

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2022 年 3 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 3 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2021 年 01 月 01 日起至 2021 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 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
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 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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	97

8.1 期末基金资产组合情况	97
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	98
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	99
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	108
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	110
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	110
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	110
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	110
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	110
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	110
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	110
8.12 投资组合报告附注	111
§ 9 基金份额持有人信息	112
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	112
9.2 期末上市基金前十名持有人	112
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	113
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	113
§ 10 开放式基金份额变动	113
§ 11 重大事件揭示	114
11.1 基金份额持有人大会决议	114
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	114
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	114
11.4 基金投资策略的改变	114
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	114
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	114
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	114
11.8 其他重大事件	117
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	119
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	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	120
§ 13 备查文件目录	120
13.1 备查文件目录	120
13.2 存放地点	120
13.3 查阅方式	120

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF(扩位证券简称:沪深 300ETF)
场内简称	300ETF
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	11,340,487,690.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，即完全按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，股票最低仓位为 95%，并采用完全复制的被动式投资策略：一方面，相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高，属于股票型基金中高风险、高收益的产品；另一方面，相对于采用抽样复制的指数型基金而言，其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄上海证大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码	200135	100140
法定代表人	贾波	陈四清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 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公司	北京西城区金融大街 27 号投资广场 22-23 层

§ 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	2021 年	2020 年	2019 年
本期已实现收益	4,812,806,598.71	8,865,982,822.14	3,181,407,806.78
本期利润	-1,000,246,570.00	10,510,569,368.53	11,521,793,277.91
加权平均基金份额本期利润	-0.1192	1.1486	1.2529
本期加权平均净值利润率	-2.32%	26.36%	33.30%
本期基金份额净值增长率	-3.82%	29.09%	38.02%
3.1.2 期末数据和指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
期末可供分配利润	26,314,519,217.38	22,409,392,982.13	13,766,139,829.22
期末可供分配基金份额利润	2.3204	2.5884	1.3976
期末基金	56,886,059,237.46	45,748,405,887.28	40,319,878,813.84

资产净值			
期末基金份额净值	5.0162	5.2842	4.0934
3.1.3 累计期末指标	2021 年末	2020 年末	2019 年末
基金份额累计净值增长率	113.24%	121.71%	71.75%

注：1、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。

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

3、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

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	1.48%	0.79%	1.52%	0.79%	-0.04%	0.00%
过去六个月	-4.72%	1.02%	-5.43%	1.02%	0.71%	0.00%
过去一年	-3.82%	1.17%	-5.20%	1.17%	1.38%	0.00%
过去三年	71.36%	1.29%	64.10%	1.29%	7.26%	0.00%
过去五年	60.56%	1.20%	49.25%	1.20%	11.31%	0.00%
自基金合同生效起至今	113.24%	1.42%	83.55%	1.43%	29.69%	-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

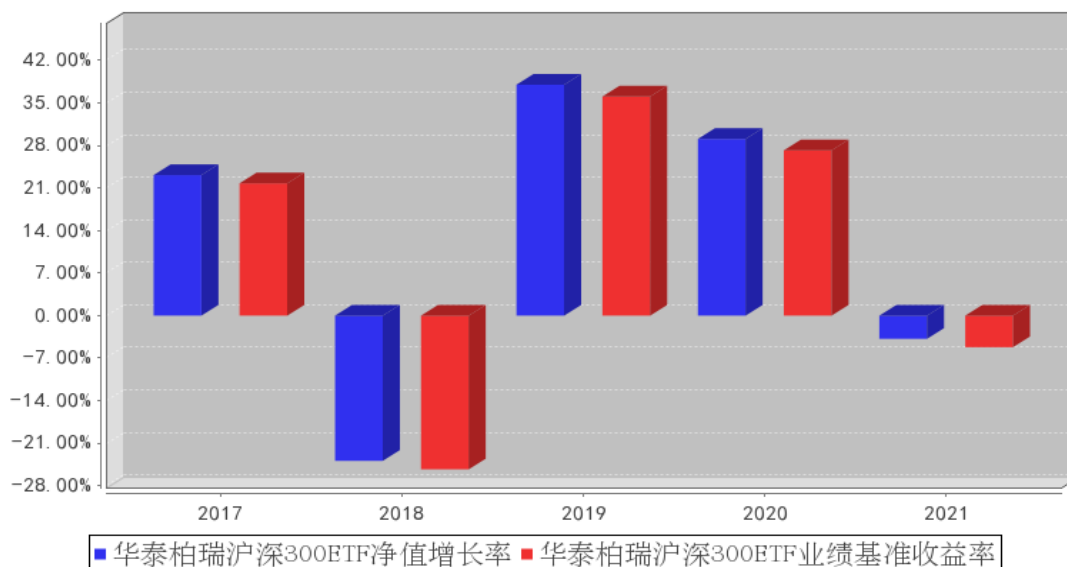
华泰柏瑞沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 日至 2021 年 12 月 31 日。

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

华泰柏瑞沪深300ETF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



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2021 年	0.7200	635,399,113.28	-	635,399,113.28	-
2020 年	-	-	-	-	-
2019 年	1.2100	1,174,654,411.49	-	1,174,654,411.49	-

合计	1.9300	1,810,053,524.77	-	1,810,053,524.77
----	--------	------------------	---	------------------

§ 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞亨利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金

融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华

泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。截至 2021 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 2443.87 亿元。

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		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 5 月 4 日	-	20 年	20 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基

					金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：无。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、

5 日)下进行分析,综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能,确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内,公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离,实行集中交易制度,由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务,为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况,兼任业务遵照相关法律法规要求进行,同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理,公平交易的相关管理制度健全,投资决策流程完善,各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待,不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现,报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查,交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制,风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内,该制度执行情况良好,无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中,均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5%的同日反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2021 年市场以结构性机会为主。其中电气设备、有色金属、采掘、化工、钢铁等行业录得正收益,期间电气设备行业指数上涨达 47.86%,有色金属行业指数上涨达 40.47%。整体来看,沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板涨跌幅分别为-5.20%、15.58%、20.52%和 12.02%。从市场风格来看,价值风格表现相对强势,优于成长风格,期间中证 500 价值指数和中证 500 成长指数的涨幅分别为 18.83%和 6.85%。沪深 300 价值指数相对于沪深 300 成长指数,亦略胜一筹。

我们严格按照基金合同的规定,紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内,本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.014%,期间日跟踪误差为 0.021%,较好地实现了本基金的投资目标。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略,从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

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 5.0162 元；本报告期基金份额净值增长率为-3.82%，业绩比较基准收益率为-5.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021 年经济走势前高后低，由于低基数逐渐消退、政策回归常态化，技术性驱动转为基本面主导，GDP 增速逐季下行。三季度 GDP 增速超预期下滑至 4.9%，经济增长动能明显放缓。展望 2022 年，在出口增速放缓，房地产投资回落、消费难有明显修复的大背景下，经济下行压力明显，基建将成为刺激经济的重要抓手。随着通胀约束缓释，经济下行压力加大，胀的风险让位于滞，政策重心从“抑通胀”转为“稳增长”。市场将在估值提升与业绩下行背景下博弈，市场的不确定进一步加剧，存在结构性机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2021 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统进行事先合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时

要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本基金于 2021 年 1 月 18 日进行收益分配，每 10 份基金份额分配 0.72 元。

4.9 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

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持

有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华泰柏瑞基金管理有限公司编制和披露的本基金 2021 年年度报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 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(2022)第 28209 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	华泰柏瑞沪深 300 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>我们审计了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 基金”)的财务报表，包括 2021 年 12 月 31 日的资产负债表，2021 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，公允反映了华泰柏瑞沪深 300ETF 基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 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	<p>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，我们独立于华泰柏瑞沪深 300ETF 基金，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	华泰柏瑞沪深 300ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会

	<p>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华泰柏瑞沪深 300ETF 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华泰柏瑞沪深 300ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞沪深 300ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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，就可能对华泰柏瑞沪深 300ETF 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得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞沪深 300ETF 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	张炯	朱宏宇
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2022 年 03 月 30 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	235,699,884.97	49,601,507.93
结算备付金		1,222,370,183.37	1,073,316,400.59
存出保证金		142,546,631.84	150,670,295.60
交易性金融资产	7.4.7.2	55,381,502,659.10	44,480,582,821.95
其中：股票投资		55,381,502,659.10	44,448,766,821.95
基金投资		-	-
债券投资		-	31,816,000.00
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	-	-
应收证券清算款		19,407,797.62	96,792,226.64
应收利息	7.4.7.5	1,708,435.57	3,033,489.50
应收股利		-	3,085.50
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		57,003,235,592.47	45,853,999,827.71
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		67,951.26	12,839.42

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		5,546,645.91	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		20,251,085.76	18,498,144.84
应付托管费		4,050,217.15	3,699,628.99
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	3,337,919.65	2,748,200.68
应交税费		308,093.67	1,421,149.09
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	83,614,441.61	79,213,977.41
负债合计		117,176,355.01	105,593,940.43
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	30,571,540,020.08	23,339,012,905.15
未分配利润	7.4.7.10	26,314,519,217.38	22,409,392,982.13
所有者权益合计		56,886,059,237.46	45,748,405,887.28
负债和所有者权益总计		57,003,235,592.47	45,853,999,827.71

注：报告截止日 2021 年 12 月 31 日，基金份额净值 5.0162 元，基金份额总额 11,340,487,690.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 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
		2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
一、收入		-655,735,759.43	10,822,282,984.93
1. 利息收入		105,267,088.18	39,182,556.03
其中：存款利息收入	7.4.7.11	18,152,609.36	15,352,272.04
债券利息收入		17,826.56	14,462.13
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		87,096,652.26	23,815,821.86
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		4,960,836,663.90	9,140,091,580.25
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,142,083,896.00	8,137,493,299.45

基金投资收益	-	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	24,179,469.38	21,242,078.61
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13.5	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	87,673,689.32	264,886,427.18
股利收益	7.4.7.16	706,899,609.20	716,469,775.01
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.17	-5,813,053,168.71	1,644,608,937.40
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	91,213,657.20	-1,600,088.75
减：二、费用		344,510,810.57	311,713,616.42
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	214,959,646.71	199,082,558.94
2. 托管费	7.4.10.2.2	42,991,929.36	39,816,511.74
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	72,812,988.99	59,416,255.44
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		315,682.61	953,638.64
7. 其他费用	7.4.7.20	13,430,562.90	12,444,651.66
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-1,000,246,570.00	10,510,569,368.51
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-1,000,246,570.00	10,510,569,368.51

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 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）	23,339,012,905.15	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28
二、本期经营活 动产生的基金净 值变动数（本期 利润）	-	-1,000,246,570.00	-1,000,246,570.00
三、本期基金份	7,232,527,114.93	5,540,771,918.53	12,773,299,033.46

额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	60,616,389,616.49	54,875,089,370.83	115,491,478,987.32
2. 基金赎回款	-53,383,862,501.56	-49,334,317,452.30	-102,718,179,953.86
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）	-	-635,399,113.28	-635,399,113.28
五、期末所有者权益（基金净值）	30,571,540,020.08	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
项目	上年度可比期间 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）	26,553,738,984.62	13,766,139,829.22	40,319,878,813.84
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	10,510,569,368.51	10,510,569,368.51
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）	-3,214,726,079.47	-1,867,316,215.60	-5,082,042,295.07
其中：1. 基金申购款	54,395,591,389.79	34,059,752,374.14	88,455,343,763.93
2. 基金赎回款	-57,610,317,469.26	-35,927,068,589.74	-93,537,386,059.00
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）	23,339,012,905.15	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28

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：

韩勇

房伟力

赵景云

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

华泰柏瑞沪深 300 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]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额,其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算,折算比例为 0.37094933,并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)上证基字[2012]14 号文审核同意,本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象;此外,为更好地实现投资目标,本基金可少量投资于新股(一级市场初次发行或增发)、存托凭证、债券、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下,本基金日均跟踪偏离度(剔除成份股分红因素)的绝对值不超过 0.2%,年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF,于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”)。华

泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 3 月 30 日批准报出。

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》、《华泰柏瑞沪深 300 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

本基金 2021 年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2021 年 12 月 31 日的财务状况以及 2021 年度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。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，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。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中以交易性金融负债列示。本基金持有的其他金融负债包括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

金融资产和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，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债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以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债，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

本基金持有的股票投资、债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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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。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。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。本基金参与的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“证金公司”)出借证券，证金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

本基金的管理人报酬和托管费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

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。本基金的基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权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

根据本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，本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。本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。本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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号—收入》,本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则,该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

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

本基金在本报告期间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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
活期存款	235,699,884.97	49,601,507.93
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	235,699,884.97	49,601,507.93
----	----------------	---------------

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	55,548,196,088.44	55,381,502,659.10	-166,693,429.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	55,548,196,088.44	55,381,502,659.10	-166,693,429.34
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	38,901,471,995.38	44,448,766,821.95	5,547,294,826.57
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	31,816,000.00	31,816,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	31,816,000.00	31,816,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	38,933,287,995.38	44,480,582,821.95	5,547,294,826.57

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	1,168,432,020.00	-	-	
其中：股指期货投资	1,168,432,020.00	-	-	

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,168,432,020.00	-	-	-
项目	上年度末 2020 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	1,130,131,260.00	-	-	-
股指期货	1,130,131,260.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,130,131,260.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2203	沪深 2203	770	1,143,588,600.00	-24,843,420.00
总额合计		770	1,143,588,600.00	-24,843,420.00
减：可抵销期货暂收款				24,843,420.00
股指期货投资净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	39,699.33	12,396.96
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	588,511.86	601,964.98
应收债券利息	-	2,354.16
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
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	1,077,872.36	2,414,006.02
其他	2,352.02	2,767.38
合计	1,708,435.57	3,033,489.50

7.4.7.6 其他资产

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
交易所市场应付交易费用	3,337,919.65	2,748,200.68
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	3,337,919.65	2,748,200.68

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	377,671.12	290,000.00
应付指数使用费	3,232,054.19	3,084,517.29
应退退补款	79,504,716.30	75,339,460.12
合计	83,614,441.61	79,213,977.41

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,657,587,690.00	23,339,012,905.15
本期申购	22,485,600,000.00	60,616,389,616.49

本期赎回（以“-”号填列）	-19,802,700,000.00	-53,383,862,501.56
- 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	11,340,487,690.00	30,571,540,020.08

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

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	28,962,367,536.88	-6,552,974,554.75	22,409,392,982.13
本期利润	4,812,806,598.71	-5,813,053,168.71	-1,000,246,570.00
本期基金份额交易产生的变动数	10,412,333,301.72	-4,871,561,383.19	5,540,771,918.53
其中：基金申购款	84,470,398,902.19	-29,595,309,531.36	54,875,089,370.83
基金赎回款	-74,058,065,600.47	24,723,748,148.17	-49,334,317,452.30
本期已分配利润	-635,399,113.28	-	-635,399,113.28
本期末	43,552,108,324.03	-17,237,589,106.65	26,314,519,217.38

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
活期存款利息收入	656,448.03	1,102,919.63
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	17,385,272.93	14,177,425.36
其他	110,888.40	71,927.05
合计	18,152,609.36	15,352,272.04

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	上年度可比期间
	2021年1月1日至2021年12月31日	2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,146,951,248.12	4,912,092,822.39
股票投资收益——赎回差价收入	1,995,132,647.88	3,225,400,477.06
股票投资收益——申购	-	-

差价收入		
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	4,142,083,896.00	8,137,493,299.45

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
卖出股票成交总额	49,224,520,823.75	41,122,878,030.02
减：卖出股票成本总额	47,077,569,575.63	36,210,785,207.63
买卖股票差价收入	2,146,951,248.12	4,912,092,822.39

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	102,718,179,953.86	93,537,386,059.00
减：现金支付赎回款总额	41,480,920,620.86	35,046,503,971.00
减：赎回股票成本总额	59,242,126,685.12	55,265,481,610.94
赎回差价收入	1,995,132,647.88	3,225,400,477.06

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.12.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-证券出借差价收入。

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020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	24,179,469.38	21,242,078.61
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	24,179,469.38	21,242,078.61

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 2021年1月1日至2021年12月31 日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月 31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	134,251,227.73	94,501,882.39
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	110,051,100.00	73,247,300.00
减：应收利息总额	20,658.35	12,503.78
买卖债券差价收入	24,179,469.38	21,242,078.61

7.4.7.13.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.13.4 债券投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.13.5 资产支持证券投资收益

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

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

注：无。

7.4.7.14.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.14.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.14.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

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 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2020年1月1日至2020年12月31日
股指期货投资收益	87,673,689.32	264,886,427.18

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	706,899,609.20	716,469,775.01
其中：证券出借权益补偿收入	85,926,527.85	6,866,151.34
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	706,899,609.20	716,469,775.01

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-5,714,033,608.71	1,573,810,317.40
股票投资	-5,714,033,608.71	1,573,810,317.40
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	-99,019,560.00	70,798,620.00
权证投资	-	-
期货投资	-99,019,560.00	70,798,620.00
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	-5,813,053,168.71	1,644,608,937.40

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	87,464,474.82	-1,600,088.75
其他	3,749,182.38	-
合计	91,213,657.20	-1,600,088.75

注：1、替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

2、其他为康美药业赔偿款。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
交易所市场交易费用	72,418,662.50	59,027,701.49
银行间市场交易费用	-	-
期货交易费用	394,326.49	388,553.95
合计	72,812,988.99	59,416,255.44

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日
审计费用	150,000.00	170,000.00
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	5,312.98	4,698.18
指数使用费	12,897,578.80	11,944,953.48
注册登记费	257,671.12	150,000.00
其他费用	-	55,000.00
合计	13,430,562.90	12,444,651.66

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

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

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

本基金的基金管理人于 2022 年 1 月 12 日宣告 2021 年度第 1 次分红，向截至 2022 年 1 月 18 日止在本基金注册登记人中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.75 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
柏瑞爱建资产管理（上海）有限公司	基金管理人的控股子公司
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	3,196,733,220.10	3.08	2,087,587,017.59	2.59

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	419,732.99	3.03	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	274,104.28	2.59	270,001.00	9.82

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

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

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 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	214,959,646.71	199,082,558.94
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年1月1日至2021年12 月31日	上年度可比期间 2020年1月1日至2020年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	42,991,929.36	39,816,511.74

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.10% / 当年天数。

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

注：本基金本期及上年可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	43,142,400,035.00	42,187,145.91	1,011,362,053.00	347,444.29
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	17,385,800,922.00	11,611,663.67	2,689,823,283.00	1,173,760.03

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

单位：人民币元

本期 2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:张)	出借期限(单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2021010400000197	东方财富	2021-01-04	27,370,000.00	850,000.00	14	5.40%	57,477.00	-	-
华泰证券	2021010400013120	亿纬锂能	2021-01-04	14,612,487.00	156,300.00	14	3.40%	19,320.98	-	-
华泰证券	2021010500000360	沃森生物	2021-01-05	152,120.00	4,000.00	14	3.40%	201.18	-	-
华泰证券	2021010500010640	沃森生物	2021-01-05	76,060.00	2,000.00	14	3.40%	100.52	-	-
华泰证券	2021010500010642	沃森生物	2021-01-05	950,750.00	25,000.00	14	4.40%	1,626.80	-	-
华泰证券	2021010600000415	蓝思科技	2021-01-06	311,322.00	8,900.00	14	3.40%	411.60	-	-
华泰证券	2021010600007229	蓝思科技	2021-01-06	1,626,570.00	46,500.00	14	4.40%	2,783.20	-	-
华泰证券	2021010600007919	沃森生物	2021-01-06	579,900.00	15,000.00	14	3.40%	766.78	-	-
华泰证券	2021010700011772	沃森生物	2021-01-07	4,661,125.00	122,500.00	14	3.40%	6,163.08	-	-
华泰证券	2021010700011774	东方财富	2021-01-07	728,700.00	21,000.00	14	4.40%	1,246.84	-	-
华泰证券	2021011100008228	泰格医药	2021-01-11	2,885,400.00	17,500.00	14	3.40%	3,815.14	-	-
华泰证券	2021011100008992	蓝思科技	2021-01-11	1,295,000.00	35,000.00	14	3.40%	1,712.34	-	-
华泰证券	2021011100008994	蓝思科技	2021-01-11	518,000.00	14,000.00	14	3.40%	684.88	-	-
华泰证券	2021011200006485	蓝思科技	2021-01-12	56,025.00	1,500.00	14	3.40%	74.06	-	-

