00	10,100.00	14	1.7 0	259.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 5301	太极股 份	2023- 04-14	644,2 15.00	14,300.00	14	1.7 0	425.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 5687	中科曙 光	2023- 04-14	24,91 8.00	600.00	14	1.7 0	16.47	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 9235	晶晨股 份	2023- 04-14	1,834 ,800. 00	20,000.00	14	3.4 0	2,426 .01	0.00	0.00
广发证 券	2023 0417 0000 9316	中科曙 光	2023- 04-17	3,048 ,500. 00	70,000.00	14	3.2 0	4,606 .62	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1682	富瀚微	2023- 04-18	182,8 25.00	2,500.00	14	1.8 0	274.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1684	全志科 技	2023- 04-18	304,7 61.00	9,300.00	14	1.8 0	243.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1685	北京君 正	2023- 04-18	523,1 58.00	5,100.00	14	1.8 0	418.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1686	中科创 达	2023- 04-18	687,6 54.00	6,900.00	14	1.8 0	550.1 2	0.00	0.00

广发证 券	2023 0418 0000 1698	深信服	2023- 04-18	710,5 18.00	5,300.00	14	1.8 0	568.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1704	景嘉微	2023- 04-18	518,7 84.00	4,800.00	14	1.8 0	415.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1706	易华录	2023- 04-18	385,7 30.00	8,500.00	14	1.8 0	308.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1707	万达信 息	2023- 04-18	426,7 30.00	30,700.00	14	1.8 0	341.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1710	广电运 通	2023- 04-18	334,2 24.00	26,400.00	14	1.8 0	267.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1715	德赛西 威	2023- 04-18	672,4 52.00	5,800.00	14	1.8 0	537.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1717	启明星 辰	2023- 04-18	473,9 96.00	14,200.00	14	1.8 0	379.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1722	千方科 技	2023- 04-18	342,6 30.00	23,500.00	14	1.8 0	274.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1723	太极股 份	2023- 04-18	402,4 80.00	8,600.00	14	1.8 0	321.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1727	美亚柏 科	2023- 04-18	274,1 20.00	11,000.00	14	1.8 0	219.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1729	光环新 网	2023- 04-18	383,9 95.00	30,500.00	14	1.8 0	307.2 0	0.00	0.00
广发证	2023	拓邦股	2023-	267,2	21,500.00	14	1.8	213.8	0.00	0.00

券	0418 0000 1733	份	04-18	45.00			0	0		
广发证 券	2023 0418 0000 1734	中科曙 光	2023- 04-18	1,197 ,000. 00	25,000.00	14	1.8 0	957.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1739	宝信软 件	2023- 04-18	723,2 40.00	12,600.00	14	1.8 0	578.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1740	大华股 份	2023- 04-18	959,3 73.00	38,700.00	14	1.8 0	767.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1743	瑞芯微	2023- 04-18	315,0 00.00	3,500.00	14	1.8 0	252.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1747	紫光股 份	2023- 04-18	1,393 ,446. 00	42,600.00	14	1.8 0	1,114 .76	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1748	澜起科 技	2023- 04-18	1,194 ,492. 00	16,900.00	14	1.8 0	955.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1751	均胜电 子	2023- 04-18	303,4 85.00	20,300.00	14	1.8 0	242.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1752	四维图 新	2023- 04-18	680,3 94.00	50,700.00	14	1.8 0	544.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1753	和而泰	2023- 04-18	327,6 66.00	19,400.00	14	1.8 0	262.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1756	虹软科 技	2023- 04-18	155,8 04.00	4,400.00	14	1.8 0	124.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418	用友网 络	2023- 04-18	1,042 ,002.	43,800.00	14	1.8 0	833.6 0	0.00	0.00

	0000 1763			00						
广发证 券	2023 0418 0000 1764	东软集 团	2023- 04-18	205,8 75.00	18,300.00	14	1.8 0	164.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1765	科大讯 飞	2023- 04-18	2,366 ,496. 00	39,600.00	14	1.8 0	1,893 .20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1766	科华数 据	2023- 04-18	301,3 92.00	6,900.00	14	1.8 0	241.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1768	东华软 件	2023- 04-18	378,7 38.00	47,700.00	14	1.8 0	302.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1769	海康威 视	2023- 04-18	2,886 ,702. 00	66,300.00	14	1.8 0	2,309 .36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1774	神州信 息	2023- 04-18	143,8 50.00	10,500.00	14	1.8 0	115.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1775	北斗星 通	2023- 04-18	259,0 84.00	7,600.00	14	1.8 0	207.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1776	浪潮信 息	2023- 04-18	910,8 04.00	21,800.00	14	1.8 0	728.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1778	奥普特	2023- 04-18	246,6 00.00	1,500.00	14	1.8 0	197.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1782	晶晨股 份	2023- 04-18	544,9 13.00	6,100.00	14	1.8 0	435.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000	石头科 技	2023- 04-18	490,0 50.00	1,500.00	14	1.8 0	392.0 4	0.00	0.00

	1784									
广发证 券	2023 0418 0000 1792	佳都科 技	2023- 04-18	227,5 89.00	32,100.00	14	1.8 0	182.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1800	中国软 件	2023- 04-18	565,2 50.00	8,500.00	14	1.8 0	452.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1801	寒武纪	2023- 04-18	822,2 76.00	4,200.00	14	1.8 0	657.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1807	芯原股 份	2023- 04-18	502,0 69.00	5,300.00	14	1.8 0	401.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1810	汇顶科 技	2023- 04-18	337,4 44.00	5,800.00	14	1.8 0	269.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1811	极米科 技	2023- 04-18	302,1 00.00	1,500.00	14	1.8 0	241.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1815	安恒信 息	2023- 04-18	351,0 60.00	1,500.00	14	1.8 0	280.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1820	三六零	2023- 04-18	996,6 94.00	60,700.00	14	1.8 0	797.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1822	科沃斯	2023- 04-18	389,5 20.00	4,800.00	14	1.8 0	311.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1827	电科数 字	2023- 04-18	195,2 75.00	7,300.00	14	1.8 0	156.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1829	恒玄科 技	2023- 04-18	239,6 25.00	1,500.00	14	1.8 0	191.7 0	0.00	0.00

广发证 券	2023 0418 0000 1835	韦尔股 份	2023- 04-18	1,563 ,000. 00	15,000.00	14	1.8 0	1,250 .40	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0000 6963	浪潮信 息	2023- 04-20	442,6 94.00	10,300.00	14	3.1 0	533.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0000 7009	三六零	2023- 04-20	440,0 46.00	26,100.00	14	3.1 0	530.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0001 0723	晶晨股 份	2023- 04-20	4,733 ,860. 00	50,200.00	14	3.5 1	6,461 .72	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0001 0779	三六零	2023- 04-20	724,9 80.00	43,000.00	14	3.1 0	874.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0001 0781	三六零	2023- 04-20	13,51 4,976 .00	801,600.0 0	14	3.1 0	16,29 3.05	0.00	0.00
广发证 券	2023 0421 0000 6767	澜起科 技	2023- 04-21	129,7 08.00	1,800.00	14	2.5 0	126.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0424 0003 3009	三六零	2023- 04-24	2,140 ,478. 00	129,100.0 0	14	3.1 0	2,580 .47	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0001 7090	佳都科 技	2023- 04-26	598,0 68.00	89,800.00	14	3.1 0	721.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0002 1568	千方科 技	2023- 04-26	528,4 00.00	40,000.00	14	3.1 0	637.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0002 1628	千方科 技	2023- 04-26	488,7 70.00	37,000.00	14	3.1 0	589.2 4	0.00	0.00
广发证	2023	太极股	2023-	116,1	3,000.00	14	3.1	139.9	0.00	0.00

券	0426 0002 1676	份	04-26	00.00			0	7		
广发证 券	2023 0426 0002 2684	万达信 息	2023- 04-26	1,470 ,000. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	2,006 .55	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0002 6980	中国软 件	2023- 04-26	3,357 ,900. 00	58,500.00	14	3.1 0	4,048 .14	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0000 4625	浪潮信 息	2023- 04-27	2,119 ,000. 00	50,000.00	14	8.0 2	6,608 .93	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0001 2220	太极股 份	2023- 04-27	394,0 00.00	10,000.00	14	3.1 0	474.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0001 2240	浪潮信 息	2023- 04-27	690,7 94.00	16,300.00	14	3.1 0	832.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0001 6604	美亚柏 科	2023- 04-27	62,85 0.00	3,000.00	14	2.5 0	61.10	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0001 6660	中科曙 光	2023- 04-27	534,0 21.00	11,100.00	14	3.1 0	643.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0000 6566	晶晨股 份	2023- 04-28	1,673 ,400. 00	20,000.00	14	3.4 0	2,212 .61	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0000 6984	佳都科 技	2023- 04-28	56,16 0.00	8,000.00	14	3.1 0	67.70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0000 9780	太极股 份	2023- 04-28	575,0 03.00	14,300.00	14	3.1 0	693.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428	浪潮信 息	2023- 04-28	415,1 10.00	10,100.00	14	3.1 0	500.4 4	0.00	0.00

	0001 1452									
广发证 券	2023 0504 0002 2481	启明星 辰	2023- 05-04	431,6 80.00	14,200.00	14	1.8 0	302.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2487	美亚柏 科	2023- 05-04	259,4 90.00	11,000.00	14	1.8 0	181.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2501	澜起科 技	2023- 05-04	1,003 ,015. 00	16,900.00	14	1.8 0	702.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2513	三六零	2023- 05-04	392,5 44.00	26,100.00	14	3.1 0	473.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2547	中科创 达	2023- 05-04	559,7 97.00	6,900.00	14	1.8 0	391.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2553	北斗星 通	2023- 05-04	245,9 36.00	7,600.00	14	1.8 0	172.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2585	用友网 络	2023- 05-04	912,3 54.00	43,800.00	14	1.8 0	638.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2587	晶晨股 份	2023- 05-04	479,4 60.00	6,100.00	14	1.8 0	335.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2589	中国软 件	2023- 05-04	486,9 65.00	8,500.00	14	1.8 0	340.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 2629	拓邦股 份	2023- 05-04	241,6 60.00	21,500.00	14	1.8 0	169.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002	深信服	2023- 05-04	624,8 17.00	5,300.00	14	1.8 0	437.3 7	0.00	0.00

	2631									
广发证 券	2023 0504 0002 5521	安恒信 息	2023- 05-04	302,2 95.00	1,500.00	14	1.8 0	211.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 5589	三六零	2023- 05-04	646,7 20.00	43,000.00	14	3.1 0	779.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 5591	三六零	2023- 05-04	12,05 6,064 .00	801,600.0 0	14	3.1 0	14,53 4.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 5677	中科曙 光	2023- 05-04	3,552 ,500. 00	70,000.00	14	3.1 0	4,282 .74	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0002 5693	寒武纪	2023- 05-04	977,7 60.00	4,200.00	14	1.8 0	684.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6841	宝信软 件	2023- 05-04	672,3 36.00	12,600.00	14	1.8 0	470.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6867	北京君 正	2023- 05-04	428,6 55.00	5,100.00	14	1.8 0	300.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6885	虹软科 技	2023- 05-04	151,8 44.00	4,400.00	14	1.8 0	106.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6905	德赛西 威	2023- 05-04	588,8 74.00	5,800.00	14	1.8 0	412.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6907	四维图 新	2023- 05-04	590,6 55.00	50,700.00	14	1.8 0	413.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6913	浪潮信 息	2023- 05-04	912,9 84.00	21,800.00	14	1.8 0	639.0 9	0.00	0.00

