# 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	
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	
	3.2 基金净值表现	
4	管理人报告	
	4.1 基金管理人及基金经理情况	
	4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	
	4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	
	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	
	4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	
	4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	
	4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	
	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	
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	
	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	
	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	
6	半年度财务会计报告(未经审计)	
	6.1 资产负债表	
	6.2 利润表	
	6.3 净资产(基金净值)变动表	
_	6.4 报表附注	
7	<b>投资组合报告</b>	
	7.1 期末基金资产组合情况	
	7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	
	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	
	7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	
	7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	
	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	
	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	
	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	
	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	
	7.10 本基金投资股指期货的投资政策	
	7.11 报告期本本基金投资的国领期员父易情况说明	
	7.1.2 1.1.2 1.1.2.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1.1	/6

# 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%。		
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 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 整。具体包括: 1、股票投资策略; 2、债券投资策略; 3、股指期 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			
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	
<b>产</b> 自 拉 靈	姓名	程才良	许俊	
信息披露	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	
客户服务电记	舌	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	北京市西城区复兴门内大街1	
生加地址		路3018号2608室	号	
	广东省广州市海珠区琶洲大道			
办公地址	东1号保利国际广场南塔31-33		北京市西城区复兴门内大街1	
77. A 16.4L		楼;广东省珠海市横琴新区环	号	
		岛东路3018号2603-2622室		
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	www.gffunds.com.cn
互联网网址	W. W. Mg. London V. Similan
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)。

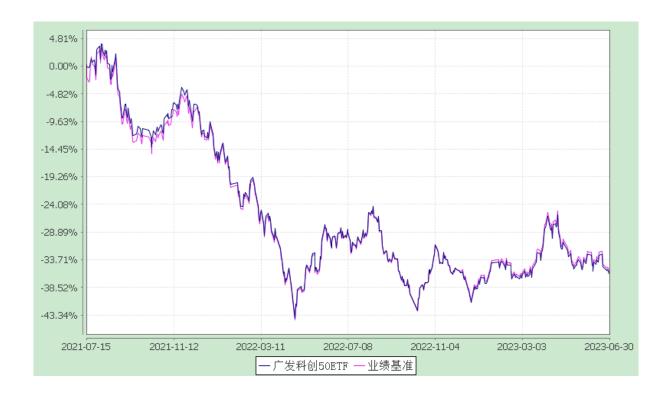
#### 3.2 基金净值表现

#### 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	平限	
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	2021-07-1	-	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

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

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

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)。

券投资基金基金经理(自 2015 年 1 投资基金的基 金经理:广发 月8日至2021年6月17日)、广 中证上海环交 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 所碳中和交易 型开放式指数 基金基金经理(自 2015 年 1 月 29 证券投资基金 日至 2021 年 6 月 17 日)、广发中 的基金经理: 证全指金融地产交易型开放式指 广发中证全指 数证券投资基金基金经理(自 2015 电力公用事业 年3月23日至2021年6月17日)、 交易型开放式 广发中证全指可选消费交易型开 指数证券投资 放式指数证券投资基金发起式联 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 接基金的基金 经理;广发中 中证全指医药卫生交易型开放式 证上海环交所 指数证券投资基金发起式联接基 碳中和交易型 金基金经理(自2015年5月6日至 2021年6月17日)、广发中证全 开放式指数证 指原材料交易型开放式指数证券 券投资基金发 起式联接基金 投资基金基金经理(自2015年6月 的基金经理 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

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遵规守信情况的说明

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第10页共84页

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

		本期末	
资产	附注号	2023年6月30日	2022年12月31日
资产:		2020   0 /4 co H	-0 1 / 0-1 H
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	上年度末
火顶种伊页)	附在与	2023年6月30日	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		-	

	500,920.62	288,240.55
	100,184.15	57,648.11
	-	-
	-	-
	12,703.95	6,863.20
	-	-
	-	-
6.4.7.7	368,146.89	311,970.64
	981,955.61	684,479.43
6.4.7.8	1,985,140,000.00	1,225,140,000.00
6.4.7.9	-711,063,788.59	-474,001,653.84
	1,274,076,211.41	751,138,346.16
	1,275,058,167.02	751,822,825.59
	6.4.7.8	100,184.15  12,703.95  6.4.7.7 368,146.89  981,955.61  6.4.7.8 1,985,140,000.00  6.4.7.9 -711,063,788.59  1,274,076,211.41

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

		本期	上年度可比期间
项目	附注号	2023年1月1日至	2022年1月1日至
		2023年6月30日	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

其他投资收益 3.公允价值变动收益(损失以"-"号			
3.公允价值受动収益(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		37,198,315.03	-52,722,963.63
列)		37,190,313.03	-52,722,905.05
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

		本期	
项目	2023年1月1日至2023年6月30		80 日
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资	1,225,140,000.00	-474,001,653.84	751,138,346.16
产(基金净值)	1,223,140,000.00	-474,001,033.64	/31,136,340.10
加:会计政策变更		1	-
二、本期期初净资	1 225 140 000 00	474 001 652 94	751 120 246 16
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"-"	760,000,000.00	-237,062,134.75	522,937,865.25
号填列)			
(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		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

		本期末			
项目			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
贵金属护	设资-金交				
所黄金合	约	-	-	-	-
	交易所				
	市场	-	-	1	1
债券	银行间				
	市场	-	-	-	ı
	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

番口	本期末
项目	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

		本期
	, , ,	• • • •
项目	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	6,683.87
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

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	-21,450,421.30
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	480,565.78
债券到期兑付)差价收入 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

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)	2.022.000.00
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

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		上年度可比期间			
	2023年1月1日至2023年	年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日			
		占当期股		占当期股		
	成交金额	票成交总	成交金额	票成交总		
		额的比例		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		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			
		占当期债		占当期债		
	成交金额	券成交总	成交金额	券成交总		
		额的比例		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

	本期							
关联方名称	2023年1月1日至2023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	<b>州本四刊州並未</b> 被	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%				
	上年度可比期间							
关联方名称	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

	本期	上年度可比期间		
项目	2023年1月1日至2023年6月	2022年1月1日至2022年6月		
	30日	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×0.50%÷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

	本期	上年度可比期间
项目	2023年1月1日至2023年6月	2022年1月1日至2022年6月
	30日	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×0.10%÷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

	本期									
				2023年	E1月1日至20	23年6月30	目			
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	2023 0103 0000 0923	康希诺	2023- 01-03	220,1 55.00	1,500.00	14	3.2	273.9 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0103 0000 0935	金山办公	2023- 01-03	312,3 34.00	1,100.00	14	3.2	388.6 8	ı	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0103 0003 3941	大全能源	2023- 01-03	289,2 00.00	6,000.00	14	3.2	359.8 9	1	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0104 0000 1067	寒武纪	2023- 01-04	415,6 62.00	7,300.00	14	3.2	517.2 7	-	-
广发证 券股份 有限公 司	2023 0105 0001 6803	大全能 源	2023- 01-05	482,5 00.00	10,000.00	14	3.5	656.7 4	-	-

	1	1	ı	1				1		
广发证	2023									
券股份	0105	大全能	2023-	246,0	<b>5</b> 100 00	1.4	3.2	306.2		
有限公	0001	源	01-05	75.00	5,100.00	14	0	3	-	-
司	6805									
广发证	2023									
券股份	0106	君实生	2023-	638,1			3.1	1,538		
有限公	0001	物	01-06	00.00	10,000.00	28	0	.53	-	-
司	0312	,,,								
广发证	2023									
券股份	0109	大全能	2023-	48,60			3.2			
有限公	0003	源	01-09	0.00	1,000.00	14	0	90.72	-	-
司	4788	10/15	01-07	0.00						
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0110	油却到	2023-	6246			3.2	1 120		
有限公	0001	瀬起科   技	01-10	634,6	10,000.00	14	0	1,128	-	-
一 有限公		1X	01-10	00.00			U	.18		
·	7969									
广发证	2023	다 지 사	2022	1505			2.2			
券股份	0111	晶科能	2023-	15,96	1,000.00	14	3.2	26.95	-	-
有限公	0002	源	01-11	0.00	•		0			
司	4883									
广发证	2023			6,054						
券股份	0112	中微公	2023-	,250.	61,000.00	14	3.2	9,686	_	_
有限公	0001	司	01-12	00	01,000.00		0	.80		
司	2641			00						
广发证	2023									
券股份	0113	容百科	2023-	586,4	8,000.00	14	3.1	858.4	_	_
有限公	0000	技	01-13	00.00	0,000.00	14	0	2	_	_
司	9384									
广发证	2023									
券股份	0117	金山办	2023-	304,5	1 100 00	1.4	3.2	379.0		
有限公	0002	公	01-17	90.00	1,100.00	14	0	5	-	-
司	8001									
广发证	2023									
券股份	0117	大全能	2023-	295,6	6.000.00	1.4	3.2	367.8		
有限公	0002	源	01-17	20.00	6,000.00	14	0	8	-	-
司	8035									
广发证	2023									
券股份	0118	芯原股	2023-	373,8			3.1	450.7		
有限公	0001	份	01-18	75.00	7,500.00	14	0	3	-	-
司	3755									
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0118	晶晨股	2023-	585,3			3.1	705.7		
有限公	0001	份	01-18	75.00	7,500.00	14	0	0	-	-
司	3771	l M	01-10	73.00						
•		工人业	2022	1 211	17 000 00	1./	2.2	1 507		
广发证	2023	天合光	2023-	1,211	17,000.00	14	3.2	1,507	-	-

券股份	0119	能	01-19	,250.			0	.33		
有限公	0000			00						
司	1074									
广发证	2023			1 206						
券股份	0119	中微公	2023-	1,296	11,900.00	14	3.2	1,613		
有限公	0000	司	01-19	,267. 00	11,900.00	14	0	.13	-	-
司	1083			00						
广发证	2023			2,801						
券股份	0119	沪硅产	2023-	1	148,700.0	14	3.2	3,486		
有限公	0000	业	01-19	,508. 00	0	14	0	.32	-	-
司	1087			00						
广发证	2023									
券股份	0119	大全能	2023-	498,5	10,000.00	14	3.5	678.5		
有限公	0001	源	01-19	00.00	10,000.00	14	0	1	-	-
司	5072									
广发证	2023									
券股份	0119	大全能	2023-	254,2	5,100.00	14	3.2	316.3		
有限公	0001	源	01-19	35.00	3,100.00	14	0	8	-	-
司	5074									
广发证	2023									
券股份	0120	中微公	2023-	325,0	3,000.00	14	3.2	404.5		
有限公	0000	司	01-20	50.00	3,000.00	14	0	1	-	-
司	0464									
广发证	2023			1,392						
券股份	0120	九号公	2023-	,148.	43,600.00	14	3.2	1,732	_	_
有限公	0000	司	01-20	00	43,000.00	14	0	.45	-	-
司	0466			00						
广发证	2023			2,577						
券股份	0120	晶晨股	2023-	,520.	31,900.00	14	3.2	3,207	_	_
有限公	0000	份	01-20	00	31,700.00	14	0	.58	_	_
司	0468			00						
广发证	2023			1,419						
券股份	0130	金山办	2023-	,776.	4,700.00	14	3.2	1,766	_	_
有限公	0000	公	01-30	00	.,,,,,,,,,,,	1	0	.83		
司	1624									
广发证	2023									
券股份	0130	奇安信	2023-	502,2	6,200.00	14	3.2	624.9	_	_
有限公	0000		01-30	00.00	-,-00.00		0	6		
司	1664									
广发证	2023									
券股份	0130	澜起科	2023-	598,4	10,000.00	14	3.2	744.6	_	_
有限公	0008	技	01-30	00.00			0	8		
司	4319									
广发证	2023	容百科	2023-	620,4	8,000.00	14	3.1	747.9	_	_
券股份	0130	技	01-30	00.00	2,220.00	- •	0	3		

有限公	0008		1							
<b>有限公</b> 司	4485									
广发证										
	2023	十人此	2022	40.22			2.2			
券股份	0130	大全能	2023-	49,23	1,000.00	14	3.2	61.26	-	-
有限公司	0009	源	01-30	0.00			0			
司	3513									
广发证	2023	EL STAN								
券股份	0130	晶科能	2023-	15,30	1,000.00	14	3.2	19.04	-	-
有限公	0010	源	01-30	0.00	,		0			
司	0671									
广发证	2023									
券股份	0131	奇安信	2023-	234,2	3,000.00	14	3.2	291.5	_	_
有限公	0000	13 A III	01-31	40.00	3,000.00	11	0	0		
司	3044									
广发证	2023			2,538						
券股份	0131	中微公	2023-	,338.	24,200.00	14	3.2	3,158		
有限公	0000	司	01-31	,336.	24,200.00	14	0	.82	-	-
司	3048			00						
广发证	2023									
券股份	0131	传音控	2023-	265,1	2 100 00	1.4	3.2	329.9		
有限公	0000	股	01-31	43.00	3,100.00	14	0	6	-	-
司	3050									
广发证	2023									
券股份	0131	芯原股	2023-	159,4	2 000 00	1.4	3.2	198.4		
有限公	0000	份	01-31	71.00	2,900.00	14	0	5	-	-
司	3052									
广发证	2023									
券股份	0131	→ -b /→	2023-	217,3			3.2	270.4		
有限公	0000	寒武纪	01-31	50.00	3,500.00	14	0	8	-	-
司	3056									
广发证	2023									
券股份	0131	沪硅产	2023-	847,7			3.2	1,054		
有限公	0000	业	01-31	28.00	40,600.00	14	0	.95	-	-
司	3058									
广发证	2023									
券股份	0131	大全能	2023-	293,8			3.2	365.6		
有限公	0002	源	01-31	20.00	6,000.00	14	0	4	-	-
司	2591	V/4N		20.00						
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0202	晶晨股	2023-	742,1			3.2	923.5		
有限公	0000	份	02-02	40.00	9,300.00	14	0	5	-	-
司	0911	נע	02-02	70.00						
广发证	2023									
→ 及证 参股份	0202	中微公	2023-	882,3	8,100.00	14	3.2	1,098	_	_
有限公	0000	司	02-02	33.00	0,100.00	14	0	.01	_	-
有K公	UUUU									

