

# 易方达中证云计算与大数据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：招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。

基金托管人招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	12
§ 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	78
7.1	期末基金资产组合情况	78
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	79
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	79
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	82
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	85
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	85
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	85
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	85
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	85

7.10	本基金投资股指期货的投资政策.....	85
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	86
7.12	投资组合报告附注.....	86
§ 8	基金份额持有人信息.....	87
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	87
8.2	期末上市基金前十名持有人.....	88
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	88
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.....	89
§ 9	开放式基金份额变动.....	89
§ 10	重大事件揭示.....	89
10.1	基金份额持有人大会决议.....	89
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.....	89
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	90
10.4	基金投资策略的改变.....	90
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	90
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.....	90
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	90
10.8	其他重大事件.....	92
§ 11	备查文件目录.....	93
11.1	备查文件目录.....	93
11.2	存放地点.....	93
11.3	查阅方式.....	94

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证云计算与大数据主题 ETF
场内简称	云计算、云计算 ETF
基金主代码	516510
交易代码	516510
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 29 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	招商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,033,890,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 4 月 7 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	<p>本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。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。本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证云计算与大数据主题指数收益率。
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	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	张姗
	联系电话	020-85102688	0755-83077987
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400 881 8088	95555
传真		020-38798812	0755-83195201
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银 行大厦
邮政编码		510620	518040
法定代表人		刘晓艳	缪建民

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
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	107,484,628.11
本期利润	171,408,245.16
加权平均基金份额本期利润	0.2778

本期加权平均净值利润率	24.71%
本期基金份额净值增长率	50.27%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
期末可供分配利润	76,408,850.20
期末可供分配基金份额利润	0.0739
期末基金资产净值	1,246,663,242.02
期末基金份额净值	1.2058
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	<b>报告期末(2023年6月30日)</b>
基金份额累计净值增长率	20.58%

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	3.64%	2.90%	3.64%	2.94%	0.00%	-0.04%
过去三个月	1.29%	2.87%	1.05%	2.91%	0.24%	-0.04%
过去六个月	50.27%	2.58%	50.33%	2.61%	-0.06%	-0.03%
过去一年	54.69%	2.16%	54.53%	2.19%	0.16%	-0.03%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	20.58%	1.91%	17.98%	1.93%	2.60%	-0.02%

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

易方达中证云计算与大数据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

(2021年3月29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 20.58%，同期业绩比较基准收益率为 17.98%。

## § 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）、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万	2021-03-29	-	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

	得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证新能源 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。
刘文魁	本基金的基金经理助理	2023-04-15	-	9 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任华夏基金管理有限公司基金运作高级经理，银华基金管理股份有限公司量化研究员、基金经理助理。

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

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金跟踪中证云计算与大数据主题指数，该指数从沪深市场中选取 50 只业务涉及提供云计算服务、大数据服务以及上述服务相关硬件设备的上市公司证券作为指数样本，以反映沪深市场云计算与大数据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。云计算与大数据作为数字经济和实体经济深度融合的基础设施的重要部分，在我国大力推动数字经济发展以及人工智能领域的投入迅速扩张等因素的推动下，得到投资者的持续关注，指数在大幅上涨后波动水平有所上升。本报告期内，中证云计算与大数据主题指数上涨 50.3%。

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 1.2058 元，本报告期份额净值增长率为 50.27%，同期业绩比较基准收益率为 50.33%，年化跟踪误差 0.50%，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。得益于全球云计算领域的快速发展和我国政策的持续支持，我国云计算行业市场规模快速增长，增速超过全球平均水平。云计算与大数据作为数字化的基石，是实现“十四五”规划中“加快数字化发展，建设数字中国”美好愿景不可或缺的基础设施。云计算与大数据产业受益于“东数西算”以及信创产业链的持续推进，在新一轮以人工智能引领的科技浪潮中，有望长期维持景气，其投资和配置价值值得关注。

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，为长期看好云计算与大数据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

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

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

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

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

本年度中期报告中利润分配情况真实、准确。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告（未经审计）

## 6.1 资产负债表

会计主体：易方达中证云计算与大数据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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	17,145,904.05	2,852,698.99
结算备付金		4,261,339.02	159,051.23
存出保证金		449,925.08	29,749.88
交易性金融资产	6.4.7.2	1,233,569,149.05	228,617,164.56
其中：股票投资		1,233,569,149.05	228,617,164.56
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		8,306,318.03	395,361.16
应收股利		48,359.51	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	165,138.33	-
资产总计		1,263,946,133.07	232,054,025.82
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		5,341,017.96	343,623.81
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		171,036.18	29,240.83
应付托管费		57,012.04	9,746.94
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		12,747.13	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	11,701,077.74	665,794.11
负债合计		17,282,891.05	1,048,405.69
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,033,890,000.00	287,890,000.00
未分配利润	6.4.7.8	212,773,242.02	-56,884,379.87
净资产合计		1,246,663,242.02	231,005,620.13
负债和净资产总计		1,263,946,133.07	232,054,025.82

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2058 元，基金份额总额 1,033,890,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：易方达中证云计算与大数据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
<b>一、营业总收入</b>		172,259,652.76	-57,896,154.98
1.利息收入		760,062.77	8,905.62
其中：存款利息收入	6.4.7.9	35,813.44	8,905.62
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		724,249.33	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		103,636,672.65	-19,199,875.81
其中：股票投资收益	6.4.7.10	101,000,629.31	-19,846,344.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	2,636,043.34	646,468.19
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	63,923,617.05	-39,378,158.46
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	3,939,300.29	672,973.67
<b>减：二、营业总支出</b>		851,407.60	356,440.27
1. 管理人报酬		510,498.84	139,581.25
2. 托管费		170,166.34	46,527.07
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		2,607.44	-
8. 其他费用	6.4.7.18	168,134.98	170,331.95
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>171,408,245.16</b>	<b>-58,252,595.25</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>171,408,245.16</b>	<b>-58,252,595.25</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		<b>171,408,245.16</b>	<b>-58,252,595.25</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证云计算与大数据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）	287,890,000.00	-56,884,379.87	231,005,620.13
二、本期期初净资产（基金净值）	287,890,000.00	-56,884,379.87	231,005,620.13
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	746,000,000.00	269,657,621.89	1,015,657,621.89
（一）、综合收益总额	-	171,408,245.16	171,408,245.16
（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）	746,000,000.00	98,249,376.73	844,249,376.73
其中：1.基金申	1,869,000,000.00	292,036,522.69	2,161,036,522.69

购款			
2. 基金赎回款	-1,123,000,000.00	-193,787,145.96	-1,316,787,145.96
(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)	1,033,890,000.00	212,773,242.02	1,246,663,242.02
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)	104,890,000.00	4,839,965.04	109,729,965.04
二、本期期初净资产(基金净值)	104,890,000.00	4,839,965.04	109,729,965.04
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	156,000,000.00	-62,353,366.85	93,646,633.15
(一)、综合收益总额	-	-58,252,595.25	-58,252,595.25
(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)	156,000,000.00	-4,100,771.60	151,899,228.40
其中：1. 基金申购款	281,000,000.00	-20,122,765.28	260,877,234.72
2. 基金赎回款	-125,000,000.00	16,021,993.68	-108,978,006.32
(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)	260,890,000.00	-57,513,401.81	203,376,598.19

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：王永铨

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

易方达中证云计算与大数据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[2021]768 号《关于准予易方达中证云计算与大数据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《易方达中证云计算与大数据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,《易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 29 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 384,890,000.00 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,基金托管人为招商银行股份有限公司。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 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

#### (1) 印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰,由出让方缴纳。

## （2）增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

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

价格作为买入价计算销售额。

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

### (3) 企业所得税

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

### (4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	17,145,904.05
等于：本金	17,143,643.88
加：应计利息	2,260.17
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	17,145,904.05

### 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	1,186,658,399.24	-	1,233,569,149.05	46,910,749.81
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	1,186,658,399.24	-	1,233,569,149.05	46,910,749.81

#### 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	89,522.09
待摊费用	75,616.24
合计	165,138.33

#### 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	417,948.70
其中：交易所市场	417,948.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	107,325.26
应付替代款	11,175,803.78
合计	11,701,077.74

## 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	287,890,000.00	287,890,000.00
本期申购	1,869,000,000.00	1,869,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,123,000,000.00	-1,123,000,000.00
本期末	1,033,890,000.00	1,033,890,000.00

## 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	-21,238,714.30	-35,645,665.57	-56,884,379.87
本期利润	107,484,628.11	63,923,617.05	171,408,245.16
本期基金份额交易产生的变动数	-9,837,063.61	108,086,440.34	98,249,376.73
其中：基金申购款	13,390,501.66	278,646,021.03	292,036,522.69
基金赎回款	-23,227,565.27	-170,559,580.69	-193,787,145.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	76,408,850.20	136,364,391.82	212,773,242.02

## 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
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	15,437.35
其他	1,341.45
合计	35,813.44

## 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	81,506,185.76
股票投资收益——赎回差价收入	19,494,443.55
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	101,000,629.31

**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	1,119,477,640.44
减：卖出股票成本总额	1,036,153,570.39
减：交易费用	1,817,884.29
买卖股票差价收入	81,506,185.76

**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	1,316,787,145.96
减：现金支付赎回款总额	892,261,481.96
减：赎回股票成本总额	405,031,220.45
减：交易费用	-
赎回差价收入	19,494,443.55

**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	2,636,043.34
其中：证券出借权益补偿收入	172,321.51

基金投资产生的股利收益	-
合计	2,636,043.34

## 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	63,923,617.05
——股票投资	63,923,617.05
——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	63,923,617.05

## 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	3,939,300.29
合计	3,939,300.29

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	17,900.90
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	6,425.96
其他	84,300.75

合计	168,134.98
----	------------

#### 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
招商银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	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	2,332,438,324.52	83.23%	249,331,728.15	84.83%

##### 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	240,808.34	50.62%	192,814.64	46.13%
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	124,678.64	84.83%	20,234.17	55.61%

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	510,498.84
其中：支付销售机构的客户维护费	7,384.23	2,744.03

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

基金管理费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

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	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
当期发生的基金应支付的托管费	170,166.34	46,527.07

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

基金托管费每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人双方核对无误后，基金托管人按照与基金管理人协商一致的方式于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。

#### 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	27,272,692.00	18,063.04	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
-	-	-	-	-

