

嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资 基金 2020 年年度报告

2020 年 12 月 31 日

基金管理人：嘉实基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：2021 年 3 月 30 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。本年度报告已经全部独立董事签字同意，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 2021 年 03 月 23 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。

本报告期自 2020 年 01 月 01 日起至 2020 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
3.4 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明	15
4.10 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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	20
7.4 报表附注	22

§ 8 投资组合报告	204
8.1 期末基金资产组合情况	204
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	205
8.3 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	206
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	219
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	220
8.6 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	221
8.7 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	221
8.8 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	221
8.9 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	221
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	221
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	222
8.12 投资组合报告附注	222
§ 9 基金份额持有人信息	223
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	223
9.2 期末上市基金前十名持有人	224
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	224
9.4 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	225
§ 10 开放式基金份额变动	225
§ 11 重大事件揭示	225
11.1 基金份额持有人大会决议	225
11.2 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	225
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	225
11.4 基金投资策略的改变	226
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	226
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	226
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	226
11.8 其他重大事件	229
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	230
12.1 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	230
§ 13 备查文件目录	230
13.1 备查文件目录	230
13.2 存放地点	230
13.3 查阅方式	231

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	嘉实中证 500ETF
场内简称	500ETF
基金主代码	159922
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2013 年 2 月 6 日
基金管理人	嘉实基金管理有限公司
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	527,931,868.00 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	2013 年 3 月 15 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金进行被动式指数化投资，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	<p>本基金采取完全复制法，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。但因特殊情况（如流动性原因）导致无法获得足够数量的股票时，或者因为法律法规的限制无法投资某只股票时，基金管理人将采用其他指数投资技术适当调整基金投资组合，以达到跟踪标的指数的目的；</p> <p>本基金日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年化跟踪误差不超过 2%；本基金可投资股指期货和其他经中国证监会允许的衍生金融产品，如期权、权证以及其他与标的指数或标的指数成份股、备选成份股相关的衍生工具。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约；</p> <p>本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的；</p>
业绩比较基准	中证 500 指数
风险收益特征	本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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	嘉实基金管理有限公司	中国建设银行股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	胡勇钦	李申
	联系电话	(010)65215588	021-60637102
	电子邮箱	service@jsfund.cn	lishen.zh@ccb.com
客户服务电话		400-600-8800	021-60637111
传真		(010)65215588	021-60635778
注册地址		中国（上海）自由贸易试验区世纪大道 8 号上海国金中心二期 27 楼 09-14 单元	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址		北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层	北京市西城区闹市口大街 1 号院 1 号楼
邮政编码		100005	100033
法定代表人		经雷	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	《上海证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.jsfund.cn
基金年度报告备置地点	北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2020 年	2019 年	2018 年
本期已实现收益	921,499,740.31	-33,945,605.04	-114,993,316.90
本期利润	833,969,075.34	473,996,397.93	-448,641,628.78
加权平均基金份额本期利润	1.7109	1.0364	-2.0710
本期加权平均净值利润率	27.17%	19.75%	-38.82%
本期基金	25.02%	28.00%	-32.24%

份额净值增长率			
3.1.2 期末数据和指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
期末可供分配利润	1,794,960,434.33	1,255,320,111.22	229,686,666.35
期末可供分配基金份额利润	3.4000	2.0055	0.7865
期末基金资产净值	3,677,862,359.06	3,487,745,146.67	1,271,236,532.11
期末基金份额净值	6.9665	5.5721	4.3531
3.1.3 累计期末指标	2020 年末	2019 年末	2018 年末
基金份额累计净值增长率	95.33%	56.23%	22.05%

注：（1）本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

（3）期末可供分配利润采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

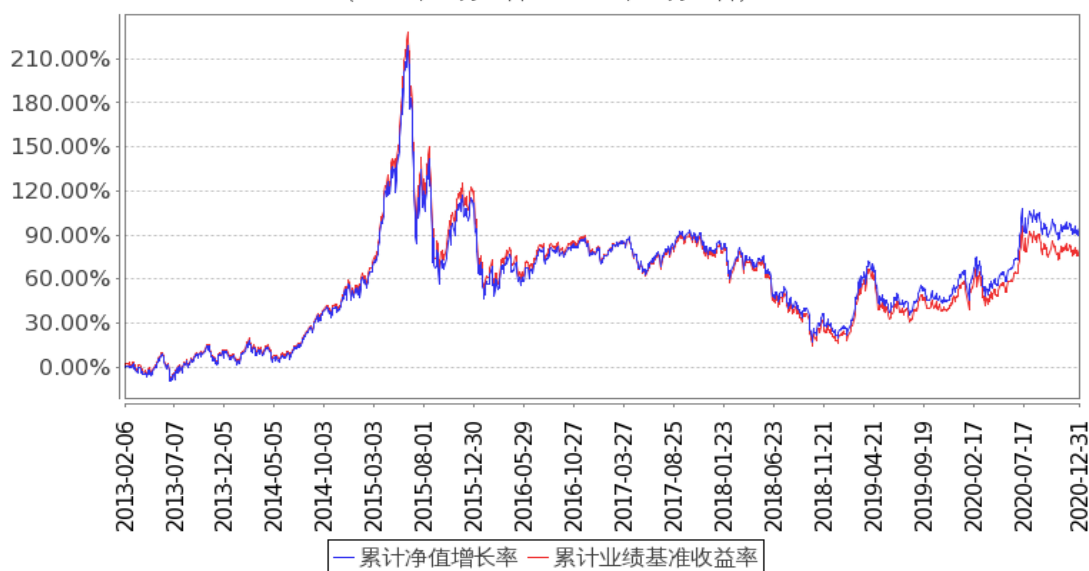
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	3.10%	1.16%	2.82%	1.16%	0.28%	0.00%
过去六个月	10.80%	1.43%	8.57%	1.45%	2.23%	-0.02%
过去一年	25.02%	1.61%	20.87%	1.62%	4.15%	-0.01%

过去三年	8.44%	1.53%	1.86%	1.54%	6.58%	-0.01%
过去五年	-6.39%	1.50%	-16.42%	1.52%	10.03%	-0.02%
自基金合同生效起至今	95.33%	1.69%	80.85%	1.70%	14.48%	-0.01%

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

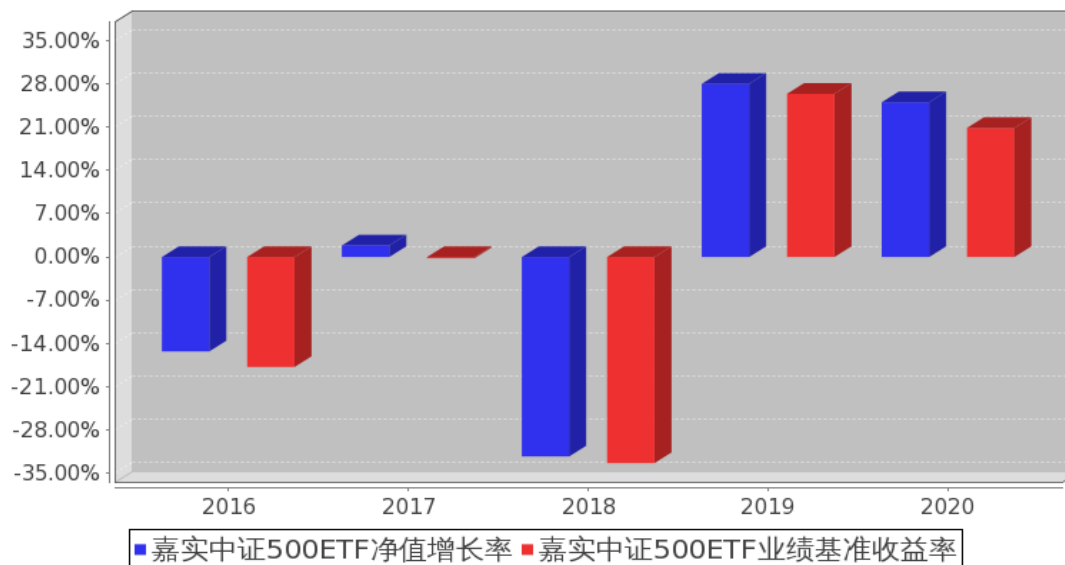
嘉实中证500ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2013年02月06日至2020年12月31日)



注：按基金合同和招募说明书的约定，本基金自基金合同生效日起3个月为建仓期，建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合基金合同约定。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

嘉实中证500ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



注：上述数据根据基金当年实际存续期计算。

3.3 其他指标

无。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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

嘉实基金管理有限公司经中国证监会证监基字[1999]5号文批准，于1999年3月25日成立，是中国第一批基金管理公司之一，是中外合资基金管理公司。公司注册地上海，总部设在北京并设北京、深圳、成都、杭州、青岛、南京、福州、广州、北京怀柔、武汉分公司。公司获得首批全国社保基金、企业年金投资管理人、QDII资格和特定资产管理业务资格。

截止2020年12月31日，基金管理人共管理205只开放式证券投资基金，具体包括嘉实成长收益混合、嘉实增长混合、嘉实稳健混合、嘉实债券、嘉实服务增值行业混合、嘉实优质企业混合、嘉实货币、嘉实沪深300ETF联接（LOF）、嘉实超短债债券、嘉实主题混合、嘉实策略混合、嘉实海外中国股票混合（QDII）、嘉实研究精选混合、嘉实多元债券、嘉实量化阿尔法混合、嘉实回报混合、嘉实基本面50指数（LOF）、嘉实稳固收益债券、嘉实价值优势混合、嘉实H股指数（QDII-LOF）、嘉实主题新动力混合、嘉实领先成长混合、嘉实深证基本面120ETF、嘉实深证基

本面 120ETF 联接、嘉实黄金 (QDII-FOF-LOF)、嘉实信用债券、嘉实周期优选混合、嘉实安心货币、嘉实中创 400ETF、嘉实中创 400ETF 联接、嘉实沪深 300ETF、嘉实优化红利混合、嘉实全球房地产 (QDII)、嘉实理财宝 7 天债券、嘉实纯债债券、嘉实中证 500ETF、嘉实增强信用定期债券、嘉实中证 500ETF 联接、嘉实中证中期国债 ETF、嘉实中证金边中期国债 ETF 联接、嘉实丰益纯债定期债券、嘉实研究阿尔法股票、嘉实如意宝定期债券、嘉实美国成长股票 (QDII)、嘉实丰益策略定期债券、嘉实新兴市场债券、嘉实绝对收益策略定期混合、嘉实宝 A/B、嘉实活期宝货币、嘉实活钱包货币、嘉实泰和混合、嘉实薪金宝货币、嘉实对冲套利定期混合、嘉实中证主要消费 ETF、嘉实中证医药卫生 ETF、嘉实中证金融地产 ETF、嘉实 3 个月理财债券 A/E、嘉实医疗保健股票、嘉实新兴产业股票、嘉实新收益混合、嘉实沪深 300 指数研究增强、嘉实逆向策略股票、嘉实企业变革股票、嘉实新消费股票、嘉实全球互联网股票、嘉实先进制造股票、嘉实事件驱动股票、嘉实快线货币、嘉实低价策略股票、嘉实中证金融地产 ETF 联接、嘉实新起点混合、嘉实腾讯自选股大数据策略股票、嘉实环保低碳股票、嘉实创新成长混合、嘉实智能汽车股票、嘉实新起航混合、嘉实新财富混合、嘉实稳祥纯债债券、嘉实稳瑞纯债债券、嘉实新优选混合、嘉实新趋势混合、嘉实新思路混合、嘉实沪港深精选股票、嘉实稳盛债券、嘉实稳鑫纯债债券、嘉实安益混合、嘉实文体娱乐股票、嘉实稳泽纯债债券、嘉实惠泽混合 (LOF)、嘉实成长增强混合、嘉实策略优选混合、嘉实研究增强混合、嘉实优势成长混合、嘉实稳荣债券、嘉实农业产业股票、嘉实现金宝货币、嘉实增益宝货币、嘉实物流产业股票、嘉实丰安 6 个月定期债券、嘉实稳元纯债债券、嘉实新能源新材料股票、嘉实稳熙纯债债券、嘉实丰和灵活配置混合、嘉实新添华定期混合、嘉实现金添利货币、嘉实沪港深回报混合、嘉实原油 (QDII-LOF)、嘉实前沿科技沪港深股票、嘉实稳宏债券、嘉实中关村 A 股 ETF、嘉实稳华纯债债券、嘉实 6 个月理财债券、嘉实稳怡债券、嘉实富时中国 A50ETF 联接、嘉实富时中国 A50ETF、嘉实中小企业量化活力灵活配置混合、嘉实创业板 ETF、嘉实新添泽定期混合、嘉实新添丰定期混合、嘉实新添辉定期混合、嘉实领航资产配置混合 (FOF)、嘉实价值精选股票、嘉实医药健康股票、嘉实润泽量化定期混合、嘉实核心优势股票、嘉实润和量化定期混合、嘉实金融精选股票、嘉实新添荣定期混合、嘉实致兴定期纯债债券、嘉实战略配售混合、嘉实瑞享定期混合、嘉实新添康定期混合、嘉实资源精选股票、嘉实致盈债券、嘉实恒生港股通新经济指数 (LOF)、嘉实中短债债券、嘉实致享纯债债券、嘉实互通精选股票、嘉实互融精选股票、嘉实养老 2040 混合 (FOF)、嘉实消费精选股票、嘉实新添元定期混合、嘉实中债 1-3 政金债指数、嘉实养老 2050 混合 (FOF)、嘉实长青竞争优势股票、嘉实科技创新混合、嘉实基本面 50ETF、嘉实稳联纯债债券、嘉实汇达中短债债券、嘉实养老 2030 混合 (FOF)、嘉实致元 42 个月定期债券、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF、嘉实新添益定期混合、

嘉实融享货币、嘉实瑞虹三年定期混合、嘉实价值成长混合、嘉实央企创新驱动 ETF、嘉实新兴科技 100ETF、嘉实致安 3 个月定期债券、嘉实汇鑫中短债债券、嘉实新兴科技 100ETF 联接、嘉实致华纯债债券、嘉实商业银行精选债券、嘉实央企创新驱动 ETF 联接、嘉实致禄 3 个月定期纯债债券、嘉实民企精选一年定期债券、嘉实先进制造 100 ETF、嘉实沪深 300 红利低波动 ETF 联接、嘉实安元 39 个月定期纯债债券、嘉实中债 3-5 年国开债指数、嘉实鑫和一年持有期混合、嘉实致融一年定期债券、嘉实瑞熙三年封闭运作混合、嘉实中证 500 指数增强、嘉实回报精选股票、嘉实致宁 3 个月定开纯债债券、嘉实中证 500 成长估值 ETF、嘉实瑞和两年持有期混合、嘉实基础产业优选股票、嘉实中证主要消费 ETF 联接 A/C、嘉实医药健康 100ETF、嘉实稳福混合、嘉实瑞成两年持有期混合、嘉实致益纯债债券、嘉实精选平衡混合、嘉实致信一年定期纯债债券、嘉实致嘉纯债债券、嘉实产业先锋混合、嘉实远见精选两年持有期混合、嘉实致业一年定期纯债债券、嘉实安泽一年定期纯债债券、嘉实前沿创新混合、嘉实远见企业精选两年持有期混合、嘉实价值发现三个月定期混合、嘉实 H 股 50ETF (QDII)、嘉实浦惠 6 个月持有期混合、嘉实创新先锋混合、嘉实核心成长混合、嘉实彭博国开债 1-5 年指数、嘉实动力先锋混合、嘉实多利收益债券、嘉实稳惠 6 个月持有期混合、嘉实优质精选混合、嘉实稳骏纯债基金、嘉实价值长青混合。

其中嘉实增长混合、嘉实稳健混合和嘉实债券属于嘉实理财通系列基金。同时，基金管理人还管理多个全国社保基金、企业年金、特定客户资产投资组合。

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		
何如	本基金、嘉实沪深 300ETF 联接（LOF）、嘉实基本面 50 指数（LOF）、嘉实 H 股指数（QDII-LOF）、嘉实沪深 300ETF、嘉实中证 500ETF 联	2016 年 1 月 5 日	-	14 年	曾任职于 IA 克莱灵顿投资管理公司 (IA-Clarington Investments Inc)、富兰克林坦普顿投资管理公司 (Franklin Templeton Investments Corp.)。2007 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部执行总监、基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，加拿大籍。

	接、嘉实基本 面 50ETF、嘉 实 沪 深 300 红利 低 波 动 ETF、嘉实 沪 深 300 红利低波 动 ETF 联 接、嘉实 中 证 500 成 长 估 值 ETF 基金 经 理				
陈 正 宪	本基金、 嘉实沪深 300ETF 联 接 (LOF)、 嘉实基本 面 50 指数 (LOF)、 嘉实黄金 (QDII-F OF-LOF) 、嘉实沪 深 300ETF、 嘉实中 证 500ETF 联 接、嘉 实 恒 生 港 股 通 新 经 济 指 数 (LOF)、 嘉实基本 面 50ETF、嘉 实 沪 深 300 红利 低 波 动 ETF、嘉实 沪 深 300 红利低波	2016 年 1 月 5 日	-	15 年	曾任职于中国台湾台育证券、中国台湾保诚投信。2008 年 6 月加入嘉实基金管理有限公司，先后任职于产品管理部、指数投资部，现任指数投资部总监及基金经理。硕士研究生，具有基金从业资格，中国台湾籍。

动 ETF 联接、嘉实中证 500 成长估值 ETF 基金经理				
---------------------------------	--	--	--	--

注：（1）首任基金经理的“任职日期”为基金合同生效日，此后的非首任基金经理的“任职日期”指根据公司决定确定的聘任日期；“离任日期”指根据公司决定确定的解聘日期。

（2）证券从业的含义遵从《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵循了《证券法》、《证券投资基金法》及其各项配套法规、《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和其他相关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金运作管理符合有关法律法规和基金合同的规定和约定，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 公平交易制度和控制方法

公司制定了《公平交易管理制度》，按照证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规的规定，从组织架构、岗位设置和业务流程、系统和制度建设、内控措施和信息披露等多方面，确保在投资管理活动中公平对待不同投资组合，杜绝不同投资组合之间进行利益输送，保护投资者合法权益。

公司公平交易管理制度要求境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易以及投资管理过程中各个相关环节符合公平交易的监管要求。各投资组合能够公平地获得投资信息、投资建议，并在投资决策委员会的制度规范下独立决策，实施投资决策时享有公平的机会。所有组合投资决策与交易执行保持隔离，任何组合必须经过公司交易部集中交易。各组合享有平等的交易权利，共享交易资源。对交易所公开竞价交易以及银行间市场交易、交易所大宗交易等非集中竞价交易制定专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易机会。对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，严格遵循各投资组合交易前独立确定交易要素，交易后按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

报告期内，公司严格执行证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，各投资组合按投资管理制度和流程独立决策，并在获得投资信息、投资建议和

实施投资决策方面享有公平的机会；通过完善交易范围内各类交易的公平交易执行细则、严格的流程控制、持续的技术改进，确保公平交易原则的实现；对投资交易行为进行监察稽核，通过 IT 系统和人工监控等方式进行日常监控和定期分析评估并完整详实记录相关信息，及时完成每季度和年度公平交易专项稽核。

报告期内，公司对连续四个季度期间内、不同时间窗下（日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合向交易的交易价差进行分析，未发现违反公平交易制度的异常行为。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内，公司旗下所有投资组合参与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，合计 1 次，为旗下组合被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

报告期内，本基金日均跟踪误差为 0.06%，年度化拟合偏离度为 0.97%。

本基金的跟踪误差主要来源于基金的申购赎回、样本股停牌、样本股分红以及样本股调整的冲击。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 6.9665 元；本报告期基金份额净值增长率为 25.02%，业绩比较基准收益率为 20.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证 500 指数在众多指数中，属于高波动、高收益指数，其中长期收益相对大部分指数而言，存在明显优势。随着未来中国经济发展更加倚重机制创新、技术创新，政府资源、市场资源也将较多地偏向新兴产业和机制灵活市场化程度高的中小型企业。中证 500 指数相对其他主流指数，其中小市值个股占比较大，因此对转型经济中的新兴产业代表性更强。

作为一只投资于中证 500 指数的被动投资管理产品，本基金将继续秉承指数化被动投资策略，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果带来的冲击，力争进一步降低本基金的跟踪误差，给投资者提供一个标准化的中证 500 指数的投资工具。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，基金管理人有关法律稽核工作情况如下：

(1) 继续内控前置，在基金营销、投资管理、信息披露以及新产品设计开发、海外业务、另类业务、制度建设、合同管理、法律咨询等方面，事前进行合规性审核、监控。对于新产品、新

业务，从战略规划到具体产品方案，在制度流程、投资范围、投资工具、运作规则等方面，防控重大风险。

(2) 主要从事前研讨、合规审核、全方位合规监控、数据库维护、“三条底线”防范、合规培训等方面，积极开展各项合规管理工作。

(3) 按计划对销售、投资、后台和其它业务开展内部稽核，完成相应内审报告及其后续改进跟踪。完成公司及基金的外审、公司 GIPS 第三方验证、ISAE3402 国际鉴证等。

(4) 负责日常法律事务工作，包括合同、协议审查（包括各类产品及业务），主动解决各项法律文件以及实务运作中存在的差错和风险隐患，未发现新增产品、新增业务以及日常业务的法律风险问题。

(5) 加强差错管理，继续推动各业务单元梳理流程、制度，落实风险责任授权体系，确保所有识别的关键风险点均有相应措施控制。

此外，我们还积极配合监管机关、社保基金理事会的检查以及统计调查工作，按时完成合规报告和各项统计、专题报告。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证监会相关规定和基金合同的约定，日常估值由基金管理人与基金托管人一同进行，基金份额净值由基金管理人完成估值后，经基金托管人复核无误后由基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账目的核对同时进行。

本基金管理人设立估值专业委员会，委员由固定收益、交易、运营、风险管理、合规等部门负责人组成，负责研究、指导基金估值业务。基金管理人估值委员和基金会计均具有专业胜任能力和相关工作经验。报告期内，固定收益部门负责人同时兼任基金经理、估值委员，基金经理参加估值专业委员会会议，但不介入基金日常估值业务；参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突；与估值相关的机构包括基金投资市场的各证券交易所以及境内相关机构等。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期，本基金未实施利润分配，符合法律法规和基金合同的相关约定。具体参见本报告“7.4.11 利润分配情况”。

4.9 管理人对会计师事务所出具非标准审计报告所涉相关事项的说明

无。

4.10 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明

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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本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，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2021)第 23461 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“嘉实中证 500ETF 基金”)的财务报表,包括 2020 年 12 月 31 日的资产负债表,2020 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了嘉实中证 500ETF 基金 2020 年 12 月 31 日的财务状况以及 2020 年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一

	<p>步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于嘉实中证 500ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>嘉实中证 500ETF 基金的基金管理人嘉实基金管理有限公司（以下简称“基金管理人”）管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估嘉实中证 500ETF 基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算嘉实中证 500ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督嘉实中证 500ETF 基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>（一） 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>（二） 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>（三） 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>（四） 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对嘉实中证 500ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获</p>

	<p>得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致嘉实中证 500ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	薛竞	周祎
会计师事务所的地址	上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场二座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2021 年 03 月 25 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体: 嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2020 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	7.4.7.1	18,218,332.37	29,099,903.38
结算备付金		22,036,574.87	27,395,359.46
存出保证金		10,939,944.44	19,837,434.40
交易性金融资产	7.4.7.2	3,601,549,153.64	3,320,244,436.57
其中: 股票投资		3,601,461,953.64	3,314,041,436.57
基金投资		-	-
债券投资		87,200.00	6,203,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	54,000,000.00	109,000,000.00
应收证券清算款		112,011,486.57	9,880,164.95
应收利息	7.4.7.5	197,314.19	53,995.39
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,818,952,806.08	3,515,511,294.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
负债:			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		138,483,256.52	25,125,887.40
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		439,077.34	416,903.26
应付托管费		146,359.10	138,967.75
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	1,169,741.86	1,460,029.90
应交税费		412,923.24	173,335.27
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	439,088.96	451,023.90
负债合计		141,090,447.02	27,766,147.48
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,882,901,924.73	2,232,425,035.45
未分配利润	7.4.7.10	1,794,960,434.33	1,255,320,111.22
所有者权益合计		3,677,862,359.06	3,487,745,146.67
负债和所有者权益总计		3,818,952,806.08	3,515,511,294.15

注：报告截止日 2020 年 12 月 31 日，基金份额净值 6.9665 元，基金份额总额 527,931,868.00 份。

7.2 利润表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
一、收入		853,020,503.49	487,856,381.90
1. 利息收入		7,342,620.21	1,500,505.74
其中：存款利息收入	7.4.7.11	624,976.63	363,934.20
债券利息收入		3,750.04	2,255.63
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		1,360,523.37	1,053,071.04
证券出借利息收入		5,353,370.17	81,244.87
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填		926,025,517.75	-24,395,520.07

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.12	854,649,248.25	-67,488,784.61
基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	3,772,521.85	998,340.85
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	37,889,088.03	11,888,581.86
股利收益	7.4.7.16	29,714,659.62	30,206,341.83
3. 公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.17	-87,530,664.97	507,942,002.97
4. 汇兑收益（损失以“-”号 填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号 填列）	7.4.7.18	7,183,030.50	2,809,393.26
减：二、费用		19,051,428.15	13,859,983.97
1. 管理人报酬		4,601,963.98	6,622,430.16
2. 托管费		1,533,988.01	1,628,242.46
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	11,604,998.09	4,562,316.09
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支 出		-	-
6. 税金及附加		142,611.37	40,867.78
7. 其他费用	7.4.7.20	1,167,866.70	1,006,127.48
三、利润总额（亏损总额以“-” 号填列）		833,969,075.34	473,996,397.93
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		833,969,075.34	473,996,397.93

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者 权益（基金净值）	2,232,425,035.45	1,255,320,111.22	3,487,745,146.67
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期	-	833,969,075.34	833,969,075.34

利润)			
三、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)	-349,523,110.72	-294,328,752.23	-643,851,862.95
其中:1.基金申购款	6,585,300,726.58	5,408,385,702.97	11,993,686,429.55
2.基金赎回款	-6,934,823,837.30	-5,702,714,455.20	-12,637,538,292.50
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,882,901,924.73	1,794,960,434.33	3,677,862,359.06
项目	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,041,549,865.76	229,686,666.35	1,271,236,532.11
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	473,996,397.93	473,996,397.93
三、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)	1,190,875,169.69	551,637,046.94	1,742,512,216.63
其中:1.基金申购款	3,477,933,278.37	1,655,035,681.00	5,132,968,959.37
2.基金赎回款	-2,287,058,108.68	-1,103,398,634.06	-3,390,456,742.74
四、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)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	2,232,425,035.45	1,255,320,111.22	3,487,745,146.67

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

<u>经雷</u>	<u>罗丽丽</u>	<u>罗丽丽</u>
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

嘉实中证 500 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[2012]1588 号《关于核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及其联接基金募集的批复》核准,由嘉实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《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定。经向中国证监会备案,《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2013 年 2 月 6 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 3,108,729,402.00 份基金份额。本基金的基金管理人为嘉实基金管理有限公司,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

7.4.2 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》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《嘉实中证 500 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 7.4.4 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。

7.4.3 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的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以交易性金融资产列示。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，在资产负债表中以衍生金融资产列示。

基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。基金目前以交易目的持有的衍生工具所产生的金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，在资产负债表中以衍生金融负债列示。基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。

终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。对于曾经实施份额拆分或折算的基金，由于基金份额拆分或折算引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日或基金份额折算日根据拆分前或折算前的基金份额数及确定的拆分或折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金

指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证券金融公司”)出借证券，证券金融公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

基金的管理人报酬、托管费等费用在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权。基金收益评价日核定的基金净值增长率超过标的指

数同期增长率达到 1%以上时，基金管理人可以进行收益分配。在符合上述基金分红条件的前提下，本基金收益每年至多分配 12 次，每次基金收益分配数额的确定原则为使收益分配后基金净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补亏损为前提，收益分配后有可能使基金份额净值低于面值，即基金收益分配基准日（即收益评价日）的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后可能低于面值。基金红利发放日距离收益分配基准日的时间不超过 15 个工作日。本基金收益分配采取现金分红。

经宣告的拟分配基金收益于分红除息日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照

中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
活期存款	18,218,332.37	29,099,903.38
定期存款	-	-
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	-	-
合计	18,218,332.37	29,099,903.38

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,547,952,307.53	3,601,461,953.64	53,509,646.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	87,200.00	87,200.00
	银行间市场	-	-
	合计	87,200.00	87,200.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,548,039,507.53	3,601,549,153.64	53,509,646.11

项目	上年度末 2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	3,179,514,966.17	3,314,041,436.57	134,526,470.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	6,203,000.00	6,203,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	6,203,000.00	6,203,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	3,185,717,966.17	3,320,244,436.57	134,526,470.40

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	71,330,200.00	-	-	
其中：股指期货投资	71,330,200.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	71,330,200.00	-	-	
项目	上年度末 2019年12月31日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	155,562,119.32	-	-	
其中：股指期货投资	155,562,119.32	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	

合计	155,562,119.32	-	+
----	----------------	---	---

注：股指期货投资采用当日无负债结算制度，相关价值已包含在结算备付金中。

于 2020 年 12 月 31 日，本基金买入 IC2106 持仓量为 60 手，对应合约市值 73,228,800.00 元，公允价值变动 1,898,600.00 元，公允价值变动总额合计 1,898,600.00 元，可抵消期货暂收款 1,898,600.00 元，股指期货投资净额为零(于 2019 年 12 月 31 日：买入 IC2003 持仓量为 58 手，对应合约市值 60,686,560.00 元，公允价值变动 5,601,600.68 元；买入 IC2006 持仓量为 100 手，对应合约市值 103,288,000.00 元，公允价值变动 2,810,840.00 元；公允价值变动总额合计 8,412,440.68 元，可抵消期货暂收款 8,412,440.68 元，股指期货投资净额为零)。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	54,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	54,000,000.00	-
项目	上年度末 2019 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	109,000,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	109,000,000.00	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日	上年度末 2019 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	3,198.15	7,098.02
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-
应收结算备付金利息	11,559.23	13,606.89
应收债券利息	8.03	772.13
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-7,458.91	-8,506.85

应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	189,667.13	40,945.78
其他	340.56	79.42
合计	197,314.19	53,995.39

7.4.7.6 其他资产

无。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,169,741.86	1,460,029.90
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,169,741.86	1,460,029.90

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31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	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
应付指数使用费	219,088.96	231,023.90
合计	439,088.96	451,023.90

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	625,931,868.00	2,232,425,035.45
本期申购	1,846,400,000.00	6,585,300,726.58
本期赎回（以“-”号填列）	-1,944,400,000.00	-6,934,823,837.30
- 基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	527,931,868.00	1,882,901,924.73

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.10 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	1,488,534,327.10	-233,214,215.88	1,255,320,111.22
本期利润	921,499,740.31	-87,530,664.97	833,969,075.34
本期基金份额交易产生的变动数	-89,885,331.27	-204,443,420.96	-294,328,752.23
其中：基金申购款	6,556,487,794.16	-1,148,102,091.19	5,408,385,702.97
基金赎回款	-6,646,373,125.43	943,658,670.23	-5,702,714,455.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,320,148,736.14	-525,188,301.81	1,794,960,434.33

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
活期存款利息收入	187,283.36	124,781.07
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	429,474.54	238,461.79
其他	8,218.73	691.34
合计	624,976.63	363,934.20

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	403,783,399.64	-30,286,856.91
股票投资收益——赎回差价收入	450,865,848.61	-37,201,927.70
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	854,649,248.25	-67,488,784.61

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020年1月1日至2020年12月31日	2019年1月1日至2019年12月31日
卖出股票成交总额	7,122,707,964.11	2,134,589,085.52
减：卖出股票成本总额	6,718,924,564.47	2,164,875,942.43
买卖股票差价收入	403,783,399.64	-30,286,856.91

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	12,637,538,292.50	3,390,456,742.74
减：现金支付赎回款总额	5,678,623,506.50	1,090,001,169.74
减：赎回股票成本总额	6,508,048,937.39	2,337,657,500.70
赎回差价收入	450,865,848.61	-37,201,927.70

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	3,772,521.85	998,340.85
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	3,772,521.85	998,340.85
----	--------------	------------

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	24,161,902.12	13,578,670.69
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	20,364,531.90	12,578,800.00
减：应收利息总额	24,848.37	1,529.84
买卖债券差价收入	3,772,521.85	998,340.85

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2019年1月1日至2019年12月31日
股指期货投资收益	37,889,088.03	11,888,581.86

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	29,714,659.62	30,206,341.83
其中：证券出借权益补偿收入	4,988,575.98	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	29,714,659.62	30,206,341.83

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年1月1日至2020年12月31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	-81,016,824.29	497,809,842.29
股票投资	-81,016,824.29	497,809,842.29
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	-6,513,840.68	10,132,160.68
权证投资	-	-
期货投资	-6,513,840.68	10,132,160.68
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	-87,530,664.97	507,942,002.97

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	7,183,030.50	2,809,393.26
合计	7,183,030.50	2,809,393.26

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
交易所市场交易费用	11,604,998.09	4,562,316.09
银行间市场交易费用	-	-
合计	11,604,998.09	4,562,316.09

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年1月1日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行划款手续费	27,005.01	9,364.33
上市年费	-	60,000.00
指数使用费	920,392.69	716,290.15
其他	469.00	473.00
合计	1,167,866.70	1,006,127.48

7.4.7.21 分部报告

无。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

无。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

无。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
嘉实基金管理有限公司(“嘉实基金”)	基金管理人
中国建设银行股份有限公司(“中国建设银行”)	基金托管人
DWS Investments Singapore Limited	基金管理人的股东
立信投资有限责任公司	基金管理人的股东
中诚信托有限责任公司	基金管理人的股东
嘉实资本管理有限公司(“嘉实资本”)	基金管理人的控股子公司
嘉实财富管理有限公司(“嘉实财富”)	基金管理人的控股子公司
嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“嘉实中证 500ETF 联接”)	本基金的联接基金

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

无。

7.4.10.1.2 债券交易

无。

7.4.10.1.3 债券回购交易

无。

7.4.10.1.4 权证交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	4,601,963.98	6,622,430.16
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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%/0.15%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. 自 2019 年 6 月 18 日起，基金管理费率由 0.50%调整为 0.15%。3. 根据本基金的基金管理人与各代销机构签订的基金代销协议，客户维护费按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2019 年 1 月 1 日至 2019 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,533,988.01	1,628,242.46

注：1. 支付基金托管人的托管费按前一日基金资产净值 0.1%/0.05%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。2. 自 2019 年 6 月 18 日起，基金托管费率由 0.1%调整为 0.05%。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

无。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

无。

7.4.10.4.2 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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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 2020年12月31日		上年度末 2019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(%)
嘉实中证 500ETF联接	226,543,731.00	42.91	422,937,780.00	67.57

7.4.10.6 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 2020年1月1日至2020年12月31 日		上年度可比期间 2019年1月1日至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限 公司_活期	18,218,332.37	187,283.36	29,099,903.38	124,781.07

注：本基金的上述存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本期(2020年1月1日至2020年12月31日)，本基金未实施利润分配。

7.4.12 期末(2020年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	可流通 日	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
003030	祖名 股份	2020年 12月25 日	2021年 1月6 日	新发未 上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
003031	中瓷 电子	2020年 12月24 日	2021年 1月4 日	新发未 上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
300862	蓝盾 光电	2020年 8月7 日	2021年 3月4 日	新股锁 定	33.95	38.54	5,843	198,369.85	225,189.22	-

		日	日								
300864	南大环境	2020年 8月13 日	2021年 2月25 日	新股锁 定	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10		-
300872	天阳科技	2020年 8月14 日	2021年 2月25 日	新股锁 定	21.34	37.84	871	18,587.14	32,958.64		-
300873	海晨股份	2020年 8月14 日	2021年 3月2 日	新股锁 定	30.72	41.32	484	14,868.48	19,998.88		-
300882	万胜智能	2020年 8月27 日	2021年 3月10 日	新股锁 定	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60		-
300884	狄耐克	2020年 11月5 日	2021年 5月12 日	新股锁 定	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49		-
300886	华业香料	2020年 9月8 日	2021年 3月16 日	新股锁 定	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49		-
300889	爱克股份	2020年 9月9 日	2021年 3月16 日	新股锁 定	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48		-
300890	翔丰华	2020年 9月10 日	2021年 3月18 日	新股锁 定	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10		-
300891	惠云钛业	2020年 9月10 日	2021年 3月17 日	新股锁 定	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20		-
300892	品渥食品	2020年 9月11 日	2021年 3月24 日	新股锁 定	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72		-
300895	铜牛信息	2020年 9月17 日	2021年 3月24 日	新股锁 定	12.65	45.30	283	3,579.95	12,819.90		-
300896	爱美客	2020年 9月21 日	2021年 3月29 日	新股锁 定	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28		-
300898	熊猫乳品	2020年 10月9 日	2021年 4月16 日	新股锁 定	10.78	33.03	496	5,346.88	16,382.88		-
300900	广联航空	2020年 10月19 日	2021年 4月29 日	新股锁 定	17.87	33.16	879	15,707.73	29,147.64		-
300902	国安	2020年	2021年	新股锁	15.38	24.26	551	8,474.38	13,367.26		-

