

易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：易方达基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 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	6
§ 3	主要财务指标和基金净值表现	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
§ 4	管理人报告	8
4.1	基金管理人及基金经理情况	8
4.2	管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
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	11
4.7	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
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	12
§ 5	托管人报告	12
5.1	报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
§ 6	半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1	资产负债表	12
6.2	利润表	14
6.3	净资产（基金净值）变动表	15
6.4	报表附注	16
§ 7	投资组合报告	64
7.1	期末基金资产组合情况	64
7.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	66
7.4	报告期内股票投资组合的重大变动	70
7.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
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	71
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	71
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	71

7.10	本基金投资股指期货的投资政策	72
7.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.12	投资组合报告附注	72
§ 8	基金份额持有人信息	73
8.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2	期末上市基金前十名持有人	73
8.3	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
8.4	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	74
§ 9	开放式基金份额变动	74
§ 10	重大事件揭示	75
10.1	基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4	基金投资策略的改变	75
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
10.8	其他重大事件	77
§ 11	备查文件目录	78
11.1	备查文件目录	78
11.2	存放地点	78
11.3	查阅方式	78

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	易方达中证新能源 ETF
场内简称	新能源 E、新能源 ETF 易方达
基金主代码	516090
交易代码	516090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 3 月 11 日
基金管理人	易方达基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,360,844,752.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 3 月 19 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。但在因特殊情形导致基金无法完全投资于标的指数成份股时，基金管理人可采取包括成份股替代策略在内的其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到紧密跟踪标的指数的目的。本基金力争将日均跟踪偏离度的绝对值控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。如因标的指数编制规则调整或其他因素导致跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施避免跟踪误差进一步扩大。本基金将以降低跟踪误差和流动性管理为目的，综合考虑流动性和收益性，适当参与债券和货币市场工具的投资。 为更好地实现投资目标，本基金可投资股指期货、股票期权和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。在加强风险防范并遵守审慎原则的前提下，本基金可根据投资管理的需要参与转融通证券出借业务。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即中证新能源指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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		易方达基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王玉	王小飞
	联系电话	020-85102688	021-60637103
	电子邮箱	service@efunds.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400 881 8088	021-60637228
传真		020-38798812	021-60635778
注册地址		广东省珠海市横琴新区荣粤道 188号6层	北京市西城区金融大街25号
办公地址		广州市天河区珠江新城珠江东路30号广州银行大厦40-43楼	北京市西城区闹市口大街1号院 1号楼
邮政编码		510620	100033
法定代表人		刘晓艳	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.efunds.com.cn
基金中期报告备置地点	广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-41,049,404.63
本期利润	-65,121,037.30
加权平均基金份额本期利润	-0.0640

本期加权平均净值利润率	-11.17%
本期基金份额净值增长率	-10.47%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	54,169,902.20
期末可供分配基金份额利润	0.0398
期末基金资产净值	734,592,279.53
期末基金份额净值	0.5398
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	7.96%

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

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

3.期末可供分配利润，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	3.11%	1.59%	2.53%	1.60%	0.58%	-0.01%
过去三个月	-7.38%	1.67%	-8.76%	1.68%	1.38%	-0.01%
过去六个月	-10.47%	1.47%	-12.04%	1.49%	1.57%	-0.02%
过去一年	-32.76%	1.70%	-34.96%	1.72%	2.20%	-0.02%
过去三年	-	-	-	-	-	-
自基金合同生效起至今	7.96%	2.07%	5.11%	2.12%	2.85%	-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

易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021 年 3 月 11 日至 2023 年 6 月 30 日)



注：自基金合同生效至报告期末，基金份额净值增长率为 7.96%，同期业绩比较基准收益率为 5.11%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

经中国证监会证监基金字[2001]4 号文批准，本基金管理人成立于 2001 年 4 月 17 日，注册资本 13,244.2 万元人民币。本基金管理人拥有公募、社保、年金、特定客户资产管理、QDII、基本养老保险基金投资等业务资格，在主动权益、固定收益、指数投资、量化投资、多资产投资、海外投资、FOF 投资、另类投资等领域全面布局，为境内外客户提供资产管理解决方案。

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		
张湛	本基金的基金经理，易方达中证科技 50ETF、易方达中证全指证券公司 ETF（自 2020 年 04 月 30 日至 2023 年 05 月 19 日）、易方达中证人工智能主题 ETF、易方达中证万	2021-03-11	-	14 年	硕士研究生，具有基金从业资格。曾任易方达基金管理有限公司数量化投资研究员、量化研究员、投资经理，易方达中证军工 ETF、易方达中证军工指数（LOF）、易方达中证全指证

得生物科技指数（LOF）、易方达中证生物科技主题 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF、易方达中证内地低碳经济主题 ETF、易方达中证医疗 ETF、易方达中证物联网主题 ETF（自 2021 年 10 月 13 日至 2023 年 05 月 19 日）、易方达中证芯片产业 ETF、易方达中证科技 50 联接、易方达中证人工智能主题 ETF 联接、易方达中证全指证券公司 ETF 联接、易方达中证内地低碳经济主题 ETF 联接、易方达恒生科技 ETF（QDII）、易方达中证 500 增强策略 ETF、易方达中证云计算与大数据主题 ETF 联接发起式、易方达中证医疗 ETF 联接发起式、易方达中证信息安全主题 ETF、易方达中证芯片产业 ETF 联接发起式的基金经理，易方达中证港股通中国 100ETF、易方达恒生科技 ETF 联接（QDII）的基金经理助理				券公司指数（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	------------------

注：1.对基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，“离任日期”为根据公司决定确定的解聘日期；对此后的非首任基金经理/基金经理助理，“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。

2.证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

3.为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》等有关法律法规及基金合同、基金招募说明书等有关基金法律文件的规定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金运作合法合规，无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

本基金管理人主要通过建立有纪律、规范化的投资研究和决策流程、交易流程，以及强化事后

监控分析来确保公平对待不同投资组合，切实防范利益输送。本基金管理人制定了严格的投资权限管理制度、投资备选库管理制度和集中交易制度等，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“时间优先、价格优先”作为执行指令的基本原则，通过投资交易系统内的公平交易模块，以尽可能确保公平对待各投资组合。本报告期内，公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，公司旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共 23 次，其中 20 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，3 次为不同基金经理管理的基金因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理按规定履行了审批程序。

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪中证新能源指数，该指数选取沪深市场中涉及可再生能源生产、新能源应用、新能源存储以及新能源交互设备等业务的上市公司证券作为指数样本，以反映新能源产业相关上市公司证券的整体表现。报告期内本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组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。

2023 年上半年，欧美主要国家的货币政策依然趋紧，但对美国加息力度缓和、货币政策走向宽松的预期一度对海外市场情绪有所提振。然而，美国经济运行状况及美联储货币政策趋向等因素依然为海外市场带来不确定性。我国在度过疫情高峰后，国内社会经济活动逐步恢复，但居民消费的恢复相对缓慢，消费意愿仍有待进一步修复。年初以来国内上市企业盈利小幅增长，增速逐步改善。中证新能源指数主要覆盖的光伏、风电和新能源车等板块，受光伏产业链供需博弈以及新能源车企竞相降价等短期不确定因素的影响，年初以来指数维持了震荡的行情。本报告期内，中证新能源指数下跌 12.0%。

本报告期为本基金的正常运作期，本基金在投资运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，在指数权重调整和基金申赎变动时，应用指数复制和数量化技术降低冲击成本和减少跟踪误差，力求跟踪误差最小化。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.5398 元，本报告期份额净值增长率为-10.47%，同期业绩比较基准收益率为-12.04%，年化跟踪误差 0.67%，各项指标均在合同规定的目标控制范围之内。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下一阶段，“推动经济运行整体好转，实现质的有效提升和量的合理增长”仍将是我国在经济工作方面的重要目标之一。6 月中的国务院常务会议指出要“加大宏观政策调控力度、着力扩大有效需求”，强调“具备条件的政策措施要及时出台、抓紧实施，同时加强政策措施的储备，最大限度发挥政策综合效应”。利率下调等一系列政策支持措施的逐步推出有望进一步提振企业和消费者的信心。与此同时，欧美等发达国家经济衰退的风险仍不可忽视，中国经济发展所面临的国际环境也将不断变化，国内外市场的波动仍可能持续。在实现“碳达峰”、“碳中和”目标的过程中，我国需要大力发展新能源、新能源汽车等绿色低碳产业，构建以新能源为主体的新型电力系统，加快形成以储能和调峰为基础支撑的新增电力装机发展机制。新能源产业将引领我国能源领域的重大变革，是实现“双碳”目标的必由之路，并将助力经济高质量发展，其长期的投资和配置价值值得关注。

作为被动型投资基金，本基金将坚持既定的指数化投资策略，以严格控制基金相对目标指数的跟踪偏离为投资目标，追求跟踪误差的最小化，为投资者提供质地优良的指数投资工具，为长期看好新能源领域投资前景的投资者提供方便、高效的工具。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规或基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值原则和方法的最终决策和日常估值的执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间不存在直接的重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据和流通受限股票的折扣率数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§ 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：易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

银行存款	6.4.7.1	8,003,700.57	4,307,043.30
结算备付金		666,370.99	505,970.90
存出保证金		158,453.12	117,791.30
交易性金融资产	6.4.7.2	727,310,506.64	408,492,321.64
其中：股票投资		727,310,506.64	408,492,321.64
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		4,617,768.28	923,018.41
应收股利		99,920.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	106,253.23	26,213.24
资产总计		740,962,973.63	414,372,358.79
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		3,872,232.27	681,624.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		90,080.21	53,700.25
应付托管费		30,026.73	17,900.08
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,649.03	3,325.48
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,372,705.86	710,089.77
负债合计		6,370,694.10	1,466,639.88
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	680,422,377.33	342,422,376.27
未分配利润	6.4.7.8	54,169,902.20	70,483,342.64
净资产合计		734,592,279.53	412,905,718.91
负债和净资产总计		740,962,973.63	414,372,358.79