##### 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	2023 0315 0000 1480	卫宁健 康	2023- 03-15	853,3 05.00	81,500.00	14	3.4 1	1,131 .58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0321 0000 1497	网宿科 技	2023- 03-21	136,7 13.00	19,900.00	14	3.4 1	181.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0323 0000 0831	润和软 件	2023- 03-23	45,61 2.00	1,800.00	14	6.0 1	106.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0329 0001 5956	卫宁健 康	2023- 03-29	978,0 00.00	81,500.00	14	3.4 1	1,296 .94	0.00	0.00
广发证 券	2023 0331 0000 0514	万达信 息	2023- 03-31	60,69 6.00	5,400.00	14	3.4 1	80.49	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 3930	润和软 件	2023- 04-06	51,84 0.00	1,800.00	14	6.0 1	121.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0002 6325	数据港	2023- 04-10	425,4 12.00	11,700.00	14	1.7 0	281.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2582	新易盛	2023- 04-11	216,2 40.00	3,000.00	14	1.8 0	151.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2584	广联达	2023- 04-11	619,3 80.00	9,000.00	14	1.8 0	433.5 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2585	万达信 息	2023- 04-11	150,0 71.00	10,300.00	14	1.8 0	105.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2586	数字认 证	2023- 04-11	46,09 8.00	1,300.00	14	1.8 0	32.27	0.00	0.00

广发证 券	2023 0411 0000 2588	长亮科 技	2023- 04-11	68,85 0.00	5,000.00	14	1.8 0	48.20	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2589	深信服	2023- 04-11	350,7 36.00	2,400.00	14	1.8 0	245.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2594	科华数 据	2023- 04-11	132,7 50.00	3,000.00	14	1.8 0	92.93	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2595	太极股 份	2023- 04-11	149,2 05.00	3,500.00	14	1.8 0	104.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2596	石基信 息	2023- 04-11	146,8 35.00	6,500.00	14	1.8 0	102.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2597	美亚柏 科	2023- 04-11	110,7 60.00	3,900.00	14	1.8 0	77.53	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2600	浪潮信 息	2023- 04-11	348,6 00.00	8,400.00	14	1.8 0	244.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2603	汉得信 息	2023- 04-11	109,0 98.00	8,700.00	14	1.8 0	76.37	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2605	奥飞数 据	2023- 04-11	63,29 6.00	4,300.00	14	1.8 0	44.31	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2608	拓尔思	2023- 04-11	165,9 00.00	6,000.00	14	1.8 0	116.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2609	光环新 网	2023- 04-11	172,9 00.00	13,300.00	14	1.8 0	121.0 3	0.00	0.00
广发证	2023	华宇软	2023-	61,24	5,900.00	14	1.8	42.87	0.00	0.00

券	0411 0000 2612	件	04-11	2.00			0			
广发证 券	2023 0411 0000 2614	星网锐 捷	2023- 04-11	99,00 0.00	4,000.00	14	1.8 0	69.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2615	润和软 件	2023- 04-11	186,6 59.00	7,100.00	14	1.8 0	130.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2616	神州信 息	2023- 04-11	62,77 5.00	4,500.00	14	1.8 0	43.94	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2618	卫宁健 康	2023- 04-11	210,0 69.00	15,300.00	14	1.8 0	147.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2620	易华录	2023- 04-11	142,3 29.00	3,300.00	14	1.8 0	99.63	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2623	东方国 信	2023- 04-11	124,2 68.00	9,400.00	14	1.8 0	86.99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2624	数字政 通	2023- 04-11	86,66 0.00	3,500.00	14	1.8 0	60.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2626	神州泰 岳	2023- 04-11	177,0 12.00	14,900.00	14	1.8 0	123.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2627	网宿科 技	2023- 04-11	156,2 20.00	21,400.00	14	1.8 0	109.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2634	拓维信 息	2023- 04-11	147,2 90.00	10,300.00	14	1.8 0	103.1 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411	科大讯 飞	2023- 04-11	1,077 ,300.	18,000.00	14	1.8 0	754.1 1	0.00	0.00

	0000 2635			00						
广发证 券	2023 0411 0000 2636	梦网科 技	2023- 04-11	81,56 7.00	5,700.00	14	1.8 0	57.10	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2644	东华软 件	2023- 04-11	167,2 68.00	21,200.00	14	1.8 0	117.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2645	紫光股 份	2023- 04-11	516,9 28.00	16,400.00	14	1.8 0	361.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2646	优刻得	2023- 04-11	74,55 0.00	3,000.00	14	1.8 0	52.19	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2677	恒生电 子	2023- 04-11	718,0 28.00	14,600.00	14	1.8 0	502.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2696	云赛智 联	2023- 04-11	66,69 0.00	5,700.00	14	1.8 0	46.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2698	国网信 通	2023- 04-11	83,10 7.00	4,100.00	14	1.8 0	58.17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2715	用友网 络	2023- 04-11	494,0 00.00	20,000.00	14	1.8 0	345.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2719	安恒信 息	2023- 04-11	236,2 60.00	1,000.00	14	1.8 0	165.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2735	天下秀	2023- 04-11	76,64 8.00	8,800.00	14	1.8 0	53.65	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000	金山办 公	2023- 04-11	862,6 00.00	2,000.00	14	1.8 0	603.8 2	0.00	0.00

	2740									
广发证 券	2023 0411 0000 2748	电科数 字	2023- 04-11	84,01 0.00	3,100.00	14	1.8 0	58.81	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2755	奇安信	2023- 04-11	171,9 94.00	2,300.00	14	1.8 0	120.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2762	中科曙 光	2023- 04-11	430,7 10.00	10,500.00	14	1.8 0	301.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2764	华胜天 成	2023- 04-11	66,93 4.00	9,800.00	14	1.8 0	46.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2766	宝信软 件	2023- 04-11	297,4 32.00	5,100.00	14	1.8 0	208.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0001 2692	拓维信 息	2023- 04-11	217,3 60.00	15,200.00	14	1.7 0	143.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0001 5402	天下秀	2023- 04-12	104,5 98.00	11,700.00	14	1.7 0	69.15	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0002 7508	卫宁健 康	2023- 04-12	1,157 ,300. 00	81,500.00	14	3.4 1	1,534 .71	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 3647	石基信 息	2023- 04-14	679,5 35.00	31,100.00	14	1.7 0	449.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 9795	万达信 息	2023- 04-14	79,81 2.00	5,400.00	14	3.4 1	105.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0000 6965	浪潮信 息	2023- 04-20	575,9 32.00	13,400.00	14	3.1 0	694.3 2	0.00	0.00

广发证 券	2023 0420 0000 6977	拓维信 息	2023- 04-20	180,5 50.00	11,500.00	14	3.1 0	217.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0001 1519	润和软 件	2023- 04-20	47,61 0.00	1,800.00	14	6.0 1	111.2 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0005 3831	万达信 息	2023- 04-25	133,7 97.00	10,300.00	14	1.8 0	93.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3371	广联达	2023- 04-25	543,7 80.00	9,000.00	14	1.8 0	380.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3455	新易盛	2023- 04-25	221,4 00.00	3,000.00	14	1.8 0	154.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3557	天下秀	2023- 04-25	70,04 8.00	8,800.00	14	1.8 0	49.03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3559	拓维信 息	2023- 04-25	142,6 55.00	10,300.00	14	1.8 0	99.86	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3561	汉得信 息	2023- 04-25	95,09 1.00	8,700.00	14	1.8 0	66.56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 3563	科大讯 飞	2023- 04-25	1,101 ,060. 00	18,000.00	14	1.8 0	770.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4265	数字认 证	2023- 04-25	43,09 5.00	1,300.00	14	1.8 0	30.17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4269	科华数 据	2023- 04-25	123,3 90.00	3,000.00	14	1.8 0	86.37	0.00	0.00
广发证	2023	易华录	2023-	120,4	3,300.00	14	1.8	84.29	0.00	0.00

券	0425 0006 4273		04-25	17.00			0			
广发证 券	2023 0425 0006 4275	恒生电 子	2023- 04-25	681,8 20.00	14,600.00	14	1.8 0	477.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4277	云赛智 联	2023- 04-25	57,91 2.00	5,700.00	14	1.8 0	40.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4279	国网信 通	2023- 04-25	77,53 1.00	4,100.00	14	1.8 0	54.27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4283	安恒信 息	2023- 04-25	210,5 80.00	1,000.00	14	1.8 0	147.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4287	美亚柏 科	2023- 04-25	88,02 3.00	3,900.00	14	1.8 0	61.62	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4291	用友网 络	2023- 04-25	433,6 00.00	20,000.00	14	1.8 0	303.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4293	优刻得	2023- 04-25	65,07 0.00	3,000.00	14	1.8 0	45.55	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4297	奥飞数 据	2023- 04-25	59,98 5.00	4,300.00	14	1.8 0	41.99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4299	华字软 件	2023- 04-25	53,86 7.00	5,900.00	14	1.8 0	37.71	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4301	电科数 字	2023- 04-25	72,97 4.00	3,100.00	14	1.8 0	51.08	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425	奇安信	2023- 04-25	149,5 23.00	2,300.00	14	1.8 0	104.6 7	0.00	0.00

	0006 4303									
广发证 券	2023 0425 0006 4305	中科曙 光	2023- 04-25	623,5 95.00	10,500.00	14	1.8 0	436.5 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4307	华胜天 成	2023- 04-25	61,05 4.00	9,800.00	14	1.8 0	42.74	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4309	宝信软 件	2023- 04-25	283,8 66.00	5,100.00	14	1.8 0	198.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4311	太极股 份	2023- 04-25	150,5 00.00	3,500.00	14	1.8 0	105.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4313	梦网科 技	2023- 04-25	87,72 3.00	5,700.00	14	1.8 0	61.41	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4315	深信服	2023- 04-25	295,0 80.00	2,400.00	14	1.8 0	206.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4317	光环新 网	2023- 04-25	184,2 05.00	13,300.00	14	1.8 0	128.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4319	东方国 信	2023- 04-25	108,1 00.00	9,400.00	14	1.8 0	75.67	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4321	长亮科 技	2023- 04-25	60,35 0.00	5,000.00	14	1.8 0	42.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4323	网宿科 技	2023- 04-25	176,5 50.00	21,400.00	14	1.8 0	123.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006	紫光股 份	2023- 04-25	531,3 60.00	16,400.00	14	1.8 0	371.9 5	0.00	0.00

