

# 华安上证科创板芯片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：华安基金管理有限公司

基金托管人：华泰证券股份有限公司

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。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

s

<b>1 重要提示及目录</b>	2
1.1 重要提示	2
<b>2 基金简介</b>	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
<b>3 主要财务指标和基金净值表现</b>	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
<b>4 管理人报告</b>	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	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
<b>5 托管人报告</b>	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的真实、准确和完整发表意见	13
<b>6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
<b>7 投资组合报告</b>	184
7.1 期末基金资产组合情况	184
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	184
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	185
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	187
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	189
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	189
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	189
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	189
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	189
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	189
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	189
7.12 投资组合报告附注	189
<b>8 基金份额持有人信息</b>	191

8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	191
8.2	期末上市基金前十名持有人 .....	191
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	192
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 .....	192
<b>9</b>	<b>开放式基金份额变动 .....</b>	<b>192</b>
<b>10</b>	<b>重大事件揭示 .....</b>	<b>192</b>
10.1	基金份额持有人大会决议 .....	192
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 .....	192
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	193
10.4	基金投资策略的改变 .....	193
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	193
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 .....	193
10.6.1	管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	193
10.6.2	托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	193
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	193
10.8	其他重大事件 .....	194
<b>11</b>	<b>影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>195</b>
<b>12</b>	<b>备查文件目录 .....</b>	<b>195</b>
12.1	备查文件目录 .....	195
12.2	存放地点 .....	196
12.3	查阅方式 .....	196

## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华安上证科创板芯片 ETF
场内简称	科创板芯片 ETF
基金主代码	588290
交易代码	588290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 9 月 30 日
基金管理人	华安基金管理有限公司
基金托管人	华泰证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	961,397,000.00 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	2022 年 10 月 26 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最小化。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
投资策略	<p>本基金主要采取组合复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。</p> <p>对于出现市场流动性不足、因法律法规原因个别成份股被限制投资等情况，导致本基金无法获得足够数量的股票时，基金管理人将通过投资成份股、非成份股进行替代。</p> <p>本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。</p> <p>未来，随着证券市场投资工具的发展和丰富，本基金可在履行适当程序后相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新中公告。</p>
业绩比较基准	上证科创板芯片指数收益率
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	华安基金管理有限公司	华泰证券股份有限公司
姓名	杨牧云	李双均

信息披露	联系电话	021-38969999	025-83389842
负责人	电子邮箱	service@huaan.com.cn	lishuangjun@htsc.com
客户服务电话		4008850099	95597
传真		021-68863414	025-83387215
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区 临港新片区环湖西二路888号B 楼2118室	江苏省南京市江东中路228号
办公地址		中国（上海）自由贸易试验区 世纪大道8号国金中心二期31 —32层	江苏省南京市江东中路228号
邮政编码		200120	210009
法定代表人		朱学华	张伟

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.huaan.com.cn
基金中期报告备置地点	上海市世纪大道8号上海国金中心二期31、 32层

## 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	3,510,683.96
本期利润	-74,105,568.30
加权平均基金份额本期利润	-0.1872
本期加权平均净值利润率	-14.64%
本期基金份额净值增长率	20.94%
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	209,207,282.86
期末可供分配基金份额利润	0.2176
期末基金资产净值	1,170,604,282.86
期末基金份额净值	1.2176

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	21.76%

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、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）。

4、本基金于 2022 年 9 月 30 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

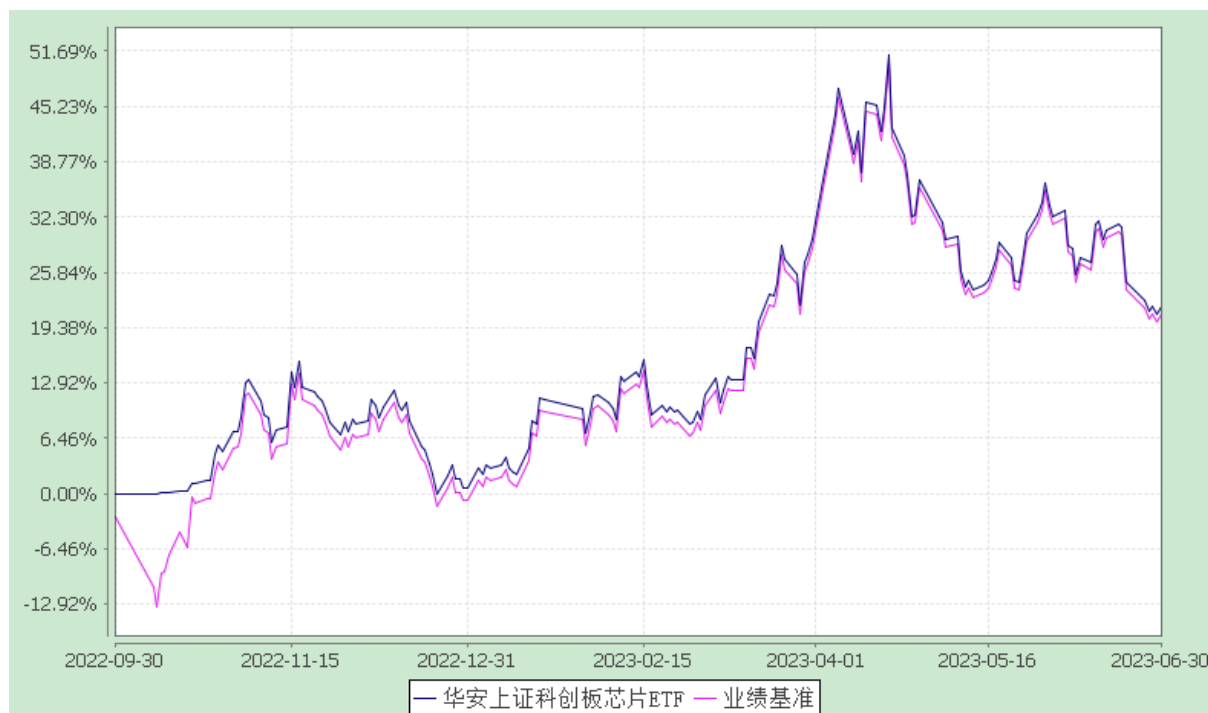
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-10.63%	1.80%	-10.70%	1.81%	0.07%	-0.01%
过去三个月	-6.14%	2.39%	-6.03%	2.41%	-0.11%	-0.02%
过去六个月	20.94%	2.11%	21.81%	2.14%	-0.87%	-0.03%
过去一年	-	-	-	-	-	-
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	21.76%	1.95%	20.87%	2.21%	0.89%	-0.26%

#### 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

华安上证科创板芯片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  
 （2022 年 9 月 30 日至 2023 年 6 月 30 日）



注：本基金于 2022 年 9 月 30 日成立，截止本报告期末，本基金成立不满一年。

## 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

华安基金管理有限公司经中国证监会证监基金字[1998]20 号文批准于 1998 年 6 月设立，是国内首批基金管理公司之一，注册资本 1.5 亿元人民币，公司总部设在上海陆家嘴金融贸易区。目前的股东为国泰君安证券股份有限公司、上海上国投资产管理有限公司、上海锦江国际投资管理有限公司、上海工业投资（集团）有限公司和国泰君安投资管理股份有限公司。公司在香港和上海设有子公司——华安资产管理（香港）有限公司、华安未来资产管理（上海）有限公司。截至 2023 年 6 月 30 日，公司旗下共管理华安创新混合、华安 MSCI 中国 A、华安现金富利货币、华安稳定收益债券、华安黄金易 ETF、华安沪港深外延增长混合、华安全球美元收益债券等 239 只证券投资基金，管理资产规模达到 6,023.30 亿元人民币。

#### 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		



刘璇子	本基金的基金经理	2022-09-30	-	8 年	<p>硕士研究生，8 年基金行业从业经验。2014 年 7 月应届毕业生加入华安基金，曾任指数与量化投资部研究员、基金经理助理。2020 年 11 月起，担任上证龙头企业交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金的基金经理（2023 年 2 月起，转型为华安上证 50 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金）。2021 年 1 月起，同时担任华安创业板 50 指数型证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月起，同时担任华安中证内地新能源主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起，同时担任华安 CES 半导体芯片行业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月至 2022 年 7 月，同时担任华安中证光伏产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起，同时担任华安深证 100 交易型开放式指数证券投资基金、华安中证内地新能源主题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。2022 年 4 月起，同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 7 月起，同时担任华安中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华安中证申万食品饮料交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 9 月起，同时担任华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月起，同时担任华安中证上海环交所碳中和指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 11 月起，同时担任华安中证基建指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月起，同时担任华安上证科创板芯片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。</p>
-----	----------	------------	---	-----	---

注：此处的任职日期和离任日期均指公司作出决定之日，即以公告日为准。证券从业的含义遵从行业协会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、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，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在违法违规或未履行基金合同承诺的情形。

## 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

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司制定了《华安基金管理有限公司公平交易管理制度》，将各投资组合在研究分析、投资决策、交易执行等方面全部纳入公平交易管理中。控制措施包括：在研究环节，研究员在为公司管理的各类投资组合提供研究信息、投资建议过程中，使用晨会发言、邮件发送、登录在研究报告管理系统中等方式来确保各类投资组合经理可以公平享有信息获取机会。在投资环节，公司各投资组合经理根据投资组合的风格和投资策略，制定并严格执行交易决策规则，以保证各投资组合交易决策的客观性和独立性。同时严格执行投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体授权机制，投资组合经理在授权范围内自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。在交易环节，公司实行强制公平交易机制，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。（1）交易所二级市场业务，遵循价格优先、时间优先、比例分配、综合平衡的控制原则，实现同一时间下达指令的投资组合在交易时机上的公平性。

（2）交易所一级市场业务，投资组合经理按意愿独立进行业务申报，集中交易部以投资组合名义对外进行申报。若该业务以公司名义进行申报与中签，则按实际中签情况以价格优先、比例分配原则进行分配。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在合规监察员监督参与下，进行公平协商分配。（3）银行间市场业务遵循指令时间优先原则，先到先询价的控制原则。通过内部共同的 iwind 群，发布询价需求和结果，做到信息公开。若是多个投资组合进行一级市场投标，则各投资组合经理须以各投资组合名义向集中交易部下达投资意向，交易员以此进行投标，以确保中签结果与投资组合投标意向一一对应。若中签量过小无法合理进行比例分配，且以公司名义获得，则投资部门在风险管理部投资监督参与下，进行公平协商分配。交易监控、分析与评估环节，公司风险管理部对公司旗下的各投资组合投资境内证券市场上市交易的投资品种、进行场

外的非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购、不同投资组合同日和临近交易日的反向交易以及可能导致不公平交易和利益输送的异常交易行为进行监控，根据市场公认的第三方信息（如：中债登的债券估值），定期对各投资组合与交易对手之间议价交易的交易价格公允性进行审查，对不同投资组合临近交易日的同向交易的交易时机和交易价差进行分析。

本报告期内，公司公平交易制度总体执行情况良好。

本基金管理人通过统计检验的方法对管理的不同投资组合，在不同时间窗下（日内、3日内、5日内）的本年度同向交易价差进行了专项分析，未发现违反公平交易原则的异常情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，公司风险管理部会同基金投资、交易部门讨论制定了各类投资组合针对股票、债券、回购等投资品种在交易所及银行间的同日反向交易控制规则，并在投资系统中进行了设置，实现了完全的系统控制。同时加强了对各类投资组合间的同日反向交易的监控与隔日反向交易的检查；风险管理部开发了同向交易分析系统，对相关同向交易指标进行持续监控，并定期对组合间的同向交易行为进行了重点分析。

本报告期内，因组合流动性管理或投资策略调整需要，除指数基金以外的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% 的次数为 7 次，未出现异常交易。

#### 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

在经历一季度的大幅上行后，2023 年二季度，科创芯片板块震荡调整，上半年科创芯片指数上涨 21.81%。由于宏观经济放缓、消费需求疲软，半导体行业仍在库存消化过程中，但节奏上已临近周期底部，存储价格上调已逐渐反映行业筑底预期。AIGC 带来加速服务器快速增长，由此带来算力需求爆发下的结构性机会。人工智能和国产替代是芯片板块演绎的主要逻辑。

本基金跟踪的科创芯片指数，从科创板上市公司中选取业务涉及半导体材料和设备、芯片设计、芯片制造、芯片封装和测试相关的证券作为指数样本，以反映科创板代表性芯片产业上市公司证券的整体表现。

投资管理上，基金采取完全复制的管理方法跟踪指数，并利用量化工具进行精细化管理，从而控制基金的跟踪误差和跟踪偏离度。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 1.2176 元，本报告期份额净值增长率为 20.94%，同期业绩比较基准增长率为 21.81%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前我们仍然看好芯片板块下半年的投资机会。首先，周期复苏的逻辑逐渐得到印证和强化，消费类芯片库存见顶后有望回落，需求呈现弱复苏趋势，存储、封测、AIoT 等领域的机会值得关注；其次，国产替代和自主可控依然是国产芯片发展的主要支撑，随着海外不断强化出口管制和封锁，国内芯片产业在成熟制程国产化推进基础上，围绕卡脖子环节也有望寻求突破与进展；人工智能正迅速成为全球科技创新浪潮的核心驱动力。对于算力的需求激增使得 AI 芯片迎来历史性发展机遇，国内相关产业公司也在加速推进，海外印射下的相关机会值得关注。

本基金跟踪的科创芯片指数囊括了科创板上市的 50 只芯片产业龙头企业，是科创板硬核科技的代表，聚焦芯片产业高精尖环节，具有“小而美”的特点，科创属性强，是投资国内芯片产业链龙头公司的优质工具，当前配置价值突出。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人设有估值委员会，负责在证券发行机构发生了严重影响证券价格的重大事件时，评估重大事件对投资品种价值的影响程度、评估对基金估值的影响程度、确定采用的估值方法、确定该证券的公允价值；同时将采用的估值方法以及采用该方法对相关证券的估值与基金的托管银行进行沟通。估值委员会成员由首席投资官、公司分管运营、专户的领导、指数与量化投资部负责人、固定收益部负责人、投资研究部负责人、基金运营部负责人、产品部负责人、风险管理部负责人、全球投资部负责人等人员组成，具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备行业研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司及中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定分别提供银行间同业市场及交易所交易的债券品种的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期不进行收益分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金报告期内不存在基金持有人数低于 200 人或基金资产净值低于 5000 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

在本报告期内，本基金托管人-华泰证券股份有限公司严格遵守了基金合同和各项法律法规的相关规定，履行了基金托管人应尽的义务，不存在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

本报告期内，华泰证券对基金管理人的投资运作行为依基金合同约定进行了监督，对本基金资产净值计算、利润分配、费用开支等方面进行了复核，未发现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