司	0913									
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0202	九号公	2023-	44,52			3.2			
有限公	0000	司	02-02	•	1,300.00	14	0	55.41	-	-
司	0915	11	02-02	5.00			0			
广发证	2023	-1- /dd. 7\	2022	1,296				1 -10		
券股份	0202	中微公	2023-	,267.	11,900.00	14	3.2	1,613	-	-
有限公司	0001	司	02-02	00			0	.13		
司	3039									
广发证	2023	1 4 61								
券股份	0202	大全能	2023-	257,9	5,100.00	14	3.2	321.0	_	_
有限公	0001	源	02-02	58.00	,		0	1		
司	3131									
广发证	2023			1,150						
券股份	0202	天合光	2023-	,390.	17,000.00	14	3.2	1,431	_	_
有限公	0001	能	02-02	00	17,000.00	11	0	.60		
司	3217			00						
广发证	2023			3,104						
券股份	0202	沪硅产	2023-	,856.	148,700.0	14	3.2	3,863		
有限公	0001	业	02-02	,850.	0	14	0	.82	-	-
司	3237			00						
广发证	2023									
券股份	0202	大全能	2023-	505,8	10 000 00	1.4	3.5	688.4		
有限公	0001	源	02-02	00.00	10,000.00	14	0	5	-	-
司	3317									
广发证	2023									
券股份	0203		2023-	785,9	• 000 00		3.2	978.1		
有限公	0000	固德威	02-03	80.00	2,000.00	14	0	1	-	-
司	1011									
广发证	2023									
券股份	0203	晶晨股	2023-	145,6			3.2	181.2		
有限公	0000	份	02-03	74.00	1,800.00	14	0	8	-	-
司	1020									
广发证	2023									
券股份	0203		2023-	291,5			3.2	362.8		
有限公	0000	寒武纪	02-03	51.00	4,100.00	14	0	2	-	-
司	1022			.,,						
广发证	2023									
券股份	0203	君实生	2023-	573,0			3.1	1,381		
有限公	0000	物	02-03	00.00	10,000.00	28	0	.57	-	-
司	8866	1/2	2 03	33.30				,		
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0203	中微公	2023-	324,6			3.2	403.9		
有限公	0000	司	02-03	00.00	3,000.00	14	0	5	-	-
司	9896	[ ]	02 03	00.00						
н	7070		<u>I</u>				1	]		

					T				T	
广发证	2023			1,477						
券股份	0203	九号公	2023-		12 (00 00	1.4	3.2	1,838		
有限公	0000	司	02-03	,168.	43,600.00	14	0	.25	-	-
司	9898			00						
广发证	2023									
券股份	0203	晶晨股	2023-	2,581			3.2	3,212		
有限公	0000	份	02-03	,667.	31,900.00	14	0	.74	-	-
司	9906	1/1	02-03	00			0	./4		
广发证	2023	A 1 1.		1,362						
券股份	0213	金山办	2023-	,624.	4,700.00	14	3.2	1,695	-	-
有限公	0006	公	02-13	00			0	.71		
司	8010									
广发证	2023									
券股份	0213	大全能	2023-	47,82	1,000.00	14	3.2	59.51	_	_
有限公	0007	源	02-13	0.00	1,000.00	14	0	37.31	_	
司	7646									
广发证	2023									
券股份	0213	容百科	2023-	621,7	0.000.00		3.1	749.5		
有限公	0007	技	02-13	60.00	8,000.00	14	0	7	-	-
司	7672									
广发证	2023									
券股份	0213	澜起科	2023-	628,5			3.2	782.1		
有限公	0008	技	02-13	00.00	10,000.00	14	0	3	-	-
司	4620	100	02-13	00.00				3		
广发证	2023									
			2022	220.2			2.0	205.4		
券股份	0214	奇安信	2023-	229,3	3,000.00	14	3.2	285.4	-	-
有限公	0002		02-14	80.00			0	5		
司	1539									
广发证	2023									
券股份	0214	传音控	2023-	273,2	3,100.00	14	3.2	340.1	_	_
有限公	0002	股	02-14	96.00	3,100.00	11	0	0		
司	1541									
广发证	2023									
券股份	0214	芯原股	2023-	179,8	2,900.00	1 /	3.2	223.7		
有限公	0002	份	02-14	29.00	2,900.00	14	0	9	-	-
司	1543									
广发证	2023									
券股份	0214		2023-	299,1			3.2	372.3		
有限公	0002	寒武纪	02-14	80.00	3,500.00	14	0	1	-	-
司	1545							_		
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0214	大全能	2023-	286,2			3.2	356.1		
有限公	0002	八王 R   源	02-14	00.00	6,000.00	14	0	6	-	-
<b>有限公</b> 司		<i>1</i> /57	02-14	00.00			0	U		
	1601	8 B 8 8 8	2022	771 0	0.200.00	1.4	2.2	0.60.5		
广发证	2023	晶晨股	2023-	771,9	9,300.00	14	3.2	960.5	-	-

券股份	0216	份	02-16	00.00			0	9		
有限公	0001									
司	4903									
广发证	2023			1.005						
券股份	0216	天合光	2023-	1,085	17,000,00	1.4	3.2	1,350		
有限公	0001	能	02-16	,280.	17,000.00	14	0	.57	-	-
司	4965			00						
广发证	2023									
券股份	0217	容百科	2023-	495,2	6 000 00	1.4	3.2	616.3		
有限公	0000	技	02-17	44.00	6,800.00	14	0	0	-	-
司	1474									
广发证	2023									
券股份	0217	海光信	2023-	682,8	1 4 100 00	1.4	3.2	849.7		
有限公	0000	息	02-17	63.00	14,100.00	14	0	9	-	-
司	1479									
广发证	2023									
券股份	0217	芯原股	2023-	124,6	2 100 00	1.4	3.2	155.1		
有限公	0000	份	02-17	98.00	2,100.00	14	0	8	-	-
司	1483									
广发证	2023									
券股份	0217	田地油	2023-	260,1	1 000 00	1.4	3.2	323.7		
有限公	0000	思瑞浦	02-17	50.00	1,000.00	14	0	4	-	-
司	1495									
广发证	2023			2,642						
券股份	0217	晶晨股	2023-		31,900.00	14	3.2	3,288		
有限公	0001	份	02-17	,277. 00	31,900.00	14	0	.17	-	-
司	9496			00						
广发证	2023									
券股份	0217	固德威	2023-	716,7	2,000.00	14	3.2	891.9		
有限公	0001	凹心风	02-17	60.00	2,000.00	14	0	7	_	-
司	9576									
广发证	2023									
券股份	0217	寒武纪	2023-	328,0	4,100.00	14	3.2	408.1	_	_
有限公	0001	~ INV	02-17	00.00	1,100.00	11	0	8		
司	9578									
广发证	2023									
券股份	0220	思瑞浦	2023-	265,0	1,000.00	14	3.2	329.7	_	_
有限公	0000	٠٠٠ با ١١ به با ١٠٠٠	02-20	00.00	2,500.00	1.	0	8		
司	1510									
广发证	2023									
券股份	0220	海尔生	2023-	99,32	1,300.00	14	3.2	123.6	_	_
有限公	0000	物	02-20	0.00	1,500.00	- 1	0	0		
司	1514									
广发证	2023	海光信	2023-	684,8	13,700.00	14	3.2	852.2	_	_
券股份	0221	息	02-21	63.00	12,, 30,00	- 1	0	7		

有限公	0000									
司	0776									
广发证	2023									
→ 及 址 → 券 股 份	0222	晶晨股	2023-	203,4			3.2	253.1		
					2,400.00	14			-	-
有限公司	0000	份	02-22	24.00			0	5		
司	0798									
广发证	2023	-H- EZ: HH	2022	1,005						
券股份	0222	芯原股	2023-	,648.	16,400.00	14	3.2	1,251	-	-
有限公	0000	份	02-22	00			0	.47		
司	0802									
广发证	2023									
券股份	0222	海尔生	2023-	77,00	1,000.00	14	3.2	95.82	_	_
有限公	0000	物	02-22	0.00	1,000.00		0	70.02		
司	0804									
广发证	2023									
券股份	0224	康希诺	2023-	429,7	3,200.00	14	3.2	534.7	_	_
有限公	0000	/ACTIONE	02-24	28.00	3,200.00	14	0	7		
司	0763									
广发证	2023									
券股份	0227	容百科	2023-	576,8	8,000.00	14	3.1	695.3		
有限公	0005	技	02-27	00.00	8,000.00	14	0	6	-	-
司	7964									
广发证	2023									
券股份	0227	澜起科	2023-	580,0	10 000 00	1.4	3.2	721.7		
有限公	0006	技	02-27	00.00	10,000.00	14	0	8	-	-
司	0180									
广发证	2023									
券股份	0228	君实生	2023-	248,1	4.700.00	1.4	3.5	337.7		
有限公	0000	物	02-28	60.00	4,700.00	14	0	7	-	-
司	1103									
广发证	2023									
券股份	0228		2023-	293,8			3.2	365.7		
有限公	0002	寒武纪	02-28	95.00	3,500.00	14	0	4	-	-
司	6146									
广发证	2023									
券股份	0302	晶晨股	2023-	716,5			3.2	891.7		
有限公	0001	份	03-02	65.00	9,300.00	14	0	3	-	-
司	1533	174	05 02	05.00						
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0302	天合光	2023-	1,004			3.2	1,249		
有限公	0001	能	03-02	,360.	17,000.00	14	0	.87	-	-
司	5461	HE	03-02	00				.07		
广发证	2023									
→ 及址 → 券股份	0303	容百科	2023-	472,9	6,800.00	14	3.2	588.5		
		技	03-03	40.00	0,000.00	14	0	5	-	-
有限公	0000						1			

司	9479									
广发证	2023									
券股份	0303		2023-	257,7			3.2	320.6		
有限公	0000	思瑞浦	03-03	00.00	1,000.00	14	0	9	-	-
司	9487		03-03	00.00			U			
	2023									
广发证		开办出	2022	5240			2.1	1.065		
券股份	0303	君实生	2023-	524,9	10,000.00	28	3.1	1,265	-	-
有限公司	0000	物	03-03	00.00			0	.59		
司	9551									
广发证	2023		2022	2,443				2010		
券股份	0303	晶晨股	2023-	,540.	31,900.00	14	3.2	3,040	-	-
有限公	0000	份	03-03	00			0	.85		
司	9621									
广发证	2023									
券股份	0303	固德威	2023-	722,4	2,000.00	14	3.2	899.0	_	-
有限公	0000	, , , , , , , ,	03-03	60.00	,		0	6		
司	9631									
广发证	2023									
券股份	0306	思瑞浦	2023-	259,0	1,000.00	14	3.2	322.3	_	_
有限公	0001	いいと同れ出	03-06	00.00	1,000.00	14	0	1		
司	6399									
广发证	2023									
券股份	0308	晶晨股	2023-	177,8	2,400.00	14	3.2	221.3		
有限公	0000	份	03-08	40.00	2,400.00	14	0	1	-	-
司	5418									
广发证	2023									
券股份	0313	澜起科	2023-	555,2	10 000 00	1.4	3.2	690.9		
有限公	0005	技	03-13	00.00	10,000.00	14	0	2	-	-
司	1290									
广发证	2023									
券股份	0313	容百科	2023-	546,8	0.000.00	1.4	3.1	659.2		
有限公	0006	技	03-13	80.00	8,000.00	14	0	9	-	-
司	5688									
广发证	2023									
券股份	0314	君实生	2023-	237,5	4.500.00		3.5	323.3		
有限公	0002	物	03-14	85.00	4,700.00	14	0	8	-	-
司	2870									
广发证	2023									
券股份	0314		2023-	360,1			3.2	448.1		
有限公	0002	寒武纪	03-14	15.00	3,500.00	14	0	4	-	-
司	2874									
广发证	2023									
券股份	0316	天合光	2023-	917,8			3.2	1,142		
有限公	0001	能	03-16	30.00	17,000.00	14	0	.19	-	-
司	4970	,,,,,		20.00						
۱-,	7710						<u> </u>			

		1	ı				1	1		
广发证	2023			2,390						
券股份	0317	晶晨股	2023-		21 000 00	1.4	3.2	2,974		
有限公	0001	份	03-17	,586.	31,900.00	14	0	.95	-	-
司	1181			00						
广发证	2023									
券股份	0317		2023-	616,0			3.2	766.5		
有限公	0001	固德威	03-17	00.00	2,000.00	14	0	8	-	-
司	1197		00 17	00.00						
广发证	2023									
券股份	0322	晶晨股	2023-	200,6			3.2	267.5		
有限公	0000	份	03-22	40.00	2,400.00	14	0	207.3	-	-
司		707	03-22	40.00			0	2		
	7643									
广发证	2023	生业片	2022	1,006			2.2	1 252		
券股份	0323	海光信	2023-	,240.	15,200.00	14	3.2	1,252	-	-
有限公	0000	息	03-23	00			0	.21		
司	1276									
广发证	2023			2,852						
券股份	0324	芯原股	2023-	,030.	30,700.00	14	3.2	3,549	_	_
有限公	0000	份	03-24	00	20,700.00	11	0	.19		
司	0633			00						
广发证	2023									
券股份	0327	金山办	2023-	391,3	1 000 00	1.4	3.2	487.0		
有限公	0000	公	03-27	70.00	1,000.00	14	0	4	-	-
司	1292									
广发证	2023			1.2.10						
券股份	0327	传音控	2023-	1,249			3.2	1,554		
有限公	0000	股	03-27	,502.	11,800.00	14	0	.94	-	-
司	1294	,,,,		00						
广发证	2023									
券股份	0327	澜起科	2023-	685,9			3.2	853.5		
有限公	0005	技	03-27	00.00	10,000.00	14	0	6	-	-
司	8033	100	03 27	00.00						
广发证	2023									
→ 及业 参股份	0327	容百科	2023-	570,1			3.1	687.3		
	0005	谷日科   技	03-27	60.00	8,000.00	14	0	6	-	-
有限公司		1)	03-27	00.00			"	U		
	8289									
广发证	2023	人工工	2022	561.4				c00 c		
券股份	0328	金山办	2023-	561,4	1,400.00	14	3.2	698.6	-	-
有限公	0000	公	03-28	14.00			0	5		
司	1830									
广发证	2023									
券股份	0328	传音控	2023-	563,5	5,700.00	14	3.2	701.2	_	_
有限公	0000	股	03-28	02.00	5,700.00	17	0	5		
司	1832									
广发证	2023	芯原股	2023-	262,3	2,800.00	14	3.2	326.4	-	-

