

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：国泰基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同约定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
7 投资组合报告	56
7.1 期末基金资产组合情况	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	59
7.3.1 期末指数投资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	59
7.3.2 期末积极投资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	60
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	64
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	64
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	64
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	64
7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
7.11 投资组合报告附注	64
8 基金份额持有人信息	66

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	66
8.2 期末上市基金前十名持有人	66
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	67
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	67
9 开放式基金份额变动	68
10 重大事件揭示	68
10.1 基金份额持有人大会决议	68
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	68
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	68
10.4 基金投资策略的改变	68
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	68
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	68
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	69
11 影响投资者决策的其他重要信息	71
12 备查文件目录	71
12.1 备查文件目录	71
12.2 存放地点	71
12.3 查阅方式	72

2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	国泰中证计算机主题 ETF
场内简称	计算机 ETF
基金主代码	512720
交易代码	512720
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 7 月 11 日
基金管理人	国泰基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,434,453,447.00 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	2019 年 8 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	1、股票投资策略； 2、存托凭证投资策略； 3、债券投资策略； 4、可转换债券投资策略； 5、资产支持证券投资策略； 6、股指期货投资策略； 7、融资与转融通证券出借投资策略。
业绩比较基准	中证计算机主题指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。 本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪中证计算机主题指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

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		国泰基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘国华	秦一楠
	联系电话	021-31081600转	010-66060069
	电子邮箱	xinxipilu@gtfund.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		(021)31089000, 400-888-8688	95599
传真		021-31081800	010-68121816
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区	北京市东城区建国门内大街69

	浦东大道1200号2层225室	号
办公地址	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	200082	100031
法定代表人	邱军	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.gtfund.com
基金中期报告备置地点	上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层和本基金托管人住所

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	299,582,963.07
本期利润	427,181,272.56
加权平均基金份额本期利润	0.3111
本期加权平均净值利润率	24.39%
本期基金份额净值增长率	23.77%
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	439,461,796.34
期末可供分配基金份额利润	0.3064
期末基金资产净值	1,873,915,243.34
期末基金份额净值	1.3064
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	30.64%

注：(1)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。

(2)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。

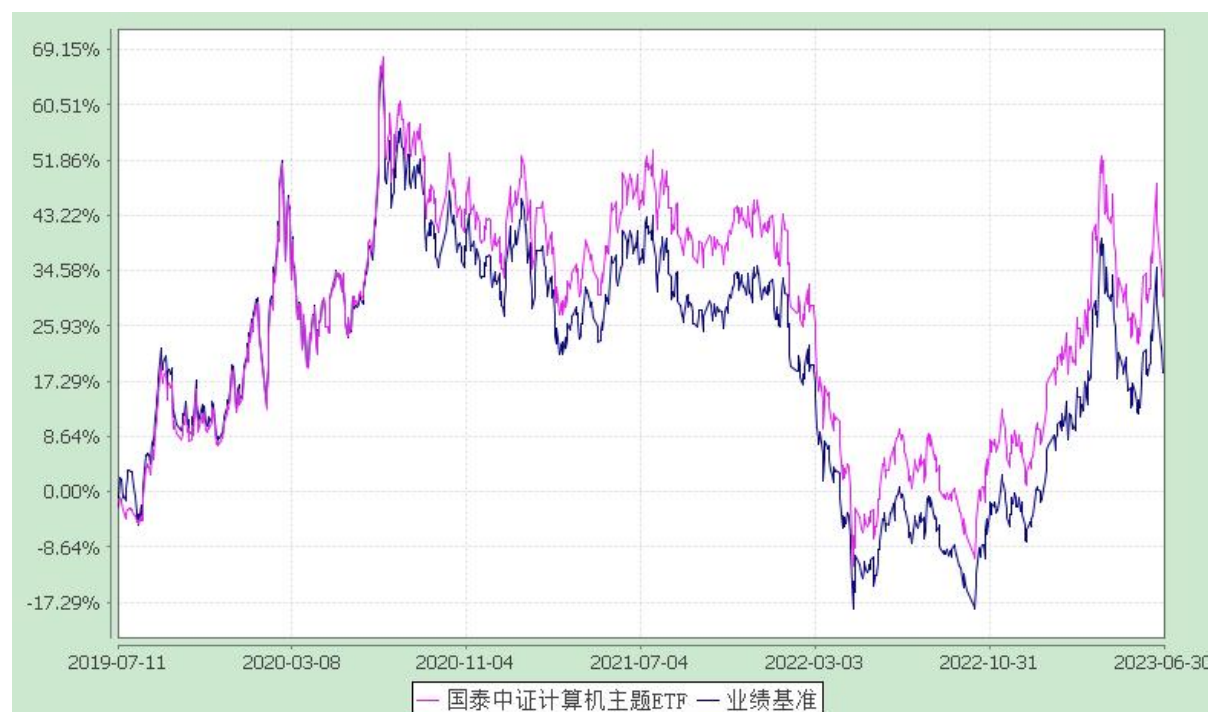
3.2 基金净值表现

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	1.03%	2.54%	0.92%	2.57%	0.11%	-0.03%
过去三个月	-8.90%	2.35%	-9.58%	2.37%	0.68%	-0.02%
过去六个月	23.77%	2.17%	23.56%	2.19%	0.21%	-0.02%
过去一年	20.07%	1.88%	19.25%	1.89%	0.82%	-0.01%
过去三年	-7.48%	1.73%	-15.11%	1.75%	7.63%	-0.02%
自基金合同生效起至今	30.64%	1.81%	18.82%	1.85%	11.82%	-0.04%

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

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
 (2019年7月11日至2023年6月30日)



注：本基金的合同生效日为 2019 年 7 月 11 日，本基金在 6 个月建仓期结束时，各项资产配置比例符合合同约定。

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

国泰基金管理有限公司成立于 1998 年 3 月 5 日，是经中国证监会证监基字[1998]5 号文批准的首批规范的全国性基金管理公司之一。公司注册资本为 1.1 亿元人民币，公司注册地为上海，并在北京和深圳设有分公司。

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金管理人共管理 244 只开放式证券投资基金。另外，本基金管理人于 2004 年获得全国社会保障基金理事会社保基金资产管理人资格，目前受托管理全国社保基金多个投资组合。2007 年 11 月 19 日，本基金管理人获得企业年金投资管理人资格。2008 年 2 月 14 日，本基金管理人成为首批获准开展特定客户资产管理业务（专户理财）的基金公司之一，并于 3 月 24 日经中国证监会批准获得合格境内机构投资者（QDII）资格，囊括了公募基金、社保、年金、专户理财和 QDII 等管理业务资格。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
艾小军	国泰黄金 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF 联接、国泰上证 180 金融 ETF、国泰中证计算机主题 ETF 联接、国泰黄金 ETF、国泰中证军工 ETF、国泰中证全指证券公司 ETF、国泰国证航天军工指数 (LOF)、国泰中证申万证券行业指数 (LOF)、国泰策略价值灵活	2019-07-11	-	22 年	硕士。2001 年 5 月至 2006 年 9 月在华安基金管理有限公司任量化分析师；2006 年 9 月至 2007 年 8 月在汇丰晋信基金管理有限公司任应用分析师；2007 年 9 月至 2007 年 10 月在平安资产管理有限公司任量化分析师；2007 年 10 月加入国泰基金，历任金融工程分析师、高级产品经理和基金经理助理。2014 年 1 月起任国泰黄金交易型开放式证券投资基金、上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金、国泰上证 180 金融交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理，2015 年 3 月至 2020 年 12 月任国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金的基金经理，2015 年 4 月至 2021 年 1 月任国泰沪深 300 指数证券投资基金的基金经理，2016 年 4 月起兼任国泰

	<p>配置混合、芯片 ETF、国泰中证计算机主题 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF、国泰中证全指通信设备 ETF 联接、国泰中证全指证券公司 ETF 联接、国泰纳斯达克 100 (QDII-ETF)、国泰标普 500ETF、国泰中证半导体材料设备主题 ETF 的基金经理、投资总监(量化)、金融工程总监</p>			<p>黄金交易型开放式证券投资基金联接基金的基金经理，2016 年 7 月起兼任国泰中证军工交易型开放式指数证券投资基金和国泰中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2017 年 5 月任国泰保本混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月至 2018 年 12 月任国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 3 月起兼任国泰国证航天军工指数证券投资基金(LOF)的基金经理，2017 年 4 月起兼任国泰中证申万证券行业指数证券投资基金(LOF)的基金经理，2017 年 5 月起兼任国泰策略价值灵活配置混合型证券投资基金(由国泰保本混合型证券投资基金变更而来)的基金经理，2017 年 5 月至 2018 年 7 月任国泰量化收益灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2017 年 8 月起至 2019 年 5 月任国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2022 年 3 月任国泰量化成长优选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 5 月至 2019 年 7 月任国泰量化价值精选混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 8 月至 2019 年 4 月任国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金的基金经理，2018 年 12 月至 2019 年 3 月任国泰量化策略收益混合型证券投资基金(由国泰策略收益灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理，2019 年 4 月至 2019 年 11 月任国泰沪深 300 指数增强型证券投资基金(由国泰结构转型灵活配置混合型证券投资基金变更而来)的基金经理，2019 年 5 月至 2019 年 11 月任国泰中证 500 指数增强型证券投资基金(由国泰宁益定期开放灵活配置混合型证券投资基金变更</p>
--	---	--	--	---

