

广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券 投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

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.....	5
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遵规守信情况的说明.....	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	16
6.4 报表附注.....	18
7 投资组合报告	71
7.1 期末基金资产组合情况.....	71
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	71
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.....	72
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
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.....	75
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	76
7.12 投资组合报告附注.....	76

8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	77
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	78
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	78
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.....	78
9 开放式基金份额变动	79
10 重大事件揭示	79
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.8 其他重大事件.....	82
11 影响投资者决策的其他重要信息	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况.....	83
12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录.....	84
12.2 存放地点.....	84
12.3 查阅方式.....	84

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	广发科创 50ETF
场内简称	上证科创
基金主代码	588060
交易代码	588060
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 7 月 15 日
基金管理人	广发基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,985,140,000.00 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	2021-07-29

注：本基金的扩位证券简称为“科创 50ETF 龙头”。

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。在正常情况下，本基金力争控制投资组合的净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值小于 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即按照标的指数的成份股的构成及其权重构建指数化投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应的调整。具体包括：1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、股指期货投资策略；4、资产支持证券投资策略；5、参与转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	上证科创板 50 成份指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		广发基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露	姓名	程才良	许俊
	联系电话	020-83936666	010-66596688

负责人	电子邮箱	ccl@gffunds.com.cn	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		95105828	95566
传真		020-89899158	010-66594942
注册地址		广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2608室	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		广东省广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼；广东省珠海市横琴新区环岛东路3018号2603-2622室	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		510308	100818
法定代表人		孙树明	葛海蛟

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.gffunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市海珠区琶洲大道东1号保利国际广场南塔31-33楼

2.5 其他相关资料

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

3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023年1月1日至2023年6月30日）
本期已实现收益	-3,867,159.68
本期利润	37,198,315.03
加权平均基金份额本期利润	0.0271
本期加权平均净值利润率	4.11%
本期基金份额净值增长率	4.68%
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	-711,063,788.59

期末可供分配基金份额利润	-0.3582
期末基金资产净值	1,274,076,211.41
期末基金份额净值	0.6418
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	-35.82%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	-4.55%	1.30%	-4.63%	1.31%	0.08%	-0.01%
过去三个月	-6.80%	1.56%	-7.06%	1.57%	0.26%	-0.01%
过去六个月	4.68%	1.36%	4.71%	1.37%	-0.03%	-0.01%
过去一年	-9.81%	1.39%	-9.09%	1.40%	-0.72%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-35.82%	1.54%	-35.43%	1.56%	-0.39%	-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

广发上证科创板 50 成份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 7 月 15 日至 2023 年 6 月 30 日）



4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陆志明	本基金的基金经理；广发深证 100 指数证券投资基金 (LOF) 的基金经理；广发中	2021-07-15	-	24 年	陆志明先生，经济学硕士，持有中国证券投资基金业从业证书。曾任大鹏证券有限公司研究员，深圳证券信息有限公司部门总监，广发基金管理有限公司数量投资部总经理、指数投资部副总经理、量化投

	<p>证 1000 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证全指建筑材料指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发中证全指汽车指数型发起式证券投资基金的基金经理；广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证央企创新驱动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理；广发中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指家用电器交易型开放式指数证券</p>				<p>资部副总经理、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2011 年 6 月 3 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中小企业 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理(自 2011 年 6 月 9 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发深证 100 指数分级证券投资基金基金经理(自 2012 年 5 月 7 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证百度百发策略 100 指数型证券投资基金基金经理(自 2014 年 10 月 30 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证医疗指数分级证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 23 日至 2016 年 7 月 28 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2018 年 10 月 9 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 8 月 18 日至 2018 年 12 月 20 日)、广发中证全指主要消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 7 月 1 日至 2019 年 4 月 2 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2020 年 8 月 21 日)、广发中证全指工业交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2017 年 6 月 13 日至 2021 年 2 月 10 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 6 月 3 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2014 年 12 月 1 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证</p>
--	--	--	--	--	--

	投资基金的基金经理；广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金的基金经理；广发中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理；广发中证上海环交所碳中和交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金的基金经理			券投资基金基金经理(自 2015 年 1 月 8 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指信息技术交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 3 月 23 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指可选消费交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 4 月 15 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指医药卫生交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 5 月 6 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指原材料交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指能源交易型开放式指数证券投资基金基金经理(自 2015 年 6 月 25 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指金融地产交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理(自 2015 年 7 月 9 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中证全指家用电器指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 5 月 10 日)、广发中证 1000 指数型发起式证券投资基金基金经理(自 2021 年 6 月 17 日至 2022 年 11 月 22 日)。
--	---	--	--	--

注：1.“任职日期”和“离职日期”指公司公告聘任或解聘日期。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，在疫情影响逐步减弱和宏观经济逐步恢复等因素的影响下，市场指数整体有所反弹，并呈现出先扬后抑的特点。年初至 4 月中旬，在疫情好转以及宏观经济好转预期的刺激下，市场出现反弹，但后期受到宏观数据未及预期以及复杂的国际形势影响，整个市场出现回调。上半年，中证全指全收益指数上涨 3.23%。从规模指数表现来看，大市值指数弱于小市值指数，代表小市值股票的国证 2000 全收益指数上涨 7.86%，而同期沪深 300 全收益指数仅微涨 0.46%；从风格指数表现来看，价值风格表现好于成长风格，国证价值全收益指数上涨 6.85%，而同期国证成长全收益指数则下跌 5.15%。

本基金跟踪的标的是上证科创板 50 成份指数，该指数是由上海证券交易所科创板中市值大、流动性好的 50 只证券组成，反映最具市场代表性的一批科创企业的整体表现。本基金按照根据指数结构复制指数的方法投资，指数样本采用完全复制法进行投资运作，尽量降低跟踪误差。

上半年，上证科创板 50 成份指数涨幅高于整体市场平均水平。在全球与 AI 投资相关刺激因素的影响下，占指数成份股中七成左右的信息技术行业的科技成长型股票表现好于整体市场，导致在抵消了其它行业相关股票下跌的情况下，指数仍然跑赢整体市场。上半年，指数样本股票日均换手率高于市场平均水平，表明上半年上证科创板 50 成份指数的投资者关注度有所上升。

在基金投资运作方面，本基金严格遵守合同要求，认真对待投资者日常申购、赎回及成份股调整等工作，本基金在报告期内交易和申购赎回正常，运作过程中未发生风险事件。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，本基金的份额净值增长率为 4.68%，同期业绩比较基准收益率为 4.71%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来半年，随着国际通胀逐步得到控制，市场流动性有望继续保持充裕，随着各项经济政策的落实，企业利润或将逐步得到修复。科技创新型企业龙头上市公司将受益于国家产业鼓励政策和流动性宽松环境，获得进一步成长。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：广发上证科创板 50 成份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	4,596,848.54	3,063,921.53
结算备付金		102,629.14	-
存出保证金		9,164.31	17,837.61
交易性金融资产	6.4.7.2	1,269,783,661.18	748,688,874.21
其中：股票投资		1,269,783,661.18	748,688,874.21
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
应收清算款		285,573.57	-
应收股利		136,550.26	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	143,740.02	52,192.24
资产总计		1,275,058,167.02	751,822,825.59
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		-	19,756.93
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		500,920.62	288,240.55
应付托管费		100,184.15	57,648.11
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,703.95	6,863.20
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.7	368,146.89	311,970.64
负债合计		981,955.61	684,479.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.8	1,985,140,000.00	1,225,140,000.00
未分配利润	6.4.7.9	-711,063,788.59	-474,001,653.84
净资产合计		1,274,076,211.41	751,138,346.16
负债和净资产总计		1,275,058,167.02	751,822,825.59

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值人民币 0.6418 元，基金份额总额 1,985,140,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：广发上证科创板 50 成份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		40,045,260.87	-51,823,633.67
1.利息收入		1,673,037.08	17,529.25
其中：存款利息收入	6.4.7.10	8,523.86	6,770.61
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		1,664,513.22	10,758.64
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,892,866.47	-27,922,813.13
其中：股票投资收益	6.4.7.11	-7,717,660.16	-28,662,834.82
基金投资收益	6.4.7.12	-	-
债券投资收益	6.4.7.13	481,422.72	60,118.77
资产支持证券投资收益	6.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.15	-	-
衍生工具收益	6.4.7.16	-	-
股利收益	6.4.7.17	4,343,370.97	679,902.92

以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	41,065,474.71	-23,658,246.79
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.19	199,615.55	-260,103.00
减：二、营业总支出		2,846,945.84	899,329.96
1. 管理人报酬		2,230,821.07	622,188.80
2. 托管费		446,164.21	124,437.79
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		5,996.24	39.02
8. 其他费用	6.4.7.21	163,964.32	152,664.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		37,198,315.03	-52,722,963.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		37,198,315.03	-52,722,963.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		37,198,315.03	-52,722,963.63

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,225,140,000.00	-474,001,653.84	751,138,346.16
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,225,140,000.00	-474,001,653.84	751,138,346.16
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	760,000,000.00	-237,062,134.75	522,937,865.25
（一）、综合收益	-	37,198,315.03	37,198,315.03

总额			
(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)	760,000,000.00	-274,260,449.78	485,739,550.22
其中: 1. 基金申购款	1,524,000,000.00	-523,619,201.46	1,000,380,798.54
2. 基金赎回款	-764,000,000.00	249,358,751.68	-514,641,248.32
(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)	1,985,140,000.00	-711,063,788.59	1,274,076,211.41
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)	273,140,000.00	-26,566,630.23	246,573,369.77
加: 会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	273,140,000.00	-26,566,630.23	246,573,369.77
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	164,000,000.00	-99,525,859.27	64,474,140.73
(一)、综合收益总额	-	-52,722,963.63	-52,722,963.63
(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)	164,000,000.00	-46,802,895.64	117,197,104.36
其中: 1. 基金申购款	248,000,000.00	-68,957,941.22	179,042,058.78
2. 基金赎回款	-84,000,000.00	22,155,045.58	-61,844,954.42
(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）	437,140,000.00	-126,092,489.50	311,047,510.50

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：孙树明，主管会计工作负责人：窦刚，会计机构负责人：张晓章

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金（“本基金”）经中国证券监督管理委员会（“中国证监会”）证监许可[2021]1450 号《关于准予广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》（“基金合同”）公开募集，于 2021 年 7 月 5 日向社会公开发行募集并于 2021 年 7 月 15 日正式成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

