

天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信证券股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月29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01月01日起至2023年06月30日止。

1.2 目录

| | |
|---|-----|
| §1 重要提示及目录 | 2 |
| 1.1 重要提示 | 2 |
| 1.2 目录 | 3 |
| §2 基金简介 | 5 |
| 2.1 基金基本情况 | 5 |
| 2.2 基金产品说明 | 5 |
| 2.3 基金管理人和基金托管人 | 6 |
| 2.4 信息披露方式 | 6 |
| 2.5 其他相关资料 | 7 |
| §3 主要财务指标和基金净值表现 | 7 |
| 3.1 主要会计数据和财务指标 | 7 |
| 3.2 基金净值表现 | 8 |
| §4 管理人报告 | 9 |
| 4.1 基金管理人及基金经理情况 | 9 |
| 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 | 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 | 11 |
| 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 | 12 |
| 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 | 13 |
| 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 | 13 |
| §5 托管人报告 | 13 |
| 5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 | 13 |
| 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 | 13 |
| 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见 | 14 |
| §6 半年度财务会计报告（未经审计） | 14 |
| 6.1 资产负债表 | 14 |
| 6.2 利润表 | 16 |
| 6.3 净资产（基金净值）变动表 | 18 |
| 6.4 报表附注 | 20 |
| §7 投资组合报告 | 114 |
| 7.1 期末基金资产组合情况 | 114 |
| 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 | 115 |
| 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 | 117 |
| 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 | 122 |
| 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 | 124 |
| 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 | 124 |
| 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 | 124 |
| 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 | 124 |
| 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 | 124 |
| 7.10 本基金投资股指期货的投资政策 | 124 |
| 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 | 124 |
| 7.12 投资组合报告附注 | 124 |
| §8 基金份额持有人信息 | 126 |
| 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 | 126 |
| 8.2 期末上市基金前十名持有人 | 126 |

| | |
|---|-----|
| 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况..... | 127 |
| 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情况..... | 127 |
| §9 开放式基金份额变动..... | 127 |
| §10 重大事件揭示..... | 128 |
| 10.1 基金份额持有人大会决议..... | 128 |
| 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..... | 128 |
| 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼..... | 128 |
| 10.4 基金投资策略的改变..... | 128 |
| 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况..... | 128 |
| 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..... | 128 |
| 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况..... | 128 |
| 10.8 其他重大事件..... | 129 |
| §11 影响投资者决策的其他重要信息..... | 131 |
| 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..... | 131 |
| 11.2 影响投资者决策的其他重要信息..... | 132 |
| §12 备查文件目录..... | 132 |
| 12.1 备查文件目录..... | 132 |
| 12.2 存放地点..... | 132 |
| 12.3 查阅方式..... | 132 |

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | |
|--------------|-------------------------|
| 基金名称 | 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金 |
| 基金简称 | 天弘中证计算机主题ETF |
| 场内简称 | 计算机ETF |
| 基金主代码 | 159998 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2020年03月20日 |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 中信证券股份有限公司 |
| 报告期末基金份额总额 | 2,243,855,354.00份 |
| 基金合同存续期 | 不定期 |
| 基金份额上市的证券交易所 | 深圳证券交易所 |
| 上市日期 | 2020年04月13日 |

2.2 基金产品说明

| | |
|------|--|
| 投资目标 | 紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。 |
| 投资策略 | 本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份 |

| | |
|--------|---|
| | 股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。 |
| 业绩比较基准 | 中证计算机主题指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。 |

2.3 基金管理人和基金托管人

| 项目 | | 基金管理人 | 基金托管人 |
|---------|------|-------------------------------|-----------------------------|
| 名称 | | 天弘基金管理有限公司 | 中信证券股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 童建林 | 杨军智 |
| | 联系电话 | 022-83310208 | 010-60834299 |
| | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn | yjz@citics.com |
| 客户服务电话 | | 95046 | 010-60836588 |
| 传真 | | 022-83865564 | 010-60834004 |
| 注册地址 | | 天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层 | 广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场（二期）北座 |
| 办公地址 | | 天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层 | 北京市朝阳区亮马桥路48号中信证券大厦5层 |
| 邮政编码 | | 300203 | 100125 |
| 法定代表人 | | 韩歆毅 | 张佑君 |

2.4 信息披露方式

| | |
|--------------------|-------------------|
| 本基金选定的信息披露报纸名称 | 证券时报 |
| 登载基金中期报告正文的管理人互联网网 | www.thfund.com.cn |

| | |
|------------|------------------|
| 址 | |
| 基金中期报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公地址 |

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

| 3.1.1 期间数据和指标 | 报告期 (2023年01月01日- 2023年06月30日) | |
|---------------|-----------------------------------|------------------|
| | 本期已实现收益 | 251,122,208.12 |
| 本期利润 | 592,161,961.42 | |
| 加权平均基金份额本期利润 | 0.2420 | |
| 本期加权平均净值利润率 | 24.90% | |
| 本期基金份额净值增长率 | 24.20% | |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| | 期末可供分配利润 | -7,508,615.41 |
| | 期末可供分配基金份额利润 | -0.0033 |
| | 期末基金资产净值 | 2,236,346,738.59 |
| | 期末基金份额净值 | 0.9967 |
| 3.1.3 累计期末指标 | 报告期末 (2023年06月30日) | |
| | 基金份额累计净值增长率 | -0.33% |

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

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

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净值增长率① | 份额净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|-----------------|----------|-------------|------------|---------------|-------|--------|
| 过去一个月 | 1.11% | 2.56% | 0.92% | 2.57% | 0.19% | -0.01% |
| 过去三个月 | -9.07% | 2.37% | -9.58% | 2.37% | 0.51% | 0.00% |
| 过去六个月 | 24.20% | 2.18% | 23.56% | 2.19% | 0.64% | -0.01% |
| 过去一年 | 20.10% | 1.88% | 19.25% | 1.89% | 0.85% | -0.01% |
| 过去三年 | -9.96% | 1.74% | -15.11% | 1.75% | 5.15% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至 今 | -0.33% | 1.71% | -8.27% | 1.76% | 7.94% | -0.05% |

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

天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率
历史走势对比图
(2020年03月20日-2023年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2020年03月20日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

| 股东名称 | 股权比例 |
|----------------------|-------|
| 蚂蚁科技集团股份有限公司 | 51% |
| 天津信托有限责任公司 | 16.8% |
| 内蒙古君正能源化工集团股份有限公司 | 15.6% |
| 芜湖高新投资有限公司 | 5.6% |
| 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙） | 3.5% |
| 新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙） | 2% |
| 新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙） | 2% |
| 新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙） | 3.5% |
| 合计 | 100% |

截至2023年6月30日，公司共管理运作180只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理（助理）期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|---------|-----------------|------|--------|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 林心龙 | 本基金基金经理 | 2022年05月 | - | 8年 | 男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理，2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。 |

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密

制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金作为一只被动指数型基金，以最小化跟踪误差为投资目标，紧密跟踪标的指数。报告期内本基金秉承合规与风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

报告期内，本基金跟踪误差和超额收益的来源主要是申购赎回导致的仓位和结构偏离、标的指数样本股调整导致的结构偏离、成分股分红、打新和转融通券息收益五方面因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，在保证跟踪误差可控的前提下实现了相对基准指数的正向偏离。报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，本基金份额净值为0.9967元，本报告期份额净值增长率24.20%，同期业绩比较基准增长率23.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年上半年国内经济受有效需求不足等因素影响，整体呈弱复苏格局。具体来看，上半年内需部门中基建投资韧性较强，是为数不多的亮点，主要原因在于政策支持力度大，政策性金融工具以及专项债均有所发力。地产部门仍是内需疲软的主要拖累，居民

购房意愿在今年一季度集中释放，二季度后劲不足，受制于居民杠杆率水平已经偏高，后续加杠杆能力受限。消费和服务业整体缓慢恢复，修复斜率受制于收入预期以及地产收缩带来的财富效应下行。外需部门上半年亦整体走弱，主要受高利率对全球经济增长的抑制作用逐步显现，二季度全球以及主要国家制造业PMI持续回落，叠加去年基数压力较大，今年出口增速维持在零增速附近。在出口景气走弱的背景下，制造业投资增速逐月下行。股票市场方面，同宏观基本面趋同，今年上半年呈现先涨后跌的走势。在业绩驱动不显著的背景下，估值变化成为市场主导力量，结构性提估值的领域聚焦在受益于新兴产业周期的TMT和政策驱动的中特估板块；杀估值的领域则主要聚焦在对经济更为敏感的制造和消费板块。

展望下半年，从经济形势来看，大概率呈现温和复苏的格局，一方面政策强调高质量发展，不搞强刺激，着眼中长期增长目标，因此需求端的提振将不明显。今年一季度宏观杠杆率明显抬升后，当前居民和企业继续加杠杆的动力和空间都不够，依靠债务驱动增长的旧发展模式遇到瓶颈，也不符合新发展格局基调。另一方面，从供给端来看，本轮国内去库存接近尾声，库存周期有望在三季度见底，但美国仍处于去库存的早期，下半年缺少库存周期的共振，也会制约经济修复斜率。下半年股票市场仍将呈现结构性行情特点，核心驱动仍在于估值，一方面由于业绩虽在底部但向上弹性不够，整体A股估值处于较为便宜的水平，结构性提估值可期，另一方面下半年流动性改善以及国内改革强化有望成为提估值的两个主要因素。从市场风格的选择来看，结合产业周期以及政策高质量发展基调来看，我们相对更看好中小成长风格。

具体行业赛道方面，“大安全”“自主可控”在我国战略地位不断攀升的同时，也为计算机行业提供了新的投资主线，包括国内自上而下不断强调安全发展正在推动新一轮信创周期的开启，而且这轮信创周期涉及的广度和深度有望远超过去几轮信创周期，特别是行业信创有望与党政信创形成联动，从而以点带面将计算机板块分散的下游有效串联起来。另外OpenAI为代表的AI技术不断创新迭代，算法持续改进，有望推动以生成式人工智能为代表的人工智能产业保持飞速发展；同时高阶自动驾驶(L3+)也正在如火如荼进行中，有望带动智能驾驶产业高速发展。信创、生成式人工智能和高阶自动驾驶有望推动整个计算机行业迎来新一轮上行周期。本基金将持续跟踪各个赛道的订单以及企业业绩兑现情况，并密切关注计算机各个细分板块景气度的边际变化。

本基金为被动指数基金，我们将通过严谨的投资管理流程和精细的数量化模型，以及勤勉尽责的工作态度，恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与基准相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中信证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在对天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期，天弘基金管理有限公司在天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期，由天弘基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

| 资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|--------------|---------|--------------------|---------------------|
| 资产： | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 24,628,208.60 | 5,636,861.09 |
| 结算备付金 | | 3,522,503.44 | 667,842.54 |
| 存出保证金 | | 558,186.75 | 158,236.80 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 2,233,873,593.66 | 2,065,006,128.03 |
| 其中：股票投资 | | 2,233,873,593.66 | 2,065,006,128.03 |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券 投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | - | - |
| 债权投资 | | - | - |

| | | | |
|---------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 其中：债券投资 | | - | - |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 其他投资 | | - | - |
| 其他债权投资 | | - | - |
| 其他权益工具投资 | | - | - |
| 应收清算款 | | - | - |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | - | - |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.5 | 116,592.91 | 62,858.83 |
| 资产总计 | | 2,262,699,085.36 | 2,071,531,927.29 |
| 负债和净资产 | 附注号 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| 负 债： | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付清算款 | | 24,041,681.17 | 4,418,783.58 |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 1,072,865.05 | 885,685.83 |
| 应付托管费 | | 214,573.02 | 177,137.17 |
| 应付销售服务费 | | - | - |
| 应付投资顾问费 | | - | - |
| 应交税费 | | 20,416.98 | 2,311.33 |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.6 | 1,002,810.55 | 627,393.18 |
| 负债合计 | | 26,352,346.77 | 6,111,311.09 |
| 净资产： | | | |

| | | | |
|----------|---------|------------------|------------------|
| 实收基金 | 6.4.7.7 | 2,243,855,354.00 | 2,573,855,354.00 |
| 其他综合收益 | | - | - |
| 未分配利润 | 6.4.7.8 | -7,508,615.41 | -508,434,737.80 |
| 净资产合计 | | 2,236,346,738.59 | 2,065,420,616.20 |
| 负债和净资产总计 | | 2,262,699,085.36 | 2,071,531,927.29 |

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值0.9967元，基金份额总额2,243,855,354.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 附注号 | 本期 2023年01月01日至 2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日 |
|----------------------|----------|-----------------------------------|--|
| 一、营业总收入 | | 599,825,268.52 | -505,440,734.26 |
| 1.利息收入 | | 2,666,216.59 | 1,928,023.01 |
| 其中：存款利息收入 | 6.4.7.9 | 102,792.00 | 53,888.40 |
| 债券利息收入 | | - | - |
| 资产支持证券利息 收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产 收入 | | - | - |
| 证券出借利息收入 | | 2,563,424.59 | 1,874,134.61 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益（损失以“-” 填列） | | 249,611,590.31 | -110,518,266.14 |
| 其中：股票投资收益 | 6.4.7.10 | 237,957,938.24 | -122,846,922.04 |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.11 | - | - |
| 资产支持证券投资 收益 | 6.4.7.12 | - | - |

| | | | |
|----------------------------|----------|----------------|-----------------|
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.13 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.15 | 11,653,652.07 | 12,328,655.90 |
| 以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益 | | - | - |
| 其他投资收益 | | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列) | 6.4.7.16 | 341,039,753.30 | -397,778,700.72 |
| 4.汇兑收益(损失以“-”号填列) | | - | - |
| 5.其他收入(损失以“-”号填列) | 6.4.7.17 | 6,507,708.32 | 928,209.59 |
| 减：二、营业总支出 | | 7,663,307.10 | 5,804,191.63 |
| 1. 管理人报酬 | | 5,919,449.36 | 4,449,813.20 |
| 2. 托管费 | | 1,183,889.89 | 889,962.68 |
| 3. 销售服务费 | | - | - |
| 4. 投资顾问费 | | - | - |
| 5. 利息支出 | | - | - |
| 其中：卖出回购金融资产支出 | | - | - |
| 6. 信用减值损失 | 6.4.7.18 | - | - |
| 7. 税金及附加 | | 11,402.40 | 8,987.89 |
| 8. 其他费用 | 6.4.7.19 | 548,565.45 | 455,427.86 |
| 三、利润总额(亏损总额以“-”号填列) | | 592,161,961.42 | -511,244,925.89 |
| 减：所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以“-”号填列) | | 592,161,961.42 | -511,244,925.89 |
| 五、其他综合收益的税后净额 | | - | - |
| 六、综合收益总额 | | 592,161,961.42 | -511,244,925.89 |

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | |
|-------------------------------------|-------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产（基金净值） | 2,573,855,354.00 | - | -508,434,737.80 | 2,065,420,616.20 |
| 加：会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产（基金净值） | 2,573,855,354.00 | - | -508,434,737.80 | 2,065,420,616.20 |
| 三、本期增减变动额（减少以“-”号填列） | -330,000,000.00 | - | 500,926,122.39 | 170,926,122.39 |
| （一）、综合收益总额 | - | - | 592,161,961.42 | 592,161,961.42 |
| （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） | -330,000,000.00 | - | -91,235,839.03 | -421,235,839.03 |
| 其中：1.基金申购款 | 3,184,800,000.00 | - | -60,413,770.08 | 3,124,386,229.92 |
| 2.基金 | -3,514,800,000. | - | -30,822,068.95 | -3,545,622,068. |

| | | | | |
|--|------------------------------------|--------|-----------------|------------------|
| 赎回款 | 00 | | | 95 |
| (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)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 2,243,855,354.00 | - | -7,508,615.41 | 2,236,346,738.59 |
| 项目 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | |
| | 实收基金 | 其他综合收益 | 未分配利润 | 净资产合计 |
| 一、上期期末净资产(基金净值) | 1,466,255,354.00 | - | 138,821,609.50 | 1,605,076,963.50 |
| 加: 会计政策变更 | - | - | - | - |
| 前期差错更正 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 二、本期期初净资产(基金净值) | 1,466,255,354.00 | - | 138,821,609.50 | 1,605,076,963.50 |
| 三、本期增减变动额(减少以“-”号填列) | 766,800,000.00 | - | -518,634,658.98 | 248,165,341.02 |
| (一)、综合收益总额 | - | - | -511,244,925.89 | -511,244,925.89 |
| (二)、本期基 | 766,800,000.00 | - | -7,389,733.09 | 759,410,266.91 |

| | | | | |
|--|------------------|---|-----------------|------------------|
| 金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列) | | | | |
| 其中: 1.基金申购款 | 1,164,000,000.00 | - | -62,905,950.88 | 1,101,094,049.12 |
| 2.基金赎回款 | -397,200,000.00 | - | 55,516,217.79 | -341,683,782.21 |
| (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)、其他综合收益结转留存收益 | - | - | - | - |
| 四、本期期末净资产(基金净值) | 2,233,055,354.00 | - | -379,813,049.48 | 1,853,242,304.52 |

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:

韩歆毅(代)

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]2091号《关于准予天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘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《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,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287,826,000.00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(2020)第0211号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年3月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为287,855,354.00份基金份额，其中认购资金利息折合29,354.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中信证券股份有限公司。

根据《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2020]262号文审核同意，本基金287,855,354.00份基金份额于2020年4月13日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的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的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的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%；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。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。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的业绩比较基准为：中证计算机主题指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF，将原天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘中证计算机主题ETF联接基金”)。天弘中证计算机主题ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、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 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06月30日 |
|--------|--------------------|
| 活期存款 | 24,628,208.60 |
| 等于：本金 | 24,622,795.86 |
| 加：应计利息 | 5,412.74 |
| 减：坏账准备 | - |
| 定期存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |

| | |
|--------------|---------------|
| 其中：存款期限1个月以内 | - |
| 存款期限1-3个月 | - |
| 存款期限3个月以上 | - |
| 其他存款 | - |
| 等于：本金 | - |
| 加：应计利息 | - |
| 减：坏账准备 | - |
| 合计 | 24,628,208.60 |

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 | | | |
|---------------|----------------------|------|----------------------|---------------|
| | 成本 | 应计利息 | 公允价值 | 公允价值变动 |
| 股票 | 2,202,011,291.0 0 | - | 2,233,873,593.6 6 | 31,862,302.66 |
| 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 | 2,202,011,291.0 0 | - | 2,233,873,593.6 6 | 31,862,302.66 |

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06月30日 |
|-------|--------------------|
| 应收利息 | - |
| 其他应收款 | 40,976.67 |
| 待摊费用 | 75,616.24 |
| 合计 | 116,592.91 |

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

| 项目 | 本期末 2023年06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 | 657,299.70 |
| 其中：交易所市场 | 657,299.70 |
| 银行间市场 | - |
| 应付利息 | - |
| 预提费用 | 169,014.74 |
| 其他应付款 | 176,496.11 |
| 合计 | 1,002,810.55 |

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|----|----|
|----|----|

| | 2023年01月01日至2023年06月30日 | |
|---------------|-------------------------|-------------------|
| | 基金份额（份） | 账面金额 |
| 上年度末 | 2,573,855,354.00 | 2,573,855,354.00 |
| 本期申购 | 3,184,800,000.00 | 3,184,800,000.00 |
| 本期赎回（以“-”号填列） | -3,514,800,000.00 | -3,514,800,000.00 |
| 本期末 | 2,243,855,354.00 | 2,243,855,354.00 |

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 |
|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| 本期期初 | 156,921,422.16 | -665,356,159.96 | -508,434,737.80 |
| 本期利润 | 251,122,208.12 | 341,039,753.30 | 592,161,961.42 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | -16,147,783.79 | -75,088,055.24 | -91,235,839.03 |
| 其中：基金申购款 | 367,894,064.46 | -428,307,834.54 | -60,413,770.08 |
| 基金赎回款 | -384,041,848.25 | 353,219,779.30 | -30,822,068.95 |
| 本期已分配利润 | - | - | - |
| 本期末 | 391,895,846.49 | -399,404,461.90 | -7,508,615.41 |

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|-----------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 活期存款利息收入 | 79,194.49 |
| 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 | 20,612.02 |
| 其他 | 2,985.49 |
| 合计 | 102,792.00 |

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01月01日至2023年06月30日 |
|------------------|-------------------------------|
| 股票投资收益——买卖股票差价收入 | 111,329,167.18 |
| 股票投资收益——赎回差价收入 | 126,628,771.06 |
| 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 | 237,957,938.24 |

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01月01日至2023年06月30日 |
|------------|-------------------------------|
| 卖出股票成交总额 | 1,405,876,991.12 |
| 减：卖出股票成本总额 | 1,291,793,365.10 |
| 减：交易费用 | 2,754,458.84 |
| 买卖股票差价收入 | 111,329,167.18 |

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01月01日至2023年06月30日 |
|-------------|-------------------------------|
| 赎回基金份额对价总额 | 3,545,622,068.95 |
| 减：现金支付赎回款总额 | 1,127,795,978.95 |
| 减：赎回股票成本总额 | 2,291,197,318.94 |
| 减：交易费用 | - |
| 赎回差价收入 | 126,628,771.06 |

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

| 项目 | 本期 |
|---------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 股票投资产生的股利收益 | 11,653,652.07 |
| 其中：证券出借权益补偿收入 | 603,870.38 |
| 基金投资产生的股利收益 | - |
| 合计 | 11,653,652.07 |

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目名称 | 本期 |
|------------|-------------------------|
| | 2023年01月01日至2023年06月30日 |
| 1.交易性金融资产 | 341,039,753.30 |
| ——股票投资 | 341,039,753.30 |
| ——债券投资 | - |
| ——资产支持证券投资 | - |
| ——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 | 341,039,753.30 |