华泰证券作为基金托管人，复核了本基金 2023 年中期报告中的有关财务数据、收益分配、投资组合报告等内容，相关内容真实、准确和完整。

### 6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>		-	-
银行存款	6.4.7.1	8,477,623.10	2,251,565.52
结算备付金		142,219.63	3,345.67
存出保证金		40,991.35	270,674.89
交易性金融资产	6.4.7.2	1,162,706,411.66	97,892,020.87
其中：股票投资		1,162,706,411.66	97,609,017.15
基金投资		-	-
债券投资		-	283,003.72
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		620,210.58	-
应收股利		16,761.89	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	38,217.14	-
<b>资产总计</b>		<b>1,172,042,435.35</b>	<b>100,417,606.95</b>
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 年 12 月 31 日</b>
<b>负 债：</b>		-	-
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		290,925.99	352,207.41
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		506,869.72	42,006.49
应付托管费		101,373.93	8,401.30
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	538,982.85	448,278.94
<b>负债合计</b>		<b>1,438,152.49</b>	<b>850,894.25</b>
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	961,397,000.00	98,897,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	209,207,282.86	669,712.70
<b>净资产合计</b>		<b>1,170,604,282.86</b>	<b>99,566,712.70</b>
<b>负债和净资产总计</b>		<b>1,172,042,435.35</b>	<b>100,417,606.95</b>

注：报告截至日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2176 元，基金份额总额 961,397,000.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华安上证科创板芯片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
<b>一、营业总收入</b>		<b>-72,545,248.50</b>
1.利息收入		320,154.59
其中：存款利息收入	6.4.7.9	34,529.73
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		285,624.86
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以“-”填列)		4,312,428.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,699,637.61
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	176,321.99
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益		-
股利收益	6.4.7.12	1,436,469.17
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.13	-77,616,252.26
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	438,420.40
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>1,560,319.80</b>
1. 管理人报酬		1,242,412.57
2. 托管费		248,482.50
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		0.37
8. 其他费用	6.4.7.15	69,424.36
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-74,105,568.30</b>
减：所得税费用		-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-74,105,568.30
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-74,105,568.30

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华安上证科创板芯片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	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	98,897,000.00	-	669,712.70	99,566,712.70
二、本期期初净资产（基金净值）	98,897,000.00	-	669,712.70	99,566,712.70
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	862,500,000.00	-	208,537,570.16	1,071,037,570.16
（一）、综合收益总额	-	-	-74,105,568.30	-74,105,568.30
（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）	862,500,000.00	-	282,643,138.46	1,145,143,138.46
其中：1.基金申购款	1,475,000,000.00	-	467,595,188.42	1,942,595,188.42
2.基金赎回款	-612,500,000.00	-	-184,952,049.96	-797,452,049.96
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	961,397,000.00	-	209,207,282.86	1,170,604,282.86

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：朱学华，主管会计工作负责人：朱学华，会计机构负责人：陈松一

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华安上证科创板芯片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[2022]第 2185 号《关于准予华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》核准，由华安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《华安上证科创板芯片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 361,397,000.00 元，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(2022)第 0835 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2022 年 9 月 30 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 361,397,000.00 份基金份额，无认购资金利息折合的基金份额。本基金的基金管理人为华安基金管理有限公司，基金托管人为华泰证券股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2022]286 号核准，本基金 361,397,000.00 份基金份额(截至 2022 年 9 月 27 日)于 2022 年 10 月 26 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《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的标的指数为上证科创板芯片指数，投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股(含存托凭证)及其备选成份股(含存托凭证)、其他股票(包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证)、股指期货、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债、短期融资券、超短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、货币市场工具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)。本基金将根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。本基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不得低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易

保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：上证科创板芯片指数收益率。

本基金的基金管理人华安基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2022 年 12 月 27 日募集成立了华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起

式联接基金(以下简称“华安上证科创板芯片 ETF 发起式联接基金”)。华安上证科创板芯片 ETF 发起式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华安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》、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2023 年 1 月 1 日起至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 所采用的会计政策上年度会计报表相一致的说明

本基金报告期所采用的会计政策、其他会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

#### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 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	8,477,623.10
等于：本金	8,474,043.02
加：应计利息	3,580.08
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	8,477,623.10

##### 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	1,245,799,945.19	-	1,162,706,411.66	-83,093,533.53
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		1,245,799,945.19	-	1,162,706,411.66	-83,093,533.53

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

#### 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	38,217.14
待摊费用	-
合计	38,217.14

#### 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	381,544.24
其中：交易所市场	381,544.24
银行间市场	-
应付利息	-
预提信息披露费	39,671.58
预提审计费	29,752.78
应付替代款	72,992.40
可退替代款	15,021.85
合计	538,982.85

### 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	98,897,000.00	98,897,000.00
本期申购	1,475,000,000.00	1,475,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-612,500,000.00	-612,500,000.00
本期末	961,397,000.00	961,397,000.00

### 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	14,774,359.87	-14,104,647.17	669,712.70
本期利润	3,510,683.96	-77,616,252.26	-74,105,568.30
本期基金份额交易产生的变动数	203,203,407.75	79,439,730.71	282,643,138.46
其中：基金申购款	345,239,844.05	122,355,344.37	467,595,188.42
基金赎回款	-142,036,436.30	-42,915,613.66	-184,952,049.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	221,488,451.58	-12,281,168.72	209,207,282.86

### 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	549.14
其他	1,635.23
合计	34,529.73

### 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

股票投资收益——赎回差价收入	13,555,989.56
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	2,699,637.61

#### 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	202,949,349.50
减：卖出股票成本总额	213,188,965.16
减：交易费用	616,736.29
买卖股票差价收入	-10,856,351.95

#### 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	797,452,049.96
减：现金支付赎回款总额	-8,432,547.04
减：赎回股票成本总额	792,328,607.44
减：交易费用	-
赎回差价收入	13,555,989.56

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 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	102.07
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	176,219.92
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	176,321.99

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	548,350.60
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	372,000.00
减：应计利息总额	108.74
减：交易费用	21.94
买卖债券差价收入	176,219.92

#### 6.4.7.12 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	1,436,469.17
其中：证券出借权益补偿收入	121,607.31
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,436,469.17

#### 6.4.7.13 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	-77,616,252.26
——股票投资	-77,616,252.26
——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	-77,616,252.26

#### 6.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日



基金赎回费收入	-
替代损益收入	438,420.40
合计	438,420.40

#### 6.4.7.15 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	29,752.78
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	69,424.36

#### 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

无。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

#### 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

无。

##### 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
华安基金管理有限公司（“华安基金公司”）	基金管理人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金托管人
国泰君安证券股份有限公司	基金管理人的股东

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

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
华泰证券	409,688,687.61	100.00%

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
华泰证券	637,350.60	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
华泰证券	381,544.24	100.00%	381,544.24	100.00%

注：1. 上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2. 该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,242,412.57
其中：支付销售机构的客户维护费	0.00

注：支付基金管理人华安基金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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

#### 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
当期发生的基金应支付的托管费	248,482.50

注：支付基金托管人华泰证券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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

#### 6.4.10.3 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

##### 6.4.10.3.1 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

无。

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

单位：人民币

本期										
2023年1月1日至2023年6月30日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量（单位：股）	出借期限（单位：天）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2023050800001155	概伦电子	2023-05-08	28,680.00	1,000.00	14	3.40	37.92	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023050800001 157	天岳先进	2023-05-08	79,120.00	1,000.00	14	3.40	104.61	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023050800001 159	英集芯	2023-05-08	16,770.00	1,000.00	14	3.40	22.17	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023050800001 161	希荻微	2023-05-08	21,300.00	1,000.00	14	3.40	28.16	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023050800001 163	翱捷科技	2023-05-08	66,300.00	1,000.00	14	3.40	87.66	0.00	0.00

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 265	臻镭科技	2023-05-10	223,880.00	2,900.00	14	2.00	174.13	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 267	明微电子	2023-05-10	198,315.00	3,900.00	14	2.00	154.25	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 268	格科微	2023-05-10	399,497.00	26,300.00	14	2.00	310.72	0.00	0.00
国泰君安证券	2023051000004 275	艾为电子	2023-05-10	381,524.00	4,400.00	14	2.00	296.74	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 279	中芯国际	2023-05-10	5,265,980.00	100,400.00	14	2.00	4,095.76	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 283	普冉股份	2023-05-10	333,080.00	2,200.00	14	2.00	259.06	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 287	中科蓝讯	2023-05-10	220,320.00	3,200.00	14	2.00	171.36	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 288	复旦微	2023-05-	1,198,785.00	23,300.00	14	2.00	932.39	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司		电 10								
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 293	峰 崑 科 技	202 3- 05- 10	186,144.0 0	2,400.00	14	2.0 0	144.78	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 296	天 岳 先 进	202 3- 05- 10	272,544.0 0	3,400.00	14	2.0 0	211.98	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 300	神 工 股 份	202 3- 05- 10	244,720.0 0	7,000.00	14	2.0 0	190.34	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 301	晶丰明源	2023-05-10	229,755.00	1,700.00	14	2.00	178.70	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 307	力芯微	2023-05-10	210,397.00	3,100.00	14	2.00	163.64	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 311	思瑞浦	2023-05-10	1,207,284.00	5,200.00	14	2.00	939.00	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 313	华润微	2023-05-10	2,767,351.00	46,300.00	14	2.00	2,152.38	0.00	0.00



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 317	国芯科技	2023-05-10	353,745.00	6,300.00	14	2.00	275.14	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 323	芯原股份	2023-05-10	1,737,460.00	21,800.00	14	2.00	1,351.36	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 328	翱捷科技	2023-05-10	216,942.00	3,300.00	14	2.00	168.73	0.00	0.00
国泰君安证券	2023051000004 333	华特气体	2023-05-10	237,440.00	3,200.00	14	2.00	184.68	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 335	芯朋微	2023-05-10	399,312.00	5,900.00	14	2.00	310.58	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 337	恒玄科技	2023-05-10	819,126.00	6,300.00	14	2.00	637.10	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 339	寒武纪	2023-05-10	3,503,808.00	17,600.00	14	2.00	2,725.18	0.00	0.00
国泰君安	2023051000004 343	芯海科	2023-05-	252,525.00	7,500.00	14	2.00	196.41	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司		技	10							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 345	正 帆 科 技	202 3- 05- 10	630,300.0 0	16,500.0 0	14	2.0 0	490.23	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 377	思 特 威	202 3- 05- 10	159,852.0 0	2,800.00	14	2.0 0	124.33	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 469	安 路 科 技	202 3- 05- 10	210,420.0 0	4,200.00	14	2.0 0	163.66	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 477	龙芯 中科	202 3- 05- 10	385,280.0 0	2,800.00	14	2.0 0	299.66	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 483	盛美 上海	202 3- 05- 10	339,320.0 0	3,400.00	14	2.0 0	263.92	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 487	金宏 气体	202 3- 05- 10	651,264.0 0	25,600.0 0	14	2.0 0	506.54	0.00	0.00
国泰君安证券股份有	2023051000004 491	沪 硅 产业	202 3- 05- 10	2,097,333. 00	95,900.0 0	14	2.0 0	1,631. 26	0.00	0.00

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 492	海光信息	2023-05-10	1,418,067.00	18,300.00	14	2.00	1,102.94	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 497	希荻微	2023-05-10	66,560.00	3,200.00	14	2.00	51.77	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 501	英集芯	2023-05-10	53,592.00	3,300.00	14	2.00	41.68	0.00	0.00
国泰君安证券	2023051000004 507	长光华芯	2023-05-10	310,104.00	3,600.00	14	2.00	241.19	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 509	乐鑫科技	2023-05-10	538,692.00	4,200.00	14	2.00	418.98	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 511	晶晨股份	2023-05-10	1,851,660.00	25,400.00	14	2.00	1,440.18	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 513	华峰测控	2023-05-10	956,600.00	4,000.00	14	2.00	744.02	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 514	安集科技	2023-05-10	887,835.00	3,900.00	14	2.00	690.54	0.00	0.00

安 证 券 股 份 有 限 公 司		技	10							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 518	纳 芯 微	202 3- 05- 10	756,000.0 0	2,700.00	14	2.0 0	588.00	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 521	拓 荆 科 技	202 3- 05- 10	1,203,576. 00	3,300.00	14	2.0 0	936.11	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 525	概 伦 电 子	202 3- 05- 10	93,160.00	3,400.00	14	2.0 0	72.46	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 532	华海清科	2023-05-10	949,144.00	2,800.00	14	2.00	738.22	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 537	聚辰股份	2023-05-10	341,055.00	5,300.00	14	2.00	265.27	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 541	中微公司	2023-05-10	5,901,180.00	35,400.00	14	2.00	4,589.81	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 543	芯源微	2023-05-10	1,012,618.00	4,100.00	14	2.00	787.59	0.00	0.00



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 545	华兴源创	2023-05-10	173,374.00	4,600.00	14	2.00	134.85	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 553	唯捷创芯	2023-05-10	167,591.00	2,900.00	14	2.00	130.35	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 557	东芯股份	2023-05-10	335,356.00	11,600.00	14	2.00	260.83	0.00	0.00
国泰君安证券	2023051000004 559	澜起科技	2023-05-10	3,931,704.00	69,600.00	14	2.00	3,057.99	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023051000004 561	睿创微纳	2023-05-10	1,557,175.00	31,300.00	14	2.00	1,211.14	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400008 974	复旦微电	2023-05-24	1,261,229.00	23,300.00	14	2.00	980.96	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400008 976	晶丰明源	2023-05-24	246,670.00	1,700.00	14	2.00	191.85	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400008 978	格科微	2023-05-	416,066.00	26,300.00	14	2.00	323.61	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司			24							
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400008 982	中 芯 国 际	202 3- 05- 24	5,010,964. 00	100,400. 00	14	2.0 0	3,897. 42	0.00	0.00
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400008 984	臻 镭 科 技	202 3- 05- 24	244,673.0 0	2,900.00	14	2.0 0	190.30	0.00	0.00
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400010 694	芯 朋 微	202 3- 05- 24	397,306.0 0	5,900.00	14	2.0 0	309.02	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 696	思特威	2023-05-24	162,036.00	2,800.00	14	2.00	126.03	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 698	安路科技	2023-05-24	219,996.00	4,200.00	14	2.00	171.11	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 700	沪硅产业	2023-05-24	1,997,597.00	95,900.00	14	2.00	1,553.69	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 706	乐鑫科技	2023-05-24	537,474.00	4,200.00	14	2.00	418.04	0.00	0.00

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010708	纳芯微	2023-05-24	724,626.00	2,700.00	14	2.00	563.60	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010710	海光信息	2023-05-24	1,405,989.00	18,300.00	14	2.00	1,093.55	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010712	唯捷创芯	2023-05-24	188,152.00	2,900.00	14	2.00	146.34	0.00	0.00
国泰君安证券	2023052400010714	长光华芯	2023-05-24	356,184.00	3,600.00	14	2.00	277.03	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 716	金宏气体	2023-05-24	637,440.00	25,600.00	14	2.00	495.79	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 718	华峰测控	2023-05-24	1,036,560.00	4,000.00	14	2.00	806.21	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400010 720	华兴原创	2023-05-24	168,682.00	4,600.00	14	2.00	131.20	0.00	0.00
国泰君安	2023052400010 722	晶晨股	2023-05-	2,092,452.00	25,400.00	14	2.00	1,627.46	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司		份	24							
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400010 736	中 微 公 司	202 3- 05- 24	5,613,732. 00	35,400.0 0	14	2.0 0	4,366. 24	0.00	0.00
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400020 824	峰 昭 科 技	202 3- 05- 24	201,240.0 0	2,400.00	14	2.0 0	156.52	0.00	0.00
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023052400020 826	天 岳 先 进	202 3- 05- 24	264,214.0 0	3,400.00	14	2.0 0	205.50	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 830	神工股份	2023-05-24	252,770.00	7,000.00	14	2.00	196.60	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 832	力芯微	2023-05-24	235,600.00	3,100.00	14	2.00	183.24	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 836	华润微	2023-05-24	2,654,842.00	46,300.00	14	2.00	2,064.88	0.00	0.00
国泰君安股份有	2023052400020 838	国芯科技	2023-05-24	348,642.00	6,300.00	14	2.00	271.17	0.00	0.00