本基金募集期间为 2021 年 7 月 5 日至 2021 年 7 月 9 日，为交易型开放式基金，存续期限不定，募集资金总额为人民币 425,140,000.00 元，有效认购户数为 6,313 户。认购资金在募集期间的利息为人民币 96,901.83 元，按照基金合同的有关约定计入基金财产。本基金募集资金经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验资。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无需说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

(1) 印花税

境内证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

值税纳税人；

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

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

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

（3）企业所得税

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

（4）个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

（5）境外投资

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	4,596,848.54
等于：本金	4,596,382.32
加：应计利息	466.22
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	4,596,848.54

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	1,304,156,278.13	-	1,269,783,661.18	-34,372,616.95
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	1,304,156,278.13	-	1,269,783,661.18	-34,372,616.95

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 债权投资

本基金本报告期末无债权投资。

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	68,123.78
待摊费用	75,616.24
合计	143,740.02

6.4.7.7 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	232,496.70
其中：交易所市场	232,496.70
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	85,790.38
应付替代款	2,163.30
可退替代款	47,696.51

合计	368,146.89
----	------------

6.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,225,140,000.00	1,225,140,000.00
本期申购	1,524,000,000.00	1,524,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-764,000,000.00	-764,000,000.00
本期末	1,985,140,000.00	1,985,140,000.00

6.4.7.9 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-140,983,746.11	-333,017,907.73	-474,001,653.84
本期利润	-3,867,159.68	41,065,474.71	37,198,315.03
本期基金份额交易产生的变动数	-84,728,504.36	-189,531,945.42	-274,260,449.78
其中：基金申购款	-177,704,495.34	-345,914,706.12	-523,619,201.46
基金赎回款	92,975,990.98	156,382,760.70	249,358,751.68
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-229,579,410.15	-481,484,378.44	-711,063,788.59

6.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
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	1,761.79
其他	78.20
合计	8,523.86

6.4.7.11 股票投资收益

6.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	股票投资收益——买卖股票差价收入
股票投资收益——赎回差价收入	13,732,761.14
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	-7,717,660.16
----	---------------

6.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	172,444,651.37
减：卖出股票成本总额	193,349,617.00
减：交易费用	545,455.67
买卖股票差价收入	-21,450,421.30

6.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	514,641,248.32
减：现金支付赎回款总额	13,146,883.32
减：赎回股票成本总额	487,761,603.86
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,732,761.14

6.4.7.12 基金投资收益

本基金本报告期内无基金投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	856.94
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	480,565.78
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	481,422.72

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,414,585.04

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,933,000.00
减：应计利息总额	882.62
减：交易费用	136.64
买卖债券差价收入	480,565.78

6.4.7.14 资产支持证券投资收益

6.4.7.14.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	4,343,370.97
其中：证券出借权益补偿收入	915,534.80
基金投资产生的股利收益	-
合计	4,343,370.97

6.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	41,065,474.71
——股票投资	41,065,474.71
——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	41,065,474.71

6.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	199,615.55
合计	199,615.55

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

6.4.7.20 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	26,283.01
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,125.63
其他	76,048.31
合计	163,964.32

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本基金本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人
中国银行股份有限公司	基金托管人
广发证券股份有限公司	基金管理人控股股东、申购赎回代办证券公司
广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基	本基金的联接基金

金发起式联接基金	
----------	--

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的 比例	成交金额	占当期股票成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	369,295,318.48	100.00%	141,370,230.19	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间内无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期债券成交总额的 比例
广发证券股份有限公司	6,347,585.04	100.00%	560,121.60	100.00%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的 比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的 比例
广发证券股份有限公司	343,967.53	100.00%	232,496.70	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣

	佣金	总量的比例		金总额的比例
广发证券股份有限公司	131,768.82	100.00%	94,755.05	100.00%

注：1、上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示；

2、本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,230,821.07	622,188.80
其中：支付销售机构的客户维护费	33,470.87	2,862.12

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

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

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支付给基金管理人，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

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	446,164.21	124,437.79

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

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

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，经基金管理人与基金托管人核对一致后，由基金托管人于次月首日起 5 个工作日内按照指定的账户路径从基金财产中一次性支取，管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

单位：人民币元

本期 2023年1月1日至2023年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:股)	出借期限 (单位:天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券股份有限公司	2023010300000923	康希诺	2023-01-03	220,155.00	1,500.00	14	3.20	273.97	-	-
广发证券股份有限公司	2023010300000935	金山办公	2023-01-03	312,334.00	1,100.00	14	3.20	388.68	-	-
广发证券股份有限公司	2023010300033941	大全能源	2023-01-03	289,200.00	6,000.00	14	3.20	359.89	-	-
广发证券股份有限公司	2023010400001067	寒武纪	2023-01-04	415,662.00	7,300.00	14	3.20	517.27	-	-
广发证券股份有限公司	2023010500016803	大全能源	2023-01-05	482,500.00	10,000.00	14	3.50	656.74	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0105 0001 6805	大全能 源	2023- 01-05	246,0 75.00	5,100.00	14	3.2 0	306.2 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0106 0001 0312	君实生 物	2023- 01-06	638,1 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,538 .53	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0109 0003 4788	大全能 源	2023- 01-09	48,60 0.00	1,000.00	14	3.2 0	90.72	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0110 0001 7969	澜起科 技	2023- 01-10	634,6 00.00	10,000.00	14	3.2 0	1,128 .18	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0111 0002 4883	晶科能 源	2023- 01-11	15,96 0.00	1,000.00	14	3.2 0	26.95	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0112 0001 2641	中微公 司	2023- 01-12	6,054 ,250. 00	61,000.00	14	3.2 0	9,686 .80	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0113 0000 9384	容百科 技	2023- 01-13	586,4 00.00	8,000.00	14	3.1 0	858.4 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0117 0002 8001	金山办 公	2023- 01-17	304,5 90.00	1,100.00	14	3.2 0	379.0 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0117 0002 8035	大全能 源	2023- 01-17	295,6 20.00	6,000.00	14	3.2 0	367.8 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0118 0001 3755	芯原股 份	2023- 01-18	373,8 75.00	7,500.00	14	3.1 0	450.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0118 0001 3771	晶晨股 份	2023- 01-18	585,3 75.00	7,500.00	14	3.1 0	705.7 0	-	-
广发证	2023	天合光	2023-	1,211	17,000.00	14	3.2	1,507	-	-

券股份 有限公司	0119 0000 1074	能	01-19	,250. 00			0	.33		
广发证 券股份 有限公司	2023 0119 0000 1083	中微公 司	2023- 01-19	1,296 ,267. 00	11,900.00	14	3.2 0	1,613 .13	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0119 0000 1087	沪硅产 业	2023- 01-19	2,801 ,508. 00	148,700.0 0	14	3.2 0	3,486 .32	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0119 0001 5072	大全能 源	2023- 01-19	498,5 00.00	10,000.00	14	3.5 0	678.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0119 0001 5074	大全能 源	2023- 01-19	254,2 35.00	5,100.00	14	3.2 0	316.3 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0120 0000 0464	中微公 司	2023- 01-20	325,0 50.00	3,000.00	14	3.2 0	404.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0120 0000 0466	九号公 司	2023- 01-20	1,392 ,148. 00	43,600.00	14	3.2 0	1,732 .45	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0120 0000 0468	晶晨股 份	2023- 01-20	2,577 ,520. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,207 .58	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0130 0000 1624	金山办 公	2023- 01-30	1,419 ,776. 00	4,700.00	14	3.2 0	1,766 .83	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0130 0000 1664	奇安信	2023- 01-30	502,2 00.00	6,200.00	14	3.2 0	624.9 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0130 0008 4319	澜起科 技	2023- 01-30	598,4 00.00	10,000.00	14	3.2 0	744.6 8	-	-
广发证 券股份	2023 0130	容百科 技	2023- 01-30	620,4 00.00	8,000.00	14	3.1 0	747.9 3	-	-

有限公司	0008 4485									
广发证 券股份 有限公司	2023 0130 0009 3513	大全能 源	2023- 01-30	49,23 0.00	1,000.00	14	3.2 0	61.26	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0130 0010 0671	晶科能 源	2023- 01-30	15,30 0.00	1,000.00	14	3.2 0	19.04	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3044	奇安信	2023- 01-31	234,2 40.00	3,000.00	14	3.2 0	291.5 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3048	中微公 司	2023- 01-31	2,538 ,338. 00	24,200.00	14	3.2 0	3,158 .82	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3050	传音控 股	2023- 01-31	265,1 43.00	3,100.00	14	3.2 0	329.9 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3052	芯原股 份	2023- 01-31	159,4 71.00	2,900.00	14	3.2 0	198.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3056	寒武纪	2023- 01-31	217,3 50.00	3,500.00	14	3.2 0	270.4 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0000 3058	沪硅产 业	2023- 01-31	847,7 28.00	40,600.00	14	3.2 0	1,054 .95	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0131 0002 2591	大全能 源	2023- 01-31	293,8 20.00	6,000.00	14	3.2 0	365.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0202 0000 0911	晶晨股 份	2023- 02-02	742,1 40.00	9,300.00	14	3.2 0	923.5 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0000	中微公 司	2023- 02-02	882,3 33.00	8,100.00	14	3.2 0	1,098 .01	-	-