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5398 元，基金份额总额 1,360,844,752.00

份。

6.2 利润表

会计主体：易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-64,368,844.13	2,426,390.38
1.利息收入		778,061.74	211,806.73
其中：存款利息收入	6.4.7.9	17,670.59	24,912.83
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		760,391.15	186,893.90
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-41,552,831.25	-49,207,606.00
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-49,004,943.94	-50,843,347.10
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	92,106.61	453,420.74
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-	-
股利收益	6.4.7.14	7,360,006.08	1,182,320.36
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-24,071,632.67	49,764,415.61
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	477,558.05	1,657,774.04
减：二、营业总支出		752,193.17	523,848.26
1. 管理人报酬		432,188.20	269,505.11
2. 托管费		144,062.70	89,835.05
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	6.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		2,738.47	673.71
8. 其他费用	6.4.7.18	173,203.80	163,834.39

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-65,121,037.30	1,902,542.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-65,121,037.30	1,902,542.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-65,121,037.30	1,902,542.12

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	342,422,376.27	70,483,342.64	412,905,718.91
二、本期期初净资产（基金净值）	342,422,376.27	70,483,342.64	412,905,718.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	338,000,001.06	-16,313,440.44	321,686,560.62
（一）、综合收益总额	-	-65,121,037.30	-65,121,037.30
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	338,000,001.06	48,807,596.86	386,807,597.92
其中：1.基金申购款	510,500,001.50	72,164,382.11	582,664,383.61
2.基金赎回款	-172,500,000.44	-23,356,785.25	-195,856,785.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	680,422,377.33	54,169,902.20	734,592,279.53
项目	上年度可比期间		

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	223,922,376.10	141,496,503.39	365,418,879.49
二、本期期初净资产(基金净值)	223,922,376.10	141,496,503.39	365,418,879.49
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	41,499,999.97	19,255,127.13	60,755,127.10
(一)、综合收益总额	-	1,902,542.12	1,902,542.12
(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)	41,499,999.97	17,352,585.01	58,852,584.98
其中: 1.基金申购款	632,499,999.71	254,772,589.58	887,272,589.29
2.基金赎回款	-590,999,999.74	-237,420,004.57	-828,420,004.31
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	265,422,376.07	160,751,630.52	426,174,006.59

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：刘晓艳，主管会计工作负责人：陈荣，会计机构负责人：王永铿

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”) 根据中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”) 证监许可[2021]399 号《关于准予易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》进行募集，由易方达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《易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》公开募集。经向中国证监会备案，《易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2021 年 3 月 11 日

正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 266,922,376.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,376.00 份基金份额。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定。本基金的基金管理人为易方达基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《易方达基金管理有限公司关于易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金实施基金份额拆分业务及相关业务安排的公告》和《易方达基金管理有限公司关于易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果及恢复交易和申购、赎回业务的公告》的有关规定，本基金的基金管理人确定 2021 年 11 月 26 日为本基金的基金份额拆分日。拆分前基金份额总额为 186,922,376.00 份，拆分前基金份额净值为 1.7510 元。根据基金份额拆分公式，基金份额拆分比例为 2，拆分后基金份额总额为 373,844,752.00 份，拆分后基金份额净值为 0.8755 元。本基金登记结算机构中国证券登记结算有限责任公司已根据上述拆分比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了拆分，并于 2021 年 11 月 26 日进行了变更登记。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和基金净值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

本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金本报告期无会计差错更正。

6.4.6 税项

（1）印花税

证券(股票)交易印花税税率为 1‰，由出让方缴纳。

(2) 增值税、城建税、教育费附加及地方教育费附加

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

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

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

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

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

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

债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值)、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

(3) 企业所得税

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

(4) 个人所得税

个人所得税税率为 20%。

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

暂免征收储蓄存款利息所得个人所得税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位:人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	8,003,700.57
等于: 本金	8,003,086.05
加: 应计利息	614.52
定期存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
其中: 存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于: 本金	-
加: 应计利息	-
合计	8,003,700.57

6.4.7.2 交易性金融资产

单位:人民币元

项目	本期末
----	-----

		2023 年 6 月 30 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		821,097,379.54	-	727,310,506.64	-93,786,872.90
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		821,097,379.54	-	727,310,506.64	-93,786,872.90

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	30,636.99
待摊费用	75,616.24
合计	106,253.23

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	155,562.46
其中：交易所市场	155,562.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	116,252.18
应付替代款	2,099,752.02
可退替代款	1,139.20
合计	2,372,705.86

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	684,844,752.00	342,422,376.27
本期申购	1,021,000,000.00	510,500,001.50
本期赎回（以“-”号填列）	-345,000,000.00	-172,500,000.44
本期末	1,360,844,752.00	680,422,377.33

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	110,220,900.52	-39,737,557.88	70,483,342.64
本期利润	-41,049,404.63	-24,071,632.67	-65,121,037.30
本期基金份额交易产生的变动数	102,983,358.10	-54,175,761.24	48,807,596.86
其中：基金申购款	152,221,908.75	-80,057,526.64	72,164,382.11
基金赎回款	-49,238,550.65	25,881,765.40	-23,356,785.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	172,154,853.99	-117,984,951.79	54,169,902.20

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	10,813.05
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	5,839.77
其他	1,017.77

合计	17,670.59
----	-----------

6.4.7.10 股票投资收益**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-38,464,257.32
股票投资收益——赎回差价收入	-10,540,686.62
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	-49,004,943.94

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	290,951,198.59
减：卖出股票成本总额	328,813,333.66
减：交易费用	602,122.25
买卖股票差价收入	-38,464,257.32

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	195,856,785.69
减：现金支付赎回款总额	124,119,503.69
减：赎回股票成本总额	82,277,968.62
减：交易费用	-
赎回差价收入	-10,540,686.62

6.4.7.11 债券投资收益**6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	102.53
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	92,004.08
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-

合计	92,106.61
----	-----------

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	627,134.70
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	534,996.48
减：应计利息总额	109.05
减：交易费用	25.09
买卖债券差价收入	92,004.08

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 衍生工具收益

本基金本报告期无衍生工具收益。

6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	7,360,006.08
其中：证券出借权益补偿收入	874,138.73
基金投资产生的股利收益	-
合计	7,360,006.08

6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-24,071,632.67
——股票投资	-24,071,632.67
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的	-

预估增值税	
合计	-24,071,632.67

6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益收入	477,558.05
合计	477,558.05

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

6.4.7.17 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	26,827.82
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行汇划费	2,567.86
其他	84,300.75
合计	173,203.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本会计报表批准报出日，本基金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

本报告期内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
易方达基金管理有限公司	基金管理人
中国建设银行股份有限公司	基金托管人

广发证券股份有限公司	基金管理人股东、申购赎回代办证券公司
------------	--------------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	154,084,623.46	18.73%	51,643,973.40	4.53%

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发生通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	627,134.70	100.00%	2,036,051.40	97.33%

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未发生通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	37,008.61	15.17%	25,739.31	16.55%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	22,275.56	4.70%	14,914.62	8.16%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的管理费	432,188.20	269,505.11
其中：支付销售机构的客户维护费	12,584.09	9,655.48

注：1.本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的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，该费用按照基金销售机构所销售基金的保有量作为基数进行计算，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1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	144,062.70	89,835.05

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05%的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H=E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金托管人根据与基金管理人核对一致的财务数据，自动在月初 5 个工作日内按照指定的账户路径进行资金支付，基金管理人无需再出具资金划拨指令。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。费用自动扣划后，基金管理人应进行核对，如发现数据不符，及时联系基金托管人协商解决。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场债券（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 1 月 1 日至 2023 年 6 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
广发证券	26,511,963.00	18,021.77	0.00	0.00
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	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
广发证券	33,636,403.00	20,878.15	7,053,740.00	2,880.80

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

单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
广发证券	2023010300026829	天合光能	2023-01-03	1,248,320.00	18,800.00	14	3.41	1,655.41	0.00	0.00
广发证券	2023010300036827	星源材质	2023-01-03	574,056.00	26,800.00	14	2.50	558.11	0.00	0.00
广发证	2023	新宙邦	2023-	81,32	1,800.00	14	3.2	101.2	0.00	0.00

券	0103 0003 9547		01-03	4.00			0	0		
广发证 券	2023 0109 0003 7326	容百科 技	2023- 01-09	71,69 0.00	1,000.00	14	3.2 0	133.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0111 0002 1795	固德威	2023- 01-11	355,0 00.00	1,000.00	14	3.4 1	638.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0112 0001 3003	大全能 源	2023- 01-12	110,5 61.00	2,300.00	14	3.5 1	194.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0002 5701	星源材 质	2023- 01-17	624,7 08.00	26,800.00	14	2.5 0	607.3 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0117 0003 4437	天合光 能	2023- 01-17	1,328 ,032. 00	18,800.00	14	3.4 1	1,761 .12	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 2525	容百科 技	2023- 01-30	77,55 0.00	1,000.00	14	3.2 0	96.51	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8445	大全能 源	2023- 01-30	113,2 29.00	2,300.00	14	3.5 1	154.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0130 0008 8459	固德威	2023- 01-30	396,0 20.00	1,000.00	14	3.4 1	525.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0131 0002 4823	星源材 质	2023- 01-31	623,1 00.00	26,800.00	14	2.5 0	605.7 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0208 0000 0814	天合光 能	2023- 02-08	1,612 ,524. 00	24,900.00	14	3.2 0	2,006 .70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213	固德威	2023- 02-13	381,0 00.00	1,000.00	14	3.4 1	505.2 5	0.00	0.00