华泰证券	2021011500000417	蓝思科技	2021-01-15	3,095,001.00	81,900.00	14	6.40%	7,703.08	-	-
华泰证券	2021011500000421	亿纬锂能	2021-01-15	644,000.00	7,000.00	14	4.40%	1,101.94	-	-
华泰证券	2021010400000191	同花顺	2021-01-04	1,134,270.00	9,000.00	28	4.40%	3,881.64	-	-
华泰证券	2021010400000195	东方财富	2021-01-04	15,134,000.00	470,000.00	28	5.40%	63,562.80	-	-
华泰证券	20210118000009218	东方财富	2021-01-18	32,113,000.00	850,000.00	14	5.40%	67,437.30	-	-
华泰证券	20210118000009332	亿纬锂能	2021-01-18	14,707,830.00	156,300.00	14	3.40%	19,446.98	-	-
华泰证券	2021010500000358	东方财富	2021-01-05	45,402.00	1,400.00	28	3.40%	120.12	-	-
华泰证券	2021010500000362	沃森生物	2021-01-05	1,064,840.00	28,000.00	28	3.40%	2,815.96	-	-
华泰证券	2021011900000165	华大基因	2021-01-19	624,204.00	4,200.00	14	4.40%	1,068.06	-	-
华泰证券	2021012000000224	东方财富	2021-01-20	524,300.00	14,000.00	14	4.40%	897.12	-	-
华泰证券	20210120000005916	蓝思科技	2021-01-20	1,807,920.00	46,500.00	14	4.40%	3,093.58	-	-
华泰证券	20210120000005918	蓝思科技	2021-01-20	346,032.00	8,900.00	14	3.40%	457.52	-	-
华泰证券	2021012100000315	华大基因	2021-01-21	1,163,400.00	7,000.00	14	3.40%	1,538.32	-	-
华泰证券	2021012100012311	沃森生物	2021-01-21	4,575,375.00	122,500.00	14	3.40%	6,049.68	-	-
华泰证券	2021012100012313	东方财富	2021-01-21	833,280.00	21,000.00	14	4.40%	1,425.90	-	-
华泰证券	2021012200000351	华大基因	2021-01-22	1,993,712.00	11,200.00	14	5.40%	4,186.84	-	-
华泰证券	2021011100000305	澜起科技	2021-01-11	18,164,000.00	200,000.00	28	3.40%	48,033.72	-	-
华泰证券	2021012500000264	智飞生物	2021-01-25	918,500.00	5,500.00	14	3.40%	1,214.50	-	-
华泰证券	20210125000008568	蓝思科技	2021-01-25	496,720.00	14,000.00	14	3.40%	656.74	-	-
华泰证券	20210125000008570	蓝思科技	2021-01-25	1,241,800.00	35,000.00	14	3.40%	1,641.92	-	-
华泰证券	20210125000008766	泰格医药	2021-01-25	3,351,425.00	17,500.00	14	3.40%	4,431.28	-	-
华泰证券	20210126000006530	蓝思科技	2021-01-26	52,665.00	1,500.00	14	3.40%	69.58	-	-
华泰证券	2021011500000419	亿纬锂能	2021-01-15	1,932,000.00	21,000.00	28	4.40%	8,028.42	-	-
华泰证券	2021011800000287	中国通号	2021-01-18	2,999,934.00	492,600.00	28	2.00%	5,166.46	-	-
华泰证券	2021011800000289	亿纬锂能	2021-01-18	1,646,750.00	17,500.00	28	4.40%	6,239.37	-	-
华泰证券	20210119000007934	亿纬锂能	2021-01-19	960,750.00	10,500.00	28	4.40%	3,522.90	-	-
华泰证券	2021012000000220	亿纬锂能	2021-01-20	8,400,938.00	80,600.00	28	4.40%	29,776.62	-	-
华泰证券	2021012000000222	智飞生物	2021-01-20	3,978,800.00	28,000.00	28	4.40%	14,102.70	-	-
华泰证券	20210129000001805	亿纬锂能	2021-01-29	745,500.00	7,000.00	14	4.40%	1,822.40	-	-
华泰证券	20210129000001807	蓝思科技	2021-01-29	2,735,460.00	81,900.00	14	6.40%	9,726.00	-	-
华泰证券	2021020100000238	东方财富	2021-02-01	186,576.00	5,200.00	14	4.40%	387.60	-	-
华泰证券	20210201000009316	东方财富	2021-02-01	30,498,000.00	850,000.00	14	5.40%	77,769.90	-	-
华泰证券	20210201000009320	亿纬锂能	2021-02-01	16,072,329.00	156,300.00	14	3.40%	25,804.98	-	-
华泰证券	2021020200000375	沃森生物	2021-02-02	600,990.00	13,800.00	14	4.40%	1,175.20	-	-
华泰证券	20210202000008615	华大基因	2021-02-02	613,116.00	4,200.00	14	4.40%	1,199.04	-	-
华泰证券	20210203000006532	东方财富	2021-02-03	494,760.00	14,000.00	14	4.40%	907.05	-	-
华泰证券	20210203000006818	蓝思科技	2021-02-03	1,442,895.00	46,500.00	14	4.40%	2,645.25	-	-
华泰证券	2021020400013799	沃森生物	2021-02-04	5,258,925.00	122,500.00	14	3.40%	6,953.52	-	-
华泰证券	2021020400013801	东方财富	2021-02-04	743,190.00	21,000.00	14	4.40%	1,271.62	-	-
华泰证券	2021020800000380	乐普医疗	2021-02-08	1,668,744.00	53,900.00	14	3.40%	2,206.40	-	-
华泰证券	20210208000008536	泰格医药	2021-02-08	3,253,425.00	17,500.00	14	3.40%	4,301.78	-	-
华泰证券	20210126000006182	沃森生物	2021-01-26	280,140.00	7,000.00	28	4.40%	958.72	-	-
华泰证券	2021020900000451	传音控股	2021-02-09	637,520.00	2,600.00	14	3.80%	942.06	-	-

华泰证券	2021012700000576	中国通号	2021-01-27	2,727,244.00	465,400.00	28	2.00%	4,242.28	-	-
华泰证券	2021012800009720	东方财富	2021-01-28	506,800.00	14,000.00	28	4.40%	1,734.32	-	-
华泰证券	2021012900000184	沃森生物	2021-01-29	546,480.00	13,800.00	28	5.40%	2,295.16	-	-
华泰证券	2021020100000240	华大基因	2021-02-01	435,860.00	3,100.00	28	4.40%	1,491.56	-	-
华泰证券	2021020100009318	东方财富	2021-02-01	16,863,600.00	470,000.00	28	5.40%	70,827.12	-	-
华泰证券	2021020200000377	同花顺	2021-02-02	456,475.00	3,100.00	28	4.40%	1,562.12	-	-
华泰证券	2021020200000379	乐普医疗	2021-02-02	433,048.00	14,800.00	28	4.40%	1,482.04	-	-
华泰证券	2021020200009125	沃森生物	2021-02-02	1,219,400.00	28,000.00	28	3.40%	3,224.76	-	-
华泰证券	2021020200009127	东方财富	2021-02-02	51,590.00	1,400.00	28	3.40%	136.36	-	-
华泰证券	2021020400000303	康泰生物	2021-02-04	434,520.00	2,400.00	28	5.40%	1,825.04	-	-
华泰证券	2021021800000877	智飞生物	2021-02-18	703,259.00	3,700.00	14	4.40%	1,203.30	-	-
华泰证券	2021021800000881	沃森生物	2021-02-18	1,314,873.00	24,300.00	14	4.40%	2,249.94	-	-
华泰证券	2021021800000883	蓝思科技	2021-02-18	675,990.00	21,000.00	14	4.40%	1,156.68	-	-
华泰证券	2021021800040046	亿纬锂能	2021-02-18	16,192,680.00	156,300.00	14	3.40%	21,410.34	-	-
华泰证券	2021021800041546	沃森生物	2021-02-18	6,628,475.00	122,500.00	14	3.40%	8,764.28	-	-
华泰证券	2021021900000537	温氏股份	2021-02-19	1,201,959.00	63,900.00	14	3.40%	1,589.28	-	-
华泰证券	2021021900001423	同花顺	2021-02-19	1,523,018.00	9,800.00	14	3.40%	2,013.76	-	-
华泰证券	2021020800007670	澜起科技	2021-02-08	19,100,000.00	200,000.00	28	3.40%	50,508.92	-	-
华泰证券	2021022300000207	乐普医疗	2021-02-23	1,060,076.00	33,200.00	14	3.40%	1,401.68	-	-
华泰证券	2021030100000244	爱尔眼科	2021-03-01	1,284,825.00	18,500.00	14	3.40%	1,698.76	-	-
华泰证券	2021030100000246	同花顺	2021-03-01	1,112,211.00	8,100.00	14	3.40%	1,470.56	-	-
华泰证券	2021030100000247	东方财富	2021-03-01	1,369,121.00	43,700.00	14	3.40%	1,810.34	-	-
华泰证券	2021030200000190	蓝思科技	2021-03-02	504,966.00	15,400.00	14	3.40%	667.66	-	-
华泰证券	2021030200000192	亿纬锂能	2021-03-02	5,879,720.00	64,400.00	14	3.40%	7,774.34	-	-
华泰证券	2021021800000879	爱尔眼科	2021-02-18	2,738,044.00	31,100.00	28	3.40%	7,240.52	-	-
华泰证券	2021021800040040	中国通号	2021-02-18	2,748,708.00	492,600.00	28	2.00%	4,275.88	-	-
华泰证券	2021021800041548	智飞生物	2021-02-18	5,321,960.00	28,000.00	28	4.40%	18,212.88	-	-
华泰证券	2021021800041550	亿纬锂能	2021-02-18	2,175,600.00	21,000.00	28	4.40%	7,445.48	-	-
华泰证券	2021030500000410	康泰生物	2021-03-05	1,541,916.00	10,800.00	14	3.40%	2,038.82	-	-
华泰证券	2021030500000416	泰格医药	2021-03-05	1,621,155.00	11,500.00	14	3.40%	2,143.54	-	-
华泰证券	20210223000006710	沃森生物	2021-02-23	360,850.00	7,000.00	28	4.40%	1,234.80	-	-
华泰证券	20210224000006458	中国通号	2021-02-24	2,722,590.00	465,400.00	28	2.00%	4,235.28	-	-
华泰证券	2021022500000588	中国通号	2021-02-25	189,120.00	32,000.00	28	1.80%	264.88	-	-
华泰证券	2021031100000307	智飞生物	2021-03-11	159,000.00	1,000.00	14	3.40%	210.28	-	-
华泰证券	20210226000003840	沃森生物	2021-02-26	632,178.00	13,800.00	28	5.40%	2,655.24	-	-
华泰证券	2021031200000271	智飞生物	2021-03-12	1,526,760.00	9,000.00	14	3.40%	2,018.66	-	-
华泰证券	2021030200004713	同花顺	2021-03-02	397,420.00	3,100.00	28	4.40%	1,359.96	-	-
华泰证券	2021030200004715	东方财富	2021-03-02	43,022.00	1,400.00	28	3.40%	113.68	-	-
华泰证券	2021030200004837	沃森生物	2021-03-02	1,278,480.00	28,000.00	28	3.40%	3,381.00	-	-
华泰证券	2021030200004839	乐普医疗	2021-03-02	459,984.00	14,800.00	28	4.40%	1,574.16	-	-
华泰证券	2021031600006418	亿纬锂能	2021-03-16	5,267,920.00	64,400.00	14	3.40%	6,965.42	-	-
华泰证券	2021030300000704	信维通信	2021-03-03	420,000.00	12,500.00	28	3.40%	1,110.76	-	-
华泰证券	2021030300000706	沃森生物	2021-03-03	1,625,900.00	35,500.00	28	3.40%	4,299.68	-	-

华泰证券	2021030300000708	爱尔眼科	2021-03-03	6,208,466.00	90,200.00	28	3.40%	16,418.08	-	-
华泰证券	2021031900000191	泰格医药	2021-03-19	1,516,620.00	11,500.00	14	3.40%	2,005.36	-	-
华泰证券	2021030800009001	澜起科技	2021-03-08	14,900,000.00	200,000.00	28	3.40%	40,809.38	-	-
华泰证券	2021030900000367	华大基因	2021-03-09	1,854,930.00	15,400.00	28	3.40%	4,905.32	-	-
华泰证券	2021030900000369	爱尔眼科	2021-03-09	4,766,817.00	87,900.00	28	1.80%	6,673.52	-	-
华泰证券	2021031000000164	中国通号	2021-03-10	265,080.00	47,000.00	28	1.80%	371.00	-	-
华泰证券	2021031000000166	华大基因	2021-03-10	565,551.00	4,700.00	28	3.40%	1,495.48	-	-
华泰证券	2021031100000309	智飞生物	2021-03-11	1,113,000.00	7,000.00	28	3.40%	2,943.36	-	-
华泰证券	2021031100000310	华大基因	2021-03-11	169,960.00	1,400.00	28	3.40%	449.40	-	-
					1,200,000.0					
华泰证券	2021040200000265	东方财富	2021-04-02	34,644,000.00	0	7	3.40%	22,903.51	-	-
华泰证券	2021031600000626	智飞生物	2021-03-16	2,323,300.00	14,000.00	28	3.40%	6,143.76	-	-
华泰证券	2021033000008607	亿纬锂能	2021-03-30	4,810,680.00	64,400.00	14	3.40%	6,360.76	-	-
华泰证券	2021031700000620	亿纬锂能	2021-03-17	593,600.00	7,000.00	28	3.40%	1,569.68	-	-
华泰证券	2021031800034044	亿纬锂能	2021-03-18	1,782,900.00	21,000.00	28	4.40%	6,101.48	-	-
华泰证券	2021031800035262	爱尔眼科	2021-03-18	1,873,775.00	31,100.00	28	3.40%	4,955.16	-	-
华泰证券	2021031800035264	智飞生物	2021-03-18	4,922,400.00	28,000.00	28	4.40%	16,845.64	-	-
华泰证券	2021031900000189	智飞生物	2021-03-19	2,361,800.00	14,000.00	28	3.40%	6,245.68	-	-
华泰证券	2021032400006250	中国通号	2021-03-24	2,657,434.00	465,400.00	28	2.00%	4,133.92	-	-
华泰证券	2021040700000297	芒果超媒	2021-04-07	685,190.00	11,000.00	14	3.40%	905.94	-	-
华泰证券	2021032500000472	亿纬锂能	2021-03-25	373,410.00	5,400.00	28	3.40%	987.56	-	-
华泰证券	2021032500006340	中国通号	2021-03-25	181,120.00	32,000.00	28	1.80%	253.68	-	-
华泰证券	2021032600000331	亿纬锂能	2021-03-26	3,005,200.00	40,000.00	28	3.40%	7,946.96	-	-
华泰证券	2021033000008601	东方财富	2021-03-30	39,130.00	1,400.00	28	3.40%	103.60	-	-
华泰证券	2021033000008603	沃森生物	2021-03-30	1,302,280.00	28,000.00	28	3.40%	3,443.72	-	-
华泰证券	2021033000008605	乐普医疗	2021-03-30	430,532.00	14,800.00	28	4.40%	1,473.36	-	-
华泰证券	2021033000008845	同花顺	2021-03-30	383,501.00	3,100.00	28	4.40%	1,312.36	-	-
华泰证券	2021041300007917	亿纬锂能	2021-04-13	4,482,240.00	64,400.00	14	3.40%	5,926.48	-	-
华泰证券	2021033100006114	沃森生物	2021-03-31	1,604,245.00	35,500.00	28	3.40%	4,242.28	-	-
华泰证券	2021033100006766	信维通信	2021-03-31	354,875.00	12,500.00	28	3.40%	938.56	-	-
华泰证券	2021040600016598	爱尔眼科	2021-04-06	5,534,184.00	87,900.00	28	1.80%	8,301.30	-	-
华泰证券	2021040700008547	中国通号	2021-04-07	269,310.00	47,000.00	28	1.80%	390.63	-	-
华泰证券	2021040800004889	华大基因	2021-04-08	170,646.00	1,400.00	28	3.40%	451.36	-	-
华泰证券	2021040800005125	智飞生物	2021-04-08	1,326,500.00	7,000.00	28	3.40%	3,507.84	-	-
华泰证券	2021041900000468	沃森生物	2021-04-19	843,972.00	15,900.00	14	3.40%	1,355.07	-	-
华泰证券	2021042000000929	东方财富	2021-04-20	988,696.00	33,200.00	14	3.40%	1,494.08	-	-
华泰证券	2021042000000931	澜起科技	2021-04-20	10,035,000.00	150,000.00	14	3.40%	15,164.00	-	-
华泰证券	2021041300008407	智飞生物	2021-04-13	2,528,400.00	14,000.00	28	3.40%	6,686.12	-	-
华泰证券	2021042700011518	亿纬锂能	2021-04-27	5,302,696.00	64,400.00	14	3.40%	7,011.34	-	-
华泰证券	2021041400000188	宋城演艺	2021-04-14	232,560.00	11,400.00	28	3.40%	614.88	-	-
华泰证券	2021041400000190	健帆生物	2021-04-14	435,855.00	4,900.00	28	3.40%	1,152.48	-	-
华泰证券	2021041500000208	智飞生物	2021-04-15	1,265,600.00	7,000.00	28	3.40%	3,346.84	-	-
华泰证券	2021041500030086	智飞生物	2021-04-15	5,062,400.00	28,000.00	28	4.40%	17,324.72	-	-
华泰证券	2021041500031038	爱尔眼科	2021-04-15	1,858,225.00	31,100.00	28	3.40%	4,914.00	-	-