司	0913									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0000 0915	九号公 司	2023- 02-02	44,52 5.00	1,300.00	14	3.2 0	55.41	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0001 3039	中微公 司	2023- 02-02	1,296 ,267. 00	11,900.00	14	3.2 0	1,613 .13	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0001 3131	大全能 源	2023- 02-02	257,9 58.00	5,100.00	14	3.2 0	321.0 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0001 3217	天合光 能	2023- 02-02	1,150 ,390. 00	17,000.00	14	3.2 0	1,431 .60	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0001 3237	沪硅产 业	2023- 02-02	3,104 ,856. 00	148,700.0 0	14	3.2 0	3,863 .82	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0202 0001 3317	大全能 源	2023- 02-02	505,8 00.00	10,000.00	14	3.5 0	688.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 1011	固德威	2023- 02-03	785,9 80.00	2,000.00	14	3.2 0	978.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 1020	晶晨股 份	2023- 02-03	145,6 74.00	1,800.00	14	3.2 0	181.2 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 1022	寒武纪	2023- 02-03	291,5 51.00	4,100.00	14	3.2 0	362.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 8866	君实生 物	2023- 02-03	573,0 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,381 .57	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 9896	中微公 司	2023- 02-03	324,6 00.00	3,000.00	14	3.2 0	403.9 5	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 9898	九号公 司	2023- 02-03	1,477 ,168. 00	43,600.00	14	3.2 0	1,838 .25	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0203 0000 9906	晶晨股 份	2023- 02-03	2,581 ,667. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,212 .74	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0213 0006 8010	金山办 公	2023- 02-13	1,362 ,624. 00	4,700.00	14	3.2 0	1,695 .71	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0213 0007 7646	大全能 源	2023- 02-13	47,82 0.00	1,000.00	14	3.2 0	59.51	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0213 0007 7672	容百科 技	2023- 02-13	621,7 60.00	8,000.00	14	3.1 0	749.5 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0213 0008 4620	澜起科 技	2023- 02-13	628,5 00.00	10,000.00	14	3.2 0	782.1 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0214 0002 1539	奇安信	2023- 02-14	229,3 80.00	3,000.00	14	3.2 0	285.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0214 0002 1541	传音控 股	2023- 02-14	273,2 96.00	3,100.00	14	3.2 0	340.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0214 0002 1543	芯原股 份	2023- 02-14	179,8 29.00	2,900.00	14	3.2 0	223.7 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0214 0002 1545	寒武纪	2023- 02-14	299,1 80.00	3,500.00	14	3.2 0	372.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0214 0002 1601	大全能 源	2023- 02-14	286,2 00.00	6,000.00	14	3.2 0	356.1 6	-	-
广发证	2023	晶晨股	2023-	771,9	9,300.00	14	3.2	960.5	-	-

券股份 有限公司	0216 0001 4903	份	02-16	00.00			0	9		
广发证 券股份 有限公司	2023 0216 0001 4965	天合光 能	2023- 02-16	1,085 ,280. 00	17,000.00	14	3.2 0	1,350 .57	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0000 1474	容百科 技	2023- 02-17	495,2 44.00	6,800.00	14	3.2 0	616.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0000 1479	海光信 息	2023- 02-17	682,8 63.00	14,100.00	14	3.2 0	849.7 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0000 1483	芯原股 份	2023- 02-17	124,6 98.00	2,100.00	14	3.2 0	155.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0000 1495	思瑞浦	2023- 02-17	260,1 50.00	1,000.00	14	3.2 0	323.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0001 9496	晶晨股 份	2023- 02-17	2,642 ,277. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,288 .17	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0001 9576	固德威	2023- 02-17	716,7 60.00	2,000.00	14	3.2 0	891.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0217 0001 9578	寒武纪	2023- 02-17	328,0 00.00	4,100.00	14	3.2 0	408.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0220 0000 1510	思瑞浦	2023- 02-20	265,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	329.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0220 0000 1514	海尔生 物	2023- 02-20	99,32 0.00	1,300.00	14	3.2 0	123.6 0	-	-
广发证 券股份	2023 0221	海光信 息	2023- 02-21	684,8 63.00	13,700.00	14	3.2 0	852.2 7	-	-

有限公司	0000 0776									
广发证 券股份 有限公司	2023 0222 0000 0798	晶晨股 份	2023- 02-22	203,4 24.00	2,400.00	14	3.2 0	253.1 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0222 0000 0802	芯原股 份	2023- 02-22	1,005 ,648. 00	16,400.00	14	3.2 0	1,251 .47	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0222 0000 0804	海尔生 物	2023- 02-22	77,00 0.00	1,000.00	14	3.2 0	95.82	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0224 0000 0763	康希诺	2023- 02-24	429,7 28.00	3,200.00	14	3.2 0	534.7 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0227 0005 7964	容百科 技	2023- 02-27	576,8 00.00	8,000.00	14	3.1 0	695.3 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0227 0006 0180	澜起科 技	2023- 02-27	580,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	721.7 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0228 0000 1103	君实生 物	2023- 02-28	248,1 60.00	4,700.00	14	3.5 0	337.7 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0228 0002 6146	寒武纪	2023- 02-28	293,8 95.00	3,500.00	14	3.2 0	365.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0302 0001 1533	晶晨股 份	2023- 03-02	716,5 65.00	9,300.00	14	3.2 0	891.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0302 0001 5461	天合光 能	2023- 03-02	1,004 ,360. 00	17,000.00	14	3.2 0	1,249 .87	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0303 0000	容百科 技	2023- 03-03	472,9 40.00	6,800.00	14	3.2 0	588.5 5	-	-

司	9479									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0303 0000 9487	思瑞浦	2023- 03-03	257,7 00.00	1,000.00	14	3.2 0	320.6 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0303 0000 9551	君实生 物	2023- 03-03	524,9 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,265 .59	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0303 0000 9621	晶晨股 份	2023- 03-03	2,443 ,540. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,040 .85	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0303 0000 9631	固德威	2023- 03-03	722,4 60.00	2,000.00	14	3.2 0	899.0 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0306 0001 6399	思瑞浦	2023- 03-06	259,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	322.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0308 0000 5418	晶晨股 份	2023- 03-08	177,8 40.00	2,400.00	14	3.2 0	221.3 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0005 1290	澜起科 技	2023- 03-13	555,2 00.00	10,000.00	14	3.2 0	690.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0313 0006 5688	容百科 技	2023- 03-13	546,8 80.00	8,000.00	14	3.1 0	659.2 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0314 0002 2870	君实生 物	2023- 03-14	237,5 85.00	4,700.00	14	3.5 0	323.3 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0314 0002 2874	寒武纪	2023- 03-14	360,1 15.00	3,500.00	14	3.2 0	448.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0316 0001 4970	天合光 能	2023- 03-16	917,8 30.00	17,000.00	14	3.2 0	1,142 .19	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0317 0001 1181	晶晨股 份	2023- 03-17	2,390 ,586. 00	31,900.00	14	3.2 0	2,974 .95	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0317 0001 1197	固德威	2023- 03-17	616,0 00.00	2,000.00	14	3.2 0	766.5 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0322 0000 7643	晶晨股 份	2023- 03-22	200,6 40.00	2,400.00	14	3.2 0	267.5 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0323 0000 1276	海光信 息	2023- 03-23	1,006 ,240. 00	15,200.00	14	3.2 0	1,252 .21	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0324 0000 0633	芯原股 份	2023- 03-24	2,852 ,030. 00	30,700.00	14	3.2 0	3,549 .19	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0327 0000 1292	金山办 公	2023- 03-27	391,3 70.00	1,000.00	14	3.2 0	487.0 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0327 0000 1294	传音控 股	2023- 03-27	1,249 ,502. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,554 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0327 0005 8033	澜起科 技	2023- 03-27	685,9 00.00	10,000.00	14	3.2 0	853.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0327 0005 8289	容百科 技	2023- 03-27	570,1 60.00	8,000.00	14	3.1 0	687.3 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0328 0000 1830	金山办 公	2023- 03-28	561,4 14.00	1,400.00	14	3.2 0	698.6 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0328 0000 1832	传音控 股	2023- 03-28	563,5 02.00	5,700.00	14	3.2 0	701.2 5	-	-
广发证	2023	芯原股	2023-	262,3	2,800.00	14	3.2	326.4	-	-

券股份 有限公司	0328 0000 1834	份	03-28	04.00			0	2		
广发证 券股份 有限公司	2023 0328 0001 9673	寒武纪	2023- 03-28	602,0 00.00	3,500.00	14	3.2 0	749.1 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0328 0002 2873	君实生 物	2023- 03-28	230,7 70.00	4,700.00	14	3.5 0	314.1 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0330 0000 1700	奇安信	2023- 03-30	258,1 34.00	3,800.00	14	3.2 0	321.2 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0330 0000 1708	传音控 股	2023- 03-30	3,355 ,020. 00	34,200.00	14	3.2 0	4,175 .14	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0330 0001 4815	天合光 能	2023- 03-30	871,7 60.00	17,000.00	14	3.2 0	1,084 .86	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0331 0001 2047	君实生 物	2023- 03-31	480,4 00.00	10,000.00	28	3.1 0	1,158 .30	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0331 0001 2055	晶晨股 份	2023- 03-31	2,683 ,428. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,339 .38	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0331 0001 2057	固德威	2023- 03-31	578,9 00.00	2,000.00	14	3.2 0	720.4 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0403 0000 1229	九号公 司	2023- 04-03	1,385 ,685. 00	37,100.00	14	3.2 0	1,724 .41	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0406 0001 3500	晶晨股 份	2023- 04-06	224,4 48.00	2,400.00	14	3.2 0	279.3 1	-	-
广发证 券股份	2023 0406	海光信 息	2023- 04-06	1,234 ,696.	15,200.00	14	3.2 0	1,536 .51	-	-

有限公司	0001 3978			00						
广发证 券股份 有限公司	2023 0407 0000 0820	奇安信	2023- 04-07	733,7 80.00	9,500.00	14	3.2 0	913.1 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0407 0000 0833	思瑞浦	2023- 04-07	1,015 ,920. 00	3,600.00	14	3.2 0	1,264 .26	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0407 0000 8261	芯原股 份	2023- 04-07	3,351 ,212. 00	30,700.00	14	3.2 0	4,170 .40	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0410 0000 4198	思瑞浦	2023- 04-10	1,199 ,264. 00	4,400.00	14	3.2 0	1,492 .42	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0410 0005 0551	金山办 公	2023- 04-10	423,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	526.4 0	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0410 0005 0553	传音控 股	2023- 04-10	1,321 ,600. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,644 .66	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0410 0006 0039	容百科 技	2023- 04-10	576,6 40.00	8,000.00	14	3.1 0	695.1 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0410 0006 0051	澜起科 技	2023- 04-10	717,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	892.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0411 0000 3531	中芯国 际	2023- 04-11	864,7 64.00	14,800.00	14	3.2 0	1,076 .15	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0411 0001 7602	金山办 公	2023- 04-11	603,8 20.00	1,400.00	14	3.2 0	751.4 2	-	-
广发证 券股份 有限公	2023 0411 0001	芯原股 份	2023- 04-11	268,8 56.00	2,800.00	14	3.2 0	334.5 8	-	-