	0006 8172									
广发证 券	2023 0213 0006 8670	容百科 技	2023- 02-13	77,72 0.00	1,000.00	14	3.2 0	96.72	0.00	0.00
广发证 券	2023 0213 0007 3156	大全能 源	2023- 02-13	109,9 86.00	2,300.00	14	3.5 1	150.1 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0214 0002 4575	星源材 质	2023- 02-14	601,6 60.00	26,800.00	14	2.5 0	584.9 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0222 0000 4436	天合光 能	2023- 02-22	1,536 ,579. 00	24,900.00	14	3.2 0	1,912 .19	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0006 1850	容百科 技	2023- 02-27	72,10 0.00	1,000.00	14	3.2 0	89.72	0.00	0.00
广发证 券	2023 0227 0006 5684	固德威	2023- 02-27	383,5 60.00	1,000.00	14	3.4 1	508.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0228 0002 3812	星源材 质	2023- 02-28	569,5 00.00	26,800.00	14	2.5 0	553.6 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0306 0000 0859	金博股 份	2023- 03-06	197,1 80.00	1,000.00	14	3.2 0	245.3 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0308 0000 0952	天合光 能	2023- 03-08	442,0 16.00	7,600.00	14	3.2 0	550.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0308 0000 5426	天合光 能	2023- 03-08	1,448 ,184. 00	24,900.00	14	3.2 0	1,802 .18	0.00	0.00
广发证 券	2023 0313 0005	容百科 技	2023- 03-13	68,36 0.00	1,000.00	14	3.2 0	85.07	0.00	0.00

	7034									
广发证 券	2023 0313 0006 5514	固德威	2023- 03-13	359,0 00.00	1,000.00	14	3.4 1	476.0 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0314 0002 8042	星源材 质	2023- 03-14	523,4 04.00	26,800.00	14	2.5 0	508.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0321 0000 1158	大全能 源	2023- 03-21	64,49 3.00	1,300.00	14	3.2 0	80.26	0.00	0.00
广发证 券	2023 0322 0000 7649	天合光 能	2023- 03-22	1,330 ,158. 00	24,900.00	14	3.2 0	1,773 .54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0327 0005 9433	固德威	2023- 03-27	291,1 00.00	1,000.00	14	3.4 1	386.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0327 0006 0189	容百科 技	2023- 03-27	71,27 0.00	1,000.00	14	3.2 0	88.69	0.00	0.00
广发证 券	2023 0328 0002 5389	星源材 质	2023- 03-28	516,4 36.00	26,800.00	14	2.5 0	502.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0404 0000 1064	容百科 技	2023- 04-04	69,22 0.00	1,000.00	14	3.2 0	86.14	0.00	0.00
广发证 券	2023 0406 0001 7356	天合光 能	2023- 04-06	1,275 ,627. 00	24,900.00	14	3.2 0	1,587 .45	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0005 2755	容百科 技	2023- 04-10	72,08 0.00	1,000.00	14	3.2 0	89.70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0410 0005 6103	固德威	2023- 04-10	284,1 80.00	1,000.00	14	3.4 1	376.8 5	0.00	0.00

广发证 券	2023 0411 0000 2633	新宙邦	2023- 04-11	193,7 52.00	3,600.00	14	3.2 0	241.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2656	天齐锂 业	2023- 04-11	95,96 4.00	1,200.00	14	3.2 0	119.4 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0000 2657	德方纳 米	2023- 04-11	205,9 00.00	1,000.00	14	3.2 0	256.2 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0001 8742	星源材 质	2023- 04-11	514,0 24.00	26,800.00	7	2.5 0	249.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0001 9474	湘电股 份	2023- 04-11	362,1 80.00	18,200.00	13	3.1 0	405.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0411 0002 0894	爱旭股 份	2023- 04-11	606,7 80.00	18,000.00	13	3.1 0	679.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0000 1768	太阳能	2023- 04-12	262,8 66.00	38,600.00	14	3.2 0	327.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0412 0000 1780	恩捷股 份	2023- 04-12	647,1 92.00	5,600.00	14	3.2 0	805.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 0452	吉电股 份	2023- 04-13	14,22 2.00	2,600.00	14	3.2 0	17.70	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 0457	赣锋锂 业	2023- 04-13	2,366 ,397. 00	36,300.00	14	3.2 0	2,944 .85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0413 0000 7271	晶澳科 技	2023- 04-13	1,525 ,176. 00	27,600.00	14	1.7 0	1,008 .31	0.00	0.00
广发证	2023	恩捷股	2023-	163,1	1,400.00	14	3.2	202.9	0.00	0.00

券	0414 0000 1673	份	04-14	14.00			0	9		
广发证 券	2023 0414 0000 1691	太阳能	2023- 04-14	44,10 0.00	6,300.00	14	3.2 0	54.88	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 1697	天齐锂 业	2023- 04-14	89,52 9.00	1,100.00	14	3.2 0	111.4 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 1737	吉电股 份	2023- 04-14	13,67 5.00	2,500.00	14	3.2 0	17.02	0.00	0.00
广发证 券	2023 0414 0000 3651	赣锋锂 业	2023- 04-14	689,8 00.00	10,000.00	14	1.7 0	456.0 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0417 0000 1668	晶盛机 电	2023- 04-17	69,75 0.00	1,000.00	14	3.2 0	105.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0417 0000 1727	华友钴 业	2023- 04-17	516,1 20.00	9,200.00	14	3.2 0	779.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1681	科达利	2023- 04-18	137,7 00.00	1,000.00	14	3.2 0	195.8 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0000 1754	天合光 能	2023- 04-18	614,4 38.00	12,100.00	14	3.2 0	873.8 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0418 0001 2909	星源材 质	2023- 04-18	505,9 84.00	26,800.00	6	2.5 0	210.8 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0420 0000 2187	科达利	2023- 04-20	131,0 00.00	1,000.00	14	3.2 0	163.0 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0421	科达利	2023- 04-21	131,0 10.00	1,000.00	14	3.2 0	163.0 3	0.00	0.00

	0000 2576									
广发证 券	2023 0421 0000 2578	天齐锂 业	2023- 04-21	182,1 37.00	2,300.00	14	3.2 0	226.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0424 0000 3617	杉杉股 份	2023- 04-24	172,5 47.00	10,900.00	14	3.2 0	214.7 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0424 0000 3618	新宙邦	2023- 04-24	96,88 1.00	1,900.00	14	3.2 0	120.5 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0424 0003 2063	固德威	2023- 04-24	256,8 90.00	1,000.00	14	3.4 1	340.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0424 0005 3517	容百科 技	2023- 04-24	64,90 0.00	1,000.00	14	3.2 0	80.76	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0000 2333	国轩高 科	2023- 04-25	31,51 2.00	1,200.00	14	3.2 0	39.21	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0000 2354	天顺风 能	2023- 04-25	60,86 5.00	4,700.00	14	3.2 0	75.74	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0005 9667	德方纳 米	2023- 04-25	167,5 70.00	1,000.00	14	3.2 0	208.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0425 0006 4331	天齐锂 业	2023- 04-25	84,08 4.00	1,200.00	14	3.1 0	101.3 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0000 3903	太阳能	2023- 04-26	325,4 89.00	46,300.00	14	3.2 0	405.0 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0000	新宙邦	2023- 04-26	88,93 8.00	1,800.00	14	3.2 0	110.6 8	0.00	0.00

	3977									
广发证 券	2023 0426 0000 3996	中国宝 安	2023- 04-26	79,35 0.00	7,500.00	14	3.2 0	98.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0000 4005	当升科 技	2023- 04-26	118,6 02.00	2,200.00	14	3.2 0	147.5 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0002 5718	太阳能	2023- 04-26	271,3 58.00	38,600.00	14	3.1 0	327.1 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0426 0003 0166	恩捷股 份	2023- 04-26	596,4 56.00	5,600.00	14	3.1 0	719.0 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0000 4589	国轩高 科	2023- 04-27	95,03 0.00	3,400.00	14	3.2 0	118.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0000 4695	隆基绿 能	2023- 04-27	359,7 00.00	10,000.00	14	3.2 0	447.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0002 0156	晶澳科 技	2023- 04-27	1,130 ,496. 00	27,600.00	14	3.1 0	1,362 .88	0.00	0.00
广发证 券	2023 0427 0002 0262	赣锋锂 业	2023- 04-27	2,384 ,184. 00	36,300.00	14	3.1 0	2,874 .27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0428 0000 2539	协鑫集 成	2023- 04-28	5,508 .00	1,800.00	14	3.2 0	6.85	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0004 9333	华友钴 业	2023- 05-04	474,7 20.00	9,200.00	14	3.1 0	572.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0504 0005 1749	天合光 能	2023- 05-04	586,3 66.00	12,100.00	14	3.2 0	729.7 0	0.00	0.00

广发证 券	2023 0505 0000 4763	晶澳科 技	2023- 05-05	212,9 68.00	5,600.00	14	3.7 0	306.4 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0508 0000 3554	中国宝 安	2023- 05-08	58,32 0.00	5,400.00	14	3.2 0	72.58	0.00	0.00
广发证 券	2023 0508 0001 2587	固德威	2023- 05-08	274,9 80.00	1,000.00	14	3.4 1	364.6 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0508 0003 9819	杉杉股 份	2023- 05-08	163,8 27.00	10,900.00	14	3.1 0	197.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0508 0004 1341	容百科 技	2023- 05-08	66,64 0.00	1,000.00	14	3.2 0	82.93	0.00	0.00
广发证 券	2023 0508 0004 9983	新宙邦	2023- 05-08	87,78 0.00	1,900.00	14	3.2 0	109.2 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1689	天顺风 能	2023- 05-09	65,80 0.00	4,700.00	14	3.1 0	79.33	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 1771	天齐锂 业	2023- 05-09	85,40 4.00	1,200.00	14	3.1 0	102.9 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 3611	国轩高 科	2023- 05-09	32,64 0.00	1,200.00	14	3.1 0	39.35	0.00	0.00
广发证 券	2023 0509 0001 5701	德方纳 米	2023- 05-09	153,6 10.00	1,000.00	14	3.2 0	191.1 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0510 0000 6638	恩捷股 份	2023- 05-10	570,3 60.00	5,600.00	14	3.1 0	687.6 0	0.00	0.00
广发证	2023	阳光电	2023-	2,222	20,000.00	14	1.0	864.1	0.00	0.00