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 基金赎回费收入 | - |
| 基金转换费收入 | - |
| ETF基金替代损益 | 6,507,708.32 |
| 延期合约递延费收入 | - |
| 合计 | 6,507,708.32 |

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 |
|-----------|-------------------------------|
| 审计费用 | 44,630.98 |
| 信息披露费 | 49,588.57 |
| 证券出借违约金 | - |
| 指数使用费 | 355,166.95 |
| IOPV计算发布费 | 24,795.19 |
| ETF登记结算费 | 74,383.76 |
| 合计 | 548,565.45 |

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|-----------------------------|--------------|
| 天弘基金管理有限公司 | 基金管理人 |
| 中信证券股份有限公司 | 基金托管人、基金销售机构 |
| 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 本基金的联接基金 |

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

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01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|------------|-------------------------------|--------------|------------------------------------|--------------|
| | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 | 成交金额 | 占当期股票成交总额的比例 |
| 中信证券股份有限公司 | 196,184,301.48 | 7.27% | 447,218,449.53 | 57.79% |

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 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01月01日至2023年06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 |
| 中信证券股份有限公司 | 52,287.57 | 4.62% | 49,157.80 | 7.48% |
| 关联方名称 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06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 |
| 中信证券股份有限公司 | 187,849.84 | 57.14% | 40,714.96 | 25.25% |

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01月01日至2023年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 |
|-----------------|-------------------------------|------------------------------------|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 5,919,449.36 | 4,449,813.20 |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 169,285.20 | 3,316.00 |

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期 2023年01月01日至2023 年06月30日 | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日 |
|----------------|-----------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 1,183,889.89 | 889,962.68 |

注:支付基金托管人中信证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位:人民币元

| 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | | |
|------------------------------------|--------------------|---------------|----------------|--------------|
| 关联方名称 | 交易金额 | 利息收 入 | 期末证券出借业务 余额 | 期末应收利息 余额 |
| 中信证券股份有限 公司 | 124,128,707. 00 | 80,895.5 8 | - | - |
| 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | | |
| 关联方名称 | 交易金额 | 利息收 | 期末证券出借业务 | 期末应收利息 |

| | | | | |
|----------------|--------------------|----------------|---------------|-----------|
| | | 入 | 余额 | 余额 |
| 中信证券股份有限 公司 | 967,578,376. 00 | 649,341. 03 | 35,209,956.00 | 11,359.92 |

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

单位：人民币元

| 本期 | | | | | | | | | | |
|------------------------------------|------------------|------|------------|--------------|---------|---------|-------|----------|------------|----------|
| 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 06 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(股) | 出借期限(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 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023010600009282 | 中科创达 | 2023-01-06 | 225,792.00 | 2,100 | 14 | 3.40% | 289.85 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023010600009284 | 朗新科技 | 2023-01-06 | 65,128.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 83.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023010600009286 | 拉卡拉 | 2023-01-06 | 59,430.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 76.29 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023010900002118 | 朗新科技 | 2023-01-09 | 1,739,490.00 | 69,000 | 14 | 3.40% | 3,349.50 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023010900002126 | 深信服 | 2023-01-09 | 309,488.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 595.94 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023011800000446 | 易华录 | 2023-01-18 | 67,095.00 | 2,700 | 14 | 3.40% | 86.13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023011900001107 | 软通动力 | 2023-01-19 | 157,016.00 | 3,800 | 14 | 3.40% | 201.56 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023012000000650 | 拉卡拉 | 2023-01-20 | 2,967,525.00 | 181,500 | 14 | 3.40% | 3,809.45 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023012000000659 | 中望软件 | 2023-01-20 | 3,239,652.00 | 15,600 | 14 | 3.40% | 4,158.78 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202301 200000 6553 | 中科创 达 | 2023-0 1-20 | 223,86 0.00 | 2,100 | 14 | 3.40% | 287.37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 200000 9443 | 朗新科 技 | 2023-0 1-20 | 71,00 8.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 91.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 200000 9445 | 拉卡拉 | 2023-0 1-20 | 57,22 5.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 73.46 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300000 2125 | 软通动 力 | 2023-0 1-30 | 451,11 0.00 | 11,000 | 14 | 3.40% | 579.10 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300000 2127 | 网宿科 技 | 2023-0 1-30 | 3,199, 680.00 | 555,50 0 | 14 | 3.40% | 4,107. 47 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300000 2131 | 拉卡拉 | 2023-0 1-30 | 149,04 0.00 | 9,000 | 14 | 3.40% | 191.32 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300000 2135 | 卫宁健 康 | 2023-0 1-30 | 1,629, 448.00 | 141,20 0 | 14 | 3.40% | 2,091. 74 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300006 8121 | 深信服 | 2023-0 1-30 | 370,32 3.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 475.39 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 300008 4379 | 朗新科 技 | 2023-0 1-30 | 1,745, 010.00 | 69,000 | 14 | 3.40% | 2,240. 09 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202301 310000 1224 | 朗新科 技 | 2023-0 1-31 | 29,98 8.00 | 1,200 | 14 | 3.40% | 38.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 010001 9462 | 易华录 | 2023-0 2-01 | 73,68 3.00 | 2,700 | 14 | 3.40% | 94.59 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 020001 2277 | 软通动 力 | 2023-0 2-02 | 151,77 2.00 | 3,800 | 14 | 3.40% | 194.84 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 030000 8654 | 拉卡拉 | 2023-0 2-03 | 3,317, 820.00 | 181,50 0 | 14 | 3.40% | 4,259. 13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 030000 8690 | 拉卡拉 | 2023-0 2-03 | 63,98 0.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 82.14 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 030001 0098 | 中望软 件 | 2023-0 2-03 | 3,539, 640.00 | 15,600 | 14 | 3.40% | 4,543. 87 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 030001 0134 | 中科创 达 | 2023-0 2-03 | 235,78 8.00 | 2,100 | 14 | 3.40% | 302.68 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 030001 0146 | 朗新科 技 | 2023-0 2-03 | 75,88 0.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 97.41 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 100000 2235 | 光环新 网 | 2023-0 2-10 | 731,00 0.00 | 73,100 | 14 | 3.40% | 938.39 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 100000 2237 | 网宿科 技 | 2023-0 2-10 | 222,93 9.00 | 35,900 | 14 | 3.40% | 286.18 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 130000 1545 | 光环新 网 | 2023-0 2-13 | 604,00 5.00 | 60,100 | 14 | 3.40% | 775.37 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 130006 6644 | 卫宁健 康 | 2023-0 2-13 | 1,536, 256.00 | 141,20 0 | 14 | 3.40% | 1,972. 11 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 130006 8266 | 深信服 | 2023-0 2-13 | 327,24 4.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 420.09 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 130007 0678 | 网宿科 技 | 2023-0 2-13 | 3,460, 765.00 | 555,50 0 | 14 | 3.40% | 4,442. 62 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 150001 5972 | 易华录 | 2023-0 2-15 | 71,90 1.00 | 2,700 | 14 | 3.40% | 92.30 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 170001 7682 | 拉卡拉 | 2023-0 2-17 | 3,548, 325.00 | 181,50 0 | 14 | 3.40% | 4,555. 02 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 170001 7930 | 拉卡拉 | 2023-0 2-17 | 68,42 5.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 87.84 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202302 170002 0072 | 朗新科 技 | 2023-0 2-17 | 77,72 8.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 99.78 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202302 240000 | 光环新 网 | 2023-0 2-24 | 748,54 4.00 | 73,100 | 14 | 3.40% | 960.91 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 3890 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 270006 2722 | 卫宁健康 | 2023-0 2-27 | 1,380, 936.00 | 141,20 0 | 14 | 3.40% | 1,772. 72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 270006 7814 | 深信服 | 2023-0 2-27 | 315,58 3.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 405.12 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 270006 8134 | 网宿科技 | 2023-0 2-27 | 3,355, 220.00 | 555,50 0 | 14 | 3.40% | 4,307. 14 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202302 270007 0818 | 光环新网 | 2023-0 2-27 | 597,39 4.00 | 60,100 | 14 | 3.40% | 766.88 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 030001 0185 | 朗新科技 | 2023-0 3-03 | 76,18 8.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 97.81 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 100000 1162 | 中望软件 | 2023-0 3-10 | 1,161, 180.00 | 6,000 | 14 | 3.40% | 1,490. 62 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 100000 5073 | 光环新网 | 2023-0 3-10 | 776,32 2.00 | 73,100 | 14 | 3.40% | 996.57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 130005 0324 | 光环新网 | 2023-0 3-13 | 667,11 0.00 | 60,100 | 14 | 3.40% | 856.38 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 130005 4600 | 深信服 | 2023-0 3-13 | 339,48 0.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 435.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 130005 5976 | 卫宁健康 | 2023-0 3-13 | 1,505, 192.00 | 141,20 0 | 14 | 3.40% | 1,932. 23 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 160000 1063 | 安恒信息 | 2023-0 3-16 | 677,28 0.00 | 3,400 | 14 | 3.40% | 869.43 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 170000 0932 | 安恒信息 | 2023-0 3-17 | 798,64 2.00 | 3,900 | 14 | 3.40% | 1,025. 22 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202303 170000 8483 | 朗新科技 | 2023-0 3-17 | 80,36 0.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 103.16 | - | - |
| 中信证 | 202303 | 网宿科 | 2023-0 | 1,256, | 191,50 | 14 | 3.40% | 1,612. | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份 有限公司 | 200000 0951 | 技 | 3-20 | 240.00 | 0 | | | 65 | | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 220000 1253 | 网宿科 技 | 2023-0 3-22 | 1,280, 389.00 | 183,70 0 | 14 | 3.40% | 1,761. 05 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 240000 1160 | 拉卡拉 | 2023-0 3-24 | 1,479, 690.00 | 73,800 | 14 | 3.40% | 1,899. 49 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 240000 1161 | 光环新 网 | 2023-0 3-24 | 649,35 2.00 | 51,700 | 14 | 3.40% | 833.58 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 240000 4661 | 中望软 件 | 2023-0 3-24 | 1,428, 000.00 | 6,000 | 14 | 3.40% | 1,833. 14 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 240000 5151 | 光环新 网 | 2023-0 3-24 | 918,13 6.00 | 73,100 | 14 | 3.40% | 1,178. 62 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 270005 3875 | 深信服 | 2023-0 3-27 | 323,58 7.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 415.39 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 270005 3897 | 卫宁健 康 | 2023-0 3-27 | 1,678, 868.00 | 141,20 0 | 14 | 3.40% | 2,155. 18 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 270005 8227 | 光环新 网 | 2023-0 3-27 | 747,64 4.00 | 60,100 | 14 | 3.40% | 959.76 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 300001 5523 | 安恒信 息 | 2023-0 3-30 | 693,56 6.00 | 3,400 | 14 | 3.40% | 890.34 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 310000 8923 | 安恒信 息 | 2023-0 3-31 | 783,43 2.00 | 3,900 | 14 | 3.40% | 1,005. 70 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202303 310000 9651 | 朗新科 技 | 2023-0 3-31 | 74,84 4.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 96.08 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202304 070000 6557 | 光环新 网 | 2023-0 4-07 | 1,036, 558.00 | 73,100 | 14 | 3.40% | 1,330. 64 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202304 070000 8029 | 光环新 网 | 2023-0 4-07 | 733,10 6.00 | 51,700 | 14 | 3.40% | 941.10 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|---------|----|-------|----------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 2023040700008355 | 拉卡拉 | 2023-04-07 | 1,474,524.00 | 73,800 | 14 | 3.40% | 1,892.86 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023040700008637 | 中望软件 | 2023-04-07 | 1,507,800.00 | 6,000 | 14 | 3.40% | 1,935.58 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023041000049523 | 深信服 | 2023-04-10 | 338,583.00 | 2,300 | 14 | 3.40% | 434.64 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023041000060833 | 卫宁健康 | 2023-04-10 | 1,945,736.00 | 141,200 | 14 | 3.40% | 2,497.77 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023041700003478 | 大华股份 | 2023-04-17 | 1,617,600.00 | 67,400 | 14 | 3.20% | 2,373.17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023041700003508 | 千方科技 | 2023-04-17 | 1,407,342.00 | 97,800 | 14 | 3.20% | 2,064.71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023041900003395 | 科华数据 | 2023-04-19 | 237,660.00 | 5,100 | 14 | 3.20% | 307.65 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042000002459 | 紫光股份 | 2023-04-20 | 616,680.00 | 18,000 | 14 | 3.20% | 745.07 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042000002579 | 中国软件 | 2023-04-20 | 1,734,410.00 | 25,100 | 14 | 3.20% | 2,095.51 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042000002701 | 光环新网 | 2023-04-20 | 79,119.00 | 5,900 | 14 | 3.40% | 101.56 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042100002950 | 光环新网 | 2023-04-21 | 1,151,640.00 | 91,400 | 14 | 3.40% | 1,478.37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042400002816 | 中国软件 | 2023-04-24 | 961,272.00 | 15,800 | 14 | 3.20% | 1,161.41 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042400002850 | 中望软件 | 2023-04-24 | 995,061.00 | 5,100 | 14 | 3.40% | 1,277.37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2023042400002993 | 光环新网 | 2023-04-24 | 1,069,066.00 | 80,200 | 14 | 3.40% | 1,372.37 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202304 250000 2648 | 拉卡拉 | 2023-0 4-25 | 676,48 0.00 | 44,800 | 14 | 3.40% | 868.41 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202304 260000 3358 | 拉卡拉 | 2023-0 4-26 | 132,17 6.00 | 8,800 | 14 | 3.40% | 169.68 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202304 270000 3959 | 金山办 公 | 2023-0 4-27 | 3,011, 800.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 3,866. 28 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202304 280000 3407 | 和而泰 | 2023-0 4-28 | 548,10 0.00 | 34,800 | 14 | 3.20% | 662.21 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 040001 8251 | 科华数 据 | 2023-0 5-04 | 211,24 2.00 | 5,100 | 14 | 3.20% | 255.22 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 040003 5243 | 中国软 件 | 2023-0 5-04 | 1,437, 979.00 | 25,100 | 14 | 3.20% | 1,737. 36 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 050000 5837 | 光环新 网 | 2023-0 5-05 | 1,073, 036.00 | 91,400 | 14 | 3.40% | 1,377. 47 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 080000 3865 | 金山办 公 | 2023-0 5-08 | 5,104, 000.00 | 11,600 | 14 | 3.40% | 6,552. 06 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 080000 4053 | 科华数 据 | 2023-0 5-08 | 163,80 0.00 | 4,000 | 14 | 3.20% | 197.90 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 080001 4267 | 中望软 件 | 2023-0 5-08 | 1,071, 051.00 | 5,100 | 14 | 3.40% | 1,374. 92 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 080002 3497 | 中国软 件 | 2023-0 5-08 | 930,93 6.00 | 15,800 | 14 | 3.20% | 1,124. 76 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 090000 4954 | 中望软 件 | 2023-0 5-09 | 519,18 3.00 | 2,700 | 14 | 3.40% | 666.49 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202305 090000 9843 | 拉卡拉 | 2023-0 5-09 | 822,97 6.00 | 44,800 | 14 | 3.40% | 1,056. 47 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202305 100000 | 指南针 | 2023-0 5-10 | 609,72 0.00 | 12,000 | 14 | 3.40% | 782.71 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 4022 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 100000 4029 | 拉卡拉 | 2023-0 5-10 | 64,78 5.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 83.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 100000 6756 | 拉卡拉 | 2023-0 5-10 | 162,88 8.00 | 8,800 | 14 | 3.40% | 209.10 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 110001 9759 | 金山办公 | 2023-0 5-11 | 3,106, 594.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 3,987. 97 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 120000 2659 | 拉卡拉 | 2023-0 5-12 | 24,01 1.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 30.83 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 120000 4880 | 和而泰 | 2023-0 5-12 | 521,65 2.00 | 34,800 | 14 | 3.20% | 630.26 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 180001 0274 | 科华数据 | 2023-0 5-18 | 204,61 2.00 | 5,100 | 14 | 3.20% | 247.21 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 180001 3330 | 中国软件 | 2023-0 5-18 | 1,403, 843.00 | 25,100 | 14 | 3.20% | 1,696. 12 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 190001 0587 | 光环新网 | 2023-0 5-19 | 1,017, 282.00 | 91,400 | 14 | 3.40% | 1,305. 89 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 220002 8250 | 中望软件 | 2023-0 5-22 | 974,15 1.00 | 5,100 | 14 | 3.40% | 1,250. 52 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 220005 6674 | 科华数据 | 2023-0 5-22 | 158,36 0.00 | 4,000 | 14 | 3.20% | 191.33 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 230000 4875 | 金山办公 | 2023-0 5-23 | 3,592, 160.00 | 8,800 | 7 | 4.30% | 2,915. 96 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 230000 7522 | 拉卡拉 | 2023-0 5-23 | 793,40 8.00 | 44,800 | 14 | 3.40% | 1,018. 50 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202305 230002 7344 | 中望软件 | 2023-0 5-23 | 513,48 6.00 | 2,700 | 14 | 3.40% | 659.16 | - | - |
| 中信证 | 202305 | 指南针 | 2023-0 | 552,72 | 12,000 | 14 | 3.40% | 709.53 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份 有限公司 | 240001 1348 | | 5-24 | 0.00 | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202305 240001 1352 | 拉卡拉 | 2023-0 5-24 | 63,10 5.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 81.01 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202305 240001 4814 | 拉卡拉 | 2023-0 5-24 | 158,66 4.00 | 8,800 | 14 | 3.40% | 203.68 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202305 300001 9745 | 金山办 公 | 2023-0 5-30 | 3,864, 872.00 | 8,800 | 7 | 4.30% | 3,137. 34 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8428 | 中科软 | 2023-0 6-14 | 376,10 5.00 | 9,500 | 14 | 3.89% | 552.39 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8449 | 三六零 | 2023-0 6-14 | 1,452, 555.00 | 95,500 | 14 | 3.89% | 2,133. 39 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8453 | 中科星 图 | 2023-0 6-14 | 208,23 4.00 | 2,600 | 14 | 3.89% | 305.84 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8467 | 航天宏 图 | 2023-0 6-14 | 273,60 0.00 | 4,800 | 14 | 3.89% | 401.84 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8468 | 奇安信 | 2023-0 6-14 | 428,21 8.00 | 7,300 | 14 | 3.89% | 628.93 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8475 | 国网信 通 | 2023-0 6-14 | 263,80 5.00 | 12,900 | 14 | 3.89% | 387.46 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8489 | 航天信 息 | 2023-0 6-14 | 443,11 8.00 | 29,900 | 14 | 3.89% | 650.82 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8492 | 同方股 份 | 2023-0 6-14 | 588,72 3.00 | 63,100 | 14 | 3.89% | 864.67 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8510 | 中科曙 光 | 2023-0 6-14 | 1,745, 415.00 | 31,500 | 14 | 3.89% | 2,563. 52 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202306 140002 8521 | 中望软 件 | 2023-0 6-14 | 288,12 0.00 | 1,400 | 14 | 3.89% | 423.16 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8535 | 新点软件 | 2023-0 6-14 | 132,57 4.00 | 2,600 | 14 | 3.89% | 194.72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8537 | 金山办公 | 2023-0 6-14 | 2,308, 929.00 | 4,900 | 14 | 3.89% | 3,391. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8547 | 用友网络 | 2023-0 6-14 | 1,162, 846.00 | 55,400 | 14 | 3.89% | 1,707. 89 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8558 | 宝信软件 | 2023-0 6-14 | 876,48 0.00 | 19,200 | 14 | 3.89% | 1,287. 30 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8588 | 卓朗科技 | 2023-0 6-14 | 290,19 5.00 | 45,700 | 14 | 3.89% | 426.21 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8595 | 中国软件 | 2023-0 6-14 | 788,90 0.00 | 16,100 | 14 | 3.89% | 1,158. 67 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8617 | 恒生电子 | 2023-0 6-14 | 1,795, 510.00 | 40,900 | 14 | 3.89% | 2,637. 10 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8729 | 润和软件 | 2023-0 6-14 | 550,34 7.00 | 21,900 | 14 | 3.89% | 808.30 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8744 | 光环新网 | 2023-0 6-14 | 491,43 6.00 | 39,600 | 14 | 3.89% | 721.78 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8762 | 同花顺 | 2023-0 6-14 | 1,081, 470.00 | 5,900 | 14 | 3.89% | 1,588. 37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8783 | 卫宁健康 | 2023-0 6-14 | 504,21 8.00 | 47,300 | 14 | 3.89% | 740.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8789 | 深信服 | 2023-0 6-14 | 863,26 0.00 | 6,800 | 14 | 3.89% | 1,267. 88 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8794 | 指南针 | 2023-0 6-14 | 353,09 0.00 | 6,700 | 14 | 3.89% | 518.59 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 8809 | 软通动力 | 2023-0 6-14 | 305,80 8.00 | 6,900 | 14 | 3.89% | 449.15 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8812 | 中科创 达 | 2023-0 6-14 | 915,02 4.00 | 8,800 | 14 | 3.89% | 1,343. 91 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8838 | 朗新科 技 | 2023-0 6-14 | 434,52 0.00 | 18,000 | 14 | 3.89% | 638.18 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8871 | 千方科 技 | 2023-0 6-14 | 430,76 8.00 | 30,400 | 14 | 3.89% | 632.68 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8886 | 和而泰 | 2023-0 6-14 | 412,33 5.00 | 25,500 | 14 | 3.89% | 605.60 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8901 | 科华数 据 | 2023-0 6-14 | 328,49 9.00 | 8,900 | 14 | 3.89% | 482.48 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 8929 | 太极股 份 | 2023-0 6-14 | 479,90 6.00 | 11,800 | 14 | 3.89% | 704.84 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9026 | 启明星 辰 | 2023-0 6-14 | 583,95 3.00 | 18,300 | 14 | 3.89% | 857.66 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9044 | 四维图 新 | 2023-0 6-14 | 783,38 0.00 | 65,500 | 14 | 3.89% | 1,150. 56 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9047 | 大华股 份 | 2023-0 6-14 | 936,61 0.00 | 45,800 | 14 | 3.89% | 1,375. 61 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9060 | 广联达 | 2023-0 6-14 | 1,390, 930.00 | 36,700 | 14 | 3.89% | 2,042. 88 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9063 | 东华软 件 | 2023-0 6-14 | 509,23 2.00 | 61,800 | 14 | 3.89% | 747.91 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9080 | 拓邦股 份 | 2023-0 6-14 | 306,34 2.00 | 27,900 | 14 | 3.89% | 449.93 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202306 140002 9082 | 浪潮信 息 | 2023-0 6-14 | 1,485, 750.00 | 28,300 | 14 | 3.89% | 2,182. 15 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202306 140002 | 新大 陆 | 2023-0 6-14 | 457,63 2.00 | 22,700 | 14 | 3.89% | 672.14 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|----------|----------------|-----------------------|--------|----|-------|---------------|------------------|--------|--|
| 有限公司 | 9129 | | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9155 | 纳思达 | 2023-0 6-14 | 951,75 2.00 | 27,100 | 14 | 3.89% | 1,397. 85 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9178 | 科大讯 飞 | 2023-0 6-14 | 3,831, 630.00 | 51,000 | 14 | 3.89% | 5,627. 57 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9203 | 广电运 通 | 2023-0 6-14 | 430,23 6.00 | 34,200 | 14 | 3.89% | 631.89 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9217 | 石基信 息 | 2023-0 6-14 | 368,49 0.00 | 17,300 | 14 | 3.89% | 541.20 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9352 | 中国长 城 | 2023-0 6-14 | 771,78 4.00 | 53,300 | 14 | 3.89% | 1,133. 53 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9355 | 紫光股 份 | 2023-0 6-14 | 2,156, 880.00 | 62,700 | 14 | 3.89% | 3,167. 84 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 140002 9356 | 深科技 | 2023-0 6-14 | 572,76 0.00 | 25,800 | 14 | 3.89% | 841.22 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 150000 5733 | 中望软 件 | 2023-0 6-15 | 1,967, 257.00 | 9,700 | 14 | 3.40% | 2,525. 39 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 150000 5792 | 金山办 公 | 2023-0 6-15 | 14,85 0,000. 00 | 33,000 | 14 | 3.20% | 17,94 1.75 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 3562 | 中国长 城 | 2023-0 6-28 | 756,32 7.00 | 53,300 | 14 | 4.15% | 169.30 | 737,13 9.00 | 174.38 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 3773 | 科大讯 飞 | 2023-0 6-28 | 3,536, 850.00 | 51,000 | 14 | 4.14% | 789.79 | 3,465, 960.00 | 813.48 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 4636 | 深科技 | 2023-0 6-28 | 483,75 0.00 | 25,800 | 14 | 4.14% | 108.02 | 515,74 2.00 | 111.26 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 4645 | 润和软 件 | 2023-0 6-28 | 510,27 0.00 | 21,900 | 14 | 4.14% | 113.94 | 524,72 4.00 | 117.36 | |
| 中信证 | 202306 | 中国软 | 2023-0 | 745,10 | 16,100 | 14 | 4.15% | 166.78 | 754,76 | 171.78 | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------|------------------|--------|
| 券股份有限公司 | 280003 5037 | 件 | 6-28 | 8.00 | | | | | 8.00 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 5653 | 中科星图 | 2023-0 6-28 | 205,37 4.00 | 2,600 | 14 | 4.15% | 45.98 | 209,50 8.00 | 47.36 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 5777 | 卓朗科技 | 2023-0 6-28 | 276,94 2.00 | 45,700 | 14 | 4.14% | 61.84 | 280,14 1.00 | 63.70 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 6351 | 紫光股份 | 2023-0 6-28 | 1,971, 915.00 | 62,700 | 14 | 4.14% | 440.33 | 1,996, 995.00 | 453.54 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 7946 | 启明星辰 | 2023-0 6-28 | 553,75 8.00 | 18,300 | 14 | 4.15% | 123.96 | 544,60 8.00 | 127.68 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280003 7948 | 航天宏图 | 2023-0 6-28 | 283,82 4.00 | 4,800 | 14 | 4.14% | 63.38 | 292,32 0.00 | 65.28 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 1331 | 指南针 | 2023-0 6-28 | 320,86 3.00 | 6,700 | 14 | 4.15% | 71.83 | 325,55 3.00 | 73.98 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 1333 | 科华数据 | 2023-0 6-28 | 316,48 4.00 | 8,900 | 14 | 4.15% | 70.84 | 319,95 5.00 | 72.96 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 1611 | 四维图新 | 2023-0 6-28 | 742,11 5.00 | 65,500 | 14 | 4.15% | 166.12 | 758,49 0.00 | 171.10 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 1614 | 大华股份 | 2023-0 6-28 | 879,36 0.00 | 45,800 | 14 | 4.15% | 196.84 | 904,55 0.00 | 202.74 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 1657 | 千方科技 | 2023-0 6-28 | 393,37 6.00 | 30,400 | 14 | 4.14% | 87.84 | 414,65 6.00 | 90.48 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 2239 | 新点软件 | 2023-0 6-28 | 136,24 0.00 | 2,600 | 14 | 4.14% | 30.43 | 139,90 6.00 | 31.34 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 2567 | 浪潮信息 | 2023-0 6-28 | 1,435, 659.00 | 28,300 | 14 | 4.14% | 320.58 | 1,372, 550.00 | 330.20 |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 3533 | 广联达 | 2023-0 6-28 | 1,246, 332.00 | 36,700 | 14 | 4.15% | 278.97 | 1,192, 383.00 | 287.34 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|--------|----|-------|--------|--------------|--------|
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800044245 | 金山办公 | 2023-06-28 | 2,366,700.00 | 4,900 | 14 | 4.14% | 528.49 | 2,313,878.00 | 544.34 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800045050 | 卫宁健康 | 2023-06-28 | 496,650.00 | 47,300 | 14 | 4.14% | 110.91 | 511,786.00 | 114.24 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800045343 | 同方股份 | 2023-06-28 | 505,431.00 | 63,100 | 14 | 4.14% | 112.85 | 512,372.00 | 116.24 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800045637 | 恒生电子 | 2023-06-28 | 1,815,960.00 | 40,900 | 14 | 4.15% | 406.49 | 1,811,461.00 | 418.68 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800045726 | 中科创达 | 2023-06-28 | 836,968.00 | 8,800 | 14 | 4.15% | 187.34 | 847,880.00 | 192.96 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800045952 | 纳思达 | 2023-06-28 | 925,736.00 | 27,100 | 14 | 4.15% | 207.22 | 928,175.00 | 213.44 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800046268 | 拓邦股份 | 2023-06-28 | 306,621.00 | 27,900 | 14 | 4.15% | 68.64 | 364,095.00 | 70.70 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800047092 | 用友网络 | 2023-06-28 | 1,130,714.00 | 55,400 | 14 | 4.15% | 253.11 | 1,135,700.00 | 260.70 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800047816 | 东华软件 | 2023-06-28 | 431,982.00 | 61,800 | 14 | 4.15% | 96.70 | 436,308.00 | 99.60 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800048150 | 石基信息 | 2023-06-28 | 242,546.00 | 17,300 | 14 | 4.15% | 54.29 | 242,200.00 | 55.92 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800048341 | 太极股份 | 2023-06-28 | 488,520.00 | 11,800 | 14 | 4.15% | 109.36 | 485,806.00 | 112.64 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800048541 | 同花顺 | 2023-06-28 | 1,053,740.00 | 5,900 | 14 | 4.14% | 235.30 | 1,034,152.00 | 242.36 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800048739 | 中科软 | 2023-06-28 | 357,200.00 | 9,500 | 14 | 4.14% | 79.77 | 366,320.00 | 82.16 |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062800049482 | 光环新网 | 2023-06-28 | 422,532.00 | 39,600 | 14 | 4.15% | 94.58 | 425,700.00 | 97.42 |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------|------------------|--------|--|
| 司 | | | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 9528 | 中望软件 | 2023-0 6-28 | 201,29 2.00 | 1,400 | 14 | 4.14% | 44.95 | 202,84 6.00 | 46.30 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 9563 | 深信服 | 2023-0 6-28 | 766,42 8.00 | 6,800 | 14 | 4.14% | 171.15 | 770,10 0.00 | 176.28 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280004 9604 | 三六零 | 2023-0 6-28 | 1,208, 075.00 | 95,500 | 14 | 4.14% | 269.77 | 1,197, 570.00 | 277.86 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 0086 | 奇安信 | 2023-0 6-28 | 405,29 6.00 | 7,300 | 14 | 4.14% | 90.50 | 378,21 3.00 | 93.22 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 0183 | 软通动力 | 2023-0 6-28 | 181,19 4.00 | 6,900 | 14 | 4.14% | 40.47 | 187,74 9.00 | 41.68 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 1317 | 中科曙光 | 2023-0 6-28 | 1,505, 700.00 | 31,500 | 14 | 4.14% | 336.23 | 1,603, 350.00 | 346.32 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 1615 | 广电运通 | 2023-0 6-28 | 400,48 2.00 | 34,200 | 14 | 4.15% | 89.65 | 400,82 4.00 | 92.34 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 3626 | 朗新科技 | 2023-0 6-28 | 418,32 0.00 | 18,000 | 14 | 4.15% | 93.63 | 419,04 0.00 | 96.44 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 3865 | 宝信软件 | 2023-0 6-28 | 965,56 8.00 | 19,200 | 14 | 4.15% | 216.14 | 975,55 2.00 | 222.62 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 3952 | 航天信息 | 2023-0 6-28 | 405,44 4.00 | 29,900 | 14 | 4.15% | 90.76 | 409,33 1.00 | 93.48 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 4723 | 国网信通 | 2023-0 6-28 | 257,22 6.00 | 12,900 | 14 | 4.15% | 57.57 | 260,45 1.00 | 59.30 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 5183 | 新大陆 | 2023-0 6-28 | 429,71 1.00 | 22,700 | 14 | 4.14% | 95.96 | 429,03 0.00 | 98.84 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 280005 5464 | 和而泰 | 2023-0 6-28 | 405,45 0.00 | 25,500 | 14 | 4.15% | 90.76 | 432,99 0.00 | 93.48 | |
| 中信证券股份有限公司 | 202306 290000 | 卓朗科技 | 2023-0 6-29 | 1,996, 672.00 | 328,40 0 | 14 | 3.20% | 172.31 | 2,013, 092.00 | 177.48 | |