司	7604									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0001 7626	君实生 物	2023- 04-11	241,2 98.00	4,700.00	14	3.5 0	328.4 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0411 0001 7878	传音控 股	2023- 04-11	649,4 58.00	5,700.00	14	3.2 0	808.2 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0413 0001 8061	传音控 股	2023- 04-13	3,724 ,380. 00	34,200.00	14	3.2 0	4,634 .78	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0414 0000 8129	晶晨股 份	2023- 04-14	2,926 ,506. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,641 .87	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0414 0000 8131	固德威	2023- 04-14	558,1 80.00	2,000.00	14	3.2 0	694.6 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0418 0000 5246	天奈科 技	2023- 04-18	95,90 0.00	1,400.00	14	3.2 0	136.3 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0420 0001 3835	晶晨股 份	2023- 04-20	226,3 20.00	2,400.00	14	3.2 0	281.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0420 0001 3847	海光信 息	2023- 04-20	1,478 ,960. 00	15,200.00	14	3.2 0	1,840 .48	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0421 0000 2102	天奈科 技	2023- 04-21	71,00 6.00	1,300.00	14	3.2 0	88.36	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0421 0000 7033	奇安信	2023- 04-21	646,0 95.00	9,500.00	14	3.2 0	804.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0421 0000 7035	思瑞浦	2023- 04-21	868,9 68.00	3,600.00	14	3.2 0	1,081 .38	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0421 0000 7093	芯原股 份	2023- 04-21	2,784 ,183. 00	30,700.00	14	3.2 0	3,464 .76	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0000 4663	沪硅产 业	2023- 04-24	159,1 92.00	6,700.00	14	3.2 0	198.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0000 4672	中国通 号	2023- 04-24	120,9 89.00	18,700.00	14	3.2 0	150.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0001 0565	容百科 技	2023- 04-24	519,2 00.00	8,000.00	14	3.1 0	625.9 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0004 1627	澜起科 技	2023- 04-24	692,0 00.00	10,000.00	14	3.2 0	861.1 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0424 0005 8001	传音控 股	2023- 04-24	1,237 ,584. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,540 .10	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 4619	芯原股 份	2023- 04-25	243,4 60.00	2,800.00	14	3.2 0	302.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 6521	传音控 股	2023- 04-25	580,7 73.00	5,700.00	14	3.2 0	722.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 7477	君实生 物	2023- 04-25	235,1 88.00	4,700.00	14	3.5 0	320.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0425 0005 8973	中芯国 际	2023- 04-25	908,2 76.00	14,800.00	14	3.2 0	1,130 .30	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0426 0000 2954	大全能 源	2023- 04-26	49,69 8.00	1,100.00	14	3.2 0	61.85	-	-
广发证	2023	天奈科	2023-	53,09	1,000.00	14	3.2	66.07	-	-

券股份 有限公司	0426 0000 2970	技	04-26	0.00			0			
广发证 券股份 有限公司	2023 0426 0000 2992	澜起科 技	2023- 04-26	3,210 ,000. 00	50,000.00	14	3.0 0	3,745 .00	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0427 0000 5798	天奈科 技	2023- 04-27	70,16 1.00	1,300.00	14	3.2 0	87.31	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0427 0001 5166	传音控 股	2023- 04-27	3,447 ,360. 00	34,200.00	14	3.2 0	4,290 .05	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0428 0000 3946	长远锂 科	2023- 04-28	31,13 6.00	2,800.00	14	3.2 0	38.75	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0428 0000 4105	天奈科 技	2023- 04-28	64,65 6.00	1,200.00	14	3.2 0	80.46	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0428 0001 0396	君实生 物	2023- 04-28	527,8 00.00	10,000.00	14	37. 40	7,676 .56	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0428 0001 3816	晶晨股 份	2023- 04-28	2,669 ,073. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,321 .51	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0000 5055	大全能 源	2023- 05-04	270,9 48.00	6,700.00	14	3.2 0	337.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0004 3845	晶晨股 份	2023- 05-04	188,6 40.00	2,400.00	14	3.2 0	234.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0504 0004 3849	天奈科 技	2023- 05-04	74,27 0.00	1,400.00	14	3.2 0	92.42	-	-
广发证 券股份	2023 0504	海光信 息	2023- 05-04	1,400 ,680.	15,200.00	14	3.2 0	1,743 .07	-	-

有限公司	00051875			00							
广发证券股份有限公司	2023050500011015	芯原股份	2023-05-05	2,524,461.00	30,700.00	14	3.20	3,141.55	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050800008717	沪硅产业	2023-05-08	152,291.00	6,700.00	14	3.20	189.52	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050800012031	容百科技	2023-05-08	533,120.00	8,000.00	14	3.10	642.71	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050800012033	中国通号	2023-05-08	116,314.00	18,700.00	14	3.20	144.75	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050800013877	传音控股	2023-05-08	1,362,900.00	11,800.00	14	3.20	1,696.05	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050800053079	澜起科技	2023-05-08	594,100.00	10,000.00	14	3.20	739.32	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050900003652	澜起科技	2023-05-09	2,893,500.00	50,000.00	14	3.10	3,488.28	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050900003720	大全能源	2023-05-09	50,271.00	1,300.00	14	3.10	60.60	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050900012537	中芯国际	2023-05-09	781,144.00	14,800.00	14	3.20	972.09	-	-	
广发证券股份有限公司	2023050900026289	君实生物	2023-05-09	238,290.00	4,700.00	14	3.50	324.34	-	-	
广发证券股份有限公司	202305090002	芯原股份	2023-05-09	224,000.00	2,800.00	14	3.20	278.76	-	-	

司	6505									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0509 0002 6525	传音控 股	2023- 05-09	679,4 40.00	5,700.00	14	3.2 0	845.5 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0510 0000 3142	三一重 能	2023- 05-10	352,3 89.00	10,100.00	14	3.1 0	424.8 2	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0510 0000 3157	晶晨股 份	2023- 05-10	269,7 30.00	3,700.00	14	3.1 0	325.1 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0510 0002 1980	澜起科 技	2023- 05-10	2,824 ,500. 00	50,000.00	14	3.0 0	3,295 .25	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0510 0002 7406	天奈科 技	2023- 05-10	52,36 0.00	1,000.00	14	3.2 0	65.16	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0511 0001 2621	传音控 股	2023- 05-11	3,998 ,322. 00	34,200.00	14	3.2 0	4,975 .69	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0000 1787	格科微	2023- 05-12	21,88 2.00	1,400.00	14	3.1 0	26.38	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0001 1164	长远锂 科	2023- 05-12	31,72 4.00	2,800.00	14	3.2 0	39.48	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0001 1198	晶晨股 份	2023- 05-12	2,540 ,516. 00	31,900.00	14	3.2 0	3,161 .53	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0512 0001 1246	天奈科 技	2023- 05-12	63,68 4.00	1,200.00	14	3.2 0	79.25	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0515 0000 2078	华润微	2023- 05-15	84,09 8.00	1,400.00	14	3.1 0	101.3 8	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0515 0000 2101	晶科能 源	2023- 05-15	1,218 ,639. 00	101,300.0 0	14	3.1 0	1,469 .14	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 2811	西部超 导	2023- 05-18	84,40 0.00	1,000.00	14	3.1 0	101.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 2828	大全能 源	2023- 05-18	39,39 0.00	1,000.00	14	3.1 0	47.49	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 2840	澜起科 技	2023- 05-18	2,320 ,000. 00	40,000.00	14	3.1 0	2,796 .89	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0000 7422	天奈科 技	2023- 05-18	70,51 8.00	1,400.00	14	3.2 0	87.76	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0001 0120	大全能 源	2023- 05-18	263,9 13.00	6,700.00	14	3.2 0	328.4 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0518 0002 3360	海光信 息	2023- 05-18	1,236 ,216. 00	15,200.00	14	3.2 0	1,538 .40	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0522 0001 1192	沪硅产 业	2023- 05-22	139,9 63.00	6,700.00	14	3.2 0	174.1 8	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0522 0001 9220	澜起科 技	2023- 05-22	594,1 00.00	10,000.00	7	3.2 0	369.6 6	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0522 0003 2702	传音控 股	2023- 05-22	1,375 ,644. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,711 .91	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0522 0005 2618	容百科 技	2023- 05-22	504,8 00.00	8,000.00	7	3.1 0	304.2 8	-	-
广发证	2023	君实生	2023-	182,9	3,600.00	14	3.1	220.5	-	-

券股份 有限公司	0523 0000 3540	物	05-23	52.00			0	6		
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 2298	澜起科 技	2023- 05-23	2,885 ,000. 00	50,000.00	14	3.1 0	3,478 .03	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 7276	传音控 股	2023- 05-23	641,3 64.00	5,700.00	14	3.2 0	798.1 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0523 0002 7510	君实生 物	2023- 05-23	238,8 54.00	4,700.00	14	3.5 0	325.1 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0524 0000 5172	天奈科 技	2023- 05-24	48,05 0.00	1,000.00	14	3.2 0	59.80	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0524 0001 4294	晶晨股 份	2023- 05-24	304,8 06.00	3,700.00	14	3.1 0	367.4 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0524 0001 9746	澜起科 技	2023- 05-24	2,900 ,000. 00	50,000.00	14	3.0 0	3,383 .33	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0525 0002 5120	传音控 股	2023- 05-25	3,934 ,710. 00	34,200.00	14	3.2 0	4,896 .53	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0526 0000 2995	天合光 能	2023- 05-26	1,801 ,558. 00	37,400.00	14	3.2 0	2,241 .94	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0526 0001 0837	天奈科 技	2023- 05-26	56,94 0.00	1,200.00	14	3.2 0	70.86	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0529 0001 1522	容百科 技	2023- 05-29	466,4 80.00	8,000.00	4	3.1 0	160.6 8	-	-
广发证 券股份	2023 0530	三一重 能	2023- 05-30	104,1 60.00	3,100.00	14	3.2 0	129.6 2	-	-