券	0511 0000 3357	源	05-11	,000. 00			0	1		
广发证 券	2023 0511 0001 1623	晶澳科 技	2023- 05-11	979,2 48.00	27,600.00	14	3.1 0	1,180 .54	0.00	0.00
广发证 券	2023 0512 0000 9266	协鑫集 成	2023- 05-12	5,400 .00	1,800.00	14	3.1 0	6.51	0.00	0.00
广发证 券	2023 0517 0000 3859	爱旭股 份	2023- 05-17	150,6 26.00	4,900.00	14	3.2 0	187.4 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0000 1956	TCL 中 环	2023- 05-18	55,18 8.00	1,400.00	14	3.2 0	68.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 4712	天合光 能	2023- 05-18	572,9 35.00	12,100.00	7	3.2 0	356.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0518 0001 7338	华友钴 业	2023- 05-18	477,9 40.00	9,200.00	7	3.1 0	288.0 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0519 0000 3164	天顺风 能	2023- 05-19	84,51 0.00	5,400.00	14	3.2 0	105.1 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0522 0003 1962	容百科 技	2023- 05-22	63,10 0.00	1,000.00	7	3.2 0	39.26	0.00	0.00
广发证 券	2023 0522 0003 3282	固德威	2023- 05-22	253,0 80.00	1,000.00	7	3.4 1	167.8 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0523 0000 7600	天齐锂 业	2023- 05-23	94,34 4.00	1,200.00	7	3.1 0	56.87	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524	天顺风 能	2023- 05-24	81,70 2.00	5,100.00	14	3.2 0	101.6 7	0.00	0.00

	0000 2156									
广发证 券	2023 0524 0000 2212	天赐材 料	2023- 05-24	300,2 88.00	6,800.00	14	3.2 0	373.6 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0000 2233	太阳能	2023- 05-24	429,0 40.00	62,000.00	14	3.2 0	533.9 2	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0000 2247	天赐材 料	2023- 05-24	1,859 ,136. 00	42,100.00	14	3.2 0	2,313 .59	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0000 2279	孚能科 技	2023- 05-24	28,34 0.00	1,300.00	14	3.2 0	35.27	0.00	0.00
广发证 券	2023 0524 0002 4194	恩捷股 份	2023- 05-24	560,1 68.00	5,600.00	7	3.1 0	337.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0000 4460	奥特维	2023- 05-25	299,0 88.00	1,600.00	14	3.2 0	372.2 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0000 8114	天合光 能	2023- 05-25	609,9 61.00	12,100.00	7	3.2 0	379.5 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0001 4748	晶澳科 技	2023- 05-25	1,170 ,240. 00	27,600.00	7	3.1 0	705.3 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0001 4836	阳光电 源	2023- 05-25	2,400 ,600. 00	20,000.00	7	1.0 0	466.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0525 0002 3544	华友钴 业	2023- 05-25	447,7 64.00	9,200.00	7	3.1 0	269.9 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0000	太阳能	2023- 05-29	84,24 0.00	12,000.00	14	3.2 0	104.8 3	0.00	0.00

	5402									
广发证 券	2023 0529 0001 0421	容百科 技	2023- 05-29	58,31 0.00	1,000.00	7	3.2 0	36.28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0529 0001 1670	固德威	2023- 05-29	229,9 30.00	1,000.00	7	3.4 1	152.4 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0000 6949	天顺风 能	2023- 05-30	15,64 0.00	1,000.00	14	3.2 0	19.46	0.00	0.00
广发证 券	2023 0530 0002 0309	天齐锂 业	2023- 05-30	88,08 0.00	1,200.00	7	3.1 0	53.09	0.00	0.00
广发证 券	2023 0531 0000 1201	天赐材 料	2023- 05-31	65,42 4.00	1,600.00	14	3.2 0	81.42	0.00	0.00
广发证 券	2023 0531 0000 9133	恩捷股 份	2023- 05-31	509,1 52.00	5,600.00	7	3.1 0	306.9 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0000 6068	格林美	2023- 06-01	56,78 4.00	8,400.00	14	3.2 0	70.66	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 6474	天合光 能	2023- 06-01	471,9 00.00	12,100.00	7	3.2 0	293.6 3	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0002 7529	晶澳科 技	2023- 06-01	971,5 20.00	27,600.00	7	3.1 0	585.6 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 1065	TCL 中 环	2023- 06-01	51,03 0.00	1,400.00	7	3.2 0	31.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0601 0003 4327	华友钴 业	2023- 06-01	424,1 20.00	9,200.00	7	3.1 0	255.6 5	0.00	0.00

广发证 券	2023 0601 0003 6955	阳光电 源	2023- 06-01	2,152 ,800. 00	20,000.00	7	1.0 0	418.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0602 0000 3723	璞泰来	2023- 06-02	1,591 ,744. 00	44,800.00	14	3.2 1	1,987 .03	0.00	0.00
广发证 券	2023 0602 0000 3731	阳光电 源	2023- 06-02	2,828 ,552. 00	26,200.00	14	1.0 0	1,099 .99	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4905	天齐锂 业	2023- 06-05	75,97 0.00	1,000.00	14	3.2 1	94.84	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0000 4906	天顺风 能	2023- 06-05	105,8 60.00	6,700.00	14	3.2 1	132.1 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0002 1215	固德威	2023- 06-05	226,9 80.00	1,000.00	7	3.4 1	150.5 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0605 0002 2179	容百科 技	2023- 06-05	58,95 0.00	1,000.00	7	3.2 0	36.68	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0000 4369	赣锋锂 业	2023- 06-06	75,85 2.00	1,200.00	14	3.2 1	94.69	0.00	0.00
广发证 券	2023 0606 0001 7337	天齐锂 业	2023- 06-06	89,37 6.00	1,200.00	7	3.1 0	53.87	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0000 4756	鹏辉能 源	2023- 06-07	438,6 15.00	9,500.00	14	4.1 0	699.3 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0000 4769	厦门钨 业	2023- 06-07	18,55 0.00	1,000.00	14	3.2 1	23.16	0.00	0.00
广发证	2023	天赐材	2023-	1,699	42,100.00	7	3.2	1,057	0.00	0.00

券	0607 0001 7263	料	06-07	,156. 00			0	.25		
广发证 券	2023 0607 0001 8128	孚能科 技	2023- 06-07	27,48 2.00	1,300.00	7	3.2 0	17.10	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0001 8387	太阳能	2023- 06-07	423,4 60.00	62,000.00	7	3.2 0	263.4 9	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0001 9075	天赐材 料	2023- 06-07	274,4 48.00	6,800.00	7	3.2 0	170.7 7	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0001 9611	天顺风 能	2023- 06-07	77,21 4.00	5,100.00	7	3.2 0	48.04	0.00	0.00
广发证 券	2023 0607 0002 3587	恩捷股 份	2023- 06-07	513,5 20.00	5,600.00	7	3.1 0	309.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0000 3597	天奈科 技	2023- 06-08	141,3 06.00	3,300.00	14	3.2 1	226.8 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0001 9420	奥特维	2023- 06-08	247,6 80.00	1,600.00	7	3.2 0	154.1 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 0768	TCL 中 环	2023- 06-08	51,49 2.00	1,400.00	7	3.2 0	32.04	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 1495	华友钴 业	2023- 06-08	433,5 04.00	9,200.00	7	3.1 0	261.3 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608 0002 4990	阳光电 源	2023- 06-08	2,058 ,200. 00	20,000.00	7	1.0 0	400.2 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0608	天合光 能	2023- 06-08	430,7 60.00	12,100.00	7	3.2 0	268.0 3	0.00	0.00

	0002 6534									
广发证 券	2023 0612 0002 8775	雅化集 团	2023- 06-12	85,32 0.00	4,500.00	14	3.2 1	106.5 1	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8882	容百科 技	2023- 06-12	513,8 04.00	9,400.00	14	3.7 5	749.3 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8892	恩捷股 份	2023- 06-12	546,3 40.00	5,900.00	14	3.7 5	796.7 5	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8908	晶澳科 技	2023- 06-12	2,276 ,720. 00	59,600.00	14	3.7 5	3,320 .22	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8916	天奈科 技	2023- 06-12	243,0 45.00	5,500.00	14	3.2 1	303.4 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8982	中矿资 源	2023- 06-12	1,801 ,280. 00	32,000.00	14	3.7 5	2,626 .87	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 8997	融捷股 份	2023- 06-12	72,70 0.00	1,000.00	14	3.2 1	90.75	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9071	孚能科 技	2023- 06-12	22,69 0.00	1,000.00	14	3.2 1	28.32	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9084	福莱特	2023- 06-12	426,9 29.00	13,100.00	14	3.7 5	622.6 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0612 0002 9101	璞泰来	2023- 06-12	398,8 40.00	11,800.00	14	3.7 5	581.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0003	容百科 技	2023- 06-14	52,09 0.00	1,000.00	14	3.2 1	65.03	0.00	0.00