| 有限公司 | 8301 | | | | | | | | | | |
|------------------------------------|------------------|------|------------|--------------|---------|---------|-------|----------|--------------|----------|--|
| 中信证券股份有限公司 | 2023062900008313 | 同方股份 | 2023-06-29 | 1,901,600.00 | 237,700 | 14 | 3.20% | 164.11 | 1,930,124.00 | 169.03 | |
| 中信证券股份有限公司 | 2023062900036904 | 中望软件 | 2023-06-29 | 1,392,532.00 | 9,700 | 14 | 3.40% | 127.69 | 1,405,433.00 | 131.52 | |
| 中信证券股份有限公司 | 2023063000002003 | 中科曙光 | 2023-06-30 | 1,501,550.00 | 29,500 | 14 | 3.20% | - | 1,501,550.00 | - | |
| 上年度可比期间 | | | | | | | | | | | |
| 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 06 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(股) | 出借期限(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 | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400020169 | 安恒信息 | 2022-01-04 | 973,050.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 1,175.64 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400020171 | 虹软科技 | 2022-01-04 | 859,446.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 1,038.38 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400020173 | 金山办公 | 2022-01-04 | 3,999,930.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 4,832.71 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400020857 | 网宿科技 | 2022-01-04 | 1,417,950.00 | 207,000 | 14 | 3.20% | 1,713.16 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400022581 | 卫宁健康 | 2022-01-04 | 2,453,400.00 | 145,000 | 14 | 3.20% | 2,964.19 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400022583 | 光环新网 | 2022-01-04 | 1,564,956.00 | 104,400 | 14 | 3.20% | 1,890.78 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400023587 | 同花顺 | 2022-01-04 | 2,617,260.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 3,162.16 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010400023589 | 万达信息 | 2022-01-04 | 1,338,332.00 | 100,400 | 14 | 3.20% | 1,616.97 | - | - | |
| 中信证 | 202201 | 美亚柏 | 2022-0 | 831,41 | 47,700 | 14 | 3.20% | 1,004. | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份有限公司 | 040002 3591 | 科 | 1-04 | 1.00 | | | | 50 | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 040002 3593 | 易华录 | 2022-0 1-04 | 1,169, 480.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 1,412. 96 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 040002 3595 | 华宇软件 | 2022-0 1-04 | 911,30 0.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 1,101. 03 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 040002 3597 | 深信服 | 2022-0 1-04 | 3,300, 500.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 3,987. 66 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 040002 3599 | 中科创达 | 2022-0 1-04 | 3,887, 989.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 4,697. 47 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 040002 3601 | 迪普科技 | 2022-0 1-04 | 455,76 0.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 550.65 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0145 | 网宿科技 | 2022-0 1-05 | 1,285, 982.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,553. 72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0147 | 同花顺 | 2022-0 1-05 | 2,330, 737.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 2,815. 99 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0149 | 金山办公 | 2022-0 1-05 | 3,666, 846.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 4,430. 28 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0151 | 虹软科技 | 2022-0 1-05 | 728,50 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 880.17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0153 | 安恒信息 | 2022-0 1-05 | 874,80 0.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 1,056. 93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0155 | 卫宁健康 | 2022-0 1-05 | 2,118, 336.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 2,559. 37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0157 | 华宇软件 | 2022-0 1-05 | 816,40 0.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 986.37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 050001 0159 | 易华录 | 2022-0 1-05 | 1,020, 760.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 1,233. 28 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|--------|----|-------|----------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010161 | 万达信息 | 2022-01-05 | 1,172,700.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,416.85 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010163 | 光环新网 | 2022-01-05 | 1,386,605.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,675.29 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010165 | 美亚柏科 | 2022-01-05 | 737,016.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 890.47 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010167 | 迪普科技 | 2022-01-05 | 404,838.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 489.13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010169 | 深信服 | 2022-01-05 | 2,811,085.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 3,396.35 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010500010171 | 中科创达 | 2022-01-05 | 3,350,904.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 4,048.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022010600001099 | 虹软科技 | 2022-01-06 | 239,876.00 | 5,200 | 14 | 3.40% | 307.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011000001290 | 网宿科技 | 2022-01-10 | 52,260.00 | 7,800 | 14 | 3.40% | 67.09 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011100001376 | 美亚柏科 | 2022-01-11 | 29,682.00 | 1,800 | 14 | 3.40% | 38.11 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011200001189 | 易华录 | 2022-01-12 | 239,400.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 307.32 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011300000920 | 美亚柏科 | 2022-01-13 | 163,500.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 197.54 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011300000922 | 深信服 | 2022-01-13 | 1,609,036.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,944.04 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011300000924 | 网宿科技 | 2022-01-13 | 23,625.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 28.54 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022011300010110 | 易华录 | 2022-01-13 | 41,366.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 53.11 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180000 1075 | 易华录 | 2022-0 1-18 | 416,42 2.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 763.66 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180000 1077 | 万达信 息 | 2022-0 1-18 | 69,90 0.00 | 5,000 | 14 | 3.40% | 128.18 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 1328 | 网宿科 技 | 2022-0 1-18 | 1,465, 560.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 2,529. 55 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 1354 | 美亚柏 科 | 2022-0 1-18 | 804,22 2.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 1,388. 09 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2124 | 同花顺 | 2022-0 1-18 | 2,314, 809.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 3,995. 36 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2134 | 万达信 息 | 2022-0 1-18 | 1,403, 592.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 2,422. 59 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2138 | 易华录 | 2022-0 1-18 | 1,192, 802.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 2,058. 78 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2144 | 卫宁健 康 | 2022-0 1-18 | 2,225, 750.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 3,841. 64 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2154 | 光环新 网 | 2022-0 1-18 | 1,643, 256.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 2,836. 25 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 2896 | 虹软科 技 | 2022-0 1-18 | 740,25 9.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 1,277. 69 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 3126 | 中科创 达 | 2022-0 1-18 | 4,404, 015.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 7,601. 32 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 3158 | 安恒信 息 | 2022-0 1-18 | 920,79 0.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 1,589. 28 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202201 180002 3166 | 金山办 公 | 2022-0 1-18 | 4,285, 750.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 7,397. 19 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202201 180002 | 迪普科 技 | 2022-0 1-18 | 433,40 4.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 748.06 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 4672 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 180002 5436 | 华宇软件 | 2022-0 1-18 | 915,50 6.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 1,580. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 180002 5456 | 深信服 | 2022-0 1-18 | 3,247, 125.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 5,604. 53 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190000 0770 | 中科创达 | 2022-0 1-19 | 853,06 2.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 1,486. 18 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190000 0772 | 华宇软件 | 2022-0 1-19 | 129,69 6.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 225.95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 0277 | 虹软科技 | 2022-0 1-19 | 678,43 5.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 1,112. 43 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 0299 | 迪普科技 | 2022-0 1-19 | 395,13 6.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 647.90 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 0307 | 安恒信息 | 2022-0 1-19 | 821,23 2.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 1,346. 57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 0311 | 金山办公 | 2022-0 1-19 | 3,842, 391.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 6,300. 36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1287 | 卫宁健康 | 2022-0 1-19 | 2,002, 814.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 3,284. 01 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1291 | 易华录 | 2022-0 1-19 | 1,041, 900.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 1,708. 40 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1295 | 华宇软件 | 2022-0 1-19 | 848,42 8.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 1,391. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1307 | 光环新网 | 2022-0 1-19 | 1,502, 545.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 2,463. 72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1421 | 网宿科技 | 2022-0 1-19 | 1,348, 984.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 2,211. 92 | - | - |
| 中信证 | 202201 | 同花顺 | 2022-0 | 2,136, | 16,300 | 14 | 3.20% | 3,502. | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份有限公司 | 190001 1431 | | 1-19 | 278.00 | | | | 85 | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1445 | 万达信息 | 2022-0 1-19 | 1,281, 600.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 2,101. 44 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1453 | 美亚柏科 | 2022-0 1-19 | 731,45 2.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 1,199. 36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1485 | 深信服 | 2022-0 1-19 | 2,843, 270.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 4,662. 11 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 190001 1501 | 中科创达 | 2022-0 1-19 | 3,861, 228.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 6,331. 25 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 200000 9754 | 虹软科技 | 2022-0 1-20 | 219,07 6.00 | 5,200 | 14 | 3.40% | 361.58 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 210000 0945 | 万达信息 | 2022-0 1-21 | 22,33 6.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 34.82 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 240001 0604 | 网宿科技 | 2022-0 1-24 | 54,28 8.00 | 7,800 | 14 | 3.40% | 69.69 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 250000 8950 | 美亚柏科 | 2022-0 1-25 | 28,72 8.00 | 1,800 | 14 | 3.40% | 36.87 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 260001 0472 | 易华录 | 2022-0 1-26 | 226,55 6.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 290.84 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 270000 0796 | 虹软科技 | 2022-0 1-27 | 115,59 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 148.39 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 270000 9115 | 易华录 | 2022-0 1-27 | 37,53 1.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 48.17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 270001 1227 | 美亚柏科 | 2022-0 1-27 | 145,10 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 175.31 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202201 270001 1229 | 深信服 | 2022-0 1-27 | 1,569, 460.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,896. 22 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|---------|----|-------|----------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 2022012700011233 | 网宿科技 | 2022-01-27 | 20,265.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 24.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022012800000592 | 易华录 | 2022-01-28 | 203,500.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 261.23 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022012800000595 | 华宇软件 | 2022-01-28 | 133,168.00 | 11,600 | 14 | 3.40% | 170.95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044125 | 深信服 | 2022-02-07 | 2,404,769.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,905.44 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044133 | 中科创达 | 2022-02-07 | 4,028,045.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 4,866.68 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044149 | 中科创达 | 2022-02-07 | 3,621,030.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 4,374.92 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044285 | 网宿科技 | 2022-02-07 | 1,087,711.00 | 185,300 | 14 | 3.20% | 1,314.17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044289 | 网宿科技 | 2022-02-07 | 45,786.00 | 7,800 | 14 | 3.40% | 58.78 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044291 | 网宿科技 | 2022-02-07 | 1,215,090.00 | 207,000 | 14 | 3.20% | 1,468.07 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044349 | 万达信息 | 2022-02-07 | 19,072.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 24.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044351 | 万达信息 | 2022-02-07 | 1,196,768.00 | 100,400 | 14 | 3.20% | 1,445.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044355 | 万达信息 | 2022-02-07 | 59,600.00 | 5,000 | 14 | 3.40% | 76.50 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044357 | 万达信息 | 2022-02-07 | 1,072,800.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,296.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700044369 | 卫宁健康 | 2022-02-07 | 1,484,912.00 | 129,800 | 14 | 3.20% | 1,794.07 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 4617 | 同花顺 | 2022-0 2-07 | 1,930, 409.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 2,332. 32 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 4963 | 虹软科 技 | 2022-0 2-07 | 200,61 6.00 | 5,200 | 14 | 3.40% | 257.53 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6661 | 同花顺 | 2022-0 2-07 | 2,143, 583.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,589. 87 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6757 | 迪普科 技 | 2022-0 2-07 | 351,33 0.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 424.48 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6763 | 迪普科 技 | 2022-0 2-07 | 387,18 0.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 467.79 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6795 | 安恒信 息 | 2022-0 2-07 | 822,12 0.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 993.28 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6797 | 安恒信 息 | 2022-0 2-07 | 758,88 0.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 916.87 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6801 | 虹软科 技 | 2022-0 2-07 | 659,71 8.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 797.07 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6805 | 虹软科 技 | 2022-0 2-07 | 597,99 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 722.49 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6809 | 金山办 公 | 2022-0 2-07 | 3,422, 775.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 4,135. 39 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 6813 | 金山办 公 | 2022-0 2-07 | 3,762, 625.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 4,546. 00 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 8957 | 美亚柏 科 | 2022-0 2-07 | 711,68 4.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 859.85 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202202 070005 8961 | 美亚柏 科 | 2022-0 2-07 | 638,57 6.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 771.52 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202202 070005 | 易华录 | 2022-0 2-07 | 887,25 0.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 1,071. 97 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|---------|----|-------|----------|---|---|
| 有限公司 | 8963 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058967 | 易华录 | 2022-02-07 | 309,750.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 397.63 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058969 | 易华录 | 2022-02-07 | 792,750.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 957.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058979 | 卫宁健康 | 2022-02-07 | 1,658,800.00 | 145,000 | 14 | 3.20% | 2,004.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058989 | 华宇软件 | 2022-02-07 | 722,200.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 872.56 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058991 | 华宇软件 | 2022-02-07 | 110,400.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 141.72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700058995 | 华宇软件 | 2022-02-07 | 806,150.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 973.99 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700059021 | 光环新网 | 2022-02-07 | 1,245,420.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,504.72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700059023 | 光环新网 | 2022-02-07 | 1,390,608.00 | 104,400 | 14 | 3.20% | 1,680.13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700059041 | 深信服 | 2022-02-07 | 2,680,475.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 3,238.54 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020700059061 | 中科创达 | 2022-02-07 | 799,995.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 1,026.96 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020800015026 | 美亚柏科 | 2022-02-08 | 27,450.00 | 1,800 | 14 | 3.40% | 35.24 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020900001580 | 华宇软件 | 2022-02-09 | 57,648.00 | 4,800 | 14 | 3.40% | 74.00 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022020900016148 | 易华录 | 2022-02-09 | 205,960.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 264.39 | - | - |
| 中信证 | 202202 | 虹软科 | 2022-0 | 118,44 | 3,000 | 14 | 3.40% | 152.04 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份有限公司 | 100001 2452 | 技 | 2-10 | 0.00 | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 100001 2654 | 网宿科技 | 2022-0 2-10 | 21,84 0.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 26.39 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 100001 2668 | 易华录 | 2022-0 2-10 | 34,71 0.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 44.55 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 100001 2672 | 美亚柏科 | 2022-0 2-10 | 153,90 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 185.94 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 100001 3076 | 深信服 | 2022-0 2-10 | 1,405, 530.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,698. 16 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 110000 1170 | 华宇软件 | 2022-0 2-11 | 42,22 8.00 | 3,600 | 14 | 3.40% | 54.20 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 110000 1172 | 网宿科技 | 2022-0 2-11 | 254,40 9.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 326.59 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 110001 7424 | 华宇软件 | 2022-0 2-11 | 136,06 8.00 | 11,600 | 14 | 3.40% | 174.67 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 110002 1576 | 易华录 | 2022-0 2-11 | 194,25 0.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 249.36 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 150000 0858 | 华宇软件 | 2022-0 2-15 | 19,65 2.00 | 1,700 | 14 | 3.40% | 25.22 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 150000 0898 | 迪普科技 | 2022-0 2-15 | 317,70 0.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 383.84 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 160000 0904 | 美亚柏科 | 2022-0 2-16 | 51,24 9.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 65.79 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 160000 0905 | 深信服 | 2022-0 2-16 | 146,27 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 187.77 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 160000 0912 | 华宇软件 | 2022-0 2-16 | 56,93 8.00 | 4,900 | 14 | 3.40% | 73.09 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1945 | 美亚柏科 | 2022-0 2-21 | 757,47 6.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 915.18 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1947 | 易华录 | 2022-0 2-21 | 1,031, 914.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 1,246. 76 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1949 | 中科创达 | 2022-0 2-21 | 3,794, 140.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 4,584. 08 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1951 | 迪普科技 | 2022-0 2-21 | 394,63 2.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 476.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1955 | 虹软科技 | 2022-0 2-21 | 663,13 8.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 801.20 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1957 | 安恒信息 | 2022-0 2-21 | 716,00 1.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 865.07 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1959 | 卫宁健康 | 2022-0 2-21 | 1,708, 100.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 2,063. 73 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1961 | 华宇软件 | 2022-0 2-21 | 844,00 4.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 1,019. 73 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1963 | 网宿科技 | 2022-0 2-21 | 1,471, 770.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,778. 19 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1965 | 华宇软件 | 2022-0 2-21 | 756,11 2.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 913.53 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1967 | 光环新网 | 2022-0 2-21 | 1,701, 720.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 2,056. 02 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1969 | 同花顺 | 2022-0 2-21 | 1,991, 543.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,406. 17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1971 | 网宿科技 | 2022-0 2-21 | 55,45 8.00 | 7,800 | 14 | 3.40% | 71.19 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1973 | 华宇软件 | 2022-0 2-21 | 115,58 4.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 148.38 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1975 | 深信服 | 2022-0 2-21 | 2,303, 504.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,783. 09 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1977 | 中科创 达 | 2022-0 2-21 | 3,410, 760.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 4,120. 87 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 1979 | 中科创 达 | 2022-0 2-21 | 753,54 0.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 967.33 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6509 | 迪普科 技 | 2022-0 2-21 | 358,09 2.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 432.65 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6511 | 同花顺 | 2022-0 2-21 | 1,793, 489.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 2,166. 89 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6513 | 金山办 公 | 2022-0 2-21 | 3,332, 965.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 4,026. 88 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6515 | 深信服 | 2022-0 2-21 | 2,567, 600.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 3,102. 17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6517 | 安恒信 息 | 2022-0 2-21 | 660,92 4.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 798.52 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6519 | 网宿科 技 | 2022-0 2-21 | 1,317, 483.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,591. 78 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6521 | 易华录 | 2022-0 2-21 | 922,00 6.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 1,113. 97 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6523 | 万达信 息 | 2022-0 2-21 | 1,330, 300.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 1,607. 26 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6525 | 万达信 息 | 2022-0 2-21 | 21,20 0.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 27.21 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6527 | 虹软科 技 | 2022-0 2-21 | 601,09 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 726.23 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 | 万达信 息 | 2022-0 2-21 | 1,192, 500.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,440. 78 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 6529 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6531 | 万达信息 | 2022-0 2-21 | 66,25 0.00 | 5,000 | 14 | 3.40% | 85.05 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6533 | 卫宁健康 | 2022-0 2-21 | 1,529, 044.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,847. 39 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6535 | 金山办公 | 2022-0 2-21 | 3,031, 923.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,663. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6537 | 美亚柏科 | 2022-0 2-21 | 679,66 4.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 821.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6539 | 易华录 | 2022-0 2-21 | 360,25 4.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 462.47 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 210004 6541 | 光环新网 | 2022-0 2-21 | 1,524, 050.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,841. 36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 220000 1016 | 虹软科技 | 2022-0 2-22 | 37,80 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 48.52 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 220000 1035 | 华宇软件 | 2022-0 2-22 | 344,27 5.00 | 29,300 | 14 | 3.40% | 441.95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 220001 1419 | 美亚柏科 | 2022-0 2-22 | 28,08 0.00 | 1,800 | 14 | 3.40% | 36.05 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 230000 0938 | 同花顺 | 2022-0 2-23 | 217,78 0.00 | 2,000 | 14 | 3.40% | 279.56 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 230001 1578 | 易华录 | 2022-0 2-23 | 226,25 2.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 290.45 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 230001 2600 | 华宇软件 | 2022-0 2-23 | 57,31 2.00 | 4,800 | 14 | 3.40% | 73.57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 240001 0179 | 易华录 | 2022-0 2-24 | 35,97 1.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 46.17 | - | - |
| 中信证 | 202202 | 美亚柏 | 2022-0 | 150,70 | 10,000 | 14 | 3.20% | 182.08 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份有限公司 | 240001 0807 | 科 | 2-24 | 0.00 | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 240001 0813 | 深信服 | 2022-0 2-24 | 1,386, 227.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,674. 84 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 240001 0819 | 虹软科技 | 2022-0 2-24 | 111,66 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 143.34 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 240001 1083 | 网宿科技 | 2022-0 2-24 | 24,50 0.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 29.60 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 250001 9283 | 网宿科技 | 2022-0 2-25 | 281,94 6.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 361.94 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 250001 9287 | 易华录 | 2022-0 2-25 | 207,34 8.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 266.17 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 250001 9289 | 华宇软件 | 2022-0 2-25 | 132,93 6.00 | 11,600 | 14 | 3.40% | 170.65 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202202 250001 9291 | 华宇软件 | 2022-0 2-25 | 41,25 6.00 | 3,600 | 14 | 3.40% | 52.96 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 010000 1054 | 同花顺 | 2022-0 3-01 | 108,11 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 138.79 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 010000 1096 | 万达信息 | 2022-0 3-01 | 1,278, 648.00 | 103,20 0 | 14 | 3.40% | 1,641. 42 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 010000 1108 | 卫宁健康 | 2022-0 3-01 | 265,12 2.00 | 23,400 | 14 | 3.40% | 340.34 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 010000 4276 | 华宇软件 | 2022-0 3-01 | 19,34 6.00 | 1,700 | 14 | 3.40% | 24.84 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 010000 4506 | 迪普科技 | 2022-0 3-01 | 324,99 0.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 392.65 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 020000 0633 | 美亚柏科 | 2022-0 3-02 | 63,34 5.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 81.32 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 020000 3211 | 深信服 | 2022-0 3-02 | 142,06 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 182.36 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 020000 3221 | 美亚柏 科 | 2022-0 3-02 | 50,98 5.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 65.45 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 020000 3613 | 华宇软 件 | 2022-0 3-02 | 55,76 2.00 | 4,900 | 14 | 3.40% | 71.58 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 030000 1401 | 深信服 | 2022-0 3-03 | 185,49 7.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 238.13 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070000 1408 | 易华录 | 2022-0 3-07 | 42,03 2.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 53.96 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 3076 | 中科创 达 | 2022-0 3-07 | 546,57 3.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 701.64 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 3078 | 中科创 达 | 2022-0 3-07 | 2,752, 043.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 3,325. 01 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 3082 | 中科创 达 | 2022-0 3-07 | 2,473, 962.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 2,989. 04 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 6118 | 万达信 息 | 2022-0 3-07 | 1,171, 668.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 1,415. 61 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 6120 | 美亚柏 科 | 2022-0 3-07 | 640,71 6.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 774.12 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 6122 | 美亚柏 科 | 2022-0 3-07 | 714,06 9.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 862.74 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7152 | 易华录 | 2022-0 3-07 | 887,92 6.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 1,072. 79 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7166 | 卫宁健 康 | 2022-0 3-07 | 1,362, 900.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,646. 65 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7170 | 卫宁健 康 | 2022-0 3-07 | 1,522, 500.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 1,839. 49 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7172 | 华宇软 件 | 2022-0 3-07 | 678,86 8.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 820.20 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7208 | 光环新 网 | 2022-0 3-07 | 1,486, 656.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 1,796. 17 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7212 | 光环新 网 | 2022-0 3-07 | 1,331, 440.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,608. 64 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7222 | 深信服 | 2022-0 3-07 | 2,319, 625.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 2,802. 56 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7224 | 深信服 | 2022-0 3-07 | 2,081, 035.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,514. 30 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7942 | 安恒信 息 | 2022-0 3-07 | 648,03 6.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 782.95 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7960 | 虹软科 技 | 2022-0 3-07 | 543,95 1.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 657.20 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 7962 | 虹软科 技 | 2022-0 3-07 | 493,05 5.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 595.71 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 8492 | 金山办 公 | 2022-0 3-07 | 2,826, 890.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 3,415. 45 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070003 8494 | 金山办 公 | 2022-0 3-07 | 2,571, 558.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,106. 95 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070004 0308 | 网宿科 技 | 2022-0 3-07 | 1,178, 508.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,423. 87 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070004 0310 | 网宿科 技 | 2022-0 3-07 | 1,316, 520.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,590. 62 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 070004 0366 | 万达信 息 | 2022-0 3-07 | 1,050, 300.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,268. 97 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202203 070004 | 易华录 | 2022-0 3-07 | 793,35 4.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 958.52 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 0368 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 0386 | 华宇软件 | 2022-0 3-07 | 757,78 1.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 915.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 0388 | 华宇软件 | 2022-0 3-07 | 103,77 6.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 133.21 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 0766 | 迪普科技 | 2022-0 3-07 | 363,63 6.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 439.34 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 0770 | 迪普科技 | 2022-0 3-07 | 329,96 6.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 398.66 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 0804 | 安恒信息 | 2022-0 3-07 | 702,03 9.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 848.20 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 1734 | 同花顺 | 2022-0 3-07 | 1,793, 710.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,167. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 1736 | 同花顺 | 2022-0 3-07 | 1,615, 330.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 1,951. 64 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 070004 4408 | 易华录 | 2022-0 3-07 | 309,98 6.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 397.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 080000 1271 | 拉卡拉 | 2022-0 3-08 | 1,266, 051.00 | 50,300 | 14 | 3.40% | 1,625. 24 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 080001 3176 | 虹软科技 | 2022-0 3-08 | 31,17 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 40.01 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 080001 5548 | 美亚柏科 | 2022-0 3-08 | 26,20 8.00 | 1,800 | 14 | 3.40% | 33.64 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 080001 5550 | 华宇软件 | 2022-0 3-08 | 311,16 6.00 | 29,300 | 14 | 3.40% | 399.45 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 090000 0889 | 拉卡拉 | 2022-0 3-09 | 161,37 0.00 | 6,600 | 14 | 3.40% | 207.16 | - | - |
| 中信证 | 202203 | 易华录 | 2022-0 | 193,57 | 7,600 | 14 | 3.40% | 248.49 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份 有限公司 | 090001 5737 | | 3-09 | 2.00 | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 090001 8781 | 同花顺 | 2022-0 3-09 | 196,66 0.00 | 2,000 | 14 | 3.40% | 252.46 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 090001 8795 | 华宇软 件 | 2022-0 3-09 | 48,19 2.00 | 4,800 | 14 | 3.40% | 61.86 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100000 0721 | 拉卡拉 | 2022-0 3-10 | 74,07 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 95.09 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100001 2746 | 网宿科 技 | 2022-0 3-10 | 21,77 0.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 26.30 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100001 2750 | 美亚柏 科 | 2022-0 3-10 | 143,20 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 173.01 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100001 2754 | 易华录 | 2022-0 3-10 | 33,21 5.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 42.64 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100001 2758 | 虹软科 技 | 2022-0 3-10 | 91,74 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 117.77 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 100001 2760 | 深信服 | 2022-0 3-10 | 1,275, 550.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,541. 12 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 110001 6028 | 易华录 | 2022-0 3-11 | 187,29 4.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 240.43 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 110001 6034 | 华宇软 件 | 2022-0 3-11 | 121,10 4.00 | 11,600 | 14 | 3.40% | 155.47 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 110001 6036 | 华宇软 件 | 2022-0 3-11 | 37,58 4.00 | 3,600 | 14 | 3.40% | 48.24 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 110001 8814 | 网宿科 技 | 2022-0 3-11 | 257,69 7.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 330.81 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202203 140000 1153 | 美亚柏 科 | 2022-0 3-14 | 85,63 5.00 | 5,500 | 14 | 3.40% | 109.93 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202203 140000 1159 | 网宿科技 | 2022-0 3-14 | 44,23 8.00 | 7,300 | 14 | 3.40% | 56.79 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150000 1337 | 安恒信息 | 2022-0 3-15 | 389,02 5.00 | 2,500 | 14 | 3.40% | 499.40 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150000 1350 | 万达信息 | 2022-0 3-15 | 258,85 6.00 | 24,700 | 14 | 3.40% | 332.30 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150001 1099 | 同花顺 | 2022-0 3-15 | 92,54 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 118.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150001 1285 | 迪普科技 | 2022-0 3-15 | 264,06 0.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 319.04 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150001 1527 | 华宇软件 | 2022-0 3-15 | 16,35 4.00 | 1,700 | 14 | 3.40% | 20.99 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150001 1529 | 万达信息 | 2022-0 3-15 | 1,081, 536.00 | 103,20 0 | 14 | 3.40% | 1,388. 38 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 150001 1533 | 卫宁健康 | 2022-0 3-15 | 211,53 6.00 | 23,400 | 14 | 3.40% | 271.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 160000 1679 | 网宿科技 | 2022-0 3-16 | 681,66 2.00 | 113,80 0 | 14 | 3.40% | 875.06 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 160000 6328 | 美亚柏科 | 2022-0 3-16 | 50,78 7.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 65.19 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 160000 6330 | 美亚柏科 | 2022-0 3-16 | 63,09 9.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 81.00 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 160000 6708 | 深信服 | 2022-0 3-16 | 121,62 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 156.13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 160000 6714 | 华宇软件 | 2022-0 3-16 | 48,11 8.00 | 4,900 | 14 | 3.40% | 61.77 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 170000 4928 | 深信服 | 2022-0 3-17 | 155,97 4.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 200.22 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210002 8833 | 光环新 网 | 2022-0 3-21 | 1,284, 690.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,773. 89 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210002 8857 | 中科创 达 | 2022-0 3-21 | 615,71 4.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 903.31 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210002 8861 | 中科创 达 | 2022-0 3-21 | 3,100, 174.00 | 28,700 | 14 | 3.20% | 4,280. 72 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210002 8865 | 中科创 达 | 2022-0 3-21 | 2,786, 916.00 | 25,800 | 14 | 3.20% | 3,848. 16 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 1519 | 卫宁健 康 | 2022-0 3-21 | 1,246, 080.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,720. 58 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 1521 | 卫宁健 康 | 2022-0 3-21 | 1,392, 000.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 1,922. 07 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 1523 | 华宇软 件 | 2022-0 3-21 | 96,48 0.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 141.54 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2323 | 安恒信 息 | 2022-0 3-21 | 671,58 0.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 927.32 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2337 | 金山办 公 | 2022-0 3-21 | 2,695, 920.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,722. 52 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2573 | 光环新 网 | 2022-0 3-21 | 1,434, 456.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 1,980. 70 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2591 | 深信服 | 2022-0 3-21 | 2,111, 200.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 2,915. 15 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2597 | 深信服 | 2022-0 3-21 | 1,894, 048.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,615. 30 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 210003 2653 | 迪普科 技 | 2022-0 3-21 | 300,27 2.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 414.61 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202203 210003 | 迪普科 技 | 2022-0 3-21 | 330,91 2.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 456.92 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 2657 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 3941 | 安恒信息 | 2022-0 3-21 | 619,92 0.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 855.98 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 3955 | 虹软科技 | 2022-0 3-21 | 512,82 9.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 708.12 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 3957 | 虹软科技 | 2022-0 3-21 | 464,84 5.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 641.85 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5701 | 同花顺 | 2022-0 3-21 | 1,571, 157.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 2,169. 45 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5705 | 网宿科技 | 2022-0 3-21 | 1,242, 000.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,714. 95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5745 | 美亚柏科 | 2022-0 3-21 | 726,31 6.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 1,002. 89 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5747 | 美亚柏科 | 2022-0 3-21 | 809,46 9.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 1,117. 71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5749 | 易华录 | 2022-0 3-21 | 275,17 6.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 403.71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5755 | 易华录 | 2022-0 3-21 | 37,31 2.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 54.74 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5757 | 易华录 | 2022-0 3-21 | 704,26 4.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 972.45 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5761 | 易华录 | 2022-0 3-21 | 788,21 6.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 1,088. 37 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5769 | 华宇软件 | 2022-0 3-21 | 704,50 5.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 972.78 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 5773 | 华宇软件 | 2022-0 3-21 | 631,14 0.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 871.48 | - | - |
| 中信证 | 202203 | 同花顺 | 2022-0 | 1,744, | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,409. | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份有限公司 | 210003 7491 | | 3-21 | 659.00 | | | | 02 | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 7497 | 网宿科技 | 2022-0 3-21 | 1,111, 800.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,535. 17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 7527 | 万达信息 | 2022-0 3-21 | 1,130, 504.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 1,561. 00 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 210003 7529 | 万达信息 | 2022-0 3-21 | 1,013, 400.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,399. 30 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 220001 3613 | 拉卡拉 | 2022-0 3-22 | 1,207, 200.00 | 50,300 | 14 | 3.40% | 1,660. 39 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 220001 3629 | 虹软科技 | 2022-0 3-22 | 30,22 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 41.56 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 220001 3817 | 华宇软件 | 2022-0 3-22 | 293,00 0.00 | 29,300 | 14 | 3.40% | 402.99 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 230001 3339 | 易华录 | 2022-0 3-23 | 177,53 6.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 227.90 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 230001 4107 | 同花顺 | 2022-0 3-23 | 194,44 0.00 | 2,000 | 14 | 3.40% | 249.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 240000 0954 | 华宇软件 | 2022-0 3-24 | 32,40 6.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 41.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 240001 0737 | 网宿科技 | 2022-0 3-24 | 20,93 0.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 25.29 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 240001 0747 | 美亚柏科 | 2022-0 3-24 | 161,90 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 195.61 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 240001 0885 | 深信服 | 2022-0 3-24 | 1,144, 406.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,382. 67 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 240001 1907 | 虹软科技 | 2022-0 3-24 | 89,10 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 114.38 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|----------------|--------|----|-------|--------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202203 250000 0698 | 华宇软件 | 2022-0 3-25 | 70,27 2.00 | 7,200 | 14 | 3.40% | 90.21 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 250001 6398 | 网宿科技 | 2022-0 3-25 | 243,31 2.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 312.34 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 250001 7804 | 易华录 | 2022-0 3-25 | 164,65 0.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 211.36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 280000 0603 | 同花顺 | 2022-0 3-28 | 94,81 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 121.71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 280000 5075 | 网宿科技 | 2022-0 3-28 | 44,16 5.00 | 7,300 | 14 | 3.40% | 56.70 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 280000 5353 | 美亚柏科 | 2022-0 3-28 | 86,46 0.00 | 5,500 | 14 | 3.40% | 110.99 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 290000 1045 | 拉卡拉 | 2022-0 3-29 | 27,03 6.00 | 1,200 | 14 | 3.40% | 34.71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 290000 4704 | 华宇软件 | 2022-0 3-29 | 16,37 1.00 | 1,700 | 14 | 3.40% | 21.02 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 290000 4712 | 迪普科技 | 2022-0 3-29 | 241,38 0.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 291.63 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 290000 5078 | 安恒信息 | 2022-0 3-29 | 404,42 5.00 | 2,500 | 14 | 3.40% | 519.16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 290000 5254 | 万达信息 | 2022-0 3-29 | 257,86 8.00 | 24,700 | 14 | 3.40% | 331.03 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 300000 7067 | 深信服 | 2022-0 3-30 | 109,80 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 140.95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 300000 7339 | 美亚柏科 | 2022-0 3-30 | 65,88 7.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 84.58 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202203 300000 7341 | 美亚柏科 | 2022-0 3-30 | 53,03 1.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 68.08 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 300000 7343 | 华宇软 件 | 2022-0 3-30 | 47,62 8.00 | 4,900 | 14 | 3.40% | 61.14 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 300000 7363 | 网宿科 技 | 2022-0 3-30 | 681,66 2.00 | 113,80 0 | 14 | 3.40% | 875.06 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202203 310000 6326 | 深信服 | 2022-0 3-31 | 145,02 8.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 186.17 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0245 | 深信服 | 2022-0 4-06 | 1,742, 229.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,104. 96 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0247 | 深信服 | 2022-0 4-06 | 1,941, 975.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 2,346. 29 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0401 | 迪普科 技 | 2022-0 4-06 | 268,42 2.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 324.31 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0407 | 迪普科 技 | 2022-0 4-06 | 295,81 2.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 357.40 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0955 | 网宿科 技 | 2022-0 4-06 | 1,225, 440.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,480. 57 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0957 | 同花顺 | 2022-0 4-06 | 1,550, 619.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 1,873. 46 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 0963 | 同花顺 | 2022-0 4-06 | 1,721, 853.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,080. 34 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 1691 | 网宿科 技 | 2022-0 4-06 | 1,096, 976.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,325. 37 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 1733 | 虹软科 技 | 2022-0 4-06 | 449,50 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 543.09 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 060005 1757 | 金山办 公 | 2022-0 4-06 | 2,605, 116.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,147. 49 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202204 060005 | 拉卡拉 | 2022-0 4-06 | 1,219, 272.00 | 50,300 | 14 | 3.40% | 1,565. 19 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|---------|----|-------|----------|---|---|
| 有限公司 | 9665 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061045 | 易华录 | 2022-04-06 | 699,998.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 845.74 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061047 | 易华录 | 2022-04-06 | 625,442.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 755.66 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061051 | 易华录 | 2022-04-06 | 157,396.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 202.05 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061057 | 易华录 | 2022-04-06 | 33,136.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 42.53 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061061 | 卫宁健康 | 2022-04-06 | 1,378,950.00 | 145,000 | 14 | 3.20% | 1,666.05 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061067 | 华宇软件 | 2022-04-06 | 93,888.00 | 9,600 | 14 | 3.40% | 120.52 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061071 | 华宇软件 | 2022-04-06 | 614,184.00 | 62,800 | 14 | 3.20% | 742.06 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061075 | 华宇软件 | 2022-04-06 | 286,554.00 | 29,300 | 14 | 3.40% | 367.85 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600061077 | 华宇软件 | 2022-04-06 | 685,578.00 | 70,100 | 14 | 3.20% | 828.31 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600063997 | 美亚柏科 | 2022-04-06 | 703,204.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 849.61 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600063999 | 万达信息 | 2022-04-06 | 967,500.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,168.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600064003 | 美亚柏科 | 2022-04-06 | 783,711.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 946.87 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040600064007 | 万达信息 | 2022-04-06 | 1,079,300.00 | 100,400 | 14 | 3.20% | 1,304.01 | - | - |
| 中信证 | 202204 | 易华录 | 2022-0 | 244,37 | 11,800 | 14 | 3.40% | 313.71 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份 有限公司 | 060006 4021 | | 4-06 | 8.00 | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 4045 | 卫宁健 康 | 2022-0 4-06 | 1,234, 398.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,491. 40 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 4649 | 安恒信 息 | 2022-0 4-06 | 578,16 0.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 698.53 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 4659 | 虹软科 技 | 2022-0 4-06 | 29,00 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 37.22 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 4671 | 虹软科 技 | 2022-0 4-06 | 495,90 0.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 599.15 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 6159 | 安恒信 息 | 2022-0 4-06 | 626,34 0.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 756.75 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 7251 | 光环新 网 | 2022-0 4-06 | 1,251, 030.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,511. 49 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 060006 7255 | 光环新 网 | 2022-0 4-06 | 1,396, 872.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 1,687. 70 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 070001 1660 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-07 | 154,00 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 186.06 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 070001 3478 | 虹软科 技 | 2022-0 4-07 | 81,87 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 105.10 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 070001 3480 | 华宇软 件 | 2022-0 4-07 | 31,02 0.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 39.83 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 070001 3804 | 网宿科 技 | 2022-0 4-07 | 20,02 0.00 | 3,500 | 14 | 3.20% | 24.18 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 070001 4294 | 深信服 | 2022-0 4-07 | 1,041, 295.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,258. 09 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公司 | 202204 080000 1099 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-08 | 103,98 3.00 | 6,900 | 14 | 3.40% | 133.49 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|------------|---------|----|-------|--------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 2022040800016049 | 华宇软件 | 2022-04-08 | 65,952.00 | 7,200 | 14 | 3.40% | 84.66 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040800016051 | 网宿科技 | 2022-04-08 | 228,105.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 292.83 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022040800016053 | 易华录 | 2022-04-08 | 142,154.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 182.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041100001021 | 美亚柏科 | 2022-04-11 | 32,384.00 | 2,200 | 14 | 3.40% | 41.57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041100006455 | 美亚柏科 | 2022-04-11 | 80,960.00 | 5,500 | 14 | 3.40% | 103.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041200011753 | 华宇软件 | 2022-04-12 | 15,453.00 | 1,700 | 14 | 3.40% | 19.84 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041200011763 | 迪普科技 | 2022-04-12 | 231,750.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 280.00 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041200011767 | 拉卡拉 | 2022-04-12 | 26,064.00 | 1,200 | 14 | 3.40% | 33.46 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041200011769 | 安恒信息 | 2022-04-12 | 362,000.00 | 2,500 | 14 | 3.40% | 464.70 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041300001255 | 美亚柏科 | 2022-04-13 | 21,795.00 | 1,500 | 14 | 3.40% | 27.98 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041300010222 | 网宿科技 | 2022-04-13 | 616,796.00 | 113,800 | 14 | 3.40% | 791.79 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041300010232 | 深信服 | 2022-04-13 | 97,260.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 124.85 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041300010926 | 美亚柏科 | 2022-04-13 | 47,949.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 61.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022041300010928 | 美亚柏科 | 2022-04-13 | 59,573.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 76.48 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 130001 0932 | 华宇软 件 | 2022-0 4-13 | 44,10 0.00 | 4,900 | 14 | 3.40% | 56.61 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 140000 0876 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-14 | 83,22 0.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 106.84 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 140000 5299 | 深信服 | 2022-0 4-14 | 123,42 2.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 158.44 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 150000 0892 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-15 | 31,83 4.00 | 2,200 | 14 | 3.40% | 40.86 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 180000 0913 | 易华录 | 2022-0 4-18 | 60,81 9.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 94.81 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200000 1124 | 网宿科 技 | 2022-0 4-20 | 816,14 6.00 | 151,70 0 | 14 | 3.40% | 1,122. 53 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200003 8362 | 虹软科 技 | 2022-0 4-20 | 25,68 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 35.32 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200003 8364 | 虹软科 技 | 2022-0 4-20 | 439,12 8.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 568.45 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200003 8366 | 虹软科 技 | 2022-0 4-20 | 398,04 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 515.26 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200003 8372 | 金山办 公 | 2022-0 4-20 | 2,563, 380.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,318. 29 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200004 1052 | 光环新 网 | 2022-0 4-20 | 1,219, 392.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 1,578. 50 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200004 1066 | 深信服 | 2022-0 4-20 | 1,571, 570.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 2,034. 40 | - | - |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 200004 3428 | 同花顺 | 2022-0 4-20 | 1,642, 394.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 2,126. 08 | - | - |
| 中信证 券股份 | 202204 200004 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-20 | 711,20 7.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 920.66 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 3478 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 3482 | 美亚柏科 | 2022-0 4-20 | 638,14 8.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 826.08 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4724 | 网宿科技 | 2022-0 4-20 | 1,113, 660.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,441. 63 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4726 | 网宿科技 | 2022-0 4-20 | 996,91 4.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,290. 50 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4736 | 同花顺 | 2022-0 4-20 | 1,479, 062.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 1,914. 64 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4762 | 万达信息 | 2022-0 4-20 | 935,72 8.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 1,211. 30 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4764 | 万达信息 | 2022-0 4-20 | 838,80 0.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 1,085. 83 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4768 | 易华录 | 2022-0 4-20 | 28,84 8.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 39.68 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4770 | 易华录 | 2022-0 4-20 | 137,02 8.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 188.47 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4772 | 易华录 | 2022-0 4-20 | 609,41 4.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 788.88 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4774 | 易华录 | 2022-0 4-20 | 212,75 4.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 292.62 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4776 | 易华录 | 2022-0 4-20 | 544,50 6.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 704.86 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4782 | 卫宁健康 | 2022-0 4-20 | 1,178, 850.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 1,526. 02 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 4784 | 卫宁健康 | 2022-0 4-20 | 1,055, 274.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,366. 05 | - | - |
| 中信证 | 202204 | 光环新 | 2022-0 | 1,092, | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,413. | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份有限公司 | 200004 5838 | 网 | 4-20 | 080.00 | | | | 70 | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 7896 | 迪普科技 | 2022-0 4-20 | 267,84 0.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 346.72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 7900 | 迪普科技 | 2022-0 4-20 | 243,04 0.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 314.61 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 7906 | 拉卡拉 | 2022-0 4-20 | 986,38 3.00 | 50,300 | 14 | 3.40% | 1,356. 68 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 7932 | 安恒信息 | 2022-0 4-20 | 504,00 0.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 652.43 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 7934 | 安恒信息 | 2022-0 4-20 | 546,00 0.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 706.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 200004 9556 | 深信服 | 2022-0 4-20 | 1,751, 750.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 2,267. 64 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 210001 1993 | 深信服 | 2022-0 4-21 | 946,72 0.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,143. 83 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 210001 2205 | 虹软科技 | 2022-0 4-21 | 75,66 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 97.13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 210001 3335 | 美亚柏科 | 2022-0 4-21 | 143,40 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 173.25 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 220000 0943 | 美亚柏科 | 2022-0 4-22 | 115,74 9.00 | 8,100 | 14 | 3.40% | 148.59 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 220001 3254 | 美亚柏科 | 2022-0 4-22 | 98,60 1.00 | 6,900 | 14 | 3.40% | 126.57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 220001 3256 | 易华录 | 2022-0 4-22 | 121,87 8.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 156.46 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 220001 6846 | 网宿科技 | 2022-0 4-22 | 208,37 7.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 267.49 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|----------------|-------------|----|-------|--------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 202204 250000 5117 | 美亚柏科 | 2022-0 4-25 | 72,49 0.00 | 5,500 | 14 | 3.40% | 93.06 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 250000 5413 | 美亚柏科 | 2022-0 4-25 | 28,99 6.00 | 2,200 | 14 | 3.40% | 37.22 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 260000 1303 | 万达信息 | 2022-0 4-26 | 73,65 6.00 | 9,900 | 14 | 3.40% | 94.55 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 260000 7337 | 迪普科技 | 2022-0 4-26 | 175,14 0.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 211.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 260000 7925 | 安恒信息 | 2022-0 4-26 | 283,05 0.00 | 2,500 | 14 | 3.40% | 363.36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 260000 8125 | 拉卡拉 | 2022-0 4-26 | 20,52 0.00 | 1,200 | 14 | 3.40% | 26.34 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270000 0665 | 美亚柏科 | 2022-0 4-27 | 32,67 6.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 41.94 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270001 0079 | 网宿科技 | 2022-0 4-27 | 521,20 4.00 | 113,80 0 | 14 | 3.40% | 669.08 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270001 0083 | 美亚柏科 | 2022-0 4-27 | 17,50 5.00 | 1,500 | 14 | 3.40% | 22.48 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270001 0085 | 美亚柏科 | 2022-0 4-27 | 38,51 1.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 49.44 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270001 0087 | 美亚柏科 | 2022-0 4-27 | 47,84 7.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 61.42 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 270001 0093 | 深信服 | 2022-0 4-27 | 86,77 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 111.39 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 280000 1319 | 虹软科技 | 2022-0 4-28 | 656,67 6.00 | 30,600 | 14 | 3.40% | 842.98 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202204 280000 1328 | 万达信息 | 2022-0 4-28 | 39,46 8.00 | 5,200 | 14 | 3.40% | 50.67 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|----------------|-------------|----|-------|--------|---|---|--|
| 司 | | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 280000 1336 | 易华录 | 2022-0 4-28 | 32,44 8.00 | 2,400 | 14 | 3.40% | 41.65 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 280000 7446 | 深信服 | 2022-0 4-28 | 110,21 4.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 141.49 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 280000 8158 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-28 | 64,29 6.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 82.53 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 290000 0936 | 易华录 | 2022-0 4-29 | 109,72 5.00 | 7,500 | 14 | 3.40% | 140.85 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 290000 0938 | 网宿科 技 | 2022-0 4-29 | 252,00 0.00 | 52,500 | 14 | 3.40% | 323.49 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202204 290000 5036 | 美亚柏 科 | 2022-0 4-29 | 26,18 0.00 | 2,200 | 14 | 3.40% | 33.61 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050000 1414 | 拉卡拉 | 2022-0 5-05 | 165,80 7.00 | 8,900 | 14 | 3.40% | 212.84 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050000 1416 | 金山办 公 | 2022-0 5-05 | 674,48 5.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 865.84 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050005 5451 | 网宿科 技 | 2022-0 5-05 | 732,71 1.00 | 151,70 0 | 14 | 3.40% | 940.59 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050005 5465 | 虹软科 技 | 2022-0 5-05 | 21,95 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 28.17 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050005 5467 | 虹软科 技 | 2022-0 5-05 | 65,85 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 84.53 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050005 5469 | 易华录 | 2022-0 5-05 | 23,53 6.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 30.21 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 050005 5471 | 易华录 | 2022-0 5-05 | 173,57 8.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 222.83 | - | - | |
| 中信证 券股份 | 202205 050005 | 易华录 | 2022-0 5-05 | 111,79 6.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 143.51 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|--------------|---------|----|-------|----------|---|---|
| 有限公司 | 5473 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060963 | 卫宁健康 | 2022-05-05 | 1,173,050.00 | 145,000 | 14 | 3.20% | 1,417.28 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060965 | 光环新网 | 2022-05-05 | 899,470.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,086.74 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060967 | 光环新网 | 2022-05-05 | 1,004,328.00 | 104,400 | 14 | 3.20% | 1,213.43 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060969 | 卫宁健康 | 2022-05-05 | 1,050,082.00 | 129,800 | 14 | 3.20% | 1,268.71 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060971 | 美亚柏科 | 2022-05-05 | 515,312.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 622.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060973 | 美亚柏科 | 2022-05-05 | 574,308.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 693.87 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060975 | 易华录 | 2022-05-05 | 444,242.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 536.73 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060977 | 易华录 | 2022-05-05 | 497,198.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 600.72 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060979 | 深信服 | 2022-05-05 | 1,447,540.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 1,748.91 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060981 | 虹软科技 | 2022-05-05 | 375,345.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 453.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060983 | 安恒信息 | 2022-05-05 | 469,950.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 567.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060985 | 金山办公 | 2022-05-05 | 2,717,211.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,282.93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050500060987 | 虹软科技 | 2022-05-05 | 340,225.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 411.06 | - | - |
| 中信证 | 202205 | 安恒信 | 2022-0 | 433,80 | 3,600 | 14 | 3.20% | 524.12 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|--|
| 券股份有限公司 | 050006 0989 | 息 | 5-05 | 0.00 | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1807 | 迪普科技 | 2022-0 5-05 | 204,23 2.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 246.76 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1809 | 迪普科技 | 2022-0 5-05 | 225,07 2.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 271.93 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1811 | 深信服 | 2022-0 5-05 | 1,613, 500.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 1,949. 43 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1823 | 同花顺 | 2022-0 5-05 | 1,468, 091.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 1,773. 75 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1825 | 万达信息 | 2022-0 5-05 | 736,20 0.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 889.48 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1827 | 同花顺 | 2022-0 5-05 | 1,322, 093.00 | 16,300 | 14 | 3.20% | 1,597. 35 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1829 | 网宿科技 | 2022-0 5-05 | 894,99 9.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,081. 34 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1831 | 万达信息 | 2022-0 5-05 | 821,27 2.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 992.26 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 1833 | 网宿科技 | 2022-0 5-05 | 999,81 0.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,207. 97 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050006 8493 | 易华录 | 2022-0 5-05 | 48,54 3.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 62.31 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050007 0617 | 深信服 | 2022-0 5-05 | 894,34 0.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,080. 54 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 050007 0619 | 美亚柏科 | 2022-0 5-05 | 120,40 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 145.47 | - | - | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 060000 1074 | 拉卡拉 | 2022-0 5-06 | 943,48 8.00 | 50,400 | 14 | 3.40% | 1,211. 16 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|------------------|------|------------|------------|---------|----|-------|--------|---|---|
| 中信证券股份有限公司 | 2022050600016935 | 网宿科技 | 2022-05-06 | 198,924.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | 255.36 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050600017925 | 美亚柏科 | 2022-05-06 | 83,352.00 | 6,900 | 14 | 3.40% | 107.00 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050600017927 | 美亚柏科 | 2022-05-06 | 97,848.00 | 8,100 | 14 | 3.40% | 125.61 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050600017929 | 易华录 | 2022-05-06 | 109,520.00 | 7,400 | 14 | 3.40% | 140.59 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050900001493 | 易华录 | 2022-05-09 | 52,675.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 67.62 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050900008745 | 美亚柏科 | 2022-05-09 | 26,620.00 | 2,200 | 14 | 3.40% | 34.17 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022050900008747 | 美亚柏科 | 2022-05-09 | 66,550.00 | 5,500 | 14 | 3.40% | 85.43 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051000000921 | 卫宁健康 | 2022-05-10 | 57,528.00 | 6,800 | 14 | 3.40% | 73.84 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051000000927 | 网宿科技 | 2022-05-10 | 14,587.00 | 2,900 | 14 | 3.40% | 18.73 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051000013369 | 安恒信息 | 2022-05-10 | 301,425.00 | 2,500 | 14 | 3.40% | 386.94 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051000013877 | 迪普科技 | 2022-05-10 | 189,000.00 | 9,000 | 14 | 3.20% | 228.35 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051000014451 | 万达信息 | 2022-05-10 | 82,962.00 | 9,900 | 14 | 3.40% | 106.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051100000508 | 卫宁健康 | 2022-05-11 | 116,340.00 | 14,000 | 14 | 3.40% | 149.35 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 2022051100010776 | 网宿科技 | 2022-05-11 | 574,690.00 | 113,800 | 14 | 3.40% | 737.74 | - | - |