有限公司	0001 7268									
广发证 券股份 有限公司	2023 0530 0001 7351	天合光 能	2023- 05-30	587,7 08.00	14,800.00	14	3.2 0	731.3 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0531 0000 2578	珠海冠 宇	2023- 05-31	222,0 54.00	11,900.00	14	3.2 0	276.3 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0000 3118	天合光 能	2023- 06-01	304,2 00.00	7,800.00	14	3.2 1	379.7 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0000 3345	寒武纪	2023- 06-01	711,0 30.00	3,000.00	14	3.1 0	857.1 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0000 6210	天奈科 技	2023- 05-26	56,94 0.00	1,200.00	12	3.2 0	60.74	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0003 4947	海光信 息	2023- 06-01	1,326 ,960. 00	15,200.00	14	3.2 0	1,651 .33	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0601 0003 7454	澜起科 技	2023- 06-01	2,484 ,000. 00	40,000.00	14	3.1 0	2,994 .60	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0602 0000 2665	西部超 导	2023- 06-02	906,8 70.00	11,400.00	14	3.2 1	1,132 .08	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0605 0000 2279	芯原股 份	2023- 06-05	284,8 23.00	3,300.00	14	3.2 1	355.5 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0605 0002 8817	传音控 股	2023- 06-05	1,597 ,130. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,987 .54	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0000	沪硅产 业	2023- 06-06	30,11 4.00	1,400.00	14	3.2 1	37.59	-	-

司	3290									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0000 3311	天合光 能	2023- 06-06	550,8 48.00	15,200.00	14	3.2 1	687.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0001 5305	君实生 物	2023- 06-06	145,9 44.00	3,600.00	14	3.1 0	175.9 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0001 9357	澜起科 技	2023- 06-06	2,954 ,500. 00	50,000.00	14	3.1 0	3,561 .81	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0002 0314	君实生 物	2023- 06-06	190,5 38.00	4,700.00	14	3.5 0	259.3 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0606 0002 0838	传音控 股	2023- 06-06	763,8 00.00	5,700.00	14	3.2 0	950.5 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0607 0000 3033	纳微科 技	2023- 06-07	49,36 8.00	1,200.00	14	3.2 1	61.63	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0607 0001 6844	澜起科 技	2023- 06-07	2,995 ,500. 00	50,000.00	14	3.0 0	3,494 .75	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0607 0002 2883	晶晨股 份	2023- 06-07	332,6 67.00	3,700.00	14	3.1 0	401.0 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0608 0000 2788	凯赛生 物	2023- 06-08	55,72 0.00	1,000.00	14	3.2 1	89.43	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0608 0000 2802	派能科 技	2023- 06-08	567,9 00.00	3,000.00	14	3.1 0	880.2 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0608 0000 2827	西部超 导	2023- 06-08	149,5 30.00	1,900.00	14	3.2 1	240.0 0	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0608 0002 2060	传音控 股	2023- 06-08	4,529 ,790. 00	34,200.00	14	3.2 0	7,247 .66	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0609 0000 2575	君实生 物	2023- 06-09	312,5 76.00	7,400.00	14	3.2 1	473.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0609 0000 9615	天合光 能	2023- 06-09	1,411 ,850. 00	37,400.00	14	3.2 0	2,133 .46	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1651	翱捷科 技	2023- 06-12	843,8 00.00	10,000.00	14	3.2 1	1,053 .34	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1754	金山办 公	2023- 06-12	976,0 00.00	2,000.00	14	3.1 0	1,176 .62	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0612 0003 1840	天岳先 进	2023- 06-12	843,4 80.00	11,000.00	14	3.2 1	1,052 .94	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1478	禾迈股 份	2023- 06-13	338,5 30.00	1,000.00	14	1.7 0	223.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1506	芯原股 份	2023- 06-13	642,9 05.00	7,100.00	14	1.7 0	425.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1518	复旦微 电	2023- 06-13	217,4 00.00	4,000.00	14	1.7 0	143.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1519	龙芯中 科	2023- 06-13	142,8 80.00	1,000.00	14	1.7 0	94.46	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1529	国博电 子	2023- 06-13	72,44 0.00	1,000.00	14	1.7 0	47.89	-	-
广发证	2023	中控技	2023-	267,3	3,000.00	14	1.7	176.7	-	-

券股份 有限公司	0613 0001 1538	术	06-13	60.00			0	5		
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1557	芯原股 份	2023- 06-13	642,9 05.00	7,100.00	14	1.7 0	425.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1559	国博电 子	2023- 06-13	72,44 0.00	1,000.00	14	1.7 0	47.89	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1560	海光信 息	2023- 06-13	533,1 48.00	6,600.00	14	1.7 0	352.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1561	天合光 能	2023- 06-13	199,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	131.5 6	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1563	凯赛生 物	2023- 06-13	272,3 50.00	5,000.00	14	1.7 0	180.0 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1570	复旦微 电	2023- 06-13	217,4 00.00	4,000.00	14	1.7 0	143.7 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1577	华大智 造	2023- 06-13	99,77 0.00	1,100.00	14	1.7 0	65.96	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1600	海光信 息	2023- 06-13	533,1 48.00	6,600.00	14	1.7 0	352.4 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1601	天合光 能	2023- 06-13	398,0 00.00	10,000.00	14	1.7 0	263.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1602	禾迈股 份	2023- 06-13	338,5 30.00	1,000.00	14	1.7 0	223.8 1	-	-
广发证 券股份	2023 0613	凯赛生 物	2023- 06-13	272,3 50.00	5,000.00	14	1.7 0	180.0 5	-	-

有限公司	0001 1604									
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1608	西部超 导	2023- 06-13	388,5 00.00	5,000.00	14	1.7 0	256.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1610	三一重 能	2023- 06-13	131,8 97.00	4,100.00	14	1.7 0	87.20	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1612	中控技 术	2023- 06-13	267,3 60.00	3,000.00	14	1.7 0	176.7 5	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1634	和辉光 电	2023- 06-13	310,5 90.00	119,000.0 0	14	1.7 0	205.3 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1635	天合光 能	2023- 06-13	398,0 00.00	10,000.00	14	1.7 0	263.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1636	禾迈股 份	2023- 06-13	338,5 30.00	1,000.00	14	1.7 0	223.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1638	珠海冠 宇	2023- 06-13	379,7 76.00	19,200.00	14	1.7 0	251.0 7	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1641	昱能科 技	2023- 06-13	224,6 00.00	1,000.00	14	1.7 0	148.4 9	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1643	三一重 能	2023- 06-13	131,8 97.00	4,100.00	14	1.7 0	87.20	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1664	和辉光 电	2023- 06-13	310,5 90.00	119,000.0 0	14	1.7 0	205.3 3	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001	天合光 能	2023- 06-13	199,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	131.5 6	-	-

司	1665									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1666	禾迈股 份	2023- 06-13	338,5 30.00	1,000.00	14	1.7 0	223.8 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1667	珠海冠 宇	2023- 06-13	379,7 76.00	19,200.00	14	1.7 0	251.0 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1670	昱能科 技	2023- 06-13	224,6 00.00	1,000.00	14	1.7 0	148.4 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1673	华大智 造	2023- 06-13	99,77 0.00	1,100.00	14	1.7 0	65.96	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1692	柏楚电 子	2023- 06-13	327,2 50.00	1,700.00	14	1.7 0	216.3 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1693	华熙生 物	2023- 06-13	505,6 70.00	5,500.00	14	1.7 0	334.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1694	奇安信	2023- 06-13	293,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	193.7 1	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1699	中无人 机	2023- 06-13	192,7 77.00	3,900.00	14	1.7 0	127.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1717	柏楚电 子	2023- 06-13	327,2 50.00	1,700.00	14	1.7 0	216.3 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1720	华熙生 物	2023- 06-13	505,6 70.00	5,500.00	14	1.7 0	334.3 0	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1723	奇安信	2023- 06-13	293,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	193.7 1	-	-

广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1729	中无人 机	2023- 06-13	192,7 77.00	3,900.00	14	1.7 0	127.4 5	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1746	龙芯中 科	2023- 06-13	142,8 80.00	1,000.00	14	1.7 0	94.46	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1747	传音控 股	2023- 06-13	659,4 00.00	5,000.00	14	1.7 0	435.9 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1749	西部超 导	2023- 06-13	388,5 00.00	5,000.00	14	1.7 0	256.8 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1757	中复神 鹰	2023- 06-13	79,02 8.00	2,300.00	14	1.7 0	52.25	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1775	纳芯微	2023- 06-13	202,1 40.00	1,200.00	14	1.7 0	133.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1776	传音控 股	2023- 06-13	659,4 00.00	5,000.00	14	1.7 0	435.9 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1781	长远锂 科	2023- 06-13	328,0 75.00	27,500.00	14	1.7 0	216.8 9	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1786	中复神 鹰	2023- 06-13	79,02 8.00	2,300.00	14	1.7 0	52.25	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1800	纳芯微	2023- 06-13	202,1 40.00	1,200.00	14	1.7 0	133.6 4	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0613 0001 1803	长远锂 科	2023- 06-13	328,0 75.00	27,500.00	14	1.7 0	216.8 9	-	-
广发证	2023	联影医	2023-	217,2	1,600.00	14	1.7	143.6	-	-

券股份 有限公司	0613 0001 1806	疗	06-13	48.00			0	3		
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0001 1823	联影医 疗	2023- 06-13	217,2 48.00	1,600.00	14	1.7 0	143.6 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0613 0002 1579	天合光 能	2023- 06-13	589,0 40.00	14,800.00	14	3.2 0	733.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0002 7926	天合光 能	2023- 06-15	328,4 58.00	7,800.00	14	3.2 1	410.0 3	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0002 7988	寒武纪	2023- 06-15	633,0 00.00	3,000.00	14	3.1 0	763.1 2	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0002 8187	澜起科 技	2023- 06-15	2,459 ,600. 00	40,000.00	14	3.1 0	2,965 .18	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0615 0003 1509	海光信 息	2023- 06-15	1,151 ,856. 00	15,200.00	14	3.2 0	1,433 .42	-	-
广发证 券股份 有限公司	2023 0619 0002 0498	传音控 股	2023- 06-19	1,782 ,980. 00	11,800.00	14	3.2 0	1,743 .36	1,734,600.0 0	1,743.36
广发证 券股份 有限公司	2023 0620 0003 0514	天合光 能	2023- 06-20	651,7 76.00	15,200.00	14	3.2 1	581.1 7	647,672.00	581.17
广发证 券股份 有限公司	2023 0620 0003 0865	澜起科 技	2023- 06-20	3,020 ,000. 00	50,000.00	14	3.1 0	2,600 .56	2,871,000.0 0	2,600.56
广发证 券股份 有限公司	2023 0620 0003 1752	传音控 股	2023- 06-20	843,0 30.00	5,700.00	14	3.2 0	749.3 6	837,900.00	749.36
广发证 券股份	2023 0621	澜起科 技	2023- 06-21	2,904 ,000.	50,000.00	14	3.0 0	2,178 .00	2,871,000.0 0	2,178.00