	0325									
广发证 券	2023 0614 0004 9396	天赐材 料	2023- 06-14	1,631 ,796. 00	42,100.00	7	3.2 0	1,015 .34	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 9597	天顺风 能	2023- 06-14	77,06 1.00	5,100.00	7	3.2 0	47.95	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 9766	天赐材 料	2023- 06-14	263,5 68.00	6,800.00	7	3.2 0	164.0 0	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0004 9925	孚能科 技	2023- 06-14	28,70 4.00	1,300.00	7	3.2 0	17.86	0.00	0.00
广发证 券	2023 0614 0005 1137	太阳能	2023- 06-14	425,3 20.00	62,000.00	7	3.2 0	264.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0001 3784	龙源电 力	2023- 06-15	177,5 65.00	8,500.00	14	3.2 1	221.6 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 2364	阳光电 源	2023- 06-15	2,215 ,400. 00	20,000.00	14	1.0 0	861.5 4	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 4252	华友钴 业	2023- 06-15	444,8 20.00	9,200.00	14	3.1 0	536.2 6	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 5901	TCL 中 环	2023- 06-15	54,86 6.00	1,400.00	14	3.2 0	68.28	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 6254	天合光 能	2023- 06-15	509,5 31.00	12,100.00	14	3.2 0	634.0 8	0.00	0.00
广发证 券	2023 0615 0003 9515	奥特维	2023- 06-15	288,4 80.00	1,600.00	14	3.2 0	359.0 0	0.00	0.00

广发证 券	2023 0616 0001 0568	金风科 技	2023- 06-16	10,82 0.00	1,000.00	14	3.2 1	13.51	0.00	0.00
广发证 券	2023 0616 0002 0374	璞泰来	2023- 06-16	1,566 ,656. 00	44,800.00	14	3.2 1	1,955 .71	0.00	0.00
广发证 券	2023 0620 0001 7476	西藏矿 业	2023- 06-20	278,3 00.00	9,200.00	14	3.2 1	248.1 5	272,596.00	248.15
广发证 券	2023 0621 0001 3183	孚能科 技	2023- 06-21	27,66 4.00	1,300.00	14	3.2 0	22.13	28,067.00	22.13
广发证 券	2023 0621 0001 3259	太阳能	2023- 06-21	422,2 20.00	62,000.00	14	3.2 0	337.7 8	420,360.00	337.78
广发证 券	2023 0621 0001 3307	鹏辉能 源	2023- 06-21	444,9 80.00	9,500.00	14	4.1 0	456.1 0	456,380.00	456.10
广发证 券	2023 0621 0001 5321	天顺风 能	2023- 06-21	15,90 0.00	1,000.00	14	3.2 0	12.72	15,230.00	12.72
广发证 券	2023 0621 0001 5646	天赐材 料	2023- 06-21	1,709 ,260. 00	42,100.00	14	3.2 0	1,367 .41	1,734,099.0 0	1,367.41
广发证 券	2023 0621 0001 5750	天赐材 料	2023- 06-21	276,0 80.00	6,800.00	14	3.2 0	220.8 6	280,092.00	220.86
广发证 券	2023 0626 0003 5743	孚能科 技	2023- 06-26	21,40 0.00	1,000.00	14	3.2 1	7.63	21,590.00	7.63
广发证 券	2023 0626 0003 7449	天奈科 技	2023- 06-26	141,9 99.00	3,300.00	14	3.2 1	50.65	150,975.00	50.65
广发证	2023	融捷股	2023-	68,30	1,000.00	14	3.2	24.36	66,830.00	24.36

券	0626 0003 8618	份	06-26	0.00			1			
广发证 券	2023 0626 0003 9174	中矿资 源	2023- 06-26	1,650 ,880. 00	32,000.00	14	3.7 5	687.8 7	1,630,080.0 0	687.87
广发证 券	2023 0626 0004 5907	天奈科 技	2023- 06-26	215,1 50.00	5,000.00	14	3.2 1	76.74	228,750.00	76.74
广发证 券	2023 0626 0004 6705	容百科 技	2023- 06-26	490,9 62.00	9,400.00	14	3.7 5	204.5 7	507,788.00	204.57
广发证 券	2023 0626 0004 7061	福莱特	2023- 06-26	466,2 50.00	12,500.00	14	3.7 5	194.2 7	481,375.00	194.27
广发证 券	2023 0626 0004 7832	晶澳科 技	2023- 06-26	2,297 ,350. 00	55,000.00	14	3.7 5	957.2 3	2,293,500.0 0	957.23
广发证 券	2023 0626 0004 8749	恩捷股 份	2023- 06-26	573,8 93.00	5,900.00	14	3.7 5	239.1 2	568,465.00	239.12
广发证 券	2023 0627 0000 8168	晶澳科 技	2023- 06-27	89,10 3.00	2,100.00	14	3.4 5	25.62	87,570.00	25.62
广发证 券	2023 0627 0000 8184	雅化集 团	2023- 06-27	123,7 17.00	6,900.00	14	3.2 1	33.09	122,682.00	33.09
广发证 券	2023 0628 0004 9526	容百科 技	2023- 06-28	15,55 5.00	300.00	14	3.2 1	2.77	16,206.00	2.77
广发证 券	2023 0629 0003 0482	天合光 能	2023- 06-29	508,5 63.00	12,100.00	14	3.2 0	45.21	515,581.00	45.21
广发证 券	2023 0629	龙源电 力	2023- 06-29	188,7 85.00	8,500.00	14	3.2 1	16.83	191,250.00	16.83

	0003 1501									
广发证 券	2023 0629 0004 2518	华友钴 业	2023- 06-29	413,4 48.00	9,200.00	14	3.1 0	35.60	422,372.00	35.60
广发证 券	2023 0629 0004 3867	奥特维	2023- 06-29	302,3 68.00	1,600.00	14	3.2 0	26.88	301,440.00	26.88
广发证 券	2023 0629 0004 4385	TCL 中 环	2023- 06-29	45,29 0.00	1,400.00	14	3.2 0	4.03	46,480.00	4.03
广发证 券	2023 0630 0001 8708	金风科 技	2023- 06-30	10,62 0.00	1,000.00	14	3.2 1	0.00	10,620.00	0.00
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日										
关联方 名称	合约 编号	证券名 称	成 交 时间	交易 金额	交易数量 (单位: 股)	出借期 限(单 位: 天)	费 率 (%)	利息 收入	期末证券出 借业务余额	期末应 收利息 余额
广发证 券	2022 0228 0000 0837	天合光 能	2022- 02-28	1,035 ,686. 00	13,400.00	14	3.2 0	1,288 .85	0.00	0.00
广发证 券	2022 0314 0000 5208	天合光 能	2022- 03-14	946,0 40.00	13,400.00	14	3.2 0	1,177 .29	0.00	0.00
广发证 券	2022 0328 0000 4381	天合光 能	2022- 03-28	812,0 40.00	13,400.00	14	3.2 0	1,010 .54	0.00	0.00
广发证 券	2022 0411 0000 6875	天合光 能	2022- 04-11	670,0 00.00	13,400.00	14	3.2 0	833.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0425 0000 4641	天合光 能	2022- 04-25	586,7 86.00	13,400.00	14	3.2 0	730.2 2	0.00	0.00

广发证 券	2022 0429 0000 0778	中信博	2022- 04-29	80,98 5.00	1,500.00	14	3.2 0	100.7 8	0.00	0.00
广发证 券	2022 0509 0001 0511	天合光 能	2022- 05-09	710,0 66.00	13,400.00	14	3.2 0	883.6 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0513 0000 6048	中信博	2022- 05-13	101,9 10.00	1,500.00	14	3.2 0	126.8 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0523 0000 6447	天合光 能	2022- 05-23	851,9 72.00	13,400.00	7	3.2 0	530.1 2	0.00	0.00
广发证 券	2022 0527 0000 6014	中信博	2022- 05-27	110,7 00.00	1,500.00	7	3.2 0	98.40	0.00	0.00
广发证 券	2022 0530 0000 3874	天合光 能	2022- 05-30	830,8 00.00	13,400.00	7	3.2 0	516.9 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 3228	天合光 能	2022- 06-06	882,3 90.00	13,400.00	7	3.2 0	549.0 4	0.00	0.00
广发证 券	2022 0606 0001 3602	中信博	2022- 06-06	136,2 30.00	1,500.00	7	3.2 0	84.77	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0001 9557	中信博	2022- 06-13	124,9 80.00	1,500.00	7	3.2 0	77.77	0.00	0.00
广发证 券	2022 0613 0001 9559	天合光 能	2022- 06-13	806,6 80.00	13,400.00	7	3.2 0	501.9 3	0.00	0.00
广发证 券	2022 0620 0001 5010	中信博	2022- 06-20	136,8 45.00	1,500.00	14	3.2 0	121.6 4	138,720.00	121.64
广发证	2022	天合光	2022-	851,1	13,400.00	14	3.2	756.5	874,350.00	756.59

券	0620 0001 5024	能	06-20	68.00			0	9		
广发证 券	2022 0623 0000 1750	固德威	2022- 06-23	303,9 19.00	1,100.00	14	2.0 0	118.1 9	344,311.00	118.19
广发证 券	2022 0630 0000 1080	晶盛机 电	2022- 06-30	770,5 26.00	11,400.00	14	3.2 0	0.00	770,526.00	0.00

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本报告期内和上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金 份额占基金 总份额的比 例	持有的基金份额	持有的基金份 额占基金总份 额的比例
广发证券股份有 限公司	4,340,129.00	0.3189%	5,937,200.00	0.8669%

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等相关法律文件有关规定支付。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2023年1月1日至2023年6月30日		2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行-活期存款	8,003,700.57	10,813.05	7,733,189.62	11,225.83