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 858	明微电子	2023-05-24	205,569.00	3,900.00	14	2.00	159.89	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 860	中科蓝讯	2023-05-24	259,232.00	3,200.00	14	2.00	201.62	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400020 872	艾为电子	2023-05-24	396,000.00	4,400.00	14	2.00	308.00	0.00	0.00
国泰君安证券	2023052400020 926	普冉股份	2023-05-24	380,490.00	2,200.00	14	2.00	295.94	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400024 136	恒玄科技	2023-05-24	874,314.00	6,300.00	14	2.00	680.02	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400024 138	龙芯中科	2023-05-24	383,964.00	2,800.00	14	2.00	298.64	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400024 140	寒武纪	2023-05-24	3,203,200.00	17,600.00	14	2.00	2,491.38	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 220	芯海科	2023-05-	263,400.00	7,500.00	14	2.00	204.87	0.00	0.00

安 证 券 股 份 有 限 公 司		技	24							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400026 222	正 帆 科 技	202 3- 05- 24	625,680.0 0	16,500.0 0	14	2.0 0	486.64	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400026 224	芯 原 股 份	202 3- 05- 24	1,735,062. 00	21,800.0 0	14	2.0 0	1,349. 49	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400026 226	华 特 气 体	202 3- 05- 24	275,872.0 0	3,200.00	14	2.0 0	214.57	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 228	翱捷科技	2023-05-24	240,009.00	3,300.00	14	2.00	186.67	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 230	安集科技	2023-05-24	916,227.00	3,900.00	14	2.00	712.62	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 232	华海清科	2023-05-24	1,041,768.00	2,800.00	14	2.00	810.26	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 234	聚辰股份	2023-05-24	400,786.00	5,300.00	14	2.00	311.72	0.00	0.00

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 236	芯源微	202 3- 05- 24	1,091,010. 00	4,100.00	14	2.0 0	848.56	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 238	东芯股份	202 3- 05- 24	414,468.0 0	11,600.0 0	14	2.0 0	322.36	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 240	概伦电子	202 3- 05- 24	97,410.00	3,400.00	14	2.0 0	75.76	0.00	0.00
国泰君安证券	2023052400026 242	盛美上海	202 3- 05- 24	375,700.0 0	3,400.00	14	2.0 0	292.21	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 244	希荻微	202 3- 05- 24	71,392.00	3,200.00	14	2.0 0	55.53	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 246	英集芯	202 3- 05- 24	57,717.00	3,300.00	14	2.0 0	44.89	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 248	拓荆科技	202 3- 05- 24	1,293,138. 00	3,300.00	14	2.0 0	1,005. 77	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023052400026 282	澜起科	202 3- 05-	4,036,800. 00	69,600.0 0	14	2.0 0	3,139. 73	0.00	0.00

安 证 券 股 份 有 限 公 司		技	24							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400026 284	睿 创 微 纳	202 3- 05- 24	1,565,626. 00	31,300.0 0	14	2.0 0	1,217. 71	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400020 834	思 瑞 浦	202 3- 05- 24	1,164,800. 00	5,200.00	14	2.0 0	1,229. 51	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700016 177	华 特 气 体	202 3- 06- 07	266,112.0 0	3,200.00	14	2.0 0	206.98	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023060700016 273	海光信息	2023-06-07	1,461,804.00	18,300.00	14	2.00	1,136.96	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016 274	芯源微	2023-06-07	1,145,335.00	4,100.00	14	2.00	890.82	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016 293	英集芯	2023-06-07	57,420.00	3,300.00	14	2.00	44.66	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016 503	翱捷科技	2023-06-07	263,670.00	3,300.00	14	2.00	205.08	0.00	0.00



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016599	沪硅产业	2023-06-07	2,100,210.00	95,900.00	14	2.00	1,633.50	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016600	华兴源创	2023-06-07	143,980.00	4,600.00	14	2.00	111.98	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700016601	晶晨股份	2023-06-07	2,283,714.00	25,400.00	14	2.00	1,776.22	0.00	0.00
国泰君安证券	2023060700017223	纳芯微	2023-06-07	456,840.00	2,700.00	14	2.00	355.32	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 252	盛美上海	2023-06-07	394,910.00	3,400.00	14	2.00	307.15	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 357	国芯科技	2023-06-07	372,708.00	6,300.00	14	2.00	289.88	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 358	正帆科技	2023-06-07	626,835.00	16,500.00	14	2.00	487.54	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 469	概伦电	2023-06-	100,674.00	3,400.00	14	2.00	78.30	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司		子 07								
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700017 554	唯 捷 创 芯	202 3- 06- 07	200,709.0 0	2,900.00	14	2.0 0	156.11	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700017 573	格 科 微	202 3- 06- 07	425,797.0 0	26,300.0 0	14	2.0 0	331.18	0.00	0.00
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700017 782	恒 玄 科 技	202 3- 06- 07	864,675.0 0	6,300.00	14	2.0 0	672.53	0.00	0.00

国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 872	乐鑫科技	2023-06-07	616,182.00	4,200.00	14	2.00	479.25	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700017 898	华润微	2023-06-07	2,500,200.00	46,300.00	14	2.00	1,944.60	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 081	中微公司	2023-06-07	5,453,370.00	35,400.00	14	2.00	4,241.51	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 108	芯原股份	2023-06-07	1,874,364.00	21,800.00	14	2.00	1,457.84	0.00	0.00

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 109	晶丰明源	2023-06-07	220,405.00	1,700.00	14	2.00	171.43	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 505	聚辰股份	2023-06-07	390,345.00	5,300.00	14	2.00	303.60	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 527	龙芯中科	2023-06-07	403,144.00	2,800.00	14	2.00	313.56	0.00	0.00
国泰君安证券	2023060700018 612	东芯股份	2023-06-07	402,752.00	11,600.00	14	2.00	313.25	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700018 939	华海清科	2023-06-07	982,800.00	2,800.00	14	2.00	764.40	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 064	安路科技	2023-06-07	227,094.00	4,200.00	14	2.00	176.63	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 065	金宏气体	2023-06-07	633,600.00	25,600.00	14	2.00	492.80	0.00	0.00
国泰君安	2023060700019 150	睿创微	2023-06-	1,523,058.00	31,300.00	14	2.00	1,184.60	0.00	0.00

安证 券股 份有 限公 司		纳 07								
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 169	希 荻 微 202 3- 06- 07	74,080.00	3,200.00	14	2.0 0	57.62	0.00	0.00	
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 257	澜 起 科 技 202 3- 06- 07	4,169,736. 00	69,600.0 0	14	2.0 0	3,243. 13	0.00	0.00	
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 276	长 光 华 芯 202 3- 06- 07	277,344.0 0	3,600.00	14	2.0 0	215.71	0.00	0.00	

国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 497	中芯国际	2023-06-07	5,488,868.00	100,400.00	14	2.00	4,269.12	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 499	华峰测控	2023-06-07	652,000.00	4,000.00	14	2.00	507.11	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 808	艾为电子	2023-06-07	397,408.00	4,400.00	14	2.00	309.10	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 810	拓荆科技	2023-06-07	1,369,302.00	3,300.00	14	2.00	1,065.01	0.00	0.00



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 915	思特威	2023-06-07	158,116.00	2,800.00	14	2.00	122.98	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700019 999	安集科技	2023-06-07	967,863.00	3,900.00	14	2.00	752.78	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700020 130	寒武纪	2023-06-07	3,893,120.00	17,600.00	14	2.00	3,027.98	0.00	0.00
国泰君安证券	2023060700020 239	臻镭科技	2023-06-07	183,628.00	2,900.00	14	2.00	142.82	0.00	0.00

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023060700022 359	复旦 微电	202 3- 06- 07	1,267,054. 00	23,300.0 0	14	2.0 0	985.49	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023060700022 999	天岳 先进	202 3- 06- 07	252,008.0 0	3,400.00	14	2.0 0	196.01	0.00	0.00
国泰君安证券股份有限公司	2023061200041 680	思瑞 浦	202 3- 06- 12	1,284,400. 00	5,200.00	14	2.0 0	998.98	0.00	0.00
国泰君安	2023062000023 407	中芯 国	202 3- 06-	4,500,447. 00	86,100.0 0	14	2.0 0	2,500. 25	4,500,447. 00	2,500. 25

安 证 券 股 份 有 限 公 司		际	20							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 409	晶 丰 明 源	202 3- 06- 20	268,542.0 0	1,800.00	14	2.0 0	149.19	268,542.0 0	149.19
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 411	伟 测 科 技	202 3- 06- 20	256,536.0 0	1,800.00	14	2.0 0	142.52	256,536.0 0	142.52
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 413	臻 镭 科 技	202 3- 06- 20	414,895.0 0	6,500.00	14	2.0 0	230.50	414,895.0 0	230.50

国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 415	思特威	2023-06-20	137,950.00	2,500.00	14	2.00	76.64	137,950.00	76.64
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 417	华特气体	2023-06-20	274,074.00	3,400.00	14	2.00	152.26	274,074.00	152.26
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 419	东微半导	2023-06-20	361,260.00	2,700.00	14	2.00	200.70	361,260.00	200.70
国泰君安证券股份有	2023062000023 421	寒武纪	2023-06-20	3,924,900.00	14,700.00	14	2.00	2,180.50	3,924,900.00	2,180.50

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 423	复旦微电	2023-06-20	1,061,072.00	18,800.00	14	2.00	589.48	1,061,072.00	589.48
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 425	天岳先进	2023-06-20	456,707.00	6,100.00	14	2.00	253.73	456,707.00	253.73
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 427	宏微科技	2023-06-20	466,800.00	7,500.00	14	2.00	259.33	466,800.00	259.33
国泰君安证券	2023062000023 429	艾为电子	2023-06-20	404,514.00	6,600.00	14	2.00	224.73	404,514.00	224.73

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 430	富创精密	2023-06-20	501,732.00	4,400.00	14	2.00	278.74	501,732.00	278.74
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 433	帝奥微	2023-06-20	189,528.00	5,300.00	14	2.00	105.29	189,528.00	105.29
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 434	翱捷科技	2023-06-20	1,157,656.00	14,800.00	14	2.00	643.14	1,157,656.00	643.14
国泰君安	2023062000023 437	格科微	2023-06-	577,155.00	35,300.00	14	2.00	320.64	577,155.00	320.64

安证 券股 份有 限公 司			20							
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 438	中 微 半 导	202 3- 06- 20	134,934.0 0	4,300.00	14	2.0 0	74.96	134,934.0 0	74.96
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 441	国 芯 科 技	202 3- 06- 20	757,435.0 0	11,900.0 0	14	2.0 0	420.80	757,435.0 0	420.80
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 443	芯 碁 微 装	202 3- 06- 20	394,842.0 0	5,100.00	14	2.0 0	219.36	394,842.0 0	219.36

国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 445	恒玄科技	2023-06-20	714,000.00	5,100.00	14	2.00	396.67	714,000.00	396.67
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 447	安集科技	2023-06-20	700,896.00	4,200.00	14	2.00	389.39	700,896.00	389.39
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 449	拓荆科技	2023-06-20	1,112,967.00	2,700.00	14	2.00	618.32	1,112,967.00	618.32
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 451	澜起科技	2023-06-20	3,394,480.00	56,200.00	14	2.00	1,885.82	3,394,480.00	1,885.82



限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 453	睿创微纳	2023-06-20	1,199,726.00	25,300.00	14	2.00	666.51	1,199,726.00	666.51
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 455	华兴源创	2023-06-20	122,470.00	3,700.00	14	2.00	68.04	122,470.00	68.04
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 457	华润微	2023-06-20	1,988,836.00	37,300.00	14	2.00	1,104.91	1,988,836.00	1,104.91
国泰君安证券	2023062000023 459	汇成股份	2023-06-20	116,248.00	8,800.00	14	2.00	64.58	116,248.00	64.58

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 460	海光信息	2023-06-20	1,377,108.00	16,400.00	14	2.00	765.06	1,377,108.00	765.06
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 463	纳芯微	2023-06-20	549,720.00	3,000.00	14	2.00	305.40	549,720.00	305.40
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 465	龙芯中科	2023-06-20	386,594.00	2,600.00	14	2.00	214.77	386,594.00	214.77
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 467	盛美上	2023-06-	715,042.00	6,100.00	14	2.00	397.25	715,042.00	397.25

安证 券股 份有 限公 司		海	20							
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 469	芯 源 微	202 3- 06- 20	1,418,040. 00	7,800.00	14	2.0 0	787.80	1,418,040. 00	787.80
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 471	希 荻 微	202 3- 06- 20	205,024.0 0	8,600.00	14	2.0 0	113.90	205,024.0 0	113.90
国 泰 君 安 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062000023 473	乐 鑫 科 技	202 3- 06- 20	508,266.0 0	3,400.00	14	2.0 0	282.37	508,266.0 0	282.37

国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 475	唯捷创芯	2023-06-20	172,017.00	2,300.00	14	2.00	95.57	172,017.00	95.57
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 477	思瑞浦	2023-06-20	1,142,757.00	5,100.00	14	2.00	634.87	1,142,757.00	634.87
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 479	沪硅产业	2023-06-20	2,054,485.00	96,500.00	14	2.00	1,141.38	2,054,485.00	1,141.38
国泰君安证券股份有	2023062000023 481	芯原股份	2023-06-20	1,498,816.00	17,600.00	14	2.00	832.68	1,498,816.00	832.68

限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 482	概伦电子	2023-06-20	265,052.00	9,200.00	14	2.00	147.25	265,052.00	147.25
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 485	华峰测控	2023-06-20	929,214.00	5,700.00	14	2.00	516.23	929,214.00	516.23
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 487	长光华芯	2023-06-20	417,841.00	3,700.00	14	2.00	232.13	417,841.00	232.13
国泰君安证券	2023062000023 489	安路科技	2023-06-20	464,440.00	8,500.00	14	2.00	258.02	464,440.00	258.02

股份有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 491	中微公司	2023-06-20	4,476,600.00	27,000.00	14	2.00	2,487.00	4,476,600.00	2,487.00
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 493	华海清科	2023-06-20	803,390.00	2,300.00	14	2.00	446.33	803,390.00	446.33
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 495	正帆科技	2023-06-20	576,776.00	13,600.00	14	2.00	320.43	576,776.00	320.43
国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 497	英集芯	2023-06-	50,940.00	3,000.00	14	2.00	28.30	50,940.00	28.30