华泰证券	2021042900000355	沃森生物	2021-04-29	669,978.00	11,400.00	14	3.40%	885.92	-	-
华泰证券	2021042100007957	中国通号	2021-04-21	2,671,396.00	465,400.00	28	2.00%	4,155.48	-	-
华泰证券	2021042200000358	康泰生物	2021-04-22	451,825.00	3,100.00	28	3.40%	1,194.76	-	-
华泰证券	2021042200007384	中国通号	2021-04-22	184,000.00	32,000.00	28	1.80%	257.60	-	-
华泰证券	2021050600000539	宋城演艺	2021-05-06	26,728.00	1,300.00	14	3.40%	35.28	-	-
华泰证券	2021050600000541	沃森生物	2021-05-06	3,902,500.00	70,000.00	14	3.40%	5,159.98	-	-
华泰证券	2021050600000543	温氏股份	2021-05-06	28,340.00	2,000.00	14	3.40%	37.52	-	-
华泰证券	2021050600000545	蓝思科技	2021-05-06	28,391.00	1,100.00	14	3.40%	37.52	-	-
华泰证券	2021050600000547	乐普医疗	2021-05-06	31,000.00	1,000.00	14	3.40%	41.02	-	-
华泰证券	2021042300005720	亿纬锂能	2021-04-23	3,424,000.00	40,000.00	28	3.40%	9,054.64	-	-
华泰证券	2021050700000312	乐普医疗	2021-05-07	29,950.00	1,000.00	14	3.40%	39.62	-	-
华泰证券	2021050700000314	宋城演艺	2021-05-07	25,285.00	1,300.00	14	3.40%	33.46	-	-
华泰证券	2021050700000316	温氏股份	2021-05-07	28,340.00	2,000.00	14	3.40%	37.52	-	-
华泰证券	2021042600000637	亿纬锂能	2021-04-26	591,990.00	7,000.00	28	3.40%	1,565.48	-	-
华泰证券	2021051000000279	温氏股份	2021-05-10	27,400.00	2,000.00	14	3.40%	36.26	-	-
华泰证券	2021051000000281	宋城演艺	2021-05-10	25,740.00	1,300.00	14	3.40%	34.02	-	-
华泰证券	2021051000000283	乐普医疗	2021-05-10	30,030.00	1,000.00	14	3.40%	39.76	-	-
华泰证券	2021042700000282	同花顺	2021-04-27	389,130.00	3,500.00	28	3.40%	1,029.00	-	-
华泰证券	2021042700011436	同花顺	2021-04-27	344,658.00	3,100.00	28	4.40%	1,179.64	-	-
华泰证券	2021042700011438	东方财富	2021-04-27	42,294.00	1,400.00	28	3.40%	111.72	-	-
华泰证券	2021042700011516	沃森生物	2021-04-27	1,727,320.00	28,000.00	28	3.40%	4,567.92	-	-
华泰证券	2021051100000448	温氏股份	2021-05-11	27,580.00	2,000.00	14	3.40%	36.54	-	-
华泰证券	2021051100000452	宋城演艺	2021-05-11	25,454.00	1,300.00	14	3.40%	33.60	-	-
华泰证券	2021051100000454	乐普医疗	2021-05-11	30,410.00	1,000.00	14	3.40%	40.18	-	-
华泰证券	2021051100009773	亿纬锂能	2021-05-11	5,569,312.00	64,400.00	14	3.40%	7,363.86	-	-
华泰证券	2021042800009122	信维通信	2021-04-28	350,625.00	12,500.00	28	3.40%	927.08	-	-
华泰证券	2021042800010642	沃森生物	2021-04-28	2,180,765.00	35,500.00	28	3.40%	5,766.88	-	-
华泰证券	2021051200000590	康泰生物	2021-05-12	2,312,604.00	12,600.00	14	3.40%	3,057.74	-	-
华泰证券	2021051200000592	温氏股份	2021-05-12	27,960.00	2,000.00	14	3.40%	36.96	-	-
华泰证券	2021051200000594	乐普医疗	2021-05-12	30,480.00	1,000.00	14	3.40%	40.32	-	-
华泰证券	2021051200000596	宋城演艺	2021-05-12	24,570.00	1,300.00	14	3.40%	32.48	-	-
华泰证券	2021051200000598	三环集团	2021-05-12	36,420.00	1,000.00	14	3.40%	48.16	-	-
华泰证券	2021051300000355	温氏股份	2021-05-13	19,292.00	1,400.00	14	3.40%	25.48	-	-
华泰证券	2021051300000357	三环集团	2021-05-13	35,900.00	1,000.00	14	3.40%	47.46	-	-
华泰证券	2021051300000359	乐普医疗	2021-05-13	30,430.00	1,000.00	14	3.40%	40.18	-	-
华泰证券	2021051300000361	沃森生物	2021-05-13	555,408.00	8,700.00	14	3.40%	734.44	-	-
华泰证券	2021051300000363	信维通信	2021-05-13	25,520.00	1,000.00	14	3.40%	33.74	-	-
华泰证券	2021051300000365	同花顺	2021-05-13	2,830,575.00	27,500.00	14	3.40%	3,742.62	-	-
华泰证券	2021051300025172	沃森生物	2021-05-13	727,776.00	11,400.00	14	3.40%	962.22	-	-
华泰证券	2021051700000478	温氏股份	2021-05-17	14,030.00	1,000.00	14	3.40%	18.62	-	-
华泰证券	2021051700000480	三环集团	2021-05-17	38,000.00	1,000.00	14	3.40%	50.26	-	-
华泰证券	2021051700000482	沃森生物	2021-05-17	1,470,000.00	21,000.00	14	3.40%	1,943.62	-	-
华泰证券	2021051800000304	三环集团	2021-05-18	37,400.00	1,000.00	14	3.40%	49.42	-	-

华泰证券	2021051800000306	信维通信	2021-05-18	26,600.00	1,000.00	14	3.40%	35.14	-	-
华泰证券	2021051800000308	沃森生物	2021-05-18	144,501.00	2,100.00	14	3.40%	191.10	-	-
华泰证券	2021050600028126	中国通号	2021-05-06	264,140.00	47,000.00	28	1.80%	369.88	-	-
华泰证券	2021050600028128	爱尔眼科	2021-05-06	6,363,081.00	87,900.00	28	1.80%	8,908.20	-	-
华泰证券	2021050600029208	华大基因	2021-05-06	170,030.00	1,400.00	28	3.40%	449.68	-	-
华泰证券	2021052000000391	信维通信	2021-05-20	26,800.00	1,000.00	14	3.40%	35.42	-	-
华泰证券	2021052000016849	温氏股份	2021-05-20	28,200.00	2,000.00	14	3.40%	37.24	-	-
华泰证券	2021052000016851	宋城演艺	2021-05-20	23,881.00	1,300.00	14	3.40%	31.64	-	-
华泰证券	2021052000016853	乐普医疗	2021-05-20	32,190.00	1,000.00	14	3.40%	42.56	-	-
华泰证券	2021052000017059	沃森生物	2021-05-20	4,818,800.00	70,000.00	14	3.40%	6,371.54	-	-
华泰证券	2021052000017061	蓝思科技	2021-05-20	30,998.00	1,100.00	14	3.40%	41.02	-	-
华泰证券	2021052100000363	汇川技术	2021-05-21	273,450.00	3,000.00	14	3.40%	361.62	-	-
华泰证券	20210521000005938	温氏股份	2021-05-21	27,560.00	2,000.00	14	3.40%	36.40	-	-
华泰证券	20210521000005940	乐普医疗	2021-05-21	31,730.00	1,000.00	14	3.40%	42.00	-	-
华泰证券	20210521000005942	宋城演艺	2021-05-21	23,582.00	1,300.00	14	3.40%	31.22	-	-
华泰证券	20210524000005448	温氏股份	2021-05-24	27,380.00	2,000.00	14	3.40%	36.26	-	-
华泰证券	20210524000005450	宋城演艺	2021-05-24	23,647.00	1,300.00	14	3.40%	31.22	-	-
华泰证券	20210524000005452	乐普医疗	2021-05-24	31,220.00	1,000.00	14	3.40%	41.30	-	-
华泰证券	20210511000009775	智飞生物	2021-05-11	2,937,480.00	14,000.00	28	3.40%	7,768.04	-	-
华泰证券	20210525000008938	宋城演艺	2021-05-25	23,998.00	1,300.00	14	3.40%	31.78	-	-
华泰证券	20210525000008940	亿纬锂能	2021-05-25	6,909,476.00	64,400.00	14	3.40%	9,135.84	-	-
华泰证券	20210525000008942	温氏股份	2021-05-25	28,020.00	2,000.00	14	3.40%	37.10	-	-
华泰证券	20210525000008944	乐普医疗	2021-05-25	31,890.00	1,000.00	14	3.40%	42.14	-	-
华泰证券	20210512000009919	宋城演艺	2021-05-12	215,460.00	11,400.00	28	3.40%	569.80	-	-
华泰证券	2021052600010270	康泰生物	2021-05-26	2,250,486.00	12,600.00	14	3.40%	2,975.70	-	-
华泰证券	2021052600010736	温氏股份	2021-05-26	28,120.00	2,000.00	14	3.40%	37.24	-	-
华泰证券	2021052600010740	三环集团	2021-05-26	37,080.00	1,000.00	14	3.40%	49.00	-	-
华泰证券	2021052600010742	宋城演艺	2021-05-26	23,959.00	1,300.00	14	3.40%	31.64	-	-
华泰证券	2021052600010744	乐普医疗	2021-05-26	32,760.00	1,000.00	14	3.40%	43.26	-	-
华泰证券	2021051300025174	爱尔眼科	2021-05-13	2,332,189.00	31,100.00	28	3.40%	6,167.28	-	-
华泰证券	2021051300025176	智飞生物	2021-05-13	5,846,400.00	28,000.00	28	4.40%	20,007.68	-	-
华泰证券	2021051300025178	智飞生物	2021-05-13	1,461,600.00	7,000.00	28	3.40%	3,865.12	-	-
华泰证券	2021052700000652	温氏股份	2021-05-27	28,540.00	2,000.00	14	3.40%	37.80	-	-
华泰证券	2021052700000654	宋城演艺	2021-05-27	23,738.00	1,300.00	14	3.40%	31.36	-	-
华泰证券	2021052700000656	沃森生物	2021-05-27	614,341.00	9,100.00	14	3.40%	812.28	-	-
华泰证券	2021052700018443	乐普医疗	2021-05-27	34,840.00	1,000.00	14	3.40%	46.06	-	-
华泰证券	2021052700018445	沃森生物	2021-05-27	587,337.00	8,700.00	14	3.40%	776.58	-	-
华泰证券	2021052700018447	信维通信	2021-05-27	28,120.00	1,000.00	14	3.40%	37.24	-	-
华泰证券	2021052700018449	三环集团	2021-05-27	38,420.00	1,000.00	14	3.40%	50.82	-	-
华泰证券	2021052700018451	沃森生物	2021-05-27	769,614.00	11,400.00	14	3.40%	1,017.66	-	-
华泰证券	2021052700018453	温氏股份	2021-05-27	19,978.00	1,400.00	14	3.40%	26.46	-	-
华泰证券	2021052800000468	温氏股份	2021-05-28	19,698.00	1,400.00	14	3.40%	26.04	-	-
华泰证券	2021052800000470	三环集团	2021-05-28	37,590.00	1,000.00	14	3.40%	49.70	-	-

华泰证券	202105280000472	宋城演艺	2021-05-28	23,231.00	1,300.00	14	3.40%	30.66	-	-
华泰证券	202105280000474	乐普医疗	2021-05-28	33,950.00	1,000.00	14	3.40%	44.94	-	-
华泰证券	2021060100002563	三环集团	2021-06-01	37,820.00	1,000.00	14	3.40%	49.98	-	-
华泰证券	2021060100002565	信维通信	2021-06-01	29,080.00	1,000.00	14	3.40%	38.50	-	-
华泰证券	2021051900002611	中国通号	2021-05-19	2,638,818.00	465,400.00	28	1.80%	3,694.32	-	-
华泰证券	2021052000016913	中国通号	2021-05-20	181,760.00	32,000.00	28	1.80%	254.52	-	-
华泰证券	20210603000010758	蓝思科技	2021-06-03	31,856.00	1,100.00	14	3.40%	42.14	-	-
华泰证券	2021052100006036	亿纬锂能	2021-05-21	4,028,800.00	40,000.00	28	3.40%	10,654.00	-	-
华泰证券	2021060400000256	汇川技术	2021-06-04	335,280.00	5,500.00	14	3.40%	443.38	-	-
华泰证券	2021060400000258	信维通信	2021-06-04	229,360.00	8,000.00	14	3.40%	303.24	-	-
华泰证券	2021060400005333	汇川技术	2021-06-04	182,880.00	3,000.00	14	3.40%	241.78	-	-
华泰证券	2021052400006150	亿纬锂能	2021-05-24	715,400.00	7,000.00	28	3.40%	1,891.96	-	-
华泰证券	2021060700000879	沃森生物	2021-06-07	2,269,355.00	34,100.00	14	3.40%	3,000.62	-	-
华泰证券	2021052500008982	同花顺	2021-05-25	421,960.00	3,500.00	28	3.40%	1,115.80	-	-
华泰证券	2021052500009192	东方财富	2021-05-25	53,172.00	1,400.00	28	3.40%	140.56	-	-
华泰证券	2021052500009684	沃森生物	2021-05-25	1,901,480.00	28,000.00	28	3.40%	5,028.24	-	-
华泰证券	2021060800000552	亿联网络	2021-06-08	424,050.00	5,500.00	14	3.40%	560.70	-	-
华泰证券	2021060800000554	沃森生物	2021-06-08	1,132,191.00	17,100.00	14	3.40%	1,497.02	-	-
华泰证券	2021060800000556	汇川技术	2021-06-08	3,027,500.00	50,000.00	14	3.40%	4,003.02	-	-
华泰证券	2021060800005761	亿纬锂能	2021-06-08	6,293,812.00	64,400.00	14	3.40%	8,321.88	-	-
华泰证券	2021052600010738	沃森生物	2021-05-26	2,440,625.00	35,500.00	28	3.40%	6,454.00	-	-
华泰证券	2021052600010746	信维通信	2021-05-26	346,250.00	12,500.00	28	3.40%	915.60	-	-
华泰证券	2021061000007334	沃森生物	2021-06-10	585,949.00	9,100.00	14	3.40%	774.76	-	-
华泰证券	2021061000007336	沃森生物	2021-06-10	560,193.00	8,700.00	14	3.40%	740.74	-	-
华泰证券	2021061000007338	沃森生物	2021-06-10	734,046.00	11,400.00	14	3.40%	970.62	-	-
华泰证券	2021061000007926	信维通信	2021-06-10	28,400.00	1,000.00	14	3.40%	37.52	-	-
华泰证券	2021061100003556	乐普医疗	2021-06-11	30,930.00	1,000.00	14	3.40%	40.88	-	-
华泰证券	2021061500000797	中微公司	2021-06-15	6,710,500.00	50,000.00	14	3.40%	8,872.78	-	-
华泰证券	2021061500000799	华润微	2021-06-15	759,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,003.52	-	-
华泰证券	2021061600000534	康泰生物	2021-06-16	1,471,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,945.72	-	-
华泰证券	2021061600000536	欧普康视	2021-06-16	577,551.00	5,900.00	14	3.40%	763.70	-	-
华泰证券	2021060300010556	中国通号	2021-06-03	266,490.00	47,000.00	28	1.80%	372.96	-	-
华泰证券	2021060300010760	爱尔眼科	2021-06-03	7,515,450.00	87,900.00	28	1.80%	10,521.56	-	-
华泰证券	2021061700000599	欧普康视	2021-06-17	579,675.00	5,900.00	14	3.40%	766.50	-	-
华泰证券	2021061800000932	先导智能	2021-06-18	1,829,100.00	30,000.00	14	3.40%	2,418.50	-	-
华泰证券	2021061800000934	英科医疗	2021-06-18	583,687.00	5,900.00	14	3.40%	771.82	-	-
华泰证券	2021061800000940	华润微	2021-06-18	1,471,572.00	16,400.00	14	3.40%	1,945.72	-	-
华泰证券	2021061800000944	阳光电源	2021-06-18	1,989,800.00	20,000.00	14	3.40%	2,631.02	-	-
华泰证券	2021061800000946	芒果超媒	2021-06-18	17,082,500.00	250,000.00	14	3.40%	22,586.90	-	-
华泰证券	2021061800000954	亿纬锂能	2021-06-18	1,054,500.00	10,000.00	14	3.40%	1,394.26	-	-
华泰证券	2021062100000661	华熙生物	2021-06-21	7,763,700.00	30,000.00	14	3.40%	10,265.36	-	-
华泰证券	2021062100000667	先导智能	2021-06-21	1,220,400.00	20,000.00	14	3.40%	1,613.64	-	-
华泰证券	2021062100000671	阳光电源	2021-06-21	2,056,000.00	20,000.00	14	3.40%	2,718.52	-	-

华泰证券	2021062100000713	沪硅产业	2021-06-21	1,501,000.00	50,000.00	14	3.40%	1,984.64	-	-
华泰证券	2021062100011643	沃森生物	2021-06-21	2,034,065.00	34,100.00	14	3.40%	2,689.54	-	-
华泰证券	2021060800005759	智飞生物	2021-06-08	2,617,720.00	14,000.00	28	3.40%	6,922.44	-	-
华泰证券	2021062200001296	华润微	2021-06-22	1,181,040.00	13,300.00	14	3.40%	1,561.56	-	-
华泰证券	2021062200001298	温氏股份	2021-06-22	1,251,000.00	90,000.00	14	3.40%	1,654.10	-	-
华泰证券	2021062200001300	先导智能	2021-06-22	1,198,000.00	20,000.00	14	3.40%	1,583.96	-	-
华泰证券	2021062200001302	阳光电源	2021-06-22	1,020,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,349.88	-	-
华泰证券	2021062200011578	亿联网络	2021-06-22	415,250.00	5,500.00	14	3.40%	549.08	-	-
华泰证券	2021062200011654	汇川技术	2021-06-22	3,375,500.00	50,000.00	14	3.40%	4,463.20	-	-
华泰证券	2021062200011656	沃森生物	2021-06-22	1,050,282.00	17,100.00	14	3.40%	1,388.66	-	-
华泰证券	2021062200011768	亿纬锂能	2021-06-22	6,536,600.00	64,400.00	14	3.40%	8,642.90	-	-
华泰证券	2021062300000994	先导智能	2021-06-23	1,769,700.00	30,000.00	14	3.40%	2,339.96	-	-
华泰证券	2021062300000996	阳光电源	2021-06-23	1,025,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,355.34	-	-
华泰证券	2021061000007928	爱尔眼科	2021-06-10	2,706,011.00	31,100.00	28	3.40%	7,155.96	-	-
华泰证券	2021061000008082	智飞生物	2021-06-10	1,281,000.00	7,000.00	28	3.40%	3,387.44	-	-
华泰证券	2021061000008084	智飞生物	2021-06-10	5,124,000.00	28,000.00	28	4.40%	17,535.56	-	-
华泰证券	2021062400000692	沪硅产业	2021-06-24	1,125,930.00	39,000.00	14	3.40%	1,488.76	-	-
华泰证券	2021062400000694	华润微	2021-06-24	880,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,164.38	-	-
华泰证券	2021062400000718	英科医疗	2021-06-24	1,021,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,350.16	-	-
华泰证券	2021062400000720	阳光电源	2021-06-24	1,069,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,413.58	-	-
华泰证券	2021062400000722	先导智能	2021-06-24	1,120,000.00	20,000.00	14	3.40%	1,480.92	-	-
华泰证券	2021062400008869	沃森生物	2021-06-24	543,543.00	9,100.00	14	3.40%	718.62	-	-
华泰证券	2021062400008871	沃森生物	2021-06-24	519,651.00	8,700.00	14	3.40%	687.12	-	-
华泰证券	2021062400008873	沃森生物	2021-06-24	680,922.00	11,400.00	14	3.40%	900.34	-	-
华泰证券	2021062400009067	信维通信	2021-06-24	31,690.00	1,000.00	14	3.40%	41.86	-	-
华泰证券	2021062500000484	英科医疗	2021-06-25	1,050,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,388.38	-	-
华泰证券	2021062500000486	沪硅产业	2021-06-25	795,984.00	27,600.00	14	3.40%	1,052.52	-	-
华泰证券	2021062500000488	华润微	2021-06-25	1,111,446.00	12,600.00	14	3.40%	1,469.58	-	-
华泰证券	2021062800000462	华润微	2021-06-28	890,300.00	10,000.00	14	3.40%	1,177.12	-	-
华泰证券	2021062900017921	中微公司	2021-06-29	8,094,500.00	50,000.00	14	3.40%	10,702.72	-	-
华泰证券	2021061600007187	中国通号	2021-06-16	2,592,278.00	465,400.00	28	1.80%	3,629.08	-	-
华泰证券	2021063000000595	中微公司	2021-06-30	3,318,400.00	20,000.00	14	3.40%	4,387.60	-	-
华泰证券	2021063000006121	欧普康视	2021-06-30	610,945.00	5,900.00	14	3.40%	807.80	-	-
华泰证券	2021063000006123	康泰生物	2021-06-30	1,490,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,970.08	-	-
华泰证券	2021061700017115	中国通号	2021-06-17	180,160.00	32,000.00	28	1.80%	252.28	-	-
华泰证券	2021070100000500	沪硅产业	2021-07-01	279,000.00	10,000.00	14	3.40%	368.90	-	-
华泰证券	2021070100013852	欧普康视	2021-07-01	619,500.00	5,900.00	14	3.40%	819.14	-	-
华泰证券	2021061800000956	沃森生物	2021-06-18	1,768,500.00	30,000.00	28	3.40%	4,676.84	-	-
华泰证券	2021070200000525	沪硅产业	2021-07-02	649,040.00	24,400.00	14	3.40%	858.20	-	-
华泰证券	2021070200000527	华润微	2021-07-02	1,327,590.00	14,900.00	14	3.40%	1,755.32	-	-
华泰证券	2021070200000533	英科医疗	2021-07-02	952,320.00	8,000.00	14	3.40%	1,259.16	-	-
华泰证券	2021070200010546	英科医疗	2021-07-02	702,336.00	5,900.00	14	3.40%	928.62	-	-
华泰证券	2021070200010548	阳光电源	2021-07-02	2,101,800.00	20,000.00	14	3.40%	2,779.00	-	-