				<p>注册而来)的基金经理,2019年5月起兼任国泰CES半导体芯片行业交易型开放式指数证券投资基金(由国泰CES半导体行业交易型开放式指数证券投资基金更名而来)的基金经理,2019年7月至2021年1月任上证5年期国债交易型开放式指数证券投资基金和上证10年期国债交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019年7月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019年8月起兼任国泰中证全指通信设备交易型开放式指数证券投资基金的基金经理,2019年9月起兼任国泰中证全指通信设备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,2020年12月起兼任国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(由国泰深证TMT50指数分级证券投资基金转型而来)的基金经理,2021年5月起兼任国泰中证全指证券公司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,2023年5月起兼任纳斯达克100交易型开放式指数证券投资基金和国泰标普500交易型开放式指数证券投资基金(QDII)的基金经理,2023年7月起兼任国泰中证半导体材料设备主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2017年7月起任投资总监(量化)、金融工程总监。</p>
--	--	--	--	---

注：1、此处的任职日期和离任日期均指公司决定生效之日，首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券法》、《证券投资基金法》、《基金管理公司公平交易

制度指导意见》等有关法律法规的规定，严格遵守基金合同和招募说明书约定，本着诚实信用、勤勉尽责、最大限度保护投资人合法权益等原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作合法合规，未发生损害基金份额持有人利益的行为，未发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为，信息披露及时、准确、完整，本基金与本基金管理人管理的其他基金资产、投资组合与公司资产之间严格分开、公平对待，基金管理团队保持独立运作，并通过科学决策、规范运作、精心管理和健全内控体系，有效保障投资人的合法权益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的相关规定，通过严格的内部风险控制制度和流程，对各环节的投资风险和管理风险进行有效控制，确保公平对待所管理的所有基金和投资组合，切实防范利益输送行为。

（一）本基金管理人管理的基金或组合间同向交易价差分析

根据证监会公平交易指导意见，我们计算了公司旗下基金、组合间同向交易记录配对。通过对这些配对的交易价差分析，我们发现有效配对溢价率均值都在 1%数量级及以下，且大多数溢价率均值都可以通过 95%置信度下等于 0 的 t 检验。

（二）扩展时间窗口下的价差分析

本基金管理人选取 T=3 和 T=5 作为扩展时间窗口，将基金或组合交易情况分别在这两个时间窗口内作平均，并以此为依据，进行基金或组合间在扩展时间窗口中的同向交易价差分析。对于有足够多观测样本的基金配对（样本数 ≥ 30 ），溢价率均值普遍在 1%数量级及以下。为稳妥起见，对于溢价率均值过大的基金或组合配对，我们也进行了模拟溢价金额计算。

（三）基金或组合间模拟溢价金额分析

对于不能通过溢价率均值为零的 t 检验的基金组合配对、对于在时间窗口中溢价率均值过大的基金组合配对，基金经理也对价差作出了解释，公司旗下基金或组合间没有可能导致不公平交易和利益输送的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金组合与其他投资组合之间，由于组合流动性管理或投资策略调整需要，参与的交易所公开竞价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%的交易次数为 1 次。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

一季度受大语言人工智能技术 GPT 短期内的技术升级和 ChatGPT 极佳的用户交互体验推动，同时国内新一届政府换届落地，中共中央、国务院印发了《数字中国建设整体布局规划》提出了数字中国建设的顶层设计和整体布局，数字经济被确定为推动我国经济增长的主要引擎之一，包括计算机、通信、传媒、电子在内的 TMT 板块受到了投资者的追捧，板块成交活跃，TMT 板块成交占全市场成交比超过了 40% 的历史高位，A 股市场震荡盘升；在美国出台芯片法案并裹挟日本荷兰持续对中国半导体芯片、高性能计算更大范围的打压下，包括半导体设备、材料等国产化受益细分行业的受益国产化替代份额持续攀升，经过产业链的协同合作，半导体制造的突破预计也将迎来曙光。

二季度国内经济复苏不及预期，一方面进出口数据走弱，消费低于预期，显示在三年新冠疫情影响下经济修复并非一帆风顺，叠加美国及其西方盟友推动的脱钩断链都对国内经济复苏带来一定的压力；另一方面，以 ChatGPT 为代表的各种人工智能大模型的持续推进，围绕算力所带来的包括光模块、PCB、液冷等受益细分领域受到投资者的追捧，人工智能主题投资也由早期的概念炒作转向业绩支撑。面对错综复杂的国内外政治经济形势，投资者普遍降低了预期，操作上采取及时获利了结的策略，市场表现上体现出行业风格轮动较快的特征。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期内的净值增长率为 23.77%，同期业绩比较基准收益率为 23.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

面对纷繁复杂的国内外形势，尤其是弱于预期的国内经济复苏态势，我们预计下半年国内宏观流动性将保持合理充裕，各项政策将持续发力，下半年经济活动恢复有望加快，整体上有利于投资者信心的修复。随着国内大型科技公司纷纷推出大语言模型，以及行业大语言模型的纷纷落地，GPT 引燃的人工智能技术及应用的又一次科技创新浪潮有望改变并赋能千行百业，TMT 板块的投资机会有望持续并扩散到更多板块。

后疫情时代，全球地缘政治纷繁复杂，地缘政治危机成为影响全球政治经济的最大的不确定性，经济恢复总体上仍然比较脆弱，尤其是在中国经济体量逐步赶超主要发达国家的进程中，主要经济体的博弈和竞争料将带来更多的不确定性。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员

会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。报告期内相关基金估值政策由托管银行进行复核。公司估值委员会由主管运营的公司领导负责，成员包括基金核算、风险管理、行业研究方面业务骨干，均具有丰富的行业分析、会计核算等证券投资基金行业从业经验及专业能力。基金经理如认为估值有被歪曲或有失公允的情况，可向估值委员会报告并提出相关意见和建议。各方不存在任何重大利益冲突，一切以投资者利益最大化为最高准则。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

截至本报告期末，根据本基金基金合同和相关法律法规的规定，本基金无应分配但尚未实施的利润。

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

无。

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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—国泰基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，国泰基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，国泰基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害

基金持有人利益的行为。

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：国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	12,345,406.11	10,695,890.89
结算备付金		9,416,051.36	3,209,700.03
存出保证金		1,459,914.77	380,106.51
交易性金融资产	6.4.7.2	1,857,915,108.38	1,229,746,162.10
其中：股票投资		1,857,915,108.38	1,229,746,162.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		1,009,179.76	731,903.88
应收股利		92,651.90	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	151,682.98	100,954.04
资产总计		1,882,389,995.26	1,244,864,717.45
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		934,914.99	548,589.47
应付托管费		186,982.99	109,717.87

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		17,223.90	9,371.94
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	7,335,630.04	4,589,457.16
负债合计		8,474,751.92	5,257,136.44
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,434,453,447.00	1,174,453,447.00
未分配利润	6.4.7.8	439,461,796.34	65,154,134.01
净资产合计		1,873,915,243.34	1,239,607,581.01
负债和净资产总计		1,882,389,995.26	1,244,864,717.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.3064 元，基金份额总额 1,434,453,447.00 份。

6.2 利润表

会计主体：国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		432,772,115.38	-231,531,689.65
1.利息收入		2,271,951.63	479,873.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	98,976.71	32,155.54
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		2,172,974.92	447,718.39
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		290,753,136.42	-102,438,177.08
其中：股票投资收益	6.4.7.10	281,277,320.70	-108,019,812.19
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	-	-
股利收益	6.4.7.13	9,475,815.72	5,581,635.11
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	127,598,309.49	-130,932,914.29

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	12,148,717.84	1,359,527.79
减：二、营业总支出		5,590,842.82	2,678,085.15
1. 管理人报酬		4,335,454.11	2,042,630.22
2. 托管费		867,090.83	408,526.02
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		-	-
7. 税金及附加		7,822.88	1,611.99
8. 其他费用	6.4.7.16	380,475.00	225,316.92
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		427,181,272.56	-234,209,774.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		427,181,272.56	-234,209,774.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		427,181,272.56	-234,209,774.80

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,174,453,447.00	65,154,134.01	1,239,607,581.01
二、本期期初净资产（基金净值）	1,174,453,447.00	65,154,134.01	1,239,607,581.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	260,000,000.00	374,307,662.33	634,307,662.33
（一）、综合收益总额	-	427,181,272.56	427,181,272.56
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数	260,000,000.00	-52,873,610.23	207,126,389.77

(净值减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	2,710,000,000.00	713,042,220.38	3,423,042,220.38
2.基金赎回款	-2,450,000,000.00	-765,915,830.61	-3,215,915,830.61
(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)	1,434,453,447.00	439,461,796.34	1,873,915,243.34
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	502,453,447.00	214,438,796.37	716,892,243.37
二、本期期初净资产(基金净值)	502,453,447.00	214,438,796.37	716,892,243.37
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	302,000,000.00	-143,620,602.03	158,379,397.97
(一)、综合收益总额	-	-234,209,774.80	-234,209,774.80
(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)	302,000,000.00	90,589,172.77	392,589,172.77
其中：1.基金申购款	614,000,000.00	123,871,803.19	737,871,803.19
2.基金赎回款	-312,000,000.00	-33,282,630.42	-345,282,630.42
(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)	804,453,447.00	70,818,194.34	875,271,641.34