	达	10月22日	4月29日	定							
300908	仲景食品	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40		-
300909	汇创达	2020年11月11日	2021年5月18日	新股锁定	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62		-
300910	瑞丰新材	2020年11月20日	2021年5月27日	新股锁定	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38		-
300911	亿田智能	2020年11月24日	2021年6月3日	新股锁定	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54		-
300919	中伟股份	2020年12月15日	2021年6月23日	新股锁定	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10		-
300925	法本信息	2020年12月21日	2021年6月30日	新股锁定	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49		-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年1月7日	新发未上市	10.76	10.76	3,225	34,701.00	34,701.00		-
300926	博俊科技	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	10.76	10.76	359	3,862.84	3,862.84		-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年1月7日	新发未上市	13.39	13.39	1,946	26,056.94	26,056.94		-
300927	江天化学	2020年12月29日	2021年7月7日	新股锁定	13.39	13.39	217	2,905.63	2,905.63		-
605277	新亚电子	2020年12月25日	2021年1月6日	新发未上市	16.95	16.95	507	8,593.65	8,593.65		-
688093	世华科技	2020年9月22日	2021年3月30日	新股锁定	17.55	23.63	4,595	80,642.25	108,579.85		-
688221	前沿生物	2020年10月20日	2021年4月28日	新股锁定	20.50	17.15	16,148	331,034.00	276,938.20		-
688408	中信博	2020年8月20日	2021年3月1日	新股锁定	42.19	160.54	4,450	187,745.50	714,403.00		-

688560	明冠新材	2020年12月16日	2021年6月24日	新股锁定	15.87	22.86	3,832	60,813.84	87,599.52	-
688617	惠泰医疗	2020年12月30日	2021年1月7日	新发未上市	74.46	74.46	1,673	124,571.58	124,571.58	-
688668	鼎通科技	2020年12月11日	2021年6月21日	新股锁定	20.07	24.56	3,037	60,952.59	74,588.72	-
688777	中控技术	2020年11月13日	2021年5月24日	新股锁定	35.73	77.12	5,794	207,019.62	446,833.28	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
128142	新乳转债	2020年12月18日	2021年1月19日	新债未上市	100.00	100.00	872	87,200.00	87,200.00	-

注：1. 以上“可流通日”是根据上市公司公告估算的流通日期，最终日期以上公司公告为准。

2. 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，则该股票的数量和期末成本总额相应调整，新增股票的可流通日、流通受限类型和期末估值单价与原股票一致。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020年12月30日	重大事项停牌	3.23	2021年1月7日	3.40	1,287,800	6,520,007.89	4,159,594.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
2020122300000413	688099	晶晨股份	2020-12-23	2021-01-06	78.73	8,000	629,840.00
2020122300000415	688088	虹软科技	2020-12-23	2021-01-06	69.92	7,900	552,368.00
2020122300000417	688321	微芯生物	2020-12-23	2021-01-06	37.01	8,000	296,080.00
2020122300000419	688002	睿创微纳	2020-12-23	2021-01-06	111.00	8,700	965,700.00
2020122300000423	300009	安科生物	2020-12-23	2021-01-06	14.68	37,500	550,500.00
2020122300000425	300010	豆神教育	2020-12-23	2021-01-06	9.76	27,400	267,424.00
2020122300000427	300001	特锐德	2020-12-23	2021-01-06	29.36	23,500	689,960.00
2020122300000429	300002	神州泰岳	2020-12-23	2021-01-06	5.11	77,100	393,981.00
2020122300000431	300166	东方国信	2020-12-23	2021-01-06	10.95	33,300	364,635.00
202012230000	300168	万达信息	2020-12-23	2021-01-06	21.69	32,600	707,094.00

0433							
2020 1223 0000 0435	300146	汤臣倍健	2020-12-23	2021-01-06	24.15	31,000	748,650.00
2020 1223 0000 0437	300133	华策影视	2020-12-23	2021-01-06	6.18	48,400	299,112.00
2020 1223 0000 0439	300134	大富科技	2020-12-23	2021-01-06	10.33	15,100	155,983.00
2020 1223 0000 0441	300223	北京君正	2020-12-23	2021-01-06	91.49	7,300	667,877.00
2020 1223 0000 0443	300212	易华录	2020-12-23	2021-01-06	30.65	15,300	468,945.00
2020 1223 0000 0445	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-06	30.71	43,300	1,329,743.00
2020 1223 0000 0447	300180	华峰超纤	2020-12-23	2021-01-06	5.91	48,300	285,453.00
2020 1223 0000 0449	300026	红日药业	2020-12-23	2021-01-06	4.58	71,000	325,180.00
2020 1223 0000 0451	300058	蓝色光标	2020-12-23	2021-01-06	6.00	78,200	469,200.00
2020 1223 0000 0455	300024	机器人	2020-12-23	2021-01-06	12.30	49,000	602,700.00
2020 1223 0000 0457	300012	华测检测	2020-12-23	2021-01-06	27.37	65,400	1,789,998.00

2020 1223 0000 0459	300017	网宿科技	2020-12-23	2021-01-0 6	6.89	77,100	531,219 .00
2020 1223 0000 0461	300113	顺网科技	2020-12-23	2021-01-0 6	17.15	16,300	279,545 .00
2020 1223 0000 0463	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-0 6	24.65	23,600	581,740 .00
2020 1223 0000 0465	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-0 6	8.89	96,100	854,329 .00
2020 1223 0000 0467	300070	碧水源	2020-12-23	2021-01-0 6	7.65	87,200	667,080 .00
2020 1223 0000 0469	300072	三聚环保	2020-12-23	2021-01-0 6	5.68	55,500	315,240 .00
2020 1223 0000 0473	300482	万孚生物	2020-12-23	2021-01-0 6	89.21	8,000	713,680 .00
2020 1223 0000 0475	300496	中科创达	2020-12-23	2021-01-0 6	117.00	11,600	1,357,2 00.00
2020 1223 0000 0477	300474	景嘉微	2020-12-23	2021-01-0 6	69.91	5,900	412,469 .00
2020 1223 0000 0479	300418	昆仑万维	2020-12-23	2021-01-0 6	19.95	32,200	642,390 .00
2020 1223 0000 0481	300463	迈克生物	2020-12-23	2021-01-0 6	46.60	15,300	712,980 .00
2020	300699	光威复材	2020-12-23	2021-01-0	89.05	10,100	899,405

1223 0000 0483				6			.00
2020 1223 0000 0485	300595	欧普康视	2020-12-23	2021-01-06	81.92	11,900	974,848.00
2020 1223 0000 0487	300630	普利制药	2020-12-23	2021-01-06	41.89	10,200	427,278.00
2020 1223 0000 0489	300618	寒锐钴业	2020-12-23	2021-01-06	94.91	5,900	559,969.00
2020 1223 0000 0491	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-06	72.28	40,100	2,898,428.00
2020 1223 0000 0493	300285	国瓷材料	2020-12-23	2021-01-06	45.11	30,300	1,366,833.00
2020 1223 0000 0495	300244	迪安诊断	2020-12-23	2021-01-06	34.28	17,000	582,760.00
2020 1223 0000 0497	300257	开山股份	2020-12-23	2021-01-06	13.65	13,500	184,275.00
2020 1223 0000 0499	300271	华宇软件	2020-12-23	2021-01-06	23.87	25,700	613,459.00
2020 1223 0000 0501	300324	旋极信息	2020-12-23	2021-01-06	4.23	48,100	203,463.00
2020 1223 0000 0503	300357	我武生物	2020-12-23	2021-01-06	76.70	12,300	943,410.00
2020 1223	300316	晶盛机电	2020-12-23	2021-01-06	30.08	25,200	758,016.00

0000 0505							
2020 1223 0000 0507	300315	掌趣科技	2020-12-23	2021-01-0 6	5.11	108,300	553,413 .00
2020 1223 0000 0509	300296	利亚德	2020-12-23	2021-01-0 6	6.36	69,900	444,564 .00
2020 1223 0000 0563	688321	微芯生物	2020-12-23	2021-01-0 6	37.01	3,600	133,236 .00
2020 1223 0000 0565	688088	虹软科技	2020-12-23	2021-01-0 6	69.92	3,500	244,720 .00
2020 1223 0000 0567	688099	晶晨股份	2020-12-23	2021-01-0 6	78.73	3,600	283,428 .00
2020 1223 0000 0569	688002	睿创微纳	2020-12-23	2021-01-0 6	111.00	3,900	432,900 .00
2020 1223 0000 0577	300595	欧普康视	2020-12-23	2021-01-0 6	81.92	5,300	434,176 .00
2020 1223 0000 0579	300630	普利制药	2020-12-23	2021-01-0 6	41.89	4,600	192,694 .00
2020 1223 0000 0581	300618	寒锐钴业	2020-12-23	2021-01-0 6	94.91	2,600	246,766 .00
2020 1223 0000 0583	300482	万孚生物	2020-12-23	2021-01-0 6	89.21	3,600	321,156 .00
2020 1223 0000	300496	中科创达	2020-12-23	2021-01-0 6	117.00	5,200	608,400 .00

0585							
2020 1223 0000 0587	300699	光威复材	2020-12-23	2021-01-06	89.05	4,500	400,725.00
2020 1223 0000 0589	300315	掌趣科技	2020-12-23	2021-01-06	5.11	48,500	247,835.00
2020 1223 0000 0591	300316	晶盛机电	2020-12-23	2021-01-06	30.08	11,300	339,904.00
2020 1223 0000 0593	300296	利亚德	2020-12-23	2021-01-06	6.36	31,300	199,068.00
2020 1223 0000 0595	300285	国瓷材料	2020-12-23	2021-01-06	45.11	13,600	613,496.00
2020 1223 0000 0597	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-06	72.28	17,900	1,293,812.00
2020 1223 0000 0599	300463	迈克生物	2020-12-23	2021-01-06	46.60	6,800	316,880.00
2020 1223 0000 0601	300474	景嘉微	2020-12-23	2021-01-06	69.91	2,600	181,766.00
2020 1223 0000 0603	300357	我武生物	2020-12-23	2021-01-06	76.70	5,500	421,850.00
2020 1223 0000 0605	300324	旋极信息	2020-12-23	2021-01-06	4.23	21,600	91,368.00
2020 1223 0000 0607	300418	昆仑万维	2020-12-23	2021-01-06	19.95	14,400	287,280.00

2020 1223 0000 0609	300002	神州泰岳	2020-12-23	2021-01-0 6	5.11	34,600	176,806 .00
2020 1223 0000 0611	300001	特锐德	2020-12-23	2021-01-0 6	29.36	10,500	308,280 .00
2020 1223 0000 0613	300017	网宿科技	2020-12-23	2021-01-0 6	6.89	34,500	237,705 .00
2020 1223 0000 0615	300024	机器人	2020-12-23	2021-01-0 6	12.30	21,900	269,370 .00
2020 1223 0000 0617	300012	华测检测	2020-12-23	2021-01-0 6	27.37	29,300	801,941 .00
2020 1223 0000 0619	300009	安科生物	2020-12-23	2021-01-0 6	14.68	16,800	246,624 .00
2020 1223 0000 0621	300010	豆神教育	2020-12-23	2021-01-0 6	9.76	12,200	119,072 .00
2020 1223 0000 0625	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-0 6	30.71	19,400	595,774 .00
2020 1223 0000 0631	300180	华峰超纤	2020-12-23	2021-01-0 6	5.91	21,600	127,656 .00
2020 1223 0000 0637	300166	东方国信	2020-12-23	2021-01-0 6	10.95	14,900	163,155 .00
2020 1223 0000 0639	300257	开山股份	2020-12-23	2021-01-0 6	13.65	6,000	81,900. 00
2020	300271	华宇软件	2020-12-23	2021-01-0	23.87	11,500	274,505

1223 0000 0641				6			.00
2020 1223 0000 0643	300168	万达信息	2020-12-23	2021-01-06	21.69	14,600	316,674.00
2020 1223 0000 0645	300244	迪安诊断	2020-12-23	2021-01-06	34.28	7,600	260,528.00
2020 1223 0000 0647	300212	易华录	2020-12-23	2021-01-06	30.65	6,800	208,420.00
2020 1223 0000 0649	300072	三聚环保	2020-12-23	2021-01-06	5.68	24,900	141,432.00
2020 1223 0000 0651	300223	北京君正	2020-12-23	2021-01-06	91.49	3,300	301,917.00
2020 1223 0000 0653	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-06	8.89	43,100	383,159.00
2020 1223 0000 0655	300070	碧水源	2020-12-23	2021-01-06	7.65	39,100	299,115.00
2020 1223 0000 0657	300026	红日药业	2020-12-23	2021-01-06	4.58	31,800	145,644.00
2020 1223 0000 0659	300134	大富科技	2020-12-23	2021-01-06	10.33	6,700	69,211.00
2020 1223 0000 0661	300146	汤臣倍健	2020-12-23	2021-01-06	24.15	13,900	335,685.00
2020 1223	300058	蓝色光标	2020-12-23	2021-01-06	6.00	35,100	210,600.00

0000 0663							
2020 1223 0000 0665	300113	顺网科技	2020-12-23	2021-01-0 6	17.15	7,300	125,195 .00
2020 1223 0000 0667	300133	华策影视	2020-12-23	2021-01-0 6	6.18	21,700	134,106 .00
2020 1223 0000 0669	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-0 6	24.65	10,500	258,825 .00
2020 1223 0000 0671	300316	晶盛机电	2020-12-23	2021-01-0 6	30.08	11,300	339,904 .00
2020 1223 0000 0673	300324	旋极信息	2020-12-23	2021-01-0 6	4.23	21,600	91,368. 00
2020 1223 0000 0675	300357	我武生物	2020-12-23	2021-01-0 6	76.70	5,500	421,850 .00
2020 1223 0000 0677	300296	利亚德	2020-12-23	2021-01-0 6	6.36	31,300	199,068 .00
2020 1223 0000 0679	300482	万孚生物	2020-12-23	2021-01-0 6	89.21	3,600	321,156 .00
2020 1223 0000 0681	300315	掌趣科技	2020-12-23	2021-01-0 6	5.11	48,500	247,835 .00
2020 1223 0000 0683	300496	中科创达	2020-12-23	2021-01-0 6	117.00	5,200	608,400 .00
2020 1223 0000	300474	景嘉微	2020-12-23	2021-01-0 6	69.91	2,600	181,766 .00

0685							
2020 1223 0000 0687	300418	昆仑万维	2020-12-23	2021-01-06	19.95	14,400	287,280.00
2020 1223 0000 0689	300463	迈克生物	2020-12-23	2021-01-06	46.60	6,800	316,880.00
2020 1223 0000 0691	300212	易华录	2020-12-23	2021-01-06	30.65	6,800	208,420.00
2020 1223 0000 0693	300207	欣旺达	2020-12-23	2021-01-06	30.71	19,400	595,774.00
2020 1223 0000 0695	300223	北京君正	2020-12-23	2021-01-06	91.49	3,300	301,917.00
2020 1223 0000 0697	300180	华峰超纤	2020-12-23	2021-01-06	5.91	21,600	127,656.00
2020 1223 0000 0699	300274	阳光电源	2020-12-23	2021-01-06	72.28	17,900	1,293,812.00
2020 1223 0000 0703	300271	华宇软件	2020-12-23	2021-01-06	23.87	11,500	274,505.00
2020 1223 0000 0705	300285	国瓷材料	2020-12-23	2021-01-06	45.11	13,600	613,496.00
2020 1223 0000 0707	300244	迪安诊断	2020-12-23	2021-01-06	34.28	7,600	260,528.00
2020 1223 0000 0709	300257	开山股份	2020-12-23	2021-01-06	13.65	6,000	81,900.00

2020 1223 0000 0711	300699	光威复材	2020-12-23	2021-01-0 6	89.05	4,500	400,725 .00
2020 1223 0000 0713	300630	普利制药	2020-12-23	2021-01-0 6	41.89	4,600	192,694 .00
2020 1223 0000 0715	300595	欧普康视	2020-12-23	2021-01-0 6	81.92	5,300	434,176 .00
2020 1223 0000 0717	300618	寒锐钴业	2020-12-23	2021-01-0 6	94.91	2,600	246,766 .00
2020 1223 0000 0719	300115	长盈精密	2020-12-23	2021-01-0 6	24.65	10,500	258,825 .00
2020 1223 0000 0721	300113	顺网科技	2020-12-23	2021-01-0 6	17.15	7,300	125,195 .00
2020 1223 0000 0723	300088	长信科技	2020-12-23	2021-01-0 6	8.89	43,100	383,159 .00
2020 1223 0000 0725	300070	碧水源	2020-12-23	2021-01-0 6	7.65	39,100	299,115 .00
2020 1223 0000 0727	300072	三聚环保	2020-12-23	2021-01-0 6	5.68	24,900	141,432 .00
2020 1223 0000 0729	300166	东方国信	2020-12-23	2021-01-0 6	10.95	14,900	163,155 .00
2020 1223 0000 0731	300146	汤臣倍健	2020-12-23	2021-01-0 6	24.15	13,900	335,685 .00
2020	300168	万达信息	2020-12-23	2021-01-0	21.69	14,600	316,674

1223 0000 0733				6			.00
2020 1223 0000 0735	300133	华策影视	2020-12-23	2021-01-06	6.18	21,700	134,106.00
2020 1223 0000 0736	300134	大富科技	2020-12-23	2021-01-06	10.33	6,700	69,211.00
2020 1223 0000 0739	300009	安科生物	2020-12-23	2021-01-06	14.68	16,800	246,624.00
2020 1223 0000 0741	300010	豆神教育	2020-12-23	2021-01-06	9.76	12,200	119,072.00
2020 1223 0000 0743	300002	神州泰岳	2020-12-23	2021-01-06	5.11	34,600	176,806.00
2020 1223 0000 0745	300026	红日药业	2020-12-23	2021-01-06	4.58	31,800	145,644.00
2020 1223 0000 0747	300058	蓝色光标	2020-12-23	2021-01-06	6.00	35,100	210,600.00
2020 1223 0000 0749	300001	特锐德	2020-12-23	2021-01-06	29.36	10,500	308,280.00
2020 1223 0000 0751	300012	华测检测	2020-12-23	2021-01-06	27.37	29,300	801,941.00
2020 1223 0000 0753	300024	机器人	2020-12-23	2021-01-06	12.30	21,900	269,370.00
2020 1223	300017	网宿科技	2020-12-23	2021-01-06	6.89	34,500	237,705.00

0000 0755							
2020 1223 0000 0757	688321	微芯生物	2020-12-23	2021-01-0 6	37.01	3,600	133,236 .00
2020 1223 0000 0759	688099	晶晨股份	2020-12-23	2021-01-0 6	78.73	3,600	283,428 .00
2020 1223 0000 0761	688088	虹软科技	2020-12-23	2021-01-0 6	69.92	3,500	244,720 .00
2020 1223 0000 0763	688002	睿创微纳	2020-12-23	2021-01-0 6	111.00	3,900	432,900 .00
2020 1223 0000 1086	000009	中国宝安	2020-12-23	2021-01-0 6	7.53	45,500	342,615 .00
2020 1223 0000 1087	000008	神州高铁	2020-12-23	2021-01-0 6	2.54	76,800	195,072 .00
2020 1223 0000 1089	000009	中国宝安	2020-12-23	2021-01-0 6	7.53	101,500	764,295 .00
2020 1223 0000 1092	000008	神州高铁	2020-12-23	2021-01-0 6	2.54	34,400	87,376. 00
2020 1223 0000 1093	000009	中国宝安	2020-12-23	2021-01-0 6	7.53	45,500	342,615 .00
2020 1223 0000 1096	000012	南 玻 A	2020-12-23	2021-01-0 6	7.38	24,200	178,596 .00
2020 1223 0000	000012	南 玻 A	2020-12-23	2021-01-0 6	7.38	24,200	178,596 .00

1098							
2020 1223 0000 1099	000012	南 玻 A	2020-12-23	2021-01-0 6	7.38	54,000	398,520 .00
2020 1223 0000 1100	000021	深科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.01	34,700	659,647 .00
2020 1223 0000 1101	000008	神州高铁	2020-12-23	2021-01-0 6	2.54	34,400	87,376. 00
2020 1223 0000 1104	000039	中集集团	2020-12-23	2021-01-0 6	14.99	42,000	629,580 .00
2020 1223 0000 1105	000027	深圳能源	2020-12-23	2021-01-0 6	6.09	25,200	153,468 .00
2020 1223 0000 1106	000031	大悦城	2020-12-23	2021-01-0 6	4.40	22,700	99,880. 00
2020 1223 0000 1107	000028	国药一致	2020-12-23	2021-01-0 6	45.80	10,000	458,000 .00
2020 1223 0000 1108	000021	深科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.01	15,500	294,655 .00
2020 1223 0000 1110	000046	泛海控股	2020-12-23	2021-01-0 6	3.28	61,000	200,080 .00
2020 1223 0000 1111	000027	深圳能源	2020-12-23	2021-01-0 6	6.09	56,300	342,867 .00
2020 1223 0000 1112	000021	深科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.01	15,500	294,655 .00

2020 1223 0000 1113	000039	中集集团	2020-12-23	2021-01-0 6	14.99	18,800	281,812 .00
2020 1223 0000 1115	000046	泛海控股	2020-12-23	2021-01-0 6	3.28	27,300	89,544. 00
2020 1223 0000 1118	000031	大悦城	2020-12-23	2021-01-0 6	4.40	50,700	223,080 .00
2020 1223 0000 1119	000027	深圳能源	2020-12-23	2021-01-0 6	6.09	25,200	153,468 .00
2020 1223 0000 1120	000031	大悦城	2020-12-23	2021-01-0 6	4.40	22,700	99,880. 00
2020 1223 0000 1121	000046	泛海控股	2020-12-23	2021-01-0 6	3.28	27,300	89,544. 00
2020 1223 0000 1123	000039	中集集团	2020-12-23	2021-01-0 6	14.99	18,800	281,812 .00
2020 1223 0000 1124	000050	深天马 A	2020-12-23	2021-01-0 6	14.74	38,600	568,964 .00
2020 1223 0000 1127	000062	深圳华强	2020-12-23	2021-01-0 6	12.44	12,300	153,012 .00
2020 1223 0000 1128	000061	农 产 品	2020-12-23	2021-01-0 6	7.05	11,900	83,895. 00
2020 1223 0000 1129	000050	深天马 A	2020-12-23	2021-01-0 6	14.74	17,300	255,002 .00
2020	000060	中金岭南	2020-12-23	2021-01-0	4.82	44,000	212,080

1223 0000 1130				6			.00
2020 1223 0000 1132	000078	海王生物	2020-12-23	2021-01-06	4.01	29,000	116,290.00
2020 1223 0000 1133	000062	深圳华强	2020-12-23	2021-01-06	12.44	10,000	124,400.00
2020 1223 0000 1135	000089	深圳机场	2020-12-23	2021-01-06	8.17	18,100	147,877.00
2020 1223 0000 1136	000061	农产品	2020-12-23	2021-01-06	7.05	11,900	83,895.00
2020 1223 0000 1137	000090	天健集团	2020-12-23	2021-01-06	5.94	51,300	304,722.00
2020 1223 0000 1138	000050	深天马 A	2020-12-23	2021-01-06	14.74	17,300	255,002.00
2020 1223 0000 1139	000078	海王生物	2020-12-23	2021-01-06	4.01	29,000	116,290.00
2020 1223 0000 1140	000089	深圳机场	2020-12-23	2021-01-06	8.17	18,100	147,877.00
2020 1223 0000 1143	000078	海王生物	2020-12-23	2021-01-06	4.01	64,800	259,848.00
2020 1223 0000 1147	000156	华数传媒	2020-12-23	2021-01-06	8.56	22,500	192,600.00
2020 1223	000156	华数传媒	2020-12-23	2021-01-06	8.56	10,100	86,456.00

0000 1148							
2020 1223 0000 1149	000156	华数传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	8.56	10,100	86,456. 00
2020 1223 0000 1156	000158	常山北明	2020-12-23	2021-01-0 6	6.20	16,900	104,780 .00
2020 1223 0000 1159	000158	常山北明	2020-12-23	2021-01-0 6	6.20	16,900	104,780 .00
2020 1223 0000 1163	000400	许继电气	2020-12-23	2021-01-0 6	14.46	23,800	344,148 .00
2020 1223 0000 1164	000301	东方盛虹	2020-12-23	2021-01-0 6	9.48	17,000	161,160 .00
2020 1223 0000 1165	000401	冀东水泥	2020-12-23	2021-01-0 6	14.15	37,000	523,550 .00
2020 1223 0000 1166	000401	冀东水泥	2020-12-23	2021-01-0 6	14.15	16,600	234,890 .00
2020 1223 0000 1167	000401	冀东水泥	2020-12-23	2021-01-0 6	14.15	16,600	234,890 .00
2020 1223 0000 1168	000402	金融街	2020-12-23	2021-01-0 6	6.45	21,000	135,450 .00
2020 1223 0000 1169	000402	金融街	2020-12-23	2021-01-0 6	6.45	46,800	301,860 .00
2020 1223 0000	000402	金融街	2020-12-23	2021-01-0 6	6.45	21,000	135,450 .00

1170							
2020 1223 0000 1171	000415	渤海租赁	2020-12-23	2021-01-06	2.40	43,600	104,640.00
2020 1223 0000 1173	000060	中金岭南	2020-12-23	2021-01-06	4.82	44,000	212,080.00
2020 1223 0000 1174	000488	晨鸣纸业	2020-12-23	2021-01-06	6.42	48,200	309,444.00
2020 1223 0000 1176	000061	农产品	2020-12-23	2021-01-06	7.05	26,600	187,530.00
2020 1223 0000 1178	000090	天健集团	2020-12-23	2021-01-06	5.94	23,000	136,620.00
2020 1223 0000 1179	000060	中金岭南	2020-12-23	2021-01-06	4.82	98,300	473,806.00
2020 1223 0000 1183	000158	常山北明	2020-12-23	2021-01-06	6.20	37,800	234,360.00
2020 1223 0000 1189	000090	天健集团	2020-12-23	2021-01-06	5.94	23,000	136,620.00
2020 1223 0000 1190	000089	深圳机场	2020-12-23	2021-01-06	8.17	40,400	330,068.00
2020 1223 0000 1193	000513	丽珠集团	2020-12-23	2021-01-06	40.50	10,000	405,000.00
2020 1223 0000 1194	000513	丽珠集团	2020-12-23	2021-01-06	40.50	14,600	591,300.00

2020 1223 0000 1195	000301	东方盛虹	2020-12-23	2021-01-0 6	9.48	38,000	360,240 .00
2020 1223 0000 1196	000301	东方盛虹	2020-12-23	2021-01-0 6	9.48	17,000	161,160 .00
2020 1223 0000 1197	000400	许继电气	2020-12-23	2021-01-0 6	14.46	10,600	153,276 .00
2020 1223 0000 1198	000400	许继电气	2020-12-23	2021-01-0 6	14.46	10,600	153,276 .00
2020 1223 0000 1201	000415	渤海租赁	2020-12-23	2021-01-0 6	2.40	97,200	233,280 .00
2020 1223 0000 1203	000415	渤海租赁	2020-12-23	2021-01-0 6	2.40	43,600	104,640 .00
2020 1223 0000 1204	000528	柳工	2020-12-23	2021-01-0 6	7.36	40,500	298,080 .00
2020 1223 0000 1206	000528	柳工	2020-12-23	2021-01-0 6	7.36	18,100	133,216 .00
2020 1223 0000 1207	000528	柳工	2020-12-23	2021-01-0 6	7.36	18,100	133,216 .00
2020 1223 0000 1208	000537	广宇发展	2020-12-23	2021-01-0 6	6.27	22,100	138,567 .00
2020 1223 0000 1210	000488	晨鸣纸业	2020-12-23	2021-01-0 6	6.42	21,600	138,672 .00
2020	000488	晨鸣纸业	2020-12-23	2021-01-0	6.42	21,600	138,672

1223 0000 1213				6			.00
2020 1223 0000 1215	000501	鄂武商 A	2020-12-23	2021-01-06	11.65	10,000	116,500.00
2020 1223 0000 1216	000501	鄂武商 A	2020-12-23	2021-01-06	11.65	10,000	116,500.00
2020 1223 0000 1217	000501	鄂武商 A	2020-12-23	2021-01-06	11.65	18,000	209,700.00
2020 1223 0000 1218	000540	中天金融	2020-12-23	2021-01-06	3.15	165,000	519,750.00
2020 1223 0000 1220	000519	中兵红箭	2020-12-23	2021-01-06	10.02	27,300	273,546.00
2020 1223 0000 1221	000540	中天金融	2020-12-23	2021-01-06	3.15	73,900	232,785.00
2020 1223 0000 1222	000513	丽珠集团	2020-12-23	2021-01-06	40.50	10,000	405,000.00
2020 1223 0000 1224	000543	皖能电力	2020-12-23	2021-01-06	4.18	19,900	83,182.00
2020 1223 0000 1225	000543	皖能电力	2020-12-23	2021-01-06	4.18	19,900	83,182.00
2020 1223 0000 1226	000547	航天发展	2020-12-23	2021-01-06	27.50	50,500	1,388,750.00
2020 1223	000519	中兵红箭	2020-12-23	2021-01-06	10.02	12,200	122,244.00

0000 1228							
2020 1223 0000 1229	000519	中兵红箭	2020-12-23	2021-01-06	10.02	12,200	122,244.00
2020 1223 0000 1230	000537	广宇发展	2020-12-23	2021-01-06	6.27	10,000	62,700.00
2020 1223 0000 1231	000540	中天金融	2020-12-23	2021-01-06	3.15	73,900	232,785.00
2020 1223 0000 1233	000543	皖能电力	2020-12-23	2021-01-06	4.18	44,400	185,592.00
2020 1223 0000 1234	000537	广宇发展	2020-12-23	2021-01-06	6.27	10,000	62,700.00
2020 1223 0000 1236	000547	航天发展	2020-12-23	2021-01-06	27.50	22,600	621,500.00
2020 1223 0000 1239	000559	万向钱潮	2020-12-23	2021-01-06	5.35	51,800	277,130.00
2020 1223 0000 1240	000559	万向钱潮	2020-12-23	2021-01-06	5.35	23,200	124,120.00
2020 1223 0000 1241	000559	万向钱潮	2020-12-23	2021-01-06	5.35	23,200	124,120.00
2020 1223 0000 1243	000547	航天发展	2020-12-23	2021-01-06	27.50	22,600	621,500.00
2020 1223 0000	000563	陕国投 A	2020-12-23	2021-01-06	3.77	35,000	131,950.00

1244							
2020 1223 0000 1247	000563	陕国投 A	2020-12-23	2021-01-06	3.77	78,100	294,437.00
2020 1223 0000 1249	000563	陕国投 A	2020-12-23	2021-01-06	3.77	35,000	131,950.00
2020 1223 0000 1250	000581	威孚高科	2020-12-23	2021-01-06	23.19	19,700	456,843.00
2020 1223 0000 1251	000581	威孚高科	2020-12-23	2021-01-06	23.19	10,000	231,900.00
2020 1223 0000 1252	000598	兴蓉环境	2020-12-23	2021-01-06	4.80	31,500	151,200.00
2020 1223 0000 1253	000598	兴蓉环境	2020-12-23	2021-01-06	4.80	31,500	151,200.00
2020 1223 0000 1254	000598	兴蓉环境	2020-12-23	2021-01-06	4.80	70,200	336,960.00
2020 1223 0000 1256	000581	威孚高科	2020-12-23	2021-01-06	23.19	10,000	231,900.00
2020 1223 0000 1257	000600	建投能源	2020-12-23	2021-01-06	5.61	28,300	158,763.00
2020 1223 0000 1258	000600	建投能源	2020-12-23	2021-01-06	5.61	12,700	71,247.00
2020 1223 0000 1260	000600	建投能源	2020-12-23	2021-01-06	5.61	12,700	71,247.00

2020 1223 0000 1261	000623	吉林敖东	2020-12-23	2021-01-0 6	16.47	36,600	602,802 .00
2020 1223 0000 1263	000623	吉林敖东	2020-12-23	2021-01-0 6	16.47	16,400	270,108 .00
2020 1223 0000 1265	000623	吉林敖东	2020-12-23	2021-01-0 6	16.47	16,400	270,108 .00
2020 1223 0000 1267	000629	攀钢钒钛	2020-12-23	2021-01-0 6	2.17	75,800	164,486 .00
2020 1223 0000 1268	000629	攀钢钒钛	2020-12-23	2021-01-0 6	2.17	169,100	366,947 .00
2020 1223 0000 1270	000629	攀钢钒钛	2020-12-23	2021-01-0 6	2.17	75,800	164,486 .00
2020 1223 0000 1273	000630	铜陵有色	2020-12-23	2021-01-0 6	2.57	289,600	744,272 .00
2020 1223 0000 1274	000630	铜陵有色	2020-12-23	2021-01-0 6	2.57	129,800	333,586 .00
2020 1223 0000 1276	000630	铜陵有色	2020-12-23	2021-01-0 6	2.57	129,800	333,586 .00
2020 1223 0000 1278	000636	风华高科	2020-12-23	2021-01-0 6	33.70	28,100	946,970 .00
2020 1223 0000 1279	000636	风华高科	2020-12-23	2021-01-0 6	33.70	12,600	424,620 .00
2020	000636	风华高科	2020-12-23	2021-01-0	33.70	12,600	424,620

1223 0000 1281				6			.00
2020 1223 0000 1286	000681	视觉中国	2020-12-23	2021-01-06	13.00	10,000	130,000.00
2020 1223 0000 1287	000685	中山公用	2020-12-23	2021-01-06	8.30	15,500	128,650.00
2020 1223 0000 1289	000681	视觉中国	2020-12-23	2021-01-06	13.00	10,000	130,000.00
2020 1223 0000 1290	000686	东北证券	2020-12-23	2021-01-06	9.82	55,300	543,046.00
2020 1223 0000 1291	000685	中山公用	2020-12-23	2021-01-06	8.30	34,700	288,010.00
2020 1223 0000 1292	000686	东北证券	2020-12-23	2021-01-06	9.82	24,800	243,536.00
2020 1223 0000 1295	000681	视觉中国	2020-12-23	2021-01-06	13.00	16,500	214,500.00
2020 1223 0000 1296	000690	宝新能源	2020-12-23	2021-01-06	7.30	30,700	224,110.00
2020 1223 0000 1297	000685	中山公用	2020-12-23	2021-01-06	8.30	15,500	128,650.00
2020 1223 0000 1298	000690	宝新能源	2020-12-23	2021-01-06	7.30	30,700	224,110.00
2020 1223	000686	东北证券	2020-12-23	2021-01-06	9.82	24,800	243,536.00

0000 1301							
2020 1223 0000 1304	000690	宝新能源	2020-12-23	2021-01-0 6	7.30	68,600	500,780 .00
2020 1223 0000 1306	000709	河钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.24	167,400	374,976 .00
2020 1223 0000 1308	000709	河钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.24	75,100	168,224 .00
2020 1223 0000 1309	000709	河钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.24	75,100	168,224 .00
2020 1223 0000 1310	000717	韶钢松山	2020-12-23	2021-01-0 6	4.27	47,600	203,252 .00
2020 1223 0000 1312	000717	韶钢松山	2020-12-23	2021-01-0 6	4.27	21,300	90,951. 00
2020 1223 0000 1314	000717	韶钢松山	2020-12-23	2021-01-0 6	4.27	21,300	90,951. 00
2020 1223 0000 1316	000718	苏宁环球	2020-12-23	2021-01-0 6	3.43	26,800	91,924. 00
2020 1223 0000 1318	000718	苏宁环球	2020-12-23	2021-01-0 6	3.43	59,700	204,771 .00
2020 1223 0000 1321	000718	苏宁环球	2020-12-23	2021-01-0 6	3.43	26,800	91,924. 00
2020 1223 0000	000729	燕京啤酒	2020-12-23	2021-01-0 6	8.52	55,500	472,860 .00

1344							
2020 1223 0000 1352	000729	燕京啤酒	2020-12-23	2021-01-06	8.52	24,800	211,296.00
2020 1223 0000 1353	000729	燕京啤酒	2020-12-23	2021-01-06	8.52	24,800	211,296.00
2020 1223 0000 1356	000732	泰禾集团	2020-12-23	2021-01-06	3.27	17,600	57,552.00
2020 1223 0000 1364	000732	泰禾集团	2020-12-23	2021-01-06	3.27	17,600	57,552.00
2020 1223 0000 1376	000732	泰禾集团	2020-12-23	2021-01-06	3.27	39,400	128,838.00
2020 1223 0000 1377	000738	航发控制	2020-12-23	2021-01-06	22.93	22,500	515,925.00
2020 1223 0000 1378	000738	航发控制	2020-12-23	2021-01-06	22.93	10,100	231,593.00
2020 1223 0000 1379	000738	航发控制	2020-12-23	2021-01-06	22.93	10,100	231,593.00
2020 1223 0000 1380	000739	普洛药业	2020-12-23	2021-01-06	23.28	23,100	537,768.00
2020 1223 0000 1381	000739	普洛药业	2020-12-23	2021-01-06	23.28	10,300	239,784.00
2020 1223 0000 1382	000739	普洛药业	2020-12-23	2021-01-06	23.28	10,300	239,784.00