华泰证券	2021070200010550	华润微	2021-07-03	1,461,240.0	16,400.00	14	3.40%	1,932.14	-	-
华泰证券	2021070500010881	沪硅产业	2021-07-03	1,387,000.0	50,000.00	14	3.40%	1,833.86	-	-
华泰证券	2021070500010883	华熙生物	2021-07-03	9,177,000.0	30,000.00	14	3.40%	12,134.08	-	-
华泰证券	2021070500011583	阳光电源	2021-07-03	2,154,400.0	20,000.00	14	3.40%	2,848.58	-	-
华泰证券	2021062200001304	爱尔眼科	2021-06-22	1,746,000.0	20,000.00	28	3.40%	4,617.20	-	-
华泰证券	2021070600001076	华润微	2021-07-06	860,300.0	10,000.00	14	3.40%	1,137.50	-	-
华泰证券	2021070600010718	亿纬锂能	2021-07-06	6,539,820.0	64,400.00	14	3.40%	8,647.10	-	-
华泰证券	2021070600011224	阳光电源	2021-07-06	1,053,000.0	10,000.00	14	3.40%	1,392.30	-	-
华泰证券	2021070600011310	亿联网络	2021-07-06	469,150.0	5,500.00	14	3.40%	620.34	-	-
华泰证券	2021062300018432	沃森生物	2021-06-23	2,167,985.0	35,500.00	28	3.40%	5,733.00	-	-
华泰证券	2021062300018492	信维通信	2021-06-23	395,125.0	12,500.00	28	3.40%	1,044.96	-	-
华泰证券	2021070700001681	华润微	2021-07-07	1,135,687.0	13,300.00	14	3.40%	1,501.64	-	-
华泰证券	2021070700001683	英科医疗	2021-07-07	1,161,500.0	10,000.00	14	3.40%	1,535.80	-	-
华泰证券	2021070700001685	阳光电源	2021-07-07	3,630,840.0	31,600.00	14	3.40%	4,800.74	-	-
华泰证券	2021070700015897	阳光电源	2021-07-07	1,149,000.0	10,000.00	14	3.40%	1,519.28	-	-
华泰证券	2021070800007553	华润微	2021-07-08	878,000.0	10,000.00	14	3.40%	1,160.88	-	-
华泰证券	2021070800007555	阳光电源	2021-07-08	1,183,500.0	10,000.00	14	3.40%	1,564.92	-	-
华泰证券	2021070800007557	信维通信	2021-07-08	32,100.0	1,000.00	14	3.40%	42.42	-	-
华泰证券	2021070800007659	先导智能	2021-07-08	1,283,200.00	20,000.00	14	3.40%	1,696.66	-	-
华泰证券	2021070800007663	沃森生物	2021-07-08	545,490.00	8,700.00	14	3.40%	721.28	-	-
华泰证券	2021070800007665	沃森生物	2021-07-08	714,780.00	11,400.00	14	3.40%	945.14	-	-
华泰证券	2021070800007667	沃森生物	2021-07-08	570,570.00	9,100.00	14	3.40%	754.46	-	-
华泰证券	2021070800007733	英科医疗	2021-07-08	1,132,400.00	10,000.00	14	3.40%	1,497.30	-	-
华泰证券	2021070800007735	沪硅产业	2021-07-08	1,152,840.00	39,000.00	14	3.40%	1,524.32	-	-
华泰证券	2021070900005621	华润微	2021-07-09	1,085,868.00	12,600.00	14	3.40%	1,435.70	-	-
华泰证券	2021070900005623	沪硅产业	2021-07-09	810,888.00	27,600.00	14	3.40%	1,072.12	-	-
华泰证券	2021070900005625	英科医疗	2021-07-09	1,194,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,579.90	-	-
华泰证券	2021071200003461	华润微	2021-07-12	868,300.00	10,000.00	14	3.40%	1,148.14	-	-
华泰证券	2021071300001216	阳光电源	2021-07-13	23,796,000.00	200,000.00	14	3.40%	31,463.60	-	-
华泰证券	2021071300019517	中微公司	2021-07-13	8,400,000.00	50,000.00	14	3.40%	11,106.62	-	-
华泰证券	2021071400006408	中微公司	2021-07-14	3,360,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,442.62	-	-
华泰证券	2021071400006410	康泰生物	2021-07-14	1,521,200.00	10,000.00	14	3.40%	2,011.38	-	-
华泰证券	2021071400006412	欧普康视	2021-07-14	603,452.00	5,900.00	14	3.40%	797.86	-	-
华泰证券	2021070100000502	乐普医疗	2021-07-01	1,595,000.00	50,000.00	28	3.40%	4,217.92	-	-
华泰证券	2021070100000504	同花顺	2021-07-01	1,417,130.00	13,000.00	28	3.40%	3,747.52	-	-
华泰证券	2021070100014010	中国通号	2021-07-01	267,430.00	47,000.00	28	1.80%	374.36	-	-
华泰证券	2021071500015036	欧普康视	2021-07-15	592,183.00	5,900.00	14	3.40%	783.02	-	-
华泰证券	2021071500016524	沪硅产业	2021-07-15	270,200.00	10,000.00	14	3.40%	357.28	-	-
华泰证券	2021070200000529	乐普医疗	2021-07-02	1,547,500.00	50,000.00	28	3.40%	4,092.20	-	-
华泰证券	2021070200000531	同花顺	2021-07-02	1,381,379.00	12,700.00	28	3.40%	3,652.88	-	-
华泰证券	2021071600000456	英科医疗	2021-07-16	721,680.00	6,000.00	14	3.40%	954.24	-	-
华泰证券	2021071600015840	英科医疗	2021-07-16	962,240.00	8,000.00	14	3.40%	1,272.32	-	-
华泰证券	2021071600015842	华润微	2021-07-16	1,328,072.00	16,400.00	14	3.40%	1,756.02	-	-

华泰证券	2021071600015846	华润微	2021-07-16	1,206,602.00	14,900.00	14	3.40%	1,595.44	-	-
华泰证券	2021071600016218	阳光电源	2021-07-16	2,518,000.00	20,000.00	14	3.40%	3,329.34	-	-
华泰证券	2021071600016222	沪硅产业	2021-07-16	662,460.00	24,400.00	14	3.40%	875.98	-	-
华泰证券	2021071600016224	英科医疗	2021-07-16	709,652.00	5,900.00	14	3.40%	938.28	-	-
华泰证券	2021070500000943	乐普医疗	2021-07-05	719,295.00	23,700.00	28	3.40%	1,902.04	-	-
华泰证券	2021071900012803	华熙生物	2021-07-19	8,790,900.00	30,000.00	14	3.40%	11,623.50	-	-
华泰证券	2021071900012805	沪硅产业	2021-07-19	1,349,000.00	50,000.00	14	3.40%	1,783.74	-	-
华泰证券	2021071900012843	阳光电源	2021-07-19	2,540,200.00	20,000.00	14	3.40%	3,358.74	-	-
华泰证券	2021070600001078	芒果超媒	2021-07-06	996,000.00	16,600.00	28	3.40%	2,633.96	-	-
华泰证券	2021070600010716	智飞生物	2021-07-06	2,408,140.00	14,000.00	28	3.40%	6,368.32	-	-
华泰证券	2021072000011955	阳光电源	2021-07-20	1,261,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,667.26	-	-
华泰证券	2021072000011957	华润微	2021-07-20	825,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,091.58	-	-
华泰证券	2021072000011961	亿纬锂能	2021-07-20	7,630,756.00	64,400.00	14	3.40%	10,089.52	-	-
华泰证券	2021070700001687	芒果超媒	2021-07-07	320,814.00	5,400.00	28	3.40%	848.40	-	-
华泰证券	2021072100000507	健帆生物	2021-07-21	684,600.00	8,400.00	14	3.40%	905.24	-	-
华泰证券	2021072100016715	华润微	2021-07-21	1,104,299.00	13,300.00	14	3.40%	1,460.20	-	-
华泰证券	2021072100016717	阳光电源	2021-07-21	4,360,168.00	31,600.00	14	3.40%	5,765.06	-	-
华泰证券	2021072100019975	阳光电源	2021-07-21	1,379,800.00	10,000.00	14	3.40%	1,824.34	-	-
华泰证券	2021072100019979	英科医疗	2021-07-21	1,149,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,519.42	-	-
华泰证券	2021070800007661	智飞生物	2021-07-08	1,274,350.00	7,000.00	28	3.40%	3,370.08	-	-
华泰证券	2021070800007737	爱尔眼科	2021-07-08	2,017,768.00	31,100.00	28	3.40%	5,335.96	-	-
华泰证券	2021072200000835	亿联网络	2021-07-22	394,002.00	4,200.00	14	3.40%	520.94	-	-
华泰证券	2021072200006984	沃森生物	2021-07-22	664,680.00	8,700.00	14	3.40%	878.92	-	-
华泰证券	2021072200006986	沃森生物	2021-07-22	870,960.00	11,400.00	14	3.40%	1,151.64	-	-
华泰证券	2021072200006988	沃森生物	2021-07-22	695,240.00	9,100.00	14	3.40%	919.24	-	-
华泰证券	2021072200006990	阳光电源	2021-07-22	1,430,500.00	10,000.00	14	3.40%	1,891.40	-	-
华泰证券	2021072200006992	先导智能	2021-07-22	1,330,000.00	20,000.00	14	3.40%	1,758.54	-	-
华泰证券	2021072200006994	英科医疗	2021-07-22	1,139,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,505.98	-	-
华泰证券	2021072200008614	华润微	2021-07-22	878,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,161.02	-	-
华泰证券	2021072200008616	沪硅产业	2021-07-22	1,187,160.00	39,000.00	14	3.40%	1,569.68	-	-
华泰证券	2021070900000560	康泰生物	2021-07-09	1,395,000.00	10,000.00	28	3.40%	3,689.00	-	-
华泰证券	2021070900000562	沃森生物	2021-07-09	665,689.00	10,300.00	28	3.40%	1,760.36	-	-
华泰证券	2021072300005353	英科医疗	2021-07-23	1,059,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,400.28	-	-
华泰证券	2021072300006549	华润微	2021-07-23	1,085,616.00	12,600.00	14	3.40%	1,435.42	-	-
华泰证券	2021072300006551	沪硅产业	2021-07-23	831,312.00	27,600.00	14	3.40%	1,099.14	-	-
华泰证券	2021072600005458	华润微	2021-07-26	900,300.00	10,000.00	14	3.40%	1,190.42	-	-
华泰证券	2021071300001214	同花顺	2021-07-13	2,021,482.00	19,300.00	28	3.40%	5,345.76	-	-
华泰证券	2021072700020195	中微公司	2021-07-27	10,048,000.00	50,000.00	14	3.40%	13,285.72	-	-
华泰证券	2021072700020435	阳光电源	2021-07-27	25,194,000.00	200,000.00	14	3.40%	33,312.02	-	-
华泰证券	2021071400000532	澜起科技	2021-07-14	941,700.00	14,600.00	28	3.40%	2,490.32	-	-
华泰证券	2021071400000534	同花顺	2021-07-14	1,435,890.00	13,800.00	28	3.40%	3,797.08	-	-
华泰证券	2021072800000795	宋城演艺	2021-07-28	3,517,857.00	265,900.00	14	3.40%	4,651.36	-	-
华泰证券	20210728000008072	欧普康视	2021-07-28	520,380.00	5,900.00	14	3.40%	688.10	-	-

华泰证券	2021072800008074	中微公司	2021-07-28	3,913,000.00	20,000.00	14	3.40%	5,173.84	-	-
华泰证券	2021071500001021	沃森生物	2021-07-15	498,760.00	7,400.00	28	3.40%	1,319.08	-	-
华泰证券	2021071500001023	信维通信	2021-07-15	742,835.00	23,500.00	28	3.40%	1,964.48	-	-
华泰证券	2021071500015032	中国通号	2021-07-15	172,480.00	32,000.00	28	1.80%	241.36	-	-
华泰证券	2021072900016099	欧普康视	2021-07-29	544,334.00	5,900.00	14	3.40%	719.74	-	-
华泰证券	2021072900016107	沪硅产业	2021-07-29	349,700.00	10,000.00	14	3.40%	462.42	-	-
华泰证券	2021071600015844	沃森生物	2021-07-16	2,216,400.00	30,000.00	28	3.40%	5,861.24	-	-
华泰证券	2021073000001023	沃森生物	2021-07-30	1,513,424.00	17,600.00	14	3.40%	2,001.02	-	-
华泰证券	2021073000001025	信维通信	2021-07-30	380,289.00	14,700.00	14	3.40%	502.88	-	-
华泰证券	2021073000013092	华润微	2021-07-30	1,490,000.00	14,900.00	14	3.40%	1,970.08	-	-
华泰证券	2021073000013094	华润微	2021-07-30	1,640,000.00	16,400.00	14	3.40%	2,168.46	-	-
华泰证券	2021073000013096	沪硅产业	2021-07-30	917,440.00	24,400.00	14	3.40%	1,213.10	-	-
华泰证券	2021073000013100	阳光电源	2021-07-30	3,356,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,437.44	-	-
华泰证券	2021073000013102	英科医疗	2021-07-30	935,920.00	8,000.00	14	3.40%	1,237.46	-	-
华泰证券	2021073000013106	英科医疗	2021-07-30	701,940.00	6,000.00	14	3.40%	928.06	-	-
华泰证券	2021073000013108	英科医疗	2021-07-30	690,241.00	5,900.00	14	3.40%	912.66	-	-
华泰证券	2021080200013098	华熙生物	2021-08-02	6,753,000.00	30,000.00	14	3.40%	8,928.92	-	-
华泰证券	2021080200013100	沪硅产业	2021-08-02	1,891,500.00	50,000.00	14	3.40%	2,500.96	-	-
华泰证券	2021080200013790	阳光电源	2021-08-02	3,212,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,247.04	-	-
华泰证券	2021072000001099	温氏股份	2021-07-20	393,316.00	30,800.00	28	3.40%	1,040.20	-	-
华泰证券	2021072000011959	爱尔眼科	2021-07-20	1,327,600.00	20,000.00	28	3.40%	3,510.64	-	-
华泰证券	2021080300012736	亿纬锂能	2021-08-03	7,093,660.00	64,400.00	14	3.40%	9,379.44	-	-
华泰证券	2021080300012744	阳光电源	2021-08-03	1,439,800.00	10,000.00	14	3.40%	1,903.72	-	-
华泰证券	2021080300012756	华润微	2021-08-03	866,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,145.90	-	-
华泰证券	2021072100019977	沃森生物	2021-07-21	2,768,645.00	35,500.00	28	3.40%	7,321.44	-	-
华泰证券	2021072100019981	信维通信	2021-07-21	327,500.00	12,500.00	28	3.40%	866.04	-	-
华泰证券	2021080400000897	英科医疗	2021-08-04	1,185,129.00	9,900.00	14	3.40%	1,567.02	-	-
华泰证券	2021080400017594	阳光电源	2021-08-04	4,844,280.00	31,600.00	14	3.40%	6,405.28	-	-
华泰证券	2021080400018398	华润微	2021-08-04	1,195,803.00	13,300.00	14	3.40%	1,581.16	-	-
华泰证券	2021080400018400	英科医疗	2021-08-04	1,197,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,582.84	-	-
华泰证券	2021080400018402	阳光电源	2021-08-04	1,533,000.00	10,000.00	14	3.40%	2,026.92	-	-
华泰证券	2021080400018404	健帆生物	2021-08-04	514,080.00	8,400.00	14	3.40%	679.70	-	-
华泰证券	2021080500009009	先导智能	2021-08-05	1,552,000.00	20,000.00	14	3.40%	2,052.12	-	-
华泰证券	2021080500010383	沃森生物	2021-08-05	815,886.00	8,700.00	14	3.40%	1,078.84	-	-
华泰证券	2021080500010385	英科医疗	2021-08-05	1,143,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,511.44	-	-
华泰证券	2021080500010387	阳光电源	2021-08-05	1,543,100.00	10,000.00	14	3.40%	2,040.36	-	-
华泰证券	2021080500010389	沃森生物	2021-08-05	853,398.00	9,100.00	14	3.40%	1,128.40	-	-
华泰证券	2021080500010391	沃森生物	2021-08-05	1,069,092.00	11,400.00	14	3.40%	1,413.58	-	-
华泰证券	2021080500010393	沪硅产业	2021-08-05	1,360,320.00	39,000.00	14	3.40%	1,798.72	-	-
华泰证券	2021080500010395	华润微	2021-08-05	894,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,182.86	-	-
华泰证券	2021072300000249	中国通号	2021-07-23	3,612,393.00	680,300.00	28	2.00%	5,619.32	-	-
华泰证券	2021080600007580	英科医疗	2021-08-06	1,090,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,441.30	-	-
华泰证券	2021080600007582	华润微	2021-08-06	1,119,636.00	12,600.00	14	3.40%	1,480.36	-	-