广发证 券	2023 0504 0003 6915	神州信 息	2023- 05-04	130,7 25.00	10,500.00	14	1.8 0	91.51	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6953	浪潮信 息	2023- 05-04	431,3 64.00	10,300.00	14	3.1 0	520.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3843	晶晨股 份	2023- 05-04	3,945 ,720. 00	50,200.00	14	3.5 1	5,385 .91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3855	千方科 技	2023- 05-04	324,5 35.00	23,500.00	14	1.8 0	227.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3913	全志科 技	2023- 05-04	236,6 85.00	9,300.00	14	1.8 0	165.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3915	和而泰	2023- 05-04	303,8 04.00	19,400.00	14	1.8 0	212.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3933	佳都科 技	2023- 05-04	245,5 65.00	32,100.00	14	1.8 0	171.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3935	芯原股 份	2023- 05-04	437,1 44.00	5,300.00	14	1.8 0	306.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3937	科华数 据	2023- 05-04	285,7 98.00	6,900.00	14	1.8 0	200.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 4011	科大讯 飞	2023- 05-04	2,375 ,604. 00	39,600.00	14	1.8 0	1,662 .92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9701	太极股 份	2023- 05-04	332,9 06.00	8,600.00	14	1.8 0	233.0 3	0.00	0.00
广发证	2023	万达信	2023-	393,5	30,700.00	14	1.8	275.5	0.00	0.00

券	0504 0004 9703	息	05-04	74.00			0	0		
广发证 券	2023 0504 0004 9711	极米科 技	2023- 05-04	242,0 70.00	1,500.00	14	1.8 0	169.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9719	科沃斯	2023- 05-04	340,8 00.00	4,800.00	14	1.8 0	238.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9721	恒玄科 技	2023- 05-04	180,9 00.00	1,500.00	14	1.8 0	126.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9761	瑞芯微	2023- 05-04	250,1 80.00	3,500.00	14	1.8 0	175.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1727	电科数 字	2023- 05-04	170,6 01.00	7,300.00	14	1.8 0	119.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1729	三六零	2023- 05-04	912,9 28.00	60,700.00	14	1.8 0	639.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1731	汇顶科 技	2023- 05-04	293,4 22.00	5,800.00	14	1.8 0	205.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1733	广电运 通	2023- 05-04	316,2 72.00	26,400.00	14	1.8 0	221.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1751	均胜电 子	2023- 05-04	314,0 41.00	20,300.00	14	1.8 0	219.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1753	东软集 团	2023- 05-04	211,1 82.00	18,300.00	14	1.8 0	147.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504	东华软 件	2023- 05-04	370,1 52.00	47,700.00	14	1.8 0	259.1 1	0.00	0.00

	0005 1755									
广发证 券	2023 0504 0005 1757	石头科 技	2023- 05-04	478,6 05.00	1,500.00	14	1.8 0	335.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1769	大华股 份	2023- 05-04	910,9 98.00	38,700.00	14	1.8 0	637.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1819	中科曙 光	2023- 05-04	1,268 ,750. 00	25,000.00	14	1.8 0	888.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1821	光环新 网	2023- 05-04	360,2 05.00	30,500.00	14	1.8 0	252.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1823	易华录	2023- 05-04	274,3 80.00	8,500.00	14	1.8 0	192.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1885	韦尔股 份	2023- 05-04	1,382 ,850. 00	15,000.00	14	1.8 0	968.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1911	景嘉微	2023- 05-04	406,1 76.00	4,800.00	14	1.8 0	284.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 3679	紫光股 份	2023- 05-04	1,231 ,992. 00	42,600.00	14	1.8 0	862.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 3707	海康威 视	2023- 05-04	2,466 ,360. 00	66,300.00	14	1.8 0	1,726 .45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 3745	奥普特	2023- 05-04	219,9 15.00	1,500.00	14	1.8 0	153.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0505 0001	澜起科 技	2023- 05-05	106,0 92.00	1,800.00	14	2.5 0	103.1 5	0.00	0.00

	1785									
广发证 券	2023 0508 0003 9529	三六零	2023- 05-08	1,961 ,029. 00	129,100.0 0	14	3.1 0	2,364 .13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0000 5330	科华数 据	2023- 05-10	85,05 0.00	2,100.00	14	3.2 0	105.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0002 0110	佳都科 技	2023- 05-10	655,5 40.00	89,800.00	14	3.1 0	790.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0002 4094	万达信 息	2023- 05-10	1,912 ,800. 00	120,000.0 0	14	3.5 1	2,610 .97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0003 0588	太极股 份	2023- 05-10	123,7 50.00	3,000.00	14	3.1 0	149.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0000 3360	三六零	2023- 05-11	441,3 00.00	30,000.00	14	4.6 3	794.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0000 7453	太极股 份	2023- 05-11	392,5 00.00	10,000.00	14	3.1 0	473.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0000 7477	浪潮信 息	2023- 05-11	1,767 ,000. 00	50,000.00	14	8.0 2	5,511 .08	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0000 7503	美亚柏 科	2023- 05-11	64,92 0.00	3,000.00	14	2.5 0	63.12	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0001 5891	中科曙 光	2023- 05-11	514,4 85.00	11,100.00	14	3.1 0	620.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0001 5923	浪潮信 息	2023- 05-11	576,0 42.00	16,300.00	14	3.1 0	694.4 5	0.00	0.00

广发证 券	2023 0512 0000 4604	浪潮信 息	2023- 05-12	358,6 51.00	10,100.00	14	3.1 0	432.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0512 0000 6196	佳都科 技	2023- 05-12	57,20 0.00	8,000.00	14	3.1 0	68.96	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0000 2007	四维图 新	2023- 05-18	462,7 59.00	40,700.00	14	3.2 0	575.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0000 5412	富瀚微	2023- 05-18	142,0 25.00	2,500.00	14	1.8 0	99.42	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 9880	浪潮信 息	2023- 05-18	847,8 02.00	21,800.00	7	1.8 0	296.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 9964	佳都科 技	2023- 05-18	237,2 19.00	32,100.00	7	1.8 0	83.03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 9966	芯原股 份	2023- 05-18	421,2 44.00	5,300.00	7	1.8 0	147.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1104	韦尔股 份	2023- 05-18	1,431 ,000. 00	15,000.00	7	1.8 0	500.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1154	奥普特	2023- 05-18	238,8 00.00	1,500.00	7	1.8 0	83.58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1164	科华数 据	2023- 05-18	276,8 28.00	6,900.00	7	1.8 0	96.89	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1186	中科创 达	2023- 05-18	629,9 70.00	6,900.00	7	1.8 0	220.4 9	0.00	0.00
广发证	2023	汇顶科	2023-	289,4	5,800.00	7	1.8	101.3	0.00	0.00

券	0518 0002 1232	技	05-18	78.00			0	2		
广发证 券	2023 0518 0002 1240	广电运 通	2023- 05-18	310,2 00.00	26,400.00	7	1.8 0	108.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1288	东华软 件	2023- 05-18	345,3 48.00	47,700.00	7	1.8 0	120.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1292	石头科 技	2023- 05-18	454,7 40.00	1,500.00	7	1.8 0	159.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1294	均胜电 子	2023- 05-18	300,0 34.00	20,300.00	7	1.8 0	105.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1296	景嘉微	2023- 05-18	414,0 00.00	4,800.00	7	1.8 0	144.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 1298	紫光股 份	2023- 05-18	1,215 ,378. 00	42,600.00	7	1.8 0	425.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 6546	用友网 络	2023- 05-18	880,3 80.00	43,800.00	7	1.8 0	308.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 6548	晶晨股 份	2023- 05-18	505,1 41.00	6,100.00	7	1.8 0	176.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 6560	安恒信 息	2023- 05-18	271,1 70.00	1,500.00	7	1.8 0	94.91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 6576	海康威 视	2023- 05-18	2,355 ,639. 00	66,300.00	7	1.8 0	824.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518	启明星 辰	2023- 05-18	414,6 40.00	14,200.00	7	1.8 0	145.1 2	0.00	0.00

	0002 6622									
广发证 券	2023 0518 0002 8198	晶晨股 份	2023- 05-18	4,157 ,062. 00	50,200.00	7	3.5 1	2,837 .19	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8222	瑞芯微	2023- 05-18	273,8 05.00	3,500.00	7	1.8 0	95.83	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8230	德赛西 威	2023- 05-18	609,0 58.00	5,800.00	7	1.8 0	213.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8232	四维图 新	2023- 05-18	576,4 59.00	50,700.00	7	1.8 0	201.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8242	拓邦股 份	2023- 05-18	239,2 95.00	21,500.00	7	1.8 0	83.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8252	深信服	2023- 05-18	647,5 54.00	5,300.00	7	1.8 0	226.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8310	宝信软 件	2023- 05-18	663,7 68.00	12,600.00	7	1.8 0	232.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8328	和而泰	2023- 05-18	299,9 24.00	19,400.00	7	1.8 0	104.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0002 8336	科大讯 飞	2023- 05-18	2,423 ,124. 00	39,600.00	7	1.8 0	848.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 0126	三六零	2023- 05-18	618,7 70.00	43,000.00	7	3.1 0	372.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003	三六零	2023- 05-18	8,094 ,375. 00	562,500.0 0	7	3.1 0	4,879 .11	0.00	0.00

	0128									
广发证 券	2023 0518 0003 0140	易华录	2023- 05-18	272,0 00.00	8,500.00	7	1.8 0	95.20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 0166	虹软科 技	2023- 05-18	173,7 12.00	4,400.00	7	1.8 0	60.80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 0242	浪潮信 息	2023- 05-18	400,5 67.00	10,300.00	7	3.1 0	241.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 2290	万达信 息	2023- 05-18	435,3 26.00	30,700.00	7	1.8 0	152.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 2358	澜起科 技	2023- 05-18	980,2 00.00	16,900.00	7	1.8 0	343.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3832	神州信 息	2023- 05-18	126,3 15.00	10,500.00	7	1.8 0	44.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3888	北京君 正	2023- 05-18	429,7 77.00	5,100.00	7	1.8 0	150.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3896	科沃斯	2023- 05-18	320,4 00.00	4,800.00	7	1.8 0	112.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3898	恒玄科 技	2023- 05-18	217,5 00.00	1,500.00	7	1.8 0	76.13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3910	电科数 字	2023- 05-18	174,1 05.00	7,300.00	7	1.8 0	60.94	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 3912	三六零	2023- 05-18	873,4 73.00	60,700.00	7	1.8 0	305.7 2	0.00	0.00

广发证 券	2023 0518 0003 3932	东软集 团	2023- 05-18	195,9 93.00	18,300.00	7	1.8 0	68.60	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4228	中国软 件	2023- 05-18	475,4 05.00	8,500.00	7	1.8 0	166.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4236	大华股 份	2023- 05-18	865,3 32.00	38,700.00	7	1.8 0	302.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4300	中科曙 光	2023- 05-18	1,208 ,500. 00	25,000.00	7	1.8 0	422.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4302	光环新 网	2023- 05-18	339,7 70.00	30,500.00	7	1.8 0	118.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4312	美亚柏 科	2023- 05-18	240,9 00.00	11,000.00	7	1.8 0	84.32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4354	千方科 技	2023- 05-18	289,5 20.00	23,500.00	7	1.8 0	101.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4856	北斗星 通	2023- 05-18	254,4 48.00	7,600.00	7	1.8 0	89.06	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4878	太极股 份	2023- 05-18	320,1 78.00	8,600.00	7	1.8 0	112.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4884	寒武纪	2023- 05-18	826,6 02.00	4,200.00	7	1.8 0	289.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4890	中科曙 光	2023- 05-18	3,383 ,800. 00	70,000.00	7	3.1 0	2,039 .68	0.00	0.00
广发证	2023	三六零	2023-	375,5	26,100.00	7	3.1	226.3	0.00	0.00