	4325									
广发证 券	2023 0425 0006 4327	金山办 公	2023- 04-25	891,6 00.00	2,000.00	14	1.8 0	624.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4333	神州信 息	2023- 04-25	59,67 0.00	4,500.00	14	1.8 0	41.77	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4335	卫宁健 康	2023- 04-25	177,7 86.00	15,300.00	14	1.8 0	124.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4337	石基信 息	2023- 04-25	123,4 35.00	6,500.00	14	1.8 0	86.40	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4339	星网锐 捷	2023- 04-25	89,64 0.00	4,000.00	14	1.8 0	62.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4343	润和软 件	2023- 04-25	168,2 70.00	7,100.00	14	1.8 0	117.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4345	拓尔思	2023- 04-25	155,8 80.00	6,000.00	14	1.8 0	109.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4347	浪潮信 息	2023- 04-25	395,6 40.00	8,400.00	14	1.8 0	276.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4351	数字政 通	2023- 04-25	111,8 95.00	3,500.00	14	1.8 0	78.33	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4353	神州泰 岳	2023- 04-25	208,0 04.00	14,900.00	14	1.8 0	145.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4361	东华软 件	2023- 04-25	159,2 12.00	21,200.00	14	1.8 0	111.4 5	0.00	0.00

广发证 券	2023 0426 0003 1270	天下秀	2023- 04-26	89,15 4.00	11,700.00	14	3.1 0	107.4 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0000 4661	浪潮信 息	2023- 04-27	1,322 ,256. 00	31,200.00	14	8.0 2	4,123 .97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0001 2666	万达信 息	2023- 04-28	70,47 0.00	5,400.00	14	3.4 1	93.45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0001 3120	石基信 息	2023- 04-28	595,5 65.00	31,100.00	14	3.1 0	717.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0003 6955	浪潮信 息	2023- 05-04	561,1 92.00	13,400.00	14	3.1 0	676.5 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 3841	拓维信 息	2023- 05-04	146,7 40.00	11,500.00	14	3.1 0	176.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9785	润和软 件	2023- 05-04	41,86 8.00	1,800.00	14	6.0 1	97.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1067	长亮科 技	2023- 05-09	56,20 0.00	5,000.00	14	1.8 0	39.34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1069	神州信 息	2023- 05-09	56,92 5.00	4,500.00	14	1.8 0	39.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1079	华胜天 成	2023- 05-09	68,89 4.00	9,800.00	14	1.8 0	48.23	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1087	深信服	2023- 05-09	278,4 72.00	2,400.00	14	1.8 0	194.9 3	0.00	0.00
广发证	2023	紫光股	2023-	470,1	16,400.00	14	1.8	329.1	0.00	0.00

券	0509 0001 1095	份	05-09	88.00			0	3		
广发证 券	2023 0509 0001 1123	天下秀	2023- 05-09	66,08 8.00	8,800.00	14	1.8 0	46.26	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1125	恒生电 子	2023- 05-09	678,0 24.00	14,600.00	14	1.8 0	474.6 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1131	云赛智 联	2023- 05-09	57,85 5.00	5,700.00	14	1.8 0	40.50	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1141	光环新 网	2023- 05-09	157,0 73.00	13,300.00	14	1.8 0	109.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1161	中科曙 光	2023- 05-09	556,2 90.00	10,500.00	14	1.8 0	389.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1167	优刻得	2023- 05-09	57,36 0.00	3,000.00	14	1.8 0	40.15	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1195	新易盛	2023- 05-09	192,8 40.00	3,000.00	14	1.8 0	134.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1197	数字认 证	2023- 05-09	42,27 6.00	1,300.00	14	1.8 0	29.59	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1233	浪潮信 息	2023- 05-09	324,7 44.00	8,400.00	14	1.8 0	227.3 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1235	安恒信 息	2023- 05-09	195,4 90.00	1,000.00	14	1.8 0	136.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509	润和软 件	2023- 05-09	168,4 12.00	7,100.00	14	1.8 0	117.8 9	0.00	0.00

	0001 1237									
广发证 券	2023 0509 0001 1241	奇安信	2023- 05-09	129,3 75.00	2,300.00	14	1.8 0	90.56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1243	东华软 件	2023- 05-09	165,5 72.00	21,200.00	14	1.8 0	115.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1669	广联达	2023- 05-09	495,0 00.00	9,000.00	14	1.8 0	346.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1675	用友网 络	2023- 05-09	420,0 00.00	20,000.00	14	1.8 0	294.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4325	奥飞数 据	2023- 05-09	57,14 7.00	4,300.00	14	1.8 0	40.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4345	万达信 息	2023- 05-09	158,1 05.00	10,300.00	14	1.8 0	110.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4347	东方国 信	2023- 05-09	107,9 12.00	9,400.00	14	1.8 0	75.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4349	汉得信 息	2023- 05-09	90,48 0.00	8,700.00	14	1.8 0	63.34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4351	美亚柏 科	2023- 05-09	86,97 0.00	3,900.00	14	1.8 0	60.88	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4353	易华录	2023- 05-09	117,0 84.00	3,300.00	14	1.8 0	81.96	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001	拓尔思	2023- 05-09	147,5 40.00	6,000.00	14	1.8 0	103.2 8	0.00	0.00

	4357									
广发证 券	2023 0509 0001 4359	卫宁健 康	2023- 05-09	174,4 20.00	15,300.00	14	1.8 0	122.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4411	金山办 公	2023- 05-09	890,7 20.00	2,000.00	14	1.8 0	623.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4459	梦网科 技	2023- 05-09	76,83 6.00	5,700.00	14	1.8 0	53.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4461	石基信 息	2023- 05-09	118,4 30.00	6,500.00	14	1.8 0	82.90	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4475	科大讯 飞	2023- 05-09	1,157 ,040. 00	18,000.00	14	1.8 0	809.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 4483	拓维信 息	2023- 05-09	123,6 00.00	10,300.00	14	1.8 0	86.52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8337	国网信 通	2023- 05-09	75,03 0.00	4,100.00	14	1.8 0	52.52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8347	电科数 字	2023- 05-09	72,85 0.00	3,100.00	14	1.8 0	51.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8377	网宿科 技	2023- 05-09	171,4 14.00	21,400.00	14	1.8 0	119.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8385	数字政 通	2023- 05-09	103,3 20.00	3,500.00	14	1.8 0	72.32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8387	星网锐 捷	2023- 05-09	83,24 0.00	4,000.00	14	1.8 0	58.27	0.00	0.00

广发证 券	2023 0509 0001 8391	宝信软 件	2023- 05-09	272,1 87.00	5,100.00	14	1.8 0	190.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8407	科华数 据	2023- 05-09	118,2 00.00	3,000.00	14	1.8 0	82.74	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8409	太极股 份	2023- 05-09	146,7 20.00	3,500.00	14	1.8 0	102.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8419	神州泰 岳	2023- 05-09	178,9 49.00	14,900.00	14	1.8 0	125.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 8443	华字软 件	2023- 05-09	53,98 5.00	5,900.00	14	1.8 0	37.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0003 0732	天下秀	2023- 05-10	88,80 3.00	11,700.00	14	3.1 0	107.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0511 0000 7475	浪潮信 息	2023- 05-11	1,102 ,608. 00	31,200.00	14	8.0 2	3,438 .91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0512 0000 4616	石基信 息	2023- 05-12	585,9 24.00	31,100.00	14	3.1 0	706.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0512 0000 6216	万达信 息	2023- 05-12	80,51 4.00	5,400.00	14	3.4 1	106.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 9884	润和软 件	2023- 05-18	40,80 6.00	1,800.00	7	6.0 1	47.69	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0003 4330	浪潮信 息	2023- 05-18	521,1 26.00	13,400.00	7	3.1 0	314.1 2	0.00	0.00
广发证	2023	拓维信	2023-	148,6	11,500.00	7	3.1	89.63	0.00	0.00

券	0518 0003 4360	息	05-18	95.00			0			
广发证 券	2023 0523 0001 2424	新易盛	2023- 05-23	189,0 90.00	3,000.00	7	1.8 0	66.18	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2434	梦网科 技	2023- 05-23	73,30 2.00	5,700.00	7	1.8 0	25.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2438	石基信 息	2023- 05-23	115,8 30.00	6,500.00	7	1.8 0	40.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2440	宝信软 件	2023- 05-23	266,7 30.00	5,100.00	7	1.8 0	93.36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2446	紫光股 份	2023- 05-23	449,6 88.00	16,400.00	7	1.8 0	157.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2462	数字政 通	2023- 05-23	93,31 0.00	3,500.00	7	1.8 0	32.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2472	网宿科 技	2023- 05-23	156,6 48.00	21,400.00	7	1.8 0	54.83	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2480	科大讯 飞	2023- 05-23	1,063 ,620. 00	18,000.00	7	1.8 0	372.2 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2494	奇安信	2023- 05-23	127,3 05.00	2,300.00	7	1.8 0	44.56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 2516	华胜天 成	2023- 05-23	61,05 4.00	9,800.00	7	1.8 0	21.37	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523	中科曙 光	2023- 05-23	470,6 10.00	10,500.00	7	1.8 0	164.7 1	0.00	0.00

	0001 2578									
广发证 券	2023 0523 0001 3754	金山办 公	2023- 05-23	816,4 00.00	2,000.00	7	1.8 0	285.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 3756	拓维信 息	2023- 05-23	119,7 89.00	10,300.00	7	1.8 0	41.93	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4260	科华数 据	2023- 05-23	117,9 30.00	3,000.00	7	1.8 0	41.28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4264	润和软 件	2023- 05-23	159,7 50.00	7,100.00	7	1.8 0	55.91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4278	华宇软 件	2023- 05-23	52,98 2.00	5,900.00	7	1.8 0	18.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4280	太极股 份	2023- 05-23	121,8 00.00	3,500.00	7	1.8 0	42.63	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4290	神州泰 岳	2023- 05-23	162,1 12.00	14,900.00	7	1.8 0	56.74	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4330	奥飞数 据	2023- 05-23	51,34 2.00	4,300.00	7	1.8 0	17.97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4336	恒生电 子	2023- 05-23	620,5 00.00	14,600.00	7	1.8 0	217.1 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4338	云赛智 联	2023- 05-23	52,26 9.00	5,700.00	7	1.8 0	18.29	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001	东方国 信	2023- 05-23	100,4 86.00	9,400.00	7	1.8 0	35.17	0.00	0.00