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：周向勇，主管会计工作负责人：倪莹，会计机构负责人：吴洪涛

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]850 号《关于准予国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由国泰基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 618,453,447.00 元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第 0355 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2019 年 7 月 11 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 618,453,447.00 份基金份额，无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为国泰基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]176 号文审核同意，本基金于 2019 年 8 月 16 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非标的指数成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、政府支持机构债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、资产支持证券、同业存单、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。在法律法规允许的情况下，在履行适当程序后，本基金可以参与融资和转融通证券出借。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的 80%且不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证计算机主题指数收益率。

本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，由原国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金转型成了国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“国泰中证计算机主题 ETF 联接基金”)。国泰中证计算机主题 ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人国泰基金管理有限公司于 2023 年 8 月 28 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2023 年半年度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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个

人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	12,345,406.11
等于：本金	12,343,054.75
加：应计利息	2,351.36
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	12,345,406.11

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	1,812,644,374.75	-	1,857,915,108.38	45,270,733.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,812,644,374.75	-	1,857,915,108.38	45,270,733.63

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	-
应计转融通出借证券利息	151,682.98
合计	151,682.98

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	634,917.49
其中：交易所市场	634,917.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
应付指数使用费	134,051.78
可退替代款	5,766.40
应付替代款	6,451,798.43
合计	7,335,630.04

注：1、应付替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差

乘以替代数量的金额。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,174,453,447.00	1,174,453,447.00
本期申购	2,710,000,000.00	2,710,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,450,000,000.00	-2,450,000,000.00
本期末	1,434,453,447.00	1,434,453,447.00

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	100,195,788.58	-35,041,654.57	65,154,134.01
本期利润	299,582,963.07	127,598,309.49	427,181,272.56
本期基金份额交易产生的变动数	76,594,297.28	-129,467,907.51	-52,873,610.23
其中：基金申购款	584,356,364.39	128,685,855.99	713,042,220.38
基金赎回款	-507,762,067.11	-258,153,763.50	-765,915,830.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	476,373,048.93	-36,911,252.59	439,461,796.34

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
	活期存款利息收入
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	41,880.48
其他	7,408.13
合计	98,976.71

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	183,651,891.06
股票投资收益——赎回差价收入	97,625,429.64
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	281,277,320.70

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,420,819,091.74
减：卖出股票成本总额	2,233,454,699.07
减：交易费用	3,712,501.61
买卖股票差价收入	183,651,891.06

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	3,215,915,830.61
减：现金支付赎回款总额	2,136,665,782.61
减：赎回股票成本总额	981,624,618.36
减：交易费用	-
赎回差价收入	97,625,429.64

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.12 衍生工具收益

本基金本报告期内无衍生工具收益。

6.4.7.13 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	9,475,815.72
其中：证券出借权益补偿收入	621,455.43
基金投资产生的股利收益	-
合计	9,475,815.72

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	127,598,309.49
——股票投资	127,598,309.49
——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	127,598,309.49

注：本基金本会计期间公允价值变动损益——股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益。

6.4.7.15 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	-
ETF 替代损益	12,148,717.84
合计	12,148,717.84

注：ETF 替代损益收入是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代证券的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代证券在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.7.16 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	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费用	11,251.82
指数使用费	260,127.24
合计	380,475.00

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000.00 元，且当季日均基金资产净值小于或等于人民币 5000 万元时，无许可使用基点费的收取下限。

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期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
国泰基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“国泰中证计算机主题 ETF 联接”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,335,454.11	2,042,630.22

其中：支付销售机构的客户维护费	-	-
-----------------	---	---

注：支付基金管理人国泰基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	867,090.83	408,526.02

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（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未有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。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未有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。

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

本基金本报告期及上年度可比期间内均无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日

	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
国泰中证计算机主题 ETF 联接	177,744,775.00	12.39%	169,744,775.00	14.45%

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	12,345,406.11	49,688.10	8,841,364.85	19,319.33

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，活期存款按银行同业利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金在本报告期及上年度可比期间未有在承销期间参与关联方承销证券的情况。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688111	金山办公	2023-05-16	6 个月以上	询价转让	400.00	424.54	50,000.00	20,000,000.00	21,227,000.00	-
68824	晶合	2023-0	6 个月	新股	19.86	18.06	6,541.	129,90	118,13	-

9	集成	4-24	以上	锁定 流通 受限			00	4.26	0.46	
68847 2	阿特 斯	2023-0 6-02	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	11.10	17.04	6,156. 00	68,331 .60	104,89 8.24	-
30148 8	豪恩 汽电	2023-0 6-26	1 个月 内 (含)	网下 中签 流通 受限	39.78	39.78	2,356. 00	93,721 .68	93,721 .68	-
30120 2	朗威 股份	2023-0 6-28	1 个月 内 (含)	网下 中签 流通 受限	25.82	25.82	3,060. 00	79,009 .20	79,009 .20	-
30126 1	恒工 精密	2023-0 6-29	1 个月 内 (含)	网下 中签 流通 受限	36.90	36.90	1,973. 00	72,803 .70	72,803 .70	-
30135 8	湖南 裕能	2023-0 2-01	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	23.77	42.89	1,584. 00	37,651 .68	67,937 .76	-
68846 9	中芯 集成	2023-0 4-28	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	5.69	5.41	12,468 .00	70,942 .92	67,451 .88	-
68836 1	中科 飞测	2023-0 5-12	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	23.60	64.67	831.00	19,611 .60	53,740 .77	-
68848 4	南芯 科技	2023-0 3-28	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	39.99	36.71	1,008. 00	40,309 .92	37,003 .68	-
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	9.60	9.41	3,767. 00	36,163 .20	35,447 .47	-
30130 1	川宁 生物	2022-1 2-20	6 个月 以上	新股 锁定 流通 受限	5.00	8.96	3,574. 00	17,870 .00	32,023 .04	-
60106 1	中信 金属	2023-0 3-30	6 个月 以上	新股 锁定	6.58	7.58	4,016. 00	26,425 .28	30,441 .28	-

				流通受限						
688352	顾中科技	2023-04-11	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.10	12.07	2,361.00	28,568.10	28,497.27	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	29.60	71.42	333.00	9,856.80	23,782.86	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	21.17	23.50	956.00	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	30.26	25.33	884.00	26,749.84	22,391.72	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月以上	新股锁定流通受限	43.67	53.05	410.00	17,904.70	21,750.50	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	75.00	90.76	221.00	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	125.80	118.03	163.00	20,505.40	19,238.89	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	245.56	122.11	150.00	36,834.00	18,316.50	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月以上	新股锁定流通受限	32.52	42.37	402.00	13,073.04	17,032.74	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	12.68	22.31	726.00	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通	19.99	16.90	949.00	18,970.51	16,038.10	-

				受限							
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.81	13.73	1,122.00	16,616.82	15,405.06	-	
688334	西高院	2023-06-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	14.16	16.21	888.00	12,574.08	14,394.48	-	
688593	新相微	2023-05-25	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.18	14.59	959.00	10,721.62	13,991.81	-	
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.92	19.16	721.00	15,083.32	13,814.36	-	
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月以上	新股锁定流通受限	23.80	32.84	408.00	9,710.40	13,398.72	-	
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.66	31.50	418.00	11,143.88	13,167.00	-	
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	9.26	18.59	708.00	6,556.08	13,161.72	-	
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月以上	新股锁定流通受限	10.68	12.34	1,016.00	10,850.88	12,537.44	-	
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	73.45	46.64	266.00	19,537.70	12,406.24	-	
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.78	39.78	262.00	10,422.36	10,422.36	-	
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月以上	新股锁定流通受限	33.99	29.49	332.00	11,284.68	9,790.68	-	

301323	新莱福	2023-05-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	39.06	39.36	228.00	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月以上	新股锁定流通受限	19.20	25.53	346.00	6,643.20	8,833.38	-
688507	索辰科技	2023-06-20	1-6 个月(含)	送股	-	122.11	72.00	-	8,791.92	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	35.00	51.23	161.00	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定流通受限	11.66	12.26	664.00	7,742.24	8,140.64	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月以上	新股锁定流通受限	37.40	36.07	215.00	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6 个月以上	新股锁定流通受限	46.13	34.40	225.00	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月以上	新股锁定流通受限	32.60	30.37	232.00	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	26.35	30.60	229.00	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	25.98	24.53	160.00	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月以上	新股锁定流通受限	20.68	25.49	145.00	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月以上	新股锁定	15.38	14.87	177.00	2,722.26	2,631.99	-

				流通受限						
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月以上	新股锁定流通受限	15.90	17.09	139.00	2,210.10	2,375.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月以上	新股锁定流通受限	18.88	19.60	114.00	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月以上	新股锁定流通受限	44.48	39.48	55.00	2,446.40	2,171.40	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

2、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无银行间市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无交易所市场债券正回购中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量(单位：股)	期末估值总额
1	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	67.96	113,000.00	7,679,480.00
2	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日	67.96	113,000.00	7,679,480.00