华泰证券	2021080600007584	沪硅产业	2021-08-06	916,872.00	27,600.00	14	3.40%	1,212.26	-	-
华泰证券	2021072600000858	亿纬锂能	2021-07-26	13,486,107.00	112,300.00	28	3.40%	35,663.32	-	-
华泰证券	2021080900004776	华润微	2021-08-09	845,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,117.34	-	-
华泰证券	2021072700000769	东方财富	2021-07-27	443,014.00	14,300.00	28	3.40%	1,171.52	-	-
华泰证券	2021081000021613	阳光电源	2021-08-10	30,892,000.00	200,000.00	14	3.40%	40,846.12	-	-
华泰证券	2021081000021621	中微公司	2021-08-10	9,027,500.00	50,000.00	14	3.40%	11,936.40	-	-
华泰证券	2021072800000797	芒果超媒	2021-07-28	1,027,650.00	19,500.00	28	3.40%	2,717.68	-	-
华泰证券	2021081100010748	中微公司	2021-08-11	3,646,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,820.76	-	-
华泰证券	2021081100010752	欧普康视	2021-08-11	530,941.00	5,900.00	14	3.40%	701.96	-	-
华泰证券	2021081100010754	宋城演艺	2021-08-11	3,523,175.00	265,900.00	14	3.40%	4,658.36	-	-
华泰证券	2021072900000713	中国通号	2021-07-29	55,880.00	11,000.00	28	2.00%	86.80	-	-
华泰证券	2021072900000715	爱尔眼科	2021-07-29	4,996,719.00	81,900.00	28	3.40%	13,213.48	-	-
华泰证券	2021072900000717	宋城演艺	2021-07-29	13,330.00	1,000.00	28	3.40%	35.28	-	-
华泰证券	2021072900016101	乐普医疗	2021-07-29	1,284,500.00	50,000.00	28	3.40%	3,396.68	-	-
华泰证券	2021072900016103	同花顺	2021-07-29	1,234,870.00	13,000.00	28	3.40%	3,265.64	-	-
华泰证券	2021072900016105	中国通号	2021-07-29	238,760.00	47,000.00	28	1.80%	334.32	-	-
华泰证券	2021081200016851	沪硅产业	2021-08-12	332,200.00	10,000.00	14	3.40%	439.18	-	-
华泰证券	2021081200016857	欧普康视	2021-08-12	526,280.00	5,900.00	14	3.40%	695.80	-	-
华泰证券	2021073000013098	乐普医疗	2021-07-30	1,289,000.00	50,000.00	28	3.40%	3,408.72	-	-
华泰证券	2021073000013104	同花顺	2021-07-30	1,176,909.00	12,700.00	28	3.40%	3,112.20	-	-
华泰证券	2021081300042476	华润微	2021-08-13	1,363,660.00	16,400.00	14	3.40%	1,803.06	-	-
华泰证券	2021081300042478	华润微	2021-08-13	1,238,935.00	14,900.00	14	3.40%	1,638.14	-	-
华泰证券	2021081300042480	沪硅产业	2021-08-13	760,792.00	24,400.00	14	3.40%	1,005.90	-	-
华泰证券	2021081300042482	英科医疗	2021-08-13	659,820.00	6,000.00	14	3.40%	872.48	-	-
华泰证券	2021081300042484	英科医疗	2021-08-13	648,823.00	5,900.00	14	3.40%	857.92	-	-
华泰证券	2021081300042486	英科医疗	2021-08-13	879,760.00	8,000.00	14	3.40%	1,163.26	-	-
华泰证券	2021081300042488	信维通信	2021-08-13	386,022.00	14,700.00	14	3.40%	510.44	-	-
华泰证券	2021081300042490	阳光电源	2021-08-13	2,879,600.00	20,000.00	14	3.40%	3,807.44	-	-
华泰证券	2021081300042494	沃森生物	2021-08-13	1,350,272.00	17,600.00	14	3.40%	1,785.42	-	-
华泰证券	2021080200013792	乐普医疗	2021-08-02	620,229.00	23,700.00	28	3.40%	1,640.24	-	-
华泰证券	2021081600012199	华熙生物	2021-08-16	6,561,000.00	30,000.00	14	3.40%	8,675.10	-	-
华泰证券	2021081600012201	沪硅产业	2021-08-16	1,572,000.00	50,000.00	14	3.40%	2,078.58	-	-
华泰证券	2021081600013623	阳光电源	2021-08-16	2,816,000.00	20,000.00	14	3.40%	3,723.44	-	-
华泰证券	2021080300012740	智飞生物	2021-08-03	2,448,740.00	14,000.00	28	3.40%	6,475.56	-	-
华泰证券	2021081700012860	华润微	2021-08-17	819,700.00	10,000.00	14	3.40%	1,083.88	-	-
华泰证券	2021081700012892	亿纬锂能	2021-08-17	6,721,428.00	64,400.00	14	3.40%	8,887.20	-	-
华泰证券	2021081700012894	阳光电源	2021-08-17	1,447,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,913.24	-	-
华泰证券	2021080400017592	芒果超媒	2021-08-04	285,660.00	5,400.00	28	3.40%	755.44	-	-
华泰证券	2021081800018552	华润微	2021-08-18	1,065,330.00	13,300.00	14	3.40%	1,408.54	-	-
华泰证券	2021081800018554	阳光电源	2021-08-18	1,345,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,778.42	-	-
华泰证券	2021081800018556	阳光电源	2021-08-18	4,250,200.00	31,600.00	14	3.40%	5,619.74	-	-
华泰证券	2021081800018558	健帆生物	2021-08-18	455,784.00	8,400.00	14	3.40%	602.70	-	-
华泰证券	2021081800018560	英科医疗	2021-08-18	1,056,825.00	9,900.00	14	3.40%	1,397.34	-	-

华泰证券	2021081800018562	英科医疗	2021-08-18	1,067,500.00	10,000.00	14	3.40%	1,411.48	-	-
华泰证券	2021080500000783	温氏股份	2021-08-05	1,250,565.00	95,100.00	28	3.40%	3,307.08	-	-
华泰证券	2021080500010397	智飞生物	2021-08-05	1,240,610.00	7,000.00	28	3.40%	3,280.76	-	-
华泰证券	2021081900011053	沪硅产业	2021-08-19	1,195,740.00	39,000.00	14	3.40%	1,581.02	-	-
华泰证券	2021081900011055	沃森生物	2021-08-19	737,646.00	9,100.00	14	3.40%	975.38	-	-
华泰证券	2021081900011057	英科医疗	2021-08-19	1,049,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,388.24	-	-
华泰证券	2021081900011059	阳光电源	2021-08-19	1,371,700.00	10,000.00	14	3.40%	1,813.70	-	-
华泰证券	2021081900011061	沃森生物	2021-08-19	705,222.00	8,700.00	14	3.40%	932.40	-	-
华泰证券	2021081900011063	沃森生物	2021-08-19	924,084.00	11,400.00	14	3.40%	1,221.78	-	-
华泰证券	2021081900011531	华润微	2021-08-19	851,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,126.44	-	-
华泰证券	2021080600007588	康泰生物	2021-08-06	1,453,100.00	10,000.00	28	3.40%	3,842.72	-	-
华泰证券	2021080600007590	沃森生物	2021-08-06	893,010.00	10,300.00	28	3.40%	2,361.52	-	-
华泰证券	2021082000007644	华润微	2021-08-20	1,099,980.00	12,600.00	14	3.40%	1,454.46	-	-
华泰证券	2021082000007646	沪硅产业	2021-08-20	856,428.00	27,600.00	14	3.40%	1,132.46	-	-
华泰证券	2021082000007650	英科医疗	2021-08-20	1,024,700.00	10,000.00	14	3.40%	1,354.92	-	-
华泰证券	2021082300007657	华润微	2021-08-23	866,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,145.90	-	-
华泰证券	2021081000021617	同花顺	2021-08-10	1,916,297.00	19,300.00	28	3.40%	5,067.44	-	-
华泰证券	2021082400017973	中微公司	2021-08-24	9,100,000.00	50,000.00	14	3.40%	12,032.16	-	-
华泰证券	2021082400019307	阳光电源	2021-08-24	29,418,000.00	200,000.00	14	3.40%	38,897.18	-	-
华泰证券	2021081100010750	澜起科技	2021-08-11	939,072.00	14,600.00	28	3.40%	2,483.32	-	-
华泰证券	2021081100010756	同花顺	2021-08-11	1,359,162.00	13,800.00	28	3.40%	3,594.36	-	-
华泰证券	2021082500007973	中微公司	2021-08-25	3,570,200.00	20,000.00	14	3.40%	4,720.66	-	-
华泰证券	2021082500007977	欧普康视	2021-08-25	468,460.00	5,900.00	14	3.40%	619.36	-	-
华泰证券	2021081200000326	温氏股份	2021-08-12	1,413,146.00	104,600.00	28	3.40%	3,736.88	-	-
华泰证券	2021081200016853	信维通信	2021-08-12	626,745.00	23,500.00	28	3.40%	1,657.32	-	-
华泰证券	2021081200016855	沃森生物	2021-08-12	597,772.00	7,400.00	28	3.40%	1,580.88	-	-
华泰证券	2021082600015509	沪硅产业	2021-08-26	290,000.00	10,000.00	14	3.40%	383.46	-	-
华泰证券	2021082600015587	欧普康视	2021-08-26	444,034.00	5,900.00	14	3.40%	587.16	-	-
华泰证券	2021081300000523	温氏股份	2021-08-13	1,031,036.00	76,600.00	28	3.40%	2,726.64	-	-
华泰证券	2021081300042492	沃森生物	2021-08-13	2,301,600.00	30,000.00	28	3.40%	6,086.36	-	-
华泰证券	2021082700012595	华润微	2021-08-27	1,328,400.00	16,400.00	14	3.40%	1,756.44	-	-
华泰证券	2021082700012597	华润微	2021-08-27	1,206,900.00	14,900.00	14	3.40%	1,595.86	-	-
华泰证券	2021082700012599	沪硅产业	2021-08-27	714,676.00	24,400.00	14	3.40%	945.00	-	-
华泰证券	2021082700012601	英科医疗	2021-08-27	631,260.00	6,000.00	14	3.40%	834.68	-	-
华泰证券	2021082700012603	英科医疗	2021-08-27	841,680.00	8,000.00	14	3.40%	1,112.86	-	-
华泰证券	2021082700012605	英科医疗	2021-08-27	620,739.00	5,900.00	14	3.40%	820.82	-	-
华泰证券	2021082700012611	阳光电源	2021-08-27	2,983,600.00	20,000.00	14	3.40%	3,944.92	-	-
华泰证券	2021082700012613	沃森生物	2021-08-27	1,435,808.00	17,600.00	14	3.40%	1,898.40	-	-
华泰证券	2021083000015481	华熙生物	2021-08-30	5,579,400.00	30,000.00	14	3.40%	7,377.16	-	-
华泰证券	2021083000015483	沪硅产业	2021-08-30	1,499,000.00	50,000.00	14	3.40%	1,981.98	-	-
华泰证券	2021083000015491	阳光电源	2021-08-30	3,247,600.00	20,000.00	14	3.40%	4,294.08	-	-
华泰证券	2021081700000692	芒果超媒	2021-08-17	3,640,390.00	68,300.00	28	3.40%	9,626.68	-	-
华泰证券	2021081700012890	温氏股份	2021-08-17	403,480.00	30,800.00	28	3.40%	1,067.08	-	-

华泰证券	2021081700012896	爱尔眼科	2021-08-17	1,040,000.00	20,000.00	28	3.40%	2,750.16	-	-
华泰证券	2021083100000307	宋城演艺	2021-08-31	681,488.00	44,600.00	14	3.40%	901.04	-	-
华泰证券	2021083100012105	华润微	2021-08-31	754,000.00	10,000.00	14	3.40%	996.94	-	-
华泰证券	2021083100012113	阳光电源	2021-08-31	1,572,800.00	10,000.00	14	3.40%	2,079.56	-	-
华泰证券	2021081800000581	温氏股份	2021-08-18	785,652.00	59,700.00	28	3.40%	2,077.60	-	-
华泰证券	2021090100016219	华润微	2021-09-01	1,009,603.00	13,300.00	14	3.40%	1,334.90	-	-
华泰证券	2021090100019189	英科医疗	2021-09-01	1,028,700.00	10,000.00	14	3.40%	1,360.24	-	-
华泰证券	2021090100019191	英科医疗	2021-09-01	1,018,413.00	9,900.00	14	3.40%	1,346.52	-	-
华泰证券	2021090100019193	阳光电源	2021-09-01	1,420,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,878.80	-	-
华泰证券	2021090100019195	阳光电源	2021-09-01	4,490,044.00	31,600.00	14	3.40%	5,936.84	-	-
华泰证券	2021090100019197	健帆生物	2021-09-01	413,280.00	8,400.00	14	3.40%	546.42	-	-
华泰证券	2021081900000741	温氏股份	2021-08-19	234,669.00	17,900.00	28	3.40%	620.48	-	-
华泰证券	2021081900000743	汇川技术	2021-08-19	832,923.00	11,700.00	28	3.40%	2,202.76	-	-
华泰证券	2021081900000745	芒果超媒	2021-08-19	1,719,830.00	31,100.00	28	3.40%	4,548.04	-	-
华泰证券	2021090200000616	泰格医药	2021-09-02	4,134,000.00	31,800.00	14	3.40%	5,466.02	-	-
华泰证券	2021090200012002	华润微	2021-09-02	716,100.00	10,000.00	14	3.40%	946.82	-	-
华泰证券	2021090200012004	沪硅产业	2021-09-02	1,130,220.00	39,000.00	14	3.40%	1,494.36	-	-
华泰证券	2021090200012566	沃森生物	2021-09-02	643,104.00	8,700.00	14	3.40%	850.36	-	-
华泰证券	2021090200012568	沃森生物	2021-09-02	672,672.00	9,100.00	14	3.40%	889.42	-	-
华泰证券	2021090200012572	沃森生物	2021-09-02	842,688.00	11,400.00	14	3.40%	1,114.26	-	-
华泰证券	2021090200012574	英科医疗	2021-09-02	1,001,200.00	10,000.00	14	3.40%	1,323.84	-	-
华泰证券	2021090200012576	阳光电源	2021-09-02	1,429,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,889.44	-	-
华泰证券	2021082000000766	芒果超媒	2021-08-20	580,534.00	10,900.00	28	3.40%	1,535.24	-	-
华泰证券	2021082000007648	中国通号	2021-08-20	3,462,727.00	680,300.00	28	2.00%	5,386.36	-	-
华泰证券	2021090300000551	澜起科技	2021-09-03	2,793,280.00	46,400.00	14	1.70%	1,846.74	-	-
华泰证券	2021090300009429	英科医疗	2021-09-03	999,800.00	10,000.00	14	3.40%	1,322.02	-	-
华泰证券	2021090300009691	华润微	2021-09-03	930,258.00	12,600.00	14	3.40%	1,230.04	-	-
华泰证券	2021090300009693	沪硅产业	2021-09-03	818,616.00	27,600.00	14	3.40%	1,082.34	-	-
华泰证券	2021082300000459	芒果超媒	2021-08-23	387,940.00	7,000.00	28	3.40%	1,099.20	-	-
华泰证券	2021082300000461	智飞生物	2021-08-23	931,952.00	5,600.00	28	3.40%	2,640.60	-	-
华泰证券	2021082300007659	亿纬锂能	2021-08-23	11,252,460.00	112,300.00	28	3.40%	31,881.90	-	-
华泰证券	2021082400017975	东方财富	2021-08-24	460,031.00	14,300.00	28	3.40%	1,260.05	-	-
华泰证券	2021082500000775	爱尔眼科	2021-08-25	2,695,784.00	52,900.00	28	3.40%	7,128.80	-	-
华泰证券	2021082500007975	芒果超媒	2021-08-25	1,056,120.00	19,500.00	28	3.40%	2,792.72	-	-
华泰证券	20210906000006456	华润微	2021-09-06	751,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,135.68	-	-
华泰证券	2021090700018931	阳光电源	2021-09-07	28,400,000.00	200,000.00	14	3.40%	40,233.30	-	-
华泰证券	2021090700018933	中微公司	2021-09-07	7,950,000.00	50,000.00	14	3.40%	11,262.45	-	-
华泰证券	2021090800011399	中微公司	2021-09-08	3,183,200.00	20,000.00	14	3.40%	4,208.96	-	-
华泰证券	2021090800011401	欧普康视	2021-09-08	392,173.00	5,900.00	14	3.40%	518.56	-	-
华泰证券	2021082600015511	中国通号	2021-08-26	56,320.00	11,000.00	28	2.00%	87.64	-	-
华泰证券	2021082600015513	同花顺	2021-08-26	1,457,950.00	13,000.00	28	3.40%	3,855.60	-	-
华泰证券	2021082600015515	爱尔眼科	2021-08-26	3,989,349.00	81,900.00	28	3.40%	10,549.56	-	-
华泰证券	2021090900000391	泰格医药	2021-09-09	7,980,000.00	53,200.00	14	3.40%	10,551.38	-	-

华泰证券	2021090900014327	欧普康视	2021-09-09	392,055.00	5,900.00	14	3.40%	518.42	-	-
华泰证券	2021090900016205	沪硅产业	2021-09-09	292,300.00	10,000.00	14	3.40%	386.54	-	-
华泰证券	2021082700000480	温氏股份	2021-08-27	1,991,296.00	150,400.00	28	3.40%	5,265.96	-	-
华泰证券	2021082700012607	同花顺	2021-08-27	1,450,340.00	12,700.00	28	3.40%	3,835.44	-	-
华泰证券	2021082700012609	乐普医疗	2021-08-27	1,251,000.00	50,000.00	28	3.40%	3,308.20	-	-
华泰证券	2021091000016199	华润微	2021-09-10	1,243,120.00	16,400.00	14	3.40%	1,643.74	-	-
华泰证券	2021091000016201	华润微	2021-09-10	1,129,420.00	14,900.00	14	3.40%	1,493.38	-	-
华泰证券	2021091000016203	沪硅产业	2021-09-10	732,000.00	24,400.00	14	3.40%	967.82	-	-
华泰证券	2021091000016205	英科医疗	2021-09-10	567,720.00	6,000.00	14	3.40%	750.68	-	-
华泰证券	2021091000016207	英科医疗	2021-09-10	756,960.00	8,000.00	14	3.40%	1,000.86	-	-
华泰证券	2021091000016209	沃森生物	2021-09-10	1,324,400.00	17,600.00	14	3.40%	1,751.12	-	-
华泰证券	2021091000016213	英科医疗	2021-09-10	558,258.00	5,900.00	14	3.40%	738.08	-	-
华泰证券	2021091000016217	阳光电源	2021-09-10	2,870,200.00	20,000.00	14	3.40%	3,794.98	-	-
华泰证券	2021083000000656	三环集团	2021-08-30	53,508.00	1,400.00	28	3.40%	141.40	-	-
华泰证券	2021083000000658	亿纬锂能	2021-08-30	315,000.00	3,000.00	28	3.40%	833.00	-	-
华泰证券	2021083000015489	乐普医疗	2021-08-30	605,061.00	23,700.00	28	3.40%	1,599.92	-	-
华泰证券	2021091300015810	华熙生物	2021-09-13	5,225,100.00	30,000.00	14	3.40%	6,908.72	-	-
华泰证券	2021091300015812	沪硅产业	2021-09-13	1,437,500.00	50,000.00	14	3.40%	1,900.64	-	-
华泰证券	2021091300015814	阳光电源	2021-09-13	2,690,800.00	20,000.00	14	3.40%	3,557.82	-	-
华泰证券	2021091400013088	宋城演艺	2021-09-14	664,094.00	44,600.00	14	3.40%	878.08	-	-
华泰证券	2021091400013504	华润微	2021-09-14	709,500.00	10,000.00	14	3.40%	938.14	-	-
华泰证券	2021091400013510	阳光电源	2021-09-14	1,352,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,788.78	-	-
华泰证券	2021090100000635	乐普医疗	2021-09-01	379,152.00	14,400.00	28	3.40%	1,002.68	-	-
华泰证券	2021090100000637	爱尔眼科	2021-09-01	1,493,720.00	34,900.00	28	3.40%	3,949.96	-	-
华泰证券	2021090100019199	芒果超媒	2021-09-01	238,680.00	5,400.00	28	3.40%	631.12	-	-
华泰证券	2021091500018160	健帆生物	2021-09-15	409,164.00	8,400.00	14	3.40%	540.96	-	-
华泰证券	2021091500019022	华润微	2021-09-15	937,251.00	13,300.00	14	3.40%	1,239.28	-	-
华泰证券	2021091500019024	阳光电源	2021-09-15	4,351,952.00	31,600.00	14	3.40%	5,754.28	-	-
华泰证券	2021091500019026	英科医疗	2021-09-15	940,203.00	9,900.00	14	3.40%	1,243.20	-	-
华泰证券	2021091500019028	阳光电源	2021-09-15	1,377,200.00	10,000.00	14	3.40%	1,820.98	-	-
华泰证券	2021091500019030	英科医疗	2021-09-15	949,700.00	10,000.00	14	3.40%	1,255.66	-	-
华泰证券	2021090200000618	三环集团	2021-09-02	2,300,368.00	64,400.00	28	3.40%	6,083.28	-	-
华泰证券	2021090200000620	爱尔眼科	2021-09-02	5,021,694.00	122,900.00	28	3.40%	13,279.56	-	-
华泰证券	2021090200000622	汇川技术	2021-09-02	1,558,884.00	22,200.00	28	3.40%	4,122.44	-	-
华泰证券	2021090200012570	智飞生物	2021-09-02	1,184,330.00	7,000.00	28	3.40%	3,131.80	-	-
华泰证券	2021090200012578	温氏股份	2021-09-02	1,242,957.00	95,100.00	28	3.40%	3,286.92	-	-
华泰证券	2021091600011173	华润微	2021-09-16	678,500.00	10,000.00	14	3.40%	897.12	-	-
华泰证券	2021091600011175	沪硅产业	2021-09-16	1,117,350.00	39,000.00	14	3.40%	1,477.42	-	-
华泰证券	2021091600011177	英科医疗	2021-09-16	907,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,199.24	-	-
华泰证券	2021091600011179	沃森生物	2021-09-16	607,789.00	9,100.00	14	3.40%	803.60	-	-
华泰证券	2021091600011185	阳光电源	2021-09-16	1,265,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,672.58	-	-
华泰证券	2021091600011187	沃森生物	2021-09-16	581,073.00	8,700.00	14	3.40%	768.32	-	-
华泰证券	2021091600012125	泰格医药	2021-09-16	5,128,068.00	31,800.00	14	3.40%	6,780.48	-	-