	4356									
广发证 券	2023 0523 0001 4358	汉得信 息	2023- 05-23	84,47 7.00	8,700.00	7	1.8 0	29.57	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4360	美亚柏 科	2023- 05-23	87,00 9.00	3,900.00	7	1.8 0	30.45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4362	易华录	2023- 05-23	104,3 79.00	3,300.00	7	1.8 0	36.53	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4368	拓尔思	2023- 05-23	162,0 00.00	6,000.00	7	1.8 0	56.70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4396	国网信 通	2023- 05-23	76,50 6.00	4,100.00	7	1.8 0	26.78	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4992	长亮科 技	2023- 05-23	53,85 0.00	5,000.00	7	1.8 0	18.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 4994	神州信 息	2023- 05-23	52,20 0.00	4,500.00	7	1.8 0	18.27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 5022	卫宁健 康	2023- 05-23	146,5 74.00	15,300.00	7	1.8 0	51.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 5032	数字认 证	2023- 05-23	39,52 0.00	1,300.00	7	1.8 0	13.83	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 5034	用友网 络	2023- 05-23	394,2 00.00	20,000.00	7	1.8 0	137.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 5056	东华软 件	2023- 05-23	146,2 80.00	21,200.00	7	1.8 0	51.20	0.00	0.00

广发证 券	2023 0523 0001 5060	优刻得	2023- 05-23	50,88 0.00	3,000.00	7	1.8 0	17.81	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 5192	安恒信 息	2023- 05-23	181,0 00.00	1,000.00	7	1.8 0	63.35	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6506	浪潮信 息	2023- 05-23	314,1 60.00	8,400.00	7	1.8 0	109.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6616	星网锐 捷	2023- 05-23	81,00 0.00	4,000.00	7	1.8 0	28.35	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6672	广联达	2023- 05-23	330,4 80.00	9,000.00	7	1.8 0	115.6 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6908	天下秀	2023- 05-23	62,21 6.00	8,800.00	7	1.8 0	21.78	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6924	万达信 息	2023- 05-23	138,1 23.00	10,300.00	7	1.8 0	48.34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 6952	电科数 字	2023- 05-23	73,09 8.00	3,100.00	7	1.8 0	25.58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0001 8836	深信服	2023- 05-23	290,5 68.00	2,400.00	7	1.8 0	101.7 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0002 2186	光环新 网	2023- 05-23	144,1 72.00	13,300.00	7	1.8 0	50.46	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 6790	拓维信 息	2023- 05-25	139,9 55.00	11,500.00	7	3.1 0	84.36	0.00	0.00
广发证	2023	浪潮信	2023-	1,245	31,200.00	7	8.0	1,942	0.00	0.00

券	0525 0002 6820	息	05-25	,504. 00			2	.29		
广发证 券	2023 0525 0002 7114	润和软 件	2023- 05-25	39,97 8.00	1,800.00	7	6.0 1	46.72	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 7320	浪潮信 息	2023- 05-25	534,9 28.00	13,400.00	7	3.1 0	322.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0526 0001 2193	万达信 息	2023- 05-26	71,01 0.00	5,400.00	7	3.4 1	47.08	0.00	0.00
广发证 券	2023 0526 0001 3204	石基信 息	2023- 05-26	570,6 85.00	31,100.00	7	3.1 0	344.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0371	新易盛	2023- 05-30	228,9 30.00	3,000.00	7	1.8 0	80.13	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0373	梦网科 技	2023- 05-30	74,49 9.00	5,700.00	7	1.8 0	26.07	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0374	石基信 息	2023- 05-30	125,6 45.00	6,500.00	7	1.8 0	43.98	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0375	宝信软 件	2023- 05-30	272,2 38.00	5,100.00	7	1.8 0	95.28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0377	紫光股 份	2023- 05-30	517,5 84.00	16,400.00	7	1.8 0	181.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0378	网宿科 技	2023- 05-30	162,6 40.00	21,400.00	7	1.8 0	56.92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530	科大讯 飞	2023- 05-30	1,083 ,600.	18,000.00	7	1.8 0	379.2 6	0.00	0.00

	0002 0379			00						
广发证 券	2023 0530 0002 0380	奇安信	2023- 05-30	130,1 57.00	2,300.00	7	1.8 0	45.55	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0381	中科曙 光	2023- 05-30	567,4 20.00	10,500.00	7	1.8 0	198.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0386	金山办 公	2023- 05-30	878,3 80.00	2,000.00	7	1.8 0	307.4 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0387	拓维信 息	2023- 05-30	148,1 14.00	10,300.00	7	1.8 0	51.84	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0392	科华数 据	2023- 05-30	112,0 20.00	3,000.00	7	1.8 0	39.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0393	润和软 件	2023- 05-30	167,8 44.00	7,100.00	7	1.8 0	58.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0394	太极股 份	2023- 05-30	128,4 50.00	3,500.00	7	1.8 0	44.96	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0395	神州泰 岳	2023- 05-30	193,7 00.00	14,900.00	7	1.8 0	67.80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0399	恒生电 子	2023- 05-30	617,5 80.00	14,600.00	7	1.8 0	216.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0402	东方国 信	2023- 05-30	107,9 12.00	9,400.00	7	1.8 0	37.77	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002	美亚柏 科	2023- 05-30	98,98 2.00	3,900.00	7	1.8 0	34.64	0.00	0.00

	0403									
广发证 券	2023 0530 0002 0404	易华录	2023- 05-30	112,1 34.00	3,300.00	7	1.8 0	39.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0406	拓尔思	2023- 05-30	187,2 00.00	6,000.00	7	1.8 0	65.52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0411	国网信 通	2023- 05-30	82,57 4.00	4,100.00	7	1.8 0	28.90	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0416	神州信 息	2023- 05-30	54,67 5.00	4,500.00	7	1.8 0	19.14	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0420	卫宁健 康	2023- 05-30	148,5 63.00	15,300.00	7	1.8 0	52.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0421	用友网 络	2023- 05-30	391,6 00.00	20,000.00	7	1.8 0	137.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0423	东华软 件	2023- 05-30	152,4 28.00	21,200.00	7	1.8 0	53.35	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0426	安恒信 息	2023- 05-30	172,3 00.00	1,000.00	7	1.8 0	60.31	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0664	浪潮信 息	2023- 05-30	367,7 52.00	8,400.00	7	1.8 0	128.7 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0671	天下秀	2023- 05-30	63,71 2.00	8,800.00	7	1.8 0	22.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0700	奥飞数 据	2023- 05-30	46,44 0.00	4,300.00	7	1.8 0	16.25	0.00	0.00

广发证 券	2023 0530 0002 0701	星网锐 捷	2023- 05-30	83,88 0.00	4,000.00	7	1.8 0	29.36	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0708	电科数 字	2023- 05-30	76,78 7.00	3,100.00	7	1.8 0	26.88	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0709	广联达	2023- 05-30	314,1 90.00	9,000.00	7	1.8 0	109.9 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0928	深信服	2023- 05-30	288,9 60.00	2,400.00	7	1.8 0	101.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0946	光环新 网	2023- 05-30	154,0 14.00	13,300.00	7	1.8 0	53.90	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0953	万达信 息	2023- 05-30	132,5 61.00	10,300.00	7	1.8 0	46.40	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1490	拓维信 息	2023- 06-01	167,5 55.00	11,500.00	7	3.1 0	101.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4753	浪潮信 息	2023- 06-01	606,8 86.00	13,400.00	7	3.1 0	365.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 5396	浪潮信 息	2023- 06-01	1,413 ,048. 00	31,200.00	7	8.0 2	2,203 .57	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 7138	润和软 件	2023- 06-01	43,72 2.00	1,800.00	7	6.0 1	51.09	0.00	0.00
广发证 券	2023 0602 0001 1360	石基信 息	2023- 06-02	620,1 34.00	31,100.00	7	3.1 0	373.8 0	0.00	0.00
广发证	2023	万达信	2023-	72,25	5,400.00	7	3.4	47.91	0.00	0.00

券	0602 0001 3813	息	06-02	2.00			1			
广发证 券	2023 0605 0000 4885	万达信 息	2023- 06-05	1,728 ,000. 00	120,000.0 0	14	3.2 1	2,157 .12	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4925	星网锐 捷	2023- 06-05	38,68 2.00	1,800.00	14	3.2 1	48.29	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0000 4358	星网锐 捷	2023- 06-06	410,0 32.00	19,600.00	14	3.2 1	511.8 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 3927	东华软 件	2023- 06-06	155,8 20.00	21,200.00	7	1.8 0	54.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 4013	中科曙 光	2023- 06-06	525,0 00.00	10,500.00	7	1.8 0	183.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 4122	科大讯 飞	2023- 06-06	1,144 ,800. 00	18,000.00	7	1.8 0	400.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 4220	金山办 公	2023- 06-06	902,4 00.00	2,000.00	7	1.8 0	315.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 4221	拓维信 息	2023- 06-06	144,8 18.00	10,300.00	7	1.8 0	50.69	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 5736	润和软 件	2023- 06-06	179,4 17.00	7,100.00	7	1.8 0	62.80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 6606	广联达	2023- 06-06	315,0 00.00	9,000.00	7	1.8 0	110.2 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606	紫光股 份	2023- 06-06	509,7 12.00	16,400.00	7	1.8 0	178.4 0	0.00	0.00

	0001 6693									
广发证 券	2023 0606 0001 6694	安恒信 息	2023- 06-06	179,7 60.00	1,000.00	7	1.8 0	62.92	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7032	电科数 字	2023- 06-06	75,82 6.00	3,100.00	7	1.8 0	26.54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7233	易华录	2023- 06-06	117,2 82.00	3,300.00	7	1.8 0	41.05	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7326	宝信软 件	2023- 06-06	266,3 22.00	5,100.00	7	1.8 0	93.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7327	奇安信	2023- 06-06	131,5 14.00	2,300.00	7	1.8 0	46.03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7450	科华数 据	2023- 06-06	113,1 60.00	3,000.00	7	1.8 0	39.61	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7660	石基信 息	2023- 06-06	125,1 25.00	6,500.00	7	1.8 0	43.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7661	网宿科 技	2023- 06-06	169,2 74.00	21,400.00	7	1.8 0	59.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7769	用友网 络	2023- 06-06	401,4 00.00	20,000.00	7	1.8 0	140.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 8615	国网信 通	2023- 06-06	79,74 5.00	4,100.00	7	1.8 0	27.91	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001	恒生电 子	2023- 06-06	620,7 92.00	14,600.00	7	1.8 0	217.2 8	0.00	0.00