券	0518 0003 4894		05-18	79.00			0	9		
广发证 券	2023 0518 0003 4968	极米科 技	2023- 05-18	245,7 00.00	1,500.00	7	1.8 0	86.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 5214	全志科 技	2023- 05-18	253,8 90.00	9,300.00	7	1.8 0	88.86	0.00	0.00
广发证 券	2023 0519 0000 3185	北斗星 通	2023- 05-19	67,74 0.00	2,000.00	14	3.2 0	84.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0519 0000 7005	澜起科 技	2023- 05-19	106,1 28.00	1,800.00	7	2.5 0	51.59	0.00	0.00
广发证 券	2023 0522 0005 7872	三六零	2023- 05-22	1,764 ,797. 00	129,100.0 0	7	3.1 0	1,063 .78	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0000 2268	晶晨股 份	2023- 05-24	2,990 ,394. 00	36,300.00	14	3.2 0	3,721 .38	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0001 4782	万达信 息	2023- 05-24	1,561 ,200. 00	120,000.0 0	13	3.5 1	1,978 .82	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0002 3084	佳都科 技	2023- 05-24	588,1 90.00	89,800.00	7	3.1 0	354.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 3246	启明星 辰	2023- 05-25	424,2 96.00	14,200.00	7	1.8 0	148.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6522	和而泰	2023- 05-25	304,7 74.00	19,400.00	7	1.8 0	106.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525	科华数 据	2023- 05-25	270,2 04.00	6,900.00	7	1.8 0	94.57	0.00	0.00

	0002 6540									
广发证 券	2023 0525 0002 6566	海康威 视	2023- 05-25	2,317 ,185. 00	66,300.00	7	1.8 0	811.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6668	四维图 新	2023- 05-25	576,4 59.00	50,700.00	7	1.8 0	201.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6676	德赛西 威	2023- 05-25	619,0 34.00	5,800.00	7	1.8 0	216.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6692	极米科 技	2023- 05-25	237,7 35.00	1,500.00	7	1.8 0	83.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6696	拓邦股 份	2023- 05-25	239,9 40.00	21,500.00	7	1.8 0	83.98	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6714	太极股 份	2023- 05-25	297,3 88.00	8,600.00	7	1.8 0	104.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6716	万达信 息	2023- 05-25	388,3 55.00	30,700.00	7	1.8 0	135.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6718	寒武纪	2023- 05-25	816,9 00.00	4,200.00	7	1.8 0	285.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6762	神州信 息	2023- 05-25	121,6 95.00	10,500.00	7	1.8 0	42.59	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6766	浪潮信 息	2023- 05-25	870,2 56.00	21,800.00	7	1.8 0	304.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002	深信服	2023- 05-25	636,8 48.00	5,300.00	7	1.8 0	222.9 0	0.00	0.00

	6770									
广发证 券	2023 0525 0002 6774	浪潮信 息	2023- 05-25	411,1 76.00	10,300.00	7	3.1 0	247.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6784	电科数 字	2023- 05-25	171,1 85.00	7,300.00	7	1.8 0	59.91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6786	三六零	2023- 05-25	815,8 08.00	60,700.00	7	1.8 0	285.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6822	浪潮信 息	2023- 05-25	1,996 ,000. 00	50,000.00	7	8.0 2	3,112 .65	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6824	景嘉微	2023- 05-25	398,1 12.00	4,800.00	7	1.8 0	139.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6826	浪潮信 息	2023- 05-25	650,6 96.00	16,300.00	7	3.1 0	392.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6836	北京君 正	2023- 05-25	463,7 43.00	5,100.00	7	1.8 0	162.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6846	东华软 件	2023- 05-25	328,1 76.00	47,700.00	7	1.8 0	114.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6870	广电运 通	2023- 05-25	299,6 40.00	26,400.00	7	1.8 0	104.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6882	北斗星 通	2023- 05-25	245,3 28.00	7,600.00	7	1.8 0	85.86	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6892	科沃斯	2023- 05-25	345,8 40.00	4,800.00	7	1.8 0	121.0 4	0.00	0.00

广发证 券	2023 0525 0002 6894	恒玄科 技	2023- 05-25	210,0 90.00	1,500.00	7	1.8 0	73.53	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6910	奥普特	2023- 05-25	231,8 10.00	1,500.00	7	1.8 0	81.13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6914	三六零	2023- 05-25	350,7 84.00	26,100.00	7	3.1 0	211.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6920	宝信软 件	2023- 05-25	670,8 24.00	12,600.00	7	1.8 0	234.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6934	紫光股 份	2023- 05-25	1,236 ,252. 00	42,600.00	7	1.8 0	432.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7064	三六零	2023- 05-25	403,2 00.00	30,000.00	7	4.6 3	362.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7080	佳都科 技	2023- 05-25	208,6 50.00	32,100.00	7	1.8 0	73.03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7082	芯原股 份	2023- 05-25	427,9 75.00	5,300.00	7	1.8 0	149.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7154	美亚柏 科	2023- 05-25	263,8 90.00	11,000.00	7	1.8 0	92.36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7180	韦尔股 份	2023- 05-25	1,452 ,750. 00	15,000.00	7	1.8 0	508.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7186	中科曙 光	2023- 05-25	3,304 ,000. 00	70,000.00	7	3.1 0	1,991 .58	0.00	0.00
广发证	2023	中科曙	2023-	523,9	11,100.00	7	3.1	315.8	0.00	0.00

券	0525 0002 7190	光	05-25	20.00			0	1		
广发证 券	2023 0525 0002 7194	千方科 技	2023- 05-25	274,4 80.00	23,500.00	7	1.8 0	96.07	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7204	石头科 技	2023- 05-25	466,1 25.00	1,500.00	7	1.8 0	163.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7206	均胜电 子	2023- 05-25	314,2 44.00	20,300.00	7	1.8 0	109.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7210	东软集 团	2023- 05-25	184,6 47.00	18,300.00	7	1.8 0	64.63	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7250	美亚柏 科	2023- 05-25	71,97 0.00	3,000.00	7	2.5 0	34.99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7318	安恒信 息	2023- 05-25	265,4 85.00	1,500.00	7	1.8 0	92.92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7346	晶晨股 份	2023- 05-25	4,101 ,340. 00	50,200.00	7	3.5 1	2,799 .16	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7358	用友网 络	2023- 05-25	851,0 34.00	43,800.00	7	1.8 0	297.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7360	晶晨股 份	2023- 05-25	498,3 70.00	6,100.00	7	1.8 0	174.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7362	中国软 件	2023- 05-25	463,2 50.00	8,500.00	7	1.8 0	162.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525	汇顶科 技	2023- 05-25	287,1 00.00	5,800.00	7	1.8 0	100.4 9	0.00	0.00

	0002 7396									
广发证 券	2023 0525 0002 7412	中科曙 光	2023- 05-25	1,180 ,000. 00	25,000.00	7	1.8 0	413.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7414	光环新 网	2023- 05-25	330,6 20.00	30,500.00	7	1.8 0	115.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7422	三六零	2023- 05-25	577,9 20.00	43,000.00	7	3.1 0	348.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7424	三六零	2023- 05-25	7,560 ,000. 00	562,500.0 0	7	3.1 0	4,557 .00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7434	中科创 达	2023- 05-25	576,0 81.00	6,900.00	7	1.8 0	201.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7438	科大讯 飞	2023- 05-25	2,202 ,156. 00	39,600.00	7	1.8 0	770.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7446	澜起科 技	2023- 05-25	1,015 ,690. 00	16,900.00	7	1.8 0	355.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7450	全志科 技	2023- 05-25	286,2 54.00	9,300.00	7	1.8 0	100.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7458	瑞芯微	2023- 05-25	283,7 80.00	3,500.00	7	1.8 0	99.32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7462	易华录	2023- 05-25	267,7 50.00	8,500.00	7	1.8 0	93.71	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002	虹软科 技	2023- 05-25	159,0 60.00	4,400.00	7	1.8 0	55.67	0.00	0.00

	7470									
广发证 券	2023 0525 0002 7482	大华股 份	2023- 05-25	801,4 77.00	38,700.00	7	1.8 0	280.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0526 0001 2290	佳都科 技	2023- 05-26	52,08 0.00	8,000.00	7	3.1 0	31.39	0.00	0.00
广发证 券	2023 0526 0001 3198	澜起科 技	2023- 05-26	110,0 52.00	1,800.00	7	2.5 0	53.50	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0000 5427	景嘉微	2023- 05-29	940,1 00.00	10,000.00	14	3.2 0	1,169 .90	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0000 5448	紫光股 份	2023- 05-29	484,4 73.00	15,900.00	14	3.2 0	602.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0000 5566	科沃斯	2023- 05-29	717,4 00.00	10,000.00	14	3.2 0	892.7 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0001 0775	三六零	2023- 05-29	1,724 ,776. 00	129,100.0 0	7	3.1 0	1,039 .66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0000 7005	四维图 新	2023- 05-30	464,3 87.00	40,700.00	14	3.2 0	577.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0000 7044	瑞芯微	2023- 05-30	179,5 42.00	2,200.00	14	3.2 0	223.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0000 7107	科沃斯	2023- 05-30	1,238 ,475. 00	17,500.00	14	3.2 0	1,541 .21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0531 0000 1204	景嘉微	2023- 05-31	1,397 ,800. 00	14,500.00	14	3.8 0	2,065 .64	0.00	0.00

广发证 券	2023 0531 0000 1257	中国软 件	2023- 05-31	583,0 08.00	9,600.00	14	3.2 0	725.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0000 6099	中国软 件	2023- 06-01	1,031 ,238. 00	16,900.00	14	3.2 0	1,283 .32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 6504	拓邦股 份	2023- 06-01	238,0 05.00	21,500.00	7	1.8 0	83.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 8625	宝信软 件	2023- 06-01	679,8 96.00	12,600.00	7	1.8 0	237.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 8742	德赛西 威	2023- 06-01	658,5 90.00	5,800.00	7	1.8 0	230.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 9161	汇顶科 技	2023- 06-01	299,8 60.00	5,800.00	7	1.8 0	104.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 0766	中科创 达	2023- 06-01	687,3 78.00	6,900.00	7	1.8 0	240.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 0989	恒玄科 技	2023- 06-01	229,6 65.00	1,500.00	7	1.8 0	80.38	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1091	三六零	2023- 06-01	8,161 ,875. 00	562,500.0 0	7	3.1 0	4,919 .80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1174	芯原股 份	2023- 06-01	474,6 15.00	5,300.00	7	1.8 0	166.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1277	四维图 新	2023- 06-01	608,4 00.00	50,700.00	7	1.8 0	212.9 4	0.00	0.00
广发证	2023	紫光股	2023-	1,382	42,600.00	7	1.8	483.8	0.00	0.00

券	0601 0003 1538	份	06-01	,370. 00			0	3		
广发证 券	2023 0601 0003 1811	浪潮信 息	2023- 06-01	2,264 ,500. 00	50,000.00	7	8.0 2	3,531 .36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1853	广电运 通	2023- 06-01	327,3 60.00	26,400.00	7	1.8 0	114.5 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 2276	均胜电 子	2023- 06-01	315,6 65.00	20,300.00	7	1.8 0	110.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 2288	电科数 字	2023- 06-01	181,5 51.00	7,300.00	7	1.8 0	63.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 2309	富瀚微	2023- 06-01	151,5 00.00	2,500.00	7	1.8 0	53.03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 2313	晶晨股 份	2023- 06-01	4,519 ,506. 00	50,200.00	7	3.5 1	3,084 .56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3125	三六零	2023- 06-01	378,7 11.00	26,100.00	7	3.1 0	228.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3174	科沃斯	2023- 06-01	337,0 08.00	4,800.00	7	1.8 0	117.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3184	晶晨股 份	2023- 06-01	549,1 83.00	6,100.00	7	1.8 0	192.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3193	中科曙 光	2023- 06-01	3,688 ,300. 00	70,000.00	7	3.1 0	2,223 .23	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601	三六零	2023- 06-01	435,3 00.00	30,000.00	7	4.6 3	391.8 9	0.00	0.00