| | | | | | | | | | | | |
|------------------------|--------------------------|----------|----------------|----------------|--------|----|-------|--------|---|---|--|
| 司 | | | | | | | | | | | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 110001 1168 | 美亚柏 科 | 2022-0 5-11 | 40,35 9.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 51.81 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 110001 1170 | 美亚柏 科 | 2022-0 5-11 | 34,24 4.00 | 2,800 | 14 | 3.40% | 43.96 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 110001 1172 | 美亚柏 科 | 2022-0 5-11 | 18,34 5.00 | 1,500 | 14 | 3.40% | 23.55 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 110001 1174 | 美亚柏 科 | 2022-0 5-11 | 50,14 3.00 | 4,100 | 14 | 3.40% | 64.37 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 110001 1182 | 深信服 | 2022-0 5-11 | 88,57 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 113.70 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 0784 | 卫宁健 康 | 2022-0 5-12 | 121,65 5.00 | 14,500 | 14 | 3.40% | 156.16 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 0788 | 拉卡拉 | 2022-0 5-12 | 26,46 0.00 | 1,400 | 14 | 3.40% | 33.97 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 7186 | 易华录 | 2022-0 5-12 | 36,76 8.00 | 2,400 | 14 | 3.40% | 47.20 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 7188 | 深信服 | 2022-0 5-12 | 116,22 0.00 | 1,300 | 14 | 3.40% | 149.19 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 7190 | 虹软科 技 | 2022-0 5-12 | 705,02 4.00 | 30,600 | 14 | 3.40% | 905.05 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 8046 | 美亚柏 科 | 2022-0 5-12 | 72,90 3.00 | 5,700 | 14 | 3.40% | 93.58 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 120000 8048 | 万达信 息 | 2022-0 5-12 | 44,04 4.00 | 5,200 | 14 | 3.40% | 56.54 | - | - | |
| 中信证 券股份 有限公 司 | 202205 130000 4542 | 易华录 | 2022-0 5-13 | 114,75 0.00 | 7,500 | 14 | 3.40% | 147.31 | - | - | |
| 中信证 券股份 | 202205 130000 | 网宿科 技 | 2022-0 5-13 | 272,47 5.00 | 52,500 | 14 | 3.40% | 349.78 | - | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|---|---|
| 有限公司 | 5466 | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 160000 0718 | 美亚柏科 | 2022-0 5-16 | 67,84 0.00 | 5,300 | 14 | 3.40% | 87.09 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9119 | 光环新网 | 2022-0 5-19 | 903,21 0.00 | 93,500 | 14 | 3.20% | 1,091. 25 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9137 | 深信服 | 2022-0 5-19 | 845,16 1.00 | 9,700 | 14 | 3.20% | 1,021. 13 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9143 | 深信服 | 2022-0 5-19 | 1,524, 775.00 | 17,500 | 14 | 3.20% | 1,842. 23 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9149 | 深信服 | 2022-0 5-19 | 1,367, 941.00 | 15,700 | 14 | 3.20% | 1,652. 75 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9205 | 迪普科技 | 2022-0 5-19 | 206,97 6.00 | 9,800 | 14 | 3.20% | 250.07 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9207 | 迪普科技 | 2022-0 5-19 | 228,09 6.00 | 10,800 | 14 | 3.20% | 275.58 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9279 | 虹软科技 | 2022-0 5-19 | 71,52 0.00 | 3,000 | 14 | 3.40% | 91.82 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9281 | 虹软科技 | 2022-0 5-19 | 23,84 0.00 | 1,000 | 14 | 3.40% | 30.60 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9283 | 安恒信息 | 2022-0 5-19 | 445,17 6.00 | 3,600 | 14 | 3.20% | 537.86 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9287 | 虹软科技 | 2022-0 5-19 | 407,66 4.00 | 17,100 | 14 | 3.20% | 492.54 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190003 9289 | 金山办公 | 2022-0 5-19 | 726,60 0.00 | 3,500 | 14 | 3.40% | 932.75 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0799 | 同花顺 | 2022-0 5-19 | 1,474, 969.00 | 18,100 | 14 | 3.20% | 1,782. 06 | - | - |
| 中信证 | 202205 | 同花顺 | 2022-0 | 1,328, | 16,300 | 14 | 3.20% | 1,604. | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|---|---|
| 券股份有限公司 | 190004 0803 | | 5-19 | 287.00 | | | | 84 | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0877 | 万达信息 | 2022-0 5-19 | 844,36 4.00 | 100,40 0 | 14 | 3.20% | 1,020. 16 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0879 | 万达信息 | 2022-0 5-19 | 756,90 0.00 | 90,000 | 14 | 3.20% | 914.49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0885 | 美亚柏科 | 2022-0 5-19 | 545,27 2.00 | 42,800 | 14 | 3.20% | 658.80 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0889 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 24,59 2.00 | 1,600 | 14 | 3.40% | 31.57 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0893 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 464,17 4.00 | 30,200 | 14 | 3.20% | 560.82 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0897 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 519,50 6.00 | 33,800 | 14 | 3.20% | 627.67 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0901 | 卫宁健康 | 2022-0 5-19 | 1,073, 446.00 | 129,80 0 | 14 | 3.20% | 1,296. 93 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0907 | 卫宁健康 | 2022-0 5-19 | 1,199, 150.00 | 145,00 0 | 14 | 3.20% | 1,448. 82 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 0947 | 光环新网 | 2022-0 5-19 | 1,008, 504.00 | 104,40 0 | 14 | 3.20% | 1,218. 48 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 4573 | 拉卡拉 | 2022-0 5-19 | 166,34 1.00 | 8,900 | 14 | 3.40% | 213.53 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 5507 | 网宿科技 | 2022-0 5-19 | 776,70 4.00 | 151,70 0 | 14 | 3.40% | 997.07 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 5511 | 网宿科技 | 2022-0 5-19 | 1,059, 840.00 | 207,00 0 | 14 | 3.20% | 1,280. 49 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 5515 | 网宿科技 | 2022-0 5-19 | 948,73 6.00 | 185,30 0 | 14 | 3.20% | 1,146. 26 | - | - |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|--------|----|-------|--------------|------------------|--------------|
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 6837 | 安恒信息 | 2022-0 5-19 | 482,27 4.00 | 3,900 | 14 | 3.20% | 582.68 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 6839 | 虹软科技 | 2022-0 5-19 | 369,52 0.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 446.46 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 6843 | 金山办公 | 2022-0 5-19 | 2,927, 160.00 | 14,100 | 14 | 3.20% | 3,536. 59 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 8769 | 美亚柏科 | 2022-0 5-19 | 127,40 0.00 | 10,000 | 14 | 3.20% | 153.92 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 8771 | 美亚柏科 | 2022-0 5-19 | 607,69 8.00 | 47,700 | 14 | 3.20% | 734.22 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 8775 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 116,81 2.00 | 7,600 | 14 | 3.40% | 149.95 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 8781 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 50,72 1.00 | 3,300 | 14 | 3.40% | 65.11 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202205 190004 8783 | 易华录 | 2022-0 5-19 | 181,36 6.00 | 11,800 | 14 | 3.40% | 232.83 | - | - |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1798 | 拉卡拉 | 2022-0 6-22 | 325,74 0.00 | 17,800 | 14 | 3.20% | 224.93 | 339,26 8.00 | 231.68 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1800 | 迪普科技 | 2022-0 6-22 | 138,00 0.00 | 9,200 | 14 | 3.20% | 95.30 | 148,58 0.00 | 98.16 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1806 | 卫宁健康 | 2022-0 6-22 | 731,88 0.00 | 85,500 | 14 | 3.20% | 505.32 | 750,69 0.00 | 520.48 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1807 | 中科创达 | 2022-0 6-22 | 1,984, 000.00 | 15,500 | 14 | 3.20% | 1,369. 79 | 2,022, 440.00 | 1,410.8 8 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1812 | 易华录 | 2022-0 6-22 | 332,83 8.00 | 19,800 | 14 | 3.20% | 229.83 | 344,52 0.00 | 236.72 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1814 | 万达信息 | 2022-0 6-22 | 530,41 0.00 | 59,000 | 14 | 3.20% | 366.21 | 556,96 0.00 | 377.20 |