	9218									
广发证 券	2023 0606 0001 9599	东方国 信	2023- 06-06	122,6 70.00	9,400.00	7	1.8 0	42.93	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 9600	拓尔思	2023- 06-06	175,3 80.00	6,000.00	7	1.8 0	61.38	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 9619	天下秀	2023- 06-06	66,44 0.00	8,800.00	7	1.8 0	23.25	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 9789	新易盛	2023- 06-06	238,5 00.00	3,000.00	7	1.8 0	83.48	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 9790	太极股 份	2023- 06-06	134,1 90.00	3,500.00	7	1.8 0	46.97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 9957	神州信 息	2023- 06-06	55,12 5.00	4,500.00	7	1.8 0	19.29	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 0237	神州泰 岳	2023- 06-06	201,5 97.00	14,900.00	7	1.8 0	70.56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 0238	美亚柏 科	2023- 06-06	96,56 4.00	3,900.00	7	1.8 0	33.80	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 0598	万达信 息	2023- 06-06	141,5 22.00	10,300.00	7	1.8 0	49.53	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 0887	梦网科 技	2023- 06-06	77,74 8.00	5,700.00	7	1.8 0	27.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 0897	深信服	2023- 06-06	293,4 00.00	2,400.00	7	1.8 0	102.6 9	0.00	0.00

广发证 券	2023 0606 0002 0993	光环新 网	2023- 06-06	154,2 80.00	13,300.00	7	1.8 0	54.00	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 1208	星网锐 捷	2023- 06-06	83,68 0.00	4,000.00	7	1.8 0	29.29	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 1290	卫宁健 康	2023- 06-06	151,7 76.00	15,300.00	7	1.8 0	53.12	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0002 1637	浪潮信 息	2023- 06-06	367,8 36.00	8,400.00	7	1.8 0	128.7 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 5160	润和软 件	2023- 06-08	46,06 2.00	1,800.00	7	6.0 1	53.83	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6336	浪潮信 息	2023- 06-08	576,8 70.00	13,400.00	7	3.1 0	347.7 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 6395	拓维信 息	2023- 06-08	184,3 45.00	11,500.00	7	3.1 0	111.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 7194	浪潮信 息	2023- 06-08	1,343 ,160. 00	31,200.00	7	8.0 2	2,094 .58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0609 0000 9478	石基信 息	2023- 06-09	590,5 89.00	31,100.00	7	3.1 0	355.9 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0609 0000 9637	万达信 息	2023- 06-09	72,90 0.00	5,400.00	7	3.4 1	48.34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8795	浪潮信 息	2023- 06-12	6,431 ,706. 00	142,200.0 0	14	3.7 5	9,379 .57	0.00	0.00
广发证	2023	中国长	2023-	1,969	141,400.0	14	3.2	2,458	0.00	0.00

券	0612 0002 8812	城	06-12	,702. 00	0		1	.84		
广发证 券	2023 0612 0002 8813	金山办 公	2023- 06-12	16,93 3,600 .00	34,700.00	14	3.7 5	24,69 4.83	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8830	中国长 城	2023- 06-12	110,0 47.00	7,900.00	14	3.7 5	160.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8975	中际旭 创	2023- 06-12	4,483 ,350. 00	36,900.00	14	3.7 5	6,538 .22	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9011	网宿科 技	2023- 06-12	39,55 2.00	4,800.00	14	3.7 5	57.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9012	中科曙 光	2023- 06-12	2,560 ,000. 00	50,000.00	14	3.7 5	3,733 .33	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0000 7425	中科星 图	2023- 06-13	1,496 ,840. 00	18,400.00	14	3.2 1	1,868 .56	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8151	中科曙 光	2023- 06-13	564,6 90.00	10,500.00	7	1.8 0	197.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8400	神州泰 岳	2023- 06-13	205,6 20.00	14,900.00	7	1.8 0	71.97	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8401	拓尔思	2023- 06-13	184,7 40.00	6,000.00	7	1.8 0	64.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8612	易华录	2023- 06-13	123,7 17.00	3,300.00	7	1.8 0	43.30	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613	紫光股 份	2023- 06-13	547,7 60.00	16,400.00	7	1.8 0	191.7 2	0.00	0.00

	0001 8712									
广发证 券	2023 0613 0001 8713	恒生电 子	2023- 06-13	622,5 44.00	14,600.00	7	1.8 0	217.8 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8818	万达信 息	2023- 06-13	133,3 85.00	10,300.00	7	1.8 0	46.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 8922	宝信软 件	2023- 06-13	230,7 75.00	5,100.00	7	1.8 0	80.77	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9134	星网锐 捷	2023- 06-13	88,72 0.00	4,000.00	7	1.8 0	31.05	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9231	卫宁健 康	2023- 06-13	157,4 37.00	15,300.00	7	1.8 0	55.10	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9371	拓维信 息	2023- 06-13	196,6 27.00	10,300.00	7	1.8 0	68.82	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9650	浪潮信 息	2023- 06-13	412,6 08.00	8,400.00	7	1.8 0	144.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9748	润和软 件	2023- 06-13	185,1 68.00	7,100.00	7	1.8 0	64.81	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9749	东方国 信	2023- 06-13	125,1 14.00	9,400.00	7	1.8 0	43.79	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9750	美亚柏 科	2023- 06-13	93,60 0.00	3,900.00	7	1.8 0	32.76	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001	网宿科 技	2023- 06-13	179,7 60.00	21,400.00	7	1.8 0	62.92	0.00	0.00

	9849									
广发证 券	2023 0613 0001 9851	国网信 通	2023- 06-13	83,27 1.00	4,100.00	7	1.8 0	29.14	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0001 9992	金山办 公	2023- 06-13	960,7 40.00	2,000.00	7	1.8 0	336.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0172	天下秀	2023- 06-13	77,00 0.00	8,800.00	7	1.8 0	26.95	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0382	梦网科 技	2023- 06-13	83,50 5.00	5,700.00	7	1.8 0	29.23	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0471	广联达	2023- 06-13	339,5 70.00	9,000.00	7	1.8 0	118.8 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0679	新易盛	2023- 06-13	184,1 40.00	3,000.00	7	1.8 0	64.45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0773	神州信 息	2023- 06-13	57,91 5.00	4,500.00	7	1.8 0	20.27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0775	东华软 件	2023- 06-13	170,8 72.00	21,200.00	7	1.8 0	59.81	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0891	电科数 字	2023- 06-13	78,43 0.00	3,100.00	7	1.8 0	27.45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 0994	石基信 息	2023- 06-13	130,0 00.00	6,500.00	7	1.8 0	45.50	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 1112	深信服	2023- 06-13	304,7 52.00	2,400.00	7	1.8 0	106.6 6	0.00	0.00

广发证 券	2023 0613 0002 1207	用友网 络	2023- 06-13	421,0 00.00	20,000.00	7	1.8 0	147.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 1296	安恒信 息	2023- 06-13	187,1 90.00	1,000.00	7	1.8 0	65.52	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 1356	科大讯 飞	2023- 06-13	1,347 ,300. 00	18,000.00	7	1.8 0	471.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 1749	光环新 网	2023- 06-13	164,7 87.00	13,300.00	7	1.8 0	57.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 1752	奇安信	2023- 06-13	134,7 80.00	2,300.00	7	1.8 0	47.17	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 2262	科华数 据	2023- 06-13	111,7 50.00	3,000.00	7	1.8 0	39.11	0.00	0.00
广发证 券	2023 0613 0002 2263	太极股 份	2023- 06-13	141,6 45.00	3,500.00	7	1.8 0	49.58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0001 3760	宝信软 件	2023- 06-15	180,7 92.00	3,600.00	14	3.2 1	225.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0001 3782	东华软 件	2023- 06-15	643,1 79.00	79,700.00	14	3.2 1	802.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 0867	浪潮信 息	2023- 06-15	1,623 ,024. 00	31,200.00	14	8.0 2	5,062 .03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 3814	拓维信 息	2023- 06-15	216,5 45.00	11,500.00	14	3.1 0	261.0 6	0.00	0.00
广发证	2023	润和软	2023-	44,78	1,800.00	14	6.0	104.6	0.00	0.00

券	0615 0003 8101	件	06-15	4.00			1	7		
广发证 券	2023 0615 0003 8155	浪潮信 息	2023- 06-15	697,0 68.00	13,400.00	14	3.1 0	840.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0616 0001 9084	万达信 息	2023- 06-16	70,47 0.00	5,400.00	14	3.4 1	93.45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0616 0002 0896	石基信 息	2023- 06-16	637,8 61.00	31,100.00	14	3.1 0	768.9 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0619 0001 9349	万达信 息	2023- 06-19	1,696 ,800. 00	120,000.0 0	14	3.2 1	1,664 .28	1,359,600.0 0	1,664.28
广发证 券	2023 0620 0001 7426	科大讯 飞	2023- 06-20	888,8 00.00	11,000.00	14	3.2 1	792.5 1	747,560.00	792.51
广发证 券	2023 0620 0003 0811	易华录	2023- 06-20	135,3 00.00	3,300.00	14	1.8 0	67.65	109,659.00	67.65
广发证 券	2023 0620 0003 1027	星网锐 捷	2023- 06-20	92,08 0.00	4,000.00	14	1.8 0	46.04	90,360.00	46.04
广发证 券	2023 0620 0003 1286	浪潮信 息	2023- 06-20	546,0 00.00	8,400.00	14	1.8 0	273.0 0	407,400.00	273.00
广发证 券	2023 0620 0003 1351	科大讯 飞	2023- 06-20	1,454 ,400. 00	18,000.00	14	1.8 0	727.2 0	1,223,280.0 0	727.20
广发证 券	2023 0620 0003 1569	万达信 息	2023- 06-20	147,2 90.00	10,300.00	14	1.8 0	73.65	116,699.00	73.65
广发证 券	2023 0620	广联达	2023- 06-20	366,0 30.00	9,000.00	14	1.8 0	183.0 2	292,410.00	183.02