有限公司	0001 5152			00						
广发证 券股份 有限公司	2023 0621 0001 7679	纳微科 技	2023- 06-21	48,80 4.00	1,200.00	14	3.2 1	39.17	46,620.00	39.17
广发证 券股份 有限公司	2023 0626 0003 7840	传音控 股	2023- 06-26	4,989 ,096. 00	34,200.00	14	3.2 0	1,773 .90	5,027,400.0 0	1,773.90
广发证 券股份 有限公司	2023 0626 0003 8676	翱捷科 技	2023- 06-26	766,5 00.00	10,000.00	14	3.2 1	273.3 9	753,900.00	273.39
广发证 券股份 有限公司	2023 0626 0004 0339	金山办 公	2023- 06-26	955,4 20.00	2,000.00	14	3.1 0	329.0 9	944,440.00	329.09
广发证 券股份 有限公司	2023 0626 0004 5301	派能科 技	2023- 06-26	584,4 00.00	3,000.00	14	3.1 0	201.2 9	594,750.00	201.29
广发证 券股份 有限公司	2023 0626 0004 8547	天合光 能	2023- 06-26	1,614 ,932. 00	37,400.00	14	3.2 0	574.2 0	1,593,614.0 0	574.20
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 5866	奇安信	2023- 06-27	297,4 50.00	5,000.00	14	1.7 0	42.14	259,050.00	42.14
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 5913	龙芯中 科	2023- 06-27	134,8 70.00	1,000.00	14	1.7 0	19.11	114,790.00	19.11
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 5921	国博电 子	2023- 06-27	77,76 0.00	1,000.00	14	1.7 0	11.02	79,200.00	11.02
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 5931	海光信 息	2023- 06-27	453,5 52.00	6,600.00	14	1.7 0	64.25	450,582.00	64.25
广发证 券股份 有限公	2023 0627 0001	天合光 能	2023- 06-27	420,0 00.00	10,000.00	14	1.7 0	59.50	426,100.00	59.50

司	6029									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6115	奇安信	2023- 06-27	297,4 50.00	5,000.00	14	1.7 0	42.14	259,050.00	42.14
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6146	珠海冠 宇	2023- 06-27	363,6 48.00	19,200.00	14	1.7 0	51.52	386,880.00	51.52
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6147	中控技 术	2023- 06-27	186,2 70.00	3,000.00	14	1.7 0	26.39	188,340.00	26.39
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6167	三一重 能	2023- 06-27	128,2 07.00	4,100.00	14	1.7 0	18.16	132,102.00	18.16
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6397	昱能科 技	2023- 06-27	180,1 20.00	1,000.00	14	1.7 0	25.52	187,830.00	25.52
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6467	三一重 能	2023- 06-27	128,2 07.00	4,100.00	14	1.7 0	18.16	132,102.00	18.16
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6518	中复神 鹰	2023- 06-27	79,81 0.00	2,300.00	14	1.7 0	11.31	84,364.00	11.31
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6646	长远锂 科	2023- 06-27	308,5 50.00	27,500.00	14	1.7 0	43.71	309,925.00	43.71
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6682	禾迈股 份	2023- 06-27	353,2 20.00	1,000.00	14	1.7 0	50.04	355,150.00	50.04
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6730	中无人 机	2023- 06-27	189,1 50.00	3,900.00	14	1.7 0	26.80	200,031.00	26.80
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6731	柏楚电 子	2023- 06-27	330,5 99.00	1,700.00	14	1.7 0	46.83	320,552.00	46.83

广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6744	西部超 导	2023- 06-27	259,3 50.00	5,000.00	14	1.7 0	36.74	278,650.00	36.74
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 6758	纳芯微	2023- 06-27	200,4 00.00	1,200.00	14	1.7 0	28.39	190,044.00	28.39
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7093	芯原股 份	2023- 06-27	549,2 56.00	7,100.00	14	1.7 0	77.81	510,632.00	77.81
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7266	中无人 机	2023- 06-27	189,1 50.00	3,900.00	14	1.7 0	26.80	200,031.00	26.80
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7370	柏楚电 子	2023- 06-27	330,5 99.00	1,700.00	14	1.7 0	46.83	320,552.00	46.83
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7585	华熙生 物	2023- 06-27	491,9 20.00	5,500.00	14	1.7 0	69.69	490,380.00	69.69
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7705	龙芯中 科	2023- 06-27	134,8 70.00	1,000.00	14	1.7 0	19.11	114,790.00	19.11
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 7816	中复神 鹰	2023- 06-27	79,81 0.00	2,300.00	14	1.7 0	11.31	84,364.00	11.31
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8182	西部超 导	2023- 06-27	259,3 50.00	5,000.00	14	1.7 0	36.74	278,650.00	36.74
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8322	昱能科 技	2023- 06-27	180,1 20.00	1,000.00	14	1.7 0	25.52	187,830.00	25.52
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0001 8482	复旦微 电	2023- 06-27	205,9 20.00	4,000.00	14	1.7 0	29.17	200,400.00	29.17
广发证	2023	天合光	2023-	420,0	10,000.00	14	1.7	59.50	426,100.00	59.50

券股份 有限公司	0627 0001 8506	能	06-27	00.00			0			
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 8554	华熙生 物	2023- 06-27	491,9 20.00	5,500.00	14	1.7 0	69.69	490,380.00	69.69
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 8594	禾迈股 份	2023- 06-27	353,2 20.00	1,000.00	14	1.7 0	50.04	355,150.00	50.04
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 8886	联影医 疗	2023- 06-27	223,5 20.00	1,600.00	14	1.7 0	31.67	220,816.00	31.67
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 8919	天合光 能	2023- 06-27	210,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	29.75	213,050.00	29.75
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 8943	天合光 能	2023- 06-27	621,6 00.00	14,800.00	14	3.2 0	165.7 6	630,628.00	165.76
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9040	凯赛生 物	2023- 06-27	324,5 00.00	5,000.00	14	1.7 0	45.97	311,300.00	45.97
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9258	和辉光 电	2023- 06-27	304,6 40.00	119,000.0 0	14	1.7 0	43.16	302,260.00	43.16
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9390	珠海冠 宇	2023- 06-27	363,6 48.00	19,200.00	14	1.7 0	51.52	386,880.00	51.52
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9453	复旦微 电	2023- 06-27	205,9 20.00	4,000.00	14	1.7 0	29.17	200,400.00	29.17
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9454	海光信 息	2023- 06-27	453,5 52.00	6,600.00	14	1.7 0	64.25	450,582.00	64.25
广发证 券股份	2023 0627	禾迈股 份	2023- 06-27	353,2 20.00	1,000.00	14	1.7 0	50.04	355,150.00	50.04

有限公司	0001 9506									
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9507	华大智 造	2023- 06-27	94,11 6.00	1,100.00	14	1.7 0	13.33	95,216.00	13.33
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9601	禾迈股 份	2023- 06-27	353,2 20.00	1,000.00	14	1.7 0	50.04	355,150.00	50.04
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9664	联影医 疗	2023- 06-27	223,5 20.00	1,600.00	14	1.7 0	31.67	220,816.00	31.67
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9697	凯赛生 物	2023- 06-27	324,5 00.00	5,000.00	14	1.7 0	45.97	311,300.00	45.97
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9771	和辉光 电	2023- 06-27	304,6 40.00	119,000.0 0	14	1.7 0	43.16	302,260.00	43.16
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9772	天合光 能	2023- 06-27	210,0 00.00	5,000.00	14	1.7 0	29.75	213,050.00	29.75
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9800	纳芯微	2023- 06-27	200,4 00.00	1,200.00	14	1.7 0	28.39	190,044.00	28.39
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0001 9801	传音控 股	2023- 06-27	717,2 00.00	5,000.00	14	1.7 0	101.6 0	735,000.00	101.60
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0168	传音控 股	2023- 06-27	717,2 00.00	5,000.00	14	1.7 0	101.6 0	735,000.00	101.60
广发证 券股份 有限公司	2023 0627 0002 0181	长远锂 科	2023- 06-27	308,5 50.00	27,500.00	14	1.7 0	43.71	309,925.00	43.71
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002	国博电 子	2023- 06-27	77,76 0.00	1,000.00	14	1.7 0	11.02	79,200.00	11.02

司	0307									
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002 0530	华大智 造	2023- 06-27	94,11 6.00	1,100.00	14	1.7 0	13.33	95,216.00	13.33
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002 1616	中控技 术	2023- 06-27	186,2 70.00	3,000.00	14	1.7 0	26.39	188,340.00	26.39
广发证 券股份 有限公 司	2023 0627 0002 1831	芯原股 份	2023- 06-27	549,2 56.00	7,100.00	14	1.7 0	77.81	510,632.00	77.81
广发证 券股份 有限公 司	2023 0629 0000 6699	西部超 导	2023- 06-29	878,2 20.00	16,400.00	14	3.2 1	78.31	913,972.00	78.31
广发证 券股份 有限公 司	2023 0629 0003 3167	寒武纪	2023- 06-29	579,0 00.00	3,000.00	14	3.1 0	49.86	564,000.00	49.86
广发证 券股份 有限公 司	2023 0629 0003 3308	海光信 息	2023- 06-29	1,033 ,752. 00	15,200.00	14	3.2 0	91.89	1,037,704.0 0	91.89
广发证 券股份 有限公 司	2023 0629 0003 4716	天合光 能	2023- 06-29	327,8 34.00	7,800.00	14	3.2 1	29.23	332,358.00	29.23
广发证 券股份 有限公 司	2023 0629 0003 9268	澜起科 技	2023- 06-29	2,226 ,800. 00	40,000.00	14	3.1 0	191.7 5	2,296,800.0 0	191.75
广发证 券股份 有限公 司	2023 0630 0000 5392	传音控 股	2023- 06-30	294,0 00.00	2,000.00	14	3.1 0	-	294,000.00	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成交 时间	交易 金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位:天)	费 率 (%)	利息 收入	期末证券出 借业务余额	期末应 收利息 余额
广发证	2022	圣湘生	2022-	599,6	12,400.00	28	3.1	1,445	-	-