安证 券股 份有 限公 司			20							
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 499	金宏 气体	202 3- 06- 20	541,986.0 0	20,600.0 0	14	2.0 0	301.10	541,986.0 0	301.10
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 501	东芯 股份	202 3- 06- 20	695,600.0 0	18,800.0 0	14	2.0 0	386.44	695,600.0 0	386.44
国泰 君安 证 券股 份有 限公 司	2023062000023 503	晶晨 股份	202 3- 06- 20	1,846,378. 00	20,600.0 0	14	2.0 0	1,025. 77	1,846,378. 00	1,025. 77

国泰君安证券股份有限公司	2023062000023 505	聚辰股份	2023-06-20	408,499.00	6,700.00	14	2.00	226.94	408,499.00	226.94
华泰证券股份有限公司	2023051000004 407	拓荆科技	2023-05-10	583,552.00	1,600.00	14	2.00	453.87	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 409	纳芯微	2023-05-10	392,000.00	1,400.00	14	2.00	304.89	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 413	华兴源创	2023-05-10	37,690.00	1,000.00	14	2.00	29.31	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 415	安路科	2023-05-	100,200.00	2,000.00	14	2.00	77.93	0.00	0.00



券股份有限公司		技	10							
华泰证券股份有限公司	2023051000004 416	海光信息	2023-05-10	278,964.00	3,600.00	14	2.00	216.97	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 419	龙芯中科	2023-05-10	192,640.00	1,400.00	14	2.00	149.83	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 421	睿创微纳	2023-05-10	308,450.00	6,200.00	14	2.00	239.91	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 423	华峰测控	2023-05-10	478,300.00	2,000.00	14	2.00	372.01	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051000004 425	东芯股份	2023-05-10	69,384.00	2,400.00	14	2.00	53.97	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 429	澜起科技	2023-05-10	790,860.00	14,000.00	14	2.00	615.11	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 431	安集科技	2023-05-10	455,300.00	2,000.00	14	2.00	354.12	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 432	芯海科技	2023-05-10	47,138.00	1,400.00	14	2.00	36.66	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 435	金宏气	2023-05-	132,288.00	5,200.00	14	2.00	102.89	0.00	0.00

券股份有限公司		体	10							
华泰证券股份有限公司	2023051000004 439	华海清科	2023-05-10	474,572.00	1,400.00	14	2.00	369.11	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 441	正帆科技	2023-05-10	122,240.00	3,200.00	14	2.00	95.08	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 443	盛美上海	2023-05-10	159,680.00	1,600.00	14	2.00	124.20	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 447	晶丰明源	2023-05-10	135,150.00	1,000.00	14	2.00	105.12	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051000004 449	明微电子	2023-05-10	101,700.00	2,000.00	14	2.00	79.10	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 451	唯捷创芯	2023-05-10	80,906.00	1,400.00	14	2.00	62.93	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 452	力芯微	2023-05-10	108,592.00	1,600.00	14	2.00	84.46	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 455	芯源微	2023-05-10	493,960.00	2,000.00	14	2.00	384.19	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 457	希荻微	2023-05-	33,280.00	1,600.00	14	2.00	25.88	0.00	0.00

券股份有限公司			10							
华泰证券股份有限公司	2023051000004 459	恒玄科技	2023-05-10	156,024.00	1,200.00	14	2.00	121.35	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 461	乐鑫科技	2023-05-10	256,520.00	2,000.00	14	2.00	199.52	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 463	沪硅产业	2023-05-10	419,904.00	19,200.00	14	2.00	326.59	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 465	晶晨股份	2023-05-10	364,500.00	5,000.00	14	2.00	283.50	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051000004 467	聚辰股份	2023-05-10	64,350.00	1,000.00	14	2.00	50.05	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 471	中芯国际	2023-05-10	1,049,000.00	20,000.00	14	2.00	815.89	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 473	中微公司	2023-05-10	1,166,900.00	7,000.00	14	2.00	907.59	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 475	艾为电子	2023-05-10	86,710.00	1,000.00	14	2.00	67.44	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 479	普冉股	2023-05-	151,400.00	1,000.00	14	2.00	117.76	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		份	10							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 481	华 润 微	202 3- 05- 10	549,884.0 0	9,200.00	14	2.0 0	427.69	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 485	格 科 微	202 3- 05- 10	78,988.00	5,200.00	14	2.0 0	61.44	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 489	复 旦 微 电	202 3- 05- 10	236,670.0 0	4,600.00	14	2.0 0	184.08	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023051000004 495	芯 朋 微	202 3- 05- 10	81,216.00	1,200.00	14	2.0 0	63.17	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051000004 499	芯原股份	2023-05-10	350,680.00	4,400.00	14	2.00	272.75	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 503	国芯科技	2023-05-10	67,380.00	1,200.00	14	2.00	52.41	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 504	思瑞浦	2023-05-10	232,170.00	1,000.00	14	2.00	180.58	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 517	寒武纪	2023-05-10	716,688.00	3,600.00	14	2.00	557.42	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 519	神工股	2023-05-	48,944.00	1,400.00	14	2.00	38.07	0.00	0.00



券 股 份 有 限 公 司		份	10							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 527	华 特 气 体	202 3- 05- 10	118,720.0 0	1,600.00	14	2.0 0	92.34	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 529	峰 昭 科 技	202 3- 05- 10	93,072.00	1,200.00	14	2.0 0	72.39	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051000004 531	思 特 威	202 3- 05- 10	79,926.00	1,400.00	14	2.0 0	62.16	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023051000004 535	中 科 蓝 讯	202 3- 05- 10	110,160.0 0	1,600.00	14	2.0 0	85.68	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051000004 539	概伦电子	2023-05-10	43,840.00	1,600.00	14	2.00	34.10	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 547	英集芯	2023-05-10	25,984.00	1,600.00	14	2.00	20.21	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 549	翱捷科技	2023-05-10	105,184.00	1,600.00	14	2.00	81.81	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051000004 551	天岳先进	2023-05-10	128,256.00	1,600.00	14	2.00	99.75	0.00	0.00
华泰证	2023051000004 555	臻镭科	2023-05-	108,080.00	1,400.00	14	2.00	84.06	0.00	0.00

券股份有限公司		技	10							
华泰证券股份有限公司	2023051100002 226	华峰测控	2023-05-11	470,780.00	2,000.00	14	2.00	366.16	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 228	思特威	2023-05-11	87,540.00	1,500.00	14	2.00	68.09	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 230	概伦电子	2023-05-11	46,920.00	1,700.00	14	2.00	36.49	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 232	安路科技	2023-05-11	105,168.00	2,100.00	14	2.00	81.80	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051100002 234	海光信息	2023-05-11	698,740.00	9,200.00	14	2.00	543.46	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 236	华海清科	2023-05-11	510,030.00	1,500.00	14	2.00	396.69	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 238	中微公司	2023-05-11	2,972,007.00	17,700.00	14	2.00	2,311.56	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 240	安集科技	2023-05-11	430,122.00	1,900.00	14	2.00	334.54	0.00	0.00
华泰证	2023051100002 242	天岳先	2023-05-	135,796.00	1,700.00	14	2.00	105.62	0.00	0.00

券股份有限公司		进	11							
华泰证券股份有限公司	2023051100002 244	聚辰股份	2023-05-11	171,774.00	2,700.00	14	2.00	133.60	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 246	希荻微	2023-05-11	33,856.00	1,600.00	14	2.00	26.33	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 248	芯源微	2023-05-11	495,320.00	2,000.00	14	2.00	385.25	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 249	乐鑫科技	2023-05-11	277,221.00	2,100.00	14	2.00	215.62	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051100002 252	神工股份	2023-05-11	118,090.00	3,500.00	14	2.00	91.85	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 254	龙芯中科	2023-05-11	210,870.00	1,500.00	14	2.00	164.01	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 255	唯捷创芯	2023-05-11	89,820.00	1,500.00	14	2.00	69.86	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 258	澜起科技	2023-05-11	1,941,492.00	34,800.00	14	2.00	1,510.05	0.00	0.00
华泰证	2023051100002 259	中芯国	2023-05-	2,658,592.00	50,200.00	14	2.00	2,067.79	0.00	0.00

券股份有限公司		际	11							
华泰证券股份有限公司	2023051100002 262	英集芯	2023-05-11	27,795.00	1,700.00	14	2.00	21.62	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 263	睿创微纳	2023-05-11	765,061.00	15,700.00	14	2.00	595.05	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 266	力芯微	2023-05-11	108,432.00	1,600.00	14	2.00	84.34	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 268	华兴源创	2023-05-11	88,067.00	2,300.00	14	2.00	68.50	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051100002 270	翱捷科技	2023-05-11	112,166.00	1,700.00	14	2.00	87.24	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 272	东芯股份	2023-05-11	181,250.00	5,800.00	14	2.00	140.97	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 274	格科微	2023-05-11	206,580.00	13,200.00	14	2.00	160.67	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 276	晶晨股份	2023-05-11	985,520.00	12,700.00	14	2.00	766.52	0.00	0.00
华泰证	2023051100002 278	金宏气	2023-05-	323,215.00	12,700.00	14	2.00	251.39	0.00	0.00



券股份有限公司		体	11							
华泰证券股份有限公司	2023051100002 280	艾为电子	2023-05-11	189,024.00	2,200.00	14	2.00	147.02	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 282	明微电子	2023-05-11	96,045.00	1,900.00	14	2.00	74.70	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 284	沪硅产业	2023-05-11	1,035,840.00	48,000.00	14	2.00	805.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 286	正帆科技	2023-05-11	320,456.00	8,200.00	14	2.00	249.24	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051100002 288	峰 昭 科 技	202 3- 05- 11	93,600.00	1,200.00	14	2.0 0	72.80	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 290	芯 海 科 技	202 3- 05- 11	124,912.0 0	3,700.00	14	2.0 0	97.15	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 292	思 瑞 浦	202 3- 05- 11	611,858.0 0	2,600.00	14	2.0 0	475.89	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 294	恒 玄 科 技	202 3- 05- 11	448,320.0 0	3,200.00	14	2.0 0	348.69	0.00	0.00
华泰证	2023051100002 296	芯 原 股	202 3- 05-	867,422.0 0	10,900.0 0	14	2.0 0	674.66	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		份	11							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051100002 297	盛 美 上 海	202 3- 05- 11	169,966.0 0	1,700.00	14	2.0 0	132.20	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051100002 300	臻 镭 科 技	202 3- 05- 11	114,390.0 0	1,500.00	14	2.0 0	88.97	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023051100002 301	普 冉 股 份	202 3- 05- 11	157,900.0 0	1,000.00	14	2.0 0	122.81	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023051100002 304	纳 芯 微	202 3- 05- 11	356,200.0 0	1,300.00	14	2.0 0	277.04	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023051100002 306	复旦微电	2023-05-11	607,698.00	11,700.00	14	2.00	472.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 308	华润微	2023-05-11	1,400,352.00	23,200.00	14	2.00	1,089.16	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 310	芯朋微	2023-05-11	207,840.00	3,000.00	14	2.00	161.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 312	中科蓝讯	2023-05-11	132,192.00	1,600.00	14	2.00	102.82	0.00	0.00
华泰证	2023051100002 314	国芯科	2023-05-	177,920.00	3,200.00	14	2.00	138.38	0.00	0.00

券股份有限公司		技	11							
华泰证券股份有限公司	2023051100002 316	晶丰明源	2023-05-11	140,000.00	1,000.00	14	2.00	108.89	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 318	拓荆科技	2023-05-11	643,484.00	1,700.00	14	2.00	500.49	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 320	华特气体	2023-05-11	118,672.00	1,600.00	14	2.00	92.30	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023051100002 322	寒武纪	2023-05-11	1,724,976.00	8,800.00	14	2.00	1,341.65	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400014 882	芯源微	2023-05-24	532,200.00	2,000.00	14	2.00	413.93	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400014 884	中微公司	2023-05-24	1,110,060.00	7,000.00	14	2.00	863.38	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400014 886	金宏气体	2023-05-24	129,480.00	5,200.00	14	2.00	100.71	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400014 888	盛美上海	2023-05-24	176,800.00	1,600.00	14	2.00	137.51	0.00	0.00
华泰证	2023052400014 890	神工股	2023-05-	50,554.00	1,400.00	14	2.00	39.32	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		份	24							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400014 892	复 旦 微 电	202 3- 05- 24	248,998.0 0	4,600.00	14	2.0 0	193.67	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400014 894	澜 起 科 技	202 3- 05- 24	812,000.0 0	14,000.0 0	14	2.0 0	631.56	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400017 844	华 峰 测 控	202 3- 05- 24	518,280.0 0	2,000.00	14	2.0 0	403.11	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023052400017 846	晶 晨 股 份	202 3- 05- 24	411,900.0 0	5,000.00	14	2.0 0	320.37	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400017 848	乐鑫科技	2023-05-24	255,940.00	2,000.00	14	2.00	199.06	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 850	沪硅产业	2023-05-24	399,936.00	19,200.00	14	2.00	311.06	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 852	中芯国际	2023-05-24	998,200.00	20,000.00	14	2.00	776.38	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 854	普冉股份	2023-05-24	172,950.00	1,000.00	14	2.00	134.52	0.00	0.00
华泰证	2023052400017 856	华润微	2023-05-	527,528.00	9,200.00	14	2.00	410.30	0.00	0.00



券股份有限公司			24							
华泰证券股份有限公司	2023052400017858	芯海科技	2023-05-24	49,168.00	1,400.00	14	2.00	38.24	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017860	明微电子	2023-05-24	105,420.00	2,000.00	14	2.00	81.99	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017862	力芯微	2023-05-24	121,600.00	1,600.00	14	2.00	94.58	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017864	恒玄科技	2023-05-24	166,536.00	1,200.00	14	2.00	129.53	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400017 866	纳芯微	2023-05-24	375,732.00	1,400.00	14	2.00	292.24	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 868	海光信息	2023-05-24	276,588.00	3,600.00	14	2.00	215.12	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 870	国芯科技	2023-05-24	66,408.00	1,200.00	14	2.00	51.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017 872	天岳先进	2023-05-24	124,336.00	1,600.00	14	2.00	96.71	0.00	0.00
华泰证	2023052400017 874	概伦电	2023-05-	45,840.00	1,600.00	14	2.00	35.65	0.00	0.00

券股份有限公司		子	24							
华泰证券股份有限公司	2023052400017876	格科微	2023-05-24	82,264.00	5,200.00	14	2.00	63.98	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017878	芯原股份	2023-05-24	350,196.00	4,400.00	14	2.00	272.37	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017880	睿创微纳	2023-05-24	310,124.00	6,200.00	14	2.00	241.21	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400017882	峰昭科技	2023-05-24	100,620.00	1,200.00	14	2.00	78.26	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400017886	臻镭科技	2023-05-24	118,118.00	1,400.00	14	2.00	91.87	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022540	安路科技	2023-05-24	104,760.00	2,000.00	14	2.00	81.48	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022542	安集科技	2023-05-24	469,860.00	2,000.00	14	2.00	365.45	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022544	华海清科	2023-05-24	520,884.00	1,400.00	14	2.00	405.13	0.00	0.00
华泰证	2023052400022546	晶丰明	2023-05-	145,100.00	1,000.00	14	2.00	112.86	0.00	0.00