	0003 1726									
广发证 券	2023 0620 0003 1782	中科曙 光	2023- 06-20	626,6 40.00	10,500.00	14	1.8 0	313.3 2	534,450.00	313.32
广发证 券	2023 0620 0003 2097	光环新 网	2023- 06-20	165,7 18.00	13,300.00	14	1.8 0	82.86	142,975.00	82.86
广发证 券	2023 0620 0003 2258	金山办 公	2023- 06-20	1,034 ,000. 00	2,000.00	14	1.8 0	517.0 0	944,440.00	517.00
广发证 券	2023 0620 0003 2416	拓尔思	2023- 06-20	198,4 80.00	6,000.00	14	1.8 0	99.24	155,820.00	99.24
广发证 券	2023 0620 0003 2417	润和软 件	2023- 06-20	188,1 50.00	7,100.00	14	1.8 0	94.08	170,116.00	94.08
广发证 券	2023 0620 0003 2424	石基信 息	2023- 06-20	111,9 30.00	6,500.00	14	1.8 0	55.97	91,000.00	55.97
广发证 券	2023 0620 0003 2523	卫宁健 康	2023- 06-20	173,3 49.00	15,300.00	14	1.8 0	86.67	165,546.00	86.67
广发证 券	2023 0620 0003 2583	奇安信	2023- 06-20	143,7 96.00	2,300.00	14	1.8 0	71.90	119,163.00	71.90
广发证 券	2023 0620 0003 3007	安恒信 息	2023- 06-20	204,6 80.00	1,000.00	14	1.8 0	102.3 4	174,710.00	102.34
广发证 券	2023 0620 0003 3114	宝信软 件	2023- 06-20	275,1 45.00	5,100.00	14	1.8 0	137.5 7	259,131.00	137.57
广发证 券	2023 0620 0003	紫光股 份	2023- 06-20	603,5 20.00	16,400.00	14	1.8 0	301.7 6	522,340.00	301.76

	3115									
广发证 券	2023 0620 0003 3709	神州信 息	2023- 06-20	58,86 0.00	4,500.00	14	1.8 0	29.43	55,350.00	29.43
广发证 券	2023 0620 0003 3923	美亚柏 科	2023- 06-20	101,9 07.00	3,900.00	14	1.8 0	50.95	81,081.00	50.95
广发证 券	2023 0620 0003 4032	东方国 信	2023- 06-20	122,6 70.00	9,400.00	14	1.8 0	61.34	105,656.00	61.34
广发证 券	2023 0620 0003 4076	梦网科 技	2023- 06-20	82,99 2.00	5,700.00	14	1.8 0	41.50	75,753.00	41.50
广发证 券	2023 0620 0003 4456	深信服	2023- 06-20	307,3 20.00	2,400.00	14	1.8 0	153.6 6	271,800.00	153.66
广发证 券	2023 0620 0003 4544	网宿科 技	2023- 06-20	176,1 22.00	21,400.00	14	1.8 0	88.06	152,154.00	88.06
广发证 券	2023 0620 0003 4761	太极股 份	2023- 06-20	161,7 00.00	3,500.00	14	1.8 0	80.85	144,095.00	80.85
广发证 券	2023 0620 0003 5354	用友网 络	2023- 06-20	462,6 00.00	20,000.00	14	1.8 0	231.3 0	410,000.00	231.30
广发证 券	2023 0620 0003 5430	天下秀	2023- 06-20	81,57 6.00	8,800.00	14	1.8 0	40.79	62,392.00	40.79
广发证 券	2023 0620 0003 5772	拓维信 息	2023- 06-20	210,1 20.00	10,300.00	14	1.8 0	105.0 6	198,893.00	105.06
广发证 券	2023 0620 0003 5831	东华软 件	2023- 06-20	172,1 44.00	21,200.00	14	1.8 0	86.07	149,672.00	86.07

广发证 券	2023 0620 0003 5956	恒生电 子	2023- 06-20	741,8 26.00	14,600.00	14	1.8 0	370.9 1	646,634.00	370.91
广发证 券	2023 0620 0003 5982	新易盛	2023- 06-20	240,0 00.00	3,000.00	14	1.8 0	120.0 0	203,910.00	120.00
广发证 券	2023 0620 0003 6435	国网信 通	2023- 06-20	85,69 0.00	4,100.00	14	1.8 0	42.85	82,779.00	42.85
广发证 券	2023 0620 0003 6484	科华数 据	2023- 06-20	113,3 10.00	3,000.00	14	1.8 0	56.66	107,850.00	56.66
广发证 券	2023 0620 0003 6819	电科数 字	2023- 06-20	81,09 6.00	3,100.00	14	1.8 0	40.55	73,129.00	40.55
广发证 券	2023 0620 0003 6830	神州泰 岳	2023- 06-20	231,0 99.00	14,900.00	14	1.8 0	115.5 5	208,600.00	115.55
广发证 券	2023 0621 0000 2498	中科星 图	2023- 06-21	107,4 72.00	1,200.00	14	3.2 1	86.25	96,696.00	86.25
广发证 券	2023 0626 0003 5625	网宿科 技	2023- 06-26	34,84 8.00	4,800.00	14	3.7 5	14.52	34,128.00	14.52
广发证 券	2023 0626 0003 6271	中际旭 创	2023- 06-26	5,461 ,200. 00	36,900.00	14	3.7 5	2,275 .50	5,440,905.0 0	2,275.50
广发证 券	2023 0626 0004 6940	中科曙 光	2023- 06-26	2,459 ,500. 00	50,000.00	14	3.7 5	1,024 .79	2,545,000.0 0	1,024.79
广发证 券	2023 0626 0004 7236	浪潮信 息	2023- 06-26	8,064 ,162. 00	142,200.0 0	14	3.7 5	3,360 .07	6,896,700.0 0	3,360.07
广发证	2023	金山办	2023-	16,57	34,700.00	14	3.7	6,906	16,386,034.	6,906.89

券	0626 0004 9467	公	06-26	6,537 .00			5	.89	00	
广发证 券	2023 0627 0001 7157	中科星 图	2023- 06-27	1,512 ,480. 00	18,400.00	14	3.2 1	404.5 9	1,482,672.0 0	404.59
广发证 券	2023 0629 0002 9970	润和软 件	2023- 06-29	41,99 4.00	1,800.00	14	6.0 1	7.01	43,128.00	7.01
广发证 券	2023 0629 0003 0399	浪潮信 息	2023- 06-29	643,7 36.00	13,400.00	14	3.1 0	55.43	649,900.00	55.43
广发证 券	2023 0629 0003 2438	浪潮信 息	2023- 06-29	1,498 ,848. 00	31,200.00	14	8.0 2	333.9 1	1,513,200.0 0	333.91
广发证 券	2023 0629 0003 5400	东华软 件	2023- 06-29	561,8 85.00	79,700.00	14	3.2 1	50.10	562,682.00	50.10
广发证 券	2023 0629 0003 5657	宝信软 件	2023- 06-29	182,5 20.00	3,600.00	14	3.2 1	16.27	182,916.00	16.27
广发证 券	2023 0629 0004 4633	拓维信 息	2023- 06-29	221,8 35.00	11,500.00	14	3.1 0	19.10	222,065.00	19.10
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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 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自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自有资金投资本基金。

##### 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
易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	79,890,606.00	7.7272%	-	-
广发证券股份有限公司	6,498,869.00	0.6286%	5,946,259.00	2.0655%

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
招商银行-活期存款	17,145,904.05	19,034.64	2,396,217.63	4,942.82

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

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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
-	-	-	-	-	-

#### 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
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	11.88	21.02	493	5,856.84	10,362.86	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
30114	中科	2023-0	6 个月	新股	41.20	42.69	262	10,794	11,184	-

1	磁业	3-27		流通受限				.40	.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	-
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	522	16,881.48	16,630.92	-
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	-

30134 5	涛涛 车业	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	73.45	46.64	106	7,785. 70	4,943. 84	-
30135 5	南王 科技	2023-0 6-02	6 个月	新股 流通 受限	17.55	16.75	563	9,880. 65	9,430. 25	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月	新股 流通 受限	23.77	42.89	302	7,178. 54	12,952 .78	-
30136 0	荣旗 科技	2023-0 4-17	6 个月	新股 流通 受限	71.88	92.60	134	9,631. 92	12,408 .40	-
30137 3	凌玮 科技	2023-0 1-20	6 个月	新股 流通 受限	33.73	31.85	232	7,825. 36	7,389. 20	-
30137 6	致欧 科技	2023-0 6-14	6 个月	新股 流通 受限	24.66	22.51	420	10,357 .20	9,454. 20	-
30138 2	蜂助 手	2023-0 5-09	6 个月	新股 流通 受限	23.80	32.84	408	9,710. 40	13,398 .72	-
30138 6	未来 电器	2023-0 3-21	6 个月	新股 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336 .22	8,992. 62	-
30139 7	溯联 股份	2023-0 6-15	6 个月	新股 流通 受限	53.27	40.20	362	19,283 .74	14,552 .40	-
30139 9	英特 科技	2023-0 5-16	6 个月	新股 流通 受限	43.99	51.57	293	12,889 .07	15,110 .01	-
30140 8	华人 健康	2023-0 2-22	6 个月	新股 流通 受限	16.24	16.95	782	12,699 .68	13,254 .90	-
30141 9	阿莱 德	2023-0 2-02	6 个月	新股 流通 受限	24.80	43.85	330	8,184. 00	14,470 .50	-
30142 8	世纪 恒通	2023-0 5-10	6 个月	新股 流通 受限	26.35	30.60	229	6,034. 15	7,007. 40	-
30143 9	泓淋 电力	2023-0 3-10	6 个月	新股 流通 受限	19.99	16.90	336	6,716. 64	5,678. 40	-
30148 6	致尚 科技	2023-0 6-30	1 个月 以内	新股 流通	57.66	57.66	4,338	250,12 9.08	250,12 9.08	-

				受限						
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	1,136	7,474.88	8,610.88	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股流通受限	10.36	11.84	476	4,931.36	5,635.84	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股流通受限	11.66	12.26	363	4,232.58	4,450.38	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股流通受限	25.98	24.53	126	3,273.48	3,090.78	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股流通受限	17.80	17.89	375	6,675.00	6,708.75	-
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	374	13,520.10	14,260.62	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	新股流通受限	19.86	18.06	4,122	81,862.92	74,443.32	-
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	1,098	13,285.80	13,252.86	-
68836	中科	2023-0	6个月	新股	23.60	64.67	645	15,222	41,712	-

1	飞测	5-12		流通受限				.00	.15	
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	343	9,144.38	10,804.50	-
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	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	新股流通受限	11.10	17.04	3,513	38,994.30	59,861.52	-
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	93	15,470.28	11,356.23	-
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	133	20,266.54	18,084.01	-
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	000066	中国长城	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 11 日	13.83	25,000.00	345,750.00
2	000555	神州信息	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	12.30	112,700.00	1,386,210.00