华泰证券	2021091600012127	沃森生物	2021-09-16	761,406.00	11,400.00	14	3.40%	1,006.74	-	-
华泰证券	2021090300000553	亿纬锂能	2021-09-03	1,673,070.00	18,600.00	28	3.40%	5,530.35	-	-
华泰证券	2021090300000555	汇川技术	2021-09-03	1,455,900.00	21,100.00	28	3.40%	4,812.50	-	-
华泰证券	2021090300000557	先导智能	2021-09-03	3,274,648.00	48,100.00	28	3.40%	10,824.45	-	-
华泰证券	2021090300000559	康泰生物	2021-09-03	1,899,940.00	16,400.00	28	3.40%	6,280.40	-	-
华泰证券	2021090300000561	三环集团	2021-09-03	2,339,008.00	64,400.00	28	3.40%	7,731.85	-	-
华泰证券	2021090300000563	芒果超媒	2021-09-03	343,420.00	7,700.00	28	3.40%	1,135.05	-	-
华泰证券	2021090300009427	沃森生物	2021-09-03	743,660.00	10,300.00	28	3.40%	2,458.05	-	-
华泰证券	2021090300009431	康泰生物	2021-09-03	1,158,500.00	10,000.00	28	3.40%	3,829.35	-	-
华泰证券	2021090600000535	智飞生物	2021-09-06	5,782,368.00	34,800.00	28	3.40%	17,475.52	-	-
华泰证券	2021090600000541	三环集团	2021-09-06	1,239,672.00	32,900.00	28	3.40%	3,746.56	-	-
华泰证券	2021090700000521	沃森生物	2021-09-07	12,063,612.00	154,900.00	28	3.40%	35,319.54	-	-
华泰证券	2021090700000523	欧普康视	2021-09-07	3,295,416.00	49,200.00	28	3.40%	9,648.13	-	-
华泰证券	2021090700018935	同花顺	2021-09-07	2,603,956.00	19,300.00	28	3.40%	7,623.83	-	-
华泰证券	2021090800011397	澜起科技	2021-09-08	851,180.00	14,600.00	28	3.40%	2,411.70	-	-
华泰证券	2021090800011403	同花顺	2021-09-08	1,894,87.00	13,800.00	28	3.40%	5,368.80	-	-
华泰证券	2021090900014329	温氏股份	2021-09-09	1,430,928.00	104,600.00	28	3.40%	3,919.06	-	-
华泰证券	2021090900014331	沃森生物	2021-09-09	550,190.00	7,400.00	28	3.40%	1,506.84	-	-
华泰证券	2021090900014333	信维通信	2021-09-09	563,530.00	23,500.00	28	3.40%	1,543.38	-	-
华泰证券	2021091000000508	爱尔眼科	2021-09-10	2,739,510.00	61,000.00	28	3.40%	7,244.44	-	-
华泰证券	2021091000016211	沃森生物	2021-09-10	2,257,500.00	30,000.00	28	3.40%	5,969.88	-	-
华泰证券	2021091000016215	温氏股份	2021-09-10	1,045,590.00	76,600.00	28	3.40%	2,765.00	-	-
华泰证券	2021091700008009	沪硅产业	2021-09-17	781,080.00	27,600.00	14	3.40%	1,549.17	-	-
华泰证券	2021091700008011	华润微	2021-09-17	871,920.00	12,600.00	14	3.40%	1,729.35	-	-
华泰证券	2021091700008013	澜起科技	2021-09-17	2,610,000.00	46,400.00	14	1.70%	2,588.25	-	-
华泰证券	2021091700008019	英科医疗	2021-09-17	919,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,823.85	-	-
华泰证券	2021092200030767	中微公司	2021-09-22	7,887,500.00	50,000.00	14	3.40%	11,918.88	-	-
华泰证券	2021092200030769	华润微	2021-09-22	699,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,057.12	-	-
华泰证券	2021092200030771	中微公司	2021-09-22	3,155,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,767.52	-	-
华泰证券	2021092200030775	阳光电源	2021-09-22	24,870,000.00	200,000.00	14	3.40%	37,581.28	-	-
华泰证券	2021092200030777	欧普康视	2021-09-22	470,820.00	5,900.00	14	3.40%	711.52	-	-
华泰证券	2021092300014535	沪硅产业	2021-09-23	288,400.00	10,000.00	14	3.40%	408.60	-	-
华泰证券	2021092300014539	欧普康视	2021-09-23	472,000.00	5,900.00	14	3.40%	668.70	-	-
华泰证券	2021092300014543	泰格医药	2021-09-23	9,043,468.00	53,200.00	14	3.40%	12,811.65	-	-
华泰证券	2021092400013323	华润微	2021-09-24	1,038,530.00	14,900.00	14	3.40%	1,373.12	-	-
华泰证券	2021092400013325	华润微	2021-09-24	1,143,080.00	16,400.00	14	3.40%	1,511.44	-	-
华泰证券	2021092400013327	沪硅产业	2021-09-24	704,428.00	24,400.00	14	3.40%	931.42	-	-
华泰证券	2021092400013329	英科医疗	2021-09-24	551,280.00	6,000.00	14	3.40%	728.98	-	-
华泰证券	2021092400013333	沃森生物	2021-09-24	1,150,160.00	17,600.00	14	3.40%	1,520.82	-	-
华泰证券	2021092400013337	英科医疗	2021-09-24	735,040.00	8,000.00	14	3.40%	971.88	-	-
华泰证券	2021092400013339	英科医疗	2021-09-24	542,092.00	5,900.00	14	3.40%	716.80	-	-
华泰证券	2021092400013341	阳光电源	2021-09-24	2,808,000.00	20,000.00	14	3.40%	3,712.80	-	-
华泰证券	2021091300000357	芒果超媒	2021-09-13	1,018,560.00	24,000.00	28	3.40%	2,693.60	-	-

华泰证券	2021092700013997	华熙生物	2021-09-27	5,734,800.00	30,000.00	14	3.40%	7,582.68	-	-
华泰证券	2021092700013999	沪硅产业	2021-09-27	1,445,000.00	50,000.00	14	3.40%	1,910.58	-	-
华泰证券	2021092700014003	阳光电源	2021-09-27	2,955,000.00	20,000.00	14	3.40%	3,907.12	-	-
华泰证券	2021091400000647	温氏股份	2021-09-14	783,486.00	59,400.00	28	3.40%	2,072.00	-	-
华泰证券	2021091400000649	汇川技术	2021-09-14	2,392,065.00	35,100.00	28	3.40%	6,325.76	-	-
华泰证券	2021091400000651	芒果超媒	2021-09-14	366,095.00	8,500.00	28	3.40%	968.24	-	-
华泰证券	2021091400000653	爱尔眼科	2021-09-14	5,778,080.00	123,200.00	28	3.40%	15,279.88	-	-
华泰证券	2021091400000655	乐普医疗	2021-09-14	209,760.00	8,000.00	28	3.40%	554.68	-	-
华泰证券	2021091400013502	温氏股份	2021-09-14	406,252.00	30,800.00	28	3.40%	1,074.36	-	-
华泰证券	2021091400013506	爱尔眼科	2021-09-14	938,000.00	20,000.00	28	3.40%	2,480.52	-	-
华泰证券	2021091400013508	芒果超媒	2021-09-14	2,941,681.00	68,300.00	28	3.40%	7,779.24	-	-
华泰证券	2021092800000399	贝达药业	2021-09-28	391,188.00	4,200.00	14	3.40%	517.30	-	-
华泰证券	2021092800013868	华润微	2021-09-28	697,800.00	10,000.00	14	3.40%	922.60	-	-
华泰证券	2021092800013870	阳光电源	2021-09-28	1,432,200.00	10,000.00	14	3.40%	1,893.64	-	-
华泰证券	2021092800013872	宋城演艺	2021-09-28	643,578.00	44,600.00	14	3.40%	850.92	-	-
华泰证券	2021091500000905	中国通号	2021-09-15	318,600.00	60,000.00	28	3.40%	842.52	-	-
华泰证券	2021091500000907	东方财富	2021-09-15	4,466,715.00	126,500.00	28	3.40%	11,812.08	-	-
华泰证券	2021091500018162	温氏股份	2021-09-15	777,891.00	59,700.00	28	3.40%	2,057.16	-	-
华泰证券	2021092900018157	华润微	2021-09-29	913,045.00	13,300.00	14	3.40%	1,207.22	-	-
华泰证券	2021092900018159	英科医疗	2021-09-29	878,600.00	10,000.00	14	3.40%	1,161.72	-	-
华泰证券	2021092900018161	英科医疗	2021-09-29	869,814.00	9,900.00	14	3.40%	1,150.10	-	-
华泰证券	2021092900018163	健帆生物	2021-09-29	481,320.00	8,400.00	14	3.40%	636.44	-	-
华泰证券	2021092900018165	阳光电源	2021-09-29	4,657,524.00	31,600.00	14	3.40%	6,158.32	-	-
华泰证券	2021092900018167	阳光电源	2021-09-29	1,473,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,948.80	-	-
华泰证券	2021091600000571	康泰生物	2021-09-16	102,400.00	1,000.00	28	3.40%	270.76	-	-
华泰证券	2021091600011181	汇川技术	2021-09-16	762,255.00	11,700.00	28	3.40%	2,015.72	-	-
华泰证券	2021091600011183	芒果超媒	2021-09-16	1,299,980.00	31,100.00	28	3.40%	3,437.84	-	-
华泰证券	2021093000012511	华润微	2021-09-30	688,500.00	10,000.00	14	3.40%	910.42	-	-
华泰证券	2021093000012513	沪硅产业	2021-09-30	1,117,740.00	39,000.00	14	3.40%	1,477.84	-	-
华泰证券	2021093000012519	泰格医药	2021-09-30	5,533,200.00	31,800.00	14	3.40%	7,316.12	-	-
华泰证券	2021093000012521	阳光电源	2021-09-30	1,483,800.00	10,000.00	14	3.40%	1,961.96	-	-
华泰证券	2021093000012523	英科医疗	2021-09-30	586,300.00	10,000.00	14	3.40%	775.18	-	-
华泰证券	2021093000012529	沃森生物	2021-09-30	720,252.00	11,400.00	14	3.40%	952.28	-	-
华泰证券	2021093000012531	沃森生物	2021-09-30	549,666.00	8,700.00	14	3.40%	726.74	-	-
华泰证券	2021093000012533	沃森生物	2021-09-30	574,938.00	9,100.00	14	3.40%	760.20	-	-
华泰证券	2021091700000335	中国通号	2021-09-17	529,000.00	100,000.00	28	2.00%	822.92	-	-
华泰证券	2021091700000337	澜起科技	2021-09-17	2,902,500.00	51,600.00	28	3.40%	7,675.64	-	-
华泰证券	20210917000008015	中国通号	2021-09-17	3,598,787.00	680,300.00	28	2.00%	5,598.04	-	-
华泰证券	20210917000008017	芒果超媒	2021-09-17	460,852.00	10,900.00	28	3.40%	1,218.84	-	-
华泰证券	2021092200030773	芒果超媒	2021-09-22	807,495.00	19,500.00	28	3.40%	2,135.28	-	-
华泰证券	2021092200030779	芒果超媒	2021-09-22	289,870.00	7,000.00	28	3.40%	766.64	-	-
华泰证券	2021092200030781	爱尔眼科	2021-09-22	2,831,208.00	52,900.00	28	3.40%	7,486.92	-	-
华泰证券	2021092200030783	亿纬锂能	2021-09-22	10,042,989.00	112,300.00	28	3.40%	26,558.00	-	-

华泰证券	2021092300000710	东方财富	2021-09-23	17,566,661.00	511,700.00	28	3.40%	46,453.96	-	-
华泰证券	2021092300014537	中国通号	2021-09-23	58,960.00	11,000.00	28	2.00%	91.84	-	-
华泰证券	2021092300014541	爱尔眼科	2021-09-23	4,287,465.00	81,900.00	28	3.40%	11,338.04	-	-
华泰证券	2021092300014545	同花顺	2021-09-23	1,723,150.00	13,000.00	28	3.40%	4,556.72	-	-
华泰证券	2021092400013331	同花顺	2021-09-24	1,661,541.00	12,700.00	28	3.40%	4,393.76	-	-
华泰证券	2021092400013335	乐普医疗	2021-09-24	1,344,000.00	50,000.00	28	3.40%	3,554.04	-	-
华泰证券	2021092400013343	温氏股份	2021-09-24	2,074,016.00	150,400.00	28	3.40%	5,484.64	-	-
华泰证券	2021100800000645	蓝思科技	2021-10-08	212,100.00	10,000.00	14	3.40%	280.42	-	-
华泰证券	2021100800000647	健帆生物	2021-10-08	2,332,280.00	39,800.00	14	3.40%	3,083.78	-	-
华泰证券	2021100800059899	华润微	2021-10-08	1,143,572.00	16,400.00	14	3.40%	1,512.00	-	-
华泰证券	2021100800059901	华润微	2021-10-08	1,038,977.00	14,900.00	14	3.40%	1,373.82	-	-
华泰证券	2021100800059903	沪硅产业	2021-10-08	708,088.00	24,400.00	14	3.40%	936.32	-	-
华泰证券	2021100800059905	沃森生物	2021-10-08	1,050,016.00	17,600.00	14	3.40%	1,388.38	-	-
华泰证券	2021100800059907	英科医疗	2021-10-08	338,188.00	5,900.00	14	3.40%	447.16	-	-
华泰证券	2021100800059909	英科医疗	2021-10-08	343,920.00	6,000.00	14	3.40%	454.72	-	-
华泰证券	2021100800059911	英科医疗	2021-10-08	458,560.00	8,000.00	14	3.40%	606.34	-	-
华泰证券	2021100800059913	阳光电源	2021-10-08	3,004,000.00	20,000.00	14	3.40%	3,971.94	-	-
华泰证券	2021100800071279	中微公司	2021-10-08	3,083,600.00	20,000.00	14	3.40%	4,077.22	-	-
华泰证券	2021100800071281	中微公司	2021-10-08	7,709,000.00	50,000.00	14	3.40%	10,192.98	-	-
华泰证券	2021100800071283	澜起科技	2021-10-08	2,779,824.00	46,400.00	14	1.70%	1,837.78	-	-
华泰证券	2021100800071287	华润微	2021-10-08	697,300.00	10,000.00	14	3.40%	922.04	-	-
华泰证券	2021100800071289	华润微	2021-10-08	878,598.00	12,600.00	14	3.40%	1,161.72	-	-
华泰证券	2021100800071291	沪硅产业	2021-10-08	800,952.00	27,600.00	14	3.40%	1,059.10	-	-
华泰证券	2021100800071293	沪硅产业	2021-10-08	290,200.00	10,000.00	14	3.40%	383.74	-	-
华泰证券	2021100800071297	英科医疗	2021-10-08	573,200.00	10,000.00	14	3.40%	757.96	-	-
华泰证券	2021100800071301	欧普康视	2021-10-08	476,484.00	5,900.00	14	3.40%	630.00	-	-
华泰证券	2021100800071313	欧普康视	2021-10-08	476,484.00	5,900.00	14	3.40%	630.00	-	-
华泰证券	2021100800071329	阳光电源	2021-10-08	30,040,000.00	200,000.00	14	3.40%	39,719.54	-	-
华泰证券	2021100800073899	泰格医药	2021-10-08	9,220,624.00	53,200.00	14	3.40%	12,191.76	-	-
华泰证券	2021092700000247	汇川技术	2021-09-27	1,009,162.00	15,400.00	28	3.40%	2,668.68	-	-
华泰证券	2021092700014001	乐普医疗	2021-09-27	635,871.00	23,700.00	28	3.40%	1,681.40	-	-
华泰证券	2021092700014005	亿纬锂能	2021-09-27	281,490.00	3,000.00	28	3.40%	744.52	-	-
华泰证券	2021101100001150	英科医疗	2021-10-11	228,304.00	3,800.00	14	3.40%	301.84	-	-
华泰证券	2021101100001164	贝达药业	2021-10-11	975,100.00	10,000.00	14	3.40%	1,289.26	-	-
华泰证券	2021101100018618	华熙生物	2021-10-11	5,512,500.00	30,000.00	14	3.40%	7,288.82	-	-
华泰证券	2021101100018620	沪硅产业	2021-10-11	1,429,500.00	50,000.00	14	3.40%	1,890.14	-	-
华泰证券	2021101100018622	阳光电源	2021-10-11	2,780,200.00	20,000.00	14	3.40%	3,675.98	-	-
华泰证券	2021092800000401	芒果超媒	2021-09-28	759,600.00	18,000.00	28	3.40%	2,008.72	-	-
华泰证券	2021092800000403	三环集团	2021-09-28	524,524.00	14,300.00	28	3.40%	1,387.12	-	-
华泰证券	2021101200000710	东方财富	2021-10-12	983,400.00	30,000.00	14	3.40%	1,300.32	-	-
华泰证券	2021101200000712	贝达药业	2021-10-12	249,054.00	2,600.00	14	3.40%	329.28	-	-
华泰证券	2021101200014813	阳光电源	2021-10-12	1,435,000.00	10,000.00	14	3.40%	1,897.42	-	-
华泰证券	2021101200014817	宋城演艺	2021-10-12	642,686.00	44,600.00	14	3.40%	849.80	-	-