			-2023 年 7 月 27 日			0
3	688111	金山办公	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	472.2 2	11,600.00	5,477,752.0 0
4	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	67.96	65,000.00	4,417,400.0 0
5	688111	金山办公	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	472.2 2	9,000.00	4,249,980.0 0
6	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	67.96	60,000.00	4,077,600.0 0
7	688111	金山办公	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	472.2 2	8,000.00	3,777,760.0 0
8	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	48.50	63,000.00	3,055,500.0 0
9	002415	海康威视	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	33.11	92,000.00	3,046,120.0 0
10	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	48.50	55,000.00	2,667,500.0 0
11	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	48.50	52,800.00	2,560,800.0 0
12	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	67.96	36,000.00	2,446,560.0 0
13	603019	中科曙光	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	50.90	47,600.00	2,422,840.0 0
14	300033	同花顺	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	175.2 8	13,300.00	2,331,224.0 0
15	000066	中国长城	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	13.83	167,000.00	2,309,610.0 0
16	002415	海康威视	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	33.11	69,000.00	2,284,590.0 0
17	300033	同花顺	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	175.2 8	12,800.00	2,243,584.0 0
18	000938	紫光股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	31.85	70,000.00	2,229,500.0 0
19	300496	中科创达	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	96.35	23,000.00	2,216,050.0 0
20	600570	恒生电子	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	44.29	46,600.00	2,063,914.0 0
21	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	67.96	25,500.00	1,732,980.0 0
22	600570	恒生电子	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	44.29	39,000.00	1,727,310.0 0
23	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	12.54	131,000.00	1,642,740.0 0
24	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日	12.54	131,000.00	1,642,740.0

			-2023 年 7 月 28 日			0
25	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	12.54	131,000.00	1,642,740.0 0
26	601360	三六零	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	12.54	130,700.00	1,638,978.0 0
27	002236	大华股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	19.75	80,900.00	1,597,775.0 0
28	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.50	32,900.00	1,595,650.0 0
29	002405	四维图新	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	11.58	135,000.00	1,563,300.0 0
30	601360	三六零	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	12.54	122,600.00	1,537,404.0 0
31	603019	中科曙光	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	50.90	30,000.00	1,527,000.0 0
32	300496	中科创达	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	96.35	15,600.00	1,503,060.0 0
33	600570	恒生电子	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	44.29	33,400.00	1,479,286.0 0
34	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	48.50	29,700.00	1,440,450.0 0
35	000938	紫光股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	31.85	45,000.00	1,433,250.0 0
36	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	67.96	20,900.00	1,420,364.0 0
37	688111	金山办公	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	472.2 2	3,000.00	1,416,660.0 0
38	002415	海康威视	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	33.11	40,700.00	1,347,577.0 0
39	603019	中科曙光	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	50.90	26,400.00	1,343,760.0 0
40	603019	中科曙光	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	50.90	26,200.00	1,333,580.0 0
41	600570	恒生电子	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	44.29	30,000.00	1,328,700.0 0
42	000066	中国长城	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	13.83	91,000.00	1,258,530.0 0
43	600100	同方股份	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	8.12	150,000.00	1,218,000.0 0
44	600100	同方股份	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	8.12	150,000.00	1,218,000.0 0
45	603019	中科曙光	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	50.90	23,700.00	1,206,330.0 0
46	300339	润和软件	2023 年 6 月 21 日	23.96	50,000.00	1,198,000.0

			-2023 年 7 月 5 日			0
47	002439	启明星辰	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	29.76	40,000.00	1,190,400.0 0
48	688111	金山办公	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	472.2 2	2,500.00	1,180,550.0 0
49	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	67.96	17,300.00	1,175,708.0 0
50	603019	中科曙光	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	50.90	23,000.00	1,170,700.0 0
51	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	67.96	17,100.00	1,162,116.0 0
52	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	67.96	17,000.00	1,155,320.0 0
53	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	67.96	16,800.00	1,141,728.0 0
54	300033	同花顺	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	175.2 8	6,400.00	1,121,792.0 0
55	603613	国联股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	36.93	30,000.00	1,107,900.0 0
56	002236	大华股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 19 日	19.75	55,200.00	1,090,200.0 0
57	002236	大华股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	19.75	54,000.00	1,066,500.0 0
58	600845	宝信软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 17 日	50.81	20,900.00	1,061,929.0 0
59	000997	新大陆	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	18.90	55,900.00	1,056,510.0 0
60	600570	恒生电子	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	44.29	23,800.00	1,054,102.0 0
61	600845	宝信软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 19 日	50.81	20,400.00	1,036,524.0 0
62	002415	海康威视	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 17 日	33.11	31,300.00	1,036,343.0 0
63	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	46.88	21,800.00	1,021,984.0 0
64	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	48.50	21,000.00	1,018,500.0 0
65	603019	中科曙光	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	50.90	20,000.00	1,018,000.0 0
66	002373	千方科技	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	13.64	73,000.00	995,720.00
67	000938	紫光股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	31.85	31,000.00	987,350.00
68	002368	太极股份	2023 年 6 月 21 日	41.17	23,800.00	979,846.00

			-2023 年 7 月 19 日			
69	300682	朗新科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.28	41,700.00	970,776.00
70	002236	大华股份	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	19.75	48,400.00	955,900.00
71	000938	紫光股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	31.85	29,900.00	952,315.00
72	002368	太极股份	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	41.17	23,000.00	946,910.00
73	688111	金山办公	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	472.2 2	2,000.00	944,440.00
74	688111	金山办公	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	472.2 2	2,000.00	944,440.00
75	000938	紫光股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	31.85	29,600.00	942,760.00
76	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	46.88	20,100.00	942,288.00
77	002410	广联达	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 17 日	32.49	28,800.00	935,712.00
78	000938	紫光股份	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 26 日	31.85	29,200.00	930,020.00
79	000938	紫光股份	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	31.85	29,000.00	923,650.00
80	000938	紫光股份	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	31.85	29,000.00	923,650.00
81	000938	紫光股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	31.85	29,000.00	923,650.00
82	000938	紫光股份	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 17 日	31.85	28,000.00	891,800.00
83	002065	东华软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	7.06	126,000.00	889,560.00
84	300339	润和软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	23.96	37,000.00	886,520.00
85	688561	奇安信	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	51.81	17,000.00	880,770.00
86	601360	三六零	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	12.54	70,000.00	877,800.00
87	000021	深科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	19.99	42,600.00	851,574.00
88	002410	广联达	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	32.49	26,000.00	844,740.00
89	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	46.88	18,000.00	843,840.00
90	600588	用友网络	2023 年 6 月 14 日	20.50	41,000.00	840,500.00

			-2023 年 7 月 12 日			
91	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	67.96	12,200.00	829,112.00
92	002405	四维图新	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	11.58	71,400.00	826,812.00
93	002402	和而泰	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	16.98	48,000.00	815,040.00
94	000997	新大陆	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	18.90	43,000.00	812,700.00
95	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	8.12	100,000.00	812,000.00
96	002065	东华软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 19 日	7.06	113,000.00	797,780.00
97	002236	大华股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	19.75	40,300.00	795,925.00
98	300496	中科创达	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	96.35	8,200.00	790,070.00
99	002236	大华股份	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	19.75	40,000.00	790,000.00
100	002236	大华股份	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	19.75	39,600.00	782,100.00
101	300383	光环新网	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	10.75	72,000.00	774,000.00
102	002439	启明星辰	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	29.76	26,000.00	773,760.00
103	603019	中科曙光	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	50.90	15,200.00	773,680.00
104	603927	中科软	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	38.56	19,800.00	763,488.00
105	300682	朗新科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	23.28	32,600.00	758,928.00
106	002268	电科网安	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	27.87	26,900.00	749,703.00
107	000021	深科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	19.99	37,300.00	745,627.00
108	002230	科大讯飞	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	67.96	10,600.00	720,376.00
109	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	6.13	117,000.00	717,210.00
110	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	6.13	117,000.00	717,210.00
111	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	6.13	117,000.00	717,210.00
112	002335	科华数据	2023 年 6 月 8 日	35.95	19,800.00	711,810.00

			-2023 年 7 月 6 日			
113	600845	宝信软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	50.81	14,000.00	711,340.00
114	603019	中科曙光	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	50.90	13,900.00	707,510.00
115	603019	中科曙光	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	50.90	13,800.00	702,420.00
116	300033	同花顺	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	175.28	4,000.00	701,120.00
117	300803	指南针	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	48.59	14,400.00	699,696.00
118	300454	深信服	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	113.25	6,100.00	690,825.00
119	002180	纳思达	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	34.25	20,000.00	685,000.00
120	002180	纳思达	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	34.25	20,000.00	685,000.00
121	300496	中科创达	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	96.35	7,000.00	674,450.00
122	000977	浪潮信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	48.50	13,800.00	669,300.00
123	002153	石基信息	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	14.00	47,800.00	669,200.00
124	688111	金山办公	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	472.22	1,400.00	661,108.00
125	600845	宝信软件	2023 年 6 月 8 日 -2023 年 7 月 6 日	50.81	13,000.00	660,530.00
126	002236	大华股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	19.75	33,000.00	651,750.00
127	000997	新大陆	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 7 日	18.90	34,000.00	642,600.00
128	002415	海康威视	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	33.11	19,400.00	642,334.00
129	603019	中科曙光	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	50.90	12,500.00	636,250.00
130	603613	国联股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	36.93	17,100.00	631,503.00
131	603019	中科曙光	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	50.90	12,400.00	631,160.00
132	300454	深信服	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 7 日	113.25	5,500.00	622,875.00
133	000938	紫光股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	31.85	19,500.00	621,075.00
134	600536	中国软件	2023 年 6 月 29 日	46.88	13,200.00	618,816.00