3	000938	紫光股份	2023年7月3日 -2023年7月14日	31.85	117,300.00	3,736,005.00
4	000977	浪潮信息	2023年7月4日 -2023年7月13日	48.50	205,900.00	9,986,150.00
5	002065	东华软件	2023年7月4日 -2023年7月13日	7.06	312,000.00	2,202,720.00
6	002123	梦网科技	2023年7月3日 -2023年7月12日	13.29	81,700.00	1,085,793.00
7	002153	石基信息	2023年7月3日 -2023年7月4日	14.00	28,700.00	401,800.00
8	002230	科大讯飞	2023年7月3日 -2023年7月14日	67.96	316,100.00	21,482,156.00
9	002261	拓维信息	2023年7月3日 -2023年7月14日	19.31	193,500.00	3,736,485.00
10	002335	科华数据	2023年7月4日 -2023年7月12日	35.95	22,400.00	805,280.00
11	002368	太极股份	2023年7月3日 -2023年7月11日	41.17	76,300.00	3,141,271.00
12	002396	星网锐捷	2023年7月3日 -2023年7月14日	22.59	92,000.00	2,078,280.00
13	002410	广联达	2023年7月4日 -2023年7月4日	32.49	50,800.00	1,650,492.00
14	002439	启明星辰	2023年7月12日 -2023年7月13日	29.76	3,000.00	89,280.00
15	300002	神州泰岳	2023年7月3日 -2023年7月14日	14.00	375,000.00	5,250,000.00
16	300017	网宿科技	2023年7月3日 -2023年7月13日	7.11	423,100.00	3,008,241.00
17	300166	东方国信	2023年7月3日 -2023年7月14日	11.24	176,200.00	1,980,488.00
18	300168	万达信息	2023年7月3日 -2023年7月11日	11.33	281,000.00	3,183,730.00
19	300188	美亚柏科	2023年7月3日 -2023年7月14日	20.79	85,800.00	1,783,782.00
20	300212	易华录	2023年7月3日 -2023年7月14日	33.23	71,300.00	2,369,299.00
21	300229	拓尔思	2023年7月3日 -2023年7月14日	25.97	104,000.00	2,700,880.00
22	300253	卫宁健康	2023年7月4日 -2023年7月14日	10.82	79,300.00	858,026.00
23	300308	中际旭创	2023年7月5日 -2023年7月14日	147.45	106,500.00	15,703,425.00
24	300339	润和软件	2023年7月3日 -2023年7月14日	23.96	155,000.00	3,713,800.00

25	300379	东方通	2023年7月10日 -2023年7月10日	20.57	91,900.00	1,890,383.0 0
26	300383	光环新网	2023年7月4日 -2023年7月13日	10.75	198,100.00	2,129,575.0 0
27	300454	深信服	2023年7月4日 -2023年7月4日	113.2 5	2,400.00	271,800.00
28	300502	新易盛	2023年7月3日 -2023年7月14日	67.97	130,700.00	8,883,679.0 0
29	300768	迪普科技	2023年7月3日 -2023年7月13日	16.57	42,800.00	709,196.00
30	301171	易点天下	2023年7月10日 -2023年7月10日	22.10	18,600.00	411,060.00
31	600131	国网信通	2023年7月3日 -2023年7月13日	20.19	40,900.00	825,771.00
32	600536	中国软件	2023年7月3日 -2023年7月11日	46.88	90,700.00	4,252,016.0 0
33	600556	天下秀	2023年7月3日 -2023年7月14日	7.09	210,200.00	1,490,318.0 0
34	600570	恒生电子	2023年7月4日 -2023年7月4日	44.29	14,600.00	646,634.00
35	600588	用友网络	2023年7月4日 -2023年7月4日	20.50	20,000.00	410,000.00
36	600845	宝信软件	2023年7月4日 -2023年7月13日	50.81	8,700.00	442,047.00
37	600850	电科数字	2023年7月3日 -2023年7月14日	23.59	62,900.00	1,483,811.0 0
38	603019	中科曙光	2023年7月3日 -2023年7月14日	50.90	218,000.00	11,096,200. 00
39	688023	安恒信息	2023年7月3日 -2023年7月14日	174.7 1	10,100.00	1,764,571.0 0
40	688066	航天宏图	2023年7月11日 -2023年7月11日	60.90	30,100.00	1,833,090.0 0
41	688111	金山办公	2023年7月4日 -2023年7月10日	472.2 2	36,700.00	17,330,474. 00
42	688232	新点软件	2023年7月3日 -2023年7月3日	53.81	11,200.00	602,672.00
43	688561	奇安信	2023年7月4日 -2023年7月4日	51.81	2,300.00	119,163.00
44	688568	中科星图	2023年7月5日 -2023年7月11日	80.58	19,600.00	1,579,368.0 0
合计	-	-	-	-	4,755,100.0 0	150,851,171 .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	17,145,904.05	-	-	-	17,145,904.05
结算备付金	4,261,339.02	-	-	-	4,261,339.02
存出保证金	449,925.08	-	-	-	449,925.08
交易性金融资产	-	-	-	1,233,569,149.05	1,233,569,149.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	8,306,318.03	8,306,318.03
应收股利	-	-	-	48,359.51	48,359.51
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	165,138.33	165,138.33
资产总计	21,857,168.15	-	-	1,242,088,964.92	1,263,946,133.07
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	-	-	-	5,341,017.96	5,341,017.96
应付赎回款	-	-	-	-	-

应付管理人报酬	-	-	-	171,036.18	171,036.18
应付托管费	-	-	-	57,012.04	57,012.04
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	12,747.13	12,747.13
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	11,701,077.74	11,701,077.74
负债总计	-	-	-	17,282,891.05	17,282,891.05
利率敏感度缺口	21,857,168.15	-	-	1,224,806,073.87	1,246,663,242.02
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	2,852,698.99	-	-	-	2,852,698.99
结算备付金	159,051.23	-	-	-	159,051.23
存出保证金	29,749.88	-	-	-	29,749.88
交易性金融资产	-	-	-	228,617,164.56	228,617,164.56
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	395,361.16	395,361.16
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,041,500.10	-	-	229,012,525.72	232,054,025.82
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	-	-	-	343,623.81	343,623.81

应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	29,240.83	29,240.83
应付托管费	-	-	-	9,746.94	9,746.94
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	665,794.11	665,794.11
负债总计	-	-	-	1,048,405.69	1,048,405.69
利率敏感度缺口	3,041,500.10	-	-	227,964,120.03	231,005,620.13

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	1,233,569,149.05	98.95	228,617,164.56	98.97
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,233,569,149.05	98.95	228,617,164.56	98.97

#### 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%	61,605,083.04	11,424,855.97
2.业绩比较基准下降5%	-61,605,083.04	-11,424,855.97	

#### 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	1,232,102,526.93
第二层次	461,074.44
第三层次	1,005,547.68
合计	1,233,569,149.05

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

层次，确定相关金融工具的公允价值应属第二层次或第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,233,569,149.05	97.60
	其中：股票	1,233,569,149.05	97.60
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	21,407,243.07	1.69
8	其他各项资产	8,969,740.95	0.71
9	合计	1,263,946,133.07	100.00

注：本基金本报告期末融出证券市值为 150,851,171.00 元，占净值比例 12.10%。

## 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	360,959,771.53	28.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	6,825.89	0.00
F	批发和零售业	41,682.84	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	872,472,417.41	69.98
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	1,233,569,149.05	98.95

## 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	002230	科大讯飞	1,826,200	124,108,552.00	9.96
2	688111	金山办公	189,142	89,316,635.24	7.16
3	300308	中际旭创	552,400	81,451,380.00	6.53
4	600570	恒生电子	1,559,476	69,069,192.04	5.54

5	000938	紫光股份	1,904,800	60,667,880.00	4.87
6	603019	中科曙光	1,188,418	60,490,476.20	4.85
7	000977	浪潮信息	1,057,500	51,288,750.00	4.11
8	300502	新易盛	728,377	49,507,784.69	3.97
9	002410	广联达	1,367,126	44,417,923.74	3.56
10	600588	用友网络	2,112,895	43,314,347.50	3.47
11	600845	宝信软件	738,615	37,529,028.15	3.01
12	300454	深信服	256,085	29,001,626.25	2.33
13	600536	中国软件	617,450	28,946,056.00	2.32
14	300002	神州泰岳	2,012,500	28,175,000.00	2.26
15	000066	中国长城	1,985,000	27,452,550.00	2.20
16	002439	启明星辰	683,800	20,349,888.00	1.63
17	002261	拓维信息	1,031,200	19,912,472.00	1.60
18	300339	润和软件	817,000	19,575,320.00	1.57
19	300253	卫宁健康	1,762,900	19,074,578.00	1.53
20	002368	太极股份	447,900	18,440,043.00	1.48
21	300017	网宿科技	2,499,800	17,773,578.00	1.43
22	300168	万达信息	1,478,800	16,754,804.00	1.34
23	002065	东华软件	2,301,400	16,247,884.00	1.30
24	300383	光环新网	1,473,600	15,841,200.00	1.27
25	300229	拓尔思	570,500	14,815,885.00	1.19
26	688561	奇安信	280,860	14,551,356.60	1.17
27	300212	易华录	409,810	13,617,986.30	1.09
28	002335	科华数据	331,700	11,924,615.00	0.96
29	002212	天融信	1,214,000	11,775,800.00	0.94
30	002153	石基信息	840,135	11,761,890.00	0.94
31	688066	航天宏图	186,473	11,356,205.70	0.91
32	300188	美亚柏科	529,200	11,002,068.00	0.88
33	002396	星网锐捷	486,100	10,980,999.00	0.88
34	300451	创业慧康	1,269,900	10,641,762.00	0.85
35	300166	东方国信	946,000	10,633,040.00	0.85
36	688023	安恒信息	57,255	10,003,021.05	0.80
37	600131	国网信通	492,842	9,950,479.98	0.80
38	300379	东方通	464,700	9,558,879.00	0.77
39	300525	博思软件	601,980	9,234,373.20	0.74
40	002123	梦网科技	658,500	8,751,465.00	0.70
41	600850	电科数字	351,830	8,299,669.70	0.67
42	688568	中科星图	101,628	8,189,184.24	0.66
43	300687	赛意信息	289,700	8,047,866.00	0.65
44	600556	天下秀	1,111,300	7,879,117.00	0.63
45	000555	神州信息	604,700	7,437,810.00	0.60
46	300442	润泽科技	193,500	5,952,060.00	0.48
47	688232	新点软件	102,556	5,518,538.36	0.44
48	603171	税友股份	125,100	5,001,498.00	0.40