	0003 3306									
广发证 券	2023 0601 0003 3477	光环新 网	2023- 06-01	363,5 60.00	30,500.00	7	1.8 0	127.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3620	科华数 据	2023- 06-01	260,8 89.00	6,900.00	7	1.8 0	91.31	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 3971	瑞芯微	2023- 06-01	305,3 40.00	3,500.00	7	1.8 0	106.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4055	东软集 团	2023- 06-01	198,0 06.00	18,300.00	7	1.8 0	69.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4078	易华录	2023- 06-01	309,4 00.00	8,500.00	7	1.8 0	108.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4425	澜起科 技	2023- 06-01	1,049 ,490. 00	16,900.00	7	1.8 0	367.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4524	景嘉微	2023- 06-01	512,0 64.00	4,800.00	7	1.8 0	179.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4583	千方科 技	2023- 06-01	318,6 60.00	23,500.00	7	1.8 0	111.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4671	浪潮信 息	2023- 06-01	738,2 27.00	16,300.00	7	3.1 0	444.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4725	和而泰	2023- 06-01	312,3 40.00	19,400.00	7	1.8 0	109.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003	北斗星 通	2023- 06-01	250,8 00.00	7,600.00	7	1.8 0	87.78	0.00	0.00

	4770									
广发证 券	2023 0601 0003 4778	中科曙 光	2023- 06-01	584,8 59.00	11,100.00	7	3.1 0	352.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4962	三六零	2023- 06-01	623,9 30.00	43,000.00	7	3.1 0	376.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5281	用友网 络	2023- 06-01	894,8 34.00	43,800.00	7	1.8 0	313.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5297	浪潮信 息	2023- 06-01	987,3 22.00	21,800.00	7	1.8 0	345.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5606	浪潮信 息	2023- 06-01	466,4 87.00	10,300.00	7	3.1 0	281.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5800	海康威 视	2023- 06-01	2,380 ,170. 00	66,300.00	7	1.8 0	833.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5864	安恒信 息	2023- 06-01	281,9 40.00	1,500.00	7	1.8 0	98.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6042	深信服	2023- 06-01	669,7 61.00	5,300.00	7	1.8 0	234.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6291	石头科 技	2023- 06-01	464,4 30.00	1,500.00	7	1.8 0	162.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6451	三六零	2023- 06-01	880,7 57.00	60,700.00	7	1.8 0	308.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6464	科大讯 飞	2023- 06-01	2,602 ,908. 00	39,600.00	7	1.8 0	911.0 2	0.00	0.00

广发证 券	2023 0601 0003 6572	中国软 件	2023- 06-01	518,6 70.00	8,500.00	7	1.8 0	181.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6584	中科曙 光	2023- 06-01	1,317 ,250. 00	25,000.00	7	1.8 0	461.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6816	启明星 辰	2023- 06-01	447,8 68.00	14,200.00	7	1.8 0	156.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6857	奥普特	2023- 06-01	254,2 80.00	1,500.00	7	1.8 0	89.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 6989	极米科 技	2023- 06-01	224,2 35.00	1,500.00	7	1.8 0	78.48	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7062	寒武纪	2023- 06-01	995,4 42.00	4,200.00	7	1.8 0	348.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7155	全志科 技	2023- 06-01	301,7 85.00	9,300.00	7	1.8 0	105.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7188	北京君 正	2023- 06-01	469,5 06.00	5,100.00	7	1.8 0	164.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7260	韦尔股 份	2023- 06-01	1,492 ,500. 00	15,000.00	7	1.8 0	522.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7455	太极股 份	2023- 06-01	337,8 08.00	8,600.00	7	1.8 0	118.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7722	东华软 件	2023- 06-01	356,7 96.00	47,700.00	7	1.8 0	124.8 8	0.00	0.00
广发证	2023	北斗星	2023-	63,18	2,000.00	7	3.2	39.31	0.00	0.00

券	0602 0001 0504	通	06-02	0.00			0			
广发证 券	2023 0602 0001 2076	澜起科 技	2023- 06-02	109,2 42.00	1,800.00	7	2.5 0	53.10	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4890	广电运 通	2023- 06-05	1,283 ,000. 00	100,000.0 0	14	3.2 1	1,601 .61	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4991	晶晨股 份	2023- 06-05	178,6 38.00	1,900.00	14	3.2 1	223.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4999	中国软 件	2023- 06-05	542,5 28.00	11,200.00	14	3.2 1	677.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0002 3478	三六零	2023- 06-05	2,001 ,050. 00	129,100.0 0	7	3.1 0	1,206 .19	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0000 4362	德赛西 威	2023- 06-06	572,0 50.00	5,000.00	14	3.2 1	714.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0000 4451	中国软 件	2023- 06-06	132,1 32.00	2,800.00	14	3.2 1	164.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0000 4500	用友网 络	2023- 06-06	509,7 78.00	25,400.00	14	3.2 1	636.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0001 9074	晶晨股 份	2023- 06-07	3,263 ,733. 00	36,300.00	7	3.2 0	2,030 .77	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0000 3571	三六零	2023- 06-08	2,828 ,000. 00	200,000.0 0	14	4.0 1	5,670 .14	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608	紫光股 份	2023- 06-08	1,320 ,600.	42,600.00	7	1.8 0	462.2 1	0.00	0.00

	0001 7625			00						
广发证 券	2023 0608 0001 9969	宝信软 件	2023- 06-08	685,3 14.00	12,600.00	7	1.8 0	239.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 0671	东华软 件	2023- 06-08	352,5 03.00	47,700.00	7	1.8 0	123.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 0784	浪潮信 息	2023- 06-08	443,4 15.00	10,300.00	7	3.1 0	267.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1078	瑞芯微	2023- 06-08	278,9 85.00	3,500.00	7	1.8 0	97.64	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1449	奥普特	2023- 06-08	217,5 00.00	1,500.00	7	1.8 0	76.13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1483	石头科 技	2023- 06-08	498,7 35.00	1,500.00	7	1.8 0	174.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1492	恒玄科 技	2023- 06-08	195,8 40.00	1,500.00	7	1.8 0	68.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1511	晶晨股 份	2023- 06-08	547,8 41.00	6,100.00	7	1.8 0	191.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 2450	中科创 达	2023- 06-08	657,7 08.00	6,900.00	7	1.8 0	230.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 2451	景嘉微	2023- 06-08	463,7 76.00	4,800.00	7	1.8 0	162.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002	三六零	2023- 06-08	608,0 20.00	43,000.00	7	3.1 0	366.5 0	0.00	0.00

	2466									
广发证 券	2023 0608 0002 2468	四维图 新	2023- 06-08	583,0 50.00	50,700.00	7	1.8 0	204.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 2909	三六零	2023- 06-08	7,953 ,750. 00	562,500.0 0	7	3.1 0	4,794 .34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 3807	中国软 件	2023- 06-08	402,7 30.00	8,500.00	7	1.8 0	140.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 4928	晶晨股 份	2023- 06-08	4,508 ,462. 00	50,200.00	7	3.5 1	3,077 .03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 4929	和而泰	2023- 06-08	302,6 40.00	19,400.00	7	1.8 0	105.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5033	海康威 视	2023- 06-08	2,290 ,665. 00	66,300.00	7	1.8 0	801.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5157	汇顶科 技	2023- 06-08	276,5 44.00	5,800.00	7	1.8 0	96.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5182	安恒信 息	2023- 06-08	268,0 05.00	1,500.00	7	1.8 0	93.80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5408	北斗星 通	2023- 06-08	229,6 72.00	7,600.00	7	1.8 0	80.39	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5490	北京君 正	2023- 06-08	428,4 00.00	5,100.00	7	1.8 0	149.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5530	深信服	2023- 06-08	639,4 45.00	5,300.00	7	1.8 0	223.8 1	0.00	0.00

广发证 券	2023 0608 0002 5743	广电运 通	2023- 06-08	326,3 04.00	26,400.00	7	1.8 0	114.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5750	三六零	2023- 06-08	858,2 98.00	60,700.00	7	1.8 0	300.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5803	浪潮信 息	2023- 06-08	938,4 90.00	21,800.00	7	1.8 0	328.4 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5834	寒武纪	2023- 06-08	928,2 42.00	4,200.00	7	1.8 0	324.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5899	浪潮信 息	2023- 06-08	701,7 15.00	16,300.00	7	3.1 0	422.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5936	均胜电 子	2023- 06-08	316,0 71.00	20,300.00	7	1.8 0	110.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5938	易华录	2023- 06-08	310,9 30.00	8,500.00	7	1.8 0	108.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6033	千方科 技	2023- 06-08	315,1 35.00	23,500.00	7	1.8 0	110.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6055	富瀚微	2023- 06-08	160,2 25.00	2,500.00	7	1.8 0	56.08	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6116	东软集 团	2023- 06-08	200,5 68.00	18,300.00	7	1.8 0	70.20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6135	中科曙 光	2023- 06-08	553,0 02.00	11,100.00	7	3.1 0	333.3 4	0.00	0.00
广发证	2023	中科曙	2023-	3,487	70,000.00	7	3.1	2,102	0.00	0.00

券	0608 0002 6152	光	06-08	,400. 00			0	.13		
广发证 券	2023 0608 0002 6393	全志科 技	2023- 06-08	273,4 20.00	9,300.00	7	1.8 0	95.70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6477	启明星 辰	2023- 06-08	460,9 32.00	14,200.00	7	1.8 0	161.3 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6532	中科曙 光	2023- 06-08	1,245 ,500. 00	25,000.00	7	1.8 0	435.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6666	光环新 网	2023- 06-08	368,4 40.00	30,500.00	7	1.8 0	128.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6678	科大讯 飞	2023- 06-08	2,542 ,716. 00	39,600.00	7	1.8 0	889.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6711	科沃斯	2023- 06-08	348,4 80.00	4,800.00	7	1.8 0	121.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6798	澜起科 技	2023- 06-08	965,1 59.00	16,900.00	7	1.8 0	337.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6898	浪潮信 息	2023- 06-08	2,152 ,500. 00	50,000.00	7	8.0 2	3,356 .70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7013	芯原股 份	2023- 06-08	448,3 80.00	5,300.00	7	1.8 0	156.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7053	电科数 字	2023- 06-08	178,9 96.00	7,300.00	7	1.8 0	62.65	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608	极米科 技	2023- 06-08	206,7 00.00	1,500.00	7	1.8 0	72.35	0.00	0.00

	0002 7101									
广发证 券	2023 0608 0002 7108	三六零	2023- 06-08	424,2 00.00	30,000.00	7	4.6 3	381.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7242	韦尔股 份	2023- 06-08	1,409 ,250. 00	15,000.00	7	1.8 0	493.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7246	拓邦股 份	2023- 06-08	223,3 85.00	21,500.00	7	1.8 0	78.18	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7251	用友网 络	2023- 06-08	876,0 00.00	43,800.00	7	1.8 0	306.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7399	德赛西 威	2023- 06-08	655,3 42.00	5,800.00	7	1.8 0	229.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7667	太极股 份	2023- 06-08	337,8 08.00	8,600.00	7	1.8 0	118.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7740	科华数 据	2023- 06-08	251,9 19.00	6,900.00	7	1.8 0	88.17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7754	三六零	2023- 06-08	369,0 54.00	26,100.00	7	3.1 0	222.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0609 0000 8055	澜起科 技	2023- 06-09	104,7 42.00	1,800.00	7	2.5 0	50.92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0609 0001 0926	北斗星 通	2023- 06-09	60,30 0.00	2,000.00	7	3.2 0	37.52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002	昆仑万 维	2023- 06-12	2,099 ,013. 00	39,300.00	14	3.7 5	3,061 .06	0.00	0.00

	8841									
广发证 券	2023 0612 0002 8906	和而泰	2023- 06-12	5,256 ,902. 00	324,100.0 0	14	3.7 5	7,666 .32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8977	金山办 公	2023- 06-12	11,22 4,000 .00	23,000.00	14	3.7 5	16,36 8.33	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8986	光迅科 技	2023- 06-12	5,445 ,250. 00	189,400.0 0	14	3.7 5	7,940 .99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9021	寒武纪	2023- 06-12	374,3 57.00	1,700.00	14	3.7 5	545.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9032	新易盛	2023- 06-12	973,1 20.00	16,000.00	14	3.2 1	1,214 .78	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9075	三六零	2023- 06-12	12,28 9,482 .00	842,900.0 0	14	3.7 5	17,92 2.16	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9093	均胜电 子	2023- 06-12	2,955 ,868. 00	169,100.0 0	14	3.7 5	4,310 .64	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0004 0332	科沃斯	2023- 06-12	719,8 00.00	10,000.00	7	3.2 0	447.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0004 0687	景嘉微	2023- 06-12	927,7 00.00	10,000.00	7	3.2 0	577.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0004 0802	三六零	2023- 06-12	1,882 ,278. 00	129,100.0 0	7	3.1 0	1,134 .60	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0000 7802	昆仑万 维	2023- 06-13	5,293 ,324. 00	96,400.00	14	3.2 1	6,607 .83	0.00	0.00