券股份有限公司		源	24							
华泰证券股份有限公司	2023052400022 548	寒武纪	2023-05-24	655,200.00	3,600.00	14	2.00	509.60	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 550	唯捷创芯	2023-05-24	90,832.00	1,400.00	14	2.00	70.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 552	希荻微	2023-05-24	35,696.00	1,600.00	14	2.00	27.76	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 554	正帆科技	2023-05-24	121,344.00	3,200.00	14	2.00	94.38	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400022 556	东芯股份	2023-05-24	85,752.00	2,400.00	14	2.00	66.70	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 558	龙芯中科	2023-05-24	191,982.00	1,400.00	14	2.00	149.32	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 560	拓荆科技	2023-05-24	626,976.00	1,600.00	14	2.00	487.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 562	华特气体	2023-05-24	137,936.00	1,600.00	14	2.00	107.28	0.00	0.00
华泰证	2023052400022 564	翱捷科	2023-05-	116,368.00	1,600.00	14	2.00	90.51	0.00	0.00

券股份有限公司		技	24							
华泰证券股份有限公司	2023052400022 566	思特威	2023-05-24	81,018.00	1,400.00	14	2.00	63.01	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 568	聚辰股份	2023-05-24	75,620.00	1,000.00	14	2.00	58.82	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 570	艾为电子	2023-05-24	90,000.00	1,000.00	14	2.00	70.00	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400022 572	芯朋微	2023-05-24	80,808.00	1,200.00	14	2.00	62.85	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052400022 576	华兴源创	2023-05-24	36,670.00	1,000.00	14	2.00	28.52	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400024 840	中科蓝讯	2023-05-24	129,616.00	1,600.00	14	2.00	100.81	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052400024 842	英集芯	2023-05-24	27,984.00	1,600.00	14	2.00	21.77	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 572	思特威	2023-05-25	86,025.00	1,500.00	14	2.00	66.91	0.00	0.00
华泰证	2023052500008 574	安路科	2023-05-	111,279.00	2,100.00	14	2.00	86.55	0.00	0.00



券股份有限公司		技	25							
华泰证券股份有限公司	2023052500008 576	华海清科	2023-05-25	577,500.00	1,500.00	14	2.00	449.17	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 578	安集科技	2023-05-25	452,637.00	1,900.00	14	2.00	352.05	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 580	翱捷科技	2023-05-25	121,737.00	1,700.00	14	2.00	94.68	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 582	乐鑫科技	2023-05-25	271,845.00	2,100.00	14	2.00	211.44	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052500008 584	龙芯中科	2023-05-25	236,520.00	1,500.00	14	2.00	183.96	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 586	英集芯	2023-05-25	30,039.00	1,700.00	14	2.00	23.36	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 588	东芯股份	2023-05-25	206,480.00	5,800.00	14	2.00	160.60	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 590	希荻微	2023-05-25	36,064.00	1,600.00	14	2.00	28.05	0.00	0.00
华泰证	2023052500008 598	艾为电	2023-05-	201,190.00	2,200.00	14	2.00	156.48	0.00	0.00

券股份有限公司		子	25							
华泰证券股份有限公司	2023052500008 616	芯海科技	2023-05-25	129,500.00	3,700.00	14	2.00	100.72	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 618	芯朋微	2023-05-25	205,200.00	3,000.00	14	2.00	159.60	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 620	中科蓝讯	2023-05-25	127,344.00	1,600.00	14	2.00	99.05	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 622	晶丰明源	2023-05-25	147,500.00	1,000.00	14	2.00	114.72	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052500008 626	恒玄科技	2023-05-25	448,192.00	3,200.00	14	2.00	348.59	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 628	拓荆科技	2023-05-25	667,930.00	1,700.00	14	2.00	519.50	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 632	华特气体	2023-05-25	136,160.00	1,600.00	14	2.00	105.90	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 634	寒武纪	2023-05-25	1,711,600.00	8,800.00	14	2.00	1,331.24	0.00	0.00
华泰证	2023052500008 826	华润微	2023-05-	1,338,640.00	23,200.00	14	2.00	1,041.16	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司			25							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 828	睿 创 微 纳	202 3- 05- 25	782,645.0 0	15,700.0 0	14	2.0 0	608.72	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 830	华 兴 源 创	202 3- 05- 25	83,191.00	2,300.00	14	2.0 0	64.70	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 832	天 岳 先 进	202 3- 05- 25	137,564.0 0	1,700.00	14	2.0 0	106.99	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023052500008 834	华 峰 测 控	202 3- 05- 25	524,720.0 0	2,000.00	14	2.0 0	408.12	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052500008 836	概伦电子	2023-05-25	48,671.00	1,700.00	14	2.00	37.86	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 838	中芯国际	2023-05-25	2,528,072.00	50,200.00	14	2.00	1,966.28	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 840	晶晨股份	2023-05-25	1,037,590.00	12,700.00	14	2.00	807.01	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500008 842	明微电子	2023-05-25	101,365.00	1,900.00	14	2.00	78.84	0.00	0.00
华泰证	2023052500008 844	力芯微	2023-05-	122,320.00	1,600.00	14	2.00	95.14	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司			25							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 846	峰 昭 科 技	202 3- 05- 25	102,816.0 0	1,200.00	14	2.0 0	79.97	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 848	海 光 信 息	202 3- 05- 25	745,200.0 0	9,200.00	14	2.0 0	579.60	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 850	聚 辰 股 份	202 3- 05- 25	205,659.0 0	2,700.00	14	2.0 0	159.96	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023052500008 852	唯 捷 创 芯	202 3- 05- 25	95,550.00	1,500.00	14	2.0 0	74.32	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023052500008 858	正帆科技	202 3- 05- 25	310,780.0 0	8,200.00	14	2.0 0	241.72	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023052500008 868	沪硅产业	202 3- 05- 25	1,008,480. 00	48,000.0 0	14	2.0 0	784.37	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023052500008 888	国芯科技	202 3- 05- 25	178,464.0 0	3,200.00	14	2.0 0	138.81	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023052500008 890	臻镭科技	202 3- 05- 25	129,375.0 0	1,500.00	14	2.0 0	100.63	0.00	0.00
华泰证	2023052500008 892	芯原股	202 3- 05-	880,175.0 0	10,900.0 0	14	2.0 0	684.58	0.00	0.00



券 股 份 有 限 公 司		份	25							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 894	普 冉 股 份	202 3- 05- 25	172,860.0 0	1,000.00	14	2.0 0	134.45	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500014 720	盛 美 上 海	202 3- 05- 25	193,052.0 0	1,700.00	14	2.0 0	150.15	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500014 722	纳 芯 微	202 3- 05- 25	347,217.0 0	1,300.00	14	2.0 0	270.06	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023052500014 732	澜 起 科 技	202 3- 05- 25	2,091,480. 00	34,800.0 0	14	2.0 0	1,626. 71	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023052500014 734	中微公司	2023-05-25	2,825,805.00	17,700.00	14	2.00	2,197.85	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500014 744	芯源微	2023-05-25	533,800.00	2,000.00	14	2.00	415.18	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500014 746	神工股份	2023-05-25	129,780.00	3,500.00	14	2.00	100.94	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023052500014 750	格科微	2023-05-25	210,408.00	13,200.00	14	2.00	163.65	0.00	0.00
华泰证	2023052500014 752	金宏气	2023-05-	325,247.00	12,700.00	14	2.00	252.97	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		体	25							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500014 762	复 旦 微 电	202 3- 05- 25	651,807.0 0	11,700.0 0	14	2.0 0	506.96	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052400022 574	思 瑞 浦	202 3- 05- 24	224,000.0 0	1,000.00	14	2.0 0	236.44	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023052500008 624	思 瑞 浦	202 3- 05- 25	585,728.0 0	2,600.00	14	2.0 0	585.73	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023060700016 178	思 特 威	202 3- 06- 07	79,058.00	1,400.00	14	2.0 0	61.49	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023060700016 315	国 芯 科 技	202 3- 06- 07	70,992.00	1,200.00	14	2.0 0	55.22	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023060700016 426	恒 玄 科 技	202 3- 06- 07	164,700.0 0	1,200.00	14	2.0 0	128.10	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023060700016 919	龙 芯 中 科	202 3- 06- 07	201,572.0 0	1,400.00	14	2.0 0	156.78	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023060700016 920	希 荻 微	202 3- 06- 07	37,040.00	1,600.00	14	2.0 0	28.81	0.00	0.00
华泰证	2023060700017 064	中 芯 国	202 3- 06-	1,093,400. 00	20,000.0 0	14	2.0 0	850.42	0.00	0.00

券股份有限公司		际	07							
华泰证券股份有限公司	2023060700017 251	金宏气体	2023-06-07	128,700.00	5,200.00	14	2.00	100.10	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700017 336	安路科技	2023-06-07	108,140.00	2,000.00	14	2.00	84.11	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700017 337	翱捷科技	2023-06-07	127,840.00	1,600.00	14	2.00	99.43	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700017 338	华特气体	2023-06-07	133,056.00	1,600.00	14	2.00	103.49	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060700017871	正帆科技	2023-06-07	121,568.00	3,200.00	14	2.00	94.55	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700017993	唯捷创芯	2023-06-07	96,894.00	1,400.00	14	2.00	75.36	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700018029	纳芯微	2023-06-07	236,880.00	1,400.00	14	2.00	184.24	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700018189	晶丰明源	2023-06-07	129,650.00	1,000.00	14	2.00	100.84	0.00	0.00
华泰证	2023060700018413	澜起科	2023-06-	838,740.00	14,000.00	14	2.00	652.35	0.00	0.00

券股份有限公司		技	07							
华泰证券股份有限公司	2023060700018 636	中微公司	2023-06-07	1,078,350.00	7,000.00	14	2.00	838.72	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700018 662	华峰测控	2023-06-07	326,000.00	2,000.00	14	2.00	253.56	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700018 732	聚辰股份	2023-06-07	73,650.00	1,000.00	14	2.00	57.28	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700018 777	晶晨股份	2023-06-07	449,550.00	5,000.00	14	2.00	349.65	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060700019 149	芯源微	2023-06-07	558,700.00	2,000.00	14	2.00	434.54	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019 168	东芯股份	2023-06-07	83,328.00	2,400.00	14	2.00	64.81	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019 170	复旦微电	2023-06-07	250,148.00	4,600.00	14	2.00	194.56	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019 314	睿创微纳	2023-06-07	301,692.00	6,200.00	14	2.00	234.65	0.00	0.00
华泰证	2023060700019 315	概伦电	2023-06-	47,376.00	1,600.00	14	2.00	36.85	0.00	0.00



券 股 份 有 限 公 司		子	07							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 380	安 集 科 技	202 3- 06- 07	496,340.0 0	2,000.00	14	2.0 0	386.04	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 396	盛 美 上 海	202 3- 06- 07	185,840.0 0	1,600.00	14	2.0 0	144.54	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700019 413	臻 镭 科 技	202 3- 06- 07	88,648.00	1,400.00	14	2.0 0	68.95	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023060700019 469	英 集 芯	202 3- 06- 07	27,840.00	1,600.00	14	2.0 0	21.65	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060700019498	拓荆科技	2023-06-07	663,904.00	1,600.00	14	2.00	516.37	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019679	华海清科	2023-06-07	491,400.00	1,400.00	14	2.00	382.20	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019809	艾为电子	2023-06-07	90,320.00	1,000.00	14	2.00	70.25	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060700019946	乐鑫科技	2023-06-07	293,420.00	2,000.00	14	2.00	228.22	0.00	0.00
华泰证	2023060700020048	海光信	2023-06-	287,568.00	3,600.00	14	2.00	223.66	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		息	07							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700020 131	华 兴 源 创	202 3- 06- 07	31,300.00	1,000.00	14	2.0 0	24.34	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060700020 263	天 岳 先 进	202 3- 06- 07	118,592.0 0	1,600.00	14	2.0 0	92.24	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060800016 461	龙 芯 中 科	202 3- 06- 08	210,000.0 0	1,500.00	14	2.0 0	210.00	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023060800016 779	艾 为 电 子	202 3- 06- 08	195,206.0 0	2,200.00	14	2.0 0	195.21	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060800016780	华兴源创	2023-06-08	69,690.00	2,300.00	14	2.00	69.69	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800016887	思特威	2023-06-08	83,490.00	1,500.00	14	2.00	83.49	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800016890	华润微	2023-06-08	1,243,288.00	23,200.00	14	2.00	1,243.29	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800016999	寒武纪	2023-06-08	1,944,888.00	8,800.00	14	2.00	1,944.89	0.00	0.00
华泰证	2023060800017102	安路科	2023-06-	112,791.00	2,100.00	14	2.00	112.79	0.00	0.00

券股份有限公司		技	08							
华泰证券股份有限公司	2023060800017 104	天岳先进	2023-06-08	126,650.00	1,700.00	14	2.00	126.65	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800017 325	芯源微	2023-06-08	552,420.00	2,000.00	14	2.00	552.42	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800017 421	华峰测控	2023-06-08	320,180.00	2,000.00	14	2.00	320.18	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800017 638	唯捷创芯	2023-06-08	100,470.00	1,500.00	14	2.00	100.47	0.00	0.00

公司										
华泰证 券股 份有 限公 司	2023060800017 743	睿 创 微 纳	202 3- 06- 08	750,303.0 0	15,700.0 0	14	2.0 0	750.30	0.00	0.00
华泰证 券股 份有 限公 司	2023060800017 848	纳 芯 微	202 3- 06- 08	212,758.0 0	1,300.00	14	2.0 0	212.76	0.00	0.00
华泰证 券股 份有 限公 司	2023060800018 016	复 旦 微 电	202 3- 06- 08	618,579.0 0	11,700.0 0	14	2.0 0	618.58	0.00	0.00
华泰证 券股 份有 限公 司	2023060800018 066	沪 硅 产 业	202 3- 06- 08	974,400.0 0	48,000.0 0	14	2.0 0	974.40	0.00	0.00
华泰证	2023060800018 171	乐 鑫 科	202 3- 06-	298,494.0 0	2,100.00	14	2.0 0	298.49	0.00	0.00

券股份有限公司		技	08							
华泰证券股份有限公司	2023060800018 279	华特气体	2023-06-08	128,768.00	1,600.00	14	2.00	128.77	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800018 384	中微公司	2023-06-08	2,692,347.00	17,700.00	14	2.00	2,692.35	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800018 599	东芯股份	2023-06-08	196,794.00	5,800.00	14	2.00	196.79	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800018 706	芯原股份	2023-06-08	922,140.00	10,900.00	14	2.00	922.14	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060800018 812	安集科技	2023-06-08	453,245.00	1,900.00	14	2.00	453.25	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800018 922	正帆科技	2023-06-08	303,400.00	8,200.00	14	2.00	303.40	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800019 245	拓荆科技	2023-06-08	706,010.00	1,700.00	14	2.00	706.01	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800019 254	格科微	2023-06-08	206,052.00	13,200.00	14	2.00	206.05	0.00	0.00
华泰证	2023060800019 353	澜起科	2023-06-	1,987,428.00	34,800.00	14	2.00	1,987.43	0.00	0.00