49	300768	迪普科技	263,907	4,372,938.99	0.35
50	301171	易点天下	96,700	2,137,070.00	0.17
51	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
52	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
53	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.01
54	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
55	688249	晶合集成	4,122	74,443.32	0.01
56	688472	阿特斯	3,513	59,861.52	0.00
57	688361	中科飞测	645	41,712.15	0.00
58	301291	明阳电气	1,206	37,422.18	0.00
59	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
60	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
61	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
62	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
63	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
64	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
65	688531	日联科技	133	18,084.01	0.00
66	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
67	301307	美利信	522	16,630.92	0.00
68	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
69	688623	二元科技	178	15,448.62	0.00
70	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
71	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
72	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
73	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
74	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
75	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
76	688146	中船特气	374	14,260.62	0.00
77	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
78	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
79	301408	华人健康	782	13,254.90	0.00
80	688352	硕中科技	1,098	13,252.86	0.00
81	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
82	301358	湖南裕能	302	12,952.78	0.00
83	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
84	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
85	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
86	688507	索辰科技	93	11,356.23	0.00
87	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
88	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
89	688433	华曙高科	343	10,804.50	0.00
90	001287	中电港	493	10,362.86	0.00
91	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
92	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00

93	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
94	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
95	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
96	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
97	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
98	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
99	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
100	601061	中信金属	1,136	8,610.88	0.00
101	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
102	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
103	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
104	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
105	301373	凌玮科技	232	7,389.20	0.00
106	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
107	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
108	603135	中重科技	375	6,708.75	0.00
109	301439	泓淋电力	336	5,678.40	0.00
110	601065	江盐集团	476	5,635.84	0.00
111	301345	涛涛车业	106	4,943.84	0.00
112	601133	柏诚股份	363	4,450.38	0.00
113	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
114	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
115	603125	常青科技	126	3,090.78	0.00
116	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
117	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
118	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
119	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
120	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	002230	科大讯飞	225,069,351.52	97.43
2	000938	紫光股份	120,437,573.92	52.14
3	002410	广联达	108,660,749.80	47.04
4	300308	中际旭创	92,532,940.43	40.06
5	000977	浪潮信息	86,131,102.68	37.29
6	300454	深信服	76,044,412.78	32.92
7	300502	新易盛	65,362,547.48	28.29

8	300002	神州泰岳	44,580,985.12	19.30
9	300339	润和软件	38,553,205.79	16.69
10	300253	卫宁健康	38,419,934.32	16.63
11	000066	中国长城	37,299,297.13	16.15
12	300168	万达信息	37,111,565.36	16.07
13	002368	太极股份	36,505,701.82	15.80
14	300017	网宿科技	36,190,244.07	15.67
15	002065	东华软件	33,677,882.15	14.58
16	300383	光环新网	33,511,197.58	14.51
17	600536	中国软件	32,063,319.32	13.88
18	300229	拓尔思	31,616,492.17	13.69
19	002439	启明星辰	30,102,079.00	13.03
20	002261	拓维信息	29,431,551.40	12.74
21	300212	易华录	27,859,258.15	12.06
22	002153	石基信息	25,787,734.66	11.16
23	002335	科华数据	25,060,367.91	10.85
24	300188	美亚柏科	22,602,622.65	9.78
25	300166	东方国信	21,968,299.00	9.51
26	002396	星网锐捷	21,155,394.89	9.16
27	002123	梦网科技	18,930,782.46	8.19
28	300170	汉得信息	18,119,053.55	7.84
29	300687	赛意信息	17,920,875.96	7.76
30	300075	数字政通	17,430,818.92	7.55
31	002212	天融信	17,162,747.00	7.43
32	688023	安恒信息	15,311,257.95	6.63
33	300451	创业慧康	15,163,421.81	6.56
34	300379	东方通	15,070,413.28	6.52
35	002649	博彦科技	14,137,615.00	6.12
36	000555	神州信息	13,521,635.00	5.85
37	300525	博思软件	13,228,558.20	5.73
38	300348	长亮科技	11,636,783.00	5.04
39	688066	航天宏图	11,366,327.67	4.92
40	300271	华宇软件	10,699,954.00	4.63
41	300738	奥飞数据	10,558,576.08	4.57
42	300768	迪普科技	10,427,057.58	4.51
43	688568	中科星图	9,382,631.02	4.06
44	300442	润泽科技	8,648,352.20	3.74
45	300662	科锐国际	8,304,960.80	3.60
46	300579	数字认证	6,841,330.50	2.96
47	688232	新点软件	6,110,109.42	2.65
48	002990	盛视科技	6,088,865.00	2.64
49	603171	税友股份	5,577,587.00	2.41

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	002230	科大讯飞	154,035,127.88	66.68
2	000938	紫光股份	81,052,973.53	35.09
3	300308	中际旭创	68,836,956.08	29.80
4	002410	广联达	65,357,722.46	28.29
5	000977	浪潮信息	57,838,140.85	25.04
6	300454	深信服	51,188,800.10	22.16
7	300502	新易盛	44,353,016.38	19.20
8	300002	神州泰岳	30,029,308.85	13.00
9	300339	润和软件	24,305,818.73	10.52
10	300253	卫宁健康	23,944,353.88	10.37
11	300017	网宿科技	23,537,824.00	10.19
12	300168	万达信息	23,026,135.86	9.97
13	002368	太极股份	22,453,996.82	9.72
14	002065	东华软件	21,300,842.00	9.22
15	300383	光环新网	21,036,179.60	9.11
16	300075	数字政通	20,726,790.73	8.97
17	002261	拓维信息	20,282,599.62	8.78
18	300229	拓尔思	20,053,228.24	8.68
19	300170	汉得信息	19,790,289.94	8.57
20	300212	易华录	17,137,937.62	7.42
21	002649	博彦科技	16,951,871.00	7.34
22	002153	石基信息	16,442,737.49	7.12
23	002335	科华数据	14,980,625.32	6.48
24	300166	东方国信	14,262,546.24	6.17
25	300188	美亚柏科	13,963,854.24	6.04
26	002396	星网锐捷	13,250,566.00	5.74
27	300348	长亮科技	13,003,669.79	5.63
28	300271	华宇软件	12,812,254.08	5.55
29	300738	奥飞数据	12,385,942.90	5.36
30	002123	梦网科技	12,117,190.00	5.25
31	300687	赛意信息	11,023,682.35	4.77
32	600410	华胜天成	10,339,470.00	4.48
33	688158	优刻得	9,923,936.21	4.30
34	000066	中国长城	9,888,068.40	4.28
35	300662	科锐国际	8,657,087.61	3.75
36	600602	云赛智联	8,255,285.68	3.57
37	300579	数字认证	7,872,110.71	3.41
38	688111	金山办公	7,788,219.49	3.37
39	002439	启明星辰	7,767,778.00	3.36

40	000555	神州信息	7,624,744.14	3.30
41	603881	数据港	7,584,870.32	3.28
42	002990	盛视科技	7,041,697.02	3.05
43	300768	迪普科技	6,969,107.50	3.02
44	688023	安恒信息	6,917,818.14	2.99
45	603019	中科曙光	5,120,770.93	2.22

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	1,693,504,018.95
卖出股票收入（成交）总额	1,119,477,640.44

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	449,925.08
2	应收清算款	8,306,318.03
3	应收股利	48,359.51
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	89,522.09
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	8,969,740.95

### 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	21,482,156.00	1.72	转融通流通受限
2	688111	金山办公	17,330,474.00	1.39	转融通流通受限
3	300308	中际旭创	15,703,425.00	1.26	转融通流通受限
4	603019	中科曙光	11,096,200.00	0.89	转融通流通受限
5	000977	浪潮信息	9,986,150.00	0.80	转融通流通受限
6	300502	新易盛	8,883,679.00	0.71	转融通流通受限
7	000938	紫光股份	3,736,005.00	0.30	转融通流通受限
8	002410	广联达	1,650,492.00	0.13	转融通流通受限
9	600570	恒生电子	646,634.00	0.05	转融通流通受限
10	600588	用友网络	410,000.00	0.03	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		招商银行股份有限公司 —易方达中证云计算与 大数据主题交易型开放 式指数证券投资基金发 起式联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
11,286	91,608.19	786,151,269 .00	76.04%	247,738,73 1.00	23.96%	79,890,606. 00	7.73%

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“招商银行股份有限公司—易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	138,504,600.00	13.40%
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	103,764,400.00	10.04%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	43,772,200.00	4.23%
4	安联人寿保险有限公司—财富成长	21,039,300.00	2.03%
5	新华人寿保险股份有限公司	20,000,000.00	1.93%
6	申万宏源证券有限公司	18,366,414.00	1.78%
7	招商银行股份有限公司—泰康福泰平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）	18,000,000.00	1.74%
8	招商银行股份有限公司—民生加银稳健配置 9 个月持有期混合型基金中基金（FOF）	17,483,800.00	1.69%
9	工银瑞信基金—恒丰银行—工银瑞信目标进取 FOF 策略 1 号集合资产管理计划	16,553,800.00	1.60%
10	工银安盛人寿保险有限公司	16,415,700.00	1.59%
11	招商银行股份有限公司—易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	79,890,606.00	7.73%

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（2021年3月29日）基金份额总额	384,890,000.00
本报告期期初基金份额总额	287,890,000.00
本报告期基金总申购份额	1,869,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,123,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,033,890,000.00

### § 10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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	

财通证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
高盛高华	2	-	-	-	-	-
广发证券	5	2,332,438,324.52	83.23%	240,808.34	50.62%	-
国盛证券	1	167,231,447.85	5.97%	83,615.89	17.58%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通	1	-	-	-	-	-
平安证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
新时代证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
野村东方	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	1	302,600,058.89	10.80%	151,308.62	31.81%	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，新增交易单元的证券公司为财通证券股份有限公司、开源证券股份有限公司。

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

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；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
财通证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
高盛高华	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-
太平洋证券	-	-	-	-	-	-
新时代证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
野村东方	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-

## 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	证券时报	2023-01-20
2	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-29

3	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	证券时报	2023-03-30
4	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
5	易方达基金管理有限公司关于聘任基金经理助理的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-15
6	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	证券时报	2023-04-21
7	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
9	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
10	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	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06
11	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	证券时报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	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云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金注册的文件;
2. 《易方达中证云计算与大数据主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》;
3. 《易方达中证云计算与大数据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