券股份	0328	份	03-28	04.00			0	2		
有限公	0000									
司	1834									
广发证	2023									
券股份	0328	安	2023-	602,0	2.500.00	1.4	3.2	749.1		
有限公	0001	寒武纪	03-28	00.00	3,500.00	14	0	6	-	-
司	9673									
广发证	2023									
券股份	0328	君实生	2023-	230,7	4.700.00	1.4	3.5	314.1		
有限公	0002	物	03-28	70.00	4,700.00	14	0	0	-	-
司	2873									
广发证	2023									
券股份	0330	大小片	2023-	258,1	2 000 00	1.4	3.2	321.2		
有限公	0000	奇安信	03-30	34.00	3,800.00	14	0	3	-	-
司	1700									
广发证	2023			2 255						
券股份	0330	传音控	2023-	3,355	24 200 00	1.4	3.2	4,175		
有限公	0000	股	03-30	,020.	34,200.00	14	0	.14	-	-
司	1708			00						
广发证	2023									
券股份	0330	天合光	2023-	871,7	17 000 00	1.4	3.2	1,084		
有限公	0001	能	03-30	60.00	17,000.00	14	0	.86	-	-
司	4815									
广发证	2023									
券股份	0331	君实生	2023-	480,4	10,000.00	28	3.1	1,158		
有限公	0001	物	03-31	00.00	10,000.00	20	0	.30	-	-
司	2047									
广发证	2023			2,683						
券股份	0331	晶晨股	2023-	,428.	31,900.00	14	3.2	3,339	_	_
有限公	0001	份	03-31	00	31,700.00	14	0	.38	_	
司	2055			00						
广发证	2023									
券股份	0331	固德威	2023-	578,9	2,000.00	14	3.2	720.4	_	_
有限公	0001		03-31	00.00	_,500.00	1	0	1		
司	2057									
广发证	2023	,		1,385						
券股份	0403	九号公	2023-	,685.	37,100.00	14	3.2	1,724	-	_
有限公	0000	司	04-03	00	,		0	.41		
司	1229						-			
广发证	2023	· ·								
券股份	0406	晶晨股	2023-	224,4	2,400.00	14	3.2	279.3	-	_
有限公	0001	份	04-06	48.00	,,		0	1		
司	3500	16 it is								
广发证	2023	海光信	2023-	1,234	15,200.00	14	3.2	1,536	-	-
券股份	0406	息	04-06	,696.	,		0	.51		

有限公	0001			00						
司	3978									
广发证	2023									
券股份	0407	* * !	2023-	733,7	0.500.00	1.4	3.2	913.1		
有限公	0000	奇安信	04-07	80.00	9,500.00	14	0	5	-	-
司	0820									
广发证	2023			1.015						
券股份	0407	田工山、土	2023-	1,015	2 (00 00	1.4	3.2	1,264		
有限公	0000	思瑞浦	04-07	,920.	3,600.00	14	0	.26	-	-
司	0833			00						
广发证	2023			2 251						
券股份	0407	芯原股	2023-	3,351	20.700.00	14	3.2	4,170		
有限公	0000	份	04-07	,212. 00	30,700.00	14	0	.40	-	-
司	8261			00						
广发证	2023			1,199						
券股份	0410	思瑞浦	2023-	,264.	4,400.00	14	3.2	1,492		
有限公	0000	心圳拥	04-10	00	4,400.00	14	0	.42	-	-
司	4198			00						
广发证	2023									
券股份	0410	金山办	2023-	423,0	1,000.00	14	3.2	526.4	_	_
有限公	0005	公	04-10	00.00	1,000.00	14	0	0	_	_
司	0551									
广发证	2023			1,321						
券股份	0410	传音控	2023-	,600.	11,800.00	14	3.2	1,644	_	_
有限公	0005	股	04-10	00	11,000.00	11	0	.66		
司	0553									
广发证	2023									
券股份	0410	容百科	2023-	576,6	8,000.00	14	3.1	695.1	-	_
有限公	0006	技	04-10	40.00			0	7		
司	0039									
广发证	2023	公司 キュイオ	2022	717 ^				002.2		
券股份	0410	瀬起科	2023-	717,0	10,000.00	14	3.2	892.2	-	-
有限公司	0006	技	04-10	00.00			0	7		
司	0051									
广发证	2023	山井田	2022	0617			2.0	1.076		
券股份	0411	中芯国	2023-	864,7	14,800.00	14	3.2	1,076	-	-
有限公司	0000 3531	际	04-11	64.00			0	.15		
广发证										
ラ	2023 0411	金山办	2023-	603,8			3.2	751.4		
有限公	0001	金田外公	04-11	20.00	1,400.00	14	0	2	-	-
一 有限公	7602	- A	04-11	20.00						
广发证	2023									
→ 及证 参股份	0411	芯原股	2023-	268,8	2,800.00	14	3.2	334.5	_	_
有限公	0001	份	04-11	56.00	2,000.00	17	0	8	_	-
H MX A	0001						<u> </u>			

司	7604									
广发证	2023									
券股份	0411	君实生	2023-	241,2			3.5	328.4		
有限公	0001	物	04-11	98.00	4,700.00	14	0	3	-	-
司	7626	123	04 11	70.00						
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0411	传音控	2023-	649,4			3.2	808.2		
有限公	0001	股	04-11	58.00	5,700.00	14	0	1	-	-
司	7878	/JX	04-11	30.00				1		
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0413	传音控	2023-	3,724			3.2	4,634		
有限公	0001	股	04-13	,380.	34,200.00	14	0	.78	-	-
司	8061	JJX	04-13	00				.76		
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0414	晶晨股	2023-	2,926			3.2	3,641		
有限公	0000	份	04-14	,506.	31,900.00	14	0	.87	-	-
司	8129	101	04-14	00				.07		
广发证	2023									
→ 及 址 → 券 股 份	0414		2023-	558,1			3.2	694.6		
有限公	0000	固德威	04-14	80.00	2,000.00	14	0	2	-	-
<b>有限公</b> 司			04-14	80.00			0	2		
	8131									
广发证	2023 0418	工去到	2023-	05.00			3.2	1262		
券股份 有限公		大奈科 技	04-18	95,90	1,400.00	14	0	136.3	-	-
<b>有限公</b> 司	0000 5246	111	04-18	0.00			0	9		
	2023									
广发证 券股份	0420	日昌匹	2022	226.2			3.2	2016		
		晶晨股 火	2023-	226,3	2,400.00	14		281.6	-	-
有限公司	0001	份	04-20	20.00			0	4		
	3835									
广发证	2023	海业层	2022	1,478			2.0	1 0 4 0		
券股份	0420	海光信	2023-	,960.	15,200.00	14	3.2	1,840	-	-
有限公司	0001	息	04-20	00			0	.48		
司	3847									
广发证	2023	工去到	2022	71.00			2.0			
券股份	0421	天奈科	2023-	71,00	1,300.00	14	3.2	88.36	-	-
有限公司	0000	技	04-21	6.00			0			
司	2102									
广发证	2023		2022	6460				004.0		
券股份	0421	奇安信	2023-	646,0	9,500.00	14	3.2	804.0	-	-
有限公司	0000		04-21	95.00			0	3		
司	7033									
广发证	2023		2022	0.00			2.2	1.004		
券股份	0421	思瑞浦	2023-	868,9	3,600.00	14	3.2	1,081	-	-
有限公司	0000		04-21	68.00			0	.38		
司	7035									

	ı	I	ı	ı	T	T	1	ı		
广发证	2023			2,784						
券股份	0421	芯原股	2023-	,183.	30,700.00	14	3.2	3,464	_	_
有限公	0000	份	04-21	00	30,700.00	14	0	.76	_	_
司	7093			00						
广发证	2023									
券股份	0424	沪硅产	2023-	159,1	6.700.00	1.4	3.2	198.1		
有限公	0000	业	04-24	92.00	6,700.00	14	0	1	-	-
司	4663									
广发证	2023									
券股份	0424	中国通	2023-	120,9			3.2	150.5		
有限公	0000	号	04-24	89.00	18,700.00	14	0	6	-	-
司	4672		0.2.	05.00						
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0424	容百科	2023-	519,2			3.1	625.9		
有限公	0001	技	04-24	00.00	8,000.00	14	0	2	-	-
司		112	04-24	00.00			U	2		
	0565									
广发证	2023	公口 ナコイイ	2022	602.0				061.1		
券股份	0424	澜起科	2023-	692,0	10,000.00	14	3.2	861.1	-	-
有限公	0004	技	04-24	00.00			0	6		
司	1627									
广发证	2023			1,237						
券股份	0424	传音控	2023-	,584.	11,800.00	14	3.2	1,540	_	_
有限公	0005	股	04-24	00	11,000.00	11	0	.10		
司	8001			00						
广发证	2023									
券股份	0425	芯原股	2023-	243,4	2,800.00	14	3.2	302.9		
有限公	0005	份	04-25	60.00	2,800.00	14	0	7	-	-
司	4619									
广发证	2023									
券股份	0425	传音控	2023-	580,7			3.2	722.7		
有限公	0005	股	04-25	73.00	5,700.00	14	0	4	-	-
司	6521									
广发证	2023									
券股份	0425	君实生	2023-	235,1			3.5	320.1		
有限公	0005	物	04-25	88.00	4,700.00	14	0	2	-	-
司	7477	1/3	0.20							
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0425	中芯国	2023-	908,2			3.2	1,130		
有限公	0005	<sup>下心園</sup>   际	04-25	76.00	14,800.00	14	0	.30	-	-
司	8973	۱۳۷۱	04-23	70.00				.50		
广发证	2023	十人孙	2022	40.60			2.0			
券股份	0426	大全能	2023-	49,69	1,100.00	14	3.2	61.85	-	-
有限公司	0000	源	04-26	8.00			0			
司	2954									
广发证	2023	天奈科	2023-	53,09	1,000.00	14	3.2	66.07	-	1

券股份	0426	技	04-26	0.00			0			
有限公	0000									
司	2970									
广发证	2023			2.210						
券股份	0426	澜起科	2023-	3,210	<b>7</b> 0 000 00	1.4	3.0	3,745		
有限公	0000	技	04-26	,000.	50,000.00	14	0	.00	-	-
司	2992			00						
广发证	2023									
券股份	0427	天奈科	2023-	70,16	1 200 00	1.4	3.2	07.21		
有限公	0000	技	04-27	1.00	1,300.00	14	0	87.31	-	-
司	5798									
广发证	2023			2 447						
券股份	0427	传音控	2023-	3,447	24 200 00	1.4	3.2	4,290		
有限公	0001	股	04-27	,360.	34,200.00	14	0	.05	-	-
司	5166			00						
广发证	2023									
券股份	0428	长远锂	2023-	31,13	2 000 00	14	3.2	38.75		
有限公	0000	科	04-28	6.00	2,800.00	14	0	36.73	-	-
司	3946									
广发证	2023									
券股份	0428	天奈科	2023-	64,65	1,200.00	14	3.2	80.46		
有限公	0000	技	04-28	6.00	1,200.00	14	0	80.40	-	-
司	4105									
广发证	2023									
券股份	0428	君实生	2023-	527,8	10,000.00	14	37.	7,676	_	_
有限公	0001	物	04-28	00.00	10,000.00	17	40	.56		
司	0396									
广发证	2023			2,669						
券股份	0428	晶晨股	2023-	,073.	31,900.00	14	3.2	3,321	_	_
有限公	0001	份	04-28	00	,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,		0	.51		
司	3816									
广发证	2023	1. A 68								
券股份	0504	大全能	2023-	270,9	6,700.00	14	3.2	337.1	-	-
有限公司	0000	源	05-04	48.00			0	8		
司	5055									
广发证	2023	8 <b>8 8</b> 8 8	2022	100 6				2247		
券股份	0504	晶晨股	2023-	188,6	2,400.00	14	3.2	234.7	-	-
有限公司	0004	份	05-04	40.00			0	5		
司	3845									
广发证	2023	工女利	2022	74.27			2.2			
券股份	0504	天奈科	2023-	74,27	1,400.00	14	3.2	92.42	-	-
有限公司	0004	技	05-04	0.00			0			
司	3849	海业片	2022	1 400			2.2	1 742		
广发证	2023	海光信	2023-	1,400	15,200.00	14	3.2	1,743	-	-
券股份	0504	息	05-04	,680.			0	.07		