广发证 券	2023 0613 0000 7834	科大讯 飞	2023- 06-13	8,592 ,780. 00	114,800.0 0	14	3.5 0	11,69 5.73	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9087	科沃斯	2023- 06-13	1,220 ,275. 00	17,500.00	7	3.2 0	759.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 2135	瑞芯微	2023- 06-13	177,0 78.00	2,200.00	7	3.2 0	110.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0003 0219	四维图 新	2023- 06-14	486,7 72.00	40,700.00	14	3.2 1	607.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 8791	中国软 件	2023- 06-14	470,4 00.00	9,600.00	7	3.2 0	292.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 8970	晶晨股 份	2023- 06-14	3,407 ,844. 00	36,300.00	7	3.2 0	2,120 .44	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 9189	景嘉微	2023- 06-14	1,486 ,250. 00	14,500.00	7	3.8 0	1,098 .17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0001 3742	东华软 件	2023- 06-15	336,5 19.00	41,700.00	14	3.2 1	420.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0002 8744	中国软 件	2023- 06-15	825,5 65.00	16,900.00	14	3.2 0	1,027 .37	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0002 9745	紫光股 份	2023- 06-15	1,450 ,956. 00	42,600.00	14	1.8 0	1,015 .67	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 0436	中科创 达	2023- 06-15	716,5 65.00	6,900.00	14	1.8 0	501.6 0	0.00	0.00
广发证	2023	宝信软	2023-	632,7	12,600.00	14	1.8	442.9	0.00	0.00

券	0615 0003 0622	件	06-15	72.00			0	4		
广发证 券	2023 0615 0003 1283	浪潮信 息	2023- 06-15	847,9 26.00	16,300.00	14	3.1 0	1,022 .22	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 1316	浪潮信 息	2023- 06-15	1,134 ,036. 00	21,800.00	14	1.8 0	793.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 1819	启明星 辰	2023- 06-15	445,4 54.00	14,200.00	14	1.8 0	311.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 2007	浪潮信 息	2023- 06-15	535,8 06.00	10,300.00	14	3.1 0	645.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 2986	东华软 件	2023- 06-15	384,9 39.00	47,700.00	14	1.8 0	269.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 3101	澜起科 技	2023- 06-15	1,039 ,181. 00	16,900.00	14	1.8 0	727.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 3295	海康威 视	2023- 06-15	2,217 ,072. 00	66,300.00	14	1.8 0	1,551 .95	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 3391	浪潮信 息	2023- 06-15	2,601 ,000. 00	50,000.00	14	8.0 2	8,112 .23	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 3608	北京君 正	2023- 06-15	466,1 40.00	5,100.00	14	1.8 0	326.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4233	汇顶科 技	2023- 06-15	292,9 58.00	5,800.00	14	1.8 0	205.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615	安恒信 息	2023- 06-15	274,4 85.00	1,500.00	14	1.8 0	192.1 4	0.00	0.00

	0003 4315									
广发证 券	2023 0615 0003 4429	三六零	2023- 06-15	898,3 60.00	60,700.00	14	1.8 0	628.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4433	极米科 技	2023- 06-15	214,7 25.00	1,500.00	14	1.8 0	150.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4617	石头科 技	2023- 06-15	466,5 00.00	1,500.00	14	1.8 0	326.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4923	深信服	2023- 06-15	646,1 23.00	5,300.00	14	1.8 0	452.2 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4925	三六零	2023- 06-15	636,4 00.00	43,000.00	14	3.1 0	767.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4953	科大讯 飞	2023- 06-15	2,886 ,048. 00	39,600.00	14	1.8 0	2,020 .23	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5038	寒武纪	2023- 06-15	886,2 00.00	4,200.00	14	1.8 0	620.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5054	德赛西 威	2023- 06-15	829,9 80.00	5,800.00	14	1.8 0	580.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5169	奥普特	2023- 06-15	232,4 25.00	1,500.00	14	1.8 0	162.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5363	中科曙 光	2023- 06-15	3,773 ,700. 00	70,000.00	14	3.1 0	4,549 .41	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003	用友网 络	2023- 06-15	915,8 58.00	43,800.00	14	1.8 0	641.1 0	0.00	0.00

	5575									
广发证 券	2023 0615 0003 5669	中国软 件	2023- 06-15	415,2 25.00	8,500.00	14	1.8 0	290.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5694	太极股 份	2023- 06-15	344,6 02.00	8,600.00	14	1.8 0	241.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 6010	恒玄科 技	2023- 06-15	202,8 75.00	1,500.00	14	1.8 0	142.0 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 6436	富瀚微	2023- 06-15	158,4 75.00	2,500.00	14	1.8 0	110.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 6769	芯原股 份	2023- 06-15	458,3 97.00	5,300.00	14	1.8 0	320.8 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 7070	易华录	2023- 06-15	321,3 00.00	8,500.00	14	1.8 0	224.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 7081	景嘉微	2023- 06-15	468,6 24.00	4,800.00	14	1.8 0	328.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 7107	科沃斯	2023- 06-15	350,1 12.00	4,800.00	14	1.8 0	245.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 7377	光环新 网	2023- 06-15	374,2 35.00	30,500.00	14	1.8 0	261.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 7791	电科数 字	2023- 06-15	181,1 13.00	7,300.00	14	1.8 0	126.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8243	三六零	2023- 06-15	444,0 00.00	30,000.00	14	4.6 3	799.4 5	0.00	0.00

广发证 券	2023 0615 0003 8254	均胜电 子	2023- 06-15	356,0 62.00	20,300.00	14	1.8 0	249.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8264	北斗星 通	2023- 06-15	230,1 28.00	7,600.00	14	1.8 0	161.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8348	瑞芯微	2023- 06-15	276,5 00.00	3,500.00	14	1.8 0	193.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8605	全志科 技	2023- 06-15	277,5 12.00	9,300.00	14	1.8 0	194.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8717	和而泰	2023- 06-15	315,6 38.00	19,400.00	14	1.8 0	220.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8734	广电运 通	2023- 06-15	327,6 24.00	26,400.00	14	1.8 0	229.3 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8830	东软集 团	2023- 06-15	203,3 13.00	18,300.00	14	1.8 0	142.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 8952	拓邦股 份	2023- 06-15	240,1 55.00	21,500.00	14	1.8 0	168.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9026	四维图 新	2023- 06-15	601,8 09.00	50,700.00	14	1.8 0	421.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9229	中科曙 光	2023- 06-15	1,347 ,750. 00	25,000.00	14	1.8 0	943.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9235	中科曙 光	2023- 06-15	598,4 01.00	11,100.00	14	3.1 0	721.4 1	0.00	0.00
广发证	2023	晶晨股	2023-	4,709	50,200.00	14	3.5	6,428	0.00	0.00

券	0615 0003 9236	份	06-15	,262. 00			1	.14		
广发证 券	2023 0615 0003 9314	三六零	2023- 06-15	8,325 ,000. 00	562,500.0 0	14	3.1 0	10,03 6.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9339	晶晨股 份	2023- 06-15	572,2 41.00	6,100.00	14	1.8 0	400.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9345	科华数 据	2023- 06-15	263,1 66.00	6,900.00	14	1.8 0	184.2 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9365	三六零	2023- 06-15	386,2 80.00	26,100.00	14	3.1 0	465.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9517	千方科 技	2023- 06-15	325,7 10.00	23,500.00	14	1.8 0	228.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9521	韦尔股 份	2023- 06-15	1,499 ,400. 00	15,000.00	14	1.8 0	1,049 .58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0616 0002 0282	澜起科 技	2023- 06-16	109,4 94.00	1,800.00	14	2.5 0	106.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0619 0001 8670	景嘉微	2023- 06-19	1,031 ,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	1,008 .09	899,900.00	1,008.09
广发证 券	2023 0619 0001 9328	中国软 件	2023- 06-19	586,5 44.00	11,200.00	14	3.2 1	575.3 0	525,056.00	575.30
广发证 券	2023 0619 0001 9657	三六零	2023- 06-19	1,935 ,209. 00	129,100.0 0	14	3.1 0	1,833 .07	1,618,914.0 0	1,833.07
广发证 券	2023 0619	科沃斯	2023- 06-19	720,3 00.00	10,000.00	14	3.2 0	704.2 9	777,700.00	704.29

	0002 0100									
广发证 券	2023 0620 0001 7441	大华股 份	2023- 06-20	1,026 ,864. 00	43,200.00	14	3.2 1	915.6 2	853,200.00	915.62
广发证 券	2023 0620 0001 7473	晶晨股 份	2023- 06-20	3,558 ,311. 00	39,700.00	14	3.2 1	3,172 .83	3,347,504.0 0	3,172.83
广发证 券	2023 0620 0003 0926	科沃斯	2023- 06-20	1,347 ,500. 00	17,500.00	14	3.2 0	1,197 .78	1,360,975.0 0	1,197.78
广发证 券	2023 0620 0003 2214	瑞芯微	2023- 06-20	176,5 72.00	2,200.00	14	3.2 0	156.9 5	160,270.00	156.95
广发证 券	2023 0620 0003 4337	德赛西 威	2023- 06-20	798,4 50.00	5,000.00	14	3.2 1	711.9 5	779,050.00	711.95
广发证 券	2023 0621 0001 2638	晶晨股 份	2023- 06-21	3,170 ,442. 00	36,300.00	14	3.2 0	2,536 .35	3,060,816.0 0	2,536.35
广发证 券	2023 0621 0001 3602	中国软 件	2023- 06-21	474,2 40.00	9,600.00	14	3.2 0	379.3 9	450,048.00	379.39
广发证 券	2023 0621 0001 5214	景嘉微	2023- 06-21	1,500 ,750. 00	14,500.00	14	3.8 0	1,425 .71	1,304,855.0 0	1,425.71
广发证 券	2023 0626 0000 6569	紫光股 份	2023- 06-26	8,702 ,470. 00	248,500.0 0	14	3.2 1	3,103 .88	7,914,725.0 0	3,103.88
广发证 券	2023 0626 0000 6575	紫光股 份	2023- 06-26	945,5 40.00	27,000.00	14	3.2 1	337.2 4	859,950.00	337.24
广发证 券	2023 0626 0003	新易盛	2023- 06-26	1,028 ,480. 00	16,000.00	14	3.2 1	366.8 2	1,087,520.0 0	366.82