券股份 有限公司	0531 0000 1266	物	05-31	64.00			0	.86		
广发证 券股份 有限公司	2022 0616 0000 1720	中控技 术	2022- 06-16	1,547 ,000. 00	20,000.00	28	3.1 0	1,864 .99	1,455,200.0 0	1,864.99
广发证 券股份 有限公司	2022 0616 0000 1722	大全能 源	2022- 06-16	682,6 00.00	10,000.00	28	3.1 0	822.9 1	683,200.00	822.91
广发证 券股份 有限公司	2022 0616 0000 1752	九号公 司	2022- 06-16	951,8 00.00	20,000.00	28	3.1 0	1,147 .45	-	1,147.45
广发证 券股份 有限公司	2022 0617 0000 2344	寒武纪	2022- 06-17	246,8 70.00	3,900.00	28	3.1 0	276.3 6	252,330.00	276.36
广发证 券股份 有限公司	2022 0628 0001 0896	圣湘生 物	2022- 06-28	372,4 96.00	12,400.00	28	3.1 0	64.15	367,164.00	64.15
广发证 券股份 有限公司	2022 0630 0000 1536	天合光 能	2022- 06-30	5,220 ,000. 00	80,000.00	28	3.1 0	-	5,220,000.0 0	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发上证科创板 50 成份交易型开 放式指数证券投	562,846,500.00	28.35%	342,843,700.00	27.98%

资基金发起式联接基金				
广发证券股份有限公司	11,750,996.00	0.59%	7,125,500.00	0.58%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	4,596,848.54	6,683.87	3,343,001.87	5,158.77

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内无在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（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

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

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值总 额
1	688111	金山办公	2023年7月3日 -2023年7月13日	472.2 2	52,400.00	24,744,328. 00
2	688036	传音控股	2023年7月3日 -2023年7月14日	147.0 0	92,100.00	13,538,700. 00
3	688008	澜起科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	57.42	230,500.00	13,235,310. 00
4	688599	天合光能	2023年7月3日 -2023年7月14日	42.61	290,500.00	12,378,205. 00
5	688256	寒武纪-U	2023年7月3日 -2023年7月13日	188.0 0	57,900.00	10,885,200. 00
6	688777	中控技术	2023年7月3日 -2023年7月13日	62.78	132,265.00	8,303,596.7 0
7	688099	晶晨股份	2023年7月3日 -2023年7月14日	84.32	80,600.00	6,796,192.0 0
8	688012	中微公司	2023年7月3日 -2023年7月13日	156.4 5	32,900.00	5,147,205.0 0
9	688521	芯原股份	2023年7月3日 -2023年7月13日	71.92	71,500.00	5,142,280.0 0
10	688223	晶科能源	2023年7月3日 -2023年7月13日	14.06	355,700.00	5,001,142.0 0
11	688303	大全能源	2023年7月3日 -2023年7月14日	40.45	115,800.00	4,684,110.0 0
12	688122	西部超导	2023年7月3日 -2023年7月14日	55.73	83,580.00	4,657,913.4 0
13	688363	华熙生物	2023年7月3日 -2023年7月14日	89.16	49,400.00	4,404,504.0 0
14	689009	九号公司-WD	2023年7月3日 -2023年7月13日	36.85	119,000.00	4,385,150.0 0
15	688390	固德威	2023年7月3日 -2023年7月13日	166.8 6	24,900.00	4,154,814.0 0
16	688063	派能科技	2023年7月3日 -2023年7月12日	198.2 5	20,000.00	3,965,000.0 0
17	688041	海光信息	2023年7月3日 -2023年7月27日	68.27	56,700.00	3,870,909.0 0
18	688385	复旦微电	2023年7月10日 -2023年7月14日	50.10	76,500.00	3,832,650.0 0
19	688169	石头科技	2023年7月3日 -2023年7月13日	320.6 8	11,700.00	3,751,956.0 0
20	688220	翱捷科技-U	2023年7月3日 -2023年7月13日	75.39	45,600.00	3,437,784.0 0
21	688779	长远锂科	2023年7月3日	11.27	293,500.00	3,307,745.0

			-2023 年 7 月 13 日			0
22	688005	容百科技	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	54.02	61,000.00	3,295,220.0 0
23	688396	华润微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	52.41	53,500.00	2,803,935.0 0
24	688772	珠海冠宇	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	20.15	135,100.00	2,722,265.0 0
25	688188	柏楚电子	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	188.5 6	13,600.00	2,564,416.0 0
26	688538	和辉光电-U	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	2.54	952,700.00	2,419,858.0 0
27	688082	盛美上海	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	110.4 0	21,600.00	2,384,640.0 0
28	688032	禾迈股份	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	355.1 5	6,500.00	2,308,475.0 0
29	688065	凯赛生物	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	62.26	34,300.00	2,135,518.0 0
30	688690	纳微科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	38.85	50,700.00	1,969,695.0 0
31	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	20.90	91,000.00	1,901,900.0 0
32	688561	奇安信-U	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	51.81	34,600.00	1,792,626.0 0
33	688297	中无人机	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	51.29	33,000.00	1,692,570.0 0
34	688536	思瑞浦	2023 年 7 月 10 日	218.0 0	7,100.00	1,547,800.0 0
35	688819	天能股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	36.84	41,600.00	1,532,544.0 0
36	688052	纳芯微	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	158.3 7	8,100.00	1,282,797.0 0
37	688009	中国通号	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	5.80	218,000.00	1,264,400.0 0
38	688234	天岳先进	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	73.94	17,100.00	1,264,374.0 0
39	688271	联影医疗	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	138.0 1	6,900.00	952,269.00
40	688348	昱能科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	187.8 3	4,540.00	852,748.20
41	688728	格科微	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	15.82	51,900.00	821,058.00
42	688301	奕瑞科技	2023 年 7 月 13 日	282.4 3	2,900.00	819,047.00
43	688295	中复神鹰	2023 年 7 月 3 日	36.68	22,300.00	817,964.00

			-2023 年 7 月 13 日			
44	688047	龙芯中科	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	114.7 9	6,700.00	769,093.00
45	688180	君实生物-U	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	38.54	18,200.00	701,428.00
46	688981	中芯国际	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	50.52	13,200.00	666,864.00
47	688349	三一重能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	32.22	19,100.00	615,402.00
48	688375	国博电子	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	79.20	4,700.00	372,240.00
49	688114	华大智造	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	86.56	4,000.00	346,240.00
合计	-	-	-	-	4,226,985.0 0	192,242,080 .30

6.4.13 金融工具风险及管理

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

持证券、同业存单，因此无相关重大信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

此外，本基金申购赎回采用一篮子股票的形式，流动性风险低于其他类型基金。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

综上所述，本基金的流动性良好，无重大流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	4,596,848.54	-	-	-	4,596,848.54
结算备付金	102,629.14	-	-	-	102,629.14
存出保证金	9,164.31	-	-	-	9,164.31
交易性金融资产	-	-	-	1,269,783,661.18	1,269,783,661.18
应收清算款	-	-	-	285,573.57	285,573.57
应收股利	-	-	-	136,550.26	136,550.26
其他资产	-	-	-	143,740.02	143,740.02
资产总计	4,708,641.99	-	-	1,270,349,525.03	1,275,058,167.02
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	500,920.62	500,920.62
应付托管费	-	-	-	100,184.15	100,184.15
应交税费	-	-	-	12,703.95	12,703.95
其他负债	-	-	-	368,146.89	368,146.89
负债总计	-	-	-	981,955.61	981,955.61
利率敏感度缺口	4,708,641.99	-	-	1,269,367,569.42	1,274,076,211.41
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	3,063,921.53	-	-	-	3,063,921.53
存出保证金	17,837.61	-	-	-	17,837.61
交易性金融资产	-	-	-	748,688,874.21	748,688,874.21
其他资产	-	-	-	52,192.24	52,192.24
资产总计	3,081,759.14	-	-	748,741,066.45	751,822,825.59
负债					
应付清算款	-	-	-	19,756.93	19,756.93
应付管理人报酬	-	-	-	288,240.55	288,240.55
应付托管费	-	-	-	57,648.11	57,648.11

应交税费	-	-	-	6,863.20	6,863.20
其他负债	-	-	-	311,970.64	311,970.64
负债总计	-	-	-	684,479.43	684,479.43
利率敏感度缺口	3,081,759.14	-	-	748,056,587.02	751,138,346.16

注：上表按金融资产和金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,269,783,661.18	99.66	748,688,874.21	99.67
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	1,269,783,661.18	99.66	748,688,874.21	99.67

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	上升 5%	64,284,780.95	37,848,099.52
	下降 5%	-64,284,780.95	-37,848,099.52

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	1,269,783,661.18
第二层次	-
第三层次	-
合计	1,269,783,661.18

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金

融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,269,783,661.18	99.59
	其中：普通股	1,250,106,166.53	98.04
	存托凭证	19,677,494.65	1.54
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	4,699,477.68	0.37
8	其他各项资产	575,028.16	0.05
9	合计	1,275,058,167.02	100.00

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

（2）本基金本报告期末参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 192,242,080.30 元，占基金资产净值比例 15.09%。

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	964,144,003.77	75.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	305,639,657.41	23.99
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,269,783,661.18	99.66

注：上述行业分类的数据已包含存托凭证。

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有通过港股通投资的股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	2,409,520	121,728,950.40	9.55
2	688111	金山办公	229,713	108,475,072.86	8.51