2020 1223 0000 1385	000750	国海证券	2020-12-23	2021-01-0 6	5.86	150,000	879,000 .00
2020 1223 0000 1387	000750	国海证券	2020-12-23	2021-01-0 6	5.86	67,200	393,792 .00
2020 1223 0000 1389	000758	中色股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.08	24,300	123,444 .00
2020 1223 0000 1390	000758	中色股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.08	24,300	123,444 .00
2020 1223 0000 1391	000758	中色股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.08	54,300	275,844 .00
2020 1223 0000 1392	000750	国海证券	2020-12-23	2021-01-0 6	5.86	67,200	393,792 .00
2020 1223 0000 1406	000778	新兴铸管	2020-12-23	2021-01-0 6	3.68	42,300	155,664 .00
2020 1223 0000 1408	000778	新兴铸管	2020-12-23	2021-01-0 6	3.68	94,300	347,024 .00
2020 1223 0000 1411	000778	新兴铸管	2020-12-23	2021-01-0 6	3.68	42,300	155,664 .00
2020 1223 0000 1418	000807	云铝股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.53	27,500	207,075 .00
2020 1223 0000 1419	000807	云铝股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.53	61,400	462,342 .00
2020	000807	云铝股份	2020-12-23	2021-01-0	7.53	27,500	207,075

1223 0000 1420				6			.00
2020 1223 0000 1430	000813	德展健康	2020-12-23	2021-01-06	4.43	35,400	156,822.00
2020 1223 0000 1431	000813	德展健康	2020-12-23	2021-01-06	4.43	15,800	69,994.00
2020 1223 0000 1433	000825	太钢不锈	2020-12-23	2021-01-06	3.61	89,500	323,095.00
2020 1223 0000 1435	000825	太钢不锈	2020-12-23	2021-01-06	3.61	40,100	144,761.00
2020 1223 0000 1437	000826	启迪环境	2020-12-23	2021-01-06	6.76	15,100	102,076.00
2020 1223 0000 1438	000813	德展健康	2020-12-23	2021-01-06	4.43	15,800	69,994.00
2020 1223 0000 1439	000825	太钢不锈	2020-12-23	2021-01-06	3.61	40,100	144,761.00
2020 1223 0000 1441	000826	启迪环境	2020-12-23	2021-01-06	6.76	33,600	227,136.00
2020 1223 0000 1442	000826	启迪环境	2020-12-23	2021-01-06	6.76	15,100	102,076.00
2020 1223 0000 1445	000830	鲁西化工	2020-12-23	2021-01-06	12.78	18,000	230,040.00
2020 1223	000830	鲁西化工	2020-12-23	2021-01-06	12.78	40,300	515,034.00

0000 1446							
2020 1223 0000 1447	000830	鲁西化工	2020-12-23	2021-01-0 6	12.78	18,000	230,040 .00
2020 1223 0000 1454	000869	张裕 A	2020-12-23	2021-01-0 6	43.60	10,000	436,000 .00
2020 1223 0000 1456	000877	天山股份	2020-12-23	2021-01-0 6	15.10	11,100	167,610 .00
2020 1223 0000 1458	000877	天山股份	2020-12-23	2021-01-0 6	15.10	24,700	372,970 .00
2020 1223 0000 1459	000878	云南铜业	2020-12-23	2021-01-0 6	14.47	17,900	259,013 .00
2020 1223 0000 1460	000878	云南铜业	2020-12-23	2021-01-0 6	14.47	40,100	580,247 .00
2020 1223 0000 1463	000878	云南铜业	2020-12-23	2021-01-0 6	14.47	17,900	259,013 .00
2020 1223 0000 1465	000883	湖北能源	2020-12-23	2021-01-0 6	3.88	34,300	133,084 .00
2020 1223 0000 1466	000887	中鼎股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.71	28,800	337,248 .00
2020 1223 0000 1468	000883	湖北能源	2020-12-23	2021-01-0 6	3.88	34,300	133,084 .00
2020 1223 0000	000877	天山股份	2020-12-23	2021-01-0 6	15.10	11,100	167,610 .00

1469							
2020 1223 0000 1470	000883	湖北能源	2020-12-23	2021-01-06	3.88	76,600	297,208.00
2020 1223 0000 1473	000887	中鼎股份	2020-12-23	2021-01-06	11.71	12,900	151,059.00
2020 1223 0000 1475	000887	中鼎股份	2020-12-23	2021-01-06	11.71	12,900	151,059.00
2020 1223 0000 1476	000898	鞍钢股份	2020-12-23	2021-01-06	3.04	94,300	286,672.00
2020 1223 0000 1477	000930	中粮科技	2020-12-23	2021-01-06	8.42	43,900	369,638.00
2020 1223 0000 1478	000898	鞍钢股份	2020-12-23	2021-01-06	3.04	42,300	128,592.00
2020 1223 0000 1479	000930	中粮科技	2020-12-23	2021-01-06	8.42	19,600	165,032.00
2020 1223 0000 1480	000932	华菱钢铁	2020-12-23	2021-01-06	4.78	72,400	346,072.00
2020 1223 0000 1482	000932	华菱钢铁	2020-12-23	2021-01-06	4.78	32,400	154,872.00
2020 1223 0000 1483	000932	华菱钢铁	2020-12-23	2021-01-06	4.78	32,400	154,872.00
2020 1223 0000 1485	000898	鞍钢股份	2020-12-23	2021-01-06	3.04	42,300	128,592.00

2020 1223 0000 1486	000937	冀中能源	2020-12-23	2021-01-0 6	4.16	18,700	77,792. 00
2020 1223 0000 1487	000937	冀中能源	2020-12-23	2021-01-0 6	4.16	18,700	77,792. 00
2020 1223 0000 1491	000937	冀中能源	2020-12-23	2021-01-0 6	4.16	41,800	173,888 .00
2020 1223 0000 1492	000930	中粮科技	2020-12-23	2021-01-0 6	8.42	19,600	165,032 .00
2020 1223 0000 1493	000959	首钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.83	62,600	239,758 .00
2020 1223 0000 1495	000959	首钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.83	28,100	107,623 .00
2020 1223 0000 1496	000959	首钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.83	28,100	107,623 .00
2020 1223 0000 1498	000960	锡业股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.20	17,600	197,120 .00
2020 1223 0000 1500	000960	锡业股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.20	17,600	197,120 .00
2020 1223 0000 1501	000960	锡业股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.20	39,300	440,160 .00
2020 1223 0000 1504	000970	中科三环	2020-12-23	2021-01-0 6	9.45	33,400	315,630 .00
2020	000970	中科三环	2020-12-23	2021-01-0	9.45	15,000	141,750

1223 0000 1508				6			.00
2020 1223 0000 1509	000967	盈峰环境	2020-12-23	2021-01-06	8.14	16,700	135,938.00
2020 1223 0000 1510	000967	盈峰环境	2020-12-23	2021-01-06	8.14	37,400	304,436.00
2020 1223 0000 1512	000967	盈峰环境	2020-12-23	2021-01-06	8.14	16,700	135,938.00
2020 1223 0000 1514	000970	中科三环	2020-12-23	2021-01-06	9.45	15,000	141,750.00
2020 1223 0000 1516	000975	银泰黄金	2020-12-23	2021-01-06	8.61	65,500	563,955.00
2020 1223 0000 1518	000975	银泰黄金	2020-12-23	2021-01-06	8.61	29,300	252,273.00
2020 1223 0000 1519	000975	银泰黄金	2020-12-23	2021-01-06	8.61	29,300	252,273.00
2020 1223 0000 1524	000983	山西焦煤	2020-12-23	2021-01-06	5.64	36,100	203,604.00
2020 1223 0000 1527	000983	山西焦煤	2020-12-23	2021-01-06	5.64	80,500	454,020.00
2020 1223 0000 1528	000988	华工科技	2020-12-23	2021-01-06	23.19	31,600	732,804.00
2020 1223	000988	华工科技	2020-12-23	2021-01-06	23.19	14,200	329,298.00

0000 1529							
2020 1223 0000 1530	000990	诚志股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.86	24,600	291,756 .00
2020 1223 0000 1533	000988	华工科技	2020-12-23	2021-01-0 6	23.19	14,200	329,298 .00
2020 1223 0000 1534	000983	山西焦煤	2020-12-23	2021-01-0 6	5.64	36,100	203,604 .00
2020 1223 0000 1535	000990	诚志股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.86	11,000	130,460 .00
2020 1223 0000 1536	000990	诚志股份	2020-12-23	2021-01-0 6	11.86	11,000	130,460 .00
2020 1223 0000 1539	000997	新大陆	2020-12-23	2021-01-0 6	15.28	12,900	197,112 .00
2020 1223 0000 1540	000997	新大陆	2020-12-23	2021-01-0 6	15.28	28,900	441,592 .00
2020 1223 0000 1541	000998	隆平高科	2020-12-23	2021-01-0 6	19.81	16,200	320,922 .00
2020 1223 0000 1543	000998	隆平高科	2020-12-23	2021-01-0 6	19.81	16,200	320,922 .00
2020 1223 0000 1545	000997	新大陆	2020-12-23	2021-01-0 6	15.28	12,900	197,112 .00
2020 1223 0000	000999	华润三九	2020-12-23	2021-01-0 6	24.94	15,400	384,076 .00

1546							
2020 1223 0000 1547	000999	华润三九	2020-12-23	2021-01-06	24.94	10,000	249,400.00
2020 1223 0000 1549	000999	华润三九	2020-12-23	2021-01-06	24.94	10,000	249,400.00
2020 1223 0000 1550	000998	隆平高科	2020-12-23	2021-01-06	19.81	36,200	717,122.00
2020 1223 0000 1551	001914	招商积余	2020-12-23	2021-01-06	21.53	16,700	359,551.00
2020 1223 0000 1552	001914	招商积余	2020-12-23	2021-01-06	21.53	10,000	215,300.00
2020 1223 0000 1554	001914	招商积余	2020-12-23	2021-01-06	21.53	10,000	215,300.00
2020 1223 0000 1556	002002	鸿达兴业	2020-12-23	2021-01-06	3.00	71,000	213,000.00
2020 1223 0000 1557	002002	鸿达兴业	2020-12-23	2021-01-06	3.00	31,800	95,400.00
2020 1223 0000 1558	002004	华邦健康	2020-12-23	2021-01-06	5.54	62,400	345,696.00
2020 1223 0000 1559	002002	鸿达兴业	2020-12-23	2021-01-06	3.00	31,800	95,400.00
2020 1223 0000 1560	002004	华邦健康	2020-12-23	2021-01-06	5.54	28,000	155,120.00

2020 1223 0000 1565	002004	华邦健康	2020-12-23	2021-01-0 6	5.54	28,000	155,120 .00
2020 1223 0000 1581	002010	传化智联	2020-12-23	2021-01-0 6	4.71	51,300	241,623 .00
2020 1223 0000 1582	002013	中航机电	2020-12-23	2021-01-0 6	11.45	76,300	873,635 .00
2020 1223 0000 1583	002013	中航机电	2020-12-23	2021-01-0 6	11.45	34,200	391,590 .00
2020 1223 0000 1584	002019	亿帆医药	2020-12-23	2021-01-0 6	18.93	13,000	246,090 .00
2020 1223 0000 1586	002019	亿帆医药	2020-12-23	2021-01-0 6	18.93	29,100	550,863 .00
2020 1223 0000 1588	002019	亿帆医药	2020-12-23	2021-01-0 6	18.93	13,000	246,090 .00
2020 1223 0000 1592	002010	传化智联	2020-12-23	2021-01-0 6	4.71	23,000	108,330 .00
2020 1223 0000 1593	002013	中航机电	2020-12-23	2021-01-0 6	11.45	34,200	391,590 .00
2020 1223 0000 1597	002010	传化智联	2020-12-23	2021-01-0 6	4.71	23,000	108,330 .00
2020 1223 0000 1598	002028	思源电气	2020-12-23	2021-01-0 6	20.06	23,900	479,434 .00
2020	002028	思源电气	2020-12-23	2021-01-0	20.06	10,700	214,642

1223 0000 1599				6			.00
2020 1223 0000 1601	002028	思源电气	2020-12-23	2021-01-06	20.06	10,700	214,642.00
2020 1223 0000 1602	002030	达安基因	2020-12-23	2021-01-06	34.30	10,800	370,440.00
2020 1223 0000 1603	002030	达安基因	2020-12-23	2021-01-06	34.30	24,100	826,630.00
2020 1223 0000 1608	002038	双鹭药业	2020-12-23	2021-01-06	10.10	24,300	245,430.00
2020 1223 0000 1611	002038	双鹭药业	2020-12-23	2021-01-06	10.10	10,900	110,090.00
2020 1223 0000 1612	002038	双鹭药业	2020-12-23	2021-01-06	10.10	10,900	110,090.00
2020 1223 0000 1615	002048	宁波华翔	2020-12-23	2021-01-06	15.57	10,000	155,700.00
2020 1223 0000 1616	002048	宁波华翔	2020-12-23	2021-01-06	15.57	19,700	306,729.00
2020 1223 0000 1619	002048	宁波华翔	2020-12-23	2021-01-06	15.57	10,000	155,700.00
2020 1223 0000 1622	002051	中工国际	2020-12-23	2021-01-06	7.09	19,300	136,837.00
2020 1223	002030	达安基因	2020-12-23	2021-01-06	34.30	10,800	370,440.00

0000 1623							
2020 1223 0000 1624	002051	中工国际	2020-12-23	2021-01-0 6	7.09	10,000	70,900. 00
2020 1223 0000 1625	002056	横店东磁	2020-12-23	2021-01-0 6	15.19	14,400	218,736 .00
2020 1223 0000 1626	002051	中工国际	2020-12-23	2021-01-0 6	7.09	10,000	70,900. 00
2020 1223 0000 1627	002056	横店东磁	2020-12-23	2021-01-0 6	15.19	32,300	490,637 .00
2020 1223 0000 1628	002064	华峰化学	2020-12-23	2021-01-0 6	10.09	54,600	550,914 .00
2020 1223 0000 1629	002064	华峰化学	2020-12-23	2021-01-0 6	10.09	24,500	247,205 .00
2020 1223 0000 1631	002074	国轩高科	2020-12-23	2021-01-0 6	39.12	18,000	704,160 .00
2020 1223 0000 1635	002075	沙钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	10.97	69,400	761,318 .00
2020 1223 0000 1636	002078	太阳纸业	2020-12-23	2021-01-0 6	14.43	27,500	396,825 .00
2020 1223 0000 1639	002078	太阳纸业	2020-12-23	2021-01-0 6	14.43	61,300	884,559 .00
2020 1223 0000	002075	沙钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	10.97	31,100	341,167 .00

1641							
2020 1223 0000 1644	002081	金螳螂	2020-12-23	2021-01-06	9.39	63,300	594,387.00
2020 1223 0000 1645	002080	中材科技	2020-12-23	2021-01-06	24.18	11,800	285,324.00
2020 1223 0000 1647	002081	金螳螂	2020-12-23	2021-01-06	9.39	28,300	265,737.00
2020 1223 0000 1648	002080	中材科技	2020-12-23	2021-01-06	24.18	11,800	285,324.00
2020 1223 0000 1649	002085	万丰奥威	2020-12-23	2021-01-06	6.56	60,200	394,912.00
2020 1223 0000 1650	002081	金螳螂	2020-12-23	2021-01-06	9.39	28,300	265,737.00
2020 1223 0000 1651	002080	中材科技	2020-12-23	2021-01-06	24.18	26,300	635,934.00
2020 1223 0000 1652	002085	万丰奥威	2020-12-23	2021-01-06	6.56	27,000	177,120.00
2020 1223 0000 1654	002092	中泰化学	2020-12-23	2021-01-06	6.15	30,200	185,730.00
2020 1223 0000 1655	002093	国脉科技	2020-12-23	2021-01-06	7.29	19,700	143,613.00
2020 1223 0000 1657	002093	国脉科技	2020-12-23	2021-01-06	7.29	10,000	72,900.00

2020 1223 0000 1659	002093	国脉科技	2020-12-23	2021-01-0 6	7.29	10,000	72,900. 00
2020 1223 0000 1661	002110	三钢闽光	2020-12-23	2021-01-0 6	6.73	48,200	324,386 .00
2020 1223 0000 1662	002110	三钢闽光	2020-12-23	2021-01-0 6	6.73	21,600	145,368 .00
2020 1223 0000 1663	002124	天邦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	14.60	36,200	528,520 .00
2020 1223 0000 1664	002124	天邦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	14.60	16,200	236,520 .00
2020 1223 0000 1665	002128	露天煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	10.94	30,200	330,388 .00
2020 1223 0000 1666	002128	露天煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	10.94	13,500	147,690 .00
2020 1223 0000 1669	002131	利欧股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.03	119,100	360,873 .00
2020 1223 0000 1671	002138	顺络电子	2020-12-23	2021-01-0 6	24.52	25,300	620,356 .00
2020 1223 0000 1672	002138	顺络电子	2020-12-23	2021-01-0 6	24.52	11,300	277,076 .00
2020 1223 0000 1675	002064	华峰化学	2020-12-23	2021-01-0 6	10.09	24,500	247,205 .00
2020	002056	横店东磁	2020-12-23	2021-01-0	15.19	14,400	218,736

1223 0000 1676				6			.00
2020 1223 0000 1678	002078	太阳纸业	2020-12-23	2021-01-06	14.43	27,500	396,825.00
2020 1223 0000 1680	002085	万丰奥威	2020-12-23	2021-01-06	6.56	27,000	177,120.00
2020 1223 0000 1682	002074	国轩高科	2020-12-23	2021-01-06	39.12	18,000	704,160.00
2020 1223 0000 1684	002138	顺络电子	2020-12-23	2021-01-06	24.52	11,300	277,076.00
2020 1223 0000 1685	002075	沙钢股份	2020-12-23	2021-01-06	10.97	31,100	341,167.00
2020 1223 0000 1686	002092	中泰化学	2020-12-23	2021-01-06	6.15	30,200	185,730.00
2020 1223 0000 1687	002128	露天煤业	2020-12-23	2021-01-06	10.94	13,500	147,690.00
2020 1223 0000 1688	002092	中泰化学	2020-12-23	2021-01-06	6.15	67,300	413,895.00
2020 1223 0000 1690	002152	广电运通	2020-12-23	2021-01-06	10.68	21,200	226,416.00
2020 1223 0000 1691	002074	国轩高科	2020-12-23	2021-01-06	39.12	40,300	1,576,536.00
2020 1223	002110	三钢闽光	2020-12-23	2021-01-06	6.73	21,600	145,368.00

0000 1692							
2020 1223 0000 1693	002124	天邦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	14.60	16,200	236,520 .00
2020 1223 0000 1696	002152	广电运通	2020-12-23	2021-01-0 6	10.68	21,200	226,416 .00
2020 1223 0000 1698	002152	广电运通	2020-12-23	2021-01-0 6	10.68	47,400	506,232 .00
2020 1223 0000 1704	002155	湖南黄金	2020-12-23	2021-01-0 6	8.51	33,100	281,681 .00
2020 1223 0000 1705	002155	湖南黄金	2020-12-23	2021-01-0 6	8.51	14,800	125,948 .00
2020 1223 0000 1707	002131	利欧股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.03	119,100	360,873 .00
2020 1223 0000 1708	002131	利欧股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.03	265,800	805,374 .00
2020 1223 0000 1709	002155	湖南黄金	2020-12-23	2021-01-0 6	8.51	14,800	125,948 .00
2020 1223 0000 1718	002156	通富微电	2020-12-23	2021-01-0 6	25.24	11,700	295,308 .00
2020 1223 0000 1720	002156	通富微电	2020-12-23	2021-01-0 6	25.24	11,700	295,308 .00
2020 1223 0000	002174	游族网络	2020-12-23	2021-01-0 6	13.16	12,900	169,764 .00

1721							
2020 1223 0000 1723	002156	通富微电	2020-12-23	2021-01-06	25.24	26,100	658,764.00
2020 1223 0000 1724	002174	游族网络	2020-12-23	2021-01-06	13.16	12,900	169,764.00
2020 1223 0000 1725	002183	怡亚通	2020-12-23	2021-01-06	4.36	58,600	255,496.00
2020 1223 0000 1726	002174	游族网络	2020-12-23	2021-01-06	13.16	28,800	379,008.00
2020 1223 0000 1730	002183	怡亚通	2020-12-23	2021-01-06	4.36	26,200	114,232.00
2020 1223 0000 1731	002183	怡亚通	2020-12-23	2021-01-06	4.36	26,200	114,232.00
2020 1223 0000 1733	002185	华天科技	2020-12-23	2021-01-06	13.62	38,600	525,732.00
2020 1223 0000 1735	002185	华天科技	2020-12-23	2021-01-06	13.62	86,200	1,174,044.00
2020 1223 0000 1739	002185	华天科技	2020-12-23	2021-01-06	13.62	38,600	525,732.00
2020 1223 0000 1740	002191	劲嘉股份	2020-12-23	2021-01-06	9.23	34,500	318,435.00
2020 1223 0000 1742	002191	劲嘉股份	2020-12-23	2021-01-06	9.23	15,400	142,142.00

2020 1223 0000 1743	002191	劲嘉股份	2020-12-23	2021-01-0 6	9.23	15,400	142,142 .00
2020 1223 0000 1745	002195	二三四五	2020-12-23	2021-01-0 6	2.26	224,900	508,274 .00
2020 1223 0000 1746	002195	二三四五	2020-12-23	2021-01-0 6	2.26	100,800	227,808 .00
2020 1223 0000 1749	002203	海亮股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.39	38,500	284,515 .00
2020 1223 0000 1750	002203	海亮股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.39	17,200	127,108 .00
2020 1223 0000 1753	002195	二三四五	2020-12-23	2021-01-0 6	2.26	100,800	227,808 .00
2020 1223 0000 1755	002203	海亮股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.39	17,200	127,108 .00
2020 1223 0000 1756	002212	天融信	2020-12-23	2021-01-0 6	21.01	36,800	773,168 .00
2020 1223 0000 1758	002217	合力泰	2020-12-23	2021-01-0 6	4.10	33,000	135,300 .00
2020 1223 0000 1759	002212	天融信	2020-12-23	2021-01-0 6	21.01	16,500	346,665 .00
2020 1223 0000 1760	002217	合力泰	2020-12-23	2021-01-0 6	4.10	73,600	301,760 .00
2020	002217	合力泰	2020-12-23	2021-01-0	4.10	33,000	135,300

1223 0000 1761				6			.00
2020 1223 0000 1763	002221	东华能源	2020-12-23	2021-01-06	10.14	45,300	459,342.00
2020 1223 0000 1764	002212	天融信	2020-12-23	2021-01-06	21.01	16,500	346,665.00
2020 1223 0000 1766	002221	东华能源	2020-12-23	2021-01-06	10.14	20,300	205,842.00
2020 1223 0000 1768	002221	东华能源	2020-12-23	2021-01-06	10.14	20,300	205,842.00
2020 1223 0000 1770	002223	鱼跃医疗	2020-12-23	2021-01-06	28.21	10,600	299,026.00
2020 1223 0000 1771	002223	鱼跃医疗	2020-12-23	2021-01-06	28.21	23,600	665,756.00
2020 1223 0000 1772	002223	鱼跃医疗	2020-12-23	2021-01-06	28.21	10,600	299,026.00
2020 1223 0000 1773	002233	塔牌集团	2020-12-23	2021-01-06	12.74	28,200	359,268.00
2020 1223 0000 1775	002233	塔牌集团	2020-12-23	2021-01-06	12.74	12,600	160,524.00
2020 1223 0000 1777	002233	塔牌集团	2020-12-23	2021-01-06	12.74	12,600	160,524.00
2020 1223	002242	九阳股份	2020-12-23	2021-01-06	32.04	12,000	384,480.00

0000 1787							
2020 1223 0000 1788	002242	九阳股份	2020-12-23	2021-01-0 6	32.04	10,000	320,400 .00
2020 1223 0000 1789	002244	滨江集团	2020-12-23	2021-01-0 6	4.59	61,100	280,449 .00
2020 1223 0000 1791	002249	大洋电机	2020-12-23	2021-01-0 6	4.50	55,800	251,100 .00
2020 1223 0000 1792	002244	滨江集团	2020-12-23	2021-01-0 6	4.59	27,400	125,766 .00
2020 1223 0000 1794	002249	大洋电机	2020-12-23	2021-01-0 6	4.50	25,000	112,500 .00
2020 1223 0000 1795	002250	联化科技	2020-12-23	2021-01-0 6	23.99	29,000	695,710 .00
2020 1223 0000 1797	002244	滨江集团	2020-12-23	2021-01-0 6	4.59	27,400	125,766 .00
2020 1223 0000 1798	002249	大洋电机	2020-12-23	2021-01-0 6	4.50	25,000	112,500 .00
2020 1223 0000 1799	002250	联化科技	2020-12-23	2021-01-0 6	23.99	13,000	311,870 .00
2020 1223 0000 1800	002266	浙富控股	2020-12-23	2021-01-0 6	4.50	63,200	284,400 .00
2020 1223 0000	002266	浙富控股	2020-12-23	2021-01-0 6	4.50	28,300	127,350 .00

1801							
2020 1223 0000 1802	002250	联化科技	2020-12-23	2021-01-06	23.99	13,000	311,870.00
2020 1223 0000 1803	002266	浙富控股	2020-12-23	2021-01-06	4.50	28,300	127,350.00
2020 1223 0000 1806	002268	卫士通	2020-12-23	2021-01-06	16.70	23,100	385,770.00
2020 1223 0000 1809	002273	水晶光电	2020-12-23	2021-01-06	11.59	47,800	554,002.00
2020 1223 0000 1810	002268	卫士通	2020-12-23	2021-01-06	16.70	10,300	172,010.00
2020 1223 0000 1812	002268	卫士通	2020-12-23	2021-01-06	16.70	10,300	172,010.00
2020 1223 0000 1813	002273	水晶光电	2020-12-23	2021-01-06	11.59	21,400	248,026.00
2020 1223 0000 1814	002281	光迅科技	2020-12-23	2021-01-06	29.04	16,400	476,256.00
2020 1223 0000 1815	002273	水晶光电	2020-12-23	2021-01-06	11.59	21,400	248,026.00
2020 1223 0000 1817	002281	光迅科技	2020-12-23	2021-01-06	29.04	10,000	290,400.00
2020 1223 0000 1818	002294	信立泰	2020-12-23	2021-01-06	28.33	10,000	283,300.00

2020 1223 0000 1820	002294	信立泰	2020-12-23	2021-01-0 6	28.33	10,000	283,300 .00
2020 1223 0000 1821	002299	圣农发展	2020-12-23	2021-01-0 6	26.54	10,900	289,286 .00
2020 1223 0000 1822	002281	光迅科技	2020-12-23	2021-01-0 6	29.04	10,000	290,400 .00
2020 1223 0000 1824	002299	圣农发展	2020-12-23	2021-01-0 6	26.54	24,500	650,230 .00
2020 1223 0000 1825	002294	信立泰	2020-12-23	2021-01-0 6	28.33	16,400	464,612 .00
2020 1223 0000 1827	002302	西部建设	2020-12-23	2021-01-0 6	8.78	10,000	87,800. 00
2020 1223 0000 1828	002302	西部建设	2020-12-23	2021-01-0 6	8.78	10,000	87,800. 00
2020 1223 0000 1829	002299	圣农发展	2020-12-23	2021-01-0 6	26.54	10,900	289,286 .00
2020 1223 0000 1830	002302	西部建设	2020-12-23	2021-01-0 6	8.78	19,900	174,722 .00
2020 1223 0000 1832	002317	众生药业	2020-12-23	2021-01-0 6	11.02	25,600	282,112 .00
2020 1223 0000 1833	002317	众生药业	2020-12-23	2021-01-0 6	11.02	11,500	126,730 .00
2020	002317	众生药业	2020-12-23	2021-01-0	11.02	11,500	126,730

1223 0000 1834				6			.00
2020 1223 0000 1836	002340	格林美	2020-12-23	2021-01-06	6.99	67,500	471,825.00
2020 1223 0000 1839	002353	杰瑞股份	2020-12-23	2021-01-06	35.00	22,500	787,500.00
2020 1223 0000 1840	002353	杰瑞股份	2020-12-23	2021-01-06	35.00	10,100	353,500.00
2020 1223 0000 1841	002368	太极股份	2020-12-23	2021-01-06	26.11	10,000	261,100.00
2020 1223 0000 1842	002368	太极股份	2020-12-23	2021-01-06	26.11	15,900	415,149.00
2020 1223 0000 1843	002340	格林美	2020-12-23	2021-01-06	6.99	150,500	1,051,995.00
2020 1223 0000 1845	002340	格林美	2020-12-23	2021-01-06	6.99	67,500	471,825.00
2020 1223 0000 1847	002368	太极股份	2020-12-23	2021-01-06	26.11	10,000	261,100.00
2020 1223 0000 1848	002353	杰瑞股份	2020-12-23	2021-01-06	35.00	10,100	353,500.00
2020 1223 0000 1851	002372	伟星新材	2020-12-23	2021-01-06	18.70	11,100	207,570.00
2020 1223	002372	伟星新材	2020-12-23	2021-01-06	18.70	24,700	461,890.00

0000 1852							
2020 1223 0000 1854	002373	千方科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.12	31,100	594,632 .00
2020 1223 0000 1856	002372	伟星新材	2020-12-23	2021-01-0 6	18.70	11,100	207,570 .00
2020 1223 0000 1857	002375	亚厦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.44	11,700	87,048. 00
2020 1223 0000 1858	002373	千方科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.12	13,900	265,768 .00
2020 1223 0000 1859	002373	千方科技	2020-12-23	2021-01-0 6	19.12	13,900	265,768 .00
2020 1223 0000 1861	002375	亚厦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.44	26,200	194,928 .00
2020 1223 0000 1862	002382	蓝帆医疗	2020-12-23	2021-01-0 6	21.09	22,700	478,743 .00
2020 1223 0000 1863	002375	亚厦股份	2020-12-23	2021-01-0 6	7.44	11,700	87,048. 00
2020 1223 0000 1865	002382	蓝帆医疗	2020-12-23	2021-01-0 6	21.09	10,100	213,009 .00
2020 1223 0000 1866	002382	蓝帆医疗	2020-12-23	2021-01-0 6	21.09	10,100	213,009 .00
2020 1223 0000	002385	大北农	2020-12-23	2021-01-0 6	9.66	51,800	500,388 .00

1868							
2020 1223 0000 1873	002385	大北农	2020-12-23	2021-01-06	9.66	115,500	1,115,730.00
2020 1223 0000 1875	002385	大北农	2020-12-23	2021-01-06	9.66	51,800	500,388.00
2020 1223 0000 1876	002387	维信诺	2020-12-23	2021-01-06	11.40	14,400	164,160.00
2020 1223 0000 1877	002387	维信诺	2020-12-23	2021-01-06	11.40	32,200	367,080.00
2020 1223 0000 1879	002387	维信诺	2020-12-23	2021-01-06	11.40	14,400	164,160.00
2020 1223 0000 1880	002390	信邦制药	2020-12-23	2021-01-06	8.48	46,000	390,080.00
2020 1223 0000 1882	002390	信邦制药	2020-12-23	2021-01-06	8.48	20,600	174,688.00
2020 1223 0000 1884	002390	信邦制药	2020-12-23	2021-01-06	8.48	20,600	174,688.00
2020 1223 0000 1885	002396	星网锐捷	2020-12-23	2021-01-06	23.06	18,300	421,998.00
2020 1223 0000 1886	002396	星网锐捷	2020-12-23	2021-01-06	23.06	10,000	230,600.00
2020 1223 0000 1887	002396	星网锐捷	2020-12-23	2021-01-06	23.06	10,000	230,600.00

2020 1223 0000 1888	002399	海普瑞	2020-12-23	2021-01-06	17.22	14,600	251,412.00
2020 1223 0000 1889	002399	海普瑞	2020-12-23	2021-01-06	17.22	10,000	172,200.00
2020 1223 0000 1890	002399	海普瑞	2020-12-23	2021-01-06	17.22	10,000	172,200.00
2020 1223 0000 1897	002408	齐翔腾达	2020-12-23	2021-01-06	8.36	27,900	233,244.00
2020 1223 0000 1898	002408	齐翔腾达	2020-12-23	2021-01-06	8.36	12,500	104,500.00
2020 1223 0000 1900	002408	齐翔腾达	2020-12-23	2021-01-06	8.36	12,500	104,500.00
2020 1223 0000 1908	002416	爱施德	2020-12-23	2021-01-06	7.46	10,900	81,314.00
2020 1223 0000 1909	002416	爱施德	2020-12-23	2021-01-06	7.46	24,300	181,278.00
2020 1223 0000 1913	002419	天虹股份	2020-12-23	2021-01-06	7.64	18,800	143,632.00
2020 1223 0000 1914	002416	爱施德	2020-12-23	2021-01-06	7.46	10,900	81,314.00
2020 1223 0000 1915	002419	天虹股份	2020-12-23	2021-01-06	7.64	10,000	76,400.00
2020	002424	贵州百灵	2020-12-23	2021-01-06	7.83	27,600	216,108

1223 0000 1917				6			.00
2020 1223 0000 1919	002424	贵州百灵	2020-12-23	2021-01-06	7.83	12,400	97,092.00
2020 1223 0000 1920	002419	天虹股份	2020-12-23	2021-01-06	7.64	10,000	76,400.00
2020 1223 0000 1921	002424	贵州百灵	2020-12-23	2021-01-06	7.83	12,400	97,092.00
2020 1223 0000 1922	002429	兆驰股份	2020-12-23	2021-01-06	6.20	71,000	440,200.00
2020 1223 0000 1925	002429	兆驰股份	2020-12-23	2021-01-06	6.20	31,800	197,160.00
2020 1223 0000 1926	002429	兆驰股份	2020-12-23	2021-01-06	6.20	31,800	197,160.00
2020 1223 0000 1927	002434	万里扬	2020-12-23	2021-01-06	8.92	26,300	234,596.00
2020 1223 0000 1929	002434	万里扬	2020-12-23	2021-01-06	8.92	11,800	105,256.00
2020 1223 0000 1930	002434	万里扬	2020-12-23	2021-01-06	8.92	11,800	105,256.00
2020 1223 0000 1934	002440	闰土股份	2020-12-23	2021-01-06	9.32	12,100	112,772.00
2020 1223	002440	闰土股份	2020-12-23	2021-01-06	9.32	27,100	252,572.00

0000 1935							
2020 1223 0000 1936	002440	闰土股份	2020-12-23	2021-01-06	9.32	12,100	112,772.00
2020 1223 0000 1938	002444	巨星科技	2020-12-23	2021-01-06	31.11	21,100	656,421.00
2020 1223 0000 1939	002444	巨星科技	2020-12-23	2021-01-06	31.11	10,000	311,100.00
2020 1223 0000 1940	002444	巨星科技	2020-12-23	2021-01-06	31.11	10,000	311,100.00
2020 1223 0000 1946	002458	益生股份	2020-12-23	2021-01-06	11.15	10,500	117,075.00
2020 1223 0000 1947	002458	益生股份	2020-12-23	2021-01-06	11.15	23,400	260,910.00
2020 1223 0000 1949	002458	益生股份	2020-12-23	2021-01-06	11.15	10,500	117,075.00
2020 1223 0000 1960	002465	海格通信	2020-12-23	2021-01-06	10.83	32,500	351,975.00
2020 1223 0000 1961	002465	海格通信	2020-12-23	2021-01-06	10.83	32,500	351,975.00
2020 1223 0000 1962	002468	申通快递	2020-12-23	2021-01-06	10.08	24,000	241,920.00
2020 1223 0000	002468	申通快递	2020-12-23	2021-01-06	10.08	10,700	107,856.00

1964							
2020 1223 0000 1967	002465	海格通信	2020-12-23	2021-01-06	10.83	72,500	785,175.00
2020 1223 0000 1969	002500	山西证券	2020-12-23	2021-01-06	8.95	37,900	339,205.00
2020 1223 0000 1971	002500	山西证券	2020-12-23	2021-01-06	8.95	37,900	339,205.00
2020 1223 0000 1973	002503	搜于特	2020-12-23	2021-01-06	2.24	73,200	163,968.00
2020 1223 0000 1974	002468	申通快递	2020-12-23	2021-01-06	10.08	10,700	107,856.00
2020 1223 0000 1975	002503	搜于特	2020-12-23	2021-01-06	2.24	32,800	73,472.00
2020 1223 0000 1980	002505	鹏都农牧	2020-12-23	2021-01-06	2.53	45,100	114,103.00
2020 1223 0000 1981	002505	鹏都农牧	2020-12-23	2021-01-06	2.53	100,600	254,518.00
2020 1223 0000 1983	002503	搜于特	2020-12-23	2021-01-06	2.24	32,800	73,472.00
2020 1223 0000 1984	002500	山西证券	2020-12-23	2021-01-06	8.95	84,600	757,170.00
2020 1223 0000 1986	002505	鹏都农牧	2020-12-23	2021-01-06	2.53	45,100	114,103.00

2020 1223 0000 1988	002506	协鑫集成	2020-12-23	2021-01-0 6	4.25	119,800	509,150 .00
2020 1223 0000 1989	002506	协鑫集成	2020-12-23	2021-01-0 6	4.25	53,700	228,225 .00
2020 1223 0000 1990	002506	协鑫集成	2020-12-23	2021-01-0 6	4.25	53,700	228,225 .00
2020 1223 0000 1992	002507	涪陵榨菜	2020-12-23	2021-01-0 6	42.30	21,700	917,910 .00
2020 1223 0000 1993	002507	涪陵榨菜	2020-12-23	2021-01-0 6	42.30	10,000	423,000 .00
2020 1223 0000 1994	002507	涪陵榨菜	2020-12-23	2021-01-0 6	42.30	10,000	423,000 .00
2020 1223 0000 1996	002511	中顺洁柔	2020-12-23	2021-01-0 6	20.87	25,700	536,359 .00
2020 1223 0000 1998	002511	中顺洁柔	2020-12-23	2021-01-0 6	20.87	11,500	240,005 .00
2020 1223 0000 1999	002511	中顺洁柔	2020-12-23	2021-01-0 6	20.87	11,500	240,005 .00
2020 1223 0000 2000	002544	杰赛科技	2020-12-23	2021-01-0 6	16.78	10,000	167,800 .00
2020 1223 0000 2003	002557	洽洽食品	2020-12-23	2021-01-0 6	53.85	11,900	640,815 .00
2020	002544	杰赛科技	2020-12-23	2021-01-0	16.78	13,400	224,852