			-2023 年 7 月 27 日			
135	000938	紫光股份	2023 年 6 月 16 日 -2023 年 7 月 14 日	31.85	19,100.00	608,335.00
136	600588	用友网络	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	20.50	29,200.00	598,600.00
137	300496	中科创达	2023 年 6 月 12 日 -2023 年 7 月 10 日	96.35	6,100.00	587,735.00
138	600131	国网信通	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	20.19	29,000.00	585,510.00
139	603019	中科曙光	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	50.90	11,300.00	575,170.00
140	002405	四维图新	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	11.58	49,400.00	572,052.00
141	688568	中科星图	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	80.58	7,000.00	564,060.00
142	688568	中科星图	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	80.58	7,000.00	564,060.00
143	600536	中国软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	46.88	12,000.00	562,560.00
144	002410	广联达	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	32.49	17,200.00	558,828.00
145	000021	深科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	19.99	27,500.00	549,725.00
146	300682	朗新科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	23.28	23,500.00	547,080.00
147	002405	四维图新	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	11.58	47,000.00	544,260.00
148	301236	软通动力	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	27.21	20,000.00	544,200.00
149	300496	中科创达	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	96.35	5,600.00	539,560.00
150	000066	中国长城	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	13.83	39,000.00	539,370.00
151	300803	指南针	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	48.59	11,000.00	534,490.00
152	300803	指南针	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	48.59	11,000.00	534,490.00
153	601360	三六零	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	12.54	42,100.00	527,934.00
154	000938	紫光股份	2023 年 6 月 16 日 -2023 年 7 月 14 日	31.85	16,000.00	509,600.00
155	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	13.05	38,000.00	495,900.00
156	002152	广电运通	2023 年 6 月 29 日	11.72	42,300.00	495,756.00

			-2023 年 7 月 27 日			
157	300383	光环新网	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	10.75	45,700.00	491,275.00
158	301236	软通动力	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	27.21	18,000.00	489,780.00
159	300383	光环新网	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	10.75	45,000.00	483,750.00
160	300496	中科创达	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	96.35	5,000.00	481,750.00
161	002236	大华股份	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	19.75	24,300.00	479,925.00
162	000021	深科技	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	19.99	24,000.00	479,760.00
163	601360	三六零	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	12.54	38,200.00	479,028.00
164	600536	中国软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	46.88	10,200.00	478,176.00
165	002439	启明星辰	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	29.76	16,000.00	476,160.00
166	688111	金山办公	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	472.2 2	1,000.00	472,220.00
167	688111	金山办公	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 19 日	472.2 2	1,000.00	472,220.00
168	300682	朗新科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.28	20,000.00	465,600.00
169	002152	广电运通	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	11.72	39,100.00	458,252.00
170	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	13.05	35,000.00	456,750.00
171	002153	石基信息	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	14.00	32,400.00	453,600.00
172	300454	深信服	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	113.2 5	4,000.00	453,000.00
173	002439	启明星辰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	15,200.00	452,352.00
174	300339	润和软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.96	18,800.00	450,448.00
175	002402	和而泰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	16.98	26,000.00	441,480.00
176	300383	光环新网	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	10.75	41,000.00	440,750.00
177	002236	大华股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	19.75	21,800.00	430,550.00
178	603613	国联股份	2023 年 6 月 29 日	36.93	11,600.00	428,388.00

			-2023 年 7 月 13 日			
179	002065	东华软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	7.06	60,000.00	423,600.00
180	601360	三六零	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	12.54	33,700.00	422,598.00
181	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	13.05	32,000.00	417,600.00
182	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	13.05	32,000.00	417,600.00
183	000938	紫光股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	31.85	13,100.00	417,235.00
184	600570	恒生电子	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	44.29	9,400.00	416,326.00
185	300682	朗新科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.28	17,700.00	412,056.00
186	002368	太极股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	41.17	10,000.00	411,700.00
187	000021	深科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	19.99	20,000.00	399,800.00
188	000021	深科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	19.99	20,000.00	399,800.00
189	603927	中科软	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	38.56	10,300.00	397,168.00
190	002065	东华软件	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	7.06	56,000.00	395,360.00
191	300339	润和软件	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	23.96	16,400.00	392,944.00
192	600588	用友网络	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	20.50	19,000.00	389,500.00
193	002415	海康威视	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	33.11	11,700.00	387,387.00
194	002439	启明星辰	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	29.76	13,000.00	386,880.00
195	603927	中科软	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	38.56	10,000.00	385,600.00
196	000938	紫光股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	31.85	12,000.00	382,200.00
197	301236	软通动力	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	27.21	14,000.00	380,940.00
198	603613	国联股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	36.93	10,300.00	380,379.00
199	000021	深科技	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	19.99	19,000.00	379,810.00
200	688232	新点软件	2023 年 6 月 13 日	53.81	7,000.00	376,670.00

			-2023 年 7 月 11 日			
201	600100	同方股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	8.12	46,000.00	373,520.00
202	002065	东华软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	7.06	52,700.00	372,062.00
203	300383	光环新网	2023 年 6 月 12 日 -2023 年 7 月 10 日	10.75	34,500.00	370,875.00
204	603613	国联股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	36.93	10,000.00	369,300.00
205	603613	国联股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	36.93	10,000.00	369,300.00
206	300253	卫宁健康	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	10.82	34,000.00	367,880.00
207	000021	深科技	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	19.99	18,400.00	367,816.00
208	002415	海康威视	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	33.11	11,100.00	367,521.00
209	000938	紫光股份	2023 年 6 月 12 日 -2023 年 7 月 10 日	31.85	11,500.00	366,275.00
210	300339	润和软件	2023 年 6 月 12 日 -2023 年 7 月 10 日	23.96	15,200.00	364,192.00
211	002153	石基信息	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	14.00	25,900.00	362,600.00
212	002335	科华数据	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	35.95	10,000.00	359,500.00
213	300339	润和软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	23.96	15,000.00	359,400.00
214	300383	光环新网	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	10.75	33,000.00	354,750.00
215	002439	启明星辰	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 7 日	29.76	11,700.00	348,192.00
216	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	8.12	42,400.00	344,288.00
217	000021	深科技	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	19.99	17,100.00	341,829.00
218	603927	中科软	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 26 日	38.56	8,700.00	335,472.00
219	002268	电科网安	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	27.87	12,000.00	334,440.00
220	000997	新大陆	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	18.90	17,500.00	330,750.00
221	600588	用友网络	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	20.50	16,000.00	328,000.00
222	600845	宝信软件	2023 年 6 月 19 日	50.81	6,400.00	325,184.00

			-2023 年 7 月 3 日			
223	600131	国网信通	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	20.19	16,000.00	323,040.00
224	002402	和而泰	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	16.98	19,000.00	322,620.00
225	000997	新大陆	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	18.90	17,000.00	321,300.00
226	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	12.54	25,400.00	318,516.00
227	000938	紫光股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	31.85	10,000.00	318,500.00
228	000021	深科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	19.99	15,800.00	315,842.00
229	300383	光环新网	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	10.75	29,000.00	311,750.00
230	688561	奇安信	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	51.81	6,000.00	310,860.00
231	688561	奇安信	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	51.81	6,000.00	310,860.00
232	002065	东华软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	7.06	44,000.00	310,640.00
233	603927	中科软	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	38.56	8,000.00	308,480.00
234	601360	三六零	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 4 日	12.54	24,300.00	304,722.00
235	300682	朗新科技	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	23.28	13,000.00	302,640.00
236	600271	航天信息	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	13.69	22,000.00	301,180.00
237	002373	千方科技	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	13.64	22,000.00	300,080.00
238	002236	大华股份	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	19.75	14,800.00	292,300.00
239	688083	中望软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	144.8 9	2,000.00	289,780.00
240	002368	太极股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	41.17	7,000.00	288,190.00
241	300339	润和软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	23.96	11,800.00	282,728.00
242	300803	指南针	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	48.59	5,800.00	281,822.00
243	600536	中国软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 17 日	46.88	6,000.00	281,280.00
244	002152	广电运通	2023 年 6 月 14 日	11.72	24,000.00	281,280.00

			-2023 年 7 月 12 日			
245	002180	纳思达	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	34.25	8,200.00	280,850.00
246	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	13.05	21,400.00	279,270.00
247	600100	同方股份	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 26 日	8.12	34,000.00	276,080.00
248	600588	用友网络	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	20.50	13,400.00	274,700.00
249	600536	中国软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	46.88	5,700.00	267,216.00
250	600100	同方股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	8.12	32,800.00	266,336.00
251	000997	新大陆	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	18.90	14,000.00	264,600.00
252	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	13.05	20,000.00	261,000.00
253	300253	卫宁健康	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	10.82	24,000.00	259,680.00
254	000021	深科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	19.99	12,800.00	255,872.00
255	603019	中科曙光	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	50.90	5,000.00	254,500.00
256	002139	拓邦股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	13.05	19,400.00	253,170.00
257	300339	润和软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	23.96	10,500.00	251,580.00
258	002152	广电运通	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	11.72	21,000.00	246,120.00
259	002065	东华软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	7.06	34,300.00	242,158.00
260	688568	中科星图	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	80.58	3,000.00	241,740.00
261	688568	中科星图	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	80.58	3,000.00	241,740.00
262	002153	石基信息	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	14.00	17,200.00	240,800.00
263	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 13 日 -2023 年 7 月 11 日	6.13	38,500.00	236,005.00
264	002373	千方科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	13.64	17,300.00	235,972.00
265	002065	东华软件	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	7.06	33,200.00	234,392.00
266	002373	千方科技	2023 年 6 月 20 日	13.64	16,000.00	218,240.00