| | | | | | | | | | | |
|------------|--------------------------|------|----------------|------------------|-------------|----|-------|--------------|------------------|--------------|
| 司 | | | | | | | | | | |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1816 | 深信服 | 2022-0 6-22 | 1,251, 306.00 | 12,600 | 14 | 3.20% | 863.92 | 1,307, 628.00 | 889.84 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1818 | 光环新网 | 2022-0 6-22 | 653,32 8.00 | 62,400 | 14 | 3.20% | 451.03 | 650,20 8.00 | 464.56 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1827 | 安恒信息 | 2022-0 6-22 | 316,94 0.00 | 2,300 | 14 | 3.20% | 218.80 | 339,61 8.00 | 225.36 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1830 | 润和软件 | 2022-0 6-22 | 601,37 0.00 | 35,500 | 14 | 3.20% | 415.22 | 637,22 5.00 | 427.68 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1834 | 同花顺 | 2022-0 6-22 | 1,011, 364.00 | 10,700 | 14 | 3.20% | 698.25 | 1,028, 805.00 | 719.20 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1836 | 中望软件 | 2022-0 6-22 | 428,77 8.00 | 2,100 | 14 | 3.20% | 296.00 | 439,78 2.00 | 304.88 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1840 | 奇安信 | 2022-0 6-22 | 640,62 2.00 | 12,200 | 14 | 3.20% | 442.25 | 680,76 0.00 | 455.52 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1844 | 虹软科技 | 2022-0 6-22 | 255,02 5.00 | 10,100 | 14 | 3.20% | 176.08 | 319,05 9.00 | 181.36 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1846 | 金山办公 | 2022-0 6-22 | 1,683, 264.00 | 8,800 | 14 | 3.20% | 1,162. 10 | 1,734, 656.00 | 1,196.9 6 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 220000 1848 | 网宿科技 | 2022-0 6-22 | 634,05 7.00 | 121,70 0 | 14 | 3.20% | 437.75 | 652,31 2.00 | 450.88 |
| 中信证券股份有限公司 | 202206 300000 1914 | 虹软科技 | 2022-0 6-30 | 1,298, 349.00 | 41,100 | 14 | 3.40% | - | 1,298, 349.00 | - |