1223 0000 2005				6			.00
2020 1223 0000 2006	002544	杰赛科技	2020-12-23	2021-01-06	16.78	10,000	167,800.00
2020 1223 0000 2008	002557	洽洽食品	2020-12-23	2021-01-06	53.85	10,000	538,500.00
2020 1223 0000 2009	002563	森马服饰	2020-12-23	2021-01-06	10.02	31,700	317,634.00
2020 1223 0000 2010	002563	森马服饰	2020-12-23	2021-01-06	10.02	14,200	142,284.00
2020 1223 0000 2011	002563	森马服饰	2020-12-23	2021-01-06	10.02	14,200	142,284.00
2020 1223 0000 2012	002568	百润股份	2020-12-23	2021-01-06	104.29	10,500	1,095,045.00
2020 1223 0000 2015	002568	百润股份	2020-12-23	2021-01-06	104.29	10,000	1,042,900.00
2020 1223 0000 2019	002572	索菲亚	2020-12-23	2021-01-06	25.90	25,100	650,090.00
2020 1223 0000 2020	002572	索菲亚	2020-12-23	2021-01-06	25.90	11,200	290,080.00
2020 1223 0000 2021	002583	海能达	2020-12-23	2021-01-06	6.14	36,100	221,654.00
2020 1223	002583	海能达	2020-12-23	2021-01-06	6.14	16,200	99,468.00

0000 2022							
2020 1223 0000 2023	002572	索菲亚	2020-12-23	2021-01-0 6	25.90	11,200	290,080 .00
2020 1223 0000 2024	002589	瑞康医药	2020-12-23	2021-01-0 6	5.23	41,300	215,999 .00
2020 1223 0000 2025	002589	瑞康医药	2020-12-23	2021-01-0 6	5.23	18,500	96,755. 00
2020 1223 0000 2027	002589	瑞康医药	2020-12-23	2021-01-0 6	5.23	18,500	96,755. 00
2020 1223 0000 2028	002583	海能达	2020-12-23	2021-01-0 6	6.14	16,200	99,468. 00
2020 1223 0000 2029	002595	豪迈科技	2020-12-23	2021-01-0 6	29.65	15,700	465,505 .00
2020 1223 0000 2034	002595	豪迈科技	2020-12-23	2021-01-0 6	29.65	10,000	296,500 .00
2020 1223 0000 2037	002595	豪迈科技	2020-12-23	2021-01-0 6	29.65	10,000	296,500 .00
2020 1223 0000 2039	002603	以岭药业	2020-12-23	2021-01-0 6	25.50	23,600	601,800 .00
2020 1223 0000 2041	002603	以岭药业	2020-12-23	2021-01-0 6	25.50	10,600	270,300 .00
2020 1223 0000	002603	以岭药业	2020-12-23	2021-01-0 6	25.50	10,600	270,300 .00

2043							
2020 1223 0000 2047	002635	安洁科技	2020-12-23	2021-01-06	17.23	12,400	213,652.00
2020 1223 0000 2049	002635	安洁科技	2020-12-23	2021-01-06	17.23	10,000	172,300.00
2020 1223 0000 2050	002640	跨境通	2020-12-23	2021-01-06	5.14	22,000	113,080.00
2020 1223 0000 2052	002648	卫星石化	2020-12-23	2021-01-06	26.12	19,300	504,116.00
2020 1223 0000 2053	002640	跨境通	2020-12-23	2021-01-06	5.14	49,000	251,860.00
2020 1223 0000 2056	002648	卫星石化	2020-12-23	2021-01-06	26.12	10,000	261,200.00
2020 1223 0000 2059	002648	卫星石化	2020-12-23	2021-01-06	26.12	10,000	261,200.00
2020 1223 0000 2061	002640	跨境通	2020-12-23	2021-01-06	5.14	22,000	113,080.00
2020 1223 0000 2062	002653	海思科	2020-12-23	2021-01-06	17.52	10,000	175,200.00
2020 1223 0000 2065	002670	国盛金控	2020-12-23	2021-01-06	13.75	45,600	627,000.00
2020 1223 0000 2066	002683	宏大爆破	2020-12-23	2021-01-06	35.95	20,600	740,570.00

2020 1223 0000 2067	002670	国盛金控	2020-12-23	2021-01-0 6	13.75	20,400	280,500 .00
2020 1223 0000 2069	002690	美亚光电	2020-12-23	2021-01-0 6	44.28	10,600	469,368 .00
2020 1223 0000 2070	002670	国盛金控	2020-12-23	2021-01-0 6	13.75	20,400	280,500 .00
2020 1223 0000 2071	002701	奥瑞金	2020-12-23	2021-01-0 6	4.94	66,600	329,004 .00
2020 1223 0000 2073	002705	新宝股份	2020-12-23	2021-01-0 6	42.25	12,600	532,350 .00
2020 1223 0000 2074	002709	天赐材料	2020-12-23	2021-01-0 6	103.80	12,800	1,328,6 40.00
2020 1223 0000 2075	002705	新宝股份	2020-12-23	2021-01-0 6	42.25	10,000	422,500 .00
2020 1223 0000 2076	002709	天赐材料	2020-12-23	2021-01-0 6	103.80	10,000	1,038,0 00.00
2020 1223 0000 2078	002683	宏大爆破	2020-12-23	2021-01-0 6	35.95	10,000	359,500 .00
2020 1223 0000 2079	002690	美亚光电	2020-12-23	2021-01-0 6	44.28	10,000	442,800 .00
2020 1223 0000 2080	002683	宏大爆破	2020-12-23	2021-01-0 6	35.95	10,000	359,500 .00
2020	002701	奥瑞金	2020-12-23	2021-01-0	4.94	29,800	147,212

1223 0000 2083				6			.00
2020 1223 0000 2085	002701	奥瑞金	2020-12-23	2021-01-06	4.94	29,800	147,212.00
2020 1223 0000 2087	002745	木林森	2020-12-23	2021-01-06	14.59	29,200	426,028.00
2020 1223 0000 2090	002797	第一创业	2020-12-23	2021-01-06	9.95	51,800	515,410.00
2020 1223 0000 2093	002745	木林森	2020-12-23	2021-01-06	14.59	13,100	191,129.00
2020 1223 0000 2101	002839	张家港行	2020-12-23	2021-01-06	6.10	49,700	303,170.00
2020 1223 0000 2103	002797	第一创业	2020-12-23	2021-01-06	9.95	51,800	515,410.00
2020 1223 0000 2107	002745	木林森	2020-12-23	2021-01-06	14.59	13,100	191,129.00
2020 1223 0000 2110	002797	第一创业	2020-12-23	2021-01-06	9.95	115,600	1,150,220.00
2020 1223 0000 2111	002839	张家港行	2020-12-23	2021-01-06	6.10	22,300	136,030.00
2020 1223 0000 2112	002839	张家港行	2020-12-23	2021-01-06	6.10	22,300	136,030.00
2020 1223	002926	华西证券	2020-12-23	2021-01-06	12.48	23,100	288,288.00

0000 2115							
2020 1223 0000 2116	002925	盈趣科技	2020-12-23	2021-01-0 6	64.33	10,000	643,300 .00
2020 1223 0000 2118	002926	华西证券	2020-12-23	2021-01-0 6	12.48	23,100	288,288 .00
2020 1223 0000 2120	002926	华西证券	2020-12-23	2021-01-0 6	12.48	51,600	643,968 .00
2020 1223 0000 2139	600188	兖州煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	10.07	15,600	157,092 .00
2020 1223 0000 2141	600699	均胜电子	2020-12-23	2021-01-0 6	25.36	14,400	365,184 .00
2020 1223 0000 2154	603708	家家悦	2020-12-23	2021-01-0 6	21.30	10,000	213,000 .00
2020 1223 0000 2157	603228	景旺电子	2020-12-23	2021-01-0 6	30.15	10,000	301,500 .00
2020 1223 0000 2160	601801	皖新传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	4.75	10,500	49,875. 00
2020 1223 0000 2162	600699	均胜电子	2020-12-23	2021-01-0 6	25.36	32,300	819,128 .00
2020 1223 0000 2166	600188	兖州煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	10.07	15,600	157,092 .00
2020 1223 0000	603708	家家悦	2020-12-23	2021-01-0 6	21.30	10,000	213,000 .00

2170							
2020 1223 0000 2171	603228	景旺电子	2020-12-23	2021-01-06	30.15	10,000	301,500.00
2020 1223 0000 2172	601801	皖新传媒	2020-12-23	2021-01-06	4.75	10,500	49,875.00
2020 1223 0000 2175	600699	均胜电子	2020-12-23	2021-01-06	25.36	14,400	365,184.00
2020 1223 0000 2177	600188	兖州煤业	2020-12-23	2021-01-06	10.07	34,800	350,436.00
2020 1223 0000 2178	600312	平高电气	2020-12-23	2021-01-06	7.14	14,300	102,102.00
2020 1223 0000 2179	600507	方大特钢	2020-12-23	2021-01-06	6.94	19,000	131,860.00
2020 1223 0000 2180	600372	中航电子	2020-12-23	2021-01-06	19.65	13,500	265,275.00
2020 1223 0000 2181	601168	西部矿业	2020-12-23	2021-01-06	12.38	74,900	927,262.00
2020 1223 0000 2183	600056	中国医药	2020-12-23	2021-01-06	14.33	10,000	143,300.00
2020 1223 0000 2184	600507	方大特钢	2020-12-23	2021-01-06	6.94	19,000	131,860.00
2020 1223 0000 2185	600372	中航电子	2020-12-23	2021-01-06	19.65	13,500	265,275.00

2020 1223 0000 2186	601168	西部矿业	2020-12-23	2021-01-0 6	12.38	33,500	414,730 .00
2020 1223 0000 2188	600056	中国医药	2020-12-23	2021-01-0 6	14.33	10,000	143,300 .00
2020 1223 0000 2189	601168	西部矿业	2020-12-23	2021-01-0 6	12.38	33,500	414,730 .00
2020 1223 0000 2190	600372	中航电子	2020-12-23	2021-01-0 6	19.65	30,200	593,430 .00
2020 1223 0000 2191	600507	方大特钢	2020-12-23	2021-01-0 6	6.94	42,500	294,950 .00
2020 1223 0000 2198	601228	广州港	2020-12-23	2021-01-0 6	3.36	48,600	163,296 .00
2020 1223 0000 2199	600056	中国医药	2020-12-23	2021-01-0 6	14.33	20,900	299,497 .00
2020 1223 0000 2200	601608	中信重工	2020-12-23	2021-01-0 6	3.96	68,000	269,280 .00
2020 1223 0000 2205	600201	生物股份	2020-12-23	2021-01-0 6	20.89	19,800	413,622 .00
2020 1223 0000 2212	600380	健康元	2020-12-23	2021-01-0 6	13.91	46,000	639,860 .00
2020 1223 0000 2213	600312	平高电气	2020-12-23	2021-01-0 6	7.14	14,300	102,102 .00
2020	601608	中信重工	2020-12-23	2021-01-0	3.96	30,500	120,780

1223 0000 2218				6			.00
2020 1223 0000 2219	600022	山东钢铁	2020-12-23	2021-01-06	1.43	96,500	137,995.00
2020 1223 0000 2220	601228	广州港	2020-12-23	2021-01-06	3.36	21,800	73,248.00
2020 1223 0000 2223	600201	生物股份	2020-12-23	2021-01-06	20.89	19,800	413,622.00
2020 1223 0000 2227	600567	山鹰国际	2020-12-23	2021-01-06	3.02	56,700	171,234.00
2020 1223 0000 2228	601608	中信重工	2020-12-23	2021-01-06	3.96	30,500	120,780.00
2020 1223 0000 2229	600312	平高电气	2020-12-23	2021-01-06	7.14	32,000	228,480.00
2020 1223 0000 2230	601228	广州港	2020-12-23	2021-01-06	3.36	21,800	73,248.00
2020 1223 0000 2232	600201	生物股份	2020-12-23	2021-01-06	20.89	44,200	923,338.00
2020 1223 0000 2235	600022	山东钢铁	2020-12-23	2021-01-06	1.43	96,500	137,995.00
2020 1223 0000 2236	603515	欧普照明	2020-12-23	2021-01-06	30.21	10,000	302,100.00
2020 1223	600567	山鹰国际	2020-12-23	2021-01-06	3.02	126,500	382,030.00

0000 2237							
2020 1223 0000 2238	601801	皖新传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	4.75	23,500	111,625 .00
2020 1223 0000 2239	600022	山东钢铁	2020-12-23	2021-01-0 6	1.43	215,300	307,879 .00
2020 1223 0000 2241	600645	中源协和	2020-12-23	2021-01-0 6	19.61	12,900	252,969 .00
2020 1223 0000 2242	600567	山鹰国际	2020-12-23	2021-01-0 6	3.02	56,700	171,234 .00
2020 1223 0000 2244	600645	中源协和	2020-12-23	2021-01-0 6	19.61	10,000	196,100 .00
2020 1223 0000 2245	600418	江淮汽车	2020-12-23	2021-01-0 6	12.23	23,300	284,959 .00
2020 1223 0000 2246	600418	江淮汽车	2020-12-23	2021-01-0 6	12.23	23,300	284,959 .00
2020 1223 0000 2254	601098	中南传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	9.53	12,600	120,078 .00
2020 1223 0000 2256	600418	江淮汽车	2020-12-23	2021-01-0 6	12.23	52,100	637,183 .00
2020 1223 0000 2259	600827	百联股份	2020-12-23	2021-01-0 6	14.60	14,100	205,860 .00
2020 1223 0000	600657	信达地产	2020-12-23	2021-01-0 6	4.05	14,900	60,345. 00

2260							
2020 1223 0000 2269	600649	城投控股	2020-12-23	2021-01-06	5.43	22,300	121,089.00
2020 1223 0000 2270	600598	北大荒	2020-12-23	2021-01-06	19.25	28,000	539,000.00
2020 1223 0000 2275	600875	东方电气	2020-12-23	2021-01-06	9.97	19,500	194,415.00
2020 1223 0000 2279	601098	中南传媒	2020-12-23	2021-01-06	9.53	28,300	269,699.00
2020 1223 0000 2280	600827	百联股份	2020-12-23	2021-01-06	14.60	31,500	459,900.00
2020 1223 0000 2282	600380	健康元	2020-12-23	2021-01-06	13.91	20,600	286,546.00
2020 1223 0000 2285	603882	金域医学	2020-12-23	2021-01-06	128.12	10,800	1,383,696.00
2020 1223 0000 2286	600497	驰宏锌锗	2020-12-23	2021-01-06	4.80	44,900	215,520.00
2020 1223 0000 2288	600657	信达地产	2020-12-23	2021-01-06	4.05	33,400	135,270.00
2020 1223 0000 2289	600598	北大荒	2020-12-23	2021-01-06	19.25	12,500	240,625.00
2020 1223 0000 2292	601098	中南传媒	2020-12-23	2021-01-06	9.53	12,600	120,078.00

2020 1223 0000 2293	600875	东方电气	2020-12-23	2021-01-0 6	9.97	43,600	434,692 .00
2020 1223 0000 2295	600827	百联股份	2020-12-23	2021-01-0 6	14.60	14,100	205,860 .00
2020 1223 0000 2298	600380	健康元	2020-12-23	2021-01-0 6	13.91	20,600	286,546 .00
2020 1223 0000 2299	603882	金域医学	2020-12-23	2021-01-0 6	128.12	10,000	1,281,2 00.00
2020 1223 0000 2301	600657	信达地产	2020-12-23	2021-01-0 6	4.05	14,900	60,345. 00
2020 1223 0000 2302	600497	驰宏锌锗	2020-12-23	2021-01-0 6	4.80	44,900	215,520 .00
2020 1223 0000 2304	600079	人福医药	2020-12-23	2021-01-0 6	33.88	19,000	643,720 .00
2020 1223 0000 2306	600859	王府井	2020-12-23	2021-01-0 6	32.58	10,000	325,800 .00
2020 1223 0000 2307	600875	东方电气	2020-12-23	2021-01-0 6	9.97	19,500	194,415 .00
2020 1223 0000 2309	600881	亚泰集团	2020-12-23	2021-01-0 6	3.10	57,200	177,320 .00
2020 1223 0000 2310	601333	广深铁路	2020-12-23	2021-01-0 6	2.22	133,400	296,148 .00
2020	600497	驰宏锌锗	2020-12-23	2021-01-0	4.80	100,300	481,440

1223 0000 2312				6			.00
2020 1223 0000 2313	600079	人福医药	2020-12-23	2021-01-06	33.88	19,000	643,720.00
2020 1223 0000 2315	600859	王府井	2020-12-23	2021-01-06	32.58	15,200	495,216.00
2020 1223 0000 2316	600316	洪都航空	2020-12-23	2021-01-06	56.87	10,000	568,700.00
2020 1223 0000 2318	600881	亚泰集团	2020-12-23	2021-01-06	3.10	127,600	395,560.00
2020 1223 0000 2319	601333	广深铁路	2020-12-23	2021-01-06	2.22	59,800	132,756.00
2020 1223 0000 2321	603377	东方时尚	2020-12-23	2021-01-06	19.36	10,000	193,600.00
2020 1223 0000 2322	600079	人福医药	2020-12-23	2021-01-06	33.88	42,500	1,439,900.00
2020 1223 0000 2323	600859	王府井	2020-12-23	2021-01-06	32.58	10,000	325,800.00
2020 1223 0000 2324	600316	洪都航空	2020-12-23	2021-01-06	56.87	10,000	568,700.00
2020 1223 0000 2326	600881	亚泰集团	2020-12-23	2021-01-06	3.10	57,200	177,320.00
2020 1223	601333	广深铁路	2020-12-23	2021-01-06	2.22	59,800	132,756.00

0000 2327							
2020 1223 0000 2328	603377	东方时尚	2020-12-23	2021-01-0 6	19.36	10,000	193,600 .00
2020 1223 0000 2329	600649	城投控股	2020-12-23	2021-01-0 6	5.43	22,300	121,089 .00
2020 1223 0000 2330	600316	洪都航空	2020-12-23	2021-01-0 6	56.87	16,900	961,103 .00
2020 1223 0000 2331	600500	中化国际	2020-12-23	2021-01-0 6	5.27	24,300	128,061 .00
2020 1223 0000 2332	600643	爱建集团	2020-12-23	2021-01-0 6	7.52	14,300	107,536 .00
2020 1223 0000 2333	600167	联美控股	2020-12-23	2021-01-0 6	11.35	16,100	182,735 .00
2020 1223 0000 2334	600166	福田汽车	2020-12-23	2021-01-0 6	3.15	81,200	255,780 .00
2020 1223 0000 2335	600649	城投控股	2020-12-23	2021-01-0 6	5.43	49,700	269,871 .00
2020 1223 0000 2336	600717	天津港	2020-12-23	2021-01-0 6	4.78	21,100	100,858 .00
2020 1223 0000 2337	600500	中化国际	2020-12-23	2021-01-0 6	5.27	24,300	128,061 .00
2020 1223 0000	600643	爱建集团	2020-12-23	2021-01-0 6	7.52	31,900	239,888 .00

2338							
2020 1223 0000 2339	600167	联美控股	2020-12-23	2021-01-06	11.35	16,100	182,735.00
2020 1223 0000 2340	600166	福田汽车	2020-12-23	2021-01-06	3.15	81,200	255,780.00
2020 1223 0000 2341	600717	天津港	2020-12-23	2021-01-06	4.78	47,200	225,616.00
2020 1223 0000 2350	600500	中化国际	2020-12-23	2021-01-06	5.27	54,300	286,161.00
2020 1223 0000 2353	600643	爱建集团	2020-12-23	2021-01-06	7.52	14,300	107,536.00
2020 1223 0000 2356	600575	淮河能源	2020-12-23	2021-01-06	2.32	61,300	142,216.00
2020 1223 0000 2358	600959	江苏有线	2020-12-23	2021-01-06	3.31	35,300	116,843.00
2020 1223 0000 2359	600717	天津港	2020-12-23	2021-01-06	4.78	21,100	100,858.00
2020 1223 0000 2360	600167	联美控股	2020-12-23	2021-01-06	11.35	35,900	407,465.00
2020 1223 0000 2363	600166	福田汽车	2020-12-23	2021-01-06	3.15	181,100	570,465.00
2020 1223 0000 2366	600959	江苏有线	2020-12-23	2021-01-06	3.31	78,800	260,828.00

2020 1223 0000 2367	600575	淮河能源	2020-12-23	2021-01-0 6	2.32	27,500	63,800. 00
2020 1223 0000 2368	600598	北大荒	2020-12-23	2021-01-0 6	19.25	12,500	240,625 .00
2020 1223 0000 2369	600959	江苏有线	2020-12-23	2021-01-0 6	3.31	35,300	116,843 .00
2020 1223 0000 2370	600516	方大炭素	2020-12-23	2021-01-0 6	7.07	40,300	284,921 .00
2020 1223 0000 2371	600516	方大炭素	2020-12-23	2021-01-0 6	7.07	40,300	284,921 .00
2020 1223 0000 2372	600516	方大炭素	2020-12-23	2021-01-0 6	7.07	89,900	635,593 .00
2020 1223 0000 2373	601127	小康股份	2020-12-23	2021-01-0 6	17.08	10,000	170,800 .00
2020 1223 0000 2374	601127	小康股份	2020-12-23	2021-01-0 6	17.08	10,000	170,800 .00
2020 1223 0000 2375	600575	淮河能源	2020-12-23	2021-01-0 6	2.32	27,500	63,800. 00
2020 1223 0000 2381	601866	中远海发	2020-12-23	2021-01-0 6	2.97	70,000	207,900 .00
2020 1223 0000 2384	601866	中远海发	2020-12-23	2021-01-0 6	2.97	156,100	463,617 .00
2020	601866	中远海发	2020-12-23	2021-01-0	2.97	70,000	207,900

1223 0000 2386				6			.00
2020 1223 0000 2387	600968	海油发展	2020-12-23	2021-01-06	2.39	36,000	86,040. 00
2020 1223 0000 2388	600968	海油发展	2020-12-23	2021-01-06	2.39	80,300	191,917 .00
2020 1223 0000 2389	600968	海油发展	2020-12-23	2021-01-06	2.39	36,000	86,040. 00
2020 1223 0000 2397	603000	人民网	2020-12-23	2021-01-06	16.90	10,000	169,000 .00
2020 1223 0000 2400	600219	南山铝业	2020-12-23	2021-01-06	3.16	126,400	399,424 .00
2020 1223 0000 2405	600329	中新药业	2020-12-23	2021-01-06	17.52	11,200	196,224 .00
2020 1223 0000 2409	600409	三友化工	2020-12-23	2021-01-06	10.25	21,800	223,450 .00
2020 1223 0000 2410	600648	外高桥	2020-12-23	2021-01-06	13.97	10,000	139,700 .00
2020 1223 0000 2411	600282	南钢股份	2020-12-23	2021-01-06	3.12	54,200	169,104 .00
2020 1223 0000 2413	600667	太极实业	2020-12-23	2021-01-06	9.45	25,900	244,755 .00
2020 1223	600517	国网英大	2020-12-23	2021-01-06	6.08	11,000	66,880. 00

0000 2414							
2020 1223 0000 2415	601611	中国核建	2020-12-23	2021-01-0 6	7.28	31,400	228,592 .00
2020 1223 0000 2419	603000	人民网	2020-12-23	2021-01-0 6	16.90	21,700	366,730 .00
2020 1223 0000 2420	600219	南山铝业	2020-12-23	2021-01-0 6	3.16	126,400	399,424 .00
2020 1223 0000 2422	600808	马钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.66	42,200	112,252 .00
2020 1223 0000 2424	600273	嘉化能源	2020-12-23	2021-01-0 6	9.24	39,500	364,980 .00
2020 1223 0000 2425	601179	中国西电	2020-12-23	2021-01-0 6	4.61	80,900	372,949 .00
2020 1223 0000 2429	600409	三友化工	2020-12-23	2021-01-0 6	10.25	21,800	223,450 .00
2020 1223 0000 2430	603866	桃李面包	2020-12-23	2021-01-0 6	59.10	10,000	591,000 .00
2020 1223 0000 2431	600535	天士力	2020-12-23	2021-01-0 6	14.79	16,000	236,640 .00
2020 1223 0000 2432	600648	外高桥	2020-12-23	2021-01-0 6	13.97	14,700	205,359 .00
2020 1223 0000	600282	南钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.12	54,200	169,104 .00

2434							
2020 1223 0000 2435	600563	法拉电子	2020-12-23	2021-01-06	107.55	10,000	1,075,500.00
2020 1223 0000 2436	600517	国网英大	2020-12-23	2021-01-06	6.08	24,600	149,568.00
2020 1223 0000 2438	601611	中国核建	2020-12-23	2021-01-06	7.28	14,000	101,920.00
2020 1223 0000 2442	603000	人民网	2020-12-23	2021-01-06	16.90	10,000	169,000.00
2020 1223 0000 2444	600808	马钢股份	2020-12-23	2021-01-06	2.66	94,100	250,306.00
2020 1223 0000 2445	600566	济川药业	2020-12-23	2021-01-06	20.23	10,000	202,300.00
2020 1223 0000 2446	600219	南山铝业	2020-12-23	2021-01-06	3.16	281,900	890,804.00
2020 1223 0000 2448	601179	中国西电	2020-12-23	2021-01-06	4.61	36,200	166,882.00
2020 1223 0000 2449	600409	三友化工	2020-12-23	2021-01-06	10.25	48,800	500,200.00
2020 1223 0000 2450	601139	深圳燃气	2020-12-23	2021-01-06	7.24	22,600	163,624.00
2020 1223 0000 2451	600535	天士力	2020-12-23	2021-01-06	14.79	35,700	528,003.00

2020 1223 0000 2453	600648	外高桥	2020-12-23	2021-01-0 6	13.97	10,000	139,700 .00
2020 1223 0000 2454	600282	南钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.12	120,900	377,208 .00
2020 1223 0000 2455	600895	张江高科	2020-12-23	2021-01-0 6	17.04	13,600	231,744 .00
2020 1223 0000 2458	600704	物产中大	2020-12-23	2021-01-0 6	4.37	44,600	194,902 .00
2020 1223 0000 2460	600064	南京高科	2020-12-23	2021-01-0 6	10.27	15,300	157,131 .00
2020 1223 0000 2461	601611	中国核建	2020-12-23	2021-01-0 6	7.28	14,000	101,920 .00
2020 1223 0000 2463	600737	中粮糖业	2020-12-23	2021-01-0 6	9.68	18,800	181,984 .00
2020 1223 0000 2464	600808	马钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.66	42,200	112,252 .00
2020 1223 0000 2465	600566	济川药业	2020-12-23	2021-01-0 6	20.23	10,500	212,415 .00
2020 1223 0000 2467	600729	重庆百货	2020-12-23	2021-01-0 6	28.90	10,000	289,000 .00
2020 1223 0000 2468	601139	深圳燃气	2020-12-23	2021-01-0 6	7.24	10,100	73,124. 00
2020	600879	航天电子	2020-12-23	2021-01-0	7.48	38,300	286,484

1223 0000 2470				6			.00
2020 1223 0000 2471	600895	张江高科	2020-12-23	2021-01-06	17.04	30,400	518,016.00
2020 1223 0000 2472	601179	中国西电	2020-12-23	2021-01-06	4.61	36,200	166,882.00
2020 1223 0000 2474	600038	中直股份	2020-12-23	2021-01-06	62.71	10,000	627,100.00
2020 1223 0000 2477	600704	物产中大	2020-12-23	2021-01-06	4.37	99,500	434,815.00
2020 1223 0000 2478	603888	新华网	2020-12-23	2021-01-06	19.00	10,000	190,000.00
2020 1223 0000 2480	600737	中粮糖业	2020-12-23	2021-01-06	9.68	42,000	406,560.00
2020 1223 0000 2481	601598	中国外运	2020-12-23	2021-01-06	4.40	61,800	271,920.00
2020 1223 0000 2482	600064	南京高科	2020-12-23	2021-01-06	10.27	15,300	157,131.00
2020 1223 0000 2483	600664	哈药股份	2020-12-23	2021-01-06	3.19	26,600	84,854.00
2020 1223 0000 2484	601139	深圳燃气	2020-12-23	2021-01-06	7.24	10,100	73,124.00
2020 1223	600782	新钢股份	2020-12-23	2021-01-06	4.59	28,000	128,520.00

0000 2485							
2020 1223 0000 2487	601928	凤凰传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	6.33	13,400	84,822. 00
2020 1223 0000 2488	600879	航天电子	2020-12-23	2021-01-0 6	7.48	85,500	639,540 .00
2020 1223 0000 2490	600895	张江高科	2020-12-23	2021-01-0 6	17.04	13,600	231,744 .00
2020 1223 0000 2491	600038	中直股份	2020-12-23	2021-01-0 6	62.71	11,500	721,165 .00
2020 1223 0000 2492	600704	物产中大	2020-12-23	2021-01-0 6	4.37	44,600	194,902 .00
2020 1223 0000 2494	600155	华创阳安	2020-12-23	2021-01-0 6	13.19	21,500	283,585 .00
2020 1223 0000 2496	603888	新华网	2020-12-23	2021-01-0 6	19.00	10,000	190,000 .00
2020 1223 0000 2498	600737	中粮糖业	2020-12-23	2021-01-0 6	9.68	18,800	181,984 .00
2020 1223 0000 2499	601598	中国外运	2020-12-23	2021-01-0 6	4.40	27,700	121,880 .00
2020 1223 0000 2500	600782	新钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	4.59	62,500	286,875 .00
2020 1223 0000	603568	伟明环保	2020-12-23	2021-01-0 6	18.93	14,800	280,164 .00

2501							
2020 1223 0000 2502	600879	航天电子	2020-12-23	2021-01-06	7.48	38,300	286,484.00
2020 1223 0000 2503	600064	南京高科	2020-12-23	2021-01-06	10.27	34,100	350,207.00
2020 1223 0000 2505	601928	凤凰传媒	2020-12-23	2021-01-06	6.33	30,000	189,900.00
2020 1223 0000 2507	600089	特变电工	2020-12-23	2021-01-06	10.15	65,500	664,825.00
2020 1223 0000 2508	600664	哈药股份	2020-12-23	2021-01-06	3.19	59,400	189,486.00
2020 1223 0000 2509	601298	青岛港	2020-12-23	2021-01-06	6.43	27,700	178,111.00
2020 1223 0000 2511	601699	潞安环能	2020-12-23	2021-01-06	6.50	46,900	304,850.00
2020 1223 0000 2513	600155	华创阳安	2020-12-23	2021-01-06	13.19	21,500	283,585.00
2020 1223 0000 2514	603638	艾迪精密	2020-12-23	2021-01-06	68.94	10,000	689,400.00
2020 1223 0000 2525	600155	华创阳安	2020-12-23	2021-01-06	13.19	47,900	631,801.00
2020 1223 0000 2529	600460	士兰微	2020-12-23	2021-01-06	25.00	30,900	772,500.00

2020 1223 0000 2531	600782	新钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	4.59	28,000	128,520 .00
2020 1223 0000 2532	600350	山东高速	2020-12-23	2021-01-0 6	6.18	10,900	67,362. 00
2020 1223 0000 2533	601598	中国外运	2020-12-23	2021-01-0 6	4.40	27,700	121,880 .00
2020 1223 0000 2534	601928	凤凰传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	6.33	13,400	84,822. 00
2020 1223 0000 2536	603568	伟明环保	2020-12-23	2021-01-0 6	18.93	10,000	189,300 .00
2020 1223 0000 2537	600765	中航重机	2020-12-23	2021-01-0 6	25.00	10,000	250,000 .00
2020 1223 0000 2538	600885	宏发股份	2020-12-23	2021-01-0 6	54.22	10,000	542,200 .00
2020 1223 0000 2539	600664	哈药股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.19	26,600	84,854. 00
2020 1223 0000 2541	600089	特变电工	2020-12-23	2021-01-0 6	10.15	65,500	664,825 .00
2020 1223 0000 2542	601699	潞安环能	2020-12-23	2021-01-0 6	6.50	21,000	136,500 .00
2020 1223 0000 2543	601298	青岛港	2020-12-23	2021-01-0 6	6.43	12,400	79,732. 00
2020	600415	小商品城	2020-12-23	2021-01-0	5.51	48,000	264,480

1223 0000 2544				6			.00
2020 1223 0000 2548	600511	国药股份	2020-12-23	2021-01-06	49.31	10,000	493,100.00
2020 1223 0000 2550	603816	顾家家居	2020-12-23	2021-01-06	70.51	12,400	874,324.00
2020 1223 0000 2551	600153	建发股份	2020-12-23	2021-01-06	8.21	30,200	247,942.00
2020 1223 0000 2554	600667	太极实业	2020-12-23	2021-01-06	9.45	25,900	244,755.00
2020 1223 0000 2555	600535	天士力	2020-12-23	2021-01-06	14.79	16,000	236,640.00
2020 1223 0000 2556	600350	山东高速	2020-12-23	2021-01-06	6.18	10,900	67,362.00
2020 1223 0000 2559	600867	通化东宝	2020-12-23	2021-01-06	13.38	25,100	335,838.00
2020 1223 0000 2561	600089	特变电工	2020-12-23	2021-01-06	10.15	146,100	1,482,915.00
2020 1223 0000 2562	600885	宏发股份	2020-12-23	2021-01-06	54.22	20,400	1,106,088.00
2020 1223 0000 2563	601298	青岛港	2020-12-23	2021-01-06	6.43	12,400	79,732.00
2020 1223	603568	伟明环保	2020-12-23	2021-01-06	18.93	10,000	189,300.00

0000 2564							
2020 1223 0000 2565	600765	中航重机	2020-12-23	2021-01-0 6	25.00	22,100	552,500 .00
2020 1223 0000 2567	601699	潞安环能	2020-12-23	2021-01-0 6	6.50	21,000	136,500 .00
2020 1223 0000 2568	600415	小商品城	2020-12-23	2021-01-0 6	5.51	48,000	264,480 .00
2020 1223 0000 2569	600511	国药股份	2020-12-23	2021-01-0 6	49.31	10,000	493,100 .00
2020 1223 0000 2570	603816	顾家家居	2020-12-23	2021-01-0 6	70.51	10,000	705,100 .00
2020 1223 0000 2572	600153	建发股份	2020-12-23	2021-01-0 6	8.21	30,200	247,942 .00
2020 1223 0000 2573	600867	通化东宝	2020-12-23	2021-01-0 6	13.38	56,000	749,280 .00
2020 1223 0000 2574	600350	山东高速	2020-12-23	2021-01-0 6	6.18	24,500	151,410 .00
2020 1223 0000 2575	600667	太极实业	2020-12-23	2021-01-0 6	9.45	57,900	547,155 .00
2020 1223 0000 2577	600917	重庆燃气	2020-12-23	2021-01-0 6	6.86	10,000	68,600. 00
2020 1223 0000	600273	嘉化能源	2020-12-23	2021-01-0 6	9.24	17,700	163,548 .00

2578							
2020 1223 0000 2580	600885	宏发股份	2020-12-23	2021-01-06	54.22	10,000	542,200.00
2020 1223 0000 2582	600511	国药股份	2020-12-23	2021-01-06	49.31	14,800	729,788.00
2020 1223 0000 2583	600765	中航重机	2020-12-23	2021-01-06	25.00	10,000	250,000.00
2020 1223 0000 2586	600517	国网英大	2020-12-23	2021-01-06	6.08	11,000	66,880.00
2020 1223 0000 2587	600572	康恩贝	2020-12-23	2021-01-06	4.71	32,900	154,959.00
2020 1223 0000 2588	600572	康恩贝	2020-12-23	2021-01-06	4.71	32,900	154,959.00
2020 1223 0000 2591	600329	中新药业	2020-12-23	2021-01-06	17.52	10,000	175,200.00
2020 1223 0000 2597	600153	建发股份	2020-12-23	2021-01-06	8.21	67,500	554,175.00
2020 1223 0000 2598	600970	中材国际	2020-12-23	2021-01-06	6.88	18,300	125,904.00
2020 1223 0000 2599	600273	嘉化能源	2020-12-23	2021-01-06	9.24	17,700	163,548.00
2020 1223 0000 2600	601992	金隅集团	2020-12-23	2021-01-06	2.97	73,500	218,295.00

2020 1223 0000 2601	600415	小商品城	2020-12-23	2021-01-0 6	5.51	107,200	590,672 .00
2020 1223 0000 2602	600867	通化东宝	2020-12-23	2021-01-0 6	13.38	25,100	335,838 .00
2020 1223 0000 2606	603866	桃李面包	2020-12-23	2021-01-0 6	59.10	10,700	632,370 .00
2020 1223 0000 2607	600546	山煤国际	2020-12-23	2021-01-0 6	8.51	13,900	118,289 .00
2020 1223 0000 2608	600572	康恩贝	2020-12-23	2021-01-0 6	4.71	73,500	346,185 .00
2020 1223 0000 2609	600869	远东股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.99	19,500	77,805. 00
2020 1223 0000 2615	601992	金隅集团	2020-12-23	2021-01-0 6	2.97	164,100	487,377 .00
2020 1223 0000 2616	600970	中材国际	2020-12-23	2021-01-0 6	6.88	40,900	281,392 .00
2020 1223 0000 2618	600546	山煤国际	2020-12-23	2021-01-0 6	8.51	31,000	263,810 .00
2020 1223 0000 2619	600869	远东股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.99	43,600	173,964 .00
2020 1223 0000 2634	600126	杭钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.29	23,700	125,373 .00
2020	600143	金发科技	2020-12-23	2021-01-0	17.14	31,700	543,338