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	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： 股/张）	总金额
广发证券股份 有限公司	301376	致欧科技	新股网下 发行	4,192	103,374.72
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	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： 股/张）	总金额
广发证券股份 有限公司	301181	标榜股份	新股网下 发行	2,564	103,201.00
广发证券股份 有限公司	301220	亚香股份	新股网下 发行	2,849	102,507.02

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未发生利润分配。

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

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限 期	流通 受 限类 型	认购 价格	期末估 值单价	数量(单 位：股)	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
00128 2	三联 锻造	2023-0 5-15	6 个月	新股 流通 受限	27.93	33.03	105	2,932. 65	3,468. 15	-
00128 6	陕西 能源	2023-0 3-31	6 个月	新股 流通 受限	9.60	9.41	3,767	36,163 .20	35,447 .47	-
00128 7	中电 港	2023-0 3-30	6 个月	新股 流通 受限	11.88	21.02	640	7,603. 20	13,452 .80	-
00132 4	长青 科技	2023-0 5-12	6 个月	新股 流通	18.88	19.60	114	2,152. 32	2,234. 40	-

				受限						
001328	登康口腔	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6 个月	新股流通受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6 个月	新股流通受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月以内	新股流通受限	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新股流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新股流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301281	科源制药	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	38.13	31.03	1,034	39,426.42	32,085.02	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新股流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301301	川宁生物	2022-12-20	6 个月	新股流通受限	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
30130	朗坤	2023-0	6 个月	新股	25.25	19.69	753	19,013	14,826	-

5	环境	5-15		流通受限				.25	.57	
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新股流通受限	32.34	31.86	673	21,764.82	21,441.78	-
301315	威士顿	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	73.45	46.64	196	14,396.20	9,141.44	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新股流通受限	23.77	42.89	554	13,168.58	23,761.06	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新股流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6 个月	新股流通受限	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新股流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新股流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301386	未来电器	2023-03-21	6 个月	新股流通受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-

301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新股流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6 个月	新股流通受限	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新股流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6 个月	新股流通受限	19.99	16.90	623	12,453.77	10,528.70	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月以内	新股流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新股流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月以内	新股流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新股流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601061	中信金属	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	6.58	7.58	1,473	9,692.34	11,165.34	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	10.36	11.84	617	6,392.12	7,305.28	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新股流通受限	11.66	12.26	472	5,503.52	5,786.72	-
603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新股流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新股流通受限	17.80	17.89	486	8,650.80	8,694.54	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6 个月	新股流通	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-

				受限						
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新股流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	36.15	38.13	486	17,568.90	18,531.18	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新股流通受限	19.86	18.06	3,419	67,901.34	61,747.14	-
688334	西高院	2023-06-09	6 个月	新股流通受限	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新股流通受限	12.10	12.07	1,425	17,242.50	17,199.75	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	23.60	64.67	535	12,626.00	34,598.45	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新股流通受限	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新股流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新股流通受限	37.88	29.49	1,638	62,047.44	48,304.62	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新股流通受限	11.10	17.04	2,873	31,890.30	48,955.92	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6 个月	新股流通受限	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新股流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新股流通受限	245.56	122.11	121	20,135.92	14,775.31	-
688522	纳睿雷达	2023-02-22	6 个月	新股流通受限	46.68	51.50	3,141	146,621.88	161,761.50	-
68852	航天	2023-0	6 个月	新股	21.86	23.85	472	10,317	11,257	-

3	环宇	5-26		流通受限				.92	.20	
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新股流通受限	152.38	135.97	173	26,361.74	23,522.81	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新股流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新股流通受限	21.17	23.50	837	17,719.29	19,669.50	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新股流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新股流通受限	30.26	25.33	865	26,174.90	21,910.45	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新股流通受限	125.80	118.03	142	17,863.60	16,760.26	-
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新股流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
688593	新相微	2023-05-25	6 个月	新股流通受限	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
688620	安凯微	2023-06-15	6 个月	新股流通受限	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
688623	双元科技	2023-05-31	6 个月	新股流通受限	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688629	华丰科技	2023-06-16	6 个月	新股流通受限	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新股流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

注：基金持有的股票在流通受限期内，如获得股票红利、送股、转增股、配股的，则此新增股票的流通受限期和估值价格与相应原股票一致。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 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	000537	广宇发展	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	11.67	21,000.00	245,070.00
2	000591	太阳能	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	6.78	95,200.00	645,456.00
3	000762	西藏矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	29.63	21,800.00	645,934.00
4	001289	龙源电力	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	22.50	8,500.00	191,250.00
5	002074	国轩高科	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	27.62	1,000.00	27,620.00
6	002080	中材科技	2023 年 7 月 14 日 -2023 年 7 月 14 日	20.52	15,900.00	326,268.00
7	002129	TCL 中环	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	33.20	62,100.00	2,061,720.00
8	002192	融捷股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	66.83	6,600.00	441,078.00
9	002202	金风科技	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	10.62	57,500.00	610,650.00
10	002240	盛新锂能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	31.87	34,400.00	1,096,328.00
11	002340	格林美	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	6.91	190,300.00	1,314,973.00
12	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	41.70	87,400.00	3,644,580.00
13	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	60.96	45,800.00	2,791,968.00
14	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	69.91	15,900.00	1,111,569.00

15	002487	大金重工	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.84	17,900.00	552,036.00
16	002497	雅化集团	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 11 日	17.78	61,900.00	1,100,582.00
17	002518	科士达	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	40.01	12,000.00	480,120.00
18	002531	天顺风能	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	15.23	47,100.00	717,333.00
19	002709	天赐材料	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	41.19	51,900.00	2,137,761.00
20	002738	中矿资源	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	50.94	32,000.00	1,630,080.00
21	002756	永兴材料	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	62.61	17,100.00	1,070,631.00
22	002812	恩捷股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 12 日	96.35	31,500.00	3,035,025.00
23	002850	科达利	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	132.25	7,500.00	991,875.00
24	003035	南网能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	7.12	80,100.00	570,312.00
25	003816	中国广核	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	3.11	384,000.00	1,194,240.00
26	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	60.50	55,800.00	3,375,900.00
27	300037	新宙邦	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 4 日	51.89	3,300.00	171,237.00
28	300073	当升科技	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	50.33	1,000.00	50,330.00
29	300118	东方日升	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	25.63	31,600.00	809,908.00
30	300316	晶盛机电	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	70.90	32,200.00	2,282,980.00
31	300390	天华新能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	35.80	13,500.00	483,300.00
32	300438	鹏辉能源	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 12 日	48.04	14,200.00	682,168.00
33	300450	先导智能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	36.17	26,700.00	965,739.00
34	300568	星源材质	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 12 日	17.19	27,700.00	476,163.00
35	300750	宁德时代	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	228.79	22,700.00	5,193,533.00
36	300751	迈为股份	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	169.38	2,100.00	355,698.00

37	300763	锦浪科技	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	104.1 0	10,000.00	1,041,000.0 0
38	300769	德方纳米	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	110.2 3	12,000.00	1,322,760.0 0
39	300776	帝尔激光	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	64.90	4,900.00	318,010.00
40	300850	新强联	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	37.38	10,000.00	373,800.00
41	600032	浙江新能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 12 日	12.56	2,100.00	26,376.00
42	600416	湘电股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	19.09	34,300.00	654,787.00
43	600438	通威股份	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	34.31	140,000.00	4,803,400.0 0
44	600549	厦门钨业	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	19.03	17,300.00	329,219.00
45	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.75	49,400.00	1,519,050.0 0
46	600884	杉杉股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	15.14	45,200.00	684,328.00
47	600905	三峡能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	5.37	358,400.00	1,924,608.0 0
48	601016	节能风电	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	3.67	166,900.00	612,523.00
49	601615	明阳智能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	16.88	43,300.00	730,904.00
50	601865	福莱特	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	38.51	27,000.00	1,039,770.0 0
51	603185	弘元绿能	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 12 日	74.55	5,600.00	417,480.00
52	603799	华友钴业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	45.91	70,800.00	3,250,428.0 0
53	603806	福斯特	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	37.19	32,000.00	1,190,080.0 0
54	688005	容百科技	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	54.02	17,000.00	918,340.00
55	688032	禾迈股份	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 12 日	355.1 5	1,700.00	603,755.00
56	688063	派能科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	198.2 5	4,700.00	931,775.00
57	688116	天奈科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 12 日	45.75	11,700.00	535,275.00
58	688223	晶科能源	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 11 日	14.06	112,200.00	1,577,532.0 0

59	688303	大全能源	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 13 日	40.45	34,300.00	1,387,435.00
60	688390	固德威	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	166.86	5,500.00	917,730.00
61	688516	奥特维	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	188.40	4,100.00	772,440.00
62	688567	孚能科技	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	21.59	41,300.00	891,667.00
63	688598	金博股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	171.50	4,500.00	771,750.00
64	688599	天合光能	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	42.61	61,000.00	2,599,210.00
65	688707	振华新材	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	30.79	14,300.00	440,297.00
66	688778	厦钨新能	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	49.50	8,700.00	430,650.00
67	688779	长远锂科	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	11.27	45,400.00	511,658.00
合计	-	-	-	-	3,032,800.00	77,009,452.00

注：出借证券中如有其他流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

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

本基金管理人按照“自上而下与自下而上相结合，全面管理、专业分工”的思路，将风险控制嵌入到全公司的组织架构中，对风险实行多层次、多角度、全方位的管理。从投资决策的层次看，投资决策委员会、投资总监、基金投资部门总经理和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，并根据其不同权限实施风险控制；从岗位职能的分工上看，基金经理、监察合规管理部门、集中交易部门、核算部以及投资风险管理部从不同角度、不同环节对投资的全过程实行风险监控和管理；从投资管理的流程看，已经形成了一套贯穿“事前的风险定位、事中的风险管理和事后的风险评估”的健全的风险监控体系。