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

| 关联方名称 | 本期末 2023年06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 |
| 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金 | 1,452,853,247.00 | 64.75% | 1,991,717,147.00 | 77.38% |
| 中信证券股份有限公司 | 2,335,243.00 | 0.10% | 2,129,666.00 | 0.08% |

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

| 关联方名称 | 本期 2023年01月01日至2023年06月30日 | | 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | |
|------------|-------------------------------|-----------|------------------------------------|-----------|
| | 期末余额 | 当期利息收入 | 期末余额 | 当期利息收入 |
| 中信证券股份有限公司 | 24,628,208.60 | 79,194.49 | 4,304,531.28 | 41,833.80 |

注：本基金由基金托管人中信证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

| |
|----|
| 本期 |
|----|

| 2023年01月01日至2023年06月30日 | | | | | |
|-------------------------|--------|------|------|------------|------------|
| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
| | | | | 数量（单位：张/股） | 总金额 |
| 中信证券股份有限公司 | 603281 | 江瀚新材 | 网下申购 | 863 | 30,714.17 |
| 中信证券股份有限公司 | 301373 | 凌玮科技 | 网下申购 | 2,764 | 93,229.72 |
| 中信证券股份有限公司 | 688522 | 纳睿雷达 | 网下申购 | 4,299 | 200,677.32 |
| 中信证券股份有限公司 | 301157 | 华塑科技 | 网下申购 | 1,498 | 84,637.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 301439 | 泓淋电力 | 网下申购 | 9,486 | 189,625.14 |
| 中信证券股份有限公司 | 603162 | 海通发展 | 网下申购 | 523 | 19,481.75 |
| 中信证券股份有限公司 | 001367 | 海森药业 | 网下申购 | 549 | 24,419.52 |
| 中信证券股份有限公司 | 601061 | 中信金属 | 网下申购 | 40,154 | 264,213.32 |
| 中信证券股份有限公司 | 001286 | 陕西能源 | 网下申购 | 37,667 | 361,603.20 |
| 中信证券股份有限公司 | 601133 | 柏诚股份 | 网下申购 | 6,632 | 77,329.12 |

| | | | | | |
|------------------------------------|--------|------|------|--------|------------|
| 公司 | | | | | |
| 中信证券 股份有限 公司 | 688539 | 高华科技 | 网下申购 | 5,334 | 203,865.48 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 688146 | 中船特气 | 网下申购 | 10,101 | 365,151.15 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 301293 | 三博脑科 | 网下申购 | 3,324 | 98,390.40 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 001324 | 长青科技 | 网下申购 | 1,131 | 21,353.28 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 688581 | 安杰思 | 网下申购 | 1,629 | 204,928.20 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 688523 | 航天环宇 | 网下申购 | 4,717 | 103,113.62 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 301323 | 新莱福 | 网下申购 | 2,277 | 88,939.62 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 301170 | 锡南科技 | 网下申购 | 2,496 | 84,864.00 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 688631 | 莱斯信息 | 网下申购 | 3,357 | 84,864.96 |
| 中信证券 股份有限 公司 | 301261 | 恒工精密 | 网下申购 | 1,973 | 72,803.70 |
| 上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日 | | | | | |

| 关联方名称 | 证券代码 | 证券名称 | 发行方式 | 基金在承销期内买入 | |
|------------|--------|------|------|------------|------------|
| | | | | 数量（单位：张/股） | 总金额 |
| 中信证券股份有限公司 | 301117 | 佳缘科技 | 网下申购 | 2,616 | 122,428.80 |
| 中信证券股份有限公司 | 301116 | 益客食品 | 网下申购 | 5,764 | 65,709.60 |
| 中信证券股份有限公司 | 688223 | 晶科能源 | 网下申购 | 157,975 | 789,875.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 688171 | 纬德信息 | 网下申购 | 2,821 | 80,906.28 |
| 中信证券股份有限公司 | 603215 | 比依股份 | 网下申购 | 575 | 7,187.50 |
| 中信证券股份有限公司 | 603132 | 金徽股份 | 网下申购 | 1,342 | 14,493.60 |
| 中信证券股份有限公司 | 301200 | 大族数控 | 网下申购 | 8,566 | 655,812.96 |
| 中信证券股份有限公司 | 001266 | 宏英智能 | 网下申购 | 247 | 9,536.67 |
| 中信证券股份有限公司 | 688150 | 莱特光电 | 网下申购 | 5,626 | 124,053.30 |
| 中信证券股份有限公司 | 603209 | 兴通股份 | 网下申购 | 595 | 12,804.40 |

| | | | | | |
|------------|--------|------|------|--------|------------|
| 中信证券股份有限公司 | 603051 | 鹿山新材 | 网下申购 | 272 | 7,014.88 |
| 中信证券股份有限公司 | 301109 | 军信股份 | 网下申购 | 12,250 | 426,422.50 |
| 中信证券股份有限公司 | 600938 | 中国海油 | 网上申购 | 4,000 | 43,200.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 603191 | 望变电气 | 网下申购 | 1,149 | 13,627.14 |
| 中信证券股份有限公司 | 688290 | 景业智能 | 网下申购 | 3,040 | 103,025.60 |
| 中信证券股份有限公司 | 301238 | 瑞泰新材 | 网下申购 | 34,966 | 670,647.88 |
| 中信证券股份有限公司 | 688349 | 三一重能 | 网下申购 | 30,495 | 908,751.00 |
| 中信证券股份有限公司 | 301302 | 华如科技 | 网下申购 | 4,651 | 241,991.53 |
| 中信证券股份有限公司 | 688047 | 龙芯中科 | 网下申购 | 8,345 | 501,200.70 |
| 中信证券股份有限公司 | 301112 | 信邦智能 | 网下申购 | 3,984 | 109,679.52 |
| 中信证券股份有限公司 | 301175 | 中科环保 | 网下申购 | 63,694 | 243,311.08 |

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

金额单位：人民币元

| 6.4.12.1.1 受限证券类别：股票 | | | | | | | | | | |
|----------------------|------|------------|---------|---------|-------|--------|----------|------------|------------|----|
| 证券代码 | 证券名称 | 成功认购日 | 受限期 | 流通受限类型 | 认购价格 | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额 | 期末估值总额 | 备注 |
| 301486 | 致尚科技 | 2023-06-30 | 1个月内（含） | 新股未上市 | 57.66 | 57.66 | 4,820 | 277,921.20 | 277,921.20 | - |
| 301395 | 仁信新材 | 2023-06-21 | 1个月内（含） | 新股未上市 | 26.68 | 26.68 | 5,196 | 138,629.28 | 138,629.28 | - |
| 301292 | 海科新源 | 2023-06-29 | 1个月内（含） | 新股未上市 | 19.99 | 19.99 | 5,824 | 116,421.76 | 116,421.76 | - |
| 688472 | 阿特斯 | 2023-06-02 | 6个月 | 科创板打新限售 | 11.10 | 17.04 | 6,261 | 69,497.10 | 106,687.44 | - |
| 301488 | 豪恩汽电 | 2023-06-26 | 1个月内（含） | 新股未上市 | 39.78 | 39.78 | 2,618 | 104,144.04 | 104,144.04 | - |
| 688443 | 智翔金泰 | 2023-06-13 | 6个月 | 科创板打新限售 | 37.88 | 29.49 | 3,033 | 114,890.04 | 89,443.17 | - |
| 3013 | 湖南 | 2023 | 6个月 | 创业 | 23.77 | 42.89 | 2,023 | 48,08 | 86,76 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-------------|-------------|--------|--------|--------|-----------|-----------|---|
| 58 | 裕能 | -02-01 | | 板打 新限售 | | | | 6.71 | 6.47 | |
| 301202 | 朗威股份 | 2023-06-28 | 1个月内 (含) | 新股 未上市 | 25.82 | 25.82 | 3,060 | 79,009.20 | 79,009.20 | - |
| 688603 | 天承科技 | 2023-06-30 | 1个月内 (含) | 新股 未上市 | 55.00 | 55.00 | 1,391 | 76,505.00 | 76,505.00 | - |
| 688469 | 中芯集成 | 2023-04-28 | 6个月 | 科创板打 新限售 | 5.69 | 5.41 | 13,800 | 78,522.00 | 74,658.00 | - |
| 301260 | 格力博 | 2023-01-20 | 6个月 | 创业板打 新限售 | 30.85 | 23.63 | 3,121 | 96,282.85 | 73,749.23 | - |
| 301261 | 恒工精密 | 2023-06-29 | 1个月内 (含) | 新股 未上市 | 36.90 | 36.90 | 1,973 | 72,803.70 | 72,803.70 | - |
| 688361 | 中科飞测 | 2023-05-12 | 6个月 | 科创板打 新限售 | 23.60 | 64.67 | 831 | 19,611.60 | 53,740.77 | - |
| 688531 | 日联科技 | 2023-03-24 | 6个月 | 科创板打 新限售 | 152.38 | 135.97 | 346 | 52,723.48 | 47,045.62 | - |
| 301325 | 曼恩斯特 | 2023-05-04 | 6个月 | 创业板打 新限售 | 76.80 | 107.95 | 364 | 27,955.20 | 39,293.80 | - |
| 688146 | 中船特气 | 2023-04-1 | 6个月 | 科创板打 | 36.15 | 38.13 | 1,011 | 36,547.65 | 38,549.43 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 3 | | 新限售 | | | | | | |
| 001286 | 陕西能源 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股锁定 | 9.60 | 9.41 | 3,767 | 36,163.20 | 35,447.47 | - |
| 301301 | 川宁生物 | 2022-12-20 | 6个月 | 创业板打新限售 | 5.00 | 8.96 | 3,574 | 17,870.00 | 32,023.04 | - |
| 601061 | 中信金属 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股锁定 | 6.58 | 7.58 | 4,016 | 26,425.28 | 30,441.28 | - |
| 001287 | 中电港 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股锁定 | 11.88 | 21.02 | 1,386 | 16,465.68 | 29,133.72 | - |
| 688576 | 西山科技 | 2023-05-30 | 6个月 | 科创板打新限售 | 135.80 | 120.41 | 240 | 32,592.00 | 28,898.40 | - |
| 688352 | 颀中科技 | 2023-04-11 | 6个月 | 科创板打新限售 | 12.10 | 12.07 | 2,361 | 28,568.10 | 28,497.27 | - |
| 688507 | 索辰科技 | 2023-04-10 | 6个月 | 科创板打新限售 | 245.56 | 122.11 | 222 | 36,834.00 | 27,108.42 | - |
| 688582 | N芯动 | 2023-06-21 | 6个月 | 科创板打新限售 | 26.74 | 40.68 | 648 | 17,327.52 | 26,360.64 | - |
| 301293 | 三博脑科 | 2023-04-25 | 6个月 | 创业板打新限售 | 29.60 | 71.42 | 333 | 9,856.80 | 23,782.86 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|--------|--------|-------|-----------|-----------|---|
| 301303 | 真兰仪表 | 2023-02-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 26.80 | 22.32 | 1,058 | 28,354.40 | 23,614.56 | - |
| 688552 | 航天南湖 | 2023-05-08 | 6个月 | 科创板打新限售 | 21.17 | 23.50 | 956 | 20,238.52 | 22,466.00 | - |
| 688570 | 天玛智控 | 2023-05-29 | 6个月 | 科创板打新限售 | 30.26 | 25.33 | 884 | 26,749.84 | 22,391.72 | - |
| 301307 | 美利信 | 2023-04-14 | 6个月 | 创业板打新限售 | 32.34 | 31.86 | 687 | 22,217.58 | 21,887.82 | - |
| 688543 | 国科军工 | 2023-06-14 | 6个月 | 科创板打新限售 | 43.67 | 53.05 | 410 | 17,904.70 | 21,750.50 | - |
| 301322 | 绿通科技 | 2023-02-27 | 6个月 | 创业板打新限售 | 131.11 | 53.24 | 392 | 34,219.71 | 20,870.08 | - |
| 688458 | 美芯晟 | 2023-05-15 | 6个月 | 科创板打新限售 | 75.00 | 90.76 | 221 | 16,575.00 | 20,057.96 | - |
| 688581 | 安杰思 | 2023-05-12 | 6个月 | 科创板打新限售 | 125.80 | 118.03 | 163 | 20,505.40 | 19,238.89 | - |
| 301317 | 鑫磊股份 | 2023-01-1 | 6个月 | 创业板打 | 20.67 | 26.17 | 694 | 14,344.98 | 18,161.98 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|--------|-------|-------|-----------|-----------|---|--|
| | | 2 | | 新限售 | | | | | | | |
| 301262 | 海看股份 | 2023-06-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 30.22 | 25.50 | 692 | 20,912.24 | 17,646.00 | - | |
| 688478 | 晶升股份 | 2023-04-13 | 6个月 | 科创板打新限售 | 32.52 | 42.37 | 402 | 13,073.04 | 17,032.74 | - | |
| 688562 | 航天软件 | 2023-05-15 | 6个月 | 科创板打新限售 | 12.68 | 22.31 | 726 | 9,205.68 | 16,197.06 | - | |
| 301439 | 泓淋电力 | 2023-03-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 19.99 | 16.90 | 949 | 18,970.51 | 16,038.10 | - | |
| 688623 | 双元科技 | 2023-05-31 | 6个月 | 科创板打新限售 | 125.88 | 86.79 | 178 | 22,406.64 | 15,448.62 | - | |
| 301332 | 德尔玛 | 2023-05-09 | 6个月 | 创业板打新限售 | 14.81 | 13.73 | 1,122 | 16,616.82 | 15,405.06 | - | |
| 301399 | 英特科技 | 2023-05-16 | 6个月 | 创业板打新限售 | 43.99 | 51.57 | 293 | 12,889.07 | 15,110.01 | - | |
| 301408 | 华人健康 | 2023-02-22 | 6个月 | 创业板打新限售 | 16.24 | 16.95 | 879 | 14,274.96 | 14,899.05 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 301305 | 朗坤环境 | 2023-05-15 | 6个月 | 创业板打新限售 | 25.25 | 19.69 | 753 | 19,013.25 | 14,826.57 | - |
| 301397 | C溯联 | 2023-06-15 | 6个月 | 创业板打新限售 | 53.27 | 40.20 | 362 | 19,283.74 | 14,552.40 | - |
| 301419 | 阿莱德 | 2023-02-02 | 6个月 | 创业板打新限售 | 24.80 | 43.85 | 330 | 8,184.00 | 14,470.50 | - |
| 688334 | 西高院 | 2023-06-09 | 6个月 | 科创板打新限售 | 14.16 | 16.21 | 888 | 12,574.08 | 14,394.48 | - |
| 688593 | 新相微 | 2023-05-25 | 6个月 | 科创板打新限售 | 11.18 | 14.59 | 959 | 10,721.62 | 13,991.81 | - |
| 301210 | N金杨 | 2023-06-21 | 6个月 | 创业板打新限售 | 57.88 | 49.17 | 281 | 16,264.28 | 13,816.77 | - |
| 688512 | 慧智微 | 2023-05-08 | 6个月 | 科创板打新限售 | 20.92 | 19.16 | 721 | 15,083.32 | 13,814.36 | - |
| 301382 | 蜂助手 | 2023-05-09 | 6个月 | 创业板打新限售 | 23.80 | 32.84 | 408 | 9,710.40 | 13,398.72 | - |
| 301320 | 豪江智能 | 2023-06-0 | 6个月 | 创业板打 | 13.06 | 20.62 | 642 | 8,384.52 | 13,238.04 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-------|-----------|-----------|---|
| | | 1 | | 新限售 | | | | | | |
| 688433 | 华曙高科 | 2023-04-07 | 6个月 | 科创板打新限售 | 26.66 | 31.50 | 418 | 11,143.88 | 13,167.00 | - |
| 688629 | C华丰 | 2023-06-16 | 6个月 | 科创板打新限售 | 9.26 | 18.59 | 708 | 6,556.08 | 13,161.72 | - |
| 688620 | C安凯微 | 2023-06-15 | 6个月 | 科创板打新限售 | 10.68 | 12.34 | 1,016 | 10,850.88 | 12,537.44 | - |
| 301360 | 荣旗科技 | 2023-04-17 | 6个月 | 创业板打新限售 | 71.88 | 92.60 | 134 | 9,631.92 | 12,408.40 | - |
| 301345 | 涛涛车业 | 2023-03-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 73.45 | 46.64 | 266 | 19,537.70 | 12,406.24 | - |
| 301315 | 威士顿 | 2023-06-13 | 6个月 | 创业板打新限售 | 32.29 | 51.12 | 226 | 7,297.54 | 11,553.12 | - |
| 688523 | 航天环宇 | 2023-05-26 | 6个月 | 科创板打新限售 | 21.86 | 23.85 | 472 | 10,317.92 | 11,257.20 | - |
| 603135 | 中重科技 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股锁定 | 17.80 | 17.89 | 628 | 11,178.40 | 11,234.92 | - |
| 3012 | 恒勃 | 2023 | 6个月 | 创业 | 35.66 | 33.26 | 333 | 11,87 | 11,07 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|-----------|-----------|---|
| 25 | 股份 | -06-08 | | 板打新限售 | | | | 4.78 | 5.58 | |
| 301429 | 森泰股份 | 2023-04-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 28.75 | 21.02 | 499 | 14,346.25 | 10,488.98 | - |
| 601065 | 江盐集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股锁定 | 10.36 | 11.84 | 875 | 9,065.00 | 10,360.00 | - |
| 688631 | C莱斯 | 2023-06-19 | 6个月 | 科创板打新限售 | 25.28 | 29.87 | 336 | 8,494.08 | 10,036.32 | - |
| 688479 | 友车科技 | 2023-05-04 | 6个月 | 科创板打新限售 | 33.99 | 29.49 | 332 | 11,284.68 | 9,790.68 | - |
| 301232 | 飞沃科技 | 2023-06-08 | 6个月 | 创业板打新限售 | 72.50 | 58.42 | 165 | 11,962.50 | 9,639.30 | - |
| 301376 | 致欧科技 | 2023-06-14 | 6个月 | 创业板打新限售 | 24.66 | 22.51 | 420 | 10,357.20 | 9,454.20 | - |
| 301355 | 南王科技 | 2023-06-02 | 6个月 | 创业板打新限售 | 17.55 | 16.75 | 563 | 9,880.65 | 9,430.25 | - |
| 301357 | 北方长龙 | 2023-04-11 | 6个月 | 创业板打新限售 | 50.00 | 48.39 | 190 | 9,500.00 | 9,194.10 | - |

| | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|-----------|----------|---|
| 301386 | 未来电器 | 2023-03-21 | 6个月 | 创业板打新限售 | 29.99 | 23.79 | 378 | 11,336.22 | 8,992.62 | - |
| 301323 | 新莱福 | 2023-05-29 | 6个月 | 创业板打新限售 | 39.06 | 39.36 | 228 | 8,905.68 | 8,974.08 | - |
| 688429 | C时创 | 2023-06-20 | 6个月 | 科创板打新限售 | 19.20 | 25.53 | 346 | 6,643.20 | 8,833.38 | - |
| 301373 | 凌玮科技 | 2023-01-20 | 6个月 | 创业板打新限售 | 33.73 | 31.85 | 277 | 9,343.21 | 8,822.45 | - |
| 301170 | C锡南 | 2023-06-16 | 6个月 | 创业板打新限售 | 34.00 | 34.93 | 250 | 8,500.00 | 8,732.50 | - |
| 301281 | 科源制药 | 2023-03-28 | 6个月 | 创业板打新限售 | 44.18 | 25.10 | 337 | 10,647.38 | 8,458.70 | - |
| 688535 | 华海诚科 | 2023-03-28 | 6个月 | 科创板打新限售 | 35.00 | 51.23 | 161 | 5,635.00 | 8,248.03 | - |
| 601133 | 柏诚股份 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股锁定 | 11.66 | 12.26 | 664 | 7,742.24 | 8,140.64 | - |
| 301157 | 华塑科技 | 2023-03-01 | 6个月 | 创业板打新限售 | 56.50 | 52.93 | 150 | 8,475.00 | 7,939.50 | - |

| | | | | | | | | | | | |
|--------|------|------------|-----|---------|-------|-------|-----|----------|----------|---|--|
| | | | | 售 | | | | | | | |
| 301295 | C美硕 | 2023-06-19 | 6个月 | 创业板打新限售 | 37.40 | 36.07 | 215 | 8,041.00 | 7,755.05 | - | |
| 300804 | C广康 | 2023-06-15 | 6个月 | 创业板打新限售 | 42.45 | 32.97 | 226 | 9,593.70 | 7,451.22 | - | |
| 301337 | 亚华电子 | 2023-05-16 | 6个月 | 创业板打新限售 | 32.60 | 30.37 | 232 | 7,563.20 | 7,045.84 | - | |
| 301428 | 世纪恒通 | 2023-05-10 | 6个月 | 创业板打新限售 | 26.35 | 30.60 | 229 | 6,034.15 | 7,007.40 | - | |
| 001380 | 华纬科技 | 2023-05-09 | 6个月 | 新股锁定 | 28.84 | 30.78 | 170 | 4,902.80 | 5,232.60 | - | |
| 603125 | 常青科技 | 2023-03-30 | 6个月 | 新股锁定 | 25.98 | 24.53 | 160 | 4,156.80 | 3,924.80 | - | |
| 001328 | 登康口腔 | 2023-03-29 | 6个月 | 新股锁定 | 20.68 | 25.49 | 145 | 2,998.60 | 3,696.05 | - | |
| 001282 | 三联锻造 | 2023-05-15 | 6个月 | 新股锁定 | 27.93 | 33.03 | 105 | 2,932.65 | 3,468.15 | - | |
| 001360 | 南矿集团 | 2023-03-31 | 6个月 | 新股锁定 | 15.38 | 14.87 | 177 | 2,722.26 | 2,631.99 | - | |
| 603137 | 恒尚节能 | 2023-04-10 | 6个月 | 新股锁定 | 15.90 | 17.09 | 139 | 2,210.10 | 2,375.51 | - | |

| | | | | | | | | | | |
|------------|----------|--------------------|-----|----------|-------|-------|-----|--------------|--------------|---|
| 0013 24 | 长青 科技 | 2023 -05-1 2 | 6个月 | 新股 锁定 | 18.88 | 19.60 | 114 | 2,15 2.32 | 2,23 4.40 | - |
| 0013 67 | 海森 药业 | 2023 -03-3 0 | 6个月 | 新股 锁定 | 44.48 | 39.48 | 55 | 2,44 6.40 | 2,17 1.40 | - |
| 6031 72 | 万丰 股份 | 2023 -04-2 8 | 6个月 | 新股 锁定 | 14.58 | 16.13 | 122 | 1,77 8.76 | 1,96 7.86 | - |

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

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

4、创业板新股致尚科技（证券代码：301486）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中482股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

5、创业板新股仁信新材（证券代码：301395）于2023年07月03日起上市流通，本基金获配的股数中520股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月03日。

6、创业板新股海科新源（证券代码：301292）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中583股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

7、创业板新股豪恩汽电（证券代码：301488）于2023年07月04日起上市流通，本基金获配的股数中262股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月04日。

8、创业板新股朗威股份（证券代码：301202）于2023年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中306股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月05日。

9、科创板新股天承科技（证券代码：688603）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中140股根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

10、创业板新股恒工精密（证券代码：301261）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中198股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

| 序号 | 证券代码 | 证券名称 | 出借到期日 | 期末估值 单价 | 数量（单 位：股） | 期末估值 总额 |
|----|--------|------|-----------------------------|------------|--------------|-------------------|
| 1 | 000021 | 深科技 | 2023年07月06日- 2023年07月13日 | 19.99 | 233,300 | 4,663,667. 00 |
| 2 | 000066 | 中国长城 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 13.83 | 159,900 | 2,211,417. 00 |
| 3 | 000938 | 紫光股份 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 31.85 | 192,900 | 6,143,865. 00 |
| 4 | 000977 | 浪潮信息 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 48.50 | 285,400 | 13,841,90 0.00 |
| 5 | 000997 | 新大陆 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 18.90 | 68,100 | 1,287,090. 00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|-----------------------------|--------|---------|-------------------|
| 6 | 002065 | 东华软件 | 2023年07月12日- 2023年07月13日 | 7.06 | 641,900 | 4,531,814. 00 |
| 7 | 002139 | 拓邦股份 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 13.05 | 174,500 | 2,277,225. 00 |
| 8 | 002152 | 广电运通 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 11.72 | 102,600 | 1,202,472. 00 |
| 9 | 002153 | 石基信息 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 14.00 | 51,900 | 726,600.00 |
| 10 | 002180 | 纳思达 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 34.25 | 81,300 | 2,784,525. 00 |
| 11 | 002230 | 科大讯飞 | 2023年07月04日- 2023年07月14日 | 67.96 | 651,700 | 44,289,53 2.00 |
| 12 | 002236 | 大华股份 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 19.75 | 193,300 | 3,817,675. 00 |
| 13 | 002335 | 科华数据 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 35.95 | 26,700 | 959,865.00 |
| 14 | 002368 | 太极股份 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 41.17 | 41,000 | 1,687,970. 00 |
| 15 | 002373 | 千方科技 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 13.64 | 91,200 | 1,243,968. 00 |
| 16 | 002402 | 和而泰 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 16.98 | 76,500 | 1,298,970. 00 |
| 17 | 002405 | 四维图新 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 11.58 | 226,600 | 2,624,028. 00 |
| 18 | 002410 | 广联达 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 32.49 | 110,100 | 3,577,149. 00 |
| 19 | 002415 | 海康威视 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 33.11 | 258,000 | 8,542,380. 00 |
| 20 | 002439 | 启明星辰 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 29.76 | 54,900 | 1,633,824. 00 |
| 21 | 300033 | 同花顺 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 175.28 | 17,700 | 3,102,456. 00 |
| 22 | 300253 | 卫宁健康 | 2023年07月12日- | 10.82 | 155,300 | 1,680,346. |

| | | | | | | |
|----|--------|------|-----------------------------|--------|---------|------------------|
| | | | 2023年07月13日 | | | 00 |
| 23 | 300339 | 润和软件 | 2023年07月12日- 2023年07月13日 | 23.96 | 196,200 | 4,700,952. 00 |
| 24 | 300383 | 光环新网 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 10.75 | 118,800 | 1,277,100. 00 |
| 25 | 300454 | 深信服 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 113.25 | 20,400 | 2,310,300. 00 |
| 26 | 300496 | 中科创达 | 2023年07月12日- 2023年07月13日 | 96.35 | 29,500 | 2,842,325. 00 |
| 27 | 300682 | 朗新科技 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 23.28 | 54,000 | 1,257,120. 00 |
| 28 | 300803 | 指南针 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 48.59 | 31,700 | 1,540,303. 00 |
| 29 | 301236 | 软通动力 | 2023年07月05日- 2023年07月13日 | 27.21 | 124,900 | 3,398,529. 00 |
| 30 | 301308 | 江波龙 | 2023年07月14日- 2023年07月14日 | 101.76 | 10,100 | 1,027,776. 00 |
| 31 | 600100 | 同方股份 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 8.12 | 833,100 | 6,764,772. 00 |
| 32 | 600131 | 国网信通 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 20.19 | 38,700 | 781,353.00 |
| 33 | 600225 | 卓朗科技 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 6.13 | 603,500 | 3,699,455. 00 |
| 34 | 600271 | 航天信息 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 13.69 | 89,700 | 1,227,993. 00 |
| 35 | 600536 | 中国软件 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 46.88 | 48,300 | 2,264,304. 00 |
| 36 | 600570 | 恒生电子 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 44.29 | 122,700 | 5,434,383. 00 |
| 37 | 600588 | 用友网络 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 20.50 | 166,200 | 3,407,100. 00 |
| 38 | 600845 | 宝信软件 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 50.81 | 57,600 | 2,926,656. 00 |

| | | | | | | |
|----|--------|------|-----------------------------|--------|-----------|--------------------|
| 39 | 601360 | 三六零 | 2023年07月12日- 2023年07月14日 | 12.54 | 1,087,300 | 13,634,74 2.00 |
| 40 | 603019 | 中科曙光 | 2023年07月03日- 2023年07月14日 | 50.90 | 414,500 | 21,098,05 0.00 |
| 41 | 603927 | 中科软 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 38.56 | 28,500 | 1,098,960. 00 |
| 42 | 688066 | 航天宏图 | 2023年07月11日- 2023年07月13日 | 60.90 | 26,700 | 1,626,030. 00 |
| 43 | 688083 | 中望软件 | 2023年07月12日- 2023年07月13日 | 144.89 | 23,300 | 3,375,937. 00 |
| 44 | 688111 | 金山办公 | 2023年07月03日- 2023年07月14日 | 472.22 | 23,900 | 11,286,05 8.00 |
| 45 | 688232 | 新点软件 | 2023年07月04日- 2023年07月12日 | 53.81 | 37,100 | 1,996,351. 00 |
| 46 | 688561 | 奇安信 | 2023年07月12日- 2023年07月12日 | 51.81 | 21,900 | 1,134,639. 00 |
| 47 | 688568 | 中科星图 | 2023年07月11日- 2023年07月12日 | 80.58 | 14,400 | 1,160,352. 00 |
| 合计 | | | | | 8,117,800 | 215,400,27 8.00 |

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部

控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中信证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；

在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及

时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

| 本期末 2023 年 06 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 | 24,628,208.60 | - | - | - | 24,628,208.60 |
| 结算备付金 | 3,522,503.44 | - | - | - | 3,522,503.44 |
| 存出保证金 | 558,186.75 | - | - | - | 558,186.75 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 2,233,873,593.66 | 2,233,873,593.66 |
| 其他资产 | - | - | - | 116,592.91 | 116,592.91 |
| 资产总计 | 28,708,898.79 | - | - | 2,233,990,186.57 | 2,262,699,085.36 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 24,041,681.17 | 24,041,681.17 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 1,072,865.05 | 1,072,865.05 |
| 应付托管费 | - | - | - | 214,573.02 | 214,573.02 |
| 应交税费 | - | - | - | 20,416.98 | 20,416.98 |
| 其他负债 | - | - | - | 1,002,810.55 | 1,002,810.55 |
| 负债总计 | - | - | - | 26,352,346.77 | 26,352,346.77 |
| 利率敏感度缺口 | 28,708,898.79 | - | - | 2,207,637,839.80 | 2,236,346,738.59 |
| 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 | 5,636,861.09 | - | - | - | 5,636,861.09 |
| 结算备付金 | 667,842.54 | - | - | - | 667,842.54 |
| 存出保证金 | 158,236.80 | - | - | - | 158,236.80 |
| 交易性金融资产 | - | - | - | 2,065,006,128.03 | 2,065,006,128.03 |
| 其他资产 | - | - | - | 62,858.83 | 62,858.83 |
| 资产总计 | 6,462,940.43 | - | - | 2,065,068,986.86 | 2,071,531,927.29 |
| 负债 | | | | | |
| 应付清算款 | - | - | - | 4,418,783.58 | 4,418,783.58 |
| 应付管理人报酬 | - | - | - | 885,685.83 | 885,685.83 |

| | | | | | |
|---------|------------------|---|---|----------------------|----------------------|
| 应付托管费 | - | - | - | 177,137.17 | 177,137.17 |
| 应交税费 | - | - | - | 2,311.33 | 2,311.33 |
| 其他负债 | - | - | - | 627,393.18 | 627,393.18 |
| 负债总计 | - | - | - | 6,111,311.09 | 6,111,311.09 |
| 利率敏感度缺口 | 6,462,940.4 3 | - | - | 2,058,957,675. 77 | 2,065,420,616. 20 |

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：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证计算机主题指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

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06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 | 2,233,873,593.66 | 99.89 | 2,065,006,128.03 | 99.98 |

| | | | | |
|---------------|------------------|-------|------------------|-------|
| 产—股票投资 | | | | |
| 交易性金融资产—基金投资 | - | - | - | - |
| 交易性金融资产—贵金属投资 | - | - | - | - |
| 衍生金融资产—权证投资 | - | - | - | - |
| 其他 | - | - | - | - |
| 合计 | 2,233,873,593.66 | 99.89 | 2,065,006,128.03 | 99.98 |

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

| 假设 | 除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变 | | |
|----|----------------------|-----------------------------|---------------------|
| 分析 | 相关风险变量的变动 | 对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元） | |
| | | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
| | 业绩比较基准上升5% | 114,176,682.74 | 103,054,161.65 |
| | 业绩比较基准下降5% | -114,176,682.74 | -103,054,161.65 |

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

金额单位：人民币元

| 公允价值计量结果所属的层次 | 本期末 2023年06月30日 | 上年度末 2022年12月31日 |
|---------------|--------------------|---------------------|
| | | |

| | | |
|------|------------------|------------------|
| 第一层次 | 2,231,370,513.03 | 2,061,455,874.08 |
| 第二层次 | 865,434.18 | - |
| 第三层次 | 1,637,646.45 | 3,550,253.95 |
| 合计 | 2,233,873,593.66 | 2,065,006,128.03 |

6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金总资产的比例(%) |
|----|--------|------------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 2,233,873,593.66 | 98.73 |
| | 其中：股票 | 2,233,873,593.66 | 98.73 |
| 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 | 28,150,712.04 | 1.24 |
| 8 | 其他各项资产 | 674,779.66 | 0.03 |
| 9 | 合计 | 2,262,699,085.36 | 100.00 |

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 215,400,278.00 元，占基金资产净值的比例为 9.63%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|------------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 842,104,956.29 | 37.66 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | - | - |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 1,296,927,297.98 | 57.99 |
| J | 金融业 | 76,040,220.00 | 3.40 |
| K | 房地产业 | 16,024,996.96 | 0.72 |
| 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 | 2,231,097,471.23 | 99.77 |

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

| 代码 | 行业类别 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|------------------|--------------|--------------|
| A | 农、林、牧、渔业 | - | - |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,473,443.09 | 0.11 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 35,447.47 | 0.00 |
| E | 建筑业 | 10,516.15 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 83,928.25 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 119,783.56 | 0.01 |
| J | 金融业 | - | - |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | - | - |
| M | 科学研究和技术服务业 | 14,394.48 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 14,826.57 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 23,782.86 | 0.00 |

| | | | |
|---|-----------|--------------|------|
| R | 文化、体育和娱乐业 | - | - |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 2,776,122.43 | 0.12 |