1223 0000 2635				6			.00
2020 1223 0000 2636	600597	光明乳业	2020-12-23	2021-01-06	16.26	10,800	175,608.00
2020 1223 0000 2637	601828	美凯龙	2020-12-23	2021-01-06	8.49	17,200	146,028.00
2020 1223 0000 2638	601992	金隅集团	2020-12-23	2021-01-06	2.97	73,500	218,295.00
2020 1223 0000 2639	600970	中材国际	2020-12-23	2021-01-06	6.88	18,300	125,904.00
2020 1223 0000 2640	600869	远东股份	2020-12-23	2021-01-06	3.99	19,500	77,805.00
2020 1223 0000 2642	600546	山煤国际	2020-12-23	2021-01-06	8.51	13,900	118,289.00
2020 1223 0000 2647	601828	美凯龙	2020-12-23	2021-01-06	8.49	10,000	84,900.00
2020 1223 0000 2648	600597	光明乳业	2020-12-23	2021-01-06	16.26	24,100	391,866.00
2020 1223 0000 2649	600126	杭钢股份	2020-12-23	2021-01-06	5.29	53,000	280,370.00
2020 1223 0000 2650	600143	金发科技	2020-12-23	2021-01-06	17.14	31,700	543,338.00
2020 1223	600754	锦江酒店	2020-12-23	2021-01-06	51.53	12,500	644,125.00

0000 2651							
2020 1223 0000 2652	600460	士兰微	2020-12-23	2021-01-0 6	25.00	13,800	345,000 .00
2020 1223 0000 2654	600820	隧道股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.41	33,200	179,612 .00
2020 1223 0000 2657	600597	光明乳业	2020-12-23	2021-01-0 6	16.26	10,800	175,608 .00
2020 1223 0000 2658	601828	美凯龙	2020-12-23	2021-01-0 6	8.49	10,000	84,900. 00
2020 1223 0000 2659	600460	士兰微	2020-12-23	2021-01-0 6	25.00	13,800	345,000 .00
2020 1223 0000 2660	600143	金发科技	2020-12-23	2021-01-0 6	17.14	70,800	1,213,5 12.00
2020 1223 0000 2661	600754	锦江酒店	2020-12-23	2021-01-0 6	51.53	10,000	515,300 .00
2020 1223 0000 2662	600820	隧道股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.41	74,000	400,340 .00
2020 1223 0000 2665	603328	依顿电子	2020-12-23	2021-01-0 6	7.95	15,500	123,225 .00
2020 1223 0000 2666	601003	柳钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.19	10,000	51,900. 00
2020 1223 0000	601958	金钼股份	2020-12-23	2021-01-0 6	6.21	38,200	237,222 .00

2667							
2020 1223 0000 2671	600528	中铁工业	2020-12-23	2021-01-06	8.74	23,500	205,390.00
2020 1223 0000 2674	603077	和邦生物	2020-12-23	2021-01-06	1.42	208,700	296,354.00
2020 1223 0000 2675	600820	隧道股份	2020-12-23	2021-01-06	5.41	33,200	179,612.00
2020 1223 0000 2681	600909	华安证券	2020-12-23	2021-01-06	8.00	38,200	305,600.00
2020 1223 0000 2682	600039	四川路桥	2020-12-23	2021-01-06	4.51	75,100	338,701.00
2020 1223 0000 2684	603328	依顿电子	2020-12-23	2021-01-06	7.95	10,000	79,500.00
2020 1223 0000 2688	600673	东阳光	2020-12-23	2021-01-06	5.03	26,500	133,295.00
2020 1223 0000 2690	601958	金铂股份	2020-12-23	2021-01-06	6.21	17,100	106,191.00
2020 1223 0000 2694	600528	中铁工业	2020-12-23	2021-01-06	8.74	23,500	205,390.00
2020 1223 0000 2695	600060	海信视像	2020-12-23	2021-01-06	11.48	13,800	158,424.00
2020 1223 0000 2697	603077	和邦生物	2020-12-23	2021-01-06	1.42	93,600	132,912.00

2020 1223 0000 2699	601003	柳钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.19	20,000	103,800 .00
2020 1223 0000 2700	601689	拓普集团	2020-12-23	2021-01-0 6	38.43	16,500	634,095 .00
2020 1223 0000 2701	603328	依顿电子	2020-12-23	2021-01-0 6	7.95	10,000	79,500. 00
2020 1223 0000 2702	600392	盛和资源	2020-12-23	2021-01-0 6	8.89	24,700	219,583 .00
2020 1223 0000 2704	600062	华润双鹤	2020-12-23	2021-01-0 6	11.99	10,000	119,900 .00
2020 1223 0000 2705	601958	金铂股份	2020-12-23	2021-01-0 6	6.21	17,100	106,191 .00
2020 1223 0000 2706	600528	中铁工业	2020-12-23	2021-01-0 6	8.74	52,400	457,976 .00
2020 1223 0000 2707	600060	海信视像	2020-12-23	2021-01-0 6	11.48	13,800	158,424 .00
2020 1223 0000 2709	601003	柳钢股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.19	10,000	51,900. 00
2020 1223 0000 2710	603077	和邦生物	2020-12-23	2021-01-0 6	1.42	93,600	132,912 .00
2020 1223 0000 2711	601689	拓普集团	2020-12-23	2021-01-0 6	38.43	10,000	384,300 .00
2020	600132	重庆啤酒	2020-12-23	2021-01-0	118.99	10,000	1,189,9

1223 0000 2712				6			00.00
2020 1223 0000 2713	600392	盛和资源	2020-12-23	2021-01-06	8.89	24,700	219,583.00
2020 1223 0000 2724	600580	卧龙电驱	2020-12-23	2021-01-06	15.60	13,800	215,280.00
2020 1223 0000 2725	600141	兴发集团	2020-12-23	2021-01-06	11.03	10,000	110,300.00
2020 1223 0000 2726	603858	步长制药	2020-12-23	2021-01-06	23.07	10,000	230,700.00
2020 1223 0000 2727	600410	华胜天成	2020-12-23	2021-01-06	8.86	43,200	382,752.00
2020 1223 0000 2728	600062	华润双鹤	2020-12-23	2021-01-06	11.99	10,000	119,900.00
2020 1223 0000 2730	601689	拓普集团	2020-12-23	2021-01-06	38.43	10,000	384,300.00
2020 1223 0000 2731	600060	海信视像	2020-12-23	2021-01-06	11.48	30,900	354,732.00
2020 1223 0000 2732	600039	四川路桥	2020-12-23	2021-01-06	4.51	33,600	151,536.00
2020 1223 0000 2733	601865	福莱特	2020-12-23	2021-01-06	39.90	10,000	399,000.00
2020 1223	600132	重庆啤酒	2020-12-23	2021-01-06	118.99	10,000	1,189,900.00

0000 2734							
2020 1223 0000 2738	600392	盛和资源	2020-12-23	2021-01-06	8.89	55,100	489,839.00
2020 1223 0000 2740	600580	卧龙电驱	2020-12-23	2021-01-06	15.60	30,900	482,040.00
2020 1223 0000 2741	600141	兴发集团	2020-12-23	2021-01-06	11.03	10,000	110,300.00
2020 1223 0000 2742	601005	重庆钢铁	2020-12-23	2021-01-06	1.48	103,200	152,736.00
2020 1223 0000 2743	600062	华润双鹤	2020-12-23	2021-01-06	11.99	20,400	244,596.00
2020 1223 0000 2745	600755	厦门国贸	2020-12-23	2021-01-06	6.68	23,100	154,308.00
2020 1223 0000 2746	600376	首开股份	2020-12-23	2021-01-06	5.87	22,600	132,662.00
2020 1223 0000 2748	600126	杭钢股份	2020-12-23	2021-01-06	5.29	23,700	125,373.00
2020 1223 0000 2749	600039	四川路桥	2020-12-23	2021-01-06	4.51	33,600	151,536.00
2020 1223 0000 2750	600580	卧龙电驱	2020-12-23	2021-01-06	15.60	13,800	215,280.00
2020 1223 0000	600158	中体产业	2020-12-23	2021-01-06	12.26	11,800	144,668.00

2751							
2020 1223 0000 2757	600733	北汽蓝谷	2020-12-23	2021-01-06	8.67	82,400	714,408.00
2020 1223 0000 2761	600707	彩虹股份	2020-12-23	2021-01-06	6.66	28,300	188,478.00
2020 1223 0000 2762	600141	兴发集团	2020-12-23	2021-01-06	11.03	21,900	241,557.00
2020 1223 0000 2765	600307	酒钢宏兴	2020-12-23	2021-01-06	1.65	55,400	91,410.00
2020 1223 0000 2769	601005	重庆钢铁	2020-12-23	2021-01-06	1.48	230,100	340,548.00
2020 1223 0000 2771	601718	际华集团	2020-12-23	2021-01-06	3.03	86,500	262,095.00
2020 1223 0000 2773	600376	首开股份	2020-12-23	2021-01-06	5.87	22,600	132,662.00
2020 1223 0000 2775	600755	厦门国贸	2020-12-23	2021-01-06	6.68	51,600	344,688.00
2020 1223 0000 2776	600158	中体产业	2020-12-23	2021-01-06	12.26	11,800	144,668.00
2020 1223 0000 2778	600733	北汽蓝谷	2020-12-23	2021-01-06	8.67	36,900	319,923.00
2020 1223 0000 2782	600707	彩虹股份	2020-12-23	2021-01-06	6.66	12,700	84,582.00

2020 1223 0000 2783	601118	海南橡胶	2020-12-23	2021-01-0 6	4.82	30,100	145,082 .00
2020 1223 0000 2784	600094	大名城	2020-12-23	2021-01-0 6	4.02	28,000	112,560 .00
2020 1223 0000 2785	601005	重庆钢铁	2020-12-23	2021-01-0 6	1.48	103,200	152,736 .00
2020 1223 0000 2786	600376	首开股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.87	50,500	296,435 .00
2020 1223 0000 2787	600158	中体产业	2020-12-23	2021-01-0 6	12.26	26,300	322,438 .00
2020 1223 0000 2788	600862	中航高科	2020-12-23	2021-01-0 6	30.10	12,200	367,220 .00
2020 1223 0000 2789	600755	厦门国贸	2020-12-23	2021-01-0 6	6.68	23,100	154,308 .00
2020 1223 0000 2791	600277	亿利洁能	2020-12-23	2021-01-0 6	2.99	24,000	71,760. 00
2020 1223 0000 2793	600307	酒钢宏兴	2020-12-23	2021-01-0 6	1.65	55,400	91,410. 00
2020 1223 0000 2794	601717	郑煤机	2020-12-23	2021-01-0 6	10.93	41,000	448,130 .00
2020 1223 0000 2795	601118	海南橡胶	2020-12-23	2021-01-0 6	4.82	30,100	145,082 .00
2020	600094	大名城	2020-12-23	2021-01-0	4.02	62,500	251,250

1223 0000 2796				6			.00
2020 1223 0000 2797	600862	中航高科	2020-12-23	2021-01-06	30.10	27,300	821,730.00
2020 1223 0000 2798	600673	东阳光	2020-12-23	2021-01-06	5.03	26,500	133,295.00
2020 1223 0000 2799	600277	亿利洁能	2020-12-23	2021-01-06	2.99	24,000	71,760.00
2020 1223 0000 2800	600258	首旅酒店	2020-12-23	2021-01-06	21.22	10,000	212,200.00
2020 1223 0000 2801	601717	郑煤机	2020-12-23	2021-01-06	10.93	18,300	200,019.00
2020 1223 0000 2810	600026	中远海能	2020-12-23	2021-01-06	6.68	54,500	364,060.00
2020 1223 0000 2811	600466	蓝光发展	2020-12-23	2021-01-06	4.63	26,700	123,621.00
2020 1223 0000 2812	600277	亿利洁能	2020-12-23	2021-01-06	2.99	53,500	159,965.00
2020 1223 0000 2813	600673	东阳光	2020-12-23	2021-01-06	5.03	59,200	297,776.00
2020 1223 0000 2814	601997	贵阳银行	2020-12-23	2021-01-06	7.95	45,300	360,135.00
2020 1223	600862	中航高科	2020-12-23	2021-01-06	30.10	12,200	367,220.00

0000 2815							
2020 1223 0000 2816	601717	郑煤机	2020-12-23	2021-01-0 6	10.93	18,300	200,019 .00
2020 1223 0000 2817	600307	酒钢宏兴	2020-12-23	2021-01-0 6	1.65	123,600	203,940 .00
2020 1223 0000 2818	600739	辽宁成大	2020-12-23	2021-01-0 6	24.32	21,500	522,880 .00
2020 1223 0000 2821	601860	紫金银行	2020-12-23	2021-01-0 6	4.21	32,200	135,562 .00
2020 1223 0000 2822	601718	际华集团	2020-12-23	2021-01-0 6	3.03	38,800	117,564 .00
2020 1223 0000 2827	600021	上海电力	2020-12-23	2021-01-0 6	7.12	18,400	131,008 .00
2020 1223 0000 2829	600259	广晟有色	2020-12-23	2021-01-0 6	30.17	10,000	301,700 .00
2020 1223 0000 2830	600258	首旅酒店	2020-12-23	2021-01-0 6	21.22	10,000	212,200 .00
2020 1223 0000 2832	601106	中国一重	2020-12-23	2021-01-0 6	2.99	108,000	322,920 .00
2020 1223 0000 2833	601128	常熟银行	2020-12-23	2021-01-0 6	7.38	107,700	794,826 .00
2020 1223 0000	600410	华胜天成	2020-12-23	2021-01-0 6	8.86	19,300	170,998 .00

2834							
2020 1223 0000 2835	601106	中国一重	2020-12-23	2021-01-06	2.99	48,400	144,716.00
2020 1223 0000 2836	600779	水井坊	2020-12-23	2021-01-06	83.02	10,000	830,200.00
2020 1223 0000 2837	600466	蓝光发展	2020-12-23	2021-01-06	4.63	26,700	123,621.00
2020 1223 0000 2839	601997	贵阳银行	2020-12-23	2021-01-06	7.95	101,100	803,745.00
2020 1223 0000 2840	600170	上海建工	2020-12-23	2021-01-06	3.01	78,500	236,285.00
2020 1223 0000 2841	601718	际华集团	2020-12-23	2021-01-06	3.03	38,800	117,564.00
2020 1223 0000 2842	601880	大连港	2020-12-23	2021-01-06	1.93	54,400	104,992.00
2020 1223 0000 2847	601128	常熟银行	2020-12-23	2021-01-06	7.38	48,300	356,454.00
2020 1223 0000 2848	601016	节能风电	2020-12-23	2021-01-06	3.43	35,200	120,736.00
2020 1223 0000 2849	601106	中国一重	2020-12-23	2021-01-06	2.99	48,400	144,716.00
2020 1223 0000 2850	600021	上海电力	2020-12-23	2021-01-06	7.12	41,100	292,632.00

2020 1223 0000 2851	600094	大名城	2020-12-23	2021-01-0 6	4.02	28,000	112,560 .00
2020 1223 0000 2852	600258	首旅酒店	2020-12-23	2021-01-0 6	21.22	19,400	411,668 .00
2020 1223 0000 2853	600410	华胜天成	2020-12-23	2021-01-0 6	8.86	19,300	170,998 .00
2020 1223 0000 2857	601997	贵阳银行	2020-12-23	2021-01-0 6	7.95	45,300	360,135 .00
2020 1223 0000 2858	600466	蓝光发展	2020-12-23	2021-01-0 6	4.63	59,600	275,948 .00
2020 1223 0000 2864	600642	申能股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.22	96,700	504,774 .00
2020 1223 0000 2871	600398	海澜之家	2020-12-23	2021-01-0 6	6.42	50,900	326,778 .00
2020 1223 0000 2874	600871	石化油服	2020-12-23	2021-01-0 6	1.96	33,300	65,268. 00
2020 1223 0000 2875	600170	上海建工	2020-12-23	2021-01-0 6	3.01	78,500	236,285 .00
2020 1223 0000 2876	600909	华安证券	2020-12-23	2021-01-0 6	8.00	38,200	305,600 .00
2020 1223 0000 2878	601880	大连港	2020-12-23	2021-01-0 6	1.93	121,300	234,109 .00
2020	601128	常熟银行	2020-12-23	2021-01-0	7.38	48,300	356,454

1223 0000 2879				6			.00
2020 1223 0000 2880	601016	节能风电	2020-12-23	2021-01-06	3.43	78,700	269,941.00
2020 1223 0000 2882	601799	星宇股份	2020-12-23	2021-01-06	200.50	10,000	2,005,000.00
2020 1223 0000 2883	600863	内蒙华电	2020-12-23	2021-01-06	2.57	41,000	105,370.00
2020 1223 0000 2887	603858	步长制药	2020-12-23	2021-01-06	23.07	22,400	516,768.00
2020 1223 0000 2888	603379	三美股份	2020-12-23	2021-01-06	19.10	10,000	191,000.00
2020 1223 0000 2891	600446	金证股份	2020-12-23	2021-01-06	16.21	10,600	171,826.00
2020 1223 0000 2892	603589	口子窖	2020-12-23	2021-01-06	68.90	14,100	971,490.00
2020 1223 0000 2893	600170	上海建工	2020-12-23	2021-01-06	3.01	175,100	527,051.00
2020 1223 0000 2894	603338	浙江鼎力	2020-12-23	2021-01-06	101.19	10,000	1,011,900.00
2020 1223 0000 2895	600909	华安证券	2020-12-23	2021-01-06	8.00	85,300	682,400.00
2020 1223	600733	北汽蓝谷	2020-12-23	2021-01-06	8.67	36,900	319,923.00

0000 2896							
2020 1223 0000 2898	601880	大连港	2020-12-23	2021-01-0 6	1.93	54,400	104,992 .00
2020 1223 0000 2900	601016	节能风电	2020-12-23	2021-01-0 6	3.43	35,200	120,736 .00
2020 1223 0000 2903	600120	浙江东方	2020-12-23	2021-01-0 6	5.97	23,600	140,892 .00
2020 1223 0000 2904	600871	石化油服	2020-12-23	2021-01-0 6	1.96	33,300	65,268. 00
2020 1223 0000 2905	600863	内蒙华电	2020-12-23	2021-01-0 6	2.57	91,600	235,412 .00
2020 1223 0000 2907	603589	口子窖	2020-12-23	2021-01-0 6	68.90	10,000	689,000 .00
2020 1223 0000 2908	603858	步长制药	2020-12-23	2021-01-0 6	23.07	10,000	230,700 .00
2020 1223 0000 2909	600446	金证股份	2020-12-23	2021-01-0 6	16.21	10,600	171,826 .00
2020 1223 0000 2910	603260	合盛硅业	2020-12-23	2021-01-0 6	33.44	10,000	334,400 .00
2020 1223 0000 2911	601615	明阳智能	2020-12-23	2021-01-0 6	18.98	29,500	559,910 .00
2020 1223 0000	600120	浙江东方	2020-12-23	2021-01-0 6	5.97	23,600	140,892 .00

2913							
2020 1223 0000 2914	600748	上实发展	2020-12-23	2021-01-06	4.91	16,200	79,542.00
2020 1223 0000 2915	600871	石化油服	2020-12-23	2021-01-06	1.96	74,300	145,628.00
2020 1223 0000 2916	600811	东方集团	2020-12-23	2021-01-06	3.65	52,300	190,895.00
2020 1223 0000 2917	603589	口子窖	2020-12-23	2021-01-06	68.90	10,000	689,000.00
2020 1223 0000 2918	600863	内蒙华电	2020-12-23	2021-01-06	2.57	41,000	105,370.00
2020 1223 0000 2919	600446	金证股份	2020-12-23	2021-01-06	16.21	23,600	382,556.00
2020 1223 0000 2920	601860	紫金银行	2020-12-23	2021-01-06	4.21	71,900	302,699.00
2020 1223 0000 2922	600120	浙江东方	2020-12-23	2021-01-06	5.97	52,700	314,619.00
2020 1223 0000 2923	600748	上实发展	2020-12-23	2021-01-06	4.91	36,200	177,742.00
2020 1223 0000 2924	600388	龙净环保	2020-12-23	2021-01-06	8.88	13,100	116,328.00
2020 1223 0000 2925	600811	东方集团	2020-12-23	2021-01-06	3.65	116,600	425,590.00

2020 1223 0000 2926	601615	明阳智能	2020-12-23	2021-01-0 6	18.98	13,200	250,536 .00
2020 1223 0000 2927	601118	海南橡胶	2020-12-23	2021-01-0 6	4.82	67,200	323,904 .00
2020 1223 0000 2928	600348	阳泉煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	5.61	21,200	118,932 .00
2020 1223 0000 2929	600748	上实发展	2020-12-23	2021-01-0 6	4.91	16,200	79,542. 00
2020 1223 0000 2930	600388	龙净环保	2020-12-23	2021-01-0 6	8.88	29,300	260,184 .00
2020 1223 0000 2931	600811	东方集团	2020-12-23	2021-01-0 6	3.65	52,300	190,895 .00
2020 1223 0000 2933	601860	紫金银行	2020-12-23	2021-01-0 6	4.21	32,200	135,562 .00
2020 1223 0000 2934	600315	上海家化	2020-12-23	2021-01-0 6	34.73	10,000	347,300 .00
2020 1223 0000 2945	601615	明阳智能	2020-12-23	2021-01-0 6	18.98	13,200	250,536 .00
2020 1223 0000 2948	600388	龙净环保	2020-12-23	2021-01-0 6	8.88	13,100	116,328 .00
2020 1223 0000 2949	600642	申能股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.22	43,300	226,026 .00
2020	601233	桐昆股份	2020-12-23	2021-01-0	20.59	26,300	541,517

1223 0000 2950				6			.00
2020 1223 0000 2951	600515	海航基础	2020-12-23	2021-01-06	6.75	61,500	415,125.00
2020 1223 0000 2954	600348	阳泉煤业	2020-12-23	2021-01-06	5.61	47,300	265,353.00
2020 1223 0000 2955	600739	辽宁成大	2020-12-23	2021-01-06	24.32	21,500	522,880.00
2020 1223 0000 2956	600707	彩虹股份	2020-12-23	2021-01-06	6.66	12,700	84,582.00
2020 1223 0000 2957	600315	上海家化	2020-12-23	2021-01-06	34.73	13,300	461,909.00
2020 1223 0000 2960	603885	吉祥航空	2020-12-23	2021-01-06	11.37	23,100	262,647.00
2020 1223 0000 2961	600398	海澜之家	2020-12-23	2021-01-06	6.42	22,800	146,376.00
2020 1223 0000 2963	600131	国网信通	2020-12-23	2021-01-06	14.23	10,000	142,300.00
2020 1223 0000 2964	600021	上海电力	2020-12-23	2021-01-06	7.12	18,400	131,008.00
2020 1223 0000 2966	601233	桐昆股份	2020-12-23	2021-01-06	20.59	26,300	541,517.00
2020 1223	600256	广汇能源	2020-12-23	2021-01-06	2.83	71,300	201,779.00

0000 2967							
2020 1223 0000 2970	600348	阳泉煤业	2020-12-23	2021-01-0 6	5.61	21,200	118,932 .00
2020 1223 0000 2971	600398	海澜之家	2020-12-23	2021-01-0 6	6.42	22,800	146,376 .00
2020 1223 0000 2972	600026	中远海能	2020-12-23	2021-01-0 6	6.68	24,400	162,992 .00
2020 1223 0000 2973	600739	辽宁成大	2020-12-23	2021-01-0 6	24.32	48,100	1,169,7 92.00
2020 1223 0000 2974	603885	吉祥航空	2020-12-23	2021-01-0 6	11.37	10,300	117,111 .00
2020 1223 0000 2975	600131	国网信通	2020-12-23	2021-01-0 6	14.23	10,000	142,300 .00
2020 1223 0000 2978	600256	广汇能源	2020-12-23	2021-01-0 6	2.83	71,300	201,779 .00
2020 1223 0000 2980	600642	申能股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.22	43,300	226,026 .00
2020 1223 0000 2982	603806	福斯特	2020-12-23	2021-01-0 6	85.40	12,100	1,033,3 40.00
2020 1223 0000 2983	603885	吉祥航空	2020-12-23	2021-01-0 6	11.37	10,300	117,111 .00
2020 1223 0000	600026	中远海能	2020-12-23	2021-01-0 6	6.68	24,400	162,992 .00

2984							
2020 1223 0000 2985	600131	国网信通	2020-12-23	2021-01-06	14.23	14,100	200,643.00
2020 1223 0000 2986	600256	广汇能源	2020-12-23	2021-01-06	2.83	159,000	449,970.00
2020 1223 0000 2989	603806	福斯特	2020-12-23	2021-01-06	85.40	10,000	854,000.00
2020 1223 0000 2990	600639	浦东金桥	2020-12-23	2021-01-06	12.40	13,300	164,920.00
2020 1223 0000 2991	603712	七一二	2020-12-23	2021-01-06	41.65	10,000	416,500.00
2020 1223 0000 2992	600633	浙数文化	2020-12-23	2021-01-06	8.14	13,700	111,518.00
2020 1223 0000 2998	600037	歌华有线	2020-12-23	2021-01-06	9.20	17,100	157,320.00
2020 1223 0000 3002	600804	鹏博士	2020-12-23	2021-01-06	6.72	25,200	169,344.00
2020 1223 0000 3006	600787	中储股份	2020-12-23	2021-01-06	4.61	15,500	71,455.00
2020 1223 0000 3007	600639	浦东金桥	2020-12-23	2021-01-06	12.40	10,000	124,000.00
2020 1223 0000 3009	603712	七一二	2020-12-23	2021-01-06	41.65	10,000	416,500.00

2020 1223 0000 3011	600633	浙数文化	2020-12-23	2021-01-0 6	8.14	30,700	249,898 .00
2020 1223 0000 3013	600037	歌华有线	2020-12-23	2021-01-0 6	9.20	17,100	157,320 .00
2020 1223 0000 3014	600804	鹏博士	2020-12-23	2021-01-0 6	6.72	56,300	378,336 .00
2020 1223 0000 3015	600787	中储股份	2020-12-23	2021-01-0 6	4.61	34,500	159,045 .00
2020 1223 0000 3016	600291	西水股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.67	11,500	65,205. 00
2020 1223 0000 3018	601966	玲珑轮胎	2020-12-23	2021-01-0 6	35.17	27,000	949,590 .00
2020 1223 0000 3020	600633	浙数文化	2020-12-23	2021-01-0 6	8.14	13,700	111,518 .00
2020 1223 0000 3026	600171	上海贝岭	2020-12-23	2021-01-0 6	14.02	10,000	140,200 .00
2020 1223 0000 3028	600291	西水股份	2020-12-23	2021-01-0 6	5.67	11,500	65,205. 00
2020 1223 0000 3030	600216	浙江医药	2020-12-23	2021-01-0 6	13.60	11,900	161,840 .00
2020 1223 0000 3032	600037	歌华有线	2020-12-23	2021-01-0 6	9.20	38,300	352,360 .00
2020	600804	鹏博士	2020-12-23	2021-01-0	6.72	25,200	169,344

1223 0000 3033				6			.00
2020 1223 0000 3034	600787	中储股份	2020-12-23	2021-01-06	4.61	15,500	71,455.00
2020 1223 0000 3035	601966	玲珑轮胎	2020-12-23	2021-01-06	35.17	12,100	425,557.00
2020 1223 0000 3036	600623	华谊集团	2020-12-23	2021-01-06	5.80	22,100	128,180.00
2020 1223 0000 3041	600515	海航基础	2020-12-23	2021-01-06	6.75	27,600	186,300.00
2020 1223 0000 3042	600171	上海贝岭	2020-12-23	2021-01-06	14.02	22,100	309,842.00
2020 1223 0000 3043	600291	西水股份	2020-12-23	2021-01-06	5.67	25,700	145,719.00
2020 1223 0000 3045	600216	浙江医药	2020-12-23	2021-01-06	13.60	26,500	360,400.00
2020 1223 0000 3046	600160	巨化股份	2020-12-23	2021-01-06	8.11	23,800	193,018.00
2020 1223 0000 3047	600623	华谊集团	2020-12-23	2021-01-06	5.80	10,000	58,000.00
2020 1223 0000 3049	601966	玲珑轮胎	2020-12-23	2021-01-06	35.17	12,100	425,557.00
2020 1223	600426	华鲁恒升	2020-12-23	2021-01-06	37.30	20,000	746,000.00

0000 3050							
2020 1223 0000 3051	600623	华谊集团	2020-12-23	2021-01-06	5.80	10,000	58,000.00
2020 1223 0000 3052	600486	扬农化工	2020-12-23	2021-01-06	132.00	10,000	1,320,000.00
2020 1223 0000 3054	600515	海航基础	2020-12-23	2021-01-06	6.75	27,600	186,300.00
2020 1223 0000 3055	601233	桐昆股份	2020-12-23	2021-01-06	20.59	58,700	1,208,633.00
2020 1223 0000 3056	600160	巨化股份	2020-12-23	2021-01-06	8.11	23,800	193,018.00
2020 1223 0000 3060	600426	华鲁恒升	2020-12-23	2021-01-06	37.30	20,000	746,000.00
2020 1223 0000 3061	601969	海南矿业	2020-12-23	2021-01-06	5.98	10,000	59,800.00
2020 1223 0000 3062	600529	山东药玻	2020-12-23	2021-01-06	50.15	10,000	501,500.00
2020 1223 0000 3064	600835	上海机电	2020-12-23	2021-01-06	19.46	12,700	247,142.00
2020 1223 0000 3073	600006	东风汽车	2020-12-23	2021-01-06	9.44	31,400	296,416.00
2020 1223 0000	600160	巨化股份	2020-12-23	2021-01-06	8.11	53,200	431,452.00

3075							
2020 1223 0000 3077	600426	华鲁恒升	2020-12-23	2021-01-06	37.30	44,700	1,667,310.00
2020 1223 0000 3078	601969	海南矿业	2020-12-23	2021-01-06	5.98	15,400	92,092.00
2020 1223 0000 3080	600835	上海机电	2020-12-23	2021-01-06	19.46	10,000	194,600.00
2020 1223 0000 3081	600529	山东药玻	2020-12-23	2021-01-06	50.15	10,000	501,500.00
2020 1223 0000 3084	600008	首创股份	2020-12-23	2021-01-06	2.83	77,600	219,608.00
2020 1223 0000 3085	600549	厦门钨业	2020-12-23	2021-01-06	16.85	14,800	249,380.00
2020 1223 0000 3086	600928	西安银行	2020-12-23	2021-01-06	5.56	23,400	130,104.00
2020 1223 0000 3087	601969	海南矿业	2020-12-23	2021-01-06	5.98	10,000	59,800.00
2020 1223 0000 3089	600776	东方通信	2020-12-23	2021-01-06	11.85	10,000	118,500.00
2020 1223 0000 3090	600529	山东药玻	2020-12-23	2021-01-06	50.15	18,700	937,805.00
2020 1223 0000 3092	600928	西安银行	2020-12-23	2021-01-06	5.56	52,300	290,788.00

2020 1223 0000 3094	600073	上海梅林	2020-12-23	2021-01-0 6	10.29	11,600	119,364 .00
2020 1223 0000 3095	600776	东方通信	2020-12-23	2021-01-0 6	11.85	18,700	221,595 .00
2020 1223 0000 3097	600928	西安银行	2020-12-23	2021-01-0 6	5.56	23,400	130,104 .00
2020 1223 0000 3098	600073	上海梅林	2020-12-23	2021-01-0 6	10.29	11,600	119,364 .00
2020 1223 0000 3107	600073	上海梅林	2020-12-23	2021-01-0 6	10.29	25,900	266,511 .00
2020 1223 0000 3108	600675	中华企业	2020-12-23	2021-01-0 6	3.36	32,200	108,192 .00
2020 1223 0000 3111	600008	首创股份	2020-12-23	2021-01-0 6	2.83	77,600	219,608 .00
2020 1223 0000 3113	600549	厦门钨业	2020-12-23	2021-01-0 6	16.85	33,100	557,735 .00
2020 1223 0000 3114	600776	东方通信	2020-12-23	2021-01-0 6	11.85	10,000	118,500 .00
2020 1223 0000 3120	600823	世茂股份	2020-12-23	2021-01-0 6	4.61	19,800	91,278. 00
2020 1223 0000 3122	600266	城建发展	2020-12-23	2021-01-0 6	5.08	23,900	121,412 .00
2020	600339	中油工程	2020-12-23	2021-01-0	3.08	29,500	90,860.