券股份有限公司		技	08							
华泰证券股份有限公司	2023060800019 562	华海清科	2023-06-08	481,065.00	1,500.00	14	2.00	481.07	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800019 670	概伦电子	2023-06-08	49,827.00	1,700.00	14	2.00	49.83	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800019 779	希荻微	2023-06-08	36,368.00	1,600.00	14	2.00	36.37	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800019 781	英集芯	2023-06-08	28,764.00	1,700.00	14	2.00	28.76	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060800019887	金宏气体	2023-06-08	303,530.00	12,700.00	14	2.00	303.53	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	202306080001992	恒玄科技	2023-06-08	417,792.00	3,200.00	14	2.00	417.79	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800020091	盛美上海	2023-06-08	198,390.00	1,700.00	14	2.00	198.39	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800020310	聚辰股份	2023-06-08	191,376.00	2,700.00	14	2.00	191.38	0.00	0.00
华泰证	2023060800020527	海光信	2023-06-	710,700.00	9,200.00	14	2.00	710.70	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		息	08							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060800022 432	国 芯 科 技	202 3- 06- 08	185,696.0 0	3,200.00	14	2.0 0	185.70	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060800022 635	晶 丰 明 源	202 3- 06- 08	124,870.0 0	1,000.00	14	2.0 0	124.87	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023060800022 636	晶 晨 股 份	202 3- 06- 08	1,140,587. 00	12,700.0 0	14	2.0 0	1,140. 59	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023060800024 244	翱 捷 科 技	202 3- 06- 08	137,853.0 0	1,700.00	14	2.0 0	137.85	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023060800024 245	中芯国际	2023-06-08	2,688,712.00	50,200.00	14	2.00	2,688.71	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023060800024 783	臻镭科技	2023-06-08	95,190.00	1,500.00	14	2.00	95.19	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 344	翱捷科技	2023-06-13	1,283,640.00	15,200.00	14	2.00	998.39	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 346	晶丰明源	2023-06-13	237,942.00	1,800.00	14	2.00	185.07	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 348	中微半	2023-06-	133,672.00	4,400.00	14	2.00	103.97	0.00	0.00

券股份有限公司		导	13							
华泰证券股份有限公司	2023061300010 350	思特威	2023-06-13	161,280.00	2,800.00	14	2.00	125.44	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 352	艾为电子	2023-06-13	441,360.00	4,800.00	14	2.00	343.28	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 354	华海清科	2023-06-13	773,237.00	2,300.00	14	2.00	601.41	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司有限	2023061300010 356	安路科技	2023-06-13	514,976.00	8,800.00	14	2.00	400.54	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 358	伟 测 科 技	202 3- 06- 13	275,329.0 0	1,900.00	14	2.0 0	214.14	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 360	复 旦 微 电	202 3- 06- 13	1,043,520. 00	19,200.0 0	14	2.0 0	811.63	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 362	东 微 半 导	202 3- 06- 13	349,600.0 0	1,900.00	14	2.0 0	271.91	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 364	格 科 微	202 3- 06- 13	607,436.0 0	36,200.0 0	14	2.0 0	472.45	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 365	中 芯 国	202 3- 06-	4,891,820. 00	88,300.0 0	14	2.0 0	3,804. 75	0.00	0.00

券股份有限公司		际	13							
华泰证券股份有限公司	2023061300010 368	华润微	2023-06-13	2,060,448.00	38,100.00	14	2.00	1,602.57	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 370	天岳先进	2023-06-13	469,216.00	6,200.00	14	2.00	364.95	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 371	华特气体	2023-06-13	285,460.00	3,500.00	14	2.00	222.02	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 374	帝奥微	2023-06-13	181,764.00	5,400.00	14	2.00	141.37	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 375	澜起科技	202 3- 06- 13	3,626,445. 00	57,700.0 0	14	2.0 0	2,820. 57	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 378	沪硅产业	202 3- 06- 13	2,156,220. 00	99,000.0 0	14	2.0 0	1,677. 06	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 379	希荻微	202 3- 06- 13	216,804.0 0	8,900.00	14	2.0 0	168.63	0.00	0.00
华泰证券股份 有限公司	2023061300010 382	睿创微纳	202 3- 06- 13	1,254,500. 00	26,000.0 0	14	2.0 0	975.72	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 383	东芯股	202 3- 06-	720,960.0 0	19,200.0 0	14	2.0 0	560.75	0.00	0.00



券 股 份 有 限 公 司		份	13							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 386	英 集 芯	202 3- 06- 13	54,405.00	3,100.00	14	2.0 0	42.32	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 387	华 兴 源 创	202 3- 06- 13	114,342.0 0	3,800.00	14	2.0 0	88.93	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 390	国 芯 科 技	202 3- 06- 13	816,597.0 0	12,300.0 0	14	2.0 0	635.13	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023061300010 391	正 帆 科 技	202 3- 06- 13	590,100.0 0	14,000.0 0	14	2.0 0	458.97	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023061300010 392	金宏气体	2023-06-13	523,980.00	21,300.00	14	2.00	407.54	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 396	拓荆科技	2023-06-13	1,236,995.00	2,900.00	14	2.00	962.11	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 397	聚辰股份	2023-06-13	401,180.00	5,200.00	14	2.00	312.03	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 400	唯捷创芯	2023-06-13	192,300.00	2,500.00	14	2.00	149.57	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 401	晶晨股	2023-06-	1,979,391.00	21,100.00	14	2.00	1,539.53	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		份	13							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 404	龙 芯 中 科	202 3- 06- 13	400,064.0 0	2,800.00	14	2.0 0	311.16	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 405	寒 武 纪	202 3- 06- 13	3,540,080. 00	15,200.0 0	14	2.0 0	2,753. 40	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 408	思 瑞 浦	202 3- 06- 13	1,268,228. 00	5,200.00	14	2.0 0	986.40	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023061300010 409	纳 芯 微	202 3- 06- 13	539,040.0 0	3,200.00	14	2.0 0	419.25	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023061300010 412	概伦电子	2023-06-13	284,350.00	9,400.00	14	2.00	221.16	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 413	芯原股份	2023-06-13	1,638,955.00	18,100.00	14	2.00	1,274.74	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 414	安集科技	2023-06-13	772,200.00	3,300.00	14	2.00	600.60	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 418	海光信息	2023-06-13	1,373,260.00	17,000.00	14	2.00	1,068.09	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 419	华峰测	2023-06-	963,765.00	5,900.00	14	2.00	749.60	0.00	0.00

券股份有限公司		控	13							
华泰证券股份有限公司	2023061300010 420	臻镭科技	2023-06-13	413,820.00	6,600.00	14	2.00	321.86	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 424	芯碁微装	2023-06-13	399,880.00	5,200.00	14	2.00	311.02	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 425	盛美上海	2023-06-13	798,336.00	6,300.00	14	2.00	620.93	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司有限	2023061300010 428	中微公司	2023-06-13	4,405,744.00	27,800.00	14	2.00	3,426.69	0.00	0.00

公司										
华泰证券股份有限公司	2023061300010 430	乐鑫科技	2023-06-13	532,000.00	3,500.00	14	2.00	413.78	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 432	富创精密	2023-06-13	542,340.00	4,600.00	14	2.00	421.82	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 434	芯源微	2023-06-13	1,494,865.00	5,300.00	14	2.00	1,162.67	0.00	0.00
华泰证券股份有限公司	2023061300010 436	恒玄科技	2023-06-13	696,280.00	5,200.00	14	2.00	541.55	0.00	0.00
华泰证	2023061300010 438	汇成股	2023-06-	117,299.00	9,100.00	14	2.00	91.23	0.00	0.00

券 股 份 有 限 公 司		份	13							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023061300010 440	宏 微 科 技	202 3- 06- 13	471,240.0 0	7,700.00	14	2.0 0	366.52	0.00	0.00
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 283	格 科 微	202 3- 06- 27	375,171.0 0	23,700.0 0	14	2.0 0	62.53	375,171.0 0	62.53
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 285	臻 镭 科 技	202 3- 06- 27	259,849.0 0	4,300.00	14	2.0 0	43.31	259,849.0 0	43.31
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700009 287	晶 丰 明 源	202 3- 06- 27	166,224.0 0	1,200.00	14	2.0 0	27.70	166,224.0 0	27.70

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 289	翱 捷 科 技	202 3- 06- 27	750,321.0 0	9,900.00	14	2.0 0	125.05	750,321.0 0	125.05
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 291	华 特 气 体	202 3- 06- 27	177,100.0 0	2,300.00	14	2.0 0	29.52	177,100.0 0	29.52
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 293	国 芯 科 技	202 3- 06- 27	459,040.0 0	8,000.00	14	2.0 0	76.51	459,040.0 0	76.51
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 295	寒 武 纪	202 3- 06- 27	1,947,231. 00	9,900.00	14	2.0 0	324.54	1,947,231. 00	324.54
华泰证	2023062700009 297	富 创 精	202 3- 06-	314,340.0 0	3,000.00	14	2.0 0	52.39	314,340.0 0	52.39



券 股 份 有 限 公 司		密	27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 299	宏 微 科 技	202 3- 06- 27	290,850.0 0	5,000.00	14	2.0 0	48.48	290,850.0 0	48.48
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 301	恒 玄 科 技	202 3- 06- 27	424,184.0 0	3,400.00	14	2.0 0	70.70	424,184.0 0	70.70
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 302	帝 奥 微	202 3- 06- 27	117,180.0 0	3,600.00	14	2.0 0	19.53	117,180.0 0	19.53
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700009 305	伟 测 科 技	202 3- 06- 27	169,464.0 0	1,200.00	14	2.0 0	28.24	169,464.0 0	28.24

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700009 306	中芯国际	2023-06-27	2,965,203.00	57,700.00	14	2.00	494.20	2,965,203.00	494.20
华泰证券股份有限公司	2023062700009 309	中微半导体	2023-06-27	82,684.00	2,800.00	14	2.00	13.78	82,684.00	13.78
华泰证券股份有限公司	2023062700009 310	思特威	2023-06-27	85,578.00	1,700.00	14	2.00	14.26	85,578.00	14.26
华泰证券股份有限公司	2023062700009 313	天岳先进	2023-06-27	304,958.00	4,100.00	14	2.00	50.83	304,958.00	50.83
华泰证	2023062700009 314	芯碁微	2023-06-	248,710.00	3,400.00	14	2.00	41.45	248,710.00	41.45

券股份有限公司		装	27							
华泰证券股份有限公司	2023062700009 317	东 微 半 导	202 3- 06- 27	251,766.0 0	1,800.00	14	2.0 0	41.96	251,766.0 0	41.96
华泰证券股份有限公司	2023062700009 319	复 旦 微 电	202 3- 06- 27	648,648.0 0	12,600.0 0	14	2.0 0	108.11	648,648.0 0	108.11
华泰证券股份有限公司	2023062700009 320	汇 成 股 份	202 3- 06- 27	72,865.00	5,900.00	14	2.0 0	12.14	72,865.00	12.14
华泰证券股份有限公司	2023062700009 323	艾 为 电 子	202 3- 06- 27	250,800.0 0	4,400.00	14	2.0 0	41.80	250,800.0 0	41.80

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700009 325	华润微	2023-06-27	1,312,750.00	25,000.00	14	2.00	218.79	1,312,750.00	218.79
华泰证券股份有限公司	2023062700009 327	海光信息	2023-06-27	755,920.00	11,000.00	14	2.00	125.99	755,920.00	125.99
华泰证券股份有限公司	2023062700009 329	纳芯微	2023-06-27	334,000.00	2,000.00	14	2.00	55.67	334,000.00	55.67
华泰证券股份有限公司	2023062700009 331	睿创微纳	2023-06-27	751,712.00	16,900.00	14	2.00	125.29	751,712.00	125.29
华泰证	2023062700009 332	龙芯中	2023-06-	229,279.00	1,700.00	14	2.00	38.21	229,279.00	38.21

券股份有限公司		科	27							
华泰证券股份有限公司	2023062700009 335	华兴源创	2023-06-27	79,750.00	2,500.00	14	2.00	13.29	79,750.00	13.29
华泰证券股份有限公司	2023062700009 337	芯源微	2023-06-27	887,484.00	5,200.00	14	2.00	147.91	887,484.00	147.91
华泰证券股份有限公司	2023062700009 339	正帆科技	2023-06-27	356,811.00	9,100.00	14	2.00	59.47	356,811.00	59.47
华泰证券股份有限公司	2023062700009 341	乐鑫科技	2023-06-27	308,154.00	2,300.00	14	2.00	51.36	308,154.00	51.36

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700009 343	安集科技	2023-06-27	448,000.00	2,800.00	14	2.00	74.67	448,000.00	74.67
华泰证券股份有限公司	2023062700009 345	思瑞浦	2023-06-27	775,880.00	3,400.00	14	2.00	129.31	775,880.00	129.31
华泰证券股份有限公司	2023062700009 347	盛美上海	2023-06-27	455,961.00	4,100.00	14	2.00	75.99	455,961.00	75.99
华泰证券股份有限公司	2023062700009 349	芯原股份	2023-06-27	912,848.00	11,800.00	14	2.00	152.14	912,848.00	152.14
华泰证	2023062700009 351	希荻微	2023-06-	130,674.00	5,800.00	14	2.00	21.78	130,674.00	21.78

券 股 份 有 限 公 司			27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 353	长 光 华 芯	202 3- 06- 27	243,875.0 0	2,500.00	14	2.0 0	40.65	243,875.0 0	40.65
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 355	唯 捷 创 芯	202 3- 06- 27	107,595.0 0	1,500.00	14	2.0 0	17.93	107,595.0 0	17.93
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 357	中 微 公 司	202 3- 06- 27	2,742,150. 00	18,100.0 0	14	2.0 0	457.03	2,742,150. 00	457.03
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700009 359	拓 荆 科 技	202 3- 06- 27	724,950.0 0	1,800.00	14	2.0 0	120.83	724,950.0 0	120.83

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 361	澜起科技	202 3- 06- 27	2,114,593. 00	37,700.0 0	14	2.0 0	352.43	2,114,593. 00	352.43
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 363	沪硅产业	202 3- 06- 27	1,352,230. 00	64,700.0 0	14	2.0 0	225.37	1,352,230. 00	225.37
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 365	概伦电子	202 3- 06- 27	166,098.0 0	6,200.00	14	2.0 0	27.68	166,098.0 0	27.68
华泰证券股份 有限公司	2023062700009 367	华峰测控	202 3- 06- 27	582,236.0 0	3,800.00	14	2.0 0	97.04	582,236.0 0	97.04
华泰证	2023062700009 369	安路科	202 3- 06-	291,099.0 0	5,700.00	14	2.0 0	48.52	291,099.0 0	48.52