	7137									
广发证 券	2023 0626 0003 7333	寒武纪	2023- 06-26	344,2 50.00	1,700.00	14	3.7 5	143.4 4	319,600.00	143.44
广发证 券	2023 0626 0003 9159	三六零	2023- 06-26	2,638 ,000. 00	200,000.0 0	14	4.0 1	1,175 .38	2,508,000.0 0	1,175.38
广发证 券	2023 0626 0004 5430	昆仑万 维	2023- 06-26	1,725 ,663. 00	39,300.00	14	3.7 5	719.0 3	1,583,004.0 0	719.03
广发证 券	2023 0626 0004 7428	金山办 公	2023- 06-26	10,98 7,330 .00	23,000.00	14	3.7 5	4,578 .05	10,861,060. 00	4,578.05
广发证 券	2023 0626 0004 9495	光迅科 技	2023- 06-26	6,880 ,902. 00	189,400.0 0	14	3.7 5	2,867 .04	7,024,846.0 0	2,867.04
广发证 券	2023 0626 0005 2801	三六零	2023- 06-26	11,11 7,851 .00	842,900.0 0	14	3.7 5	4,632 .44	10,569,966. 00	4,632.44
广发证 券	2023 0627 0001 5782	昆仑万 维	2023- 06-27	4,154 ,840. 00	96,400.00	14	3.2 1	1,111 .42	3,882,992.0 0	1,111.42
广发证 券	2023 0627 0001 5783	科大讯 飞	2023- 06-27	8,314 ,964. 00	114,800.0 0	14	3.5 0	2,425 .20	7,801,808.0 0	2,425.20
广发证 券	2023 0628 0003 8091	四维图 新	2023- 06-28	461,1 31.00	40,700.00	14	3.2 1	82.24	471,306.00	82.24
广发证 券	2023 0629 0003 0059	四维图 新	2023- 06-29	588,1 20.00	50,700.00	14	1.8 0	29.41	587,106.00	29.41
广发证 券	2023 0629 0003 0176	深信服	2023- 06-29	600,4 90.00	5,300.00	14	1.8 0	30.02	600,225.00	30.02

广发证 券	2023 0629 0003 0190	均胜电 子	2023- 06-29	355,4 53.00	20,300.00	14	1.8 0	17.77	358,092.00	17.77
广发证 券	2023 0629 0003 0396	奥普特	2023- 06-29	248,9 70.00	1,500.00	14	1.8 0	12.45	246,720.00	12.45
广发证 券	2023 0629 0003 0411	极米科 技	2023- 06-29	205,3 95.00	1,500.00	14	1.8 0	10.27	209,085.00	10.27
广发证 券	2023 0629 0003 1040	宝信软 件	2023- 06-29	638,8 20.00	12,600.00	14	1.8 0	31.94	640,206.00	31.94
广发证 券	2023 0629 0003 1061	富瀚微	2023- 06-29	139,0 75.00	2,500.00	14	1.8 0	6.95	141,850.00	6.95
广发证 券	2023 0629 0003 1270	东华软 件	2023- 06-29	336,2 85.00	47,700.00	14	1.8 0	16.81	336,762.00	16.81
广发证 券	2023 0629 0003 1560	澜起科 技	2023- 06-29	940,8 23.00	16,900.00	14	1.8 0	47.04	970,398.00	47.04
广发证 券	2023 0629 0003 1573	易华录	2023- 06-29	282,7 10.00	8,500.00	14	1.8 0	14.14	282,455.00	14.14
广发证 券	2023 0629 0003 1577	东软集 团	2023- 06-29	193,9 80.00	18,300.00	14	1.8 0	9.70	195,078.00	9.70
广发证 券	2023 0629 0003 1695	三六零	2023- 06-29	759,9 64.00	60,700.00	14	1.8 0	38.00	761,178.00	38.00
广发证 券	2023 0629 0003 1787	中国软 件	2023- 06-29	394,8 25.00	8,500.00	14	1.8 0	19.74	398,480.00	19.74
广发证	2023	北斗星	2023-	265,0	7,600.00	14	1.8	13.25	267,216.00	13.25

券	0629 0003 1906	通	06-29	88.00			0			
广发证 券	2023 0629 0003 2321	科沃斯	2023- 06-29	376,7 52.00	4,800.00	14	1.8 0	18.84	373,296.00	18.84
广发证 券	2023 0629 0003 2530	紫光股 份	2023- 06-29	1,336 ,362. 00	42,600.00	14	1.8 0	66.82	1,356,810.0 0	66.82
广发证 券	2023 0629 0003 2541	电科数 字	2023- 06-29	170,4 55.00	7,300.00	14	1.8 0	8.52	172,207.00	8.52
广发证 券	2023 0629 0003 3374	广电运 通	2023- 06-29	310,7 28.00	26,400.00	14	1.8 0	15.54	309,408.00	15.54
广发证 券	2023 0629 0003 3391	中科曙 光	2023- 06-29	3,481 ,800. 00	70,000.00	14	3.1 0	299.8 2	3,563,000.0 0	299.82
广发证 券	2023 0629 0003 3802	景嘉微	2023- 06-29	434,7 84.00	4,800.00	14	1.8 0	21.74	431,952.00	21.74
广发证 券	2023 0629 0003 3803	恒玄科 技	2023- 06-29	184,5 75.00	1,500.00	14	1.8 0	9.23	181,545.00	9.23
广发证 券	2023 0629 0003 4404	中国软 件	2023- 06-29	785,0 05.00	16,900.00	14	3.2 0	69.78	792,272.00	69.78
广发证 券	2023 0629 0003 5161	启明星 辰	2023- 06-29	425,4 32.00	14,200.00	14	1.8 0	21.27	422,592.00	21.27
广发证 券	2023 0629 0003 5574	科大讯 飞	2023- 06-29	2,734 ,380. 00	39,600.00	14	1.8 0	136.7 2	2,691,216.0 0	136.72
广发证 券	2023 0629	东华软 件	2023- 06-29	293,9 85.00	41,700.00	14	3.2 1	26.21	294,402.00	26.21

	0003 5827									
广发证 券	2023 0629 0003 6855	北京君 正	2023- 06-29	450,0 75.00	5,100.00	14	1.8 0	22.50	450,381.00	22.50
广发证 券	2023 0629 0003 7232	瑞芯微	2023- 06-29	253,5 05.00	3,500.00	14	1.8 0	12.68	254,975.00	12.68
广发证 券	2023 0629 0003 7545	芯原股 份	2023- 06-29	397,0 23.00	5,300.00	14	1.8 0	19.85	381,176.00	19.85
广发证 券	2023 0629 0003 8346	光环新 网	2023- 06-29	324,8 25.00	30,500.00	14	1.8 0	16.24	327,875.00	16.24
广发证 券	2023 0629 0003 8490	中科创 达	2023- 06-29	669,7 14.00	6,900.00	14	1.8 0	33.49	664,815.00	33.49
广发证 券	2023 0629 0003 8542	科华数 据	2023- 06-29	241,0 17.00	6,900.00	14	1.8 0	12.05	248,055.00	12.05
广发证 券	2023 0629 0003 8733	石头科 技	2023- 06-29	483,2 10.00	1,500.00	14	1.8 0	24.16	481,020.00	24.16
广发证 券	2023 0629 0003 8987	汇顶科 技	2023- 06-29	266,1 04.00	5,800.00	14	1.8 0	13.31	268,250.00	13.31
广发证 券	2023 0629 0003 9568	千方科 技	2023- 06-29	310,6 70.00	23,500.00	14	1.8 0	15.53	320,540.00	15.53
广发证 券	2023 0629 0004 0149	全志科 技	2023- 06-29	251,5 65.00	9,300.00	14	1.8 0	12.58	253,425.00	12.58
广发证 券	2023 0629 0004	浪潮信 息	2023- 06-29	1,047 ,272. 00	21,800.00	14	1.8 0	52.36	1,057,300.0 0	52.36

	0786									
广发证 券	2023 0629 0004 1977	海康威 视	2023- 06-29	2,212 ,431. 00	66,300.00	14	1.8 0	110.6 2	2,195,193.0 0	110.62
广发证 券	2023 0629 0004 2159	浪潮信 息	2023- 06-29	384,3 20.00	8,000.00	14	3.1 0	33.09	388,000.00	33.09
广发证 券	2023 0629 0004 2218	寒武纪	2023- 06-29	810,6 00.00	4,200.00	14	1.8 0	40.53	789,600.00	40.53
广发证 券	2023 0629 0004 2257	三六零	2023- 06-29	538,3 60.00	43,000.00	14	3.1 0	46.36	539,220.00	46.36
广发证 券	2023 0629 0004 2405	安恒信 息	2023- 06-29	263,2 50.00	1,500.00	14	1.8 0	13.16	262,065.00	13.16
广发证 券	2023 0629 0004 2591	和而泰	2023- 06-29	317,9 66.00	19,400.00	14	1.8 0	15.90	329,412.00	15.90
广发证 券	2023 0629 0004 3198	三六零	2023- 06-29	326,7 72.00	26,100.00	14	3.1 0	28.14	327,294.00	28.14
广发证 券	2023 0629 0004 3379	晶晨股 份	2023- 06-29	4,217 ,804. 00	50,200.00	14	3.5 1	411.2 4	4,232,864.0 0	411.24
广发证 券	2023 0629 0004 3817	中科曙 光	2023- 06-29	1,243 ,500. 00	25,000.00	14	1.8 0	62.18	1,272,500.0 0	62.18
广发证 券	2023 0629 0004 4070	三六零	2023- 06-29	375,6 00.00	30,000.00	14	4.6 3	48.31	376,200.00	48.31
广发证 券	2023 0629 0004 4383	用友网 络	2023- 06-29	904,9 08.00	43,800.00	14	1.8 0	45.25	897,900.00	45.25

广发证券	2023 0629 0004 4435	浪潮信息	2023- 06-29	494,8 12.00	10,300.00	14	3.1 0	42.61	499,550.00	42.61
广发证券	2023 0629 0004 4487	德赛西威	2023- 06-29	884,5 00.00	5,800.00	14	1.8 0	44.23	903,698.00	44.23
广发证券	2023 0629 0004 4680	晶晨股份	2023- 06-29	512,5 22.00	6,100.00	14	1.8 0	25.63	514,352.00	25.63
广发证券	2023 0629 0004 4734	拓邦股份	2023- 06-29	254,9 90.00	21,500.00	14	1.8 0	12.75	280,575.00	12.75
广发证券	2023 0629 0004 4918	浪潮信息	2023- 06-29	2,402 ,000. 00	50,000.00	14	8.0 2	535.1 1	2,425,000.0 0	535.11
广发证券	2023 0629 0004 4967	太极股份	2023- 06-29	366,4 46.00	8,600.00	14	1.8 0	18.32	354,062.00	18.32
广发证券	2023 0629 0004 5049	三六零	2023- 06-29	5,258 ,400. 00	420,000.0 0	14	3.1 0	452.8 1	5,266,800.0 0	452.81
广发证券	2023 0629 0004 5180	韦尔股份	2023- 06-29	1,471 ,500. 00	15,000.00	14	1.8 0	73.58	1,470,600.0 0	73.58
广发证券	2023 0630 0001 6313	澜起科技	2023- 06-30	103,3 56.00	1,800.00	14	2.5 0	0.00	103,356.00	0.00
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	2022 0104	易华录	2022- 01-04	1,695 ,400.	49,000.00	14	3.6 4	2,399 .93	0.00	0.00

	0002 0323			00						
广发证 券	2022 0112 0001 5383	优刻得	2022- 01-12	1,427 ,356. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,781 .82	0.00	0.00
广发证 券	2022 0113 0001 1546	机器人	2022- 01-13	32,48 0.00	2,900.00	14	3.6 4	45.98	0.00	0.00
广发证 券	2022 0117 0000 0799	优刻得	2022- 01-17	51,68 0.00	1,900.00	14	3.2 1	96.77	0.00	0.00
广发证 券	2022 0118 0002 5016	易华录	2022- 01-18	1,729 ,210. 00	49,000.00	14	3.6 4	3,496 .85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0126 0001 1280	优刻得	2022- 01-26	1,240 ,624. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,548 .71	0.00	0.00
广发证 券	2022 0207 0005 8921	易华录	2022- 02-07	1,286 ,250. 00	49,000.00	14	3.6 4	1,820 .76	0.00	0.00
广发证 券	2022 0207 0005 8931	优刻得	2022- 02-07	41,26 8.00	1,900.00	14	3.2 1	51.52	0.00	0.00
广发证 券	2022 0209 0001 7782	优刻得	2022- 02-09	1,217 ,216. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,519 .49	0.00	0.00
广发证 券	2022 0221 0004 6713	易华录	2022- 02-21	1,495 ,970. 00	49,000.00	14	3.6 4	2,117 .63	0.00	0.00
广发证 券	2022 0221 0004 6721	优刻得	2022- 02-21	53,16 2.00	1,900.00	14	3.2 1	66.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 0223 0001	优刻得	2022- 02-23	1,400 ,224. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,747 .95	0.00	0.00