1223 0000 3126				6			00
2020 1223 0000 3127	600718	东软集团	2020-12-23	2021-01-06	10.41	15,300	159,273.00
2020 1223 0000 3131	603883	老百姓	2020-12-23	2021-01-06	62.83	10,000	628,300.00
2020 1223 0000 3132	600006	东风汽车	2020-12-23	2021-01-06	9.44	14,000	132,160.00
2020 1223 0000 3137	600008	首创股份	2020-12-23	2021-01-06	2.83	173,100	489,873.00
2020 1223 0000 3138	600549	厦门钨业	2020-12-23	2021-01-06	16.85	14,800	249,380.00
2020 1223 0000 3139	601975	招商南油	2020-12-23	2021-01-06	2.51	61,100	153,361.00
2020 1223 0000 3141	600216	浙江医药	2020-12-23	2021-01-06	13.60	11,900	161,840.00
2020 1223 0000 3144	603198	迎驾贡酒	2020-12-23	2021-01-06	34.90	10,000	349,000.00
2020 1223 0000 3151	600266	城建发展	2020-12-23	2021-01-06	5.08	23,900	121,412.00
2020 1223 0000 3153	600967	内蒙一机	2020-12-23	2021-01-06	12.16	14,900	181,184.00
2020 1223	600325	华发股份	2020-12-23	2021-01-06	6.21	29,900	185,679.00

0000 3156							
2020 1223 0000 3159	600006	东风汽车	2020-12-23	2021-01-06	9.44	14,000	132,160.00
2020 1223 0000 3161	601975	招商南油	2020-12-23	2021-01-06	2.51	136,200	341,862.00
2020 1223 0000 3165	600901	江苏租赁	2020-12-23	2021-01-06	5.51	21,000	115,710.00
2020 1223 0000 3170	600967	内蒙一机	2020-12-23	2021-01-06	12.16	33,200	403,712.00
2020 1223 0000 3172	600266	城建发展	2020-12-23	2021-01-06	5.08	53,400	271,272.00
2020 1223 0000 3174	600325	华发股份	2020-12-23	2021-01-06	6.21	29,900	185,679.00
2020 1223 0000 3181	601975	招商南油	2020-12-23	2021-01-06	2.51	61,100	153,361.00
2020 1223 0000 3183	600967	内蒙一机	2020-12-23	2021-01-06	12.16	14,900	181,184.00
2020 1223 0000 3184	600901	江苏租赁	2020-12-23	2021-01-06	5.51	46,800	257,868.00
2020 1223 0000 3186	600325	华发股份	2020-12-23	2021-01-06	6.21	66,700	414,207.00
2020 1223 0000	600545	卓郎智能	2020-12-23	2021-01-06	3.50	20,000	70,000.00

3193							
2020 1223 0000 3194	600839	四川长虹	2020-12-23	2021-01-06	2.90	65,200	189,080.00
2020 1223 0000 3196	600582	天地科技	2020-12-23	2021-01-06	3.08	29,200	89,936.00
2020 1223 0000 3198	600901	江苏租赁	2020-12-23	2021-01-06	5.51	21,000	115,710.00
2020 1223 0000 3200	600260	凯乐科技	2020-12-23	2021-01-06	10.90	17,600	191,840.00
2020 1223 0000 3205	600582	天地科技	2020-12-23	2021-01-06	3.08	65,200	200,816.00
2020 1223 0000 3206	600839	四川长虹	2020-12-23	2021-01-06	2.90	145,600	422,240.00
2020 1223 0000 3207	600545	卓郎智能	2020-12-23	2021-01-06	3.50	20,000	70,000.00
2020 1223 0000 3208	600260	凯乐科技	2020-12-23	2021-01-06	10.90	17,600	191,840.00
2020 1223 0000 3209	600373	中文传媒	2020-12-23	2021-01-06	10.09	11,900	120,071.00
2020 1223 0000 3210	600339	中油工程	2020-12-23	2021-01-06	3.08	65,900	202,972.00
2020 1223 0000 3212	600718	东软集团	2020-12-23	2021-01-06	10.41	34,200	356,022.00

2020 1223 0000 3213	600171	上海贝岭	2020-12-23	2021-01-0 6	14.02	10,000	140,200 .00
2020 1223 0000 3218	600728	佳都科技	2020-12-23	2021-01-0 6	7.59	55,200	418,968 .00
2020 1223 0000 3220	601099	太平洋	2020-12-23	2021-01-0 6	4.08	120,100	490,008 .00
2020 1223 0000 3223	600839	四川长虹	2020-12-23	2021-01-0 6	2.90	65,200	189,080 .00
2020 1223 0000 3224	600582	天地科技	2020-12-23	2021-01-0 6	3.08	29,200	89,936. 00
2020 1223 0000 3226	600545	卓郎智能	2020-12-23	2021-01-0 6	3.50	44,600	156,100 .00
2020 1223 0000 3227	600260	凯乐科技	2020-12-23	2021-01-0 6	10.90	39,200	427,280 .00
2020 1223 0000 3229	600435	北方导航	2020-12-23	2021-01-0 6	9.00	18,300	164,700 .00
2020 1223 0000 3230	600373	中文传媒	2020-12-23	2021-01-0 6	10.09	11,900	120,071 .00
2020 1223 0000 3232	600823	世茂股份	2020-12-23	2021-01-0 6	4.61	19,800	91,278. 00
2020 1223 0000 3234	600903	贵州燃气	2020-12-23	2021-01-0 6	12.70	10,000	127,000 .00
2020	600728	佳都科技	2020-12-23	2021-01-0	7.59	24,700	187,473

1223 0000 3236				6			.00
2020 1223 0000 3238	600718	东软集团	2020-12-23	2021-01-06	10.41	15,300	159,273.00
2020 1223 0000 3239	600728	佳都科技	2020-12-23	2021-01-06	7.59	24,700	187,473.00
2020 1223 0000 3240	600675	中华企业	2020-12-23	2021-01-06	3.36	32,200	108,192.00
2020 1223 0000 3241	600373	中文传媒	2020-12-23	2021-01-06	10.09	26,600	268,394.00
2020 1223 0000 3242	600884	杉杉股份	2020-12-23	2021-01-06	18.03	20,100	362,403.00
2020 1223 0000 3243	600823	世茂股份	2020-12-23	2021-01-06	4.61	44,300	204,223.00
2020 1223 0000 3244	600903	贵州燃气	2020-12-23	2021-01-06	12.70	10,000	127,000.00
2020 1223 0000 3245	600435	北方导航	2020-12-23	2021-01-06	9.00	18,300	164,700.00
2020 1223 0000 3247	601099	太平洋	2020-12-23	2021-01-06	4.08	120,100	490,008.00
2020 1223 0000 3249	600339	中油工程	2020-12-23	2021-01-06	3.08	29,500	90,860.00
2020 1223	600801	华新水泥	2020-12-23	2021-01-06	20.63	12,000	247,560.00

0000 3250							
2020 1223 0000 3251	600675	中华企业	2020-12-23	2021-01-06	3.36	71,800	241,248.00
2020 1223 0000 3252	600884	杉杉股份	2020-12-23	2021-01-06	18.03	44,800	807,744.00
2020 1223 0000 3253	600435	北方导航	2020-12-23	2021-01-06	9.00	40,800	367,200.00
2020 1223 0000 3255	601099	太平洋	2020-12-23	2021-01-06	4.08	267,900	1,093,032.00
2020 1223 0000 3257	600801	华新水泥	2020-12-23	2021-01-06	20.63	26,800	552,884.00
2020 1223 0000 3258	600884	杉杉股份	2020-12-23	2021-01-06	18.03	20,100	362,403.00
2020 1223 0000 3259	600195	中牧股份	2020-12-23	2021-01-06	12.81	10,700	137,067.00
2020 1223 0000 3262	600801	华新水泥	2020-12-23	2021-01-06	20.63	12,000	247,560.00
2020 1223 0000 3263	600640	号百控股	2020-12-23	2021-01-06	12.25	12,500	153,125.00
2020 1223 0000 3264	600195	中牧股份	2020-12-23	2021-01-06	12.81	10,700	137,067.00
2020 1223 0000	600195	中牧股份	2020-12-23	2021-01-06	12.81	23,900	306,159.00

3266							
2020 1223 0000 3267	601000	唐山港	2020-12-23	2021-01-0 6	2.48	52,100	129,208 .00
2020 1223 0000 3268	600640	号百控股	2020-12-23	2021-01-0 6	12.25	10,000	122,500 .00
2020 1223 0000 3269	603883	老百姓	2020-12-23	2021-01-0 6	62.83	10,000	628,300 .00
2020 1223 0000 3270	601000	唐山港	2020-12-23	2021-01-0 6	2.48	116,300	288,424 .00
2020 1223 0000 3271	601000	唐山港	2020-12-23	2021-01-0 6	2.48	52,100	129,208 .00
2020 1223 0000 3272	603198	迎驾贡酒	2020-12-23	2021-01-0 6	34.90	10,000	349,000 .00
2020 1216 0000 0929	300182	捷成股份	2020-12-16	2020-12-3 0	3.23	111,000	358,530 .00
2020 1223 0000 0453	300182	捷成股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.23	81,000	261,630 .00
2020 1223 0000 0623	300182	捷成股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.23	36,300	117,249 .00
2020 1223 0000 0701	300182	捷成股份	2020-12-23	2021-01-0 6	3.23	36,300	117,249 .00
2020 1223 0000 0421	688029	南微医学	2020-12-23	2021-01-0 6	184.01	1,500	276,015 .00

2020 1230 0000 6973	002183	怡亚通	2020-12-30	2021-01-1 3	4.36	80,400	350,544 .00
2020 1230 0000 6975	002185	华天科技	2020-12-30	2021-01-1 3	13.62	118,400	1,612,6 08.00
2020 1230 0000 6977	002191	劲嘉股份	2020-12-30	2021-01-1 3	9.23	47,500	438,425 .00
2020 1230 0000 6979	002174	游族网络	2020-12-30	2021-01-1 3	13.16	39,500	519,820 .00
2020 1230 0000 6981	002152	广电运通	2020-12-30	2021-01-1 3	10.68	65,000	694,200 .00
2020 1230 0000 6983	002155	湖南黄金	2020-12-30	2021-01-1 3	8.51	45,300	385,503 .00
2020 1230 0000 6985	002156	通富微电	2020-12-30	2021-01-1 3	25.24	35,900	906,116 .00
2020 1230 0000 6987	002221	东华能源	2020-12-30	2021-01-1 3	10.14	62,400	632,736 .00
2020 1230 0000 6989	002223	鱼跃医疗	2020-12-30	2021-01-1 3	28.21	32,400	914,004 .00
2020 1230 0000 6991	002233	塔牌集团	2020-12-30	2021-01-1 3	12.74	38,700	493,038 .00
2020 1230 0000 6993	002217	合力泰	2020-12-30	2021-01-1 3	4.10	101,300	415,330 .00
2020	002195	二三四五	2020-12-30	2021-01-1	2.26	308,800	697,888

1230 0000 6995				3			.00
2020 1230 0000 6997	002203	海亮股份	2020-12-30	2021-01-1 3	7.39	52,600	388,714 .00
2020 1230 0000 6999	002212	天融信	2020-12-30	2021-01-1 3	21.01	50,600	1,063,1 06.00
2020 1230 0000 7001	002080	中材科技	2020-12-30	2021-01-1 3	24.18	36,200	875,316 .00
2020 1230 0000 7003	002081	金螳螂	2020-12-30	2021-01-1 3	9.39	86,900	815,991 .00
2020 1230 0000 7005	002085	万丰奥威	2020-12-30	2021-01-1 3	6.56	82,500	541,200 .00
2020 1230 0000 7007	002078	太阳纸业	2020-12-30	2021-01-1 3	14.43	84,300	1,216,4 49.00
2020 1230 0000 7009	002064	华峰化学	2020-12-30	2021-01-1 3	10.09	75,200	758,768 .00
2020 1230 0000 7011	002074	国轩高科	2020-12-30	2021-01-1 3	39.12	55,300	2,163,3 36.00
2020 1230 0000 7013	002128	露天煤业	2020-12-30	2021-01-1 3	10.94	41,400	452,916 .00
2020 1230 0000 7015	002075	沙钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	10.97	95,300	1,045,4 41.00
2020 1230	002131	利欧股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.03	365,400	1,107,1 62.00

0000 7017							
2020 1230 0000 7019	002138	顺络电子	2020-12-30	2021-01-1 3	24.52	34,800	853,296 .00
2020 1230 0000 7021	002092	中泰化学	2020-12-30	2021-01-1 3	6.15	92,500	568,875 .00
2020 1230 0000 7023	002124	天邦股份	2020-12-30	2021-01-1 3	14.60	49,700	725,620 .00
2020 1230 0000 7025	002093	国脉科技	2020-12-30	2021-01-1 3	7.29	27,100	197,559 .00
2020 1230 0000 7027	002110	三钢闽光	2020-12-30	2021-01-1 3	6.73	66,200	445,526 .00
2020 1230 0000 7029	002382	蓝帆医疗	2020-12-30	2021-01-1 3	21.09	31,200	658,008 .00
2020 1230 0000 7031	002385	大北农	2020-12-30	2021-01-1 3	9.66	158,700	1,533,0 42.00
2020 1230 0000 7033	002387	维信诺	2020-12-30	2021-01-1 3	11.40	44,200	503,880 .00
2020 1230 0000 7035	002375	亚厦股份	2020-12-30	2021-01-1 3	7.44	36,000	267,840 .00
2020 1230 0000 7037	002368	太极股份	2020-12-30	2021-01-1 3	26.11	21,900	571,809 .00
2020 1230 0000	002372	伟星新材	2020-12-30	2021-01-1 3	18.70	34,000	635,800 .00

7039							
2020 1230 0000 7041	002373	千方科技	2020-12-30	2021-01-1 3	19.12	42,700	816,424 .00
2020 1230 0000 7043	002416	爱施德	2020-12-30	2021-01-1 3	7.46	33,400	249,164 .00
2020 1230 0000 7045	002419	天虹股份	2020-12-30	2021-01-1 3	7.64	26,000	198,640 .00
2020 1230 0000 7047	002424	贵州百灵	2020-12-30	2021-01-1 3	7.83	38,000	297,540 .00
2020 1230 0000 7049	002408	齐翔腾达	2020-12-30	2021-01-1 3	8.36	38,200	319,352 .00
2020 1230 0000 7151	600909	华安证券	2020-12-30	2021-01-1 3	8.00	117,300	938,400 .00
2020 1230 0000 7153	600903	贵州燃气	2020-12-30	2021-01-1 3	12.70	12,100	153,670 .00
2020 1230 0000 7155	600928	西安银行	2020-12-30	2021-01-1 3	5.56	72,000	400,320 .00
2020 1230 0000 7157	600917	重庆燃气	2020-12-30	2021-01-1 3	6.86	10,100	69,286. 00
2020 1230 0000 7159	600885	宏发股份	2020-12-30	2021-01-1 3	54.22	28,100	1,523,5 82.00
2020 1230 0000 7161	600895	张江高科	2020-12-30	2021-01-1 3	17.04	41,700	710,568 .00

2020 1230 0000 7163	600901	江苏租赁	2020-12-30	2021-01-1 3	5.51	64,300	354,293 .00
2020 1230 0000 7165	601000	唐山港	2020-12-30	2021-01-1 3	2.48	160,300	397,544 .00
2020 1230 0000 7167	601003	柳钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.19	27,500	142,725 .00
2020 1230 0000 7169	601005	重庆钢铁	2020-12-30	2021-01-1 3	1.48	316,200	467,976 .00
2020 1230 0000 7171	600970	中材国际	2020-12-30	2021-01-1 3	6.88	56,400	388,032 .00
2020 1230 0000 7173	600967	内蒙一机	2020-12-30	2021-01-1 3	12.16	45,600	554,496 .00
2020 1230 0000 7175	600968	海油发展	2020-12-30	2021-01-1 3	2.39	110,000	262,900 .00
2020 1230 0000 7177	600859	王府井	2020-12-30	2021-01-1 3	32.58	20,900	680,922 .00
2020 1230 0000 7179	600862	中航高科	2020-12-30	2021-01-1 3	30.10	37,500	1,128,7 50.00
2020 1230 0000 7181	600959	江苏有线	2020-12-30	2021-01-1 3	3.31	107,800	356,818 .00
2020 1230 0000 7183	600863	内蒙华电	2020-12-30	2021-01-1 3	2.57	125,400	322,278 .00
2020	600839	四川长虹	2020-12-30	2021-01-1	2.90	200,000	580,000

1230 0000 7185				3			.00
2020 1230 0000 7187	600823	世茂股份	2020-12-30	2021-01-1 3	4.61	61,000	281,210 .00
2020 1230 0000 7189	600835	上海机电	2020-12-30	2021-01-1 3	19.46	17,400	338,604 .00
2020 1230 0000 7191	600827	百联股份	2020-12-30	2021-01-1 3	14.60	43,300	632,180 .00
2020 1230 0000 7193	600879	航天电子	2020-12-30	2021-01-1 3	7.48	117,400	878,152 .00
2020 1230 0000 7195	600881	亚泰集团	2020-12-30	2021-01-1 3	3.10	175,300	543,430 .00
2020 1230 0000 7197	600884	杉杉股份	2020-12-30	2021-01-1 3	18.03	61,500	1,108,8 45.00
2020 1230 0000 7199	600875	东方电气	2020-12-30	2021-01-1 3	9.97	60,100	599,197 .00
2020 1230 0000 7201	600867	通化东宝	2020-12-30	2021-01-1 3	13.38	76,900	1,028,9 22.00
2020 1230 0000 7203	600869	远东股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.99	59,800	238,602 .00
2020 1230 0000 7205	600871	石化油服	2020-12-30	2021-01-1 3	1.96	102,900	201,684 .00
2020 1230	601689	拓普集团	2020-12-30	2021-01-1 3	38.43	22,800	876,204 .00

0000 7207							
2020 1230 0000 7209	601717	郑煤机	2020-12-30	2021-01-1 3	10.93	56,400	616,452 .00
2020 1230 0000 7211	601615	明阳智能	2020-12-30	2021-01-1 3	18.98	40,500	768,690 .00
2020 1230 0000 7213	601699	潞安环能	2020-12-30	2021-01-1 3	6.50	64,800	421,200 .00
2020 1230 0000 7215	601598	中国外运	2020-12-30	2021-01-1 3	4.40	85,500	376,200 .00
2020 1230 0000 7217	601608	中信重工	2020-12-30	2021-01-1 3	3.96	93,900	371,844 .00
2020 1230 0000 7219	601611	中国核建	2020-12-30	2021-01-1 3	7.28	42,700	310,856 .00
2020 1230 0000 7221	601860	紫金银行	2020-12-30	2021-01-1 3	4.21	98,700	415,527 .00
2020 1230 0000 7223	601865	福莱特	2020-12-30	2021-01-1 3	39.90	10,000	399,000 .00
2020 1230 0000 7225	601866	中远海发	2020-12-30	2021-01-1 3	2.97	213,800	634,986 .00
2020 1230 0000 7227	601828	美凯龙	2020-12-30	2021-01-1 3	8.49	24,000	203,760 .00
2020 1230 0000	601718	际华集团	2020-12-30	2021-01-1 3	3.03	118,400	358,752 .00

7229							
2020 1230 0000 7231	601799	星宇股份	2020-12-30	2021-01-1 3	200.50	10,000	2,005,0 00.00
2020 1230 0000 7233	601801	皖新传媒	2020-12-30	2021-01-1 3	4.75	32,100	152,475 .00
2020 1230 0000 7235	601118	海南橡胶	2020-12-30	2021-01-1 3	4.82	92,400	445,368 .00
2020 1230 0000 7237	601127	小康股份	2020-12-30	2021-01-1 3	17.08	13,600	232,288 .00
2020 1230 0000 7239	601128	常熟银行	2020-12-30	2021-01-1 3	7.38	148,300	1,094,4 54.00
2020 1230 0000 7241	601106	中国一重	2020-12-30	2021-01-1 3	2.99	147,900	442,221 .00
2020 1230 0000 7243	601016	节能风电	2020-12-30	2021-01-1 3	3.43	107,200	367,696 .00
2020 1230 0000 7245	601098	中南传媒	2020-12-30	2021-01-1 3	9.53	38,800	369,764 .00
2020 1230 0000 7247	601099	太平洋	2020-12-30	2021-01-1 3	4.08	368,100	1,501,8 48.00
2020 1230 0000 7249	601233	桐昆股份	2020-12-30	2021-01-1 3	20.59	80,600	1,659,5 54.00
2020 1230 0000 7251	601298	青岛港	2020-12-30	2021-01-1 3	6.43	38,000	244,340 .00

2020 1230 0000 7253	601333	广深铁路	2020-12-30	2021-01-1 3	2.22	182,600	405,372 .00
2020 1230 0000 7255	601228	广州港	2020-12-30	2021-01-1 3	3.36	67,100	225,456 .00
2020 1230 0000 7257	601139	深圳燃气	2020-12-30	2021-01-1 3	7.24	31,000	224,440 .00
2020 1230 0000 7259	601168	西部矿业	2020-12-30	2021-01-1 3	12.38	103,000	1,275,1 40.00
2020 1230 0000 7261	601179	中国西电	2020-12-30	2021-01-1 3	4.61	110,600	509,866 .00
2020 1230 0000 7263	600820	隧道股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.41	101,900	551,279 .00
2020 1230 0000 7265	600597	光明乳业	2020-12-30	2021-01-1 3	16.26	33,000	536,580 .00
2020 1230 0000 7267	600598	北大荒	2020-12-30	2021-01-1 3	19.25	38,500	741,125 .00
2020 1230 0000 7269	600582	天地科技	2020-12-30	2021-01-1 3	3.08	89,400	275,352 .00
2020 1230 0000 7271	600623	华谊集团	2020-12-30	2021-01-1 3	5.80	30,000	174,000 .00
2020 1230 0000 7273	600572	康恩贝	2020-12-30	2021-01-1 3	4.71	100,800	474,768 .00
2020	600575	淮河能源	2020-12-30	2021-01-1	2.32	84,100	195,112

1230 0000 7275				3			.00
2020 1230 0000 7277	600580	卧龙电驱	2020-12-30	2021-01-1 3	15.60	42,300	659,880 .00
2020 1230 0000 7279	600643	爱建集团	2020-12-30	2021-01-1 3	7.52	43,700	328,624 .00
2020 1230 0000 7281	600645	中源协和	2020-12-30	2021-01-1 3	19.61	17,700	347,097 .00
2020 1230 0000 7283	600648	外高桥	2020-12-30	2021-01-1 3	13.97	20,300	283,591 .00
2020 1230 0000 7285	600642	申能股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.22	132,800	693,216 .00
2020 1230 0000 7287	600633	浙数文化	2020-12-30	2021-01-1 3	8.14	42,100	342,694 .00
2020 1230 0000 7289	600640	号百控股	2020-12-30	2021-01-1 3	12.25	17,000	208,250 .00
2020 1230 0000 7291	600639	浦东金桥	2020-12-30	2021-01-1 3	12.40	18,400	228,160 .00
2020 1230 0000 7293	600517	国网英大	2020-12-30	2021-01-1 3	6.08	34,100	207,328 .00
2020 1230 0000 7295	600528	中铁工业	2020-12-30	2021-01-1 3	8.74	71,900	628,406 .00
2020 1230	600529	山东药玻	2020-12-30	2021-01-1 3	50.15	25,700	1,288,8 55.00

0000 7297							
2020 1230 0000 7299	600516	方大炭素	2020-12-30	2021-01-1 3	7.07	123,200	871,024 .00
2020 1230 0000 7301	600507	方大特钢	2020-12-30	2021-01-1 3	6.94	58,400	405,296 .00
2020 1230 0000 7303	600511	国药股份	2020-12-30	2021-01-1 3	49.31	20,300	1,000,9 93.00
2020 1230 0000 7305	600515	海航基础	2020-12-30	2021-01-1 3	6.75	84,400	569,700 .00
2020 1230 0000 7307	600563	法拉电子	2020-12-30	2021-01-1 3	107.55	10,000	1,075,5 00.00
2020 1230 0000 7309	600566	济川药业	2020-12-30	2021-01-1 3	20.23	14,300	289,289 .00
2020 1230 0000 7311	600567	山鹰国际	2020-12-30	2021-01-1 3	3.02	173,600	524,272 .00
2020 1230 0000 7313	600549	厦门钨业	2020-12-30	2021-01-1 3	16.85	45,600	768,360 .00
2020 1230 0000 7315	600535	天士力	2020-12-30	2021-01-1 3	14.79	48,900	723,231 .00
2020 1230 0000 7317	600545	卓郎智能	2020-12-30	2021-01-1 3	3.50	61,200	214,200 .00
2020 1230 0000	600546	山煤国际	2020-12-30	2021-01-1 3	8.51	42,800	364,228 .00

7319							
2020 1230 0000 7321	600755	厦门国贸	2020-12-30	2021-01-1 3	6.68	70,700	472,276 .00
2020 1230 0000 7323	600765	中航重机	2020-12-30	2021-01-1 3	25.00	30,400	760,000 .00
2020 1230 0000 7325	600776	东方通信	2020-12-30	2021-01-1 3	11.85	25,900	306,915 .00
2020 1230 0000 7327	600754	锦江酒店	2020-12-30	2021-01-1 3	51.53	17,300	891,469 .00
2020 1230 0000 7329	600737	中粮糖业	2020-12-30	2021-01-1 3	9.68	57,700	558,536 .00
2020 1230 0000 7331	600739	辽宁成大	2020-12-30	2021-01-1 3	24.32	66,100	1,607,5 52.00
2020 1230 0000 7333	600748	上实发展	2020-12-30	2021-01-1 3	4.91	50,000	245,500 .00
2020 1230 0000 7335	600804	鹏博士	2020-12-30	2021-01-1 3	6.72	77,300	519,456 .00
2020 1230 0000 7337	600808	马钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	2.66	128,500	341,810 .00
2020 1230 0000 7339	600811	东方集团	2020-12-30	2021-01-1 3	3.65	160,300	585,095 .00
2020 1230 0000 7341	600801	华新水泥	2020-12-30	2021-01-1 3	20.63	36,700	757,121 .00

2020 1230 0000 7343	600779	水井坊	2020-12-30	2021-01-1 3	83.02	10,500	871,710 .00
2020 1230 0000 7345	600782	新钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	4.59	86,400	396,576 .00
2020 1230 0000 7347	600787	中储股份	2020-12-30	2021-01-1 3	4.61	47,500	218,975 .00
2020 1230 0000 7349	600673	东阳光	2020-12-30	2021-01-1 3	5.03	81,500	409,945 .00
2020 1230 0000 7351	600675	中华企业	2020-12-30	2021-01-1 3	3.36	99,100	332,976 .00
2020 1230 0000 7353	600699	均胜电子	2020-12-30	2021-01-1 3	25.36	44,300	1,123,4 48.00
2020 1230 0000 7355	600649	城投控股	2020-12-30	2021-01-1 3	5.43	68,400	371,412 .00
2020 1230 0000 7357	600657	信达地产	2020-12-30	2021-01-1 3	4.05	46,100	186,705 .00
2020 1230 0000 7359	600667	太极实业	2020-12-30	2021-01-1 3	9.45	79,600	752,220 .00
2020 1230 0000 7361	600664	哈药股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.19	81,600	260,304 .00
2020 1230 0000 7363	600728	佳都科技	2020-12-30	2021-01-1 3	7.59	75,800	575,322 .00
2020	600729	重庆百货	2020-12-30	2021-01-1	28.90	11,000	317,900

1230 0000 7365				3			.00
2020 1230 0000 7367	600733	北汽蓝谷	2020-12-30	2021-01-1 3	8.67	113,200	981,444 .00
2020 1230 0000 7369	600718	东软集团	2020-12-30	2021-01-1 3	10.41	46,900	488,229 .00
2020 1230 0000 7371	600707	彩虹股份	2020-12-30	2021-01-1 3	6.66	38,600	257,076 .00
2020 1230 0000 7373	600717	天津港	2020-12-30	2021-01-1 3	4.78	65,000	310,700 .00
2020 1230 0000 7375	601869	长飞光纤	2020-12-30	2021-01-1 3	27.04	10,000	270,400 .00
2020 1230 0000 7377	600704	物产中大	2020-12-30	2021-01-1 3	4.37	136,900	598,253 .00
2020 1230 0000 7379	000807	云铝股份	2020-12-30	2021-01-1 3	7.53	84,500	636,285 .00
2020 1230 0000 7381	000813	德展健康	2020-12-30	2021-01-1 3	4.43	48,500	214,855 .00
2020 1230 0000 7383	000825	太钢不锈	2020-12-30	2021-01-1 3	3.61	122,800	443,308 .00
2020 1230 0000 7385	000778	新兴铸管	2020-12-30	2021-01-1 3	3.68	129,600	476,928 .00
2020 1230	000739	普洛药业	2020-12-30	2021-01-1 3	23.28	31,800	740,304 .00

0000 7387							
2020 1230 0000 7389	000750	国海证券	2020-12-30	2021-01-1 3	5.86	206,100	1,207,7 46.00
2020 1230 0000 7391	000758	中色股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.08	74,500	378,460 .00
2020 1230 0000 7393	000878	云南铜业	2020-12-30	2021-01-1 3	14.47	55,100	797,297 .00
2020 1230 0000 7395	000883	湖北能源	2020-12-30	2021-01-1 3	3.88	105,800	410,504 .00
2020 1230 0000 7397	000887	中鼎股份	2020-12-30	2021-01-1 3	11.71	39,600	463,716 .00
2020 1230 0000 7399	000877	天山股份	2020-12-30	2021-01-1 3	15.10	34,000	513,400 .00
2020 1230 0000 7403	000830	鲁西化工	2020-12-30	2021-01-1 3	12.78	55,300	706,734 .00
2020 1230 0000 7405	000869	张裕A	2020-12-30	2021-01-1 3	43.60	10,000	436,000 .00
2020 1230 0000 7407	000681	视觉中国	2020-12-30	2021-01-1 3	13.00	22,700	295,100 .00
2020 1230 0000 7409	000685	中山公用	2020-12-30	2021-01-1 3	8.30	47,800	396,740 .00
2020 1230 0000	000686	东北证券	2020-12-30	2021-01-1 3	9.82	75,900	745,338 .00

7411							
2020 1230 0000 7413	000636	风华高科	2020-12-30	2021-01-1 3	33.70	38,700	1,304,1 90.00
2020 1230 0000 7415	000623	吉林敖东	2020-12-30	2021-01-1 3	16.47	50,200	826,794 .00
2020 1230 0000 7417	000629	攀钢钒钛	2020-12-30	2021-01-1 3	2.17	231,800	503,006 .00
2020 1230 0000 7419	000630	铜陵有色	2020-12-30	2021-01-1 3	2.57	397,900	1,022,6 03.00
2020 1230 0000 7421	000729	燕京啤酒	2020-12-30	2021-01-1 3	8.52	76,000	647,520 .00
2020 1230 0000 7423	000732	泰禾集团	2020-12-30	2021-01-1 3	3.27	53,700	175,599 .00
2020 1230 0000 7425	000738	航发控制	2020-12-30	2021-01-1 3	22.93	30,900	708,537 .00
2020 1230 0000 7427	000718	苏宁环球	2020-12-30	2021-01-1 3	3.43	81,600	279,888 .00
2020 1230 0000 7429	000690	宝新能源	2020-12-30	2021-01-1 3	7.30	94,100	686,930 .00
2020 1230 0000 7431	000709	河钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	2.24	229,800	514,752 .00
2020 1230 0000 7433	000717	韶钢松山	2020-12-30	2021-01-1 3	4.27	65,300	278,831 .00

2020 1230 0000 7435	002004	华邦健康	2020-12-30	2021-01-1 3	5.54	85,400	473,116 .00
2020 1230 0000 7437	002010	传化智联	2020-12-30	2021-01-1 3	4.71	70,500	332,055 .00
2020 1230 0000 7439	002013	中航机电	2020-12-30	2021-01-1 3	11.45	104,800	1,199,9 60.00
2020 1230 0000 7441	002002	鸿达兴业	2020-12-30	2021-01-1 3	3.00	98,200	294,600 .00
2020 1230 0000 7443	000999	华润三九	2020-12-30	2021-01-1 3	24.94	21,100	526,234 .00
2020 1230 0000 7445	001872	招商港口	2020-12-30	2021-01-1 3	15.92	10,000	159,200 .00
2020 1230 0000 7447	001914	招商积余	2020-12-30	2021-01-1 3	21.53	22,800	490,884 .00
2020 1230 0000 7449	002048	宁波华翔	2020-12-30	2021-01-1 3	15.57	27,000	420,390 .00
2020 1230 0000 7451	002051	中工国际	2020-12-30	2021-01-1 3	7.09	26,600	188,594 .00
2020 1230 0000 7453	002056	横店东磁	2020-12-30	2021-01-1 3	15.19	44,300	672,917 .00
2020 1230 0000 7455	002038	双鹭药业	2020-12-30	2021-01-1 3	10.10	33,300	336,330 .00
2020	002019	亿帆医药	2020-12-30	2021-01-1	18.93	40,000	757,200

1230 0000 7457				3			.00
2020 1230 0000 7459	002028	思源电气	2020-12-30	2021-01-1 3	20.06	32,800	657,968 .00
2020 1230 0000 7461	002030	达安基因	2020-12-30	2021-01-1 3	34.30	33,100	1,135,3 30.00
2020 1230 0000 7463	000959	首钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.83	85,900	328,997 .00
2020 1230 0000 7465	000960	锡业股份	2020-12-30	2021-01-1 3	11.20	54,200	607,040 .00
2020 1230 0000 7467	000967	盈峰环境	2020-12-30	2021-01-1 3	8.14	51,100	415,954 .00
2020 1230 0000 7469	000937	冀中能源	2020-12-30	2021-01-1 3	4.16	57,000	237,120 .00
2020 1230 0000 7471	000898	鞍钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.04	129,600	393,984 .00
2020 1230 0000 7473	000932	华菱钢铁	2020-12-30	2021-01-1 3	4.78	99,300	474,654 .00
2020 1230 0000 7475	000930	中粮科技	2020-12-30	2021-01-1 3	8.42	60,600	510,252 .00
2020 1230 0000 7477	000990	诚志股份	2020-12-30	2021-01-1 3	11.86	33,800	400,868 .00
2020 1230	000997	新大陆	2020-12-30	2021-01-1 3	15.28	39,800	608,144 .00

0000 7479							
2020 1230 0000 7481	000998	隆平高科	2020-12-30	2021-01-1 3	19.81	49,800	986,538 .00
2020 1230 0000 7483	000988	华工科技	2020-12-30	2021-01-1 3	23.19	43,400	1,006,4 46.00
2020 1230 0000 7485	000970	中科三环	2020-12-30	2021-01-1 3	9.45	46,000	434,700 .00
2020 1230 0000 7487	000975	银泰黄金	2020-12-30	2021-01-1 3	8.61	90,100	775,761 .00
2020 1230 0000 7489	000983	山西焦煤	2020-12-30	2021-01-1 3	5.64	110,800	624,912 .00
2020 1230 0000 7491	000600	建投能源	2020-12-30	2021-01-1 3	5.61	38,800	217,668 .00
2020 1230 0000 7493	603379	三美股份	2020-12-30	2021-01-1 3	19.10	10,000	191,000 .00
2020 1230 0000 7495	603515	欧普照明	2020-12-30	2021-01-1 3	30.21	10,000	302,100 .00
2020 1230 0000 7497	000008	神州高铁	2020-12-30	2021-01-1 3	2.54	105,200	267,208 .00
2020 1230 0000 7499	603377	东方时尚	2020-12-30	2021-01-1 3	19.36	12,600	243,936 .00
2020 1230 0000	603338	浙江鼎力	2020-12-30	2021-01-1 3	101.19	10,400	1,052,3 76.00

7501							
2020 1230 0000 7503	603345	安井食品	2020-12-30	2021-01-1 3	192.87	10,000	1,928,7 00.00
2020 1230 0000 7505	603355	莱克电气	2020-12-30	2021-01-1 3	30.23	10,000	302,300 .00
2020 1230 0000 7507	000028	国药一致	2020-12-30	2021-01-1 3	45.80	10,000	458,000 .00
2020 1230 0000 7509	000031	大悦城	2020-12-30	2021-01-1 3	4.40	69,600	306,240 .00
2020 1230 0000 7511	000039	中集集团	2020-12-30	2021-01-1 3	14.99	57,600	863,424 .00
2020 1230 0000 7513	000027	深圳能源	2020-12-30	2021-01-1 3	6.09	77,000	468,930 .00
2020 1230 0000 7515	000009	中国宝安	2020-12-30	2021-01-1 3	7.53	139,500	1,050,4 35.00
2020 1230 0000 7517	000012	南 玻 A	2020-12-30	2021-01-1 3	7.38	74,100	546,858 .00
2020 1230 0000 7519	000021	深科技	2020-12-30	2021-01-1 3	19.01	47,700	906,777 .00
2020 1230 0000 7521	601969	海南矿业	2020-12-30	2021-01-1 3	5.98	21,200	126,776 .00
2020 1230 0000 7523	601975	招商南油	2020-12-30	2021-01-1 3	2.51	186,600	468,366 .00

2020 1230 0000 7525	601992	金隅集团	2020-12-30	2021-01-1 3	2.97	225,700	670,329 .00
2020 1230 0000 7527	601880	大连港	2020-12-30	2021-01-1 3	1.93	167,800	323,854 .00
2020 1230 0000 7529	601966	玲珑轮胎	2020-12-30	2021-01-1 3	35.17	37,100	1,304,8 07.00
2020 1230 0000 7531	601928	凤凰传媒	2020-12-30	2021-01-1 3	6.33	41,100	260,163 .00
2020 1230 0000 7533	601958	金铂股份	2020-12-30	2021-01-1 3	6.21	52,400	325,404 .00
2020 1230 0000 7535	603228	景旺电子	2020-12-30	2021-01-1 3	30.15	13,800	416,070 .00
2020 1230 0000 7537	603260	合盛硅业	2020-12-30	2021-01-1 3	33.44	10,000	334,400 .00
2020 1230 0000 7539	603328	依顿电子	2020-12-30	2021-01-1 3	7.95	21,500	170,925 .00
2020 1230 0000 7541	603198	迎驾贡酒	2020-12-30	2021-01-1 3	34.90	12,900	450,210 .00
2020 1230 0000 7543	601997	贵阳银行	2020-12-30	2021-01-1 3	7.95	139,000	1,105,0 50.00
2020 1230 0000 7545	603077	和邦生物	2020-12-30	2021-01-1 3	1.42	286,800	407,256 .00
2020	603000	人民网	2020-12-30	2021-01-1	16.90	29,900	505,310

1230 0000 7547				3			.00
2020 1230 0000 7549	000519	中兵红箭	2020-12-30	2021-01-1 3	10.02	37,500	375,750 .00
2020 1230 0000 7551	000528	柳工	2020-12-30	2021-01-1 3	7.36	55,900	411,424 .00
2020 1230 0000 7553	000513	丽珠集团	2020-12-30	2021-01-1 3	40.50	20,000	810,000 .00
2020 1230 0000 7555	000415	渤海租赁	2020-12-30	2021-01-1 3	2.40	133,700	320,880 .00
2020 1230 0000 7557	000537	广宇发展	2020-12-30	2021-01-1 3	6.27	30,200	189,354 .00
2020 1230 0000 7559	000488	晨鸣纸业	2020-12-30	2021-01-1 3	6.42	66,200	425,004 .00
2020 1230 0000 7561	000501	鄂武商 A	2020-12-30	2021-01-1 3	11.65	25,000	291,250 .00
2020 1230 0000 7563	000563	陕国投 A	2020-12-30	2021-01-1 3	3.77	107,300	404,521 .00
2020 1230 0000 7565	000581	威孚高科	2020-12-30	2021-01-1 3	23.19	27,100	628,449 .00
2020 1230 0000 7567	000598	兴蓉环境	2020-12-30	2021-01-1 3	4.80	96,500	463,200 .00
2020 1230	000559	万向钱潮	2020-12-30	2021-01-1 3	5.35	71,600	383,060 .00

0000 7569							
2020 1230 0000 7571	000540	中天金融	2020-12-30	2021-01-1 3	3.15	227,300	715,995 .00
2020 1230 0000 7573	000543	皖能电力	2020-12-30	2021-01-1 3	4.18	60,900	254,562 .00
2020 1230 0000 7575	000547	航天发展	2020-12-30	2021-01-1 3	27.50	69,300	1,905,7 50.00
2020 1230 0000 7577	000062	深圳华强	2020-12-30	2021-01-1 3	12.44	16,900	210,236 .00
2020 1230 0000 7579	000078	海王生物	2020-12-30	2021-01-1 3	4.01	89,000	356,890 .00
2020 1230 0000 7581	000089	深圳机场	2020-12-30	2021-01-1 3	8.17	55,400	452,618 .00
2020 1230 0000 7583	000061	农 产 品	2020-12-30	2021-01-1 3	7.05	36,700	258,735 .00
2020 1230 0000 7585	000046	泛海控股	2020-12-30	2021-01-1 3	3.28	84,500	277,160 .00
2020 1230 0000 7587	000050	深天马 A	2020-12-30	2021-01-1 3	14.74	53,200	784,168 .00
2020 1230 0000 7589	000060	中金岭南	2020-12-30	2021-01-1 3	4.82	134,800	649,736 .00
2020 1230 0000	000400	许继电气	2020-12-30	2021-01-1 3	14.46	32,600	471,396 .00

7591							
2020 1230 0000 7593	000401	冀东水泥	2020-12-30	2021-01-1 3	14.15	50,900	720,235 .00
2020 1230 0000 7595	000402	金融街	2020-12-30	2021-01-1 3	6.45	64,500	416,025 .00
2020 1230 0000 7597	000301	东方盛虹	2020-12-30	2021-01-1 3	9.48	52,100	493,908 .00
2020 1230 0000 7599	000090	天健集团	2020-12-30	2021-01-1 3	5.94	70,900	421,146 .00
2020 1230 0000 7601	000156	华数传媒	2020-12-30	2021-01-1 3	8.56	30,900	264,504 .00
2020 1230 0000 7603	000158	常山北明	2020-12-30	2021-01-1 3	6.20	51,600	319,920 .00
2020 1230 0000 7605	600500	中化国际	2020-12-30	2021-01-1 3	5.27	74,800	394,196 .00
2020 1230 0000 7607	002589	瑞康医药	2020-12-30	2021-01-1 3	5.23	57,000	298,110 .00
2020 1230 0000 7609	002595	豪迈科技	2020-12-30	2021-01-1 3	29.65	21,500	637,475 .00
2020 1230 0000 7611	002603	以岭药业	2020-12-30	2021-01-1 3	25.50	32,400	826,200 .00
2020 1230 0000 7613	002583	海能达	2020-12-30	2021-01-1 3	6.14	49,600	304,544 .00