券 股 份 有 限 公 司		技	27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 371	华 海 清 科	202 3- 06- 27	341,115.0 0	1,500.00	14	2.0 0	56.85	341,115.0 0	56.85
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 373	晶 晨 股 份	202 3- 06- 27	1,196,460. 00	13,800.0 0	14	2.0 0	199.41	1,196,460. 00	199.41
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700009 375	英 集 芯	202 3- 06- 27	32,080.00	2,000.00	14	2.0 0	5.35	32,080.00	5.35
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700009 377	金 宏 气 体	202 3- 06- 27	352,590.0 0	13,800.0 0	14	2.0 0	58.77	352,590.0 0	58.77

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700009 379	东芯股份	2023-06-27	434,826.00	12,600.00	14	2.00	72.47	434,826.00	72.47
华泰证券股份有限公司	2023062700009 381	聚辰股份	2023-06-27	236,790.00	4,500.00	14	2.00	39.47	236,790.00	39.47
华泰证券股份有限公司	2023062700015 818	英集芯	2023-06-27	49,724.00	3,100.00	14	2.00	8.29	49,724.00	8.29
华泰证券股份有限公司	2023062700015 908	思特威	2023-06-27	140,952.00	2,800.00	14	2.00	23.49	140,952.00	23.49
华泰证	2023062700015 922	概伦电	2023-06-	251,826.00	9,400.00	14	2.00	41.97	251,826.00	41.97

券股份有限公司		子	27							
华泰证券股份有限公司	2023062700016020	睿创微纳	2023-06-27	1,156,480.00	26,000.00	14	2.00	192.75	1,156,480.00	192.75
华泰证券股份有限公司	2023062700016062	翱捷科技	2023-06-27	1,152,008.00	15,200.00	14	2.00	192.00	1,152,008.00	192.00
华泰证券股份有限公司	2023062700016233	龙芯中科	2023-06-27	377,636.00	2,800.00	14	2.00	62.94	377,636.00	62.94
华泰证券股份有限公司	2023062700016371	晶丰明源	2023-06-27	249,336.00	1,800.00	14	2.00	41.56	249,336.00	41.56

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023062700016 455	恒 玄 科 技	202 3- 06- 27	648,752.0 0	5,200.00	14	2.0 0	108.13	648,752.0 0	108.13
华泰证券股份 有限公司	2023062700016 529	艾 为 电 子	202 3- 06- 27	273,600.0 0	4,800.00	14	2.0 0	45.60	273,600.0 0	45.60
华泰证券股份 有限公司	2023062700016 530	安 路 科 技	202 3- 06- 27	449,416.0 0	8,800.00	14	2.0 0	74.90	449,416.0 0	74.90
华泰证券股份 有限公司	2023062700016 546	唯 捷 创 芯	202 3- 06- 27	179,325.0 0	2,500.00	14	2.0 0	29.89	179,325.0 0	29.89
华泰证	2023062700017 091	华 峰 测	202 3- 06-	903,998.0 0	5,900.00	14	2.0 0	150.67	903,998.0 0	150.67

券股份有限公司		控	27							
华泰证券股份有限公司	2023062700017 198	中芯国际	2023-06-27	4,537,737.00	88,300.00	14	2.00	756.29	4,537,737.00	756.29
华泰证券股份有限公司	2023062700017 316	盛美上海	2023-06-27	700,623.00	6,300.00	14	2.00	116.77	700,623.00	116.77
华泰证券股份有限公司	2023062700017 608	伟测科技	2023-06-27	268,318.00	1,900.00	14	2.00	44.72	268,318.00	44.72
华泰证券股份有限公司	2023062700017 635	东芯股份	2023-06-27	662,592.00	19,200.00	14	2.00	110.43	662,592.00	110.43

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700017 730	帝奥微	2023-06-27	175,770.00	5,400.00	14	2.00	29.30	175,770.00	29.30
华泰证券股份有限公司	2023062700017 834	国芯科技	2023-06-27	705,774.00	12,300.00	14	2.00	117.63	705,774.00	117.63
华泰证券股份有限公司	2023062700017 923	华海清科	2023-06-27	523,043.00	2,300.00	14	2.00	87.17	523,043.00	87.17
华泰证券股份有限公司	2023062700018 050	拓荆科技	2023-06-27	1,167,975.00	2,900.00	14	2.00	194.66	1,167,975.00	194.66
华泰证	2023062700018 052	聚辰股	2023-06-	273,624.00	5,200.00	14	2.00	45.60	273,624.00	45.60

券 股 份 有 限 公 司		份	27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700018 058	芯 碁 微 装	202 3- 06- 27	380,380.0 0	5,200.00	14	2.0 0	63.40	380,380.0 0	63.40
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700018 061	乐 鑫 科 技	202 3- 06- 27	468,930.0 0	3,500.00	14	2.0 0	78.16	468,930.0 0	78.16
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700018 169	富 创 精 密	202 3- 06- 27	481,988.0 0	4,600.00	14	2.0 0	80.33	481,988.0 0	80.33
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700018 379	东 微 半 导	202 3- 06- 27	265,753.0 0	1,900.00	14	2.0 0	44.29	265,753.0 0	44.29

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700018 476	华特气体	2023-06-27	269,500.00	3,500.00	14	2.00	44.92	269,500.00	44.92
华泰证券股份有限公司	2023062700018 478	希荻微	2023-06-27	200,517.00	8,900.00	14	2.00	33.42	200,517.00	33.42
华泰证券股份有限公司	2023062700018 917	宏微科技	2023-06-27	447,909.00	7,700.00	14	2.00	74.65	447,909.00	74.65
华泰证券股份有限公司	2023062700018 920	芯源微	2023-06-27	904,551.00	5,300.00	14	2.00	150.76	904,551.00	150.76
华泰证	2023062700019 123	复旦微	2023-06-	988,416.00	19,200.00	14	2.00	164.74	988,416.00	164.74



券股份有限公司		电	27							
华泰证券股份有限公司	2023062700019 125	华润微	2023-06-27	2,000,631.00	38,100.00	14	2.00	333.44	2,000,631.00	333.44
华泰证券股份有限公司	2023062700019 240	晶晨股份	2023-06-27	1,829,370.00	21,100.00	14	2.00	304.90	1,829,370.00	304.90
华泰证券股份有限公司	2023062700019 435	天岳先进	2023-06-27	461,156.00	6,200.00	14	2.00	76.86	461,156.00	76.86
华泰证券股份有限公司	2023062700019 554	沪硅产业	2023-06-27	2,069,100.00	99,000.00	14	2.00	344.85	2,069,100.00	344.85

公司										
华泰证券股份有限公司	2023062700019 558	中微公司	2023-06-27	4,211,700.00	27,800.00	14	2.00	701.95	4,211,700.00	701.95
华泰证券股份有限公司	2023062700019 686	格科微	2023-06-27	573,046.00	36,200.00	14	2.00	95.51	573,046.00	95.51
华泰证券股份有限公司	2023062700020 210	臻镭科技	2023-06-27	398,838.00	6,600.00	14	2.00	66.47	398,838.00	66.47
华泰证券股份有限公司	2023062700020 211	安集科技	2023-06-27	528,000.00	3,300.00	14	2.00	88.00	528,000.00	88.00
华泰证	2023062700020 248	汇成股	2023-06-	112,385.00	9,100.00	14	2.00	18.73	112,385.00	18.73

券 股 份 有 限 公 司		份	27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700020 304	寒 武 纪	202 3- 06- 27	2,989,688. 00	15,200.0 0	14	2.0 0	498.28	2,989,688. 00	498.28
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700020 305	纳 芯 微	202 3- 06- 27	534,400.0 0	3,200.00	14	2.0 0	89.07	534,400.0 0	89.07
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700020 527	金 宏 气 体	202 3- 06- 27	544,215.0 0	21,300.0 0	14	2.0 0	90.70	544,215.0 0	90.70
华 泰 证 券 股 份 有 限	2023062700020 871	海 光 信 息	202 3- 06- 27	1,168,240. 00	17,000.0 0	14	2.0 0	194.71	1,168,240. 00	194.71

公司										
华泰证券股份 有限公司	2023062700020 916	澜起科技	2023-06-27	3,236,393.00	57,700.00	14	2.00	539.40	3,236,393.00	539.40
华泰证券股份 有限公司	2023062700021 166	思瑞浦	2023-06-27	1,186,640.00	5,200.00	14	2.00	197.77	1,186,640.00	197.77
华泰证券股份 有限公司	2023062700021 762	中微半导	2023-06-27	129,932.00	4,400.00	14	2.00	21.66	129,932.00	21.66
华泰证券股份 有限公司	2023062700021 776	华兴源创	2023-06-27	121,220.00	3,800.00	14	2.00	20.20	121,220.00	20.20
华泰证	2023062700021 834	正帆科	2023-06-	548,940.00	14,000.00	14	2.00	91.49	548,940.00	91.49

券 股 份 有 限 公 司		技	27							
华 泰 证 券 股 份 有 限 公 司	2023062700021 841	芯 原 股 份	202 3- 06- 27	1,400,216. 00	18,100.0 0	14	2.0 0	233.37	1,400,216. 00	233.37

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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
华泰证券股份有 限公司	7,596,500.00	0.79%	-	-
国泰君安证券股 份有限公司	44,585,200.00	4.64%	-	-
华泰证券股份有 限公司—华安上 证科创板芯片交 易型开放式指数 证券投资基金发 起式联接基金	127,009,200.00	13.21%	9,200,000.00	9.30%

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

无。

**6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

无。

**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**

无。

**6.4.12.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

**6.4.12.2.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**6.4.12.2.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额为 0，无抵押债券。

**6.4.12.3 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	688001	华兴源创	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	35.42	10,000.00	354,200.00
2	688002	睿创微纳	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	44.80	68,200.00	3,055,360.00
3	688008	澜起科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	57.42	151,600.00	8,704,872.00
4	688012	中微公司	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	156.45	72,900.00	11,405,205.00
5	688018	乐鑫科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	129.82	9,200.00	1,194,344.00
6	688019	安集科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	164.83	10,300.00	1,697,749.00
7	688037	芯源微	2023 年 7 月 4 日-	170.9	18,300.00	3,128,385.00

			2023 年 7 月 11 日	5		0
8	688041	海光信息	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	68.27	44,400.00	3,031,188.0 0
9	688047	龙芯中科	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	114.7 9	7,100.00	815,009.00
10	688048	长光华芯	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	94.52	6,200.00	586,024.00
11	688052	纳芯微	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	158.3 7	8,200.00	1,298,634.0 0
12	688072	拓荆科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	425.9 7	7,400.00	3,152,178.0 0
13	688082	盛美上海	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	110.4 0	16,500.00	1,821,600.0 0
14	688099	晶晨股份	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	84.32	55,500.00	4,679,760.0 0
15	688106	金宏气体	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	27.20	55,700.00	1,515,040.0 0
16	688107	安路科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	55.39	23,000.00	1,273,970.0 0
17	688110	东芯股份	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	36.10	50,600.00	1,826,660.0 0
18	688120	华海清科	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	252.0 5	7,227.00	1,821,565.3 5
19	688123	聚辰股份	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	53.72	16,400.00	881,008.00
20	688126	沪硅产业	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	20.90	260,200.00	5,438,180.0 0
21	688153	唯捷创芯	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	73.16	6,300.00	460,908.00
22	688173	希荻微	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	22.88	23,300.00	533,104.00
23	688200	华峰测控	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	153.0 0	15,400.00	2,356,200.0 0
24	688206	概伦电子	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	28.04	24,800.00	695,392.00
25	688209	英集芯	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	16.32	8,100.00	132,192.00
26	688213	思特威	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	51.14	7,000.00	357,980.00
27	688220	翱捷科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	75.39	39,900.00	3,008,061.0 0
28	688234	天岳先进	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	73.94	16,400.00	1,212,616.0 0
29	688256	寒武纪	2023 年 7 月 4 日-	188.0	39,800.00	7,482,400.0

			2023 年 7 月 11 日	0		0
30	688261	东微半导	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	139.8 7	6,400.00	895,168.00
31	688262	国芯科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	40.69	45,176.00	1,838,211.4 4
32	688268	华特气体	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	80.73	9,200.00	742,716.00
33	688270	臻镭科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	64.93	17,400.00	1,129,782.0 0
34	688368	晶丰明源	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	127.2 1	4,800.00	610,608.00
35	688372	伟测科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	153.1 5	4,900.00	750,435.00
36	688380	中微半导	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	29.69	11,500.00	341,435.00
37	688381	帝奥微	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	32.28	14,300.00	461,604.00
38	688385	复旦微电	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	50.10	50,600.00	2,535,060.0 0
39	688396	华润微	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	52.41	100,400.00	5,261,964.0 0
40	688403	汇成股份	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	12.22	23,800.00	290,836.00
41	688409	富创精密	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	109.0 0	12,000.00	1,308,000.0 0
42	688521	芯原股份	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	71.92	47,500.00	3,416,200.0 0
43	688536	思瑞浦	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	218.0 0	13,700.00	2,986,600.0 0
44	688596	正帆科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	43.30	36,700.00	1,589,110.0 0
45	688608	恒玄科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	121.0 3	13,700.00	1,658,111.0 0
46	688630	芯碁微装	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	84.02	13,700.00	1,151,074.0 0
47	688711	宏微科技	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	58.34	20,200.00	1,178,468.0 0
48	688728	格科微	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	15.82	95,200.00	1,506,064.0 0
49	688798	艾为电子	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	59.15	15,800.00	934,570.00
50	688981	中芯国际	2023 年 7 月 4 日- 2023 年 7 月 11 日	50.52	232,100.00	11,725,692. 00
合计	-	-	-	-	1,869,003.0	116,231,492



					0	.79
--	--	--	--	--	---	-----

### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人建立了董事会、监事会、管理层、合规与风险管理委员会、督察长、合规监察稽核部、风险管理部与部门风险合规员各负其责的多层次的风险管理体系，形成高效运转、有效制衡的监督约束机制，保证风险管理的贯彻执行。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制委员会，负责制订公司的风险管理政策，颁布统一的风险定义和风险评估标准；在管理层层面设立合规与风险管理委员会，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监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成风险管理各项工作。

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。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，通过特定的风险量化指标、模型，形成常规的量化报告，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。

本公司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经中国人民银行和中国证券监督管理委员会所批准的具有基金托管资格和基金代销资格的银行，并根据本公司管理交易对手的经验进行筛选，因而与这些银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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，违约风险可能性很小。

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。

#### 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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金份额持有人利益。

#### 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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

本基金的生息资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等，其余金融资产和金融负债均不计息，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。

##### 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	8,477,623.10	-	-	-	8,477,623.10
结算备付金	142,219.63	-	-	-	142,219.63
存出保证金	40,991.35	-	-	-	40,991.35
交易性金融资产	-	-	-	1,162,706,411.66	1,162,706,411.66
应收清算款	-	-	-	620,210.58	620,210.58
应收股利	-	-	-	16,761.89	16,761.89
其他资产	-	-	-	38,217.14	38,217.14
资产总计	8,660,834.08	-	-	1,163,381,601.27	1,172,042,435.