华泰证券	2021101200016745	华润微	2021-10-12	660,100.00	10,000.00	14	3.40%	872.76	-	-
华泰证券	2021092900018169	芒果超媒	2021-09-29	235,440.00	5,400.00	28	3.40%	622.72	-	-
华泰证券	2021092900018171	乐普医疗	2021-09-29	389,232.00	14,400.00	28	3.40%	1,029.28	-	-
华泰证券	2021101300000775	健帆生物	2021-10-13	551,250.00	9,800.00	14	3.40%	728.84	-	-
华泰证券	2021101300000777	智飞生物	2021-10-13	1,831,180.00	13,000.00	14	3.40%	2,421.30	-	-
华泰证券	2021101300000779	东方财富	2021-10-13	1,328,000.00	40,000.00	14	3.40%	1,755.88	-	-
华泰证券	2021101300017709	华润微	2021-10-13	920,227.00	13,300.00	14	3.40%	1,216.74	-	-
华泰证券	2021101300017713	英科医疗	2021-10-13	615,483.00	9,900.00	14	3.40%	813.82	-	-
华泰证券	2021101300017715	英科医疗	2021-10-13	621,700.00	10,000.00	14	3.40%	822.08	-	-
华泰证券	2021101300017719	阳光电源	2021-10-13	4,788,348.00	31,600.00	14	3.40%	6,331.22	-	-
华泰证券	2021101300017721	健帆生物	2021-10-13	472,500.00	8,400.00	14	3.40%	624.82	-	-
华泰证券	2021101300017723	阳光电源	2021-10-13	1,515,300.00	10,000.00	14	3.40%	2,003.54	-	-
华泰证券	2021093000010515	爱尔眼科	2021-09-30	6,562,860.00	122,900.00	28	3.40%	17,355.24	-	-
华泰证券	2021093000012517	三环集团	2021-09-30	2,389,240.00	64,400.00	28	3.40%	6,318.20	-	-
华泰证券	2021093000012527	温氏股份	2021-09-30	1,376,097.00	95,100.00	28	3.40%	3,638.88	-	-
华泰证券	2021093000012535	汇川技术	2021-09-30	1,398,600.00	22,200.00	28	3.40%	3,698.52	-	-
华泰证券	2021101400013000	英科医疗	2021-10-14	631,800.00	10,000.00	14	3.40%	835.38	-	-
华泰证券	2021101400013144	阳光电源	2021-10-14	1,534,500.00	10,000.00	14	3.40%	2,029.02	-	-
华泰证券	2021101400013146	华润微	2021-10-14	688,500.00	10,000.00	14	3.40%	910.42	-	-
华泰证券	2021101400013148	沪硅产业	2021-10-14	1,083,420.00	39,000.00	14	3.40%	1,432.48	-	-
华泰证券	2021101400014502	泰格医药	2021-10-14	5,197,392.00	31,800.00	14	3.40%	6,872.18	-	-
华泰证券	2021100800071285	澜起科技	2021-10-08	874,686.00	14,600.00	28	3.40%	2,313.08	-	-
华泰证券	2021100800071299	温氏股份	2021-10-08	1,603,518.00	104,600.00	28	3.40%	4,240.32	-	-
华泰证券	2021100800071303	先导智能	2021-10-08	3,371,810.00	48,100.00	28	3.40%	8,916.60	-	-
华泰证券	2021100800071305	温氏股份	2021-10-08	1,174,278.00	76,600.00	28	3.40%	3,105.20	-	-
华泰证券	2021100800071307	康泰生物	2021-10-08	1,752,668.00	16,400.00	28	3.40%	4,634.84	-	-
华泰证券	2021100800071309	康泰生物	2021-10-08	1,068,700.00	10,000.00	28	3.40%	2,826.04	-	-
华泰证券	2021100800071311	欧普康视	2021-10-08	3,973,392.00	49,200.00	28	3.40%	10,507.28	-	-
华泰证券	2021100800071315	沃森生物	2021-10-08	9,241,334.00	154,900.00	28	3.40%	24,438.12	-	-
华泰证券	2021100800071317	沃森生物	2021-10-08	614,498.00	10,300.00	28	3.40%	1,625.12	-	-
华泰证券	2021100800071319	汇川技术	2021-10-08	1,353,776.00	21,100.00	28	3.40%	3,580.08	-	-
华泰证券	2021100800071321	信维通信	2021-10-08	546,375.00	23,500.00	28	3.40%	1,444.80	-	-
华泰证券	2021100800071323	三环集团	2021-10-08	2,390,528.00	64,400.00	28	3.40%	6,321.56	-	-
华泰证券	2021100800071325	三环集团	2021-10-08	1,221,248.00	32,900.00	28	3.40%	3,229.52	-	-
华泰证券	2021100800071327	沃森生物	2021-10-08	1,789,800.00	30,000.00	28	3.40%	4,733.12	-	-
华泰证券	2021100800071331	亿纬锂能	2021-10-08	1,872,276.00	18,600.00	28	3.40%	4,951.24	-	-
华泰证券	2021100800071333	爱尔眼科	2021-10-08	3,243,980.00	61,000.00	28	3.40%	8,578.64	-	-
华泰证券	2021100800071335	同花顺	2021-10-08	1,684,980.00	13,800.00	28	3.40%	4,455.92	-	-
华泰证券	2021100800071337	智飞生物	2021-10-08	5,085,672.00	34,800.00	28	3.40%	13,448.68	-	-
华泰证券	2021100800071339	同花顺	2021-10-08	2,356,530.00	19,300.00	28	3.40%	6,231.68	-	-
华泰证券	2021102200000530	东方财富	2021-10-22	1,662,000.00	50,000.00	14	3.40%	2,197.58	-	-
华泰证券	2021102200050824	阳光电源	2021-10-22	3,147,400.00	20,000.00	14	3.40%	4,161.50	-	-
华泰证券	2021102200050826	阳光电源	2021-10-22	31,474,000.00	200,000.00	14	3.40%	41,615.56	-	-

华泰证券	2021102200057360	沪硅产业	2021-10-22	767,832.00	27,600.00	14	3.40%	1,015.28	-	-
华泰证券	2021102200057362	华润微	2021-10-22	1,029,143.00	14,900.00	14	3.40%	1,360.80	-	-
华泰证券	2021102200057364	沪硅产业	2021-10-22	278,200.00	10,000.00	14	3.40%	367.78	-	-
华泰证券	2021102200057366	华润微	2021-10-22	690,700.00	10,000.00	14	3.40%	913.22	-	-
华泰证券	2021102200057368	华润微	2021-10-22	870,282.00	12,600.00	14	3.40%	1,150.66	-	-
华泰证券	2021102200057370	华润微	2021-10-22	1,132,748.00	16,400.00	14	3.40%	1,497.72	-	-
华泰证券	2021102200057372	中微公司	2021-10-22	3,136,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,146.52	-	-
华泰证券	2021102200057374	沪硅产业	2021-10-22	678,808.00	24,400.00	14	3.40%	897.54	-	-
华泰证券	2021102200057376	澜起科技	2021-10-22	2,619,280.00	46,400.00	14	1.70%	1,731.66	-	-
华泰证券	2021102200057378	中微公司	2021-10-22	7,840,000.00	50,000.00	14	3.40%	10,366.16	-	-
华泰证券	2021102200057380	英科医疗	2021-10-22	560,300.00	10,000.00	14	3.40%	740.88	-	-
华泰证券	2021102200057382	英科医疗	2021-10-22	330,577.00	5,900.00	14	3.40%	437.08	-	-
华泰证券	2021102200057384	英科医疗	2021-10-22	448,240.00	8,000.00	14	3.40%	592.62	-	-
华泰证券	2021102200057386	泰格医药	2021-10-22	8,725,864.00	53,200.00	14	3.40%	11,537.54	-	-
华泰证券	2021102200057390	沃森生物	2021-10-22	1,056,704.00	17,600.00	14	3.40%	1,397.20	-	-
华泰证券	2021102200057392	健帆生物	2021-10-22	2,173,080.00	39,800.00	14	3.40%	2,873.36	-	-
华泰证券	2021102200057394	英科医疗	2021-10-22	336,180.00	6,000.00	14	3.40%	444.50	-	-
华泰证券	2021102200057396	蓝思科技	2021-10-22	197,200.00	10,000.00	14	3.40%	260.68	-	-
华泰证券	2021101100001162	东方财富	2021-10-11	6,882,000.00	200,000.00	28	3.40%	18,199.16	-	-
华泰证券	2021101100017198	芒果超媒	2021-10-11	1,101,600.00	24,000.00	28	3.40%	2,913.12	-	-
华泰证券	2021102500016452	华熙生物	2021-10-25	5,170,800.00	30,000.00	14	3.40%	6,836.90	-	-
华泰证券	2021102500016454	沪硅产业	2021-10-25	1,394,500.00	50,000.00	14	3.40%	1,843.80	-	-
华泰证券	2021102500016456	英科医疗	2021-10-25	207,176.00	3,800.00	14	3.40%	273.98	-	-
华泰证券	2021102500016458	阳光电源	2021-10-25	3,440,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,548.46	-	-
华泰证券	2021101200000714	英科医疗	2021-10-12	627,200.00	10,000.00	28	3.40%	1,658.72	-	-
华泰证券	2021101200015891	芒果超媒	2021-10-12	2,675,994.00	68,300.00	28	3.40%	7,076.44	-	-
华泰证券	2021101200015893	芒果超媒	2021-10-12	333,030.00	8,500.00	28	3.40%	880.60	-	-
华泰证券	2021101200015895	温氏股份	2021-10-12	469,084.00	30,800.00	28	3.40%	1,240.40	-	-
华泰证券	2021101200015897	温氏股份	2021-10-12	904,662.00	59,400.00	28	3.40%	2,392.32	-	-
华泰证券	2021101200015899	乐普医疗	2021-10-12	218,400.00	8,000.00	28	3.40%	577.64	-	-
华泰证券	2021101200015901	爱尔眼科	2021-10-12	6,332,480.00	123,200.00	28	3.40%	16,745.96	-	-
华泰证券	2021101200015903	汇川技术	2021-10-12	2,088,801.00	35,100.00	28	3.40%	5,523.84	-	-
华泰证券	2021101200015905	爱尔眼科	2021-10-12	1,028,000.00	20,000.00	28	3.40%	2,718.52	-	-
华泰证券	2021102600012662	华润微	2021-10-26	700,200.00	10,000.00	14	3.40%	925.82	-	-
华泰证券	2021102600012664	贝达药业	2021-10-26	218,738.00	2,600.00	14	3.40%	289.24	-	-
华泰证券	2021102600012666	阳光电源	2021-10-26	1,703,000.00	10,000.00	14	3.40%	2,251.76	-	-
华泰证券	2021102600014824	宋城演艺	2021-10-26	621,278.00	44,600.00	14	3.40%	821.52	-	-
华泰证券	2021102600014826	东方财富	2021-10-26	1,017,300.00	30,000.00	14	3.40%	1,345.12	-	-
华泰证券	2021101300018453	东方财富	2021-10-13	4,199,800.00	126,500.00	28	3.40%	11,106.20	-	-
华泰证券	2021101300018455	温氏股份	2021-10-13	897,888.00	59,700.00	28	3.40%	2,374.40	-	-
华泰证券	2021102700000514	温氏股份	2021-10-27	24,672.00	1,600.00	14	3.40%	32.62	-	-
华泰证券	2021102700016741	华润微	2021-10-27	826,462.00	13,300.00	14	3.40%	1,092.84	-	-
华泰证券	2021102700016747	东方财富	2021-10-27	1,316,000.00	40,000.00	14	3.40%	1,740.06	-	-

华泰证券	2021102700016749	英科医疗	2021-10-27	539,300.00	10,000.00	14	3.40%	713.02	-	-
华泰证券	2021102700016751	英科医疗	2021-10-27	533,907.00	9,900.00	14	3.40%	705.88	-	-
华泰证券	2021102700016753	阳光电源	2021-10-27	1,725,400.00	10,000.00	14	3.40%	2,281.30	-	-
华泰证券	2021102700016755	智飞生物	2021-10-27	1,908,400.00	13,000.00	14	3.40%	2,523.36	-	-
华泰证券	2021102700016757	阳光电源	2021-10-27	5,452,264.00	31,600.00	14	3.40%	7,209.16	-	-
华泰证券	2021102700016759	健帆生物	2021-10-27	497,840.00	9,800.00	14	3.40%	658.28	-	-
华泰证券	2021102700016761	健帆生物	2021-10-27	426,720.00	8,400.00	14	3.40%	564.20	-	-
华泰证券	2021101400010778	康泰生物	2021-10-14	108,940.00	1,000.00	28	3.40%	288.12	-	-
华泰证券	2021101400010780	汇川技术	2021-10-14	698,490.00	11,700.00	28	3.40%	1,847.16	-	-
华泰证券	2021101400010782	芒果超媒	2021-10-14	1,224,718.00	31,100.00	28	3.40%	3,238.76	-	-
华泰证券	2021102800012643	华润微	2021-10-28	600,600.00	10,000.00	14	3.40%	794.08	-	-
华泰证券	2021102800012645	沪硅产业	2021-10-28	1,080,300.00	39,000.00	14	3.40%	1,428.42	-	-
华泰证券	2021102800012651	阳光电源	2021-10-28	1,710,000.00	10,000.00	14	3.40%	2,261.00	-	-
华泰证券	2021102800012653	英科医疗	2021-10-28	512,200.00	10,000.00	14	3.40%	677.18	-	-
华泰证券	2021101500003151	中国通号	2021-10-15	3,483,136.00	680,300.00	28	2.00%	5,418.28	-	-
华泰证券	2021101500003153	澜起科技	2021-10-15	3,028,404.00	51,600.00	28	3.40%	8,008.56	-	-
华泰证券	2021101500003155	中国通号	2021-10-15	512,000.00	100,000.00	28	2.00%	796.32	-	-
华泰证券	2021101800000708	东方财富	2021-10-18	5,041,500.00	150,000.00	28	3.40%	13,331.92	-	-
华泰证券	2021110100000615	亿纬锂能	2021-11-01	1,528,100.00	14,000.00	14	3.40%	2,020.48	-	-
华泰证券	2021102000005973	亿纬锂能	2021-10-20	12,804,446.00	112,300.00	28	3.40%	33,860.68	-	-
华泰证券	2021102000005975	爱尔眼科	2021-10-20	2,476,249.00	52,900.00	28	3.40%	6,548.36	-	-
华泰证券	2021110300000494	汇川技术	2021-11-03	106,576.00	1,600.00	14	3.40%	140.98	-	-
华泰证券	2021102100000513	东方财富	2021-10-21	671,400.00	20,000.00	28	3.40%	1,775.48	-	-
华泰证券	2021102100004372	东方财富	2021-10-21	17,177,769.00	511,700.00	28	3.40%	45,425.80	-	-
华泰证券	2021102100004374	中国通号	2021-10-21	56,320.00	11,000.00	28	2.00%	87.64	-	-
华泰证券	2021102100004376	同花顺	2021-10-21	1,515,800.00	13,000.00	28	3.40%	4,008.48	-	-
华泰证券	2021102100004428	爱尔眼科	2021-10-21	3,814,902.00	81,900.00	28	3.40%	10,088.40	-	-
华泰证券	2021102200000532	东方财富	2021-10-22	3,390,480.00	102,000.00	28	3.40%	8,965.88	-	-
华泰证券	20211022000045192	乐普医疗	2021-10-22	1,294,000.00	50,000.00	28	3.40%	3,421.88	-	-
华泰证券	20211022000057388	同花顺	2021-10-22	1,488,694.00	12,700.00	28	3.40%	3,936.80	-	-
华泰证券	20211022000057398	温氏股份	2021-10-22	2,361,280.00	150,400.00	28	3.40%	6,244.28	-	-
华泰证券	2021110500000638	乐普医疗	2021-11-05	47,300.00	2,200.00	14	3.40%	62.58	-	-
华泰证券	20211105000052999	健帆生物	2021-11-05	2,027,412.00	39,800.00	14	3.40%	2,680.72	-	-
华泰证券	20211105000053001	英科医疗	2021-11-05	328,040.00	5,900.00	14	3.40%	433.72	-	-
华泰证券	20211105000053003	英科医疗	2021-11-05	333,600.00	6,000.00	14	3.40%	441.14	-	-
华泰证券	20211105000053005	英科医疗	2021-11-05	444,800.00	8,000.00	14	3.40%	588.14	-	-
华泰证券	20211105000053007	东方财富	2021-11-05	1,636,500.00	50,000.00	14	3.40%	2,163.84	-	-
华泰证券	20211105000053015	蓝思科技	2021-11-05	219,700.00	10,000.00	14	3.40%	290.50	-	-
华泰证券	20211105000053017	泰格医药	2021-11-05	7,729,960.00	53,200.00	14	3.40%	10,220.70	-	-
华泰证券	20211105000053019	阳光电源	2021-11-05	3,115,600.00	20,000.00	14	3.40%	4,119.50	-	-
华泰证券	20211105000053027	阳光电源	2021-11-05	31,156,000.00	200,000.00	14	3.40%	41,195.14	-	-
华泰证券	20211105000053869	华润微	2021-11-05	843,444.00	12,600.00	14	3.40%	1,115.24	-	-
华泰证券	20211105000053871	沪硅产业	2021-11-05	285,400.00	10,000.00	14	3.40%	377.30	-	-

华泰证券	2021110500053873	沪硅产业	2021-11-05	787,704.00	27,600.00	14	3.40%	1,041.46	-	-
华泰证券	2021110500053875	华润微	2021-11-05	1,097,816.00	16,400.00	14	3.40%	1,451.52	-	-
华泰证券	2021110500053877	华润微	2021-11-05	997,406.00	14,900.00	14	3.40%	1,318.80	-	-
华泰证券	2021110500053879	华润微	2021-11-05	669,400.00	10,000.00	14	3.40%	885.08	-	-
华泰证券	2021110500053881	沪硅产业	2021-11-05	696,376.00	24,400.00	14	3.40%	920.78	-	-
华泰证券	2021110500053883	中微公司	2021-11-05	7,859,500.00	50,000.00	14	3.40%	10,392.06	-	-
华泰证券	2021110500053887	中微公司	2021-11-05	3,143,800.00	20,000.00	14	3.40%	4,156.74	-	-
华泰证券	2021110500053889	英科医疗	2021-11-05	556,000.00	10,000.00	14	3.40%	735.14	-	-
华泰证券	2021110500054059	沃森生物	2021-11-05	906,928.00	17,600.00	14	3.40%	1,199.10	-	-
华泰证券	2021110500065013	澜起科技	2021-11-05	3,448,912.00	46,400.00	14	1.70%	2,280.18	-	-
华泰证券	2021102500000409	温氏股份	2021-10-25	1,221,400.00	77,500.00	28	3.40%	3,229.80	-	-
华泰证券	2021102500016460	乐普医疗	2021-10-25	615,252.00	23,700.00	28	3.40%	1,627.08	-	-
华泰证券	2021102500016648	亿纬锂能	2021-10-25	349,500.00	3,000.00	28	3.40%	924.28	-	-
华泰证券	2021102500016650	汇川技术	2021-10-25	954,800.00	15,400.00	28	3.40%	2,525.04	-	-
华泰证券	2021110800000756	信维通信	2021-11-08	126,429.00	5,100.00	14	3.40%	167.16	-	-
华泰证券	2021110800017028	沪硅产业	2021-11-08	1,399,000.00	50,000.00	14	3.40%	1,849.82	-	-
华泰证券	2021110800017030	华熙生物	2021-11-08	4,991,700.00	30,000.00	14	3.40%	6,600.16	-	-
华泰证券	2021110800017032	阳光电源	2021-11-08	3,160,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,178.16	-	-
华泰证券	2021110800017034	英科医疗	2021-11-08	202,502.00	3,800.00	14	3.40%	267.82	-	-
华泰证券	2021102600000717	温氏股份	2021-10-26	214,760.00	14,000.00	28	3.40%	567.84	-	-
华泰证券	2021110900000597	金山办公	2021-11-09	10,074,252.00	34,800.00	14	3.40%	13,320.44	-	-
华泰证券	2021110900000599	温氏股份	2021-11-09	3,964,428.00	236,400.00	14	3.40%	5,241.88	-	-
华泰证券	2021110900014226	贝达药业	2021-11-09	208,338.00	2,600.00	14	3.40%	275.52	-	-
华泰证券	2021110900017796	华润微	2021-11-09	677,200.00	10,000.00	14	3.40%	895.44	-	-
华泰证券	2021110900017798	阳光电源	2021-11-09	1,602,100.00	10,000.00	14	3.40%	2,118.34	-	-
华泰证券	2021110900017800	东方财富	2021-11-09	1,004,700.00	30,000.00	14	3.40%	1,328.46	-	-
华泰证券	2021102700016745	乐普医疗	2021-10-27	360,576.00	14,400.00	28	3.40%	953.40	-	-
华泰证券	2021102700016763	芒果超媒	2021-10-27	211,248.00	5,400.00	28	3.40%	558.60	-	-
华泰证券	2021111000000891	智飞生物	2021-11-10	3,948,624.00	30,600.00	14	3.40%	5,221.02	-	-
华泰证券	2021111000016931	东方财富	2021-11-10	1,344,800.00	40,000.00	14	3.40%	1,778.14	-	-
华泰证券	2021111000016933	英科医疗	2021-11-10	545,000.00	10,000.00	14	3.40%	720.58	-	-
华泰证券	2021111000016935	阳光电源	2021-11-10	5,021,240.00	31,600.00	14	3.40%	6,639.22	-	-
华泰证券	2021111000016937	健帆生物	2021-11-10	417,396.00	8,400.00	14	3.40%	551.88	-	-
华泰证券	2021111000016939	智飞生物	2021-11-10	1,677,520.00	13,000.00	14	3.40%	2,218.02	-	-
华泰证券	2021111000016941	阳光电源	2021-11-10	1,589,000.00	10,000.00	14	3.40%	2,100.98	-	-
华泰证券	2021111000016943	英科医疗	2021-11-10	539,550.00	9,900.00	14	3.40%	713.44	-	-
华泰证券	2021111000016945	健帆生物	2021-11-10	486,962.00	9,800.00	14	3.40%	643.86	-	-
华泰证券	2021111000019197	华润微	2021-11-10	905,597.00	13,300.00	14	3.40%	1,197.42	-	-
华泰证券	2021111000019227	温氏股份	2021-11-10	26,672.00	1,600.00	14	3.40%	35.28	-	-
华泰证券	2021102800012647	汇川技术	2021-10-28	1,460,760.00	22,200.00	28	3.40%	3,862.88	-	-
华泰证券	2021102800012649	爱尔眼科	2021-10-28	5,623,904.00	122,900.00	28	3.40%	14,872.20	-	-
华泰证券	2021102800012655	温氏股份	2021-10-28	1,473,099.00	95,100.00	28	3.40%	3,895.64	-	-
华泰证券	2021111000012830	沪硅产业	2021-11-11	1,193,400.00	39,000.00	14	3.40%	1,577.94	-	-