2020 1230 0000 7615	002563	森马服饰	2020-12-30	2021-01-1 3	10.02	43,600	436,872 .00
2020 1230 0000 7617	002568	百润股份	2020-12-30	2021-01-1 3	104.29	14,400	1,501,7 76.00
2020 1230 0000 7619	002572	索菲亚	2020-12-30	2021-01-1 3	25.90	34,500	893,550 .00
2020 1230 0000 7621	002670	国盛金控	2020-12-30	2021-01-1 3	13.75	62,700	862,125 .00
2020 1230 0000 7623	002683	宏大爆破	2020-12-30	2021-01-1 3	35.95	28,300	1,017,3 85.00
2020 1230 0000 7625	002690	美亚光电	2020-12-30	2021-01-1 3	44.28	14,600	646,488 .00
2020 1230 0000 7627	002653	海思科	2020-12-30	2021-01-1 3	17.52	10,000	175,200 .00
2020 1230 0000 7629	002635	安洁科技	2020-12-30	2021-01-1 3	17.23	17,100	294,633 .00
2020 1230 0000 7655	002390	信邦制药	2020-12-30	2021-01-1 3	8.48	62,900	533,392 .00
2020 1230 0000 7657	002396	星网锐捷	2020-12-30	2021-01-1 3	23.06	25,200	581,112 .00
2020 1230 0000 7659	002399	海普瑞	2020-12-30	2021-01-1 3	17.22	20,200	347,844 .00
2020	002266	浙富控股	2020-12-30	2021-01-1	4.50	87,100	391,950

1230 0000 7661				3			.00
2020 1230 0000 7663	002268	卫士通	2020-12-30	2021-01-1 3	16.70	31,700	529,390 .00
2020 1230 0000 7665	002273	水晶光电	2020-12-30	2021-01-1 3	11.59	65,800	762,622 .00
2020 1230 0000 7667	002250	联化科技	2020-12-30	2021-01-1 3	23.99	39,900	957,201 .00
2020 1230 0000 7669	002242	九阳股份	2020-12-30	2021-01-1 3	32.04	16,500	528,660 .00
2020 1230 0000 7671	002244	滨江集团	2020-12-30	2021-01-1 3	4.59	83,800	384,642 .00
2020 1230 0000 7673	002249	大洋电机	2020-12-30	2021-01-1 3	4.50	76,400	343,800 .00
2020 1230 0000 7675	002317	众生药业	2020-12-30	2021-01-1 3	11.02	35,200	387,904 .00
2020 1230 0000 7677	002340	格林美	2020-12-30	2021-01-1 3	6.99	206,500	1,443,4 35.00
2020 1230 0000 7679	002353	杰瑞股份	2020-12-30	2021-01-1 3	35.00	31,000	1,085,0 00.00
2020 1230 0000 7681	002302	西部建设	2020-12-30	2021-01-1 3	8.78	27,300	239,694 .00
2020 1230	002281	光迅科技	2020-12-30	2021-01-1 3	29.04	22,600	656,304 .00

0000 7683							
2020 1230 0000 7685	002294	信立泰	2020-12-30	2021-01-1 3	28.33	22,600	640,258 .00
2020 1230 0000 7687	002299	圣农发展	2020-12-30	2021-01-1 3	26.54	33,600	891,744 .00
2020 1230 0000 7689	600216	浙江医药	2020-12-30	2021-01-1 3	13.60	36,400	495,040 .00
2020 1230 0000 7691	600219	南山铝业	2020-12-30	2021-01-1 3	3.16	387,600	1,224,8 16.00
2020 1230 0000 7693	600256	广汇能源	2020-12-30	2021-01-1 3	2.83	219,000	619,770 .00
2020 1230 0000 7695	600201	生物股份	2020-12-30	2021-01-1 3	20.89	60,700	1,268,0 23.00
2020 1230 0000 7697	600171	上海贝岭	2020-12-30	2021-01-1 3	14.02	30,500	427,610 .00
2020 1230 0000 7699	600188	兖州煤业	2020-12-30	2021-01-1 3	10.07	47,900	482,353 .00
2020 1230 0000 7701	600195	中牧股份	2020-12-30	2021-01-1 3	12.81	33,000	422,730 .00
2020 1230 0000 7703	600273	嘉化能源	2020-12-30	2021-01-1 3	9.24	54,200	500,808 .00
2020 1230 0000	600277	亿利洁能	2020-12-30	2021-01-1 3	2.99	73,500	219,765 .00

7705							
2020 1230 0000 7707	600282	南钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	3.12	166,100	518,232 .00
2020 1230 0000 7709	600266	城建发展	2020-12-30	2021-01-1 3	5.08	72,900	370,332 .00
2020 1230 0000 7711	600258	首旅酒店	2020-12-30	2021-01-1 3	21.22	26,700	566,574 .00
2020 1230 0000 7713	600259	广晟有色	2020-12-30	2021-01-1 3	30.17	10,000	301,700 .00
2020 1230 0000 7715	600260	凯乐科技	2020-12-30	2021-01-1 3	10.90	54,000	588,600 .00
2020 1230 0000 7717	600132	重庆啤酒	2020-12-30	2021-01-1 3	118.99	13,000	1,546,8 70.00
2020 1230 0000 7719	600141	兴发集团	2020-12-30	2021-01-1 3	11.03	30,200	333,106 .00
2020 1230 0000 7721	600143	金发科技	2020-12-30	2021-01-1 3	17.14	97,300	1,667,7 22.00
2020 1230 0000 7723	600131	国网信通	2020-12-30	2021-01-1 3	14.23	19,400	276,062 .00
2020 1230 0000 7725	600094	大名城	2020-12-30	2021-01-1 3	4.02	86,300	346,926 .00
2020 1230 0000 7727	600120	浙江东方	2020-12-30	2021-01-1 3	5.97	72,400	432,228 .00

2020 1230 0000 7729	600126	杭钢股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.29	73,100	386,699 .00
2020 1230 0000 7731	600166	福田汽车	2020-12-30	2021-01-1 3	3.15	248,300	782,145 .00
2020 1230 0000 7825	002640	跨境通	2020-12-30	2021-01-1 3	5.14	67,300	345,922 .00
2020 1230 0000 7827	002648	卫星石化	2020-12-30	2021-01-1 3	26.12	26,400	689,568 .00
2020 1230 0000 7829	002465	海格通信	2020-12-30	2021-01-1 3	10.83	99,700	1,079,7 51.00
2020 1230 0000 7831	002468	申通快递	2020-12-30	2021-01-1 3	10.08	33,100	333,648 .00
2020 1230 0000 7833	002500	山西证券	2020-12-30	2021-01-1 3	8.95	116,200	1,039,9 90.00
2020 1230 0000 7835	002458	益生股份	2020-12-30	2021-01-1 3	11.15	32,200	359,030 .00
2020 1230 0000 7837	002434	万里扬	2020-12-30	2021-01-1 3	8.92	36,200	322,904 .00
2020 1230 0000 7839	002440	闰土股份	2020-12-30	2021-01-1 3	9.32	37,300	347,636 .00
2020 1230 0000 7841	002444	巨星科技	2020-12-30	2021-01-1 3	31.11	28,900	899,079 .00
2020	002511	中顺洁柔	2020-12-30	2021-01-1	20.87	35,400	738,798

1230 0000 7843				3			.00
2020 1230 0000 7845	002544	杰赛科技	2020-12-30	2021-01-1 3	16.78	18,600	312,108 .00
2020 1230 0000 7847	002557	洽洽食品	2020-12-30	2021-01-1 3	53.85	16,400	883,140 .00
2020 1230 0000 7849	002507	涪陵榨菜	2020-12-30	2021-01-1 3	42.30	29,800	1,260,5 40.00
2020 1230 0000 7851	002503	搜于特	2020-12-30	2021-01-1 3	2.24	100,000	224,000 .00
2020 1230 0000 7853	002505	鹏都农牧	2020-12-30	2021-01-1 3	2.53	137,400	347,622 .00
2020 1230 0000 7855	002506	协鑫集成	2020-12-30	2021-01-1 3	4.25	164,600	699,550 .00
2020 1230 0000 7857	603888	新华网	2020-12-30	2021-01-1 3	19.00	11,100	210,900 .00
2020 1230 0000 7859	603885	吉祥航空	2020-12-30	2021-01-1 3	11.37	31,900	362,703 .00
2020 1230 0000 7861	603866	桃李面包	2020-12-30	2021-01-1 3	59.10	14,600	862,860 .00
2020 1230 0000 7863	603883	老百姓	2020-12-30	2021-01-1 3	62.83	11,000	691,130 .00
2020 1230	603882	金城医学	2020-12-30	2021-01-1 3	128.12	14,800	1,896,1 76.00

0000 7865							
2020 1230 0000 7867	002925	盈趣科技	2020-12-30	2021-01-1 3	64.33	10,000	643,300 .00
2020 1230 0000 7869	002926	华西证券	2020-12-30	2021-01-1 3	12.48	70,800	883,584 .00
2020 1230 0000 7871	002839	张家港行	2020-12-30	2021-01-1 3	6.10	68,500	417,850 .00
2020 1230 0000 7873	002797	第一创业	2020-12-30	2021-01-1 3	9.95	158,800	1,580,0 60.00
2020 1230 0000 7875	603568	伟明环保	2020-12-30	2021-01-1 3	18.93	20,300	384,279 .00
2020 1230 0000 7877	603589	口子窖	2020-12-30	2021-01-1 3	68.90	19,400	1,336,6 60.00
2020 1230 0000 7879	002745	木林森	2020-12-30	2021-01-1 3	14.59	40,000	583,600 .00
2020 1230 0000 7881	002705	新宝股份	2020-12-30	2021-01-1 3	42.25	17,200	726,700 .00
2020 1230 0000 7883	002701	奥瑞金	2020-12-30	2021-01-1 3	4.94	91,300	451,022 .00
2020 1230 0000 7885	002709	天赐材料	2020-12-30	2021-01-1 3	103.80	17,700	1,837,2 60.00
2020 1230 0000	603806	福斯特	2020-12-30	2021-01-1 3	85.40	16,600	1,417,6 40.00

7887							
2020 1230 0000 7889	603816	顾家家居	2020-12-30	2021-01-1 3	70.51	17,000	1,198,6 70.00
2020 1230 0000 7891	603858	步长制药	2020-12-30	2021-01-1 3	23.07	30,800	710,556 .00
2020 1230 0000 7893	603737	三棵树	2020-12-30	2021-01-1 3	151.50	10,000	1,515,0 00.00
2020 1230 0000 7895	603638	艾迪精密	2020-12-30	2021-01-1 3	68.94	10,000	689,400 .00
2020 1230 0000 7897	603708	家家悦	2020-12-30	2021-01-1 3	21.30	13,100	279,030 .00
2020 1230 0000 7899	603712	七一二	2020-12-30	2021-01-1 3	41.65	12,500	520,625 .00
2020 1230 0000 7901	002429	兆驰股份	2020-12-30	2021-01-1 3	6.20	97,900	606,980 .00
2020 1230 0000 8105	600167	联美控股	2020-12-30	2021-01-1 3	11.35	49,400	560,690 .00
2020 1230 0000 8107	600170	上海建工	2020-12-30	2021-01-1 3	3.01	240,500	723,905 .00
2020 1230 0000 8109	600160	巨化股份	2020-12-30	2021-01-1 3	8.11	73,100	592,841 .00
2020 1230 0000 8111	600153	建发股份	2020-12-30	2021-01-1 3	8.21	92,900	762,709 .00

2020 1230 0000 8113	600155	华创阳安	2020-12-30	2021-01-1 3	13.19	65,800	867,902 .00
2020 1230 0000 8115	600158	中体产业	2020-12-30	2021-01-1 3	12.26	36,200	443,812 .00
2020 1230 0000 8117	600410	华胜天成	2020-12-30	2021-01-1 3	8.86	59,400	526,284 .00
2020 1230 0000 8119	600415	小商品城	2020-12-30	2021-01-1 3	5.51	147,200	811,072 .00
2020 1230 0000 8121	600418	江淮汽车	2020-12-30	2021-01-1 3	12.23	71,600	875,668 .00
2020 1230 0000 8123	600409	三友化工	2020-12-30	2021-01-1 3	10.25	66,900	685,725 .00
2020 1230 0000 8125	600388	龙净环保	2020-12-30	2021-01-1 3	8.88	40,400	358,752 .00
2020 1230 0000 8127	600392	盛和资源	2020-12-30	2021-01-1 3	8.89	75,700	672,973 .00
2020 1230 0000 8129	600398	海澜之家	2020-12-30	2021-01-1 3	6.42	70,000	449,400 .00
2020 1230 0000 8131	600466	蓝光发展	2020-12-30	2021-01-1 3	4.63	81,700	378,271 .00
2020 1230 0000 8133	600486	扬农化工	2020-12-30	2021-01-1 3	132.00	10,000	1,320,0 00.00
2020	600497	驰宏锌锗	2020-12-30	2021-01-1	4.80	137,700	660,960

1230 0000 8135				3			.00
2020 1230 0000 8137	600460	士兰微	2020-12-30	2021-01-1 3	25.00	42,500	1,062,5 00.00
2020 1230 0000 8139	600426	华鲁恒升	2020-12-30	2021-01-1 3	37.30	61,500	2,293,9 50.00
2020 1230 0000 8141	600435	北方导航	2020-12-30	2021-01-1 3	9.00	56,200	505,800 .00
2020 1230 0000 8143	600446	金证股份	2020-12-30	2021-01-1 3	16.21	32,500	526,825 .00
2020 1230 0000 8145	600316	洪都航空	2020-12-30	2021-01-1 3	56.87	23,200	1,319,3 84.00
2020 1230 0000 8147	600325	华发股份	2020-12-30	2021-01-1 3	6.21	91,400	567,594 .00
2020 1230 0000 8149	600329	中新药业	2020-12-30	2021-01-1 3	17.52	15,500	271,560 .00
2020 1230 0000 8151	600315	上海家化	2020-12-30	2021-01-1 3	34.73	18,200	632,086 .00
2020 1230 0000 8153	600291	西水股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.67	35,300	200,151 .00
2020 1230 0000 8155	600307	酒钢宏兴	2020-12-30	2021-01-1 3	1.65	168,500	278,025 .00
2020 1230	600312	平高电气	2020-12-30	2021-01-1 3	7.14	44,000	314,160 .00

0000 8157							
2020 1230 0000 8159	600373	中文传媒	2020-12-30	2021-01-1 3	10.09	36,600	369,294 .00
2020 1230 0000 8161	600376	首开股份	2020-12-30	2021-01-1 3	5.87	69,400	407,378 .00
2020 1230 0000 8163	600372	中航电子	2020-12-30	2021-01-1 3	19.65	41,600	817,440 .00
2020 1230 0000 8165	600380	健康元	2020-12-30	2021-01-1 3	13.91	63,200	879,112 .00
2020 1230 0000 8167	600339	中油工程	2020-12-30	2021-01-1 3	3.08	90,300	278,124 .00
2020 1230 0000 8169	600348	阳泉煤业	2020-12-30	2021-01-1 3	5.61	65,000	364,650 .00
2020 1230 0000 8171	600350	山东高速	2020-12-30	2021-01-1 3	6.18	33,600	207,648 .00
2020 1230 0000 8173	600089	特变电工	2020-12-30	2021-01-1 3	10.15	200,800	2,038,1 20.00
2020 1230 0000 8175	600037	歌华有线	2020-12-30	2021-01-1 3	9.20	52,700	484,840 .00
2020 1230 0000 8177	600038	中直股份	2020-12-30	2021-01-1 3	62.71	15,900	997,089 .00
2020 1230 0000	600039	四川路桥	2020-12-30	2021-01-1 3	4.51	103,200	465,432 .00

8179							
2020 1230 0000 8181	600026	中远海能	2020-12-30	2021-01-1 3	6.68	74,700	498,996 .00
2020 1230 0000 8183	600008	首创股份	2020-12-30	2021-01-1 3	2.83	238,100	673,823 .00
2020 1230 0000 8185	600021	上海电力	2020-12-30	2021-01-1 3	7.12	56,600	402,992 .00
2020 1230 0000 8187	600022	山东钢铁	2020-12-30	2021-01-1 3	1.43	295,600	422,708 .00
2020 1230 0000 8189	600064	南京高科	2020-12-30	2021-01-1 3	10.27	46,800	480,636 .00
2020 1230 0000 8191	600073	上海梅林	2020-12-30	2021-01-1 3	10.29	35,300	363,237 .00
2020 1230 0000 8193	600079	人福医药	2020-12-30	2021-01-1 3	33.88	58,400	1,978,5 92.00
2020 1230 0000 8195	600062	华润双鹤	2020-12-30	2021-01-1 3	11.99	28,200	338,118 .00
2020 1230 0000 8197	600056	中国医药	2020-12-30	2021-01-1 3	14.33	28,800	412,704 .00
2020 1230 0000 8199	600053	九鼎投资	2020-12-30	2021-01-1 3	19.55	10,000	195,500 .00
2020 1230 0000 8201	600060	海信视像	2020-12-30	2021-01-1 3	11.48	42,500	487,900 .00

2020 1230 0000 8203	600006	东风汽车	2020-12-30	2021-01-1 3	9.44	43,000	405,920 .00
2020 1230 0000 8731	300285	国瓷材料	2020-12-30	2021-01-1 3	45.11	41,600	1,876,5 76.00
2020 1230 0000 8733	300296	利亚德	2020-12-30	2021-01-1 3	6.36	96,200	611,832 .00
2020 1230 0000 8735	300271	华宇软件	2020-12-30	2021-01-1 3	23.87	35,200	840,224 .00
2020 1230 0000 8737	300223	北京君正	2020-12-30	2021-01-1 3	91.49	10,100	924,049 .00
2020 1230 0000 8739	300244	迪安诊断	2020-12-30	2021-01-1 3	34.28	23,400	802,152 .00
2020 1230 0000 8741	300257	开山股份	2020-12-30	2021-01-1 3	13.65	18,500	252,525 .00
2020 1230 0000 8743	300024	机器人	2020-12-30	2021-01-1 3	12.30	67,500	830,250 .00
2020 1230 0000 8745	300026	红日药业	2020-12-30	2021-01-1 3	4.58	97,400	446,092 .00
2020 1230 0000 8747	300058	蓝色光标	2020-12-30	2021-01-1 3	6.00	107,600	645,600 .00
2020 1230 0000 8749	300017	网宿科技	2020-12-30	2021-01-1 3	6.89	106,000	730,340 .00
2020	300009	安科生物	2020-12-30	2021-01-1	14.68	51,600	757,488

1230 0000 8751				3			.00
2020 1230 0000 8753	300010	豆神教育	2020-12-30	2021-01-1 3	9.76	37,600	366,976 .00
2020 1230 0000 8755	300012	华测检测	2020-12-30	2021-01-1 3	27.37	89,800	2,457,8 26.00
2020 1230 0000 8757	300115	长盈精密	2020-12-30	2021-01-1 3	24.65	32,400	798,660 .00
2020 1230 0000 8759	300133	华策影视	2020-12-30	2021-01-1 3	6.18	66,200	409,116 .00
2020 1230 0000 8761	300134	大富科技	2020-12-30	2021-01-1 3	10.33	20,800	214,864 .00
2020 1230 0000 8763	300113	顺网科技	2020-12-30	2021-01-1 3	17.15	22,400	384,160 .00
2020 1230 0000 8765	300070	碧水源	2020-12-30	2021-01-1 3	7.65	119,800	916,470 .00
2020 1230 0000 8767	300072	三聚环保	2020-12-30	2021-01-1 3	5.68	76,000	431,680 .00
2020 1230 0000 8769	300088	长信科技	2020-12-30	2021-01-1 3	8.89	132,100	1,174,3 69.00
2020 1230 0000 8771	300418	昆仑万维	2020-12-30	2021-01-1 3	19.95	44,400	885,780 .00
2020 1230	300463	迈克生物	2020-12-30	2021-01-1 3	46.60	21,000	978,600 .00

0000 8773							
2020 1230 0000 8775	300474	景嘉微	2020-12-30	2021-01-1 3	69.91	8,100	566,271 .00
2020 1230 0000 8777	300357	我武生物	2020-12-30	2021-01-1 3	76.70	16,900	1,296,2 30.00
2020 1230 0000 8779	300315	掌趣科技	2020-12-30	2021-01-1 3	5.11	148,900	760,879 .00
2020 1230 0000 8781	300316	晶盛机电	2020-12-30	2021-01-1 3	30.08	34,700	1,043,7 76.00
2020 1230 0000 8783	300324	旋极信息	2020-12-30	2021-01-1 3	4.23	66,000	279,180 .00
2020 1230 0000 8785	300630	普利制药	2020-12-30	2021-01-1 3	41.89	14,100	590,649 .00
2020 1230 0000 8787	300699	光威复材	2020-12-30	2021-01-1 3	89.05	14,000	1,246,7 00.00
2020 1230 0000 8789	300618	寒锐钴业	2020-12-30	2021-01-1 3	94.91	8,200	778,262 .00
2020 1230 0000 8791	300482	万孚生物	2020-12-30	2021-01-1 3	89.21	11,000	981,310 .00
2020 1230 0000 8793	300496	中科创达	2020-12-30	2021-01-1 3	117.00	16,000	1,872,0 00.00
2020 1230 0000	300595	欧普康视	2020-12-30	2021-01-1 3	81.92	16,400	1,343,4 88.00

8795							
2020 1230 0000 9215	688002	睿创微纳	2020-12-30	2021-01-1 3	111.00	12,000	1,332,0 00.00
2020 1230 0000 9217	688029	南微医学	2020-12-30	2021-01-1 3	184.01	2,100	386,421 .00
2020 1230 0000 9219	300001	特锐德	2020-12-30	2021-01-1 3	29.36	32,300	948,328 .00
2020 1230 0000 9221	688088	虹软科技	2020-12-30	2021-01-1 3	69.92	10,900	762,128 .00
2020 1230 0000 9223	688099	晶晨股份	2020-12-30	2021-01-1 3	78.73	11,100	873,903 .00
2020 1230 0000 9225	688321	微芯生物	2020-12-30	2021-01-1 3	37.01	11,000	407,110 .00
2020 1230 0000 9227	300002	神州泰岳	2020-12-30	2021-01-1 3	5.11	106,200	542,682 .00
2020 1230 0000 9229	300207	欣旺达	2020-12-30	2021-01-1 3	30.71	59,600	1,830,3 16.00
2020 1230 0000 9231	300212	易华录	2020-12-30	2021-01-1 3	30.65	21,000	643,650 .00
2020 1230 0000 9233	300180	华峰超纤	2020-12-30	2021-01-1 3	5.91	66,700	394,197 .00
2020 1230 0000 9235	300146	汤臣倍健	2020-12-30	2021-01-1 3	24.15	42,700	1,031,2 05.00

2020 1230 0000 9237	300166	东方国信	2020-12-30	2021-01-1 3	10.95	45,500	498,225 .00
2020 1230 0000 9239	300168	万达信息	2020-12-30	2021-01-1 3	21.69	44,900	973,881 .00
2020 1230 0000 9241	300274	阳光电源	2020-12-30	2021-01-1 3	72.28	55,100	3,982,6 28.00
2020 1230 0000 7401	000826	启迪环境	2020-12-30	2021-01-1 3	6.76	46,500	314,340 .00
合计	-	-	-	-	-	71,307,2 00	684,473 ,957.00

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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，其长期平均风险和预期收益率高于混合型基金、债券型基金、及货币市场基金。本基金为指数型基金，被动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。基金投资的金融工具主要包括股票投资、债券投资及基金投资等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是进行被动式指数化投资，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人按照法律法规和中国证监会的规定，建立组织机构健全、职责划分清晰、制衡监督有效、激励约束合理的治理结构，建立健全内部控制机制和 risk 管理制度，坚持审慎经营理念，保护投资者利益和公司合法权益。

公司建立包括董事会、管理层、各部门及一线员工组成的四道风控防线，还有董事会风险控制与内审委员会、公司风险控制委员会、督察长及其合规管理部门、风险管理部门，评估各项风险并提出防控措施并有效执行。

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。

7.4.13.2 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。

基金的银行存款存放在托管人和其他拥有相关资质的银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。基金在交易所进行的交易均与授权的证券结算机构完成证券交收和款项清算或通过有资格的经纪商进行证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在场外交易市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.2.4 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
AAA	-	618,000.00
AAA 以下	87,200.00	5,585,000.00
未评级	-	-
合计	87,200.00	6,203,000.00

注：评级取自第三方评级机构。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。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。

于本报告期末，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同约定到期日均为一年以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 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相关法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金持有一家公司发行的证券，其市值不超过基金资产净值的 10%。本基金管理人管理的全部基金持有一家公司发行的证券，不超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

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，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。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。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2020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	18,218,332.37	-	-	-	18,218,332.37
结算备付金	22,036,574.87	-	-	-	22,036,574.87
存出保证金	687,912.44	-	-	10,252,032.00	10,939,944.44
交易性金融资产	-	-	87,200,003.64	3,601,461,953.64	3,601,549,153.64
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	54,000,000.00	-	-	-	54,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	112,011,486.57	112,011,486.57
应收利息	-	-	-	197,314.19	197,314.19
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	94,942,819.68	-	87,200,003.64	3,723,922,786.40	3,818,952,806.08
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	138,483,256.52	138,483,256.52
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	439,077.34	439,077.34

应付托管费	-	-	-	146,359.10	146,359.10
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,169,741.86	1,169,741.86
应付税费	-	-	-	412,923.24	412,923.24
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	439,088.96	439,088.96
负债总计	-	-	-	141,090,447.02	141,090,447.02
利率敏感度缺口	94,942,819.68	-	87,200.00	3,582,832,339.38	3,677,862,359.06
上年度末 2019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	29,099,903.38	-	-	-	29,099,903.38
结算备付金	27,395,359.46	-	-	-	27,395,359.46
存出保证金	160,487.20	-	-	19,676,947.20	19,837,434.40
交易性金融资产	-	-	6,203,000.00	3,314,041,436.57	3,320,244,436.57
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	109,000,000.00	-	-	-	109,000,000.00
应收证券清算款	-	-	-	9,880,164.95	9,880,164.95
应收利息	-	-	-	53,995.39	53,995.39
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	165,655,750.04	-	6,203,000.00	3,343,652,544.11	3,515,511,294.15
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	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	25,125,887.40	25,125,887.40
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	416,903.26	416,903.26
应付托管费	-	-	-	138,967.75	138,967.75
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付交易费用	-	-	-	1,460,029.90	1,460,029.90
应付税费	-	-	-	173,335.27	173,335.27
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	451,023.90	451,023.90
负债总计	-	-	-	27,766,147.48	27,766,147.48
利率敏感度缺口	165,655,750.04	-	6,203,000.00	3,315,886,396.63	3,487,745,146.67

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2020 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0%(2019 年 12 月 31 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.18%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

7.4.13.4.3 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。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、债券及基金，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。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020 年 12 月 31 日		上年度末 2019 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	3,601,461,953.64	97.92	3,314,041,436.57	95.02

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	3,601,461,953.64	97.92	3,314,041,436.57	95.02

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩基准以外的其他市场变量保持不变		
	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（2020年12月31日）	上年度末（2019年12月31日）
分析	业绩比较基准上升5%	182,815,340.60	174,247,463.96
	业绩比较基准下降5%	-182,815,340.60	-174,247,463.96

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于本报告期末，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 3,594,514,417.13 元，属于第二层次的余额为 7,034,736.51 元，无属于第三层次的余额（上年度末：第一层次 3,312,291,533.33 元，第二层次 7,952,903.24 元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 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，基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于本报告期末，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产或金融负债(上年度末：无)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	3,601,461,953.64	94.30
	其中：股票	3,601,461,953.64	94.30
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	87,200.00	0.00
	其中：债券	87,200.00	0.00
	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	54,000,000.00	1.41
	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	40,254,907.24	1.05
8	其他各项资产	123,148,745.20	3.22
9	合计	3,818,952,806.08	100.00

注：1. 股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值；2. 通过转融通证券出借业务出借的证券

公允价值为 684,473,957.00 元，占基金资产净值的比例为 18.61%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	40,419,680.53	1.10
B	采矿业	101,182,925.40	2.75
C	制造业	2,313,966,192.64	62.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	82,356,367.53	2.24
E	建筑业	50,902,011.36	1.38
F	批发和零售业	135,512,010.22	3.68
G	交通运输、仓储和邮政业	70,205,335.23	1.91
H	住宿和餐饮业	17,210,121.20	0.47
I	信息传输、软件和信息技术服务业	271,131,881.02	7.37
J	金融业	218,679,398.50	5.95
K	房地产业	105,990,162.95	2.88
L	租赁和商务服务业	35,844,485.02	0.97
M	科学研究和技术服务业	33,147,785.68	0.90
N	水利、环境和公共设施管理业	33,293,930.57	0.91
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,906,323.20	0.08
Q	卫生和社会工作	32,043,787.52	0.87
R	文化、体育和娱乐业	29,247,205.00	0.80
S	综合	24,546,474.21	0.67
	合计	3,598,586,077.78	97.84

8.2.2 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	2,297,704.92	0.06
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	16,322.72	0.00

G	交通运输、仓储和邮政业	19,998.88	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	524,505.55	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	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	15,081.10	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,873,613.17	0.08

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

8.3 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

8.3.1 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	300274	阳光电源	650,905	47,047,413.40	1.28
2	300012	华测检测	1,061,384	29,050,080.08	0.79
3	600426	华鲁恒升	726,531	27,099,606.30	0.74
4	002074	国轩高科	653,741	25,574,347.92	0.70
5	600089	特变电工	2,370,042	24,055,926.30	0.65
6	600079	人福医药	689,701	23,367,069.88	0.64
7	603882	金域医学	175,943	22,541,817.16	0.61
8	000547	航天发展	819,600	22,539,000.00	0.61
9	300285	国瓷材料	491,730	22,181,940.30	0.60
10	300496	中科创达	189,031	22,116,627.00	0.60
11	002709	天赐材料	209,037	21,698,040.60	0.59
12	300207	欣旺达	703,481	21,603,901.51	0.59
13	600143	金发科技	1,149,500	19,702,430.00	0.54
14	601233	桐昆股份	953,300	19,628,447.00	0.53
15	002185	华天科技	1,398,600	19,048,932.00	0.52

16	600739	辽宁成大	780,900	18,991,488.00	0.52
17	002797	第一创业	1,877,000	18,676,150.00	0.51
18	600132	重庆啤酒	154,413	18,373,602.87	0.50
19	002385	大北农	1,873,848	18,101,371.68	0.49
20	600885	宏发股份	332,564	18,031,620.08	0.49
21	002568	百润股份	171,000	17,833,590.00	0.48
22	601099	太平洋	4,349,300	17,745,144.00	0.48
23	601799	星宇股份	88,100	17,664,050.00	0.48
24	002340	格林美	2,415,106	16,881,590.94	0.46
25	603806	福斯特	196,339	16,767,350.60	0.46
26	300595	欧普康视	193,700	15,867,904.00	0.43
27	603589	口子窖	229,700	15,826,330.00	0.43
28	688002	睿创微纳	141,972	15,758,892.00	0.43
29	600486	扬农化工	118,622	15,658,104.00	0.43
30	600316	洪都航空	274,600	15,616,502.00	0.42
31	601966	玲珑轮胎	438,260	15,413,604.20	0.42
32	000636	风华高科	456,977	15,400,124.90	0.42
33	300357	我武生物	200,400	15,370,680.00	0.42
34	002625	光启技术	687,440	15,295,540.00	0.42
35	600529	山东药玻	303,785	15,234,817.75	0.41
36	601168	西部矿业	1,216,442	15,059,551.96	0.41
37	600201	生物股份	718,561	15,010,739.29	0.41
38	002507	涪陵榨菜	352,536	14,912,272.80	0.41
39	300699	光威复材	165,400	14,728,870.00	0.40
40	603345	安井食品	75,500	14,561,685.00	0.40
41	600219	南山铝业	4,575,280	14,457,884.80	0.39
42	002078	太阳纸业	996,307	14,376,710.01	0.39
43	000750	国海证券	2,431,791	14,250,295.26	0.39
44	603816	顾家家居	201,690	14,221,161.90	0.39
45	002013	中航机电	1,235,936	14,151,467.20	0.38
46	300088	长信科技	1,561,700	13,883,513.00	0.38
47	002030	达安基因	391,819	13,439,391.70	0.37
48	600862	中航高科	444,500	13,379,450.00	0.36
49	600699	均胜电子	523,840	13,284,582.40	0.36
50	600884	杉杉股份	727,144	13,110,406.32	0.36
51	002131	利欧股份	4,310,079	13,059,539.37	0.36
52	601997	贵阳银行	1,642,600	13,058,670.00	0.36
53	601128	常熟银行	1,748,793	12,906,092.34	0.35
54	002353	杰瑞股份	366,649	12,832,715.00	0.35
55	603486	科沃斯	144,126	12,753,709.74	0.35
56	002465	海格通信	1,176,400	12,740,412.00	0.35
57	002212	天融信	598,113	12,566,354.13	0.34

58	600460	士兰微	502,303	12,557,575.00	0.34
59	603338	浙江鼎力	123,840	12,531,369.60	0.34
60	000009	中国宝安	1,645,663	12,391,842.39	0.34
61	002075	沙钢股份	1,126,400	12,356,608.00	0.34
62	300316	晶盛机电	410,248	12,340,259.84	0.34
63	002500	山西证券	1,363,154	12,200,228.30	0.33
64	300146	汤臣倍健	504,321	12,179,352.15	0.33
65	600867	通化东宝	908,500	12,155,730.00	0.33
66	000630	铜陵有色	4,701,800	12,083,626.00	0.33
67	002683	宏大爆破	335,000	12,043,250.00	0.33
68	000988	华工科技	513,214	11,901,432.66	0.32
69	600511	国药股份	240,309	11,849,636.79	0.32
70	002791	坚朗五金	82,000	11,808,000.00	0.32
71	600038	中直股份	188,161	11,799,576.31	0.32
72	603444	吉比特	27,579	11,748,654.00	0.32
73	300482	万孚生物	131,285	11,711,934.85	0.32
74	000998	隆平高科	588,194	11,652,123.14	0.32
75	600733	北汽蓝谷	1,339,000	11,609,130.00	0.32
76	300463	迈克生物	248,814	11,594,732.40	0.32
77	300168	万达信息	530,527	11,507,130.63	0.31
78	002250	联化科技	471,260	11,305,527.40	0.31
79	300001	特锐德	381,892	11,212,349.12	0.30
80	600909	华安证券	1,386,200	11,089,600.00	0.30
81	300223	北京君正	119,600	10,942,204.00	0.30
82	002223	鱼跃医疗	383,729	10,824,995.09	0.29
83	300070	碧水源	1,413,400	10,812,510.00	0.29
84	000021	深科技	563,356	10,709,397.56	0.29
85	002156	通富微电	424,023	10,702,340.52	0.29
86	002444	巨星科技	343,030	10,671,663.30	0.29
87	002572	索菲亚	407,579	10,556,296.10	0.29
88	002299	圣农发展	396,951	10,535,079.54	0.29
89	600754	锦江酒店	204,200	10,522,426.00	0.29
90	002926	华西证券	837,500	10,452,000.00	0.28
91	002557	洽洽食品	194,030	10,448,515.50	0.28
92	300418	昆仑万维	523,599	10,445,800.05	0.28
93	603737	三棵树	68,641	10,399,111.50	0.28
94	600380	健康元	746,823	10,388,307.93	0.28
95	600879	航天电子	1,387,984	10,382,120.32	0.28
96	002080	中材科技	428,400	10,358,712.00	0.28
97	601689	拓普集团	269,265	10,347,853.95	0.28
98	600779	水井坊	124,400	10,327,688.00	0.28
99	600418	江淮汽车	844,186	10,324,394.78	0.28