本基金为股票型基金，预期风险与预期收益水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指包括债券发行人出现拒绝支付利息或到期时拒绝支付本息的违约风险，或由于债券发行人信用质量降低导致债券价格下跌的风险，及因交易对手违约而产生的交割风险。本基金管

理人建立了内部信用评级制度，通过严格的备选库制度和分散化投资方式防范信用风险。本基金在交易所进行的证券交易交收和款项清算对手为中国证券登记结算有限责任公司，在银行间同业市场主要通过交易对手库制度防范交易对手风险。本基金参与转融通证券出借业务，其中非约定申报出借证券均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，本基金的基金管理人对于约定申报的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，因此，本基金违约风险可能性很小。于 2023 年 6 月 30 日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0.00%(2022 年 12 月 31 日：0.00%)。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限在一年以内的国债、政策性金融债、央票及未有第三方机构评级的短期融资券。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	0.00	0.00
A-1 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

注：1. 债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

2. 未评级债券为剩余期限大于一年的国债、政策性金融债和央票。

3. 债券投资以全价列示。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	0.00	0.00
AAA 以下	0.00	0.00
未评级	0.00	0.00
合计	0.00	0.00

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指包括因市场交易量不足，导致基金管理人不能以合理价格及时进行证券交易的风险，或投资组合无法应付客户赎回要求所引起的违约风险。本基金采用分散投资、控制流通受限证券比例等方式防范流动性风险，同时公司已经建立全覆盖、多维度以压力测试为核心的开放式基金流动性风险监测与预警制度，投资风险管理部独立于投资部门负责流动性压力测试的实施与评估。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。于 2023 年 6 月 30 日，除卖出回购金融资产款余额(计息但该利息金额不重大)以外，本基金承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额约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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，所持大部分证券在流动性良好的证券交易所或者银行间同业市场交易，除本报告期末本基金持有的流通受限证券章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，其余均能及时变现。评估结果显示组合高流动性资产比重较高，组合变现比例能力较好。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指因受各种因素影响而引起的基金所持证券及其衍生品市场价格不利波动，使基金资产面临损失的风险，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

利率风险是指基金的财务状况和现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。投资管理人通过久期、凸度、VAR 等方法评估组合面临的利率风险敞口，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 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,003,700.57	-	-	-	8,003,700.57
结算备付金	666,370.99	-	-	-	666,370.99
存出保证金	158,453.12	-	-	-	158,453.12

交易性金融资产	-	-	-	727,310,506.64	727,310,506.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	4,617,768.28	4,617,768.28
应收股利	-	-	-	99,920.80	99,920.80
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	106,253.23	106,253.23
资产总计	8,828,524.68	-	-	732,134,448.95	740,962,973.63
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	3,872,232.27	3,872,232.27
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	90,080.21	90,080.21
应付托管费	-	-	-	30,026.73	30,026.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	5,649.03	5,649.03
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	2,372,705.86	2,372,705.86
负债总计	-	-	-	6,370,694.10	6,370,694.10
利率敏感度缺口	8,828,524.68	-	-	725,763,754.85	734,592,279.53
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	4,307,043.30	-	-	-	4,307,043.30
结算备付金	505,970.90	-	-	-	505,970.90

存出保证金	117,791.30	-	-	-	117,791.30
交易性金融资产	-	-	-	408,492,321.64	408,492,321.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	923,018.41	923,018.41
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	26,213.24	26,213.24
资产总计	4,930,805.50	-	-	409,441,553.29	414,372,358.79
负债	-	-	-	-	-
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	681,624.30	681,624.30
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	53,700.25	53,700.25
应付托管费	-	-	-	17,900.08	17,900.08
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	3,325.48	3,325.48
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	710,089.77	710,089.77
负债总计	-	-	-	1,466,639.88	1,466,639.88
利率敏感度缺口	4,930,805.50	-	-	407,974,913.41	412,905,718.91

注：各期限分类的标准为按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本期末本基金未持有交易性债券投资(不包括可转债)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

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。

本基金的基金管理人采用 Barra 风险管理系统，通过标准差、跟踪误差、beta 值、VAR 等指标，监控投资组合面临的市场价格波动风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	727,310,506.64	99.01	408,492,321.64	98.93
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	727,310,506.64	99.01	408,492,321.64	98.93

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	1.业绩比较基准上升 5%	36,290,275.29	20,397,225.88
	2.业绩比较基准下降 5%	-36,290,275.29	-20,397,225.88

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	725,674,395.31
第二层次	461,074.44
第三层次	1,175,036.89
合计	727,310,506.64

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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	727,310,506.64	98.16

	其中：股票	727,310,506.64	98.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,670,071.56	1.17
8	其他各项资产	4,982,395.43	0.67
9	合计	740,962,973.63	100.00

注：1.上表中的权益投资含可退替代款估值增值。

2.本基金本报告期末融出证券市值为 77,009,452.00 元，占净值比例 10.48%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	7,031,410.00	0.96
C	制造业	650,831,253.99	88.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	57,983,304.67	7.89
E	建筑业	8,162.23	0.00
F	批发和零售业	48,971.39	0.01
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	89,804.45	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	1,741,164.00	0.24

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,894,434.48	0.39
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	6,643,328.00	0.90
	合计	727,310,442.64	99.01

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值 比例（%）
1	300750	宁德时代	318,320	72,828,432.80	9.91
2	601012	隆基绿能	1,616,798	46,353,598.66	6.31
3	300274	阳光电源	277,500	32,364,825.00	4.41
4	002129	TCL 中环	861,375	28,597,650.00	3.89
5	600438	通威股份	719,700	24,692,907.00	3.36
6	600089	特变电工	1,037,000	23,114,730.00	3.15
7	600905	三峡能源	3,814,600	20,484,402.00	2.79
8	300014	亿纬锂能	326,621	19,760,570.50	2.69
9	002466	天齐锂业	275,900	19,288,169.00	2.63
10	002460	赣锋锂业	301,420	18,374,563.20	2.50
11	002459	晶澳科技	439,024	18,307,300.80	2.49
12	601985	中国核电	2,515,400	17,733,570.00	2.41
13	603799	华友钴业	340,660	15,639,700.60	2.13
14	002812	恩捷股份	156,800	15,107,680.00	2.06
15	002709	天赐材料	307,100	12,649,449.00	1.72
16	300316	晶盛机电	175,000	12,407,500.00	1.69
17	688599	天合光能	290,173	12,364,271.53	1.68
18	300450	先导智能	292,780	10,589,852.60	1.44
19	603659	璞泰来	268,993	10,280,912.46	1.40
20	002340	格林美	1,369,000	9,459,790.00	1.29
21	600732	爱旭股份	292,700	9,000,525.00	1.23
22	300724	捷佳伟创	73,700	8,280,195.00	1.13
23	601877	正泰电器	286,600	7,924,490.00	1.08
24	002074	国轩高科	284,900	7,868,938.00	1.07

25	002202	金风科技	735,900	7,815,258.00	1.06
26	002738	中矿资源	152,300	7,758,162.00	1.06
27	688223	晶科能源	533,560	7,501,853.60	1.02
28	603806	福斯特	198,126	7,368,305.94	1.00
29	300037	新宙邦	139,340	7,230,352.60	0.98
30	601615	明阳智能	424,600	7,167,248.00	0.98
31	688303	大全能源	169,988	6,876,014.60	0.94
32	300769	德方纳米	60,284	6,645,105.32	0.90
33	000009	中国宝安	550,400	6,643,328.00	0.90
34	003816	中国广核	2,096,900	6,521,359.00	0.89
35	300751	迈为股份	37,527	6,356,323.26	0.87
36	300568	星源材质	341,259	5,866,242.21	0.80
37	300390	天华新能	156,660	5,608,428.00	0.76
38	300763	锦浪科技	53,505	5,569,870.50	0.76
39	600875	东方电气	296,600	5,531,590.00	0.75
40	002497	雅化集团	306,300	5,446,014.00	0.74
41	002240	盛新锂能	170,700	5,440,209.00	0.74
42	300073	当升科技	107,800	5,425,574.00	0.74
43	002756	永兴材料	85,810	5,372,564.10	0.73
44	601865	福莱特	135,700	5,225,807.00	0.71
45	002850	科达利	38,008	5,026,558.00	0.68
46	000591	太阳能	727,900	4,935,162.00	0.67
47	688567	孚能科技	226,544	4,891,084.96	0.67
48	688063	派能科技	23,684	4,695,353.00	0.64
49	300118	东方日升	183,000	4,690,290.00	0.64
50	688390	固德威	27,912	4,657,396.32	0.63
51	688005	容百科技	85,172	4,600,991.44	0.63
52	600884	杉杉股份	302,194	4,575,217.16	0.62
53	688598	金博股份	25,373	4,351,469.50	0.59
54	600549	厦门钨业	226,600	4,312,198.00	0.59
55	300919	中伟股份	70,900	4,271,725.00	0.58
56	600481	双良节能	299,600	4,188,408.00	0.57
57	603185	弘元绿能	55,400	4,130,070.00	0.56
58	300438	鹏辉能源	85,400	4,102,616.00	0.56
59	002056	横店东磁	216,100	3,935,181.00	0.54
60	688516	奥特维	20,879	3,933,603.60	0.54
61	601016	节能风电	1,036,060	3,802,340.20	0.52
62	002192	融捷股份	56,000	3,742,480.00	0.51
63	002080	中材科技	179,800	3,689,496.00	0.50
64	002531	天顺风能	239,700	3,650,631.00	0.50
65	600416	湘电股份	177,500	3,388,475.00	0.46
66	000762	西藏矿业	111,000	3,288,930.00	0.45
67	688032	禾迈股份	8,897	3,159,769.55	0.43
68	688779	长远锂科	257,232	2,899,004.64	0.39