	2292									
广发证 券	2022 0307 0004 0826	易华录	2022- 03-07	1,024 ,530. 00	39,000.00	14	3.6 4	1,450 .28	0.00	0.00
广发证 券	2022 0307 0004 3594	优刻得	2022- 03-07	41,32 5.00	1,900.00	14	3.2 1	51.59	0.00	0.00
广发证 券	2022 0309 0001 8829	优刻得	2022- 03-09	1,070 ,384. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,336 .20	0.00	0.00
广发证 券	2022 0321 0003 0025	优刻得	2022- 03-21	36,27 1.00	1,900.00	14	3.2 1	51.75	0.00	0.00
广发证 券	2022 0321 0003 5659	易华录	2022- 03-21	909,4 80.00	39,000.00	14	3.6 4	1,471 .34	0.00	0.00
广发证 券	2022 0323 0001 2899	优刻得	2022- 03-23	1,006 ,544. 00	53,200.00	14	3.2 1	1,256 .50	0.00	0.00
广发证 券	2022 0330 0000 0954	光环新 网	2022- 03-30	21,13 6.00	1,600.00	14	3.2 0	26.30	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7583	易华录	2022- 04-06	807,6 90.00	39,000.00	14	3.6 4	1,143 .33	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7609	优刻得	2022- 04-06	34,12 4.00	1,900.00	14	3.2 1	42.60	0.00	0.00
广发证 券	2022 0406 0006 7611	优刻得	2022- 04-06	955,4 72.00	53,200.00	14	3.2 1	1,192 .75	0.00	0.00
广发证 券	2022 0413 0001 1002	光环新 网	2022- 04-13	18,73 6.00	1,600.00	14	3.2 0	23.32	0.00	0.00

广发证 券	2022 0420 0004 5552	易华录	2022- 04-20	703,1 70.00	39,000.00	14	3.6 4	1,066 .47	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0004 5600	优刻得	2022- 04-20	831,5 16.00	53,200.00	14	3.2 1	1,112 .15	0.00	0.00
广发证 券	2022 0420 0004 8748	优刻得	2022- 04-20	29,69 7.00	1,900.00	14	3.2 1	39.72	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3095	易华录	2022- 05-05	573,6 90.00	39,000.00	14	3.6 4	812.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3147	优刻得	2022- 05-05	703,3 04.00	53,200.00	14	3.2 1	877.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0505 0007 3151	优刻得	2022- 05-05	25,11 8.00	1,900.00	14	3.2 1	31.36	0.00	0.00
广发证 券	2022 0512 0000 0538	光环新 网	2022- 05-12	27,52 4.00	2,800.00	14	3.2 0	34.25	0.00	0.00
广发证 券	2022 0516 0000 0512	光环新 网	2022- 05-16	9,650 .00	1,000.00	14	3.2 0	12.01	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 0635	易华录	2022- 05-19	599,4 30.00	39,000.00	7	3.6 4	424.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 0807	优刻得	2022- 05-19	732,5 64.00	53,200.00	7	3.2 1	457.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0519 0004 0811	优刻得	2022- 05-19	26,16 3.00	1,900.00	7	3.2 1	16.33	0.00	0.00
广发证	2022	全志科	2022-	412,0	21,100.00	14	3.2	512.8	0.00	0.00

券	0525 0000 0510	技	05-25	83.00			0	1		
广发证 券	2022 0526 0000 8008	易华录	2022- 05-26	623,2 20.00	39,000.00	7	3.6 4	441.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0001 0476	优刻得	2022- 05-26	25,08 0.00	1,900.00	7	3.2 1	15.65	0.00	0.00
广发证 券	2022 0526 0001 1170	优刻得	2022- 05-26	702,2 40.00	53,200.00	7	3.2 1	438.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2022 0602 0002 2618	易华录	2022- 06-02	643,8 90.00	39,000.00	7	3.6 4	455.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0608 0000 5665	全志科 技	2022- 06-08	440,5 68.00	21,100.00	7	3.2 0	274.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0609 0000 8361	易华录	2022- 06-09	634,1 40.00	39,000.00	7	3.6 4	448.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0614 0000 0902	晶晨股 份	2022- 06-14	281,4 00.00	2,800.00	14	3.2 0	350.1 9	0.00	0.00
广发证 券	2022 0623 0000 1649	易华录	2022- 06-23	87,12 2.00	4,900.00	14	2.0 0	33.88	85,260.00	33.88
广发证 券	2022 0628 0001 0106	晶晨股 份	2022- 06-28	273,9 52.00	2,800.00	14	3.2 0	48.70	282,800.00	48.70

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。

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
易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金	631,576,405.00	14.7419%	77,263,297.00	3.7685%
广发证券股份有限公司	24,267,112.00	0.5664%	10,294,407.00	0.5021%

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。

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-活期存款	39,499,149.33	45,711.19	18,176,161.21	28,103.05

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。

6.4.10.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 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	301376	致欧科技	新股网下发行	4,192	103,374.72
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	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

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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
00128 2	三联 锻造	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	27.93	33.03	105	2,932. 65	3,468. 15	-
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
00128 7	中电 港	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	11.88	21.02	1,386	16,465 .68	29,133 .72	-
00132 4	长青 科技	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通 受限	18.88	19.60	114	2,152. 32	2,234. 40	-
00132 8	登康 口腔	2023-0 3-29	6 个月	新股 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998. 60	3,696. 05	-
00136 0	南矿 集团	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	15.38	14.87	177	2,722. 26	2,631. 99	-
00136 7	海森 药业	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	44.48	39.48	55	2,446. 40	2,171. 40	-
30080	广康	2023-0	6 个月	新股	42.45	32.97	226	9,593.	7,451.	-

4	生化	6-15		流通受限				70	22	
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-

301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	1,832	43,546.64	78,574.48	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股流通	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-

				受限						
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	664	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	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
68830	中润	2023-0	6 个月	新股	23.88	31.73	2,455	58,625	77,897	-

7	光学	2-08		流通受限				.40	.15	
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新股流通受限	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-

688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

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。

6.4.12.2 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。

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。

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。

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	000938	紫光股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	31.85	555,900.00	17,705,415.00
2	000977	浪潮信息	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	48.50	523,100.00	25,370,350.00
3	002065	东华软件	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	7.06	950,800.00	6,712,648.00
4	002139	拓邦股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	13.05	496,700.00	6,481,935.00
5	002151	北斗星通	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	35.16	179,300.00	6,304,188.00
6	002152	广电运通	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	11.72	72,400.00	848,528.00
7	002230	科大讯飞	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	67.96	934,100.00	63,481,436.00
8	002236	大华股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	19.75	831,500.00	16,422,125.00
9	002281	光迅科技	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 11 日	37.09	212,500.00	7,881,625.00
10	002335	科华数据	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	35.95	11,100.00	399,045.00
11	002368	太极股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	41.17	196,700.00	8,098,139.00
12	002373	千方科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	13.64	545,600.00	7,441,984.00
13	002402	和而泰	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	16.98	145,300.00	2,467,194.00
14	002405	四维图新	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	11.58	337,000.00	3,902,460.00
15	002415	海康威视	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	33.11	76,300.00	2,526,293.00
16	002439	启明星辰	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	63,300.00	1,883,808.00
17	002920	德赛西威	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	155.81	108,400.00	16,889,804.00
18	300212	易华录	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	33.23	188,700.00	6,270,501.00
19	300223	北京君正	2023 年 7 月 3 日	88.31	47,600.00	4,203,556.00

			-2023 年 7 月 14 日			0
20	300308	中际旭创	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	147.4 5	300,700.00	44,338,215.00
21	300383	光环新网	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	10.75	671,900.00	7,222,925.00
22	300418	昆仑万维	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 12 日	40.28	376,100.00	15,149,308.00
23	300454	深信服	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	113.2 5	6,300.00	713,475.00
24	300458	全志科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	27.25	178,800.00	4,872,300.00
25	300474	景嘉微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	89.99	113,800.00	10,240,862.00
26	300496	中科创达	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	96.35	39,800.00	3,834,730.00
27	300502	新易盛	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	67.97	355,000.00	24,129,350.00
28	300613	富瀚微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	56.74	57,400.00	3,256,876.00
29	600536	中国软件	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	46.88	268,400.00	12,582,592.00
30	600588	用友网络	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	20.50	51,300.00	1,051,650.00
31	600699	均胜电子	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	17.64	190,800.00	3,365,712.00
32	600718	东软集团	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	10.66	196,800.00	2,097,888.00
33	600845	宝信软件	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	50.81	12,600.00	640,206.00
34	600850	电科数字	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	23.59	171,900.00	4,055,121.00
35	601360	三六零	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	12.54	1,906,800.00	23,911,272.00
36	603019	中科曙光	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	50.90	507,200.00	25,816,480.00
37	603160	汇顶科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	46.25	22,100.00	1,022,125.00
38	603486	科沃斯	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	77.77	115,100.00	8,951,327.00
39	603501	韦尔股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	98.04	22,500.00	2,205,900.00
40	603893	瑞芯微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	72.85	35,200.00	2,564,320.00
41	688008	澜起科技	2023 年 7 月 3 日	57.42	400,600.00	23,002,452.00

			-2023 年 7 月 14 日			00
42	688023	安恒信息	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	174.7 1	27,600.00	4,821,996.0 0
43	688099	晶晨股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	84.32	132,300.00	11,155,536. 00
44	688111	金山办公	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	472.2 2	34,200.00	16,149,924. 00
45	688169	石头科技	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	320.6 8	27,900.00	8,946,972.0 0
46	688256	寒武纪	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	188.0 0	94,300.00	17,728,400. 00
47	688521	芯原股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	71.92	18,100.00	1,301,752.0 0
48	688608	恒玄科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	121.0 3	33,800.00	4,090,814.0 0
49	688686	奥普特	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	164.4 8	17,800.00	2,927,744.0 0
50	688696	极米科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	139.3 9	20,000.00	2,787,800.0 0
合计	-	-	-	-	12,883,400. 00	500,227,058 .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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

6.4.13.2 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对于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 2023 年 6 月 30 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%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 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 2023年6月30日	上年度末 2022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。

6.4.13.2.2 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

6.4.13.2.3 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

6.4.13.2.4 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

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。

6.4.13.2.5 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

6.4.13.2.6 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 2023年6月30日	上年度末 2022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

6.4.13.3 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 2023 年 6 月 30 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约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。

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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

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
资产					
银行存款	39,499,149.33	-	-	-	39,499,149.33
结算备付金	7,050,593.42	-	-	-	7,050,593.42
存出保证金	860,087.27	-	-	-	860,087.27

交易性金融资产	-	-	-	3,861,964,958.56	3,861,964,958.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	9,496,652.81	9,496,652.81
应收股利	-	-	-	68,942.38	68,942.38
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	308,167.64	308,167.64
资产总计	47,409,830.02	-	-	3,871,838,721.39	3,919,248,551.41
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	-	-	-	7,638,199.17	7,638,199.17
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	520,061.72	520,061.72
应付托管费	-	-	-	173,353.92	173,353.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	41,026.84	41,026.84
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	26,936,938.82	26,936,938.82
负债总计	-	-	-	35,309,580.47	35,309,580.47
利率敏感度缺口	47,409,830.02	-	-	3,836,529,140.92	3,883,938,970.94
上年度末 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	12,286,591.67	-	-	-	12,286,591.67
结算备付金	97,846.33	-	-	-	97,846.33

存出保证金	83,174.58	-	-	-	83,174.58
交易性金融资产	-	-	-	1,367,183,406.59	1,367,183,406.59
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	99,485.56	99,485.56
资产总计	12,467,612.58	-	-	1,367,282,892.15	1,379,750,504.73
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	-	-	-	498,096.24	498,096.24
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	179,715.89	179,715.89
应付托管费	-	-	-	59,905.27	59,905.27
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	11,541.02	11,541.02
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	495,465.07	495,465.07
负债总计	-	-	-	1,244,723.49	1,244,723.49
利率敏感度缺口	12,467,612.58	-	-	1,366,038,168.66	1,378,505,781.24