			-2023 年 7 月 4 日			
267	002152	广电运通	2023 年 6 月 7 日 -2023 年 7 月 5 日	11.72	18,300.00	214,476.00
268	002405	四维图新	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	11.58	18,400.00	213,072.00
269	600131	国网信通	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	20.19	10,500.00	211,995.00
270	002405	四维图新	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	11.58	18,000.00	208,440.00
271	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	6.13	34,000.00	208,420.00
272	002368	太极股份	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	41.17	5,000.00	205,850.00
273	601360	三六零	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	12.54	16,400.00	205,656.00
274	002065	东华软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	7.06	29,000.00	204,740.00
275	002373	千方科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	13.64	15,000.00	204,600.00
276	600131	国网信通	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	20.19	10,000.00	201,900.00
277	002373	千方科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 25 日	13.64	14,700.00	200,508.00
278	300803	指南针	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	48.59	4,000.00	194,360.00
279	002415	海康威视	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	33.11	5,800.00	192,038.00
280	002373	千方科技	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	13.64	14,000.00	190,960.00
281	002373	千方科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	13.64	13,800.00	188,232.00
282	688066	航天宏图	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	60.90	3,000.00	182,700.00
283	002153	石基信息	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	14.00	13,000.00	182,000.00
284	600570	恒生电子	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	44.29	4,100.00	181,589.00
285	002180	纳思达	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 18 日	34.25	5,300.00	181,525.00
286	300383	光环新网	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	10.75	16,800.00	180,600.00
287	002152	广电运通	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	11.72	15,000.00	175,800.00
288	300803	指南针	2023 年 6 月 30 日	48.59	3,600.00	174,924.00

			-2023 年 7 月 14 日			
289	002405	四维图新	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 28 日	11.58	15,100.00	174,858.00
290	002153	石基信息	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	14.00	12,000.00	168,000.00
291	603613	国联股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 12 日	36.93	4,500.00	166,185.00
292	300339	润和软件	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.96	6,900.00	165,324.00
293	301236	软通动力	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 25 日	27.21	6,000.00	163,260.00
294	301236	软通动力	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	27.21	6,000.00	163,260.00
295	688568	中科星图	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	80.58	2,000.00	161,160.00
296	002415	海康威视	2023 年 6 月 15 日 -2023 年 7 月 13 日	33.11	4,600.00	152,306.00
297	002439	启明星辰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	29.76	5,100.00	151,776.00
298	688232	新点软件	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	53.81	2,800.00	150,668.00
299	688561	奇安信	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	51.81	2,900.00	150,249.00
300	002065	东华软件	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	7.06	20,900.00	147,554.00
301	002335	科华数据	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	35.95	4,000.00	143,800.00
302	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	8.12	17,500.00	142,100.00
303	002180	纳思达	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 3 日	34.25	4,100.00	140,425.00
304	002373	千方科技	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	13.64	10,200.00	139,128.00
305	601360	三六零	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	12.54	10,900.00	136,686.00
306	301236	软通动力	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	27.21	5,000.00	136,050.00
307	600845	宝信软件	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 6 日	50.81	2,600.00	132,106.00
308	002152	广电运通	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	11.72	11,200.00	131,264.00
309	300339	润和软件	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	23.96	5,200.00	124,592.00
310	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日	8.12	15,100.00	122,612.00

			-2023 年 7 月 10 日			
311	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	6.13	20,000.00	122,600.00
312	300339	润和软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	23.96	5,000.00	119,800.00
313	300339	润和软件	2023 年 6 月 9 日 -2023 年 7 月 7 日	23.96	5,000.00	119,800.00
314	300339	润和软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	23.96	5,000.00	119,800.00
315	002402	和而泰	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	16.98	7,000.00	118,860.00
316	300682	朗新科技	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	23.28	5,100.00	118,728.00
317	688083	中望软件	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 12 日	144.8 9	800.00	115,912.00
318	300339	润和软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 24 日	23.96	4,800.00	115,008.00
319	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	8.12	14,100.00	114,492.00
320	600100	同方股份	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	8.12	13,900.00	112,868.00
321	600100	同方股份	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	8.12	13,800.00	112,056.00
322	300383	光环新网	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	10.75	10,200.00	109,650.00
323	688232	新点软件	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	53.81	2,000.00	107,620.00
324	600100	同方股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	8.12	13,200.00	107,184.00
325	600570	恒生电子	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	44.29	2,400.00	106,296.00
326	002065	东华软件	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	7.06	15,000.00	105,900.00
327	002152	广电运通	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	11.72	9,000.00	105,480.00
328	301308	江波龙	2023 年 6 月 14 日 -2023 年 7 月 12 日	101.7 6	1,000.00	101,760.00
329	688568	中科星图	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	80.58	1,200.00	96,696.00
330	002368	太极股份	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	41.17	2,300.00	94,691.00
331	002373	千方科技	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	13.64	6,000.00	81,840.00
332	301236	软通动力	2023 年 6 月 20 日	27.21	3,000.00	81,630.00

			-2023 年 7 月 12 日			
333	000938	紫光股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	31.85	2,500.00	79,625.00
334	600100	同方股份	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	8.12	8,900.00	72,268.00
335	002152	广电运通	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	11.72	6,000.00	70,320.00
336	002152	广电运通	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	11.72	6,000.00	70,320.00
337	300383	光环新网	2023 年 6 月 6 日 -2023 年 7 月 4 日	10.75	6,500.00	69,875.00
338	002405	四维图新	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 27 日	11.58	6,000.00	69,480.00
339	603927	中科软	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	38.56	1,800.00	69,408.00
340	603927	中科软	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	38.56	1,800.00	69,408.00
341	002402	和而泰	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	16.98	4,000.00	67,920.00
342	002415	海康威视	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	33.11	1,900.00	62,909.00
343	300253	卫宁健康	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	10.82	5,800.00	62,756.00
344	002402	和而泰	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	16.98	3,600.00	61,128.00
345	002415	海康威视	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	33.11	1,800.00	59,598.00
346	002439	启明星辰	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	29.76	2,000.00	59,520.00
347	002152	广电运通	2023 年 6 月 29 日 -2023 年 7 月 13 日	11.72	5,000.00	58,600.00
348	002153	石基信息	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 4 日	14.00	3,900.00	54,600.00
349	002153	石基信息	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 12 日	14.00	3,600.00	50,400.00
350	603927	中科软	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	38.56	1,300.00	50,128.00
351	301236	软通动力	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	27.21	1,800.00	48,978.00
352	002335	科华数据	2023 年 6 月 28 日 -2023 年 7 月 12 日	35.95	1,000.00	35,950.00
353	002335	科华数据	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	35.95	1,000.00	35,950.00
354	002152	广电运通	2023 年 6 月 26 日	11.72	3,000.00	35,160.00

			-2023 年 7 月 10 日			
355	002065	东华软件	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	7.06	4,000.00	28,240.00
356	300383	光环新网	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	10.75	2,600.00	27,950.00
357	002373	千方科技	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	13.64	1,600.00	21,824.00
358	600588	用友网络	2023 年 6 月 5 日 -2023 年 7 月 3 日	20.50	1,000.00	20,500.00
359	300253	卫宁健康	2023 年 6 月 21 日 -2023 年 7 月 5 日	10.82	1,500.00	16,230.00
360	002373	千方科技	2023 年 6 月 30 日 -2023 年 7 月 14 日	13.64	1,000.00	13,640.00
361	002373	千方科技	2023 年 6 月 19 日 -2023 年 7 月 3 日	13.64	1,000.00	13,640.00
362	002373	千方科技	2023 年 6 月 20 日 -2023 年 7 月 4 日	13.64	1,000.00	13,640.00
363	300253	卫宁健康	2023 年 6 月 27 日 -2023 年 7 月 11 日	10.82	1,000.00	10,820.00
364	600225	卓朗科技	2023 年 6 月 26 日 -2023 年 7 月 10 日	6.13	1,000.00	6,130.00
合计	-	-	-	-	9,085,000.00	245,339,701.00