100	688099	晶晨股份	131,120	10,323,077.60	0.28
101	600516	方大炭素	1,457,100	10,301,697.00	0.28
102	603866	桃李面包	173,613	10,260,528.30	0.28
103	600155	华创阳安	777,000	10,248,630.00	0.28
104	000039	中集集团	681,681	10,218,398.19	0.28
105	002670	国盛金控	734,988	10,106,085.00	0.27
106	002138	顺络电子	411,600	10,092,432.00	0.27
107	300271	华宇软件	416,500	9,941,855.00	0.27
108	300024	机器人	796,500	9,796,950.00	0.27
109	002603	以岭药业	383,975	9,791,362.50	0.27
110	000623	吉林敖东	593,651	9,777,431.97	0.27
111	600372	中航电子	492,080	9,669,372.00	0.26
112	002081	金螳螂	1,027,300	9,646,347.00	0.26
113	002373	千方科技	504,372	9,643,592.64	0.26
114	000513	丽珠集团	236,653	9,584,446.50	0.26
115	600415	小商品城	1,736,500	9,568,115.00	0.26
116	300244	迪安诊断	277,187	9,501,970.36	0.26
117	300115	长盈精密	383,120	9,443,908.00	0.26
118	000878	云南铜业	650,800	9,417,076.00	0.26
119	600563	法拉电子	86,070	9,256,828.50	0.25
120	600166	福田汽车	2,936,800	9,250,920.00	0.25
121	000050	深天马A	627,205	9,245,001.70	0.25
122	300618	寒锐钴业	96,540	9,162,611.40	0.25
123	000975	银泰黄金	1,063,084	9,153,153.24	0.25
124	601615	明阳智能	478,400	9,080,032.00	0.25
125	600549	厦门钨业	538,380	9,071,703.00	0.25
126	688088	虹软科技	129,529	9,056,667.68	0.25
127	002273	水晶光电	777,068	9,006,218.12	0.24
128	600153	建发股份	1,096,300	9,000,623.00	0.24
129	600765	中航重机	360,007	9,000,175.00	0.24
130	300315	掌趣科技	1,759,459	8,990,835.49	0.24
131	600801	华新水泥	434,525	8,964,250.75	0.24
132	300009	安科生物	609,833	8,952,348.44	0.24
133	002064	华峰化学	886,880	8,948,619.20	0.24
134	002019	亿帆医药	472,600	8,946,318.00	0.24
135	600667	太极实业	940,800	8,890,560.00	0.24
136	002920	德赛西威	105,200	8,851,528.00	0.24
137	000686	东北证券	895,940	8,798,130.80	0.24
138	000739	普洛药业	375,902	8,750,998.56	0.24
139	600598	北大荒	453,700	8,733,725.00	0.24
140	002511	中顺洁柔	418,400	8,732,008.00	0.24
141	002705	新宝股份	204,500	8,640,125.00	0.23

142	300017	网宿科技	1,252,100	8,626,969.00	0.23
143	002831	裕同科技	279,903	8,570,629.86	0.23
144	600535	天士力	579,200	8,566,368.00	0.23
145	002124	天邦股份	586,700	8,565,820.00	0.23
146	600170	上海建工	2,840,900	8,551,109.00	0.23
147	000401	冀东水泥	601,800	8,515,470.00	0.23
148	000540	中天金融	2,681,900	8,447,985.00	0.23
149	600895	张江高科	493,200	8,404,128.00	0.23
150	603858	步长制药	364,185	8,401,747.95	0.23
151	000738	航发控制	365,500	8,380,915.00	0.23
152	000830	鲁西化工	654,383	8,363,014.74	0.23
153	002506	协鑫集成	1,945,600	8,268,800.00	0.22
154	002195	二三四五	3,652,908	8,255,572.08	0.22
155	002152	广电运通	768,500	8,207,580.00	0.22
156	603883	老百姓	130,497	8,199,126.51	0.22
157	600642	申能股份	1,567,200	8,180,784.00	0.22
158	002648	卫星石化	312,800	8,170,336.00	0.22
159	002966	苏州银行	1,063,484	8,167,557.12	0.22
160	000690	宝新能源	1,110,661	8,107,825.30	0.22
161	600409	三友化工	790,356	8,101,149.00	0.22
162	600859	王府井	247,576	8,066,026.08	0.22
163	002056	横店东磁	524,400	7,965,636.00	0.22
164	600392	盛和资源	895,870	7,964,284.30	0.22
165	600008	首创股份	2,810,230	7,952,950.90	0.22
166	601992	金隅集团	2,660,400	7,901,388.00	0.21
167	601456	国联证券	370,400	7,900,632.00	0.21
168	603638	艾迪精密	114,600	7,900,524.00	0.21
169	600580	卧龙电驱	500,719	7,811,216.40	0.21
170	600497	驰宏锌锗	1,624,300	7,796,640.00	0.21
171	002028	思源电气	388,085	7,784,985.10	0.21
172	002382	蓝帆医疗	369,000	7,782,210.00	0.21
173	002281	光迅科技	267,023	7,754,347.92	0.21
174	000060	中金岭南	1,594,450	7,685,249.00	0.21
175	000729	燕京啤酒	899,200	7,661,184.00	0.21
176	002690	美亚光电	172,543	7,640,204.04	0.21
177	300058	蓝色光标	1,271,500	7,629,000.00	0.21
178	300212	易华录	248,681	7,622,072.65	0.21
179	002294	信立泰	267,000	7,564,110.00	0.21
180	002595	豪迈科技	255,085	7,563,270.25	0.21
181	000807	云铝股份	997,967	7,514,691.51	0.20
182	002372	伟星新材	401,558	7,509,134.60	0.20
183	601866	中远海发	2,527,300	7,506,081.00	0.20

184	600315	上海家化	215,877	7,497,408.21	0.20
185	600827	百联股份	511,563	7,468,819.80	0.20
186	002221	东华能源	736,472	7,467,826.08	0.20
187	000581	威孚高科	320,309	7,427,965.71	0.20
188	600528	中铁工业	849,110	7,421,221.40	0.20
189	603290	斯达半导	30,700	7,395,630.00	0.20
190	000983	山西焦煤	1,306,970	7,371,310.80	0.20
191	600256	广汇能源	2,585,800	7,317,814.00	0.20
192	601717	郑煤机	665,171	7,270,319.03	0.20
193	300296	利亚德	1,135,700	7,223,052.00	0.20
194	000997	新大陆	469,165	7,168,841.20	0.19
195	002429	兆驰股份	1,155,343	7,163,126.60	0.19
196	000960	锡业股份	638,880	7,155,456.00	0.19
197	600875	东方电气	711,700	7,095,649.00	0.19
198	600704	物产中大	1,617,300	7,067,601.00	0.19
199	300630	普利制药	167,359	7,010,668.51	0.19
200	600160	巨化股份	861,227	6,984,550.97	0.19
201	600260	凯乐科技	636,237	6,934,983.30	0.19
202	600811	东方集团	1,896,132	6,920,881.80	0.19
203	002745	木林森	473,436	6,907,431.24	0.19
204	002396	星网锐捷	297,793	6,867,106.58	0.19
205	603605	珀莱雅	38,500	6,853,000.00	0.19
206	600839	四川长虹	2,356,500	6,833,850.00	0.19
207	600728	佳都科技	896,600	6,805,194.00	0.19
208	002368	太极股份	258,948	6,761,132.28	0.18
209	600515	海航基础	997,300	6,731,775.00	0.18
210	002092	中泰化学	1,093,472	6,724,852.80	0.18
211	300474	景嘉微	96,098	6,718,211.18	0.18
212	600325	华发股份	1,080,777	6,711,625.17	0.18
213	600258	首旅酒店	315,160	6,687,695.20	0.18
214	600167	联美控股	583,950	6,627,832.50	0.18
215	600737	中粮糖业	682,386	6,605,496.48	0.18
216	603317	天味食品	80,290	6,603,049.60	0.18
217	600967	内蒙一机	539,036	6,554,677.76	0.18
218	600820	隧道股份	1,203,720	6,512,125.20	0.18
219	603927	中科软	162,400	6,510,616.00	0.18
220	000012	南玻A	875,976	6,464,702.88	0.18
221	600881	亚泰集团	2,073,059	6,426,482.90	0.17
222	002085	万丰奥威	976,700	6,407,152.00	0.17
223	300002	神州泰岳	1,251,320	6,394,245.20	0.17
224	600597	光明乳业	390,723	6,353,155.98	0.17
225	002390	信邦制药	744,668	6,314,784.64	0.17

226	002242	九阳股份	195,717	6,270,772.68	0.17
227	002268	卫士通	374,395	6,252,396.50	0.17
228	000999	华润三九	249,836	6,230,909.84	0.17
229	600446	金证股份	384,300	6,229,503.00	0.17
230	600410	华胜天成	701,138	6,212,082.68	0.17
231	600567	山鹰国际	2,051,800	6,196,436.00	0.17
232	603712	七一二	147,800	6,155,870.00	0.17
233	002174	游族网络	467,463	6,151,813.08	0.17
234	600804	鹏博士	914,060	6,142,483.20	0.17
235	600282	南钢股份	1,960,600	6,117,072.00	0.17
236	000709	河钢股份	2,710,200	6,070,848.00	0.17
237	000877	天山股份	401,562	6,063,586.20	0.16
238	601179	中国西电	1,308,300	6,031,263.00	0.16
239	000930	中粮科技	714,227	6,013,791.34	0.16
240	600435	北方导航	665,210	5,986,890.00	0.16
241	002387	维信诺	523,686	5,970,020.40	0.16
242	603000	人民网	352,700	5,960,630.00	0.16
243	000629	攀钢钒钛	2,740,500	5,946,885.00	0.16
244	002807	江阴银行	1,385,800	5,931,224.00	0.16
245	600026	中远海能	884,786	5,910,370.48	0.16
246	600273	嘉化能源	639,500	5,908,980.00	0.16
247	300166	东方国信	539,176	5,903,977.20	0.16
248	600216	浙江医药	431,100	5,862,960.00	0.16
249	000301	东方盛虹	617,000	5,849,160.00	0.16
250	001914	招商积余	270,634	5,826,750.02	0.16
251	002233	塔牌集团	456,381	5,814,293.94	0.16
252	600718	东软集团	555,000	5,777,550.00	0.16
253	600060	海信视像	500,067	5,740,769.16	0.16
254	600908	无锡银行	943,500	5,736,480.00	0.16
255	600037	歌华有线	621,626	5,718,959.20	0.16
256	600188	兖州煤业	566,700	5,706,669.00	0.16
257	600064	南京高科	552,124	5,670,313.48	0.15
258	002925	盈趣科技	87,648	5,638,395.84	0.15
259	000778	新兴铸管	1,527,800	5,622,304.00	0.15
260	600572	康恩贝	1,191,415	5,611,564.65	0.15
261	000932	华菱钢铁	1,173,320	5,608,469.60	0.15
262	002004	华邦健康	1,010,598	5,598,712.92	0.15
263	600755	厦门国贸	835,711	5,582,549.48	0.15
264	000400	许继电气	386,000	5,581,560.00	0.15
265	002985	北摩高科	28,800	5,567,040.00	0.15
266	000027	深圳能源	910,692	5,546,114.28	0.15
267	601975	招商南油	2,207,500	5,540,825.00	0.15

268	601005	重庆钢铁	3,743,200	5,539,936.00	0.15
269	600039	四川路桥	1,217,384	5,490,401.84	0.15
270	000598	兴蓉环境	1,143,200	5,487,360.00	0.15
271	000887	中鼎股份	467,300	5,472,083.00	0.15
272	002128	露天煤业	490,437	5,365,380.78	0.15
273	603198	迎驾贡酒	153,170	5,345,633.00	0.15
274	000089	深圳机场	654,281	5,345,475.77	0.15
275	002701	奥瑞金	1,078,841	5,329,474.54	0.14
276	600398	海澜之家	826,900	5,308,698.00	0.14
277	300026	红日药业	1,150,100	5,267,458.00	0.14
278	601118	海南橡胶	1,092,300	5,264,886.00	0.14
279	002110	三钢闽光	782,152	5,263,882.96	0.14
280	600158	中体产业	428,584	5,254,439.84	0.14
281	000825	太钢不锈	1,453,886	5,248,528.46	0.14
282	601106	中国一重	1,750,300	5,233,397.00	0.14
283	002191	劲嘉股份	560,915	5,177,245.45	0.14
284	002563	森马服饰	516,400	5,174,328.00	0.14
285	000970	中科三环	543,800	5,138,910.00	0.14
286	300072	三聚环保	899,555	5,109,472.40	0.14
287	600120	浙江东方	852,921	5,091,938.37	0.14
288	600171	上海贝岭	359,375	5,038,437.50	0.14
289	000488	晨鸣纸业	781,512	5,017,307.04	0.14
290	600022	山东钢铁	3,492,420	4,994,160.60	0.14
291	600195	中牧股份	388,882	4,981,578.42	0.14
292	002048	宁波华翔	319,703	4,977,775.71	0.14
293	002867	周大生	186,600	4,972,890.00	0.14
294	002936	郑州银行	1,112,280	4,960,768.80	0.13
295	000090	天健集团	834,614	4,957,607.16	0.13
296	601699	潞安环能	762,700	4,957,550.00	0.13
297	000967	盈峰环境	605,400	4,927,956.00	0.13
298	002839	张家港行	807,600	4,926,360.00	0.13
299	000402	金融街	762,800	4,920,060.00	0.13
300	601860	紫金银行	1,168,000	4,917,280.00	0.13
301	603228	景旺电子	162,980	4,913,847.00	0.13
302	002217	合力泰	1,193,200	4,892,120.00	0.13
303	600056	中国医药	340,219	4,875,338.27	0.13
304	000528	柳工	659,272	4,852,241.92	0.13
305	300133	华策影视	784,200	4,846,356.00	0.13
306	688321	微芯生物	130,776	4,840,019.76	0.13
307	600673	东阳光	961,594	4,836,817.82	0.13
308	000883	湖北能源	1,245,600	4,832,928.00	0.13
309	600376	首开股份	823,069	4,831,415.03	0.13

310	600006	东风汽车	510,032	4,814,702.08	0.13
311	603077	和邦生物	3,381,048	4,801,088.16	0.13
312	601333	广深铁路	2,161,900	4,799,418.00	0.13
313	600507	方大特钢	687,873	4,773,838.62	0.13
314	000563	陕国投 A	1,264,579	4,767,462.83	0.13
315	600021	上海电力	668,000	4,756,160.00	0.13
316	000990	诚志股份	399,800	4,741,628.00	0.13
317	600928	西安银行	849,300	4,722,108.00	0.13
318	300376	易事特	590,400	4,699,584.00	0.13
319	688029	南微医学	25,524	4,696,671.24	0.13
320	601000	唐山港	1,890,566	4,688,603.68	0.13
321	000685	中山公用	564,759	4,687,499.70	0.13
322	601200	上海环境	429,498	4,681,528.20	0.13
323	600782	新钢股份	1,017,300	4,669,407.00	0.13
324	000898	鞍钢股份	1,530,100	4,651,504.00	0.13
325	300180	华峰超纤	786,600	4,648,806.00	0.13
326	600500	中化国际	879,510	4,635,017.70	0.13
327	002266	浙富控股	1,027,815	4,625,167.50	0.13
328	002203	海亮股份	622,700	4,601,753.00	0.13
329	002317	众生药业	415,762	4,581,697.24	0.12
330	600970	中材国际	665,277	4,577,105.76	0.12
331	002155	湖南黄金	536,925	4,569,231.75	0.12
332	300113	顺网科技	265,876	4,559,773.40	0.12
333	600126	杭钢股份	861,940	4,559,662.60	0.12
334	002244	滨江集团	992,570	4,555,896.30	0.12
335	603568	伟明环保	240,059	4,544,316.87	0.12
336	601865	福莱特	113,500	4,528,650.00	0.12
337	000559	万向钱潮	843,161	4,510,911.35	0.12
338	000758	中色股份	879,600	4,468,368.00	0.12
339	600466	蓝光发展	964,620	4,466,190.60	0.12
340	000519	中兵红箭	444,310	4,451,986.20	0.12
341	601598	中国外运	1,006,100	4,426,840.00	0.12
342	600266	城建发展	863,848	4,388,347.84	0.12
343	601608	中信重工	1,107,543	4,385,870.28	0.12
344	600649	城投控股	807,100	4,382,553.00	0.12
345	601098	中南传媒	458,300	4,367,599.00	0.12
346	601016	节能风电	1,272,673	4,365,268.39	0.12
347	600373	中文传媒	432,400	4,362,916.00	0.12
348	000028	国药一致	95,242	4,362,083.60	0.12
349	300010	豆神教育	443,300	4,326,608.00	0.12
350	600073	上海梅林	418,929	4,310,779.41	0.12
351	600546	山煤国际	505,900	4,305,209.00	0.12

352	600348	阳泉煤业	767,200	4,303,992.00	0.12
353	603885	吉祥航空	376,300	4,278,531.00	0.12
354	601718	际华集团	1,401,000	4,245,030.00	0.12
355	600388	龙净环保	477,400	4,239,312.00	0.12
356	002458	益生股份	379,719	4,233,866.85	0.12
357	600959	江苏有线	1,276,270	4,224,453.70	0.11
358	000078	海王生物	1,053,152	4,223,139.52	0.11
359	600901	江苏租赁	761,500	4,195,865.00	0.11
360	300182	捷成股份	1,287,800	4,159,594.00	0.11
361	002183	怡亚通	948,200	4,134,152.00	0.11
362	002505	鹏都农牧	1,626,890	4,116,031.70	0.11
363	002399	海普瑞	238,652	4,109,587.44	0.11
364	002440	闰土股份	440,554	4,105,963.28	0.11
365	600645	中源协和	208,960	4,097,705.60	0.11
366	002640	跨境通	795,400	4,088,356.00	0.11
367	600094	大名城	1,016,800	4,087,536.00	0.11
368	002249	大洋电机	905,684	4,075,578.00	0.11
369	600633	浙数文化	498,400	4,056,976.00	0.11
370	600808	马钢股份	1,521,400	4,046,924.00	0.11
371	600835	上海机电	205,375	3,996,597.50	0.11
372	600062	华润双鹤	332,200	3,983,078.00	0.11
373	002038	双鹭药业	393,400	3,973,340.00	0.11
374	000564	供销大集	1,526,779	3,954,357.61	0.11
375	002468	申通快递	390,800	3,939,264.00	0.11
376	600141	兴发集团	357,041	3,938,162.23	0.11
377	600675	中华企业	1,167,020	3,921,187.20	0.11
378	002010	传化智联	831,500	3,916,365.00	0.11
379	600643	爱建集团	517,459	3,891,291.68	0.11
380	000959	首钢股份	1,012,447	3,877,672.01	0.11
381	601778	晶科科技	529,400	3,843,444.00	0.10
382	601958	金钼股份	617,600	3,835,296.00	0.10
383	002434	万里扬	427,592	3,814,120.64	0.10
384	601880	大连港	1,974,449	3,810,686.57	0.10
385	600863	内蒙华电	1,482,600	3,810,282.00	0.10
386	000158	常山北明	611,980	3,794,276.00	0.10
387	000415	渤海租赁	1,578,500	3,788,400.00	0.10
388	002408	齐翔腾达	453,031	3,787,339.16	0.10
389	000869	张裕A	86,762	3,782,823.20	0.10
390	600729	重庆百货	129,737	3,749,399.30	0.10
391	600312	平高电气	519,506	3,709,272.84	0.10
392	002544	杰赛科技	220,699	3,703,329.22	0.10
393	000826	启迪环境	547,700	3,702,452.00	0.10

394	601611	中国核建	507,300	3,693,144.00	0.10
395	600717	天津港	769,060	3,676,106.80	0.10
396	600776	东方通信	305,000	3,614,250.00	0.10
397	000031	大悦城	820,590	3,610,596.00	0.10
398	002583	海能达	586,800	3,602,952.00	0.10
399	300459	金科文化	1,121,670	3,578,127.30	0.10
400	002424	贵州百灵	450,239	3,525,371.37	0.10
401	002589	瑞康医药	672,110	3,515,135.30	0.10
402	000681	视觉中国	268,300	3,487,900.00	0.09
403	002635	安洁科技	202,244	3,484,664.12	0.09
404	600259	广晟有色	115,311	3,478,932.87	0.09
405	603650	彤程新材	112,100	3,475,100.00	0.09
406	002002	鸿达兴业	1,156,354	3,469,062.00	0.09
407	600566	济川药业	170,100	3,441,123.00	0.09
408	000501	鄂武商 A	294,419	3,429,981.35	0.09
409	600648	外高桥	238,500	3,331,845.00	0.09
410	000718	苏宁环球	970,400	3,328,472.00	0.09
411	300324	旋极信息	783,029	3,312,212.67	0.09
412	603708	家家悦	155,300	3,307,890.00	0.09
413	600823	世茂股份	716,800	3,304,448.00	0.09
414	000717	韶钢松山	771,900	3,296,013.00	0.09
415	600307	酒钢宏兴	1,996,000	3,293,400.00	0.09
416	600339	中油工程	1,068,800	3,291,904.00	0.09
417	000046	泛海控股	994,600	3,262,288.00	0.09
418	600582	天地科技	1,056,300	3,253,404.00	0.09
419	002815	崇达技术	225,200	3,251,888.00	0.09
420	600131	国网信通	228,400	3,250,132.00	0.09
421	600329	中新药业	183,009	3,206,317.68	0.09
422	002375	亚厦股份	427,600	3,181,344.00	0.09
423	000008	神州高铁	1,242,000	3,154,680.00	0.09
424	000156	华数传媒	365,800	3,131,248.00	0.09
425	002948	青岛银行	525,800	3,117,994.00	0.08
426	600985	淮北矿业	277,300	3,102,987.00	0.08
427	600968	海油发展	1,297,300	3,100,547.00	0.08
428	601928	凤凰传媒	487,100	3,083,343.00	0.08
429	600664	哈药股份	959,839	3,061,886.41	0.08
430	000061	农产品	433,200	3,054,060.00	0.08
431	600338	西藏珠峰	289,320	3,032,073.60	0.08
432	600707	彩虹股份	454,300	3,025,638.00	0.08
433	000543	皖能电力	723,147	3,022,754.46	0.08
434	603260	合盛硅业	89,528	2,993,816.32	0.08
435	300257	开山股份	218,985	2,989,145.25	0.08

436	002416	爱施德	395,441	2,949,989.86	0.08
437	600556	天下秀	230,600	2,917,090.00	0.08
438	603377	东方时尚	150,120	2,906,323.20	0.08
439	603515	欧普照明	96,065	2,902,123.65	0.08
440	600748	上实发展	588,387	2,888,980.17	0.08
441	601298	青岛港	447,300	2,876,139.00	0.08
442	002302	西部建设	324,400	2,848,232.00	0.08
443	600869	远东股份	705,776	2,816,046.24	0.08
444	000937	冀中能源	676,400	2,813,824.00	0.08
445	601127	小康股份	160,915	2,748,428.20	0.07
446	600639	浦东金桥	216,959	2,690,291.60	0.07
447	601139	深圳燃气	367,100	2,657,804.00	0.07
448	601228	广州港	790,400	2,655,744.00	0.07
449	002503	搜于特	1,183,972	2,652,097.28	0.07
450	600277	亿利洁能	872,400	2,608,476.00	0.07
451	600787	中储股份	561,470	2,588,376.70	0.07
452	000600	建投能源	457,200	2,564,892.00	0.07
453	600545	卓郎智能	725,583	2,539,540.50	0.07
454	000813	德展健康	572,100	2,534,403.00	0.07
455	300134	大富科技	244,860	2,529,403.80	0.07
456	603888	新华网	132,500	2,517,500.00	0.07
457	000062	深圳华强	200,121	2,489,505.24	0.07
458	600640	号百控股	203,000	2,486,750.00	0.07
459	603225	新凤鸣	178,216	2,477,202.40	0.07
460	600350	山东高速	399,100	2,466,438.00	0.07
461	600517	国网英大	401,400	2,440,512.00	0.07
462	601828	美凯龙	282,696	2,400,089.04	0.07
463	600871	石化油服	1,212,200	2,375,912.00	0.06
464	600291	西水股份	418,500	2,372,895.00	0.06
465	002419	天虹股份	306,400	2,340,896.00	0.06
466	603056	德邦股份	183,767	2,332,003.23	0.06
467	002093	国脉科技	319,200	2,326,968.00	0.06
468	600575	淮河能源	991,800	2,300,976.00	0.06
469	002051	中工国际	315,860	2,239,447.40	0.06
470	000537	广宇发展	356,500	2,235,255.00	0.06
471	603379	三美股份	116,776	2,230,421.60	0.06
472	600657	信达地产	545,954	2,211,113.70	0.06
473	000553	安道麦 A	277,900	2,173,178.00	0.06
474	603893	瑞芯微	29,200	2,112,620.00	0.06
475	601869	长飞光纤	77,416	2,093,328.64	0.06
476	002901	大博医疗	28,300	2,086,559.00	0.06
477	000732	泰禾集团	635,200	2,077,104.00	0.06

478	600623	华谊集团	356,400	2,067,120.00	0.06
479	603328	依顿电子	254,800	2,025,660.00	0.06
480	002946	新乳业	108,900	1,917,729.00	0.05
481	603786	科博达	28,100	1,900,122.00	0.05
482	600903	贵州燃气	145,300	1,845,310.00	0.05
483	601801	皖新传媒	380,684	1,808,249.00	0.05
484	002653	海思科	102,761	1,800,372.72	0.05
485	603983	丸美股份	33,300	1,738,593.00	0.05
486	601003	柳钢股份	326,980	1,697,026.20	0.05
487	603719	良品铺子	28,200	1,654,494.00	0.04
488	600053	九鼎投资	82,960	1,621,868.00	0.04
489	603355	莱克电气	52,527	1,587,891.21	0.04
490	601969	海南矿业	249,400	1,491,412.00	0.04
491	603868	飞科电器	30,605	1,431,701.90	0.04
492	002941	新疆交建	123,400	1,357,400.00	0.04
493	002818	富森美	95,846	1,354,303.98	0.04
494	002423	中粮资本	116,100	1,123,848.00	0.03
495	002957	科瑞技术	52,600	1,075,670.00	0.03
496	001872	招商港口	66,800	1,063,456.00	0.03
497	601512	中新集团	105,000	1,043,700.00	0.03
498	603256	宏和科技	112,000	988,960.00	0.03
499	600917	重庆燃气	119,100	817,026.00	0.02
500	601068	中铝国际	195,500	695,980.00	0.02

8.3.2 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	688408	中信博	4,450	714,403.00	0.02
2	688777	中控技术	5,794	446,833.28	0.01
3	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
4	688221	前沿生物	16,148	276,938.20	0.01
5	300862	蓝盾光电	5,843	225,189.22	0.01
6	688617	惠泰医疗	1,673	124,571.58	0.00
7	688093	世华科技	4,595	108,579.85	0.00
8	688560	明冠新材	3,832	87,599.52	0.00
9	688668	鼎通科技	3,037	74,588.72	0.00
10	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
11	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
12	300872	天阳科技	871	32,958.64	0.00
13	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
14	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00
15	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00

16	003026	中晶科技	460	21,693.60	0.00
17	300873	海晨股份	484	19,998.88	0.00
18	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
19	003029	吉大正元	716	18,716.24	0.00
20	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
21	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
22	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
23	605179	一鸣食品	939	16,582.74	0.00
24	300898	熊猫乳品	496	16,382.88	0.00
25	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
26	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
27	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
28	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
29	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
30	300902	国安达	551	13,367.26	0.00
31	300925	法本信息	353	13,177.49	0.00
32	300895	铜牛信息	283	12,819.90	0.00
33	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
34	605155	西大门	350	10,668.00	0.00
35	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
36	605277	新亚电子	507	8,593.65	0.00
37	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
38	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
39	003031	中瓷电子	387	5,909.49	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600739	辽宁成大	62,253,669.93	1.78
2	600079	人福医药	56,231,247.77	1.61
3	601799	星宇股份	55,492,515.69	1.59
4	600426	华鲁恒升	52,168,325.59	1.50
5	600201	生物股份	51,910,644.19	1.49
6	600298	安琪酵母	49,731,056.30	1.43
7	603517	绝味食品	48,197,237.95	1.38
8	601099	太平洋	46,879,911.85	1.34
9	600143	金发科技	46,713,050.14	1.34
10	600529	山东药玻	42,707,726.27	1.22
11	600521	华海药业	40,906,331.92	1.17
12	601233	桐昆股份	37,453,485.63	1.07
13	600885	宏发股份	37,424,402.72	1.07
14	600161	天坛生物	37,394,436.78	1.07

15	601128	常熟银行	37,257,959.08	1.07
16	603882	金域医学	36,940,527.63	1.06
17	603659	璞泰来	36,343,326.28	1.04
18	600699	均胜电子	36,305,549.10	1.04
19	600801	华新水泥	33,619,967.72	0.96
20	603883	老百姓	32,378,376.38	0.93

8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	600739	辽宁成大	84,269,676.27	2.42
2	600298	安琪酵母	79,133,800.56	2.27
3	603517	绝味食品	75,317,676.55	2.16
4	600201	生物股份	74,623,775.30	2.14
5	601799	星宇股份	72,171,431.50	2.07
6	600426	华鲁恒升	71,711,612.97	2.06
7	600079	人福医药	69,746,187.44	2.00
8	600521	华海药业	69,259,501.61	1.99
9	601099	太平洋	67,278,207.71	1.93
10	600161	天坛生物	66,596,529.91	1.91
11	600143	金发科技	64,580,371.73	1.85
12	600745	闻泰科技	63,480,445.47	1.82
13	603659	璞泰来	55,509,032.54	1.59
14	601128	常熟银行	54,404,508.57	1.56
15	603939	益丰药房	52,931,810.24	1.52
16	600584	长电科技	52,430,645.03	1.50
17	600699	均胜电子	50,113,429.10	1.44
18	600885	宏发股份	49,845,441.64	1.43
19	600845	宝信软件	49,181,221.80	1.41
20	600801	华新水泥	47,434,383.20	1.36

8.4.3 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	5,776,525,314.54
卖出股票收入（成交）总额	7,122,707,964.11

注：8.4.1 项“买入金额”、8.4.2 项“卖出金额”及 8.4.3 项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买入或卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	87,200.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	87,200.00	0.00

8.6 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	128142	新乳转债	872	87,200.00	0.00

注：报告期末，本基金仅持有上述 1 支债券。

8.7 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

无。

8.8 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

无。

8.9 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

无。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC2106	IC2106	60	73,228,800.00	1,898,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,898,600.00
股指期货投资本期收益（元）					37,889,088.03
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-6,513,840.68

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。本基金投资于标的指数为基础资产的股指期货，目的在于满足基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，实现跟踪标的指数的投资目标。

本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响很小，并符合既定的投资政策和投资目标。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

无。

8.11.3 本期国债期货投资评价

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体未被监管部门立案调查，在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。

8.12.3 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	10,939,944.44
2	应收证券清算款	112,011,486.57
3	应收股利	-
4	应收利息	197,314.19
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	123,148,745.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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	300274	阳光电源	9,468,680.00	0.26	转融通出借证

					券
2	300012	华测检测	5,851,706.00	0.16	转融通出借证 券
3	600426	华鲁恒升	5,453,260.00	0.15	转融通出借证 券
4	002074	国轩高科	5,148,192.00	0.14	转融通出借证 券
5	600089	特变电工	4,850,685.00	0.13	转融通出借证 券
6	600079	人福医药	4,705,932.00	0.13	转融通出借证 券
7	603882	金域医学	4,561,072.00	0.12	转融通出借证 券
8	000547	航天发展	4,537,500.00	0.12	转融通出借证 券
9	300285	国瓷材料	4,470,401.00	0.12	转融通出借证 券
10	300496	中科创达	4,446,000.00	0.12	转融通出借证 券

8.12.5.2 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	688408	中信博	714,403.00	0.02	新股锁定
2	688777	中控技术	446,833.28	0.01	新股锁定
3	300896	爱美客	285,389.28	0.01	新股锁定
4	688221	前沿生物	276,938.20	0.01	新股锁定
5	300862	蓝盾光电	225,189.22	0.01	新股锁定

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

无。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

9.1.1 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 (%)
11,848	44,558.73	467,468,594.00	88.55	60,463,274.00	11.45

9.1.2 目标基金的期末基金份额持有人户数及持有人结构

项目	持有份额 (份)	占总份额比例 (%)
嘉实中证 500ETF 联接	226,543,731.00	42.91

9.2 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	兴业财富—兴业银行“现金宝(4号)”—私人银行类人民币理财产品—兴业财富—兴易多策略1号专项资产管理计划	71,679,500.00	13.58
2	华泰证券股份有限公司	38,400,000.00	7.27
3	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	13,090,700.00	2.48
4	国泰君安证券股份有限公司融券专用证券账户	12,129,900.00	2.30
5	中国人保资产管理股份有限公司—安心增值投资产品	11,710,500.00	2.22
6	中国银河证券股份有限公司融券专用证券账户	11,040,800.00	2.09
7	申万宏源证券有限公司	9,501,200.00	1.80
8	国泰君安证券股份有限公司	7,567,741.00	1.43
9	建信资本—邮储银行—中国邮政储蓄银行股份有限公司	5,787,600.00	1.10
10	中信证券股份有限公司	5,776,013.00	1.09
11	嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	226,543,731.00	42.91

注：上述基金持有人份额均为场内基金份额。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

报告期末，基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 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 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

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2013年2月6日）基 金份额总额	3,108,729,402.00
本报告期期初基金份额总额	625,931,868.00
本报告期基金总申购份额	1,846,400,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,944,400,000.00
本报告期基金拆分变动份额（份额减少 以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	527,931,868.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

（1）基金管理人的重大人事变动情况

2020年4月8日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，宋振茹女士因退休不再担任公司副总经理职务。

2020年5月6日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司机构首席投资官任职公告》，郭杰先生任公司机构首席投资官。

2020年6月19日本基金管理人发布《嘉实基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，郭松先生任公司督察长，王炜女士因工作分工不再担任公司督察长职务。

（2）基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动情况

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告年度应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的审计费 100,000.00 元，该审计机构已连续 8 年为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人和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。

本基金管理人报告期内收到北京证监局有关警示函的行政监管措施，对存在的问题，公司已采取相应的改进措施。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信建投证券股份有限公司	3	9,543,561,955.60	74.22%	954,490.47	30.03%	-
广发证券股份有限公司	3	1,000,558,350.10	7.78%	672,056.39	21.14%	-
招商证券股份有限公司	1	795,919,120.06	6.19%	557,154.02	17.53%	-
北京高华证券有限责任公司	1	431,413,465.55	3.36%	301,995.10	9.50%	-
兴业证券	2	430,548,855.55	3.35%	271,812.93	8.55%	-

股份有限 公司						
西部证券 股份有限 公司	2	424,591,263.34	3.30%	268,046.44	8.43%	-
光大证券 股份有限 公司	1	132,855,883.86	1.03%	83,873.60	2.64%	-
申万宏源 证券有限 公司	2	68,963,287.02	0.54%	48,274.84	1.52%	-
海通证券 股份有限 公司	1	29,485,435.10	0.23%	20,699.41	0.65%	-
财信证券 有限责任 公司	1	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	1	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	1	-	-	-	-	-

注：1. 本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券

商的佣金合计。

2. 交易单元的选择标准和程序

- (1) 经营行为规范；
- (2) 财务状况良好；
- (3) 研究能力较强；

基金管理人根据以上标准进行考察后确定租用券商的交易单元。基金管理人与被选择的券商签订协议，并通知基金托管人。

3. 财富证券有限责任公司更名为财信证券有限责任公司。

4. 报告期内，本基金新增以下交易单元：西部证券股份有限公司新增交易单元 2 个，广发证券股份有限公司新增交易单元 2 个，中信证券股份有限公司新增交易单元 1 个。

11.7.2 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
中信建投证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-
广发证券股份有限公司	4,299,749.78	16.97%	1,044,000,000.00	6.93%	-	-
招商证券股份有限公司	6,306,253.62	24.89%	-	-	-	-
北京高华证券有限责任公司	4,817,490.80	19.01%	7,568,000,000.00	50.21%	-	-
兴业证券股份有限公司	5,533,998.78	21.84%	4,228,000,000.00	28.05%	-	-
西部证券股份有限公司	1,167,368.34	4.61%	-	-	-	-
光大证券股份有限公司	2,617,055.60	10.33%	1,888,000,000.00	12.53%	-	-

申万宏源 证券有限 公司	-	-	-	-	-	-
海通证券 股份有限 公司	598,017.10	2.36%	345,000,000.00	2.29%	-	-
财信证券 有限责任 公司	-	-	-	-	-	-
国泰君安 证券股份 有限公司	-	-	-	-	-	-
国元证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
华泰证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-
中信证券 股份有限 公司	-	-	-	-	-	-

11.8 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	嘉实基金管理有限公司关于根据《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》修改旗下部分基金基金合同及托管协议的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年01月22日
2	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年05月18日
3	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购赎回单位的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年06月29日
4	嘉实基金管理有限公司关于旗下交易型开放式指数基金在科创板股票上市首日的风险提示性公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年07月16日
5	关于嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金新增流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2020年10月09日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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 (%)
机构	-	-	-	-	-	-	-
个人	-	-	-	-	-	-	-
联接基金	1	2020/01/01 至 2020/02/09, 2020/02/11 至 2020/06/08, 2020/06/10 至 2020/12/31	422,937,780.00	1,454,710,400.00	1,651,104,449.00	226,543,731.00	42.91
产品特有风险							
<p>报告期内本基金出现了单一投资者份额占比达到或超过 20%的情况。</p> <p>未来本基金如果出现巨额赎回甚至集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产，可能对基金份额净值产生一定的影响；极端情况下可能引发基金的流动性风险，发生暂停赎回或延缓支付赎回款项；若个别投资者巨额赎回后本基金连续 60 个工作日出现基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元，还可能面临转换运作方式或者与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- (1) 中国证监会核准嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- (2) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- (3) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- (4) 《嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- (5) 基金管理人业务资格批件、营业执照；
- (6) 报告期内嘉实中证 500 交易型开放式指数证券投资基金公告的各项原稿。

13.2 存放地点

北京市朝阳区建国门外大街 21 号北京国际俱乐部 C 座写字楼 12A 层嘉实基金管理有限公司

13.3 查阅方式

(1) 书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:30。投资者可免费查阅，也可按工本费购买复印件。

(2) 网站查询：基金管理人网址：<http://www.jsfund.cn>

投资者对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人嘉实基金管理有限公司，咨询电话 400-600-8800，或发 E-mail:service@jsfund.cn。

嘉实基金管理有限公司

2021 年 3 月 30 日