有限公	0005			00			1			
司	1875			00						
广发证	2023									
→ 及 址 → 券 股 份	0505	芯原股	2023-	2,524			3.2	3,141		
有限公	0001	份 份	05-05	,461.	30,700.00	14	0	.55	-	-
<b>有限公</b> 司	1015	177	03-03	00			0	.33		
广发证										
	2023 0508	シウエキラ	2022	152.2			2.2	190 5		
券股份		沪硅产	2023-	152,2	6,700.00	14	3.2	189.5	-	-
有限公司	0000	业	05-08	91.00			0	2		
司	8717									
广发证	2023	क्रें उस्ता	2022	522.1			2.1	642.7		
券股份	0508	容百科	2023-	533,1	8,000.00	14	3.1	642.7	-	-
有限公司	0001	技	05-08	20.00			0	1		
司	2031									
广发证	2023	나무>>	2022	1160				1 4 4 =		
券股份	0508	中国通	2023-	116,3	18,700.00	14	3.2	144.7	-	-
有限公	0001	号	05-08	14.00			0	5		
司	2033									
广发证	2023	11 -3-15		1,362						
券股份	0508	传音控	2023-	,900.	11,800.00	14	3.2	1,696	_	-
有限公	0001	股	05-08	00	,		0	.05		
司	3877									
广发证	2023									
券股份	0508	澜起科	2023-	594,1	10,000.00	14	3.2	739.3	_	_
有限公	0005	技	05-08	00.00	- 0,000000		0	2		
司	3079									
广发证	2023			2,893						
券股份	0509	澜起科	2023-	,500.	50,000.00	14	3.1	3,488	_	_
有限公	0000	技	05-09	00	20,000.00		0	.28		
司	3652									
广发证	2023									
券股份	0509	大全能	2023-	50,27	1,300.00	14	3.1	60.60	_	_
有限公	0000	源	05-09	1.00	1,500.00	1	0	55.50		
司	3720									
广发证	2023									
券股份	0509	中芯国	2023-	781,1	14,800.00	14	3.2	972.0	_	_
有限公	0001	际	05-09	44.00	17,000.00	17	0	9	_	_
司	2537									
广发证	2023									
券股份	0509	君实生	2023-	238,2	4,700.00	14	3.5	324.3		
有限公	0002	物	05-09	90.00	4,700.00	14	0	4	-	-
司	6289									
广发证	2023	サ西肌	2022	2240			2.2	270 7		
券股份	0509	芯原股	2023-	224,0	2,800.00	14	3.2	278.7	-	-
有限公	0002	份	05-09	00.00			0	6		

司	6505									
广发证	2023									
券股份	0509	传音控	2023-	679,4			3.2	845.5		
有限公	0002	股	05-09	40.00	5,700.00	14	0	3	-	-
司	6525	/100	03 07	40.00						
广发证	2023									
券股份	0510	三一重	2023-	352,3			3.1	424.8		
有限公	0000	一	05-10	89.00	10,100.00	14	0	2	-	-
司	3142	HC	03-10	07.00						
广发证	2023									
券股份	0510	晶晨股	2023-	269,7			3.1	325.1		
有限公	0000	明辰成 份	05-10	30.00	3,700.00	14	0	7	-	-
司		1/3	03-10	30.00			0	/		
广发证	3157 2023									
	0510		2023-	2,824			2.0	2 205		
券股份				,500.	50,000.00	14	3.0	3,295	-	-
有限公司	0002	技	05-10	00			U	.25		
司	1980									
广发证	2023	アナシ	2022	50.26			2.0			
券股份	0510	天奈科	2023-	52,36	1,000.00	14	3.2	65.16	-	-
有限公司	0002	技	05-10	0.00			0			
司	7406									
广发证	2023	14. <del>34. 43.</del>	2022	3,998			2.2	4.07.5		
券股份	0511	传音控	2023-	,322.	34,200.00	14	3.2	4,975	-	-
有限公	0001	股	05-11	00			0	.69		
司	2621									
广发证	2023		2022	21.00			2.1			
券股份	0512	格科微	2023-	21,88	1,400.00	14	3.1	26.38	-	-
有限公	0000		05-12	2.00			0			
司	1787									
广发证	2023	17.17 Am	2022	24.52						
券股份	0512	长远锂	2023-	31,72	2,800.00	14	3.2	39.48	-	-
有限公司	0001	科	05-12	4.00			0			
司	1164									
广发证	2023	g = ***	2025	2,540				0.1.51		
券股份	0512	晶晨股	2023-	,516.	31,900.00	14	3.2	3,161	-	-
有限公司	0001	份	05-12	00			0	.53		
司	1198									
广发证	2023	77.57								
券股份	0512	天奈科	2023-	63,68	1,200.00	14	3.2	79.25	-	-
有限公	0001	技	05-12	4.00	•		0			
司	1246									
广发证	2023									
券股份	0515	华润微	2023-	84,09	1,400.00	14	3.1	101.3	_	_
有限公	0000	1 (14)	05-15	8.00	-,		0	8		
司	2078									

	I	I	1	ı	T	T	ı	ı		
广发证	2023			1,218						
券股份	0515	晶科能	2023-	,639.	101,300.0	14	3.1	1,469	_	_
有限公	0000	源	05-15	00	0	11	0	.14		
司	2101			00						
广发证	2023									
券股份	0518	西部超	2023-	84,40	1 000 00	1.4	3.1	101.7		
有限公	0000	导	05-18	0.00	1,000.00	14	0	5	-	-
司	2811									
广发证	2023									
券股份	0518	大全能	2023-	39,39			3.1			
有限公	0000	源	05-18	0.00	1,000.00	14	0	47.49	-	-
司	2828									
广发证	2023									
券股份	0518	澜起科	2023-	2,320			3.1	2,796		
有限公	0000	技	05-18	,000.	40,000.00	14	0	.89	-	-
司	2840	3~	05 10	00				.05		
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0518	天奈科	2023-	70,51			3.2			
有限公	0000	技	05-18	8.00	1,400.00	14	0	87.76	-	-
司	7422	111	03-16	8.00			U			
广发证	2023	上人孙	2022	262.0			2.0	220.4		
券股份	0518	大全能	2023-	263,9	6,700.00	14	3.2	328.4	-	-
有限公	0001	源	05-18	13.00			0	3		
司	0120									
广发证	2023	>= 1. D.		1,236						
券股份	0518	海光信	2023-	,216.	15,200.00	14	3.2	1,538	-	_
有限公	0002	息	05-18	00	,		0	.40		
司	3360			00						
广发证	2023									
券股份	0522	沪硅产	2023-	139,9	6,700.00	14	3.2	174.1	_	_
有限公	0001	业	05-22	63.00	0,700.00	14	0	8	_	_
司	1192									
广发证	2023									
券股份	0522	澜起科	2023-	594,1	10,000.00	7	3.2	369.6		
有限公	0001	技	05-22	00.00	10,000.00	,	0	6	-	-
司	9220									
广发证	2023			1.075						
券股份	0522	传音控	2023-	1,375	11 000 00	1.4	3.2	1,711		
有限公	0003	股	05-22	,644.	11,800.00	14	0	.91	-	-
司	2702			00						
广发证	2023									
券股份	0522	容百科	2023-	504,8			3.1	304.2		
有限公	0005	技	05-22	00.00	8,000.00	7	0	8	-	-
司	2618									
广发证	2023	君实生	2023-	182,9	3,600.00	14	3.1	220.5	-	-
/ / <u>/</u> / // // // // // // // // // // // //	2023	ガクエ	2023	102,7	2,000.00	17	5.1	220.3		

券股份	0523	物	05-23	52.00			0	6		
有限公	0000									
司	3540									
广发证	2023			2,885						
券股份	0523	澜起科	2023-		50,000.00	14	3.1	3,478		
有限公	0002	技	05-23	,000.	30,000.00	14	0	.03	-	-
司	2298			00						
广发证	2023									
券股份	0523	传音控	2023-	641,3	5,700.00	14	3.2	798.1		
有限公	0002	股	05-23	64.00	3,700.00	14	0	4	-	-
司	7276									
广发证	2023									
券股份	0523	君实生	2023-	238,8	4,700.00	14	3.5	325.1		
有限公	0002	物	05-23	54.00	4,700.00	14	0	1	-	-
司	7510									
广发证	2023									
券股份	0524	天奈科	2023-	48,05	1,000.00	14	3.2	59.80		
有限公	0000	技	05-24	0.00	1,000.00	14	0	39.80	-	-
司	5172									
广发证	2023									
券股份	0524	晶晨股	2023-	304,8	3,700.00	14	3.1	367.4	_	_
有限公	0001	份	05-24	06.00	3,700.00	14	0	6	_	-
司	4294									
广发证	2023			2,900						
券股份	0524	澜起科	2023-	,000.	50,000.00	14	3.0	3,383	_	_
有限公	0001	技	05-24	00	30,000.00	11	0	.33		
司	9746			00						
广发证	2023			3,934						
券股份	0525	传音控	2023-	,710.	34,200.00	14	3.2	4,896	_	_
有限公	0002	股	05-25	00	,		0	.53		
司	5120									
广发证	2023	T A 4		1,801						
券股份	0526	天合光	2023-	,558.	37,400.00	14	3.2	2,241	-	-
有限公司	0000	能	05-26	00			0	.94		
司	2995									
广发证	2023	ナナか	2022	<b>7</b>						
券股份	0526	天奈科	2023-	56,94	1,200.00	14	3.2	70.86	-	-
有限公司	0001	技	05-26	0.00			0			
司	0837									
广发证	2023	<b>宏石利</b>	2022	166.1			2 1	160.6		
券股份	0529	容百科	2023-	466,4	8,000.00	4	3.1	160.6	-	-
有限公司	0001	技	05-29	80.00			0	8		
司	1522	一手	2022	104.1			2.2	120.6		
广发证	2023	三一重	2023-	104,1	3,100.00	14	3.2	129.6	-	-
券股份	0530	能	05-30	60.00			0	2		

有限公	0001									
司	7268									
广发证	2023									
券股份	0530	天合光	2023-	587,7			3.2	731.3		
有限公	0001	能	05-30	08.00	14,800.00	14	0	731.3	-	-
司	7351	HC.	05-50	00.00				,		
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0531	珠海冠	2023-	222,0			3.2	276.3		
有限公	0000	宇	05-31	54.00	11,900.00	14	0	3	-	-
司	2578	一 丁	03-31	34.00				3		
广发证	2023									
	0601	エヘル	2023-	204.2			3.2	379.7		
券股份		天合光		304,2 00.00	7,800.00	14			-	-
有限公司	0000	能	06-01	00.00			1	4		
司	3118									
广发证	2023		2022	711 0			2.1	057 1		
券股份	0601	寒武纪	2023-	711,0	3,000.00	14	3.1	857.1	-	-
有限公司	0000		06-01	30.00			0	9		
司	3345									
广发证	2023	エナむ	2022	<b>-</b>						
券股份	0601	天奈科	2023-	56,94	1,200.00	12	3.2	60.74	-	-
有限公	0000	技	05-26	0.00			0			
司	6210									
广发证	2023	\_ \t. \		1,326						
券股份	0601	海光信	2023-	,960.	15,200.00	14	3.2	1,651	-	-
有限公	0003	息	06-01	00	,		0	.33		
司	4947									
广发证	2023			2,484						
券股份	0601	澜起科	2023-	,000.	40,000.00	14	3.1	2,994	_	_
有限公	0003	技	06-01	00			0	.60		
司	7454									
广发证	2023									
券股份	0602	西部超	2023-	906,8	11,400.00	14	3.2	1,132	_	_
有限公	0000	导	06-02	70.00	,.50.00		1	.08		
司	2665									
广发证	2023									
券股份	0605	芯原股	2023-	284,8	3,300.00	14	3.2	355.5	_	_
有限公	0000	份	06-05	23.00	2,200.00	1	1	5		
司	2279									
广发证	2023			1,597						
券股份	0605	传音控	2023-	,130.	11,800.00	14	3.2	1,987	_	_
有限公	0002	股	06-05	,130.	11,000.00	17	0	.54	-	-
司	8817			00						
广发证	2023	沪硅产	2023-	30,11			3.2			
券股份	0606	业	06-06	4.00	1,400.00	14	3.2	37.59	-	-
有限公	0000	. ۱۲.	00-00	4.00			1			

司	3290									
广发证	2023									
		エヘル	2022	550.0			2.2	697.6		
券股份 有限公	0606	天合光	2023-	550,8	15,200.00	14	3.2	687.6	-	-
	0000	能	06-06	48.00			1	4		
司	3311									
广发证	2023	7 - 1								
券股份	0606	君实生	2023-	145,9	3,600.00	14	3.1	175.9	-	_
有限公	0001	物	06-06	44.00			0	4		
司	5305									
广发证	2023			2,954						
券股份	0606	澜起科	2023-	,500.	50,000.00	14	3.1	3,561	_	_
有限公	0001	技	06-06	00	30,000.00	11	0	.81		
司	9357			00						
广发证	2023									
券股份	0606	君实生	2023-	190,5	4,700.00	14	3.5	259.3		
有限公	0002	物	06-06	38.00	4,700.00	14	0	4	-	-
司	0314									
广发证	2023									
券股份	0606	传音控	2023-	763,8	<b>7.7</b> 00.00	1.4	3.2	950.5		
有限公	0002	股	06-06	00.00	5,700.00	14	0	1	-	-
司	0838									
广发证	2023									
券股份	0607	纳微科	2023-	49,36			3.2			
有限公	0000	技	06-07	8.00	1,200.00	14	1	61.63	-	-
司	3033									
广发证	2023									
券股份	0607	澜起科	2023-	2,995			3.0	3,494		
有限公	0001	技	06-07	,500.	50,000.00	14	0	.75	-	-
司	6844	100	00 07	00				.73		
广发证	2023									
券股份	0607	晶晨股	2023-	332,6			3.1	401.0		
有限公	0007	份	06-07	67.00	3,700.00	14	0	5	-	-
司	2883	L M	00-07	07.00						
广发证	2023									
ラ	0608	凯赛生	2023-	55 70			2 2			
		跳贲生   物		55,72	1,000.00	14	3.2	89.43	-	-
有限公司	0000	170	06-08	0.00			1			
一司	2788									
广发证	2023	がたるとなり	2022	5.77 A			2.1	000.2		
券股份	0608	派能科	2023-	567,9	3,000.00	14	3.1	880.2	-	-
有限公司	0000	技	06-08	00.00			0	5		
司	2802									
广发证	2023						_			
券股份	0608	西部超	2023-	149,5	1,900.00	14	3.2	240.0	-	-
有限公	0000	导	06-08	30.00	,		1	0		
司	2827									