3	688012	中微公司	537,593	84,106,424.85	6.60
4	688036	传音控股	399,256	58,690,632.00	4.61
5	688599	天合光能	1,347,918	57,434,785.98	4.51
6	688008	澜起科技	987,711	56,714,365.62	4.45
7	688256	寒武纪-U	258,341	48,568,108.00	3.81
8	688777	中控技术	584,504	36,695,161.12	2.88
9	688126	沪硅产业	1,695,820	35,442,638.00	2.78
10	688223	晶科能源	2,483,445	34,917,236.70	2.74
11	688396	华润微	655,340	34,346,369.40	2.70
12	688303	大全能源	796,207	32,206,573.15	2.53
13	688122	西部超导	564,132	31,439,076.36	2.47
14	688099	晶晨股份	361,347	30,468,779.04	2.39
15	688169	石头科技	70,374	22,567,534.32	1.77
16	688521	芯原股份	309,708	22,274,199.36	1.75
17	688063	派能科技	108,811	21,571,780.75	1.69
18	688390	固德威	129,065	21,535,785.90	1.69
19	688363	华熙生物	239,416	21,346,330.56	1.68
20	688005	容百科技	392,255	21,189,615.10	1.66
21	688041	海光信息	288,932	19,725,387.64	1.55
22	689009	九号公司	533,989	19,677,494.65	1.54
23	688536	思瑞浦	89,812	19,579,016.00	1.54
24	688220	翱捷科技-U	259,404	19,556,467.56	1.53
25	688009	中国通号	3,205,559	18,592,242.20	1.46
26	688180	君实生物-U	475,278	18,317,214.12	1.44
27	688301	奕瑞科技	64,121	18,109,694.03	1.42
28	688561	奇安信-U	340,483	17,640,424.23	1.38
29	688772	珠海冠宇	836,254	16,850,518.10	1.32
30	688385	复旦微电	330,883	16,577,238.30	1.30
31	688032	禾迈股份	40,283	14,306,507.45	1.12
32	688188	柏楚电子	73,233	13,808,814.48	1.08
33	688187	时代电气	324,414	13,579,970.04	1.07
34	688065	凯赛生物	216,778	13,496,598.28	1.06
35	688779	长远锂科	1,197,075	13,491,035.25	1.06
36	688538	和辉光电-U	5,175,808	13,146,552.32	1.03
37	688082	盛美上海	107,469	11,864,577.60	0.93
38	688271	联影医疗	72,342	9,983,919.42	0.78
39	688728	格科微	621,168	9,826,877.76	0.77
40	688690	纳微科技	250,712	9,740,161.20	0.76
41	688297	中无人机	167,179	8,574,610.91	0.67
42	688052	纳芯微	51,336	8,130,082.32	0.64
43	688234	天岳先进	106,462	7,871,800.28	0.62
44	688348	昱能科技	40,639	7,633,223.37	0.60
45	688819	天能股份	168,237	6,197,851.08	0.49
46	688349	三一重能	177,976	5,734,386.72	0.45

47	688047	龙芯中科	43,640	5,009,435.60	0.39
48	688114	华大智造	45,179	3,910,694.24	0.31
49	688295	中复神鹰	100,532	3,687,513.76	0.29
50	688375	国博电子	43,484	3,443,932.80	0.27

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	688385	复旦微电	18,260,941.93	2.43
2	688220	翱捷科技-U	17,803,739.09	2.37
3	688303	大全能源	16,520,925.58	2.20
4	688348	昱能科技	12,905,952.36	1.72
5	688772	珠海冠宇	12,198,001.63	1.62
6	688032	禾迈股份	9,857,375.17	1.31
7	688363	华熙生物	9,055,890.26	1.21
8	688082	盛美上海	8,881,771.73	1.18
9	688297	中无人机	7,650,615.03	1.02
10	688223	晶科能源	6,549,342.50	0.87
11	688047	龙芯中科	6,164,076.66	0.82
12	688126	沪硅产业	4,697,658.49	0.63
13	688536	思瑞浦	4,544,876.40	0.61
14	688349	三一重能	4,525,057.64	0.60
15	688375	国博电子	4,381,334.14	0.58
16	688234	天岳先进	4,225,506.06	0.56
17	688114	华大智造	4,095,765.90	0.55
18	688052	纳芯微	4,061,895.90	0.54
19	688728	格科微	3,390,439.65	0.45
20	688981	中芯国际	3,237,822.03	0.43

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				产净值比例 (%)
1	688139	海尔生物	12,729,464.52	1.69
2	688981	中芯国际	12,129,346.60	1.61
3	688116	天奈科技	10,460,675.65	1.39
4	688111	金山办公	10,137,606.75	1.35
5	688301	奕瑞科技	9,072,415.14	1.21
6	688185	康希诺	7,869,839.79	1.05
7	688202	美迪西	7,615,744.90	1.01
8	688012	中微公司	7,331,703.27	0.98
9	688276	百克生物	7,142,267.18	0.95
10	688169	石头科技	5,737,700.03	0.76
11	688008	澜起科技	5,555,670.74	0.74
12	688006	杭可科技	5,549,963.05	0.74
13	688777	中控技术	5,194,533.97	0.69
14	688036	传音控股	5,095,020.34	0.68
15	688599	天合光能	4,917,082.52	0.65
16	688256	寒武纪-U	4,162,035.00	0.55
17	688396	华润微	3,718,091.88	0.49
18	688032	禾迈股份	3,241,585.94	0.43
19	688122	西部超导	3,198,673.11	0.43
20	688099	晶晨股份	2,865,911.52	0.38

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	196,888,847.13
卖出股票收入（成交）总额	172,444,651.37

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，晶科能源股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到地方海关的处罚。

本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。除上述主体外，本基金投资的其他前十名证券的发行主体本期没有出现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 本报告期内，基金投资的前十名股票未出现超出基金合同规定的备选股票库的情形。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,164.31
2	应收清算款	285,573.57
3	应收股利	136,550.26
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	68,123.78
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	575,028.16

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	688111	金山办公	24,744,328.00	1.94	转融通流通受限
2	688036	传音控股	13,538,700.00	1.06	转融通流通受限
3	688008	澜起科技	13,235,310.00	1.04	转融通流通受限
4	688599	天合光能	12,378,205.00	0.97	转融通流通受限
5	688256	寒武纪-U	10,885,200.00	0.85	转融通流通受限
6	688777	中控技术	8,303,596.70	0.65	转融通流通受限
7	688012	中微公司	5,147,205.00	0.40	转融通流通受限
8	688223	晶科能源	5,001,142.00	0.39	转融通流通受限
9	688126	沪硅产业	1,901,900.00	0.15	转融通流通受限
10	688981	中芯国际	666,864.00	0.05	转融通流通受限

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		广发上证科创板 50 成份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

20,590	96,412.82	837,032 ,929.00	42.16%	1,148,1 07,071. 00	57.84%	562,846,50 0.00	28.35%
--------	-----------	--------------------	--------	--------------------------	--------	--------------------	--------

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中已包含“广发上证科创板50成份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-个险分红	88,194,500.00	4.44%
2	中国平安人寿保险股份有限公司-自有资金	69,833,000.00	3.52%
3	吉林银行股份有限公司-吉利财富理财产品	25,000,000.00	1.26%
4	朱炳复	19,417,900.00	0.98%
5	上海涵元资产管理有限公司-涵元阿尔法 6 号私募证券投资基金	16,499,500.00	0.83%
6	兴银理财有限责任公司-兴银理财兴承恒享 5 号开放式净值型理财产品	16,399,000.00	0.83%
7	余建华	15,285,400.00	0.77%
8	招商证券股份有限公司	13,769,267.00	0.69%
9	广发证券股份有限公司	11,750,996.00	0.59%
10	贾志贤	11,670,000.00	0.59%
11	广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	562,846,500.00	28.35%

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 7 月 15 日）基金份额总额	425,140,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,225,140,000.00
本报告期基金总申购份额	1,524,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	764,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,985,140,000.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	3	369,295,318.48	100.00%	343,967.53	100.00%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
英大证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
大同证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
万和证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
银河证券	2	-	-	-	-	-
银泰证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
财通证券	2	-	-	-	-	-
国融证券	1	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	1	-	-	-	-	-
联储证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	新增 1 个
民生证券	1	-	-	-	-	新增 1 个
中信证券	3	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
华福证券	2	-	-	-	-	新增 2 个
安信证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
国金证券	4	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
摩根大通证券	2	-	-	-	-	-
东莞证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	1	-	-	-	-	-
粤开证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	3	-	-	-	-	新增 1 个
中邮证券	4	-	-	-	-	-
中金财富证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-

注：1、交易单元选择标准：

- (1) 财务状况良好，在最近一年内无重大违规行为；
- (2) 经营行为规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- (3) 具备投资运作所需的高效、安全、合规的席位资源，满足投资组合进行证券交易的需要；
- (4) 具有较强的研究和行业分析能力，能及时、全面、准确地向公司提供关于宏观、行业、市场及个股的高质量报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；
- (5) 能积极为公司投资业务的开展，提供良好的信息交流和客户服务；
- (6) 能提供其他基金运作和管理所需的服务。

2、交易单元选择流程：

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

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

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
广发证券	6,347,585.04	100.00%	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-
大同证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
万和证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
银泰证券	-	-	-	-	-	-
财通证券	-	-	-	-	-	-
国融证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
国联证券	-	-	-	-	-	-
联储证券	-	-	-	-	-	-

首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
摩根大通证券	-	-	-	-	-	-
东莞证券	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
粤开证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
中金财富证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-01-20
2	关于增加中金公司为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-03
3	关于增加东兴证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-14
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-03-30
5	关于增加国金证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-18
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-04-21
7	关于增加中金财富证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-05-17

8	关于增加东方证券为旗下部分 ETF 一级交易商的公告	中国证监会规定报刊及网站	2023-06-19
---	----------------------------	--------------	------------

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	1	20230101-20230630	342,843,700.00	296,402,400.00	76,399,600.00	562,846,500.00	28.35%
产品特有风险							
<p>报告期内，本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过 20% 的情况，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <ol style="list-style-type: none"> 1、当投资者持有份额占比较为集中时，个别投资者的大额赎回可能会对基金资产运作及净值表现产生较大影响； 2、在极端情况下，基金管理人可能无法以合理价格及时变现基金资产以应对投资者的赎回申请，可能带来流动性风险； 3、当个别投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据基金合同约定决定部分延期赎回或暂停接受基金的赎回申请，可能影响投资者赎回业务办理； 4、在特定情况下，当个别投资者大额赎回，可能导致本基金资产规模和基金份额持有人数量未能满足合同约定，基金还可能面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形； 5、在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时，持有基金份额占比较高的投资者可能拥有较大话语权。 <p>本基金管理人将对基金的大额申赎进行审慎评估并合理应对，完善流动性风险管控机制，切实保护持有人利益。</p>							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- (一) 中国证监会批准广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- (二) 《广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金基金合同》
- (三) 《广发上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金托管协议》
- (四) 法律意见书
- (五) 基金管理人业务资格批件、营业执照
- (六) 基金托管人业务资格批件、营业执照

12.2 存放地点

广州市海珠区琶洲大道东 1 号保利国际广场南塔 31-33 楼

12.3 查阅方式

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

广发基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日