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|-----------|----------------|--------------|
| 1 | 002415 | 海康威视 | 7,185,376 | 237,907,799.36 | 10.64 |
| 2 | 002230 | 科大讯飞 | 2,849,374 | 193,643,457.04 | 8.66 |
| 3 | 688111 | 金山办公 | 283,170 | 133,718,537.40 | 5.98 |
| 4 | 000938 | 紫光股份 | 3,506,775 | 111,690,783.75 | 4.99 |
| 5 | 600570 | 恒生电子 | 2,329,714 | 103,183,033.06 | 4.61 |
| 6 | 603019 | 中科曙光 | 1,795,167 | 91,374,000.30 | 4.09 |
| 7 | 000977 | 浪潮信息 | 1,582,559 | 76,754,111.50 | 3.43 |
| 8 | 601360 | 三六零 | 5,495,400 | 68,912,316.00 | 3.08 |
| 9 | 002410 | 广联达 | 2,046,771 | 66,499,589.79 | 2.97 |
| 10 | 600588 | 用友网络 | 3,163,250 | 64,846,625.00 | 2.90 |
| 11 | 300033 | 同花顺 | 329,700 | 57,789,816.00 | 2.58 |
| 12 | 600845 | 宝信软件 | 1,103,092 | 56,048,104.52 | 2.51 |
| 13 | 002180 | 纳思达 | 1,519,200 | 52,032,600.00 | 2.33 |
| 14 | 002236 | 大华股份 | 2,552,400 | 50,409,900.00 | 2.25 |
| 15 | 300496 | 中科创达 | 490,898 | 47,298,022.30 | 2.11 |
| 16 | 300454 | 深信服 | 384,900 | 43,589,925.00 | 1.95 |
| 17 | 600536 | 中国软件 | 922,825 | 43,262,036.00 | 1.93 |
| 18 | 002405 | 四维图新 | 3,646,440 | 42,225,775.20 | 1.89 |
| 19 | 000066 | 中国长城 | 2,973,704 | 41,126,326.32 | 1.84 |
| 20 | 002439 | 启明星辰 | 1,025,100 | 30,506,976.00 | 1.36 |
| 21 | 600100 | 同方股份 | 3,607,300 | 29,291,276.00 | 1.31 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----------|---------------|------|
| 22 | 300339 | 润和软件 | 1,220,723 | 29,248,523.08 | 1.31 |
| 23 | 603613 | 国联股份 | 777,617 | 28,717,395.81 | 1.28 |
| 24 | 000021 | 深科技 | 1,435,210 | 28,689,847.90 | 1.28 |
| 25 | 300253 | 卫宁健康 | 2,643,400 | 28,601,588.00 | 1.28 |
| 26 | 002368 | 太极股份 | 668,800 | 27,534,496.00 | 1.23 |
| 27 | 002268 | 电科网安 | 907,541 | 25,293,167.67 | 1.13 |
| 28 | 002065 | 东华软件 | 3,450,871 | 24,363,149.26 | 1.09 |
| 29 | 002402 | 和而泰 | 1,428,400 | 24,254,232.00 | 1.08 |
| 30 | 000997 | 新大陆 | 1,265,465 | 23,917,288.50 | 1.07 |
| 31 | 300383 | 光环新网 | 2,205,800 | 23,712,350.00 | 1.06 |
| 32 | 300682 | 朗新科技 | 1,011,792 | 23,554,517.76 | 1.05 |
| 33 | 600271 | 航天信息 | 1,709,800 | 23,407,162.00 | 1.05 |
| 34 | 002373 | 千方科技 | 1,701,279 | 23,205,445.56 | 1.04 |
| 35 | 002152 | 广电运通 | 1,909,753 | 22,382,305.16 | 1.00 |
| 36 | 688561 | 奇安信 | 421,287 | 21,826,879.47 | 0.98 |
| 37 | 603927 | 中科软 | 545,700 | 21,042,192.00 | 0.94 |
| 38 | 002139 | 拓邦股份 | 1,555,300 | 20,296,665.00 | 0.91 |
| 39 | 300803 | 指南针 | 375,600 | 18,250,404.00 | 0.82 |
| 40 | 002335 | 科华数据 | 495,300 | 17,806,035.00 | 0.80 |
| 41 | 002153 | 石基信息 | 1,254,923 | 17,568,922.00 | 0.79 |
| 42 | 688066 | 航天宏图 | 279,141 | 16,999,686.90 | 0.76 |
| 43 | 688083 | 中望软件 | 111,335 | 16,131,328.15 | 0.72 |
| 44 | 600225 | 卓朗科技 | 2,614,192 | 16,024,996.96 | 0.72 |
| 45 | 301236 | 软通动力 | 586,328 | 15,953,984.88 | 0.71 |
| 46 | 600131 | 国网信通 | 738,400 | 14,908,296.00 | 0.67 |
| 47 | 688568 | 中科星图 | 150,119 | 12,096,589.02 | 0.54 |
| 48 | 300442 | 润泽科技 | 289,400 | 8,901,944.00 | 0.40 |
| 49 | 688232 | 新点软件 | 158,281 | 8,517,100.61 | 0.38 |
| 50 | 301308 | 江波龙 | 56,800 | 5,779,968.00 | 0.26 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 数量(股) | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|--------|------------|--------------|
| 1 | 688582 | N芯动 | 6,476 | 299,402.44 | 0.01 |
| 2 | 301486 | 致尚科技 | 4,820 | 277,921.20 | 0.01 |
| 3 | 301395 | 仁信新材 | 5,196 | 138,629.28 | 0.01 |
| 4 | 301292 | 海科新源 | 5,824 | 116,421.76 | 0.01 |
| 5 | 688472 | 阿特斯 | 6,261 | 106,687.44 | 0.00 |
| 6 | 301488 | 豪恩汽电 | 2,618 | 104,144.04 | 0.00 |
| 7 | 688443 | 智翔金泰 | 3,033 | 89,443.17 | 0.00 |
| 8 | 301358 | 湖南裕能 | 2,023 | 86,766.47 | 0.00 |
| 9 | 301202 | 朗威股份 | 3,060 | 79,009.20 | 0.00 |
| 10 | 688603 | 天承科技 | 1,391 | 76,505.00 | 0.00 |
| 11 | 688469 | 中芯集成 | 13,800 | 74,658.00 | 0.00 |
| 12 | 301260 | 格力博 | 3,121 | 73,749.23 | 0.00 |
| 13 | 301261 | 恒工精密 | 1,973 | 72,803.70 | 0.00 |
| 14 | 688361 | 中科飞测 | 831 | 53,740.77 | 0.00 |
| 15 | 688531 | 日联科技 | 346 | 47,045.62 | 0.00 |
| 16 | 301325 | 曼恩斯特 | 364 | 39,293.80 | 0.00 |
| 17 | 688146 | 中船特气 | 1,011 | 38,549.43 | 0.00 |
| 18 | 001286 | 陕西能源 | 3,767 | 35,447.47 | 0.00 |
| 19 | 301301 | 川宁生物 | 3,574 | 32,023.04 | 0.00 |
| 20 | 601061 | 中信金属 | 4,016 | 30,441.28 | 0.00 |
| 21 | 001287 | 中电港 | 1,386 | 29,133.72 | 0.00 |
| 22 | 688576 | 西山科技 | 240 | 28,898.40 | 0.00 |
| 23 | 688352 | 颀中科技 | 2,361 | 28,497.27 | 0.00 |
| 24 | 688507 | 索辰科技 | 222 | 27,108.42 | 0.00 |
| 25 | 301293 | 三博脑科 | 333 | 23,782.86 | 0.00 |
| 26 | 301303 | 真兰仪表 | 1,058 | 23,614.56 | 0.00 |
| 27 | 688552 | 航天南湖 | 956 | 22,466.00 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 28 | 688570 | 天玛智控 | 884 | 22,391.72 | 0.00 |
| 29 | 301307 | 美利信 | 687 | 21,887.82 | 0.00 |
| 30 | 688543 | 国科军工 | 410 | 21,750.50 | 0.00 |
| 31 | 301322 | 绿通科技 | 392 | 20,870.08 | 0.00 |
| 32 | 688458 | 美芯晟 | 221 | 20,057.96 | 0.00 |
| 33 | 688581 | 安杰思 | 163 | 19,238.89 | 0.00 |
| 34 | 301317 | 鑫磊股份 | 694 | 18,161.98 | 0.00 |
| 35 | 301262 | 海看股份 | 692 | 17,646.00 | 0.00 |
| 36 | 688478 | 晶升股份 | 402 | 17,032.74 | 0.00 |
| 37 | 688562 | 航天软件 | 726 | 16,197.06 | 0.00 |
| 38 | 301439 | 泓淋电力 | 949 | 16,038.10 | 0.00 |
| 39 | 688623 | 双元科技 | 178 | 15,448.62 | 0.00 |
| 40 | 301332 | 德尔玛 | 1,122 | 15,405.06 | 0.00 |
| 41 | 301399 | 英特科技 | 293 | 15,110.01 | 0.00 |
| 42 | 301408 | 华人健康 | 879 | 14,899.05 | 0.00 |
| 43 | 301305 | 朗坤环境 | 753 | 14,826.57 | 0.00 |
| 44 | 301397 | C溯联 | 362 | 14,552.40 | 0.00 |
| 45 | 301419 | 阿莱德 | 330 | 14,470.50 | 0.00 |
| 46 | 688334 | 西高院 | 888 | 14,394.48 | 0.00 |
| 47 | 688593 | 新相微 | 959 | 13,991.81 | 0.00 |
| 48 | 301210 | N金杨 | 281 | 13,816.77 | 0.00 |
| 49 | 688512 | 慧智微 | 721 | 13,814.36 | 0.00 |
| 50 | 301382 | 蜂助手 | 408 | 13,398.72 | 0.00 |
| 51 | 301320 | 豪江智能 | 642 | 13,238.04 | 0.00 |
| 52 | 688433 | 华曙高科 | 418 | 13,167.00 | 0.00 |
| 53 | 688629 | C华丰 | 708 | 13,161.72 | 0.00 |
| 54 | 688620 | C安凯微 | 1,016 | 12,537.44 | 0.00 |
| 55 | 301360 | 荣旗科技 | 134 | 12,408.40 | 0.00 |
| 56 | 301345 | 涛涛车业 | 266 | 12,406.24 | 0.00 |
| 57 | 301315 | 威士顿 | 226 | 11,553.12 | 0.00 |
| 58 | 688523 | 航天环宇 | 472 | 11,257.20 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|-----------|------|
| 59 | 603135 | 中重科技 | 628 | 11,234.92 | 0.00 |
| 60 | 301225 | 恒勃股份 | 333 | 11,075.58 | 0.00 |
| 61 | 301429 | 森泰股份 | 499 | 10,488.98 | 0.00 |
| 62 | 601065 | 江盐集团 | 875 | 10,360.00 | 0.00 |
| 63 | 688631 | C莱斯 | 336 | 10,036.32 | 0.00 |
| 64 | 688479 | 友车科技 | 332 | 9,790.68 | 0.00 |
| 65 | 301232 | 飞沃科技 | 165 | 9,639.30 | 0.00 |
| 66 | 301376 | 致欧科技 | 420 | 9,454.20 | 0.00 |
| 67 | 301355 | 南王科技 | 563 | 9,430.25 | 0.00 |
| 68 | 301357 | 北方长龙 | 190 | 9,194.10 | 0.00 |
| 69 | 301386 | 未来电器 | 378 | 8,992.62 | 0.00 |
| 70 | 301323 | 新莱福 | 228 | 8,974.08 | 0.00 |
| 71 | 688429 | C时创 | 346 | 8,833.38 | 0.00 |
| 72 | 301373 | 凌玮科技 | 277 | 8,822.45 | 0.00 |
| 73 | 301170 | C锡南 | 250 | 8,732.50 | 0.00 |
| 74 | 301281 | 科源制药 | 337 | 8,458.70 | 0.00 |
| 75 | 688535 | 华海诚科 | 161 | 8,248.03 | 0.00 |
| 76 | 601133 | 柏诚股份 | 664 | 8,140.64 | 0.00 |
| 77 | 301157 | 华塑科技 | 150 | 7,939.50 | 0.00 |
| 78 | 301295 | C美硕 | 215 | 7,755.05 | 0.00 |
| 79 | 300804 | C广康 | 226 | 7,451.22 | 0.00 |
| 80 | 301337 | 亚华电子 | 232 | 7,045.84 | 0.00 |
| 81 | 301428 | 世纪恒通 | 229 | 7,007.40 | 0.00 |
| 82 | 001380 | 华纬科技 | 170 | 5,232.60 | 0.00 |
| 83 | 603125 | 常青科技 | 160 | 3,924.80 | 0.00 |
| 84 | 001328 | 登康口腔 | 145 | 3,696.05 | 0.00 |
| 85 | 001282 | 三联锻造 | 105 | 3,468.15 | 0.00 |
| 86 | 001360 | 南矿集团 | 177 | 2,631.99 | 0.00 |
| 87 | 603137 | 恒尚节能 | 139 | 2,375.51 | 0.00 |
| 88 | 001324 | 长青科技 | 114 | 2,234.40 | 0.00 |
| 89 | 001367 | 海森药业 | 55 | 2,171.40 | 0.00 |

| | | | | | |
|----|--------|------|-----|----------|------|
| 90 | 603172 | 万丰股份 | 122 | 1,967.86 | 0.00 |
|----|--------|------|-----|----------|------|

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计买入金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 688111 | 金山办公 | 227,713,830.51 | 11.03 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 160,153,982.96 | 7.75 |
| 3 | 603019 | 中科曙光 | 108,680,829.18 | 5.26 |
| 4 | 600588 | 用友网络 | 104,214,928.06 | 5.05 |
| 5 | 601360 | 三六零 | 103,296,333.10 | 5.00 |
| 6 | 600845 | 宝信软件 | 72,058,808.48 | 3.49 |
| 7 | 600536 | 中国软件 | 61,765,985.05 | 2.99 |
| 8 | 603613 | 国联股份 | 57,672,867.91 | 2.79 |
| 9 | 688561 | 奇安信 | 36,886,275.33 | 1.79 |
| 10 | 600100 | 同方股份 | 36,462,699.06 | 1.77 |
| 11 | 600271 | 航天信息 | 32,599,187.96 | 1.58 |
| 12 | 002368 | 太极股份 | 30,558,867.46 | 1.48 |
| 13 | 603927 | 中科软 | 29,091,967.31 | 1.41 |
| 14 | 688066 | 航天宏图 | 20,775,083.61 | 1.01 |
| 15 | 600131 | 国网信通 | 19,816,425.96 | 0.96 |
| 16 | 000938 | 紫光股份 | 19,332,878.15 | 0.94 |
| 17 | 600718 | 东软集团 | 19,049,559.06 | 0.92 |
| 18 | 600225 | 卓朗科技 | 17,774,783.67 | 0.86 |
| 19 | 301236 | 软通动力 | 14,383,895.04 | 0.70 |
| 20 | 300442 | 润泽科技 | 11,037,063.80 | 0.53 |

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 本期累计卖出金额 | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|----------------|----------------|
| 1 | 688111 | 金山办公 | 247,563,098.19 | 11.99 |
| 2 | 600570 | 恒生电子 | 180,308,460.37 | 8.73 |
| 3 | 600588 | 用友网络 | 118,266,575.35 | 5.73 |
| 4 | 603019 | 中科曙光 | 118,032,314.53 | 5.71 |
| 5 | 601360 | 三六零 | 101,370,696.59 | 4.91 |
| 6 | 600845 | 宝信软件 | 79,774,413.00 | 3.86 |
| 7 | 603613 | 国联股份 | 65,094,211.40 | 3.15 |
| 8 | 600536 | 中国软件 | 63,745,942.98 | 3.09 |
| 9 | 688561 | 奇安信 | 42,401,805.23 | 2.05 |
| 10 | 600100 | 同方股份 | 40,496,074.57 | 1.96 |
| 11 | 600271 | 航天信息 | 36,410,175.98 | 1.76 |
| 12 | 600718 | 东软集团 | 36,243,446.76 | 1.75 |
| 13 | 300017 | 网宿科技 | 34,789,773.12 | 1.68 |
| 14 | 603927 | 中科软 | 32,126,289.00 | 1.56 |
| 15 | 300212 | 易华录 | 27,068,419.27 | 1.31 |
| 16 | 688023 | 安恒信息 | 25,868,644.31 | 1.25 |
| 17 | 600131 | 国网信通 | 22,370,565.91 | 1.08 |
| 18 | 002212 | 天融信 | 22,180,350.56 | 1.07 |
| 19 | 300773 | 拉卡拉 | 17,627,963.35 | 0.85 |
| 20 | 002236 | 大华股份 | 11,634,553.00 | 0.56 |

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

| | |
|--------------|------------------|
| 买入股票成本（成交）总额 | 1,308,924,153.30 |
| 卖出股票收入（成交）总额 | 1,405,876,991.12 |

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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 | 558,186.75 |
| 2 | 应收清算款 | - |

| | | |
|---|-------|------------|
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | 40,976.67 |
| 7 | 待摊费用 | 75,616.24 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 674,779.66 |

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 | 002230 | 科大讯飞 | 44,289,532.00 | 1.98 | 转融通证券出借 |
| 2 | 603019 | 中科曙光 | 21,098,050.00 | 0.94 | 转融通证券出借 |
| 3 | 000977 | 浪潮信息 | 13,841,900.00 | 0.62 | 转融通证券出借 |
| 4 | 601360 | 三六零 | 13,634,742.00 | 0.61 | 转融通证券出借 |
| 5 | 688111 | 金山办公 | 11,286,058.00 | 0.50 | 转融通证券出借 |
| 6 | 002415 | 海康威视 | 8,542,380.00 | 0.38 | 转融通证券出借 |
| 7 | 000938 | 紫光股份 | 6,143,865.00 | 0.27 | 转融通证券出借 |
| 8 | 600570 | 恒生电子 | 5,434,383.00 | 0.24 | 转融通证券出借 |
| 9 | 002410 | 广联达 | 3,577,149.00 | 0.16 | 转融通证券出借 |
| 10 | 600588 | 用友网络 | 3,407,100.00 | 0.15 | 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

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 | 301486 | 致尚科技 | 277,921.20 | 0.01 | 新股未上市 |

| | | | | | |
|---|--------|------|------------|------|---------|
| 2 | 301395 | 仁信新材 | 138,629.28 | 0.01 | 新股未上市 |
| 3 | 301292 | 海科新源 | 116,421.76 | 0.01 | 新股未上市 |
| 4 | 688472 | 阿特斯 | 106,687.44 | 0.00 | 科创板打新限售 |
| 5 | 688582 | 芯动联科 | 26,360.64 | 0.00 | 科创板打新限售 |

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§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 | | 联接基金 | |
| | | 持有份额 | 占总 份额 比例 | 持有份额 | 占总 份额 比例 | 持有份额 | 占总 份额 比例 |
| 9,903 | 226,583.39 | 598,707,234.00 | 26.68% | 192,294,873.00 | 8.57% | 1,452,853,247.00 | 64.75% |

8.2 期末上市基金前十名持有人

| 序号 | 持有人名称 | 持有份额 (份) | 占上市总 份额比例 |
|----|--|------------------|--------------|
| 1 | 中信证券股份有限公司一天弘中证计算机主题交易型 开放式指数证券投资基金联接基金 | 1,452,853,247.00 | 64.75% |
| 2 | 中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金 | 65,151,500.00 | 2.90% |
| 3 | 浦银安盛基金—交通银行—浦银安盛通盈1号集合资 产管理计划 | 53,302,400.00 | 2.38% |
| 4 | 友邦人寿保险有限公司—传统 | 45,091,207.00 | 2.01% |

| | | | |
|----|-------------------------------|---------------|-------|
| | | 00 | |
| 5 | 香港中央结算有限公司 | 34,700,500.00 | 1.55% |
| 6 | 中国人寿财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品 | 30,500,000.00 | 1.36% |
| 7 | 中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红 | 18,567,000.00 | 0.83% |
| 8 | 安信证券股份有限公司 | 17,469,276.00 | 0.78% |
| 9 | 太和致远私募基金管理有限公司—锦田旭日一号私募证券投资基金 | 14,993,700.00 | 0.67% |
| 10 | 安徽省拾号职业年金计划—浦发银行 | 10,821,300.00 | 0.48% |

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 持有份额总数（份） | 占基金总份额比例 |
|------------------|-----------|----------|
| 基金管理人所有从业人员持有本基金 | 64,700.00 | 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情况

| 项目 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|--------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金 | 0 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 0 |

§9 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|----------------------------|------------------|
| 基金合同生效日(2020年03月20日)基金份额总额 | 287,855,354.00 |
| 本报告期期初基金份额总额 | 2,573,855,354.00 |
| 本报告期基金总申购份额 | 3,184,800,000.00 |
| 减：本报告期基金总赎回份额 | 3,514,800,000.00 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 2,243,855,354.00 |

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

| 券商名称 | 交易 | 股票交易 | | 应支付该券商的佣金 | | 备注 |
|------|----|------|-----|-----------|-----|----|
| | | 成交金额 | 占当期 | 佣金 | 占当期 | |
| | | | | | | |

| | 单元数量 | | 股票成交总额的比例 | | 佣金总量的比例 | |
|--------|------|------------------|-----------|--------------|---------|---|
| 东方财富证券 | 2 | 2,410,812,291.06 | 89.38% | 1,039,840.13 | 91.93% | - |
| 方正证券 | 1 | 24,069,719.89 | 0.89% | 10,381.08 | 0.92% | - |
| 国联证券 | 2 | 24,210,463.95 | 0.90% | 10,441.77 | 0.92% | - |
| 天风证券 | 1 | 42,025,534.45 | 1.56% | 18,126.52 | 1.60% | - |
| 银河证券 | 1 | - | - | - | - | - |
| 中信证券 | 6 | 196,184,301.48 | 7.27% | 52,287.57 | 4.62% | - |

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-11 |
| 2 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-19 |
| 3 | 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金2022年第4季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-28 |

| | | | |
|----|-------------------------------------|-----------|------------|
| 4 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-01-30 |
| 5 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-02-24 |
| 6 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-03 |
| 7 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-13 |
| 8 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-15 |
| 9 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-23 |
| 10 | 天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-24 |
| 11 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-29 |
| 12 | 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-03-31 |
| 13 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-01 |
| 14 | 天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-01 |
| 15 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-03 |
| 16 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-13 |
| 17 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-15 |
| 18 | 天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金2023年第1季度报告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-22 |
| 19 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-04-27 |
| 20 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-15 |
| 21 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-29 |
| 22 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-05-31 |
| 23 | 天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-08 |

| | | | |
|----|--|-----------|------------|
| | 代办证券公司的公告 | | |
| 24 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-19 |
| 25 | 天弘基金管理有限公司公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-21 |
| 26 | 天弘基金管理有限公司关于天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告 | 中国证监会规定媒介 | 2023-06-26 |

§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 | 20230101-20230630 | 1,991,717,147.00 | 610,613,100.00 | 1,149,477,000.00 | 1,452,853,247.00 | 64.75% |

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括：

（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式为四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日