_	ı	1	ı	1	r	1	1	1		1
广发证	2023			4,529						
券股份	0608	传音控	2023-		24 200 00	1.4	3.2	7,247		
有限公	0002	股	06-08	,790.	34,200.00	14	0	.66	-	-
司	2060			00						
广发证	2023									
券股份	0609	君实生	2023-	312,5			3.2	473.8		
有限公	0000	物	06-09	76.00	7,400.00	14	1	1	-	-
司	2575	1/3	00 07	70.00			1	1		
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0609	天合光	2023-	1,411			3.2	2,133		
	0009		06-09	,850.	37,400.00	14	0		-	-
有限公司		能	06-09	00			U	.46		
司	9615									
广发证	2023	dan leh del								
券股份	0612	翱捷科	2023-	843,8	10,000.00	14	3.2	1,053	-	-
有限公	0003	技	06-12	00.00	,		1	.34		
司	1651									
广发证	2023									
券股份	0612	金山办	2023-	976,0	2,000.00	14	3.1	1,176	_	_
有限公	0003	公	06-12	00.00	2,000.00	14	0	.62	_	_
司	1754									
广发证	2023									
券股份	0612	天岳先	2023-	843,4	11 000 00	1.4	3.2	1,052		
有限公	0003	进	06-12	80.00	11,000.00	14	1	.94	-	-
司	1840									
广发证	2023									
券股份	0613	禾迈股	2023-	338,5			1.7	223.8		
有限公	0001	份	06-13	30.00	1,000.00	14	0	1	-	-
司	1478	1/3	00-13	30.00				1		
广发证	2023									
		芯原股	2022	642.0			1.7	125.0		
券股份	0613		2023-	642,9	7,100.00	14	1.7	425.0	-	-
有限公司	0001	份	06-13	05.00			0	3		
司	1506									
广发证	2023	后日加	2025	217 :				1.10 =		
券股份	0613	复旦微	2023-	217,4	4,000.00	14	1.7	143.7	-	-
有限公	0001	电	06-13	00.00			0	3		
司	1518									
广发证	2023									
券股份	0613	龙芯中	2023-	142,8	1,000.00	14	1.7	94.46	_	_
有限公	0001	科	06-13	80.00	1,000.00	17	0	77.70	-	-
司	1519									
广发证	2023									
券股份	0613	国博电	2023-	72,44	1 000 00	1.4	1.7	47.00		
有限公	0001	子	06-13	0.00	1,000.00	14	0	47.89	-	-
司	1529									
广发证	2023	中控技	2023-	267,3	3,000.00	14	1.7	176.7	-	-
	1		1	<u> </u>	1	l	1	i		

券股份	0613	术	06-13	60.00			0	5		
有限公	0001									
司	1538									
广发证	2023									
券股份	0613	芯原股	2023-	642,9	7 100 00	1.4	1.7	425.0		
有限公	0001	份	06-13	05.00	7,100.00	14	0	3	-	-
司	1557									
广发证	2023									
券股份	0613	国博电	2023-	72,44	1,000.00	14	1.7	47.89		
有限公	0001	子	06-13	0.00	1,000.00	14	0	47.89	-	-
司	1559									
广发证	2023									
券股份	0613	海光信	2023-	533,1	<i>c c</i> 00 00	1.4	1.7	352.4		
有限公	0001	息	06-13	48.00	6,600.00	14	0	7	-	-
司	1560									
广发证	2023									
券股份	0613	天合光	2023-	199,0	<b>5</b> 000 00	1.4	1.7	131.5		
有限公	0001	能	06-13	00.00	5,000.00	14	0	6	-	-
司	1561									
广发证	2023									
券股份	0613	凯赛生	2023-	272,3	<b>5</b> 000 00	1.4	1.7	180.0		
有限公	0001	物	06-13	50.00	5,000.00	14	0	5	-	-
司	1563									
广发证	2023									
券股份	0613	复旦微	2023-	217,4	4,000.00	14	1.7	143.7		
有限公	0001	电	06-13	00.00	4,000.00	14	0	3	-	-
司	1570									
广发证	2023									
券股份	0613	华大智	2023-	99,77	1,100.00	14	1.7	65.96		
有限公	0001	造	06-13	0.00	1,100.00	14	0	03.90	-	-
司	1577									
广发证	2023									
券股份	0613	海光信	2023-	533,1	6,600.00	14	1.7	352.4	_	_
有限公	0001	息	06-13	48.00	0,000.00	17	0	7	_	_
司	1600									
广发证	2023									
券股份	0613	天合光	2023-	398,0	10,000.00	14	1.7	263.1	_	_
有限公	0001	能	06-13	00.00	10,000.00	17	0	2		
司	1601									
广发证	2023									
券股份	0613	禾迈股	2023-	338,5	1,000.00	14	1.7	223.8	_	_
有限公	0001	份	06-13	30.00	1,000.00	17	0	1	-	
司	1602									
广发证	2023	凯赛生	2023-	272,3	5,000.00	14	1.7	180.0	_	_
券股份	0613	物	06-13	50.00	2,000.00	17	0	5		

<b>→</b> #□ /\	0004							1		
有限公司	0001									
司	1604									
广发证	2023									
券股份	0613	西部超	2023-	388,5	5,000.00	14	1.7	256.8	-	-
有限公	0001	导	06-13	00.00	,		0	4		
司	1608									
广发证	2023									
券股份	0613	三一重	2023-	131,8	4,100.00	14	1.7	87.20	_	_
有限公	0001	能	06-13	97.00	4,100.00	14	0	07.20		
司	1610									
广发证	2023									
券股份	0613	中控技	2023-	267,3	2 000 00	1.4	1.7	176.7		
有限公	0001	术	06-13	60.00	3,000.00	14	0	5	-	-
司	1612									
广发证	2023									
券股份	0613	和辉光	2023-	310,5	119,000.0		1.7	205.3		
有限公	0001	电	06-13	90.00	0	14	0	3	-	-
司	1634	_								
广发证	2023									
券股份	0613	天合光	2023-	398,0			1.7	263.1		
有限公	0001	能	06-13	00.00	10,000.00	14	0	2	-	-
司	1635	110	00 13	00.00				_		
广发证	2023									
券股份	0613	禾迈股	2023-	338,5			1.7	223.8		
有限公	0001	份	06-13	30.00	1,000.00	14	0	1	-	-
司	1636	, IVI	00-13	30.00			U	1		
广发证	2023	水冶写	2022	270.7			1.7	251.0		
券股份	0613	珠海冠	2023-	379,7	19,200.00	14	1.7	251.0	-	-
有限公司	0001	宇	06-13	76.00			0	7		
司	1638									
广发证	2023	E About								
券股份	0613	昱能科	2023-	224,6	1,000.00	14	1.7	148.4	-	-
有限公	0001	技	06-13	00.00	,		0	9		
司	1641									
广发证	2023									
券股份	0613	三一重	2023-	131,8	4,100.00	14	1.7	87.20	_	_
有限公	0001	能	06-13	97.00	1,200.00	11	0	07.20		
司	1643									
广发证	2023									
券股份	0613	和辉光	2023-	310,5	119,000.0	14	1.7	205.3		
有限公	0001	电	06-13	90.00	0	14	0	3	_	-
司	1664									
广发证	2023	工人业	2022	100.0			1.7	121.5		
券股份	0613	天合光	2023-	199,0	5,000.00	14	1.7	131.5	-	-
有限公	0001	能	06-13	00.00			0	6		

司	1665									
广发证	2023									
券股份	0613	禾迈股	2023-	338,5			1.7	223.8		
有限公	0001	份	06-13	30.00	1,000.00	14	0	1	-	-
司	1666	Di	00-13	30.00				1		
	2023									
广发证		水岩匀	2022	270.7			1.7	251.0		
券股份	0613	珠海冠	2023-	379,7	19,200.00	14	1.7	251.0	-	-
有限公司	0001	宇	06-13	76.00			0	7		
司	1667									
广发证	2023	ロルバ								
券股份	0613	昱能科	2023-	224,6	1,000.00	14	1.7	148.4	-	-
有限公	0001	技	06-13	00.00			0	9		
司	1670									
广发证	2023									
券股份	0613	华大智	2023-	99,77	1,100.00	14	1.7	65.96	_	_
有限公	0001	造	06-13	0.00	1,100.00	11	0	02.50		
司	1673									
广发证	2023									
券股份	0613	柏楚电	2023-	327,2	1,700.00	14	1.7	216.3		
有限公	0001	子	06-13	50.00	1,700.00	14	0	5	_	-
司	1692									
广发证	2023									
券股份	0613	华熙生	2023-	505,6	<b>5 5</b> 00 00	1.4	1.7	334.3		
有限公	0001	物	06-13	70.00	5,500.00	14	0	0	-	-
司	1693									
广发证	2023									
券股份	0613		2023-	293,0			1.7	193.7		
有限公	0001	奇安信	06-13	00.00	5,000.00	14	0	1	-	-
司	1694									
广发证	2023									
券股份	0613	中无人	2023-	192,7			1.7	127.4		
有限公	0001	机机	06-13	77.00	3,900.00	14	0	5	-	-
司	1699							-		
广发证	2023									
券股份	0613	柏楚电	2023-	327,2			1.7	216.3		
有限公	0001	子	06-13	50.00	1,700.00	14	0	5	-	-
司	1717	,	0015	20.00						
广发证	2023									
→ 及 Ш 参 股 份	0613	华熙生	2023-	505,6			1.7	334.3		
有限公	0001	物	06-13	70.00	5,500.00	14	0	0	-	-
司	1720	1/0	00-13	70.00						
广发证										
	2023		2022	202.0			1 7	102.7		
券股份	0613	奇安信	2023-	293,0	5,000.00	14	1.7	193.7	-	-
有限公司	0001		06-13	00.00			0	1		
司	1723									

	1	1								ı
广发证	2023									
券股份	0613	中无人	2023-	192,7	3,900.00	14	1.7	127.4		
有限公	0001	机	06-13	77.00	3,900.00	14	0	5	-	-
司	1729									
广发证	2023									
券股份	0613	龙芯中	2023-	142,8			1.7			
有限公	0001	科	06-13	80.00	1,000.00	14	0	94.46	-	-
司	1746	, ,	00 10	00.00						
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0613	传音控	2023-	659,4			1.7	435.9		
有限公	0001	股	06-13	00.00	5,000.00	14	0	433.9	-	-
有限公司		刀又	00-13	00.00			U	4		
	1747									
广发证	2023	TT 20 47	2022	200 7				27.0		
券股份	0613	西部超	2023-	388,5	5,000.00	14	1.7	256.8	-	-
有限公	0001	导	06-13	00.00			0	4		
司	1749									
广发证	2023									
券股份	0613	中复神	2023-	79,02	2,300.00	14	1.7	52.25	_	_
有限公	0001	鹰	06-13	8.00	2,300.00	11	0	32.23		
司	1757									
广发证	2023									
券股份	0613	纳芯微	2023-	202,1	1 200 00	1.4	1.7	133.6		
有限公	0001		06-13	40.00	1,200.00	14	0	4	-	-
司	1775									
广发证	2023									
券股份	0613	传音控	2023-	659,4			1.7	435.9		
有限公	0001	股	06-13	00.00	5,000.00	14	0	4	-	-
司	1776	/**	00 10	00.00						
广发证	2023									
券股份	0613	长远锂	2023-	328,0			1.7	216.8		
有限公	0001	科	06-13	75.00	27,500.00	14	0	9	-	-
司	1781	77	00-13	73.00						
,										
广发证	2023	山有洲	2022	70.02			1.7			
券股份	0613	中复神	2023-	79,02	2,300.00	14	1.7	52.25	-	-
有限公司	0001	鹰	06-13	8.00			0			
司	1786									
广发证	2023									
券股份	0613	纳芯微	2023-	202,1	1,200.00	14	1.7	133.6	_	_
有限公	0001	1,7 5 1/2	06-13	40.00	,		0	4		
司	1800									
广发证	2023									
券股份	0613	长远锂	2023-	328,0	27,500.00	14	1.7	216.8	_	_
有限公	0001	科	06-13	75.00	41,500.00	14	0	9	-	_
司	1803									
广发证	2023	联影医	2023-	217,2	1,600.00	14	1.7	143.6	-	-