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。

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

6.4.13.4.3 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。

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	3,861,964,958.56	99.43	1,367,183,406.59	99.18
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	3,861,964,958.56	99.43	1,367,183,406.59	99.18

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
	1.业绩比较基准上升 5%	193,039,522.85	68,307,489.50
	2.业绩比较基准下降 5%	-193,039,522.85	-68,307,489.50

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	3,859,962,849.24
第二层次	461,074.44
第三层次	1,541,034.88
合计	3,861,964,958.56

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金公允价值应属第二层次还是第三层次。

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

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括银行存款、买入返售金融资产、其他各类应收款项、卖出回购金融资产款和其他各类应付款项，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 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。

§ 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	3,861,964,958.56	98.54

	其中：股票	3,861,964,958.56	98.54
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	46,549,742.75	1.19
8	其他各项资产	10,733,850.10	0.27
9	合计	3,919,248,551.41	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 500,227,058.00 元，占净值比例 12.88%。

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	2,188,351,011.59	56.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	83,928.25	0.00
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	1,673,431,239.19	43.09
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,861,965,146.56	99.43

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	占基金资产净值 比例（%）
1	002415	海康威视	10,881,033	360,271,002.63	9.28
2	002230	科大讯飞	4,438,376	301,632,032.96	7.77
3	300308	中际旭创	1,537,123	226,648,786.35	5.84
4	688111	金山办公	444,715	210,003,317.30	5.41
5	603501	韦尔股份	1,984,939	194,603,419.56	5.01
6	000938	紫光股份	5,481,224	174,576,984.40	4.49
7	603019	中科曙光	2,805,393	142,794,503.70	3.68
8	000977	浪潮信息	2,470,103	119,799,995.50	3.08
9	300502	新易盛	1,701,060	115,621,048.20	2.98
10	688008	澜起科技	1,904,683	109,366,897.86	2.82
11	601360	三六零	8,556,763	107,301,808.02	2.76
12	002920	德赛西威	666,168	103,795,636.08	2.67
13	600588	用友网络	4,933,723	101,141,321.50	2.60
14	688256	寒武纪	501,170	94,219,960.00	2.43
15	600845	宝信软件	1,724,137	87,603,400.97	2.26
16	300418	昆仑万维	2,007,100	80,845,988.00	2.08
17	002236	大华股份	3,984,804	78,699,879.00	2.03
18	300496	中科创达	767,800	73,977,530.00	1.90
19	300454	深信服	598,409	67,769,819.25	1.74
20	600536	中国软件	1,441,192	67,563,080.96	1.74
21	002405	四维图新	5,700,737	66,014,534.46	1.70
22	688099	晶晨股份	699,021	58,941,450.72	1.52
23	300223	北京君正	576,041	50,870,180.71	1.31
24	300474	景嘉微	544,530	49,002,254.70	1.26

25	002439	启明星辰	1,598,078	47,558,801.28	1.22
26	688521	芯原股份	599,792	43,137,040.64	1.11
27	688169	石头科技	133,960	42,958,292.80	1.11
28	002368	太极股份	1,043,312	42,953,155.04	1.11
29	603486	科沃斯	548,000	42,617,960.00	1.10
30	600699	均胜电子	2,293,138	40,450,954.32	1.04
31	002065	东华软件	5,374,445	37,943,581.70	0.98
32	002402	和而泰	2,232,297	37,904,403.06	0.98
33	300383	光环新网	3,446,141	37,046,015.75	0.95
34	002373	千方科技	2,650,281	36,149,832.84	0.93
35	002152	广电运通	2,971,966	34,831,441.52	0.90
36	002281	光迅科技	937,200	34,760,748.00	0.89
37	300212	易华录	956,142	31,772,598.66	0.82
38	002139	拓邦股份	2,417,478	31,548,087.90	0.81
39	603160	汇顶科技	657,339	30,401,928.75	0.78
40	002151	北斗星通	858,894	30,198,713.04	0.78
41	603893	瑞芯微	400,400	29,169,140.00	0.75
42	300458	全志科技	1,057,590	28,819,327.50	0.74
43	002335	科华数据	774,760	27,852,622.00	0.72
44	688023	安恒信息	131,706	23,010,355.26	0.59
45	600718	东软集团	2,034,741	21,690,339.06	0.56
46	688608	恒玄科技	171,575	20,765,722.25	0.53
47	600850	电科数字	820,400	19,353,236.00	0.50
48	300613	富瀚微	276,699	15,699,901.26	0.40
49	688686	奥普特	87,263	14,353,018.24	0.37
50	688696	极米科技	100,086	13,950,987.54	0.36
51	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.01
52	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
53	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
54	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
55	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
56	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
57	301358	湖南裕能	1,832	78,574.48	0.00
58	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.00
59	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
60	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
61	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
62	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
63	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
64	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
65	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
66	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
67	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
68	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00

69	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
70	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
71	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
72	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
73	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
74	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
75	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
76	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
77	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
78	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
79	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
80	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
81	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
82	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
83	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
84	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
85	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
86	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
87	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
88	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
89	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
90	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
91	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
92	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
93	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
94	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
95	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
96	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
97	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
98	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
99	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
100	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
101	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
102	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
103	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
104	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
105	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
106	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
107	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
108	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
109	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
110	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
111	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
112	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00

113	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
114	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
115	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
116	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
117	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
118	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
119	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
120	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
121	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
122	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
123	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	688111	金山办公	309,755,685.34	22.47
2	603501	韦尔股份	293,577,070.33	21.30
3	688256	寒武纪	255,281,981.42	18.52
4	603019	中科曙光	217,426,683.27	15.77
5	688008	澜起科技	203,571,927.48	14.77
6	600588	用友网络	194,831,070.54	14.13
7	300308	中际旭创	187,888,628.84	13.63
8	601360	三六零	187,289,974.33	13.59
9	600845	宝信软件	134,406,064.55	9.75
10	600536	中国软件	118,874,995.31	8.62
11	300418	昆仑万维	118,296,804.69	8.58
12	688521	芯原股份	110,310,625.05	8.00
13	688099	晶晨股份	108,142,939.15	7.84
14	300502	新易盛	107,334,020.58	7.79
15	603486	科沃斯	95,928,011.17	6.96
16	002415	海康威视	73,278,339.29	5.32
17	603160	汇顶科技	64,581,645.33	4.68
18	600699	均胜电子	62,030,565.75	4.50
19	603893	瑞芯微	56,028,084.78	4.06
20	688169	石头科技	43,564,332.95	3.16
21	688088	虹软科技	42,825,759.09	3.11
22	600718	东软集团	41,533,280.32	3.01
23	600728	佳都科技	39,726,628.45	2.88
24	600850	电科数字	34,221,934.48	2.48

25	002281	光迅科技	29,420,498.03	2.13
----	--------	------	---------------	------

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。

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	688256	寒武纪	216,528,604.22	15.71
2	603501	韦尔股份	198,741,206.23	14.42
3	603019	中科曙光	168,879,789.27	12.25
4	688008	澜起科技	149,761,596.84	10.86
5	600588	用友网络	148,430,817.65	10.77
6	601360	三六零	124,519,720.73	9.03
7	688111	金山办公	105,360,470.77	7.64
8	600845	宝信软件	102,756,473.88	7.45
9	688521	芯原股份	90,203,239.55	6.54
10	600536	中国软件	84,565,481.86	6.13
11	688099	晶晨股份	84,304,763.58	6.12
12	603486	科沃斯	77,548,869.35	5.63
13	002230	科大讯飞	75,221,656.98	5.46
14	300168	万达信息	62,758,164.21	4.55
15	688088	虹软科技	58,825,397.79	4.27
16	600728	佳都科技	55,633,095.77	4.04
17	603160	汇顶科技	49,145,634.90	3.57
18	600699	均胜电子	48,152,793.38	3.49
19	603893	瑞芯微	41,434,622.04	3.01
20	300188	美亚柏科	40,514,868.12	2.94
21	002236	大华股份	37,789,748.00	2.74
22	600718	东软集团	32,401,102.07	2.35
23	300454	深信服	32,012,091.61	2.32

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。

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	3,331,136,864.03
卖出股票收入（成交）总额	2,499,147,082.71

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

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 本基金投资的前十名证券的发行主体中,紫光股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到北京市规划和自然资源委员会海淀分局的处罚。

本基金为指数型基金,上述主体所发行的证券系标的指数成份股,上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外,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。

7.12.2 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。

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	860,087.27
2	应收清算款	9,496,652.81
3	应收股利	68,942.38
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	232,551.40
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	10,733,850.10

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	002230	科大讯飞	63,481,436.00	1.63	转融通流通受限
2	300308	中际旭创	44,338,215.00	1.14	转融通流通受限
3	603019	中科曙光	25,816,480.00	0.66	转融通流通受限
4	000977	浪潮信息	25,370,350.00	0.65	转融通流通受限
5	300502	新易盛	24,129,350.00	0.62	转融通流通受限
6	688008	澜起科技	23,002,452.00	0.59	转融通流通受限
7	000938	紫光股份	17,705,415.00	0.46	转融通流通受限
8	688111	金山办公	16,149,924.00	0.42	转融通流通受限
9	002415	海康威视	2,526,293.00	0.07	转融通流通受限
10	603501	韦尔股份	2,205,900.00	0.06	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		中国工商银行股份有限公司－易方达中证人工智能主题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
59,900	71,523.03	2,198,016,280.00	51.30%	2,086,213,389.00	48.70%	631,576,405.00	14.74%

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－易方达中证人工智能主题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	中国平安人寿保险股份有限公司－分红一个险分红	169,124,100.00	3.95%
2	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	125,044,700.00	2.92%
3	中国人寿资产管理有限公司	49,895,300.00	1.16%
4	中国人寿保险（集团）公司	44,881,402.00	1.05%
5	中国中信集团公司企业年金计划－中信银行	37,696,800.00	0.88%
6	北京诚通金控投资有限公司	37,371,103.00	0.87%

7	中国人寿财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	33,000,000.00	0.77%
8	友邦人寿保险有限公司—投连增长	32,003,300.00	0.75%
9	中韩人寿保险有限公司—传统险	31,050,000.00	0.72%
10	中国人寿保险股份有限公司	25,000,000.00	0.58%
11	中国工商银行股份有限公司—易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金	631,576,405.00	14.74%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年7月27日）基金份额总额	6,155,229,669.00
本报告期期初基金份额总额	2,050,229,669.00
本报告期基金总申购份额	6,253,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,019,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,284,229,669.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函
受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成

其他	/
----	---

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，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

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	
长江证券	1	3,735,070,464.45	64.22%	1,105,797.25	62.29%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	926,903,779.74	15.94%	92,690.75	5.22%	-
国融证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	1	906,243,265.30	15.58%	453,132.52	25.52%	-
恒泰证券	1	1,677,992.00	0.03%	839.09	0.05%	-
华创证券	1	23,856,638.48	0.41%	11,929.05	0.67%	-
华泰证券	2	41,702,318.63	0.72%	20,851.85	1.17%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	180,150,993.28	3.10%	90,077.75	5.07%	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
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，无新增交易单元。

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；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。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-

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	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东海证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-10
3	易方达基金管理有限公司关于易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-13
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	上海证券报	2023-03-30
5	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及	上海证券报、基金管理人	2023-03-31

	时提供或更新身份信息资料的公告	网站及中国证监会基金电子披露网站	
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东兴证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
7	易方达基金管理有限公司关于易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-14
8	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
9	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报	2023-04-21
10	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
11	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加东吴证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-24
12	易方达基金管理有限公司关于易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-27
13	易方达基金管理有限公司关于易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-04
14	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-07
15	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-07
16	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	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

1. 中国证监会准予易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
2. 《易方达中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
3. 《易方达中证人工智能主题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。

11.2 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。

11.3 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

二〇二三年八月三十日