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金，属于较高风险、较高收益的基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金投资目标:紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全员与全程结合、风控与发展并重的风险管理理念。董事会主要负责公司的风险管理战略和控制政策、协调突发重大风险等事项。在公司经营管理层下设风险管理委员会，制定公司日常经营过程中各类风险的防范和管理措施；在业务操作层面，一线业务部门负责对各自业务领域风险的管控，公司具体的风险管理职责由风险管理部、审计部和稽核监察部负责，组织、协调并与各业务部门一道，共同完成对法律风险、投资风险、操作风险、合规风险等风险类别的管理，并定期向公司专门的风险管理委员会报告公司风险状况。风险管理部和稽核监察部由督察长分管，配置有法律、风控、信息披露等方面专业人员。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有信用类债券比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成分股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于 2023 年 06 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、存出保证金及结算备付金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	12,345,406.11	-	-	-	12,345,406.11
结算备付金	9,416,051.36	-	-	-	9,416,051.36
存出保证金	1,459,914.77	-	-	-	1,459,914.77
交易性金融资产	-	-	-	1,857,915,108.38	1,857,915,108.38
应收清算款	-	-	-	1,009,179.76	1,009,179.76
应收股利	-	-	-	92,651.90	92,651.90
其他资产	-	-	-	151,682.98	151,682.98
资产总计	23,221,372.24	-	-	1,859,168,623.02	1,882,389,995.26
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	934,914.99	934,914.99
应付托管费	-	-	-	186,982.99	186,982.99
应交税费	-	-	-	17,223.90	17,223.90
其他负债	-	-	-	7,335,630.04	7,335,630.04
负债总计	-	-	-	8,474,751.92	8,474,751.92
利率敏感度缺口	23,221,372.24	-	-	1,850,693,871.10	1,873,915,243.34
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	10,695,890.89	-	-	-	10,695,890.89
结算备付金	3,209,700.03	-	-	-	3,209,700.03
存出保证金	380,106.51	-	-	-	380,106.51
交易性金融资产	-	-	-	1,229,746,162.10	1,229,746,162.10
应收清算款	-	-	-	731,903.88	731,903.88
其他资产	-	-	-	100,954.04	100,954.04
资产总计	14,285,697.43	-	-	1,230,579,020.02	1,244,864,717.45
负债					

应付管理人报酬	-	-	-	548,589.47	548,589.47
应付托管费	-	-	-	109,717.87	109,717.87
应交税费	-	-	-	9,371.94	9,371.94
其他负债	-	-	-	4,589,457.16	4,589,457.16
负债总计	-	-	-	5,257,136.44	5,257,136.44
利率敏感度缺口	14,285,697.43	-	-	1,225,321,883.58	1,239,607,581.01

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为 0.00%（2022 年 12 月 31 日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022 年 12 月 31 日：同）。

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

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于上市交易的证券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险，严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2023 年 6 月 30 日		2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,857,915,108.38	99.15	1,229,746,162.10	99.20
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,857,915,108.38	99.15	1,229,746,162.10	99.20

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准外的其他市场变量不变		
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: 人民币万元)	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	增加约 9,318	增加约 6,175
	业绩比较基准下降 5%	减少约 9,318	减少约 6,175

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	上年度末
---------------	-----	------

	2023 年 6 月 30 日	2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,835,437,669.26	1,228,761,607.16
第二层次	287,979.98	-
第三层次	22,189,459.14	984,554.94
合计	1,857,915,108.38	1,229,746,162.10

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022 年 12 月 31 日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 基金申购款

于 2023 年上半年度，本基金申购基金份额的对价总额为 3,423,042,220.38 元，其中包括以股票支付的申购款 1,141,183,563.22 元和以现金支付的申购款 2,281,858,657.16 元。

(2) 除基金申购款外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	1,857,915,108.38	98.70
	其中：股票	1,857,915,108.38	98.70

2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	21,761,457.47	1.16
8	其他各项资产	2,713,429.41	0.14
9	合计	1,882,389,995.26	100.00

注：（1）上述股票投资包括可退替代款估值增值。

（2）报告期内，本基金参与转融通证券出借业务遵循持有人利益优先原则，基金管理人根据法律法规以及公司相关风险管理制度对重大关联交易进行管理，交易按照市场公平合理价格执行，不存在从事利益输送及其他不正当交易活动的情况。报告期末，本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 245,339,701.00 元，占基金资产净值比例为 13.09%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 指数投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	701,793,886.11	37.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-

F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,078,164,181.14	57.54
J	金融业	63,355,809.01	3.38
K	房地产业	13,350,527.00	0.71
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,856,664,403.26	99.08

7.2.2 积极投资期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,047,568.76	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	30,441.28	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	80,548.12	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,250,439.12	0.07

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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	5,992,045	198,396,609.95	10.59
2	002230	科大讯飞	2,372,654	161,245,565.84	8.60
3	688111	金山办公	239,120	110,533,246.40	5.90
4	000938	紫光股份	2,928,560	93,274,636.00	4.98
5	600570	恒生电子	1,947,459	86,252,959.11	4.60
6	603019	中科曙光	1,498,861	76,292,024.90	4.07
7	000977	浪潮信息	1,315,030	63,778,955.00	3.40
8	601360	三六零	4,573,600	57,352,944.00	3.06
9	002410	广联达	1,704,280	55,372,057.20	2.95
10	600588	用友网络	2,636,277	54,043,678.50	2.88
11	300033	同花顺	273,900	48,009,192.00	2.56
12	600845	宝信软件	920,516	46,771,417.96	2.50
13	002180	纳思达	1,267,064	43,396,942.00	2.32
14	002236	大华股份	2,126,443	41,997,249.25	2.24
15	300496	中科创达	407,666	39,278,619.10	2.10
16	300454	深信服	324,498	36,749,398.50	1.96
17	600536	中国软件	769,018	36,051,563.84	1.92
18	002405	四维图新	3,041,950	35,225,781.00	1.88
19	000066	中国长城	2,475,000	34,229,250.00	1.83
20	002439	启明星辰	853,082	25,387,720.32	1.35
21	300339	润和软件	1,021,800	24,482,328.00	1.31
22	600100	同方股份	3,002,116	24,377,181.92	1.30
23	603613	国联股份	649,507	23,986,293.51	1.28

24	000021	深科技	1,196,300	23,914,037.00	1.28
25	300253	卫宁健康	2,197,600	23,778,032.00	1.27
26	002368	太极股份	556,933	22,928,931.61	1.22
27	002268	电科网安	754,587	21,030,339.69	1.12
28	002065	东华软件	2,873,531	20,287,128.86	1.08
29	002402	和而泰	1,189,662	20,200,460.76	1.08
30	000997	新大陆	1,055,207	19,943,412.30	1.06
31	300383	光环新网	1,839,500	19,774,625.00	1.06
32	300682	朗新科技	840,300	19,562,184.00	1.04
33	600271	航天信息	1,422,967	19,480,418.23	1.04
34	002373	千方科技	1,414,900	19,299,236.00	1.03
35	002152	广电运通	1,592,000	18,658,240.00	1.00
36	688561	奇安信	350,075	18,137,385.75	0.97
37	603927	中科软	459,000	17,699,040.00	0.94
38	002139	拓邦股份	1,294,525	16,893,551.25	0.90
39	300803	指南针	315,839	15,346,617.01	0.82
40	002335	科华数据	411,899	14,807,769.05	0.79
41	002153	石基信息	1,046,795	14,655,130.00	0.78
42	688066	航天宏图	235,130	14,319,417.00	0.76
43	600225	卓朗科技	2,177,900	13,350,527.00	0.71
44	301236	软通动力	485,399	13,207,706.79	0.70
45	600131	国网信通	612,600	12,368,394.00	0.66
46	688083	中望软件	81,376	11,790,568.64	0.63
47	688568	中科星图	123,415	9,944,780.70	0.53
48	300442	润泽科技	245,380	7,547,888.80	0.40
49	688232	新点软件	124,592	6,704,295.52	0.36
50	301308	江波龙	44,700	4,548,672.00	0.24

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688249	晶合集成	6,541	118,130.46	0.01
2	688472	阿特斯	6,156	104,898.24	0.01
3	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
4	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
5	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
6	301358	湖南裕能	1,584	67,937.76	0.00
7	688469	中芯集成	12,468	67,451.88	0.00
8	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
9	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
10	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00

11	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
12	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
13	688352	硕中科技	2,361	28,497.27	0.00
14	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
15	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
16	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
17	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
18	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
19	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
20	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
21	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
22	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
23	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
24	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
25	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
26	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
27	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
28	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
29	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
30	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
31	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
32	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
33	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
34	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
35	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
36	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
37	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
38	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
39	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
40	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
41	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
42	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
43	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
44	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
45	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
46	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
47	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资
----	------	------	----------	--------

				产净值比例 (%)
1	002415	海康威视	426,746,061.02	34.43
2	002230	科大讯飞	252,012,153.08	20.33
3	000938	紫光股份	152,687,943.95	12.32
4	002410	广联达	135,132,324.42	10.90
5	002180	纳思达	100,177,538.62	8.08
6	000977	浪潮信息	93,197,692.37	7.52
7	002236	大华股份	89,956,790.17	7.26
8	300454	深信服	87,418,104.51	7.05
9	300033	同花顺	84,836,786.87	6.84
10	300496	中科创达	79,378,382.15	6.40
11	002405	四维图新	71,135,008.82	5.74
12	000066	中国长城	57,312,383.97	4.62
13	002439	启明星辰	50,302,019.98	4.06
14	002268	电科网安	49,630,627.88	4.00
15	300253	卫宁健康	45,969,581.59	3.71
16	300339	润和软件	45,030,345.92	3.63
17	300017	网宿科技	41,943,552.38	3.38
18	002065	东华软件	39,657,482.78	3.20
19	300383	光环新网	39,216,429.59	3.16
20	000021	深科技	37,601,998.73	3.03
21	300682	朗新科技	37,072,368.40	2.99
22	002402	和而泰	36,998,679.00	2.98
23	688111	金山办公	35,749,530.08	2.88
24	002335	科华数据	35,698,163.50	2.88
25	002152	广电运通	34,769,806.42	2.80
26	000997	新大陆	34,390,198.85	2.77
27	002373	千方科技	34,031,905.89	2.75
28	002212	天融信	30,616,307.00	2.47
29	300803	指南针	30,041,502.72	2.42
30	300212	易华录	29,643,220.79	2.39
31	002368	太极股份	28,864,913.64	2.33
32	002139	拓邦股份	28,452,695.25	2.30
33	002153	石基信息	27,924,097.70	2.25