券股份	0613	疗	06-13	48.00			0	3		
有限公	0001									
司	1806									
广发证	2023									
券股份	0613	联影医	2023-	217,2	1 (00 00	1.4	1.7	143.6		
有限公	0001	疗	06-13	48.00	1,600.00	14	0	3	-	-
司	1823									
广发证	2023									
券股份	0613	天合光	2023-	589,0	14 000 00	1.4	3.2	733.0		
有限公	0002	能	06-13	40.00	14,800.00	14	0	3	-	-
司	1579									
广发证	2023									
券股份	0615	天合光	2023-	328,4	7,000,00	1.4	3.2	410.0		
有限公	0002	能	06-15	58.00	7,800.00	14	1	3	-	-
司	7926									
广发证	2023									
券股份	0615	寒武纪	2023-	633,0	2 000 00	1.4	3.1	763.1		
有限公	0002	<b>泰</b> 既纪	06-15	00.00	3,000.00	14	0	2	-	-
司	7988									
广发证	2023			2.450						
券股份	0615	澜起科	2023-	2,459	40,000,00	1.4	3.1	2,965		
有限公	0002	技	06-15	,600. 00	40,000.00	14	0	.18	-	-
司	8187			00						
广发证	2023			1,151						
券股份	0615	海光信	2023-	,856.	15,200.00	14	3.2	1,433		
有限公	0003	息	06-15	,830.	13,200.00	14	0	.42	-	-
司	1509			00						
广发证	2023			1,782						
券股份	0619	传音控	2023-	,980.	11,800.00	14	3.2	1,743	1,734,600.0	1,743.36
有限公	0002	股	06-19	,980.	11,600.00	14	0	.36	0	1,745.50
司	0498			00						
广发证	2023									
券股份	0620	天合光	2023-	651,7	15,200.00	14	3.2	581.1	647,672.00	581.17
有限公	0003	能	06-20	76.00	15,200.00	1	1	7	017,072.00	551.17
司	0514									
广发证	2023			3,020						
券股份	0620	澜起科	2023-	,000.	50,000.00	14	3.1	2,600	2,871,000.0	2,600.56
有限公	0003	技	06-20	00	2 2,000.00		0	.56	0	_,555.55
司	0865									
广发证	2023									
券股份	0620	传音控	2023-	843,0	5,700.00	14	3.2	749.3	837,900.00	749.36
有限公	0003	股	06-20	30.00	2,		0	6		
司	1752									
广发证	2023	澜起科	2023-	2,904	50,000.00	14	3.0	2,178	2,871,000.0	2,178.00
券股份	0621	技	06-21	,000.	,000.00		0	.00	0	,

有限公	0001			00						
司	5152			00						
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0621	纳微科	2023-	48,80			3.2			
有限公	0001	技	06-21	4.00	1,200.00	14	1	39.17	46,620.00	39.17
司	7679	100	00 21	4.00			1			
广发证	2023									
券股份	0626	传音控	2023-	4,989			3.2	1,773	5,027,400.0	
有限公	0003	股	06-26	,096.	34,200.00	14	0	.90	0	1,773.90
司	7840	/4X	00 20	00				.50	O	
广发证	2023									
券股份	0626	翱捷科	2023-	766,5			3.2	273.3		
有限公	0003	技	06-26	00.00	10,000.00	14	1	9	753,900.00	273.39
司	8676	12	00 20	00.00			1			
广发证	2023									
<b>券股份</b>	0626	金山办	2023-	955,4			3.1	329.0		
有限公	0004	公公	06-26	20.00	2,000.00	14	0	9	944,440.00	329.09
司	0339	4	00 20	20.00						
广发证	2023									
券股份	0626	派能科	2023-	584,4			3.1	201.2		
有限公	0004	技	06-26	00.00	3,000.00	14	0	9	594,750.00	201.29
司	5301	3.2	00 20	00.00						
广发证	2023									
券股份	0626	天合光	2023-	1,614			3.2	574.2	1,593,614.0	
有限公	0004	能	06-26	,932.	37,400.00	14	0	0	0	574.20
司	8547	1,10		00					-	
广发证	2023									
券股份	0627		2023-	297,4			1.7			
有限公	0001	奇安信	06-27	50.00	5,000.00	14	0	42.14	259,050.00	42.14
司	5866									
广发证	2023									
券股份	0627	龙芯中	2023-	134,8			1.7			
有限公	0001	科	06-27	70.00	1,000.00	14	0	19.11	114,790.00	19.11
司	5913									
广发证	2023									
券股份	0627	国博电	2023-	77,76	1 000 00	1.4	1.7	11.02	70.200.00	11.02
有限公	0001	子	06-27	0.00	1,000.00	14	0	11.02	79,200.00	11.02
司	5921									
广发证	2023									
券股份	0627	海光信	2023-	453,5	( (00 00	1 4	1.7	C4.25	450 500 00	64.05
有限公	0001	息	06-27	52.00	6,600.00	14	0	64.25	450,582.00	64.25
司	5931									
广发证	2023	エヘル	2022	420.0			1.7			
券股份	0627	天合光	2023-	420,0	10,000.00	14	1.7	59.50	426,100.00	59.50
有限公	0001	能	06-27	00.00			0			

司	6029									
广发证	2023									
券股份	0627		2023-	297,4			1.7			
有限公	0001	奇安信	06-27	50.00	5,000.00	14	0	42.14	259,050.00	42.14
司	6115		00-27	30.00						
广发证	2023									
		水岩匀	2022	262.6			1.7			
券股份	0627	珠海冠	2023-	363,6	19,200.00	14	1.7	51.52	386,880.00	51.52
有限公司	0001	宇	06-27	48.00			0			
司	6146									
广发证	2023	ملما بحريا با	2022	10.50						
券股份	0627	中控技	2023-	186,2	3,000.00	14	1.7	26.39	188,340.00	26.39
有限公	0001	术	06-27	70.00			0			
司	6147									
广发证	2023									
券股份	0627	三一重	2023-	128,2	4,100.00	14	1.7	18.16	132,102.00	18.16
有限公	0001	能	06-27	07.00	,		0		, , , , , , ,	
司	6167									
广发证	2023									
券股份	0627	昱能科	2023-	180,1	1,000.00	14	1.7	25.52	187,830.00	25.52
有限公	0001	技	06-27	20.00	1,000.00	11	0	25.52	107,050.00	20.02
司	6397									
广发证	2023									
券股份	0627	三一重	2023-	128,2	4,100.00	14	1.7	18.16	132,102.00	18.16
有限公	0001	能	06-27	07.00	4,100.00	14	0	16.10	132,102.00	16.10
司	6467									
广发证	2023									
券股份	0627	中复神	2023-	79,81	2 200 00	1.4	1.7	11 21	94.264.00	11 21
有限公	0001	鹰	06-27	0.00	2,300.00	14	0	11.31	84,364.00	11.31
司	6518									
广发证	2023									
券股份	0627	长远锂	2023-	308,5	27 500 00	1.4	1.7	42.71	200 025 00	40.71
有限公	0001	科	06-27	50.00	27,500.00	14	0	43.71	309,925.00	43.71
司	6646									
广发证	2023									
券股份	0627	禾迈股	2023-	353,2	1 000 00	1.4	1.7	50.04	055 150 00	50.04
有限公	0001	份	06-27	20.00	1,000.00	14	0	50.04	355,150.00	50.04
司	6682									
广发证	2023									
券股份	0627	中无人	2023-	189,1	2 000 00		1.7	2	200.024.00	2:00
有限公	0001	机	06-27	50.00	3,900.00	14	0	26.80	200,031.00	26.80
司	6730									
广发证	2023									
券股份	0627	柏楚电	2023-	330,5			1.7			
有限公	0001	子	06-27	99.00	1,700.00	14	0	46.83	320,552.00	46.83
司	6731									
		l	ı	l		l .		ı		

		T								
广发证	2023									
券股份	0627	西部超	2023-	259,3	5,000.00	14	1.7	36.74	279 650 00	36.74
有限公	0001	导	06-27	50.00	3,000.00	14	0	30.74	278,650.00	30.74
司	6744									
广发证	2023									
券股份	0627	/a-l	2023-	200,4	1 200 00	1.4	1.7	20.20	100 044 00	20.20
有限公	0001	纳芯微	06-27	00.00	1,200.00	14	0	28.39	190,044.00	28.39
司	6758									
广发证	2023									
券股份	0627	芯原股	2023-	549,2			1.7			
有限公	0001	份	06-27	56.00	7,100.00	14	0	77.81	510,632.00	77.81
司	7093									
广发证	2023									
券股份	0627	中无人	2023-	189,1			1.7			
有限公	0001	机机	06-27	50.00	3,900.00	14	0	26.80	200,031.00	26.80
司	7266	<i>V</i> -								
广发证	2023									
券股份	0627	柏楚电	2023-	330,5			1.7			
有限公	0001	子	06-27	99.00	1,700.00	14	0	46.83	320,552.00	46.83
司	7370	,	002,	33.00						
广发证	2023									
券股份	0627	华熙生	2023-	491,9			1.7			
有限公	0001	物	06-27	20.00	5,500.00	14	0	69.69	490,380.00	69.69
司	7585	123	0027	20.00						
广发证	2023									
券股份	0627	龙芯中	2023-	134,8			1.7			
有限公	0001	科	06-27	70.00	1,000.00	14	0	19.11	114,790.00	19.11
司	7705	11	0027	70.00						
广发证	2023									
券股份	0627	中复神	2023-	79,81			1.7			
有限公	0001	鹰	06-27	0.00	2,300.00	14	0	11.31	84,364.00	11.31
司	7816	<i>,</i> —3								
广发证	2023									
券股份	0627	西部超	2023-	259,3			1.7			
有限公	0001	导	06-27	50.00	5,000.00	14	0	36.74	278,650.00	36.74
司	8182	,,		2 3.30						
广发证	2023									
券股份	0627	昱能科	2023-	180,1			1.7			
有限公	0001	技	06-27	20.00	1,000.00	14	0	25.52	187,830.00	25.52
司	8322									
广发证	2023									
券股份	0627	复旦微	2023-	205,9			1.7			
有限公	0001	电	06-27	20.00	4,000.00	14	0	29.17	200,400.00	29.17
司	8482	J								
广发证	2023	天合光	2023-	420,0	10,000.00	14	1.7	59.50	426,100.00	59.50
/ 八皿	2023	/ \ [] ] []	2025-	120,0	10,000.00	1-7	1./	57.50	120,100.00	57.50

券股份	0627	能	06-27	00.00			0			
有限公	0001									
司	8506									
广发证	2023									
券股份	0627	华熙生	2023-	491,9	<b>5 5</b> 00 00	1.4	1.7	60.60	400 200 00	60.60
有限公	0001	物	06-27	20.00	5,500.00	14	0	69.69	490,380.00	69.69
司	8554									
广发证	2023									
券股份	0627	禾迈股	2023-	353,2	1 000 00	1.4	1.7	50.04	255 150 00	50.04
有限公	0001	份	06-27	20.00	1,000.00	14	0	50.04	355,150.00	50.04
司	8594									
广发证	2023									
券股份	0627	联影医	2023-	223,5	1 600 00	1.4	1.7	21.67	220 916 00	21.67
有限公	0001	疗	06-27	20.00	1,600.00	14	0	31.67	220,816.00	31.67
司	8886									
广发证	2023									
券股份	0627	天合光	2023-	210,0	5,000.00	14	1.7	29.75	213,050.00	29.75
有限公	0001	能	06-27	00.00	3,000.00	14	0	29.13	213,030.00	29.13
司	8919									
广发证	2023									
券股份	0627	天合光	2023-	621,6	14,800.00	14	3.2	165.7	630,628.00	165.76
有限公	0001	能	06-27	00.00	14,800.00	14	0	6	030,028.00	103.70
司	8943									
广发证	2023									
券股份	0627	凯赛生	2023-	324,5	5,000.00	14	1.7	45.97	311,300.00	45.97
有限公	0001	物	06-27	00.00	3,000.00	14	0	43.77	311,300.00	43.71
司	9040									
广发证	2023									
券股份	0627	和辉光	2023-	304,6	119,000.0	14	1.7	43.16	302,260.00	43.16
有限公	0001	电	06-27	40.00	0	1.	0	13.10	202,200.00	13.10
司	9258									
广发证	2023									
券股份	0627	珠海冠	2023-	363,6	19,200.00	14	1.7	51.52	386,880.00	51.52
有限公	0001	宇	06-27	48.00	,		0		,	
司	9390									
广发证	2023									
券股份	0627	复旦微	2023-	205,9	4,000.00	14	1.7	29.17	200,400.00	29.17
有限公司	0001	电	06-27	20.00			0			
司	9453									
广发证	2023	海中产	2022	452.5			, -			
券股份	0627	海光信	2023-	453,5	6,600.00	14	1.7	64.25	450,582.00	64.25
有限公司	0001	息	06-27	52.00			0			
司	9454	工.江二 mr.	2022	252.2			1.7			
广发证	2023	未迈股 (//	2023-	353,2	1,000.00	14	1.7	50.04	355,150.00	50.04
券股份	0627	份	06-27	20.00			0			

有限公	0001									
<b>有限公</b> 司	9506									
广发证	2023									
→ 及 址 → 券 股 份	0627	华大智	2023-	04.11			1.7			
有限公	0001	造	06-27	94,11 6.00	1,100.00	14	0	13.33	95,216.00	13.33
<b>有限公</b> 司		坦	00-27	0.00			0			
广发证	9507									
	2023	工活肌	2022	252.2			17			
券股份	0627	未迈股 //	2023-	353,2	1,000.00	14	1.7	50.04	355,150.00	50.04
有限公司	0001	份	06-27	20.00			0			
司	9601									
广发证	2023	心即后	2022	222.5			1.7			
券股份	0627	联影医	2023-	223,5	1,600.00	14	1.7	31.67	220,816.00	31.67
有限公司	0001	疗	06-27	20.00			0			
司	9664									
广发证	2023	யா க்ச ச	2022	224.5			, _			
券股份	0627	凯赛生	2023-	324,5	5,000.00	14	1.7	45.97	311,300.00	45.97
有限公	0001	物	06-27	00.00			0		•	
司	9697									
广发证	2023	ar the t								
券股份	0627	和辉光	2023-	304,6	119,000.0	14	1.7	43.16	302,260.00	43.16
有限公	0001	电	06-27	40.00	0		0		,	
司	9771									
广发证	2023									
券股份	0627	天合光	2023-	210,0	5,000.00	14	1.7	29.75	213,050.00	29.75
有限公	0001	能	06-27	00.00	-,,,,,,,,,,		0			_,,,,
司	9772									
广发证	2023									
券股份	0627	纳芯微	2023-	200,4	1,200.00	14	1.7	28.39	190,044.00	28.39
有限公	0001	71301%	06-27	00.00	1,200.00		0	20.03	150,011100	20.09
司	9800									
广发证	2023									
券股份	0627	传音控	2023-	717,2	5,000.00	14	1.7	101.6	735,000.00	101.60
有限公	0001	股	06-27	00.00	2,000.00	11	0	0	755,000.00	101.00
司	9801									
广发证	2023									
券股份	0627	传音控	2023-	717,2	5,000.00	14	1.7	101.6	735,000.00	101.60
有限公	0002	股	06-27	00.00	2,000.00	14	0	0	155,000.00	101.00
司	0168									
广发证	2023									
券股份	0627	长远锂	2023-	308,5	27,500.00	14	1.7	43.71	300 025 00	43.71
有限公	0002	科	06-27	50.00	27,300.00	14	0	45./1	309,925.00	45./1
司	0181									
广发证	2023	国埔市	2022	77 76			1 7			
券股份	0627	国博电	2023-	77,76	1,000.00	14	1.7	11.02	79,200.00	11.02
有限公	0002	子	06-27	0.00			0			