69	003035	南网能源	404,500	2,880,040.00	0.39
70	688116	天奈科技	62,713	2,869,119.75	0.39
71	000155	川能动力	195,800	2,819,520.00	0.38
72	002487	大金重工	84,300	2,599,812.00	0.35
73	002518	科士达	62,800	2,512,628.00	0.34
74	300776	帝尔激光	36,800	2,388,320.00	0.33
75	688778	厦钨新能	45,395	2,247,052.50	0.31
76	688707	振华新材	71,679	2,206,996.41	0.30
77	300850	新强联	53,400	1,996,092.00	0.27
78	000537	广宇发展	149,200	1,741,164.00	0.24
79	001289	龙源电力	40,800	918,000.00	0.12
80	600032	浙江新能	58,400	733,504.00	0.10
81	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.04
82	688522	纳睿雷达	3,141	161,761.50	0.02
83	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
84	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
85	688249	晶合集成	3,419	61,747.14	0.01
86	688472	阿特斯	2,873	48,955.92	0.01
87	688443	智翔金泰	1,638	48,304.62	0.01
88	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
89	688361	中科飞测	535	34,598.45	0.00
90	301291	明阳电气	1,034	32,085.02	0.00
91	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
92	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
93	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
94	301358	湖南裕能	554	23,761.06	0.00
95	688531	日联科技	173	23,522.81	0.00
96	688570	天玛智控	865	21,910.45	0.00
97	301307	美利信	673	21,441.78	0.00
98	688552	航天南湖	837	19,669.50	0.00
99	688146	中船特气	486	18,531.18	0.00
100	688352	硕中科技	1,425	17,199.75	0.00
101	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
102	688581	安杰思	142	16,760.26	0.00
103	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
104	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
105	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
106	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
107	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
108	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
109	688507	索辰科技	121	14,775.31	0.00
110	301397	溯联股份	362	14,552.40	0.00
111	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
112	688334	西高院	888	14,394.48	0.00

113	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
114	001287	中电港	640	13,452.80	0.00
115	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
116	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
117	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
118	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
119	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
120	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
121	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
122	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
123	601061	中信金属	1,473	11,165.34	0.00
124	301439	泓淋电力	623	10,528.70	0.00
125	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
126	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
127	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
128	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
129	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
130	301345	涛涛车业	196	9,141.44	0.00
131	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
132	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
133	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
134	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
135	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
136	603135	中重科技	486	8,694.54	0.00
137	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
138	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
139	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
140	300804	广康生化	226	7,451.22	0.00
141	601065	江盐集团	617	7,305.28	0.00
142	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
143	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
144	601133	柏诚股份	472	5,786.72	0.00
145	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
146	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
147	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
148	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
149	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
150	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
151	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
152	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	300750	宁德时代	80,258,600.76	19.44
2	002129	TCL 中环	26,693,888.66	6.46
3	300274	阳光电源	26,331,422.04	6.38
4	600089	特变电工	24,241,966.00	5.87
5	300014	亿纬锂能	21,376,821.34	5.18
6	002460	赣锋锂业	20,581,900.29	4.98
7	002466	天齐锂业	17,632,184.25	4.27
8	002459	晶澳科技	14,234,321.16	3.45
9	002812	恩捷股份	14,089,423.93	3.41
10	002709	天赐材料	13,041,765.62	3.16
11	300724	捷佳伟创	12,156,799.95	2.94
12	300316	晶盛机电	11,784,982.78	2.85
13	300450	先导智能	11,693,396.66	2.83
14	002738	中矿资源	9,538,970.40	2.31
15	002340	格林美	8,974,876.00	2.17
16	600905	三峡能源	7,500,679.00	1.82
17	002192	融捷股份	7,454,757.22	1.81
18	300919	中伟股份	7,382,948.00	1.79
19	002202	金风科技	7,095,419.00	1.72
20	688223	晶科能源	7,002,579.91	1.70

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	52,729,505.63	12.77
2	300274	阳光电源	12,981,572.00	3.14
3	002129	TCL 中环	12,611,984.25	3.05
4	002460	赣锋锂业	11,269,703.40	2.73
5	300014	亿纬锂能	11,044,863.00	2.67
6	300724	捷佳伟创	8,310,592.20	2.01
7	601012	隆基绿能	8,076,279.25	1.96
8	002466	天齐锂业	7,810,646.74	1.89
9	002709	天赐材料	7,129,956.64	1.73
10	300316	晶盛机电	6,327,035.00	1.53

11	300450	先导智能	6,269,318.00	1.52
12	002192	融捷股份	5,322,837.00	1.29
13	002812	恩捷股份	5,297,048.80	1.28
14	002459	晶澳科技	4,715,709.38	1.14
15	300919	中伟股份	4,630,988.98	1.12
16	603185	弘元绿能	4,478,117.20	1.08
17	002506	协鑫集成	4,339,443.00	1.05
18	002340	格林美	4,338,793.00	1.05
19	000875	吉电股份	3,798,220.00	0.92
20	300438	鹏辉能源	3,730,600.89	0.90

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	542,202,021.35
卖出股票收入（成交）总额	290,951,198.59

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末投资股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末投资国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中,通威股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广东省惠州市博罗县交通运输局的处罚。

本基金为指数型基金,上述主体所发行的证券系标的指数成份股,上述主体所发行证券的投资决策程序符合公司投资制度的规定。

除上述主体外,基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

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	158,453.12
2	应收清算款	4,617,768.28
3	应收股利	99,920.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	30,636.99
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-

9	合计	4,982,395.43
---	----	--------------

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产净 值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	5,193,533.00	0.71	转融通流通受限
2	600438	通威股份	4,803,400.00	0.65	转融通流通受限
3	300014	亿纬锂能	3,375,900.00	0.46	转融通流通受限
4	002460	赣锋锂业	2,791,968.00	0.38	转融通流通受限
5	002129	TCL 中环	2,061,720.00	0.28	转融通流通受限
6	600905	三峡能源	1,924,608.00	0.26	转融通流通受限
7	002466	天齐锂业	1,111,569.00	0.15	转融通流通受限

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额 比例	持有份额	占总份额 比例
26,978	50,442.76	138,715,162.00	10.19%	1,222,129,590.00	89.81%

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	平安证券—建设银行—平安证券星耀烁华1号集合资产管理计划	38,321,000.00	2.82%

2	江文彬	19,848,800.00	1.46%
3	中国国际金融股份有限公司	13,255,589.00	0.97%
4	程小林	10,280,200.00	0.76%
5	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	9,585,800.00	0.70%
6	桑宏钰	7,350,100.00	0.54%
7	李相谨	7,325,700.00	0.54%
8	傅智雄	7,000,000.00	0.51%
9	章艺兵	7,000,000.00	0.51%
10	银华乾利 2 号股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	6,156,400.00	0.45%

注：本表统计的上市基金前十名持有人均为场内持有人。

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	0.00	0.0000%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2021 年 3 月 11 日）基金份额总额	266,922,376.00
本报告期期初基金份额总额	684,844,752.00
本报告期基金总申购份额	1,021,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	345,000,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,360,844,752.00

§ 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

本基金管理人于 2023 年 4 月 22 日发布公告，自 2023 年 4 月 22 日起聘任王骏先生为副总经理级高级管理人员（首席市场官）。

本报告期内本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金的投资策略未有重大变化。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	易方达基金管理有限公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2023-03-24
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会广东监管局
受到的具体措施类型	出具警示函

受到稽查或处罚等措施的原因	个别规定及制度未严格执行
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	已整改完成
其他	/

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，基金托管人托管业务部门及其相关高级管理人员未受到稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方财富	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	154,084,623.46	18.73%	37,008.61	15.17%	-
华创证券	2	180,402,903.37	21.93%	18,042.58	7.40%	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	4	488,191,620.46	59.34%	188,892.84	77.43%	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

注：a) 本报告期内本基金无减少交易单元，无新增交易单元。

b) 本基金管理人负责选择证券经营机构，租用其交易单元作为本基金的交易单元。基金交易单元的选择标准如下：

- 1) 经营行为稳健规范，内控制度健全，在业内有良好的声誉；
- 2) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- 3) 具有较强的全方位金融服务能力和水平，包括但不限于：有较好的研究能力和行业分析能力，能及时、全面地向公司提供高质量的关于宏观、行业及市场走向、个股分析报告及丰富全面的信息；能根据公司所管理基金的特定要求，提供专门研究报告，具有开发量化投资组合模型的能力；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

c) 基金交易单元的选择程序如下：

- 1) 本基金管理人根据上述标准考察后确定选用交易单元的证券经营机构。
- 2) 基金管理人和被选中的证券经营机构签订交易单元租用协议。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
长江证券	-	-	-	-	-	-
东方财富	-	-	-	-	-	-
广发证券	627,134.70	100.00%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年第 4 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-01-20
2	易方达基金管理有限公司旗下基金 2022 年年度报告提示性公告	中国证券报	2023-03-30
3	易方达基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
4	易方达基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 1 季度报告提示性公告	中国证券报	2023-04-21
5	易方达基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-22
6	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加万联证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-04-25
7	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加德邦证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-05-26
8	易方达基金管理有限公司旗下部分 ETF 增加华福证券为一级交易商的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-06

9	易方达基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
---	----------------------------	-----------------------------	------------

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1.中国证监会准予易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金注册的文件；
- 2.《易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3.《易方达中证新能源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4.基金管理人业务资格批件和营业执照。

11.2 存放地点

广州市天河区珠江新城珠江东路 30 号广州银行大厦 40-43 楼。

11.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

易方达基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日