					35
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	290,925.99	290,925.99
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	506,869.72	506,869.72
应付托管费	-	-	-	101,373.93	101,373.93
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	538,982.85	538,982.85
负债总计	-	-	-	1,438,152.49	1,438,152.49
利率敏感度缺口	8,660,834.08	-	-	1,161,943,448.78	1,170,604,282.86
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,251,565.52	-	-	-	2,251,565.52
结算备付金	3,345.67	-	-	-	3,345.67
存出保证金	270,674.89	-	-	-	270,674.89
交易性金融资产	283,003.72	-	-	97,609,017.15	97,892,020.87
应收清算款	-	-	-	-	-
资产总计	2,808,589.80	-	-	97,609,017.15	100,417,606.95
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付清算款	-	-	-	352,207.41	352,207.41
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	42,006.49	42,006.49
应付托管费	-	-	-	8,401.30	8,401.30
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	0.11	0.11
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	448,278.94	448,278.94
负债总计	-	-	-	850,894.25	850,894.25
利率敏感度缺口	2,808,589.80	-	-	96,758,122.90	99,566,712.70

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，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 06 月 30 日，本基金未持有交易性债券投资(2022 年 12 月 31 日：0.28%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。当指数编制方法变更、成份股发生变更、成份股权重由于自由流通量调整而发生变化、成份股派发现金股息、配股及增发、股票长期停牌、市场流动性不足等情况发生时，基金管理人将对投资组合进行优化，尽量降低跟踪误差。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。投资于标的指数成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,162,706,411.66	99.33	97,609,017.15	98.03
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	283,003.72	0.28
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	1,162,706,411.66	99.33	97,892,020.87	98.32

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	基金的市场价格风险决定于业绩比较基准的变动		
	除上述基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	57,920,000.00	-
	业绩比较基准下降 5%	-57,920,000.00	-

注：于 2022 年 12 月 31 日：本基金成立尚未满 6 个月，无足够历史经验数据计算其他价格风险对基金净资产的影响。

#### 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	上期末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	1,162,706,411.66	97,609,017.15
第二层次	-	283,003.72
第三层次	-	-
合计	1,162,706,411.66	97,892,020.87

**6.4.14.2.2 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。

本基金本期持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

**6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明**

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括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

无。

## 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	1,162,706,411.66	99.20
	其中：股票	1,162,706,411.66	99.20
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	8,619,842.73	0.74
8	其他各项资产	716,180.96	0.06
9	合计	1,172,042,435.35	100.00

注：此处股票投资包含可退替代款估值增值。

### 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	919,106,326.32	78.52
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	243,599,367.28	20.81
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,162,705,693.60	99.33

### 7.2.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	688981	中芯国际	2,290,660	115,724,143.20	9.89
2	688012	中微公司	718,787	112,454,226.15	9.61
3	688008	澜起科技	1,495,118	85,849,675.56	7.33
4	688256	寒武纪	392,027	73,701,076.00	6.30
5	688126	沪硅产业	2,567,542	53,661,627.80	4.58

6	688396	华润微	992,035	51,992,554.35	4.44
7	688099	晶晨股份	548,360	46,237,715.20	3.95
8	688037	芯源微	207,628	35,494,006.60	3.03
9	688521	芯原股份	469,883	33,793,985.36	2.89
10	688072	拓荆科技	71,011	30,248,555.67	2.58
11	688002	睿创微纳	671,573	30,086,470.40	2.57
12	688041	海光信息	437,781	29,887,308.87	2.55
13	688220	翱捷科技	393,361	29,655,485.79	2.53
14	688536	思瑞浦	134,491	29,319,038.00	2.50
15	688385	复旦微电	499,737	25,036,823.70	2.14
16	688120	华海清科	92,675	23,358,733.75	2.00
17	688200	华峰测控	151,982	23,253,246.00	1.99
18	688019	安集科技	111,052	18,304,701.16	1.56
19	688082	盛美上海	163,550	18,055,920.00	1.54
20	688110	东芯股份	498,800	18,006,680.00	1.54
21	688262	国芯科技	441,713	17,973,301.97	1.54
22	688608	恒玄科技	134,240	16,247,067.20	1.39
23	688596	正帆科技	362,587	15,700,017.10	1.34
24	688106	金宏气体	549,986	14,959,619.20	1.28
25	688728	格科微	938,078	14,840,393.96	1.27
26	688409	富创精密	118,088	12,871,592.00	1.10
27	688052	纳芯微	80,182	12,698,423.34	1.08
28	688107	安路科技	225,224	12,475,157.36	1.07
29	688234	天岳先进	162,452	12,011,700.88	1.03
30	688018	乐鑫科技	91,946	11,936,429.72	1.02
31	688711	宏微科技	199,979	11,666,774.86	1.00
32	688630	芯碁微装	135,193	11,358,915.86	0.97
33	688270	臻镭科技	171,389	11,128,287.77	0.95
34	688798	艾为电子	173,507	10,262,939.05	0.88
35	688261	东微半导	70,592	9,873,703.04	0.84
36	688123	聚辰股份	177,104	9,514,026.88	0.81
37	688048	长光华芯	98,443	9,304,832.36	0.79
38	688047	龙芯中科	67,356	7,731,795.24	0.66
39	688268	华特气体	91,270	7,368,227.10	0.63
40	688372	伟测科技	47,494	7,273,706.10	0.62
41	688206	概伦电子	245,468	6,882,922.72	0.59
42	688368	晶丰明源	45,577	5,797,850.17	0.50
43	688173	希荻微	229,835	5,258,624.80	0.45
44	688381	帝奥微	141,397	4,564,295.16	0.39
45	688153	唯捷创芯	60,698	4,440,665.68	0.38
46	688001	华兴源创	98,475	3,487,984.50	0.30
47	688213	思特威	67,176	3,435,380.64	0.29
48	688380	中微半导	112,692	3,345,825.48	0.29
49	688403	汇成股份	235,249	2,874,742.78	0.25

50	688209	英集芯	79,566	1,298,517.12	0.11
----	--------	-----	--------	--------------	------

#### 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	688220	翱捷科技	24,174,155.22	24.28
2	688409	富创精密	12,153,870.88	12.21
3	688711	宏微科技	11,307,850.54	11.36
4	688037	芯源微	9,936,958.41	9.98
5	688082	盛美上海	9,685,807.96	9.73
6	688630	芯碁微装	9,260,524.30	9.30
7	688262	国芯科技	9,144,075.38	9.18
8	688536	思瑞浦	8,331,734.85	8.37
9	688261	东微半导	8,233,611.13	8.27
10	688372	伟测科技	6,828,915.30	6.86
11	688110	东芯股份	6,757,749.33	6.79
12	688107	安路科技	6,280,872.87	6.31
13	688234	天岳先进	6,257,316.24	6.28
14	688126	沪硅产业	5,031,549.48	5.05
15	688206	概伦电子	4,775,524.18	4.80
16	688381	帝奥微	4,661,021.08	4.68
17	688270	臻镭科技	4,493,550.36	4.51
18	688728	格科微	4,484,632.64	4.50
19	688041	海光信息	4,268,869.71	4.29
20	688008	澜起科技	4,083,061.28	4.10
21	688120	华海清科	4,004,463.21	4.02
22	688256	寒武纪	3,688,879.48	3.70
23	688012	中微公司	3,590,833.87	3.61
24	688173	希荻微	3,361,660.55	3.38
25	688380	中微半导	3,105,075.03	3.12
26	688403	汇成股份	2,765,521.90	2.78
27	688981	中芯国际	2,368,841.88	2.38
28	688072	拓荆科技	2,205,332.89	2.21

注：本项“买入金额”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。

##### 7.4.2 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	688012	中微公司	25,494,728.41	25.61
2	688008	澜起科技	12,772,332.15	12.83
3	688766	普冉股份	11,254,423.04	11.30
4	688981	中芯国际	10,833,823.52	10.88
5	688256	寒武纪	8,741,406.67	8.78
6	688508	芯朋微	8,702,251.40	8.74
7	688396	华润微	8,650,633.94	8.69
8	688099	晶晨股份	7,113,197.63	7.14
9	688233	神工股份	6,235,383.07	6.26
10	688019	安集科技	6,177,554.07	6.20
11	688279	峰昭科技	6,145,590.25	6.17
12	688332	中科蓝讯	6,103,337.13	6.13
13	688595	芯海科技	5,975,498.60	6.00
14	688521	芯原股份	5,916,049.23	5.94
15	688699	明微电子	5,908,145.50	5.93
16	688120	华海清科	5,893,844.36	5.92
17	688601	力芯微	4,938,920.09	4.96
18	688002	睿创微纳	4,831,894.92	4.85
19	688368	晶丰明源	4,622,698.78	4.64
20	688072	拓荆科技	4,358,398.72	4.38
21	688385	复旦微电	4,269,159.92	4.29
22	688052	纳芯微	3,983,763.53	4.00
23	688018	乐鑫科技	3,118,777.25	3.13
24	688200	华峰测控	3,115,443.52	3.13
25	688037	芯源微	2,980,571.24	2.99
26	688608	恒玄科技	2,957,329.75	2.97
27	688106	金宏气体	2,356,357.23	2.37
28	688596	正帆科技	2,179,399.86	2.19

注：本项“卖出金额”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。

#### 7.4.3 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	206,739,338.11
卖出股票的收入（成交）总额	202,949,349.50

注：本项“买入股票的成本（成交）总额”和“卖出股票的收入（成交）总额”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投资。

### 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投资。

### 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投资。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约，以降低股票仓位调整的交易成本，提高投资效率，从而更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资前十名证券的发行主体被监管部门立案调查或编制日前一年内受到公开谴责、处罚的投资决策说明

本报告期内，本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的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

#### 7.12.2 基金投资前十名股票中投资于超出基金合同规定备选股票库之外的投资决策程序说明

本基金投资的前十名股票中，不存在投资于超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

#### 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	40,991.35
2	应收清算款	620,210.58
3	应收股利	16,761.89
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	38,217.14
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	716,180.96

#### 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

##### 7.12.5.1 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	688981	中芯国际	11,725,692.00	1.00	转融通证券 出借
2	688012	中微公司	11,405,205.00	0.97	转融通证券 出借
3	688008	澜起科技	8,704,872.00	0.74	转融通证券 出借
4	688256	寒武纪	7,482,400.00	0.64	转融通证券 出借
5	688126	沪硅产业	5,438,180.00	0.46	转融通证券 出借
6	688396	华润微	5,261,964.00	0.45	转融通证券 出借
7	688099	晶晨股份	4,679,760.00	0.40	转融通证券 出借
8	688521	芯原股份	3,416,200.00	0.29	转融通证券 出借
9	688072	拓荆科技	3,152,178.00	0.27	转融通证券 出借

10	688037	芯源微	3,128,385.00	0.27	转融通证券出借
----	--------	-----	--------------	------	---------

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前五名积极投资中不存在流通受限情况。

## 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	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
9,486	101,349.04	604,838,097.00	62.91%	356,558,903.00	37.09%

### 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	大家人寿保险股份有限公司-万能产品	70,000,000.00	7.28%
2	新华人寿保险股份有限公司	53,754,800.00	5.59%
3	国泰君安证券股份有限公司	44,585,200.00	4.64%
4	方正证券股份有限公司	34,980,283.00	3.64%
5	大家人寿保险股份有限公司-传统产品	34,000,000.00	3.54%
6	大家人寿保险股份有限公司-分红产品	27,773,500.00	2.89%
7	中国平安人寿保险股份有限公司-分红-一个险分红	26,520,100.00	2.76%
8	中国人寿保险（集团）公司	20,000,000.00	2.08%

9	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	18,205,300.00	1.89%
10	招商证券股份有限公司	16,881,088.00	1.76%
11	华泰证券股份有限公司—华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	127,009,200.00	13.21%

### 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

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有该只基金份额总量的数量区间为 0。

本基金的基金经理持有本基金份额总量的数量区间为 0。

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2022 年 9 月 30 日）基金份额总额	361,397,000.00
本报告期期初基金份额总额	98,897,000.00
本报告期基金总申购份额	1,475,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	612,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	961,397,000.00

## 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

1、本报告期内本基金管理人重大人事变动如下：

无。



2、本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门重大人事变动如下：

无。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内未发生涉及本基金托管业务的诉讼。报告期内基金管理人无涉及本基金财产的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内无基金投资策略的改变。

### 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为基金审计的会计师事务所。

### 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

本报告期内无管理人及其高级管理人员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及其高级管理人员未收到稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华泰证券	5	409,688,687.61	100.00%	381,544.24	100.00%	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

(1) 内部管理规范、严谨；具备健全的内控制度，并能满足基金运作高度保密的要求，可靠、诚信，能够公平对待所有客户；

(2) 研究实力较强，有固定的研究机构和专门研究人员，能够针对本基金业务需要，提供高质量的研究报告和较为全面的服务；

(3) 具有战略规划和定位，能够积极推动多边业务合作，最大限度地调动整体资源，为基金投资赢取机会；

(4) 其他有利于基金持有人利益的商业合作考虑。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 对交易单元候选券商的综合服务进行评估

由相关部门牵头并组织有关人员依据上述交易单元选择标准和《券商服务评价办法》，对候选交易单元的券商服务质量和综合实力进行评估。

(2) 填写《新增交易单元申请审核表》

牵头部门汇总对各候选交易单元券商的综合评估结果，择优选出拟新增单元，填写《新增交易单元申请审核表》，对拟新增交易单元的必要性和合规性进行阐述。

(3) 候选交易单元名单提交分管领导审批

公司分管领导对相关部门提交的《新增交易单元申请审核表》及其对券商综合评估的结果进行审核，并签署审批意见。

(4) 协议签署及通知托管人

基金管理人与被选择的券商签订《证券交易单元租用协议》，并通知基金托管人。

3、报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

2023 年 3 月完成租用托管在华泰证券的华泰证券深交所 005276 交易单元

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
华泰证券	637,350.60	100.00%	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金 2022 年第 4 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-01-20
2	华安基金管理有限公司关于华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金新增一	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指	2023-02-24

	级交易商的公告	定媒介	
3	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金变更扩位证券简称的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-22
4	华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-23
5	华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-03-30
6	华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 1 季度报告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-04-21
7	华安基金管理有限公司关于旗下部分基金增加华福证券有限责任公司为一级交易商的公告	中国证监会基金电子披露网站和公司网站等指定媒介	2023-06-01

注：前款所涉重大事件已作为临时报告在指定媒介上披露。

## 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
联接基金	1	20230316-20230504	9,200,000.00	164,886,000.00	47,076,800.00	127,009,200.00	13.21%

注：无。

## 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 2、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 3、《华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、中国证监会批准华安上证科创板芯片交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 5、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的各项公告原件；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程；

- 7、基金托管人业务资格批件和营业执照；
- 8、华安基金管理有限公司开放式基金业务规则；

## 12.2 存放地点

基金管理人和基金托管人的办公场所，并登载于基金管理人互联网站 <http://www.huaan.com.cn>。

## 12.3 查阅方式

投资者可登录基金管理人互联网站查阅，或在营业时间内至基金管理人或基金托管人的办公场所免费查阅。

华安基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日