一方							1		•		
### Property	司	0307									
	广发证	2023									
有限公   0002   元   06-27   6.00	券股份	0627	华大智	2023-	94,11	4 400 00		1.7	10.00	0.7.24 5.00	10.00
广发证 有限公 有限公 有限公 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 可 有限公 0003 有限公 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0000 有股 00000 有限公 0000 有股 0000 0000 0000 0000 0000 0000	有限公	0002	造	06-27	6.00	1,100.00	14	0	13.33	95,216.00	13.33
券股份 何限公 可 可 有限公 可 有 形分 何 行 形 近 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五	司	0530									
券股份 何限公 可 可 有限公 可 有 形分 何 行 形 近 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五 五	广发证	2023									
有限公   1616			中控技	2023-	186.2			1.7			
日						3,000.00	14		26.39	188,340.00	26.39
广发证 有限公 可 有限公 0003 可 有限公 可 有限公 0003 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0003 可 有限公 0003 有限公 0003 有限公 0003 有限公 0003 有限公 0003 有限公 0000 有股公 0000 有限公 0000 有股公 0000 有股公 0000 有股 0000 000											
券股份 有限公 可 可 形 分 有限公 可 可 的 之 行 之 的 之 的 之 的 之 的 之 的 之 的 之 的 之 的 之											
有限公司司			芯原股	2023-	549.2			17			
日						7,100.00	14		77.81	510,632.00	77.81
万安证 存限公 同型 (6699)       2023 (6699)       B			1/1	00-27	30.00						
券股份 有限公 司 司 (6699)       0629 (6699)       西部超 (6629)       2023- (06-29)       878.2 (20.00)       16,400.00       14       3.2 (1       78.31       913,972.00       78.31         产发证 有限公 司 司 (7) 发证 有限公 (0003) 司 有限公 司 (2023)       塞式纪 (06-29)       2023- (06-29)       579.0 (00.00)       3,000.00       14       3.1 (2023) (2023)       49.86       564,000.00       49.86         产发证 有限公 (0003) 司 有限公 (0003) 司 (2023) 养股份 (0629) 有限公 (0003) 司 (2023) 养股份 (0630) 司 (2023) 专股份 (0630) 有限公 (0000) 司 (2023) 专股份 (0630) 有限公 (0000) 司 (2023) 专股份 (0630) 有限公 (0000) 司 (2023) 专股份 (0630) 有限公 (0000) 司 (2023) 专股份 (0630) 有限公 (0630) 有限公 (0630) 有限公 (0630) 专品 (											
有限公司       0000 6699       导       06-29       20.00       16.400.00       14       1       78.31       913,972.00       78.31         方と证 7次に			邢 並7 ‡77	2023	070 1			2.2			
一方   一方   一方   一方   一方   一方   一方   一方						16,400.00	14		78.31	913,972.00	78.31
广发证 寿股份 有限公 司 司 3167       2023 06-29 06-29       579,0 06-29 0000       3,000.00       14       3.1 0       49.86       564,000.00       49.86         广发证 寿股份 有限公 司 有限公 (003) 司 有限公 有限公 (003) 司 司 有限公 (003) 司 司 有限公 (003) 司 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 (2023 寿股份 (0629 有限公 (003) 司 (2023 寿股份 (0630 有限公 (06-30)       7,800.00 (14       14       3.2 29.23 332,358.00       29.23 332,358.00       29.23 29.23 29.23 29.23 29.40 00.00       40,000.00 0       14       3.1 0       191.7 2,296,800.0 0       2,296,800.0 0       191.75 0         大发证 有限公 (0000) 司 (5392       传音控 (06-30) (06-30) (06-30) (06-30)       294.0 00.00        2,000.00       14       3.1 0        -       294,000.00       -         大联方 名称       合约 编号       成交 於 时间       交易 时间       世位: 股)       出借期 度 (单位: 股)       出借期 度 (单位: 股)       利息 收入 %       期末应 收利息 余额			4	00-29	20.00			1			
券股份 有限公 司 司 3167       0629 0003 3167       寒武纪 06-29       2023 06-29       579,0 00-29       3,000.00       14       3.1 0       49.86       564,000.00       49.86         广发证 为股份 有限公 0003 司 司 有限公 0003 司 司 有限公 0003 司 司 9268       2023- 6 6 6 6 7 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8 8											
有限公司       0003 3167       基式記       06-29       00.00       3,000.00       14       0       49.86       564,000.00       49.86         广发证 2023 券股份 0629 有限公司 3308       海光信息       2023-7552.00       15,200.00       14       3.2       91.89       1,037,704.0       91.89         广发证 2023 券股份 0629 有限公司 4716       大会光 06-29       34.00       7,800.00       14       3.2       29.23       332,358.00       29.23         寿股份 0629 有限公司 9268       瀬屋科 0629 有限公司 9268       10       40,000.00       14       3.1       191.7       2,296,800.0       191.75         方发证 2023 券股份 0630 有限公司 9268       传音控 06-30 06-30       294,0       2,000.00       14       3.1       191.7       2,296,800.0       191.75         有限公司 9392       传音控 06-30 06-30       200.00       2,000.00       14       3.1       3.1       191.7       2,296,800.0       191.75         专股份 0630 有限公司 9392       大联方 66-30 06-30       200.00       2,000.00       14       3.1       9       294,000.00       -         大联方 68       公司 5392       大縣 68       大縣 78				2022	570.0			2.1			
司       3167       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       四       月       四       月       四       月 <td></td> <td></td> <td>寒武纪</td> <td></td> <td></td> <td>3,000.00</td> <td>14</td> <td></td> <td>49.86</td> <td>564,000.00</td> <td>49.86</td>			寒武纪			3,000.00	14		49.86	564,000.00	49.86
广发证 寿股份 有限公 司 司 3308       2023 息 息 06-29       1,033 ,752 00       15,200.00       14       3.2 0 91.89       91.89       1,037,704.0 0       91.89         广发证 有限公 司 有限公 司 有限公 司 有限公 司 有限公 司 司 9268       2023 後 6 06-29       34.00       7,800.00       14       3.2 1 1       29.23       332,358.00       29.23         芳股份 有限公 司 可 9268       0003 9268       技 06-29       2,226 .800. 00       40,000.00 00       14       3.1 06-29       191.75       2,296,800.0 0       191.75         芳股份 有限公 0000 司 有限公 0000 司 5392       6音控 股 06-30       294,0 00-30       2,000.00       14       3.1 0       191.7 5       2,296,800.0 0       191.75         大联方 名称       合约 编号       成交 时间       交易数量 (单位: 股)       出借期 限(单 位: 天)       利息 收入 %)       期末证券出 收入 6       期末应 收利息 余额				06-29	00.00			0			
券股份 有限公 司 司 3308     06-29 00-29 06-29 06-29 06-29 34.00     1,033 7,752 00-29 34.00     15,200.00 14     14     3.2 0 1     91.89 91.89     1,037,704.0 0 1     91.89 0       产发证 有限公 0003 有限公 0003 司 9268     天合光 6 6 2023 ½ 7,800.00     2023- 8,800. 00-29 00     40,000.00 00     14     3.2 1 29.23     29.23     332,358.00     29.23       产发证 7发证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度证 7度											
寿股份 有限公 司 司 3308     0629 息 息 06-29     表元 06-29     15,200.00 00     14     3.2 0 0     91.89     1,037,704.0 0     91.89       广发证 有限公 可 4716     2023 核 06-29     天合光 06-29     2023- 8,800. 00     7,800.00     14     3.2 1     29.23     332,358.00     29.23       寿股份 有限公 可 9268     0629 9268     瀬起科 06-29     2023- 8,800. 06-29     40,000.00     14     3.1 06-29     191.75 0     2,296,800.0 5     191.75 0       方炭证 寿股份 有限公 0000 可 5392     传音控 股 06-30     294,0 06-30     2,000.00     14     3.1 0     191.7 0     2,296,800.0 5     191.75 0       大联方 名称     合约 编号     成交 新月     交易 时间     交易 时间     交易 校 股 时间     並 交易 財間     出借期 限 位: 天 )     費 本 利息 ( ( )     期末证券出 收入 6     期末应 收利息 余额					1,033						
有限公 司 司 3308       0003 3308       息 06-29 00       00 00       14       0 0 0 0 0       0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0						15.200.00	14	3.2	91.89		91.89
司       3308       大合光       2023       大合光       2023- 327.8       7,800.00       14       3.2       29.23       332,358.00       29.23         有限公       0003       能       06-29       34.00       7,800.00       14       3.2       1       29.23       332,358.00       29.23         芳股份       0629       瀬起科       2023- 2,226       800. 00       40,000.00       14       3.1       191.7       2,296,800.0       191.75         广发证       2023       接音控       2023- 294.0       2,000.00       14       3.1       0       -       294,000.00       -         寿股份       0630       传音控       2023- 294.0       2,000.00       14       3.1       -       294,000.00       -         有限公       0000       股       06-30       00.00       2,000.00       14       3.1       -       294,000.00       -         大联方       60       5392       大東京       成交       交易數量       出借期       東京       利息       收入       期末证券出       收入       收入       40,000.00       日       14       3.1       191.7       2,296,800.0       191.75       2,000.00       14       3.1       9       2,294,000.00       14			息	06-29		,		0		0	, -10,
券股份 有限公 司 司 (4716)       0629 能 (6-29)       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 9268       2023- 技 9268       2023- 66-29       40,000.00 00       14       3.1 0       191.7 5       2,296,800.0 0       191.75 0         广发证 券股份 有限公 0630 有限公 0630 有限公 0630 5392       传音控 股 06-30       294,0 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       上年度可比期间 (单位: 股)       財末证券出 收入 6       期末证券出 收利息 余额       期末应 收利息 余额					00						
有限公司     0003		2023									
有限公   0003   能   06-29   34.00   1	券股份	0629		2023-	327,8	7 800 00	14	3.2	29 23	332 358 00	29 23
广发证 券股份 有限公 司       2023 技 9268       演起科 技 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 06-30       294,0 06-30       2,000.00       14       3.1 0       -       294,000.00       -         大联方 名称       合约 编号       证券名 新       成交 时间       交易 金额       交易数量 (单位: 股)       出借期 限(单位: 股)       费 平 (以入 %)       利息 收入 份%)       期末证券出 收入 借业务余额       期末应 收利息 余额		0003	能	06-29	34.00	7,000.00	14	1	27.23	332,330.00	27.23
券股份 有限公 司     0629 9268     瀬起科 技 06-29     2023- 06-29     40,000.00 00     14     3.1 0     191.7 5     2,296,800.0 0     191.75       广发证 寿股份 有限公 司     2023- 06-30     294,0 06-30     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     世位: 股)     出借期 (单位: 股)     费 《( %)     利息 (中位: %)     期末证券出 收入 6%     期末应 收利息 余额	司	4716									
寿股份 0629		2023			2 226						
有限公   0003   技   06-29   00				2023-		40 000 00	14	3.1	191.7	2,296,800.0	191 75
司     9268       广发证     2023       券股份     0630     传音控       有限公     0000       司     5392       上年度可比期间       2022年1月1日至2022年6月30日       美联方     合约     证券名     成交     交易       財间     定易数量     出借期     限(单位: 股)     財息     財末证券出 收利息 余额       企:天)     %)	有限公	0003	技	06-29		+0,000.00	17	0	5	0	1/1./3
券股份 有限公 司     0630 0000 5392     传音控 股     2023- 06-30     294,0 00.00     2,000.00     14     3.1 0     -     294,000.00     -       关联方 名称     合约 编号     证券名 新     成交 时间     交易 金额     过度分数量 (单位: 股)     出借期 限(单位: 股)     费 本 位: 天)     利息 收入     期末证券出 收入 借业务余额     期末应 收利息 余额		9268			00						
有限公司     0000 5392     股     06-30     00.00     2,000.00     14     0     -     294,000.00     -       关联方名和     合约编号     证券名和     成交时间     交易数量(单位:股)     出借期限(单位:股)     財末证券出收入 供入 供入 供入 条额	广发证	2023									
有限公司     0000	券股份	0630	传音控	2023-	294,0	2 000 00	1.4	3.1		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     证券名成交时间     交易数量 交易数量 (单位:股)     出借期限(单位:股)     费率(人物)     利息收入 借业务余额收利息余额条额	有限公	0000	股	06-30	00.00	۷,000.00	14	0	_	49 <del>4</del> ,000.00	-
2022年1月1日至2022年6月30日       关联方名     合约编号     证券名成交时间     交易数量(单位:股)     出借期限(单位:股)     费率(收入增址多余额收利息余额条额	司	5392									
2022年1月1日至2022年6月30日       关联方名     合约编号     证券名成交时间     交易数量(单位:股)     出借期限(单位:股)     费率(收入增址多余额收利息余额条额						上年度可比	 .期间				
关联方名名称     合约编号     证券名成交成交时间     交易数量 (单位:股)     出借期限(单位:股)     费率(收入增址多余额收利息余额								_			
关联方     合约     证券名     成交     交易     (单位: 限)     取(单位: 下)     平     利息     期末证券出     收入       名称     4     股)     位: 天)     %)     期末证券出     收入					2022年	E1月1日至20	22年6月30	H ———			
关联方     合约     证券名     成 交     交易     (单位:     限(单位:     型     利息     期末证券出     收利息       名称     编号     称     时间     金额     股)     位: 天)     %)     件入     借业务余额     收利息						六旦粉旱	山烘畑	费			
名称   編号	关联方	合约	证券名	成交	交易			率	利息	期末证券出	
	名称	编号	称	时间	金额			(	收入	借业务余额	
广发证 2022 圣湘生 2022- 599,6 12,400.00 28 3.1 1,445						版)	似: 大 )	%)			<b></b>
	广发证	2022	圣湘生	2022-	599,6	12,400.00	28	3.1	1,445	-	-