注：买入金额按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
----	------	------	----------	--------------------

1	002415	海康威视	402,096,812.51	32.44
2	002230	科大讯飞	244,560,570.52	19.73
3	000938	紫光股份	131,137,995.98	10.58
4	002410	广联达	125,489,158.61	10.12
5	000977	浪潮信息	92,630,696.55	7.47
6	300454	深信服	85,601,171.47	6.91
7	002236	大华股份	85,551,678.18	6.90
8	002180	纳思达	84,394,157.34	6.81
9	300033	同花顺	80,332,552.21	6.48
10	300496	中科创达	77,215,570.66	6.23
11	002405	四维图新	67,441,808.68	5.44
12	300017	网宿科技	62,264,728.78	5.02
13	000066	中国长城	57,108,699.00	4.61
14	002268	电科网安	46,600,707.23	3.76
15	002439	启明星辰	46,383,926.08	3.74
16	300212	易华录	45,933,104.59	3.71
17	002212	天融信	44,739,038.06	3.61
18	300339	润和软件	42,577,215.49	3.43
19	300253	卫宁健康	42,250,299.31	3.41
20	300383	光环新网	36,458,576.42	2.94
21	002065	东华软件	36,453,557.01	2.94
22	000021	深科技	35,039,598.95	2.83
23	002402	和而泰	34,681,215.21	2.80
24	300773	拉卡拉	34,297,950.16	2.77
25	688023	安恒信息	33,056,666.75	2.67
26	300682	朗新科技	32,522,739.29	2.62
27	002335	科华数据	32,259,933.42	2.60
28	002152	广电运通	32,222,591.33	2.60
29	000997	新大陆	31,733,834.60	2.56
30	002373	千方科技	31,186,361.51	2.52
31	002139	拓邦股份	26,353,659.82	2.13
32	300803	指南针	25,815,872.00	2.08
33	002153	石基信息	25,636,493.49	2.07

注：卖出金额按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	2,574,466,391.00
卖出股票的收入（成交）总额	2,420,819,091.74

注：买入股票成本、卖出股票收入均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期内未投资国债期货。

7.11 投资组合报告附注

7.11.1 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

7.11.2 基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的情况。

7.11.3 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	1,459,914.77
2	应收清算款	1,009,179.76
3	应收股利	92,651.90
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-

7	待摊费用	-
8	其他	151,682.98
9	合计	2,713,429.41

7.11.4 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可转换债券。

7.11.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例(%)	流通受限情 况说明
1	002230	科大讯飞	35,638,224.00	1.90	转融通证券 出借业务的 股票
2	688111	金山办公	21,227,000.00	1.13	询价转让
3	688111	金山办公	19,597,130.00	1.05	转融通证券 出借业务的 股票
4	000938	紫光股份	14,440,790.00	0.77	转融通证券 出借业务的 股票
5	603019	中科曙光	14,302,900.00	0.76	转融通证券 出借业务的 股票
6	000977	浪潮信息	13,007,700.00	0.69	转融通证券 出借业务的 股票
7	601360	三六零	11,377,542.00	0.61	转融通证券 出借业务的 股票
8	002415	海康威视	9,578,723.00	0.51	转融通证券 出借业务的 股票
9	600570	恒生电子	8,357,523.00	0.45	转融通证券 出借业务的 股票
10	600588	用友网络	2,451,800.00	0.13	转融通证券 出借业务的

					股票
11	002410	广联达	2,339,280.00	0.12	转融通证券出借业务的股票

7.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688249	晶合集成	118,130.46	0.01	新股锁定
2	688472	阿特斯	104,898.24	0.01	新股锁定
3	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.01	网下中签
4	301202	朗威股份	79,009.20	0.00	网下中签
5	301261	恒工精密	72,803.70	0.00	网下中签
6	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定

8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		计算机 ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
11,632	123,319.59	993,021,898.00	69.23%	263,686,774.00	18.38%	177,744,775.00	12.39%

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	中海信托股份有限公司—金海 1 号证券投资集合资金信托	66,200,000.00	4.61%

2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	66,029,700.00	4.60%
3	中信保诚人寿保险有限公司—盛世优选投资账户	54,130,400.00	3.77%
4	中国人保资管—中国银行—中国人保资产中证 800 行业轮动 2 号资产管理产品	35,036,300.00	2.44%
5	北京诚通金控投资有限公司	31,687,500.00	2.21%
6	中国人保资管—中信银行—中国人保资产聚瑞稳健混合类资产管理产品	29,895,800.00	2.08%
7	人保资管—民生银行—人保资产安心收益 3 号资产管理产品	28,805,200.00	2.01%
8	博时基金—恒大人寿保险有限公司—分红险—博时基金恒博 1 号管理人中管理人 (MOM)	28,680,000.00	2.00%
9	广东粤财信托有限公司—粤财信托·粤银 3 号单一资金信托计划	25,294,700.00	1.76%
10	泰山财产保险股份有限公司—自有资金	23,283,400.00	1.62%
-	国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金	177,744,775.00	12.39%

注：以上信息是根据中国证券登记结算有限责任公司上海分公司提供的名册编制。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

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（2019 年 7 月 11 日）基金份额总额	618,453,447.00
本报告期期初基金份额总额	1,174,453,447.00
本报告期基金总申购份额	2,710,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,450,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	1,434,453,447.00

10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

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

报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内，本基金无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内，本基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内，为本基金提供审计服务的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。

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

本报告期内基金托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
西南证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
华安证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
中金财富	3	-	-	-	-	-
中银国际	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	4,488,589,684.68	90.42%	544,477.82	60.85%	-
广发证券	3	422,997,258.17	8.52%	305,177.84	34.11%	-
方正证券	2	11,695,653.11	0.24%	10,892.27	1.22%	-
华金证券	2	7,524,808.93	0.15%	5,427.69	0.61%	-
华泰证券	3	7,057,896.17	0.14%	6,572.96	0.73%	-
国信证券	2	6,561,641.48	0.13%	6,110.88	0.68%	-
中邮证券	2	4,259,442.83	0.09%	3,072.12	0.34%	-
浙商证券	1	4,162,189.62	0.08%	3,043.70	0.34%	-
申万宏源	1	4,143,499.59	0.08%	3,858.86	0.43%	-
海通证券	1	1,933,329.10	0.04%	1,800.61	0.20%	-
天风证券	1	1,770,775.87	0.04%	1,294.91	0.14%	-
招商证券	1	1,090,057.85	0.02%	1,015.18	0.11%	-
国都证券	1	826,396.00	0.02%	769.59	0.09%	-
中信建投	3	695,362.15	0.01%	647.60	0.07%	-
中金公司	2	589,174.20	0.01%	430.89	0.05%	-
中航证券	2	181,295.00	0.00%	130.76	0.01%	-
长江证券	1	38,602.20	0.00%	28.23	0.00%	-

注：基金租用席位的选择标准是：

- (1) 资质雄厚，信誉良好；
- (2) 财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；
- (3) 经营行为规范，在最近一年内无重大违规经营行为；

(4) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求；

(5) 公司具有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供具有相当质量的关于宏观经济面分析、行业发展趋势及证券市场走向、个股分析的研究报告以及丰富全面的信息服务；能根据基金投资的特定要求，提供专门研究报告。

选择程序是：根据对各证券公司提供的各项投资、研究服务情况的考评结果，符合交易席位租用标准的，由公司投研业务部门提出租用证券公司交易席位的调整意见（包括调整名单及调整原因等），并经公司批准。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的 比例	成交金额	占当期回购成交总额的 比例	成交金额	占当期权证成交总额的 比例
西南证券	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
中邮证券	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-

中信建投	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1	2023年04月13日至2023年04月25日	169,744,775.00	28,000,000.00	20,000,000.00	177,744,775.00	12.39%
产品特有风险							
当基金份额持有人占比过于集中时,可能会因某单一基金份额持有人大额赎回而引发基金份额净值波动风险、基金流动性风险等特定风险。							

12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、关于准予国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复
- 2、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、国泰中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、报告期内披露的各项公告
- 5、法律法规要求备查的其他文件

12.2 存放地点

本基金管理人国泰基金管理有限公司办公地点——上海市虹口区公平路18号8号楼嘉昱大厦16层-19层。

基金托管人住所或办公场所。

12.3 查阅方式

可咨询本基金管理人；部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务中心电话：（021）31089000，400-888-8688

客户投诉电话：（021）31089000

公司网址：<http://www.gtfund.com>

国泰基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日