券股份	0531	物	05-31	64.00			0	.86		
有限公	0000									
司	1266									
广发证	2022			1 5 47						
券股份	0616	中控技	2022-	1,547	20,000.00	28	3.1	1,864	1,455,200.0	1,864.99
有限公	0000	术	06-16	,000. 00	20,000.00	28	0	.99	0	1,804.99
司	1720			00						
广发证	2022									
券股份	0616	大全能	2022-	682,6	10,000.00	28	3.1	822.9	683,200.00	822.91
有限公	0000	源	06-16	00.00	10,000.00	20	0	1	083,200.00	022.91
司	1722									
广发证	2022									
券股份	0616	九号公	2022-	951,8	20,000.00	28	3.1	1,147		1,147.45
有限公	0000	司	06-16	00.00	20,000.00	20	0	.45	-	1,147.43
司	1752									
广发证	2022									
券股份	0617	寒武纪	2022-	246,8	3,900.00	28	3.1	276.3	252,330.00	276.36
有限公	0000	太风纪	06-17	70.00	3,900.00	20	0	6	232,330.00	270.30
司	2344									
广发证	2022									
券股份	0628	圣湘生	2022-	372,4	12,400.00	28	3.1	64.15	367,164.00	64.15
有限公	0001	物	06-28	96.00	12,400.00	20	0	04.13	307,104.00	04.13
司	0896									
广发证	2022			5,220						
券股份	0630	天合光	2022-	,000.	80,000.00	28	3.1		5,220,000.0	
有限公	0000	能	06-30	,000.	00,000.00	20	0	-	0	-
司	1536			00						

# 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

	本期末 2023 年	6月30日	上年度末 2022 年 12 月 31 日		
关联方名称	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	11.750.006.00	0.500/	7 125 500 00	0.590/
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

	7	本期	上年度可比期间		
关联方名称	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	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	单价 472.2 2	52,400.00	24,744,328.
2	688036	传音控股	2023年7月3日 -2023年7月14日	147.0	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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
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
25	688188	柏楚电子	2023年7月3日 2023年7月13日 -2023年7月13日	188.5	13,600.00	2,564,416.0
26	688538	和辉光电-U	2023年7月13日 2023年7月13日 -2023年7月13日	2.54	952,700.00	2,419,858.0
27	688082	盛美上海	2023年7月10日	110.4	21,600.00	2,384,640.0
28	688032	禾迈股份	-2023 年 7 月 13 日 2023 年 7 月 11 日 2023 年 7 月 13 日	355.1	6,500.00	2,308,475.0
29	688065	凯赛生物	-2023年7月13日 2023年7月10日 2023年7月13日	5 62.26	34,300.00	2,135,518.0
30	688690	纳微科技	-2023年7月13日 2023年7月3日 2023年7月13日	38.85	50,700.00	1,969,695.0
31	688126	沪硅产业	-2023 年 7 月 13 日 2023 年 7 月 3 日 2023 年 7 月 13 日	20.90	91,000.00	1,901,900.0
32	688561	奇安信-U	-2023 年 7 月 13 日 2023 年 7 月 3 日 2023 年 7 月 14 日	51.81	34,600.00	1,792,626.0
33	688297	中无人机	-2023 年 7 月 14 日 2023 年 7 月 3 日 2023 年 7 月 11 日	51.29	33,000.00	0 1,692,570.0 0
34	688536	思瑞浦	-2023 年 7 月 11 日 2023 年 7 月 10 日	218.0	7,100.00	1,547,800.0
35	688819	天能股份	2023年7月3日 -2023年7月14日	36.84	41,600.00	0 1,532,544.0 0
36	688052	纳芯微	2023年7月14日 2023年7月14日 -2023年7月14日	158.3	8,100.00	1,282,797.0
37	688009	中国通号	2023年7月14日 2023年7月3日 -2023年7月13日	5.80	218,000.00	1,264,400.0
38	688234	天岳先进	2023年7月13日 2023年7月12日 -2023年7月14日	73.94	17,100.00	1,264,374.0
39	688271	联影医疗	2023年7月3日 -2023年7月13日 -2023年7月13日	138.0	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	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	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	114.7	6,700.00	769,093.00
44	000047	龙心中符	-2023年7月13日	9	0,700.00	707,073.00
45	688180	   君实生物-U	2023年7月3日	38.54	18,200.00	701,428.00
43	000100	石头王初-U	-2023年7月13日	36.34	10,200.00	701,428.00
46	688981	中芯国际	2023年7月10日	50.52	13,200.00	666,864.00
40	40 000901	<b>中心国</b> 例	-2023年7月13日	30.32	15,200.00	000,004.00
47	688349	三一重能	2023年7月3日	32.22	19,100.00	615,402.00
47	000349		-2023年7月13日			013,402.00
48	688375	国博电子	2023年7月3日	79.20	4 700 00	272 240 00
46	000373	国協出1	-2023年7月13日	19.20	4,700.00	372,240.00
49	600111	华大智造	2023年7月3日	86.56	4 000 00	346,240.00
49	49 688114	<b>一</b>	-2023年7月11日	00.30	4,000.00	340,240.00
合计	-	-	-	-	4,226,985.0	192,242,080
					0	.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最大风险,也往往是众多风险中最基本和最常见的,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	1年以内	1-5年	5 年以上	不计息	合计
2023年6月30日	1 1 2/13	10	2 1 27 2	1 71 75	
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	
负债					02
				500.000.50	500 000 co
应付管理人报酬	<u>-</u>		-	- 500,920.62	<b>†</b>
应付托管费 应交税费	-		-	- 100,184.15 - 12,703.95	· ·
其他负债	-		_	- 368,146.89	
负债总计				- 981,955.61	
	4 709 641 00				
利率敏感度缺口	4,708,641.99		-	- 1,269,367,569.42	41,274,076,211
上年度末					71
2022年12月31	1 年以内	1-5年	5 年以上	不计息	合计
日					
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	748,688,874.2
其他资产	_		-	- 52,192.24	52,192.24
资产总计	3,081,759.14			748,741,066.45	
负债					9
应付清算款			_	- 19,756.93	19,756.93
应付管理人报酬			_	- 288,240.55	<b>†</b>
应付托管费				- 57,648.11	•

应交税费	_	-	-	6,863.20	6,863.20
其他负债	-	1	1	311,970.64	311,970.64
负债总计	1	-	-	684,479.43	684,479.43
利率敏感度缺口	3,081,759.14	-	-	748,056,587.02	751,138,346.1 6

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

	本期末		上年度末		
	2023年6月3	30 日	2022年12月31日		
项目		占基金		占基金	
	八石仏店	资产净	八公仏店	资产净	
	公允价值	值比例	公允价值	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	
交易性金融资产一基金投资	-	-	-	-	
交易性金融资产-债券投资	-	-	-	-	
交易性金融资产一贵金属投资	-	-	-	-	
衍生金融资产一权证投资	-	-	-	-	

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	上年度末	
		2023年6月30日	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 第70页共84页 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
17年		公儿川祖(九)	(%)

A	农、林、牧、渔业	-	-
В	采矿业	-	-
С	制造业	964,144,003.77	75.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
Е	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
Н	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	-	-
0	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  股票位	股票代码	代码 股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净
	从示气吗				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
L	<u> </u>		1 7	, ,	1

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

				占期初基金资
序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	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

- 1					
	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	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。

第75页共84页

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期未投资股指期货。

#### 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

本基金本报告期未投资国债期货。

# 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期未投资国债期货。

#### 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	<b>待摊费</b> 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

<b>宁</b> 旦	<b>奶茜 42</b> 57	肌西匀轮	流通受限部分的	占基金资产净	流通受限情
序号	股票代码	股票名称	公允价值	值比例(%)	况说明
1	688111	金山办公	24,744,328.00	1.94	转融通流通
	500005	/	42.720.700.00	1.05	受限 转融通流通
2	688036	传音控股	13,538,700.00	1.06	受限
3	688008	澜起科技	13,235,310.00	1.04	转融通流通
					受限 转融通流通
4	688599	天合光能	12,378,205.00	0.97	受限
5	688256	寒武纪-U	10,885,200.00	0.85	转融通流通
	000230	~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~~	10,000,200.00	0.02	受限
6	688777	中控技术	8,303,596.70	0.65	转融通流通
					受限 转融通流通
7	688012	中微公司	5,147,205.00	0.40	<b>受限</b>
8	688223	晶科能源	5 001 142 00	0.39	转融通流通
8	088223	田竹 化水	5,001,142.00	0.39	受限
9	688126	沪硅产业	1,901,900.00	0.15	转融通流通
-		, ,,	-,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,,	3.10	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

			持有人结构					
		户均持有					广发上证科	创板 50 成份交
	持有人户数	的基金份	机构	投资者	个人	.投资者	易型开放式	指数证券投资
	(户)						基金发起	式联接基金
		额	持有份	占总份额	持有份	占总份额	<b>井</b> 大	占总份额比
			额	比例	额	比例	持有份额	例

20,590	96,412.82	837,032 ,929.00	42.16%	1,148,1 07,071. 00	57.84%	562,846,50	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
Ī	基金管理人所有从业	0.00	0.0000%
	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

金额单位							
	交易	股票交易	1 7	应支付该券商	i的佣金		
<b>券商名称</b>	単元		占当期股		占当期佣	备注	
分间石物		成交金额	票成交总	佣金	金总量的	<b>首</b> 任	
	数量		额的比例		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	-	-	-	1	-	
东兴证券	2	-	-	-	1	新增2个	
华福证券	2	-	-	-	1	新增2个	
安信证券	1	-	-	-	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	-	- 五生 84 五	_	-	-	

#### 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

	债券交	· 券交易		债券回购交易		<b></b>	
券商名称	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	-	1	-	-	-	-	
英大证券	-	1	1	1	-	-	
中泰证券	-	1	1	1	-	-	
大同证券	-	1	1	1	ı	-	
海通证券	-	-	-	-	1	-	
万和证券	-	-	-	-	1	-	
银河证券	-	-	-	-	1	-	
银泰证券	-	-	-	-	1	-	
财通证券	-	-	-	-	-	-	
国融证券	-	-	-	-	-	-	
山西证券	-	-	-	-	-	_	
国联证券	-	1	-	-	-	_	
联储证券	-	-	-	-	-	-	

去學出工来						
首创证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	ı	-
中信证券	1	1	1	-	1	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
华福证券	1	1	1	-	1	-
安信证券	1	1	1	-	1	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	1	1	-	1	-
国金证券	-	1	1	-	1	-
华西证券	-	1	1	-	1	-
摩根大通证券	-	1	1	-	1	-
东莞证券	-	1	1	-	1	-
华创证券	-	1	-	-	-	-
开源证券	-	1	-	-	-	-
申万宏源	-	1	-	-	-	-
粤开证券	-	1	1	-	-	-
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	八九古石	ᅶᄼᆎᇛᆠᅩ	法定披露日	
	公告事项	法定披露方式	期	
1	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年	中国证监会规定报刊及	2023-01-20	
	第 4 季度报告提示性公告	网站		
2	关于增加中金公司为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2022 02 02	
2	商的公告	网站	2023-03-03	
3	关于增加东兴证券为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2022 02 14	
3	商的公告	网站	2023-03-14	
4	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2022 年	中国证监会规定报刊及	2023-03-30	
4	年度报告提示性公告	网站	2023-03-30	
_	关于增加国金证券为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2022 04 10	
5	商的公告	网站	2023-04-18	
6	广发基金管理有限公司关于旗下基金 2023 年	中国证监会规定报刊及	2022 04 21	
б	第1季度报告提示性公告	网站	2023-04-21	
7	关于增加中金财富证券为旗下部分 ETF 一级	中国证监会规定报刊及	2022 05 17	
/	交易商的公告	网站	2023-05-17	

0	关于增加东方证券为旗下部分 ETF 一级交易	中国证监会规定报刊及	2022 06 10
8	商的公告	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

	报告期内	持有基金份额变化情	况			报告期末持有	基金情况
投资者 类别	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	持有份额	份额占比
广证板份型式证资发联金发科50交开指券基起接上创成易放数投金式基	1	20230101-202306 30	342,84 3,700.0 0	296,402, 400.00	76,399, 600.00	562,846,500. 00	28.35%

产品特有风险

报告期内,本基金存在单一投资者持有份额比例达到或超过20%的情况,由此可能导致的特有风险 主要包括:

- 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。

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。

# 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