华泰证券	2021111100014584	华润微	2021-11-11	696,800.00	10,000.00	14	3.40%	921.34	-	-
华泰证券	2021111100014618	英科医疗	2021-11-11	548,800.00	10,000.00	14	3.40%	725.62	-	-
华泰证券	2021111100014620	阳光电源	2021-11-11	1,609,800.00	10,000.00	14	3.40%	2,128.56	-	-
华泰证券	2021111500006407	亿纬锂能	2021-11-15	1,780,660.00	14,000.00	14	3.40%	2,354.38	-	-
华泰证券	2021111600000785	华大基因	2021-11-16	669,528.00	7,200.00	14	3.40%	885.22	-	-
华泰证券	2021111700000602	传音控股	2021-11-17	14,102,325.00	80,700.00	14	3.40%	18,646.46	-	-
华泰证券	2021111700000604	智飞生物	2021-11-17	5,173,980.00	38,100.00	14	3.40%	6,841.10	-	-
华泰证券	2021111800000808	三环集团	2021-11-18	8,236,000.00	200,000.00	14	3.40%	10,889.76	-	-
华泰证券	2021111800000810	乐普医疗	2021-11-18	370,239.00	16,700.00	14	3.40%	489.58	-	-
华泰证券	2021111800000812	传音控股	2021-11-18	1,695,400.00	10,000.00	14	3.40%	2,241.68	-	-
华泰证券	2021110500053009	爱尔眼科	2021-11-05	2,957,890.00	61,000.00	28	3.40%	7,822.08	-	-
华泰证券	2021110500053011	同花顺	2021-11-05	2,179,935.00	19,300.00	28	3.40%	5,764.64	-	-
华泰证券	2021110500053013	智飞生物	2021-11-05	4,622,136.00	34,800.00	28	3.40%	12,223.12	-	-
华泰证券	2021110500053021	温氏股份	2021-11-05	1,284,582.00	76,600.00	28	3.40%	3,396.96	-	-
华泰证券	2021110500053023	温氏股份	2021-11-05	1,754,142.00	104,600.00	28	3.40%	4,638.76	-	-
华泰证券	2021110500053025	先导智能	2021-11-05	4,060,602.00	48,100.00	28	3.40%	10,738.00	-	-
华泰证券	2021110500053029	沃森生物	2021-11-05	7,981,997.00	154,900.00	28	3.40%	21,108.08	-	-
华泰证券	2021110500053885	澜起科技	2021-11-05	1,085,218.00	14,600.00	28	3.40%	2,869.72	-	-
华泰证券	2021110500053891	欧普康视	2021-11-05	3,119,280.00	49,200.00	28	3.40%	8,248.80	-	-
华泰证券	2021110500054051	信维通信	2021-11-05	594,550.00	23,500.00	28	3.40%	1,572.20	-	-
华泰证券	2021110500054053	汇川技术	2021-11-05	1,437,332.00	21,100.00	28	3.40%	3,801.00	-	-
华泰证券	2021110500054055	沃森生物	2021-11-05	530,759.00	10,300.00	28	3.40%	1,403.64	-	-
华泰证券	2021110500054057	沃森生物	2021-11-05	1,545,900.00	30,000.00	28	3.40%	4,088.00	-	-
华泰证券	2021110500059363	同花顺	2021-11-05	1,558,710.00	13,800.00	28	3.40%	4,121.88	-	-
华泰证券	2021110500065567	亿纬锂能	2021-11-05	2,110,914.00	18,600.00	28	3.40%	5,582.08	-	-
华泰证券	2021110500065569	康泰生物	2021-11-05	1,088,500.00	10,000.00	28	3.40%	2,878.40	-	-
华泰证券	2021110500065571	康泰生物	2021-11-05	1,785,140.00	16,400.00	28	3.40%	4,720.80	-	-
华泰证券	2021111900000571	三环集团	2021-11-19	474,980.00	11,000.00	14	3.40%	628.04	-	-
华泰证券	2021111900042267	华润微	2021-11-19	821,520.00	12,600.00	14	3.40%	1,086.26	-	-
华泰证券	2021111900042269	华润微	2021-11-19	1,069,280.00	16,400.00	14	3.40%	1,413.86	-	-
华泰证券	2021111900042271	华润微	2021-11-19	971,480.00	14,900.00	14	3.40%	1,284.50	-	-
华泰证券	2021111900042273	华润微	2021-11-19	652,000.00	10,000.00	14	3.40%	862.12	-	-
华泰证券	2021111900042275	中微公司	2021-11-19	3,290,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,350.08	-	-
华泰证券	2021111900042277	中微公司	2021-11-19	8,225,000.00	50,000.00	14	3.40%	10,875.34	-	-
华泰证券	2021111900042279	英科医疗	2021-11-19	325,031.00	5,900.00	14	3.40%	429.80	-	-
华泰证券	2021111900042281	英科医疗	2021-11-19	330,540.00	6,000.00	14	3.40%	437.08	-	-
华泰证券	2021111900042283	英科医疗	2021-11-19	440,720.00	8,000.00	14	3.40%	582.68	-	-
华泰证券	2021111900042285	英科医疗	2021-11-19	550,900.00	10,000.00	14	3.40%	728.42	-	-
华泰证券	2021111900042287	阳光电源	2021-11-19	3,030,400.00	20,000.00	14	3.40%	4,006.80	-	-
华泰证券	2021111900042289	沃森生物	2021-11-19	1,098,064.00	17,600.00	14	3.40%	1,451.94	-	-
华泰证券	2021111900042291	阳光电源	2021-11-19	30,304,000.00	200,000.00	14	3.40%	40,068.56	-	-
华泰证券	2021111900042293	蓝思科技	2021-11-19	231,000.00	10,000.00	14	3.40%	305.48	-	-
华泰证券	2021111900042297	东方财富	2021-11-19	1,761,000.00	50,000.00	14	3.40%	2,328.48	-	-

华泰证券	2021110800017036	东方财富	2021-11-08	6,664,000.00	200,000.00	28	3.40%	17,622.64	-	-
华泰证券	2021112200000832	欧普康视	2021-11-22	1,557,500.00	25,000.00	14	3.40%	2,059.40	-	-
华泰证券	2021112200000834	东方财富	2021-11-22	8,229,870.00	229,500.00	14	3.40%	10,881.78	-	-
华泰证券	2021112200014942	华熙生物	2021-11-22	5,007,300.00	30,000.00	14	3.40%	6,620.74	-	-
华泰证券	2021112200014944	英科医疗	2021-11-22	207,632.00	3,800.00	14	3.40%	274.54	-	-
华泰证券	2021112200014952	阳光电源	2021-11-22	3,160,600.00	20,000.00	14	3.40%	4,179.00	-	-
华泰证券	2021110900017426	英科医疗	2021-11-09	534,300.00	10,000.00	28	3.40%	1,412.88	-	-
华泰证券	2021110900017868	芒果超媒	2021-11-09	373,660.00	8,500.00	28	3.40%	988.12	-	-
华泰证券	2021110900017870	芒果超媒	2021-11-09	3,002,468.00	68,300.00	28	3.40%	7,939.96	-	-
华泰证券	2021112300000644	沃森生物	2021-11-23	682,528.00	11,200.00	14	3.40%	902.44	-	-
华泰证券	2021112300012492	华润微	2021-11-23	727,400.00	10,000.00	14	3.40%	961.80	-	-
华泰证券	2021112300012496	阳光电源	2021-11-23	1,566,100.00	10,000.00	14	3.40%	2,070.74	-	-
华泰证券	2021112300012498	温氏股份	2021-11-23	3,936,060.00	236,400.00	14	3.40%	5,204.36	-	-
华泰证券	2021112300012500	东方财富	2021-11-23	1,070,700.00	30,000.00	14	3.40%	1,415.68	-	-
华泰证券	2021112300012944	贝达药业	2021-11-23	227,188.00	2,600.00	14	3.40%	300.44	-	-
华泰证券	2021111000016929	东方财富	2021-11-10	4,252,930.00	126,500.00	28	3.40%	11,246.76	-	-
华泰证券	2021111000019229	温氏股份	2021-11-10	995,199.00	59,700.00	28	3.40%	2,631.72	-	-
华泰证券	2021112400000449	金山办公	2021-11-24	4,174,002.00	15,700.00	14	3.40%	5,518.94	-	-
华泰证券	2021112400000451	先导智能	2021-11-24	2,908,360.00	36,400.00	14	3.40%	3,845.52	-	-
华泰证券	2021112400000453	阳光电源	2021-11-24	1,276,716.00	8,400.00	14	3.40%	1,688.12	-	-
华泰证券	2021112400000455	智飞生物	2021-11-24	2,699,008.00	20,800.00	14	3.40%	3,568.74	-	-
华泰证券	2021112400015283	英科医疗	2021-11-24	539,352.00	9,900.00	14	3.40%	713.16	-	-
华泰证券	2021112400015285	英科医疗	2021-11-24	544,800.00	10,000.00	14	3.40%	720.30	-	-
华泰证券	2021112400016909	华润微	2021-11-24	971,033.00	13,300.00	14	3.40%	1,283.94	-	-
华泰证券	2021112400016911	智飞生物	2021-11-24	3,970,656.00	30,600.00	14	3.40%	5,250.14	-	-
华泰证券	2021112400016913	智飞生物	2021-11-24	1,686,880.00	13,000.00	14	3.40%	2,230.48	-	-
华泰证券	2021112400016917	阳光电源	2021-11-24	1,519,900.00	10,000.00	14	3.40%	2,009.70	-	-
华泰证券	2021112400016919	健帆生物	2021-11-24	456,204.00	8,400.00	14	3.40%	603.26	-	-
华泰证券	2021112400016923	健帆生物	2021-11-24	532,238.00	9,800.00	14	3.40%	703.78	-	-
华泰证券	2021112400016925	阳光电源	2021-11-24	4,802,884.00	31,600.00	14	3.40%	6,350.54	-	-
华泰证券	2021111100012832	芒果超媒	2021-11-11	1,344,142.00	31,100.00	28	3.40%	3,554.60	-	-
华泰证券	2021111100014622	康泰生物	2021-11-11	105,760.00	1,000.00	28	3.40%	279.72	-	-
华泰证券	2021112500000648	健帆生物	2021-11-25	443,620.00	8,200.00	14	3.40%	586.60	-	-
华泰证券	2021112500000650	先导智能	2021-11-25	948,360.00	12,000.00	14	3.40%	1,253.98	-	-
华泰证券	2021112500000652	华大基因	2021-11-25	1,675,175.00	18,500.00	14	3.40%	2,214.94	-	-
华泰证券	2021112500000654	乐普医疗	2021-11-25	1,249,908.00	55,700.00	14	3.40%	1,652.70	-	-
华泰证券	2021112500000656	泰格医药	2021-11-25	668,208.00	4,800.00	14	3.40%	883.54	-	-
华泰证券	2021112500000658	沃森生物	2021-11-25	1,844,294.00	27,400.00	14	3.40%	2,438.52	-	-
华泰证券	2021112500009490	华润微	2021-11-25	733,300.00	10,000.00	14	3.40%	969.64	-	-
华泰证券	2021112500009492	阳光电源	2021-11-25	1,484,900.00	10,000.00	14	3.40%	1,963.36	-	-
华泰证券	2021112500009494	英科医疗	2021-11-25	565,600.00	10,000.00	14	3.40%	747.88	-	-
华泰证券	2021111200004783	澜起科技	2021-11-12	3,983,520.00	51,600.00	28	3.40%	10,534.16	-	-
华泰证券	2021112600000689	华大基因	2021-11-26	134,100.00	1,500.00	14	3.40%	177.38	-	-

华泰证券	2021111500006409	东方财富	2021-11-15	5,299,500.00	150,000.00	28	3.40%	14,014.28	-	-
华泰证券	2021112900000542	健帆生物	2021-11-29	185,815.00	3,500.00	14	3.40%	245.70	-	-
华泰证券	2021112900000544	蓝思科技	2021-11-29	168,960.00	8,000.00	14	3.40%	223.44	-	-
华泰证券	2021112900000546	宋城演艺	2021-11-29	376,090.00	28,600.00	14	3.40%	497.28	-	-
华泰证券	2021112900000515	亿纬锂能	2021-11-29	2,072,000.00	14,000.00	14	3.40%	2,739.66	-	-
华泰证券	2021113000004157	华大基因	2021-11-30	684,000.00	7,200.00	14	3.40%	904.40	-	-
华泰证券	2021111700006139	亿纬锂能	2021-11-17	14,138,570.00	112,300.00	28	3.40%	37,388.68	-	-
华泰证券	2021120100000762	健帆生物	2021-12-01	617,463.00	12,100.00	14	3.40%	816.48	-	-
华泰证券	2021120100004873	传音控股	2021-12-01	12,859,545.00	80,700.00	14	3.40%	17,003.14	-	-
华泰证券	2021111800006309	东方财富	2021-11-18	693,800.00	20,000.00	28	3.40%	1,834.84	-	-
华泰证券	2021111800006311	东方财富	2021-11-18	17,750,873.00	511,700.00	28	3.40%	46,941.16	-	-
华泰证券	2021120200004991	传音控股	2021-12-02	1,555,500.00	10,000.00	14	3.40%	2,056.74	-	-
华泰证券	2021120200004997	乐普医疗	2021-12-02	363,058.00	16,700.00	14	3.40%	480.06	-	-
华泰证券	2021111900042295	东方财富	2021-11-19	3,592,440.00	102,000.00	28	3.40%	9,500.12	-	-
华泰证券	2021120300000872	爱尔眼科	2021-12-03	383,565.00	9,100.00	14	3.40%	507.22	-	-
华泰证券	2021120300000874	智飞生物	2021-12-03	1,356,864.00	11,100.00	14	3.40%	1,794.10	-	-
华泰证券	2021120300016161	英科医疗	2021-12-03	608,500.00	10,000.00	14	3.40%	804.58	-	-
华泰证券	2021120300016163	华润微	2021-12-03	922,320.00	12,600.00	14	3.40%	1,219.54	-	-
华泰证券	2021120300016165	蓝思科技	2021-12-03	208,400.00	10,000.00	14	3.40%	275.52	-	-
华泰证券	2021120300016177	阳光电源	2021-12-03	3,059,800.00	20,000.00	14	3.40%	4,045.72	-	-
华泰证券	2021120300016183	英科医疗	2021-12-03	486,800.00	8,000.00	14	3.40%	643.72	-	-
华泰证券	2021120300023737	沃森生物	2021-12-03	1,159,488.00	17,600.00	14	3.40%	1,533.14	-	-
华泰证券	2021120300023743	英科医疗	2021-12-03	359,015.00	5,900.00	14	3.40%	474.74	-	-
华泰证券	2021120300023749	英科医疗	2021-12-03	365,100.00	6,000.00	14	3.40%	482.72	-	-
华泰证券	2021120300023753	中微公司	2021-12-03	3,138,000.00	20,000.00	14	3.40%	4,149.18	-	-
华泰证券	2021120300023757	东方财富	2021-12-03	1,743,500.00	50,000.00	14	3.40%	2,305.24	-	-
华泰证券	2021120300023759	华润微	2021-12-03	732,000.00	10,000.00	14	3.40%	967.82	-	-
华泰证券	2021120300023771	阳光电源	2021-12-03	30,598,000.00	200,000.00	14	3.40%	40,457.34	-	-
华泰证券	2021112200014946	温氏股份	2021-11-22	1,314,400.00	77,500.00	28	3.40%	3,475.92	-	-
华泰证券	2021112200014948	亿纬锂能	2021-11-22	418,740.00	3,000.00	28	3.40%	1,107.40	-	-
华泰证券	2021112200014950	乐普医疗	2021-11-22	529,458.00	23,700.00	28	3.40%	1,400.00	-	-
华泰证券	2021112200014954	汇川技术	2021-11-22	1,022,868.00	15,400.00	28	3.40%	2,704.80	-	-
华泰证券	2021120600000741	中微公司	2021-12-06	4,881,657.00	31,900.00	14	3.40%	6,454.70	-	-
华泰证券	2021120600000743	三环集团	2021-12-06	434,434.00	9,800.00	14	3.40%	574.42	-	-
华泰证券	20211206000008756	华熙生物	2021-12-06	4,770,000.00	30,000.00	14	3.40%	6,307.00	-	-
华泰证券	20211206000008758	英科医疗	2021-12-06	222,490.00	3,800.00	14	3.40%	294.14	-	-
华泰证券	20211206000008762	东方财富	2021-12-06	8,099,055.00	229,500.00	14	3.40%	10,708.74	-	-
华泰证券	20211206000008908	欧普康视	2021-12-06	1,381,500.00	25,000.00	14	3.40%	1,826.72	-	-
华泰证券	2021112300012494	温氏股份	2021-11-23	233,100.00	14,000.00	28	3.40%	616.56	-	-
华泰证券	20211207000008239	温氏股份	2021-12-07	4,146,456.00	236,400.00	14	3.40%	5,482.54	-	-
华泰证券	20211207000008241	沃森生物	2021-12-07	703,808.00	11,200.00	14	3.40%	930.58	-	-
华泰证券	2021120800000909	同花顺	2021-12-08	2,540,552.00	19,600.00	14	3.40%	3,359.16	-	-
华泰证券	20211208000007242	健帆生物	2021-12-08	497,448.00	9,800.00	14	3.40%	657.72	-	-

华泰证券	2021120800007246	智飞生物	2021-12-08	3,792,258.00	30,600.00	14	3.40%	5,014.24	-	-
华泰证券	2021120800007248	阳光电源	2021-12-08	4,746,320.00	31,600.00	14	3.40%	6,275.64	-	-
华泰证券	2021120800007258	英科医疗	2021-12-08	605,600.00	10,000.00	14	3.40%	800.80	-	-
华泰证券	2021120800007440	智飞生物	2021-12-08	2,577,744.00	20,800.00	14	3.40%	3,408.30	-	-
华泰证券	2021120800007454	阳光电源	2021-12-08	1,261,680.00	8,400.00	14	3.40%	1,668.24	-	-
华泰证券	2021120800007460	英科医疗	2021-12-08	599,544.00	9,900.00	14	3.40%	792.68	-	-
华泰证券	2021120900006671	乐普医疗	2021-12-09	1,246,566.00	55,700.00	14	3.40%	1,648.22	-	-
华泰证券	2021120900008223	健帆生物	2021-12-09	428,696.00	8,200.00	14	3.40%	566.86	-	-
华泰证券	2021120900008227	阳光电源	2021-12-09	1,480,300.00	10,000.00	14	3.40%	1,957.34	-	-
华泰证券	2021120900008233	沃森生物	2021-12-09	1,729,214.00	27,400.00	14	3.40%	2,286.48	-	-
华泰证券	2021120900008793	英科医疗	2021-12-09	599,200.00	10,000.00	14	3.40%	792.26	-	-
华泰证券	2021120900008795	华大基因	2021-12-09	1,706,625.00	18,500.00	14	3.40%	2,256.52	-	-
华泰证券	2021121000004307	华大基因	2021-12-10	138,315.00	1,500.00	14	3.40%	182.84	-	-
华泰证券	2021121300001034	智飞生物	2021-12-13	308,472.00	2,400.00	14	3.40%	407.82	-	-
华泰证券	2021121300001038	东方财富	2021-12-13	11,439,000.00	300,000.00	14	3.40%	15,124.90	-	-
华泰证券	2021121300009563	宋城演艺	2021-12-13	394,394.00	28,600.00	14	3.40%	521.50	-	-
华泰证券	2021121300009565	亿纬锂能	2021-12-13	1,924,020.00	14,000.00	14	3.40%	2,543.94	-	-
华泰证券	2021121300009935	健帆生物	2021-12-13	184,940.00	3,500.00	14	3.40%	244.58	-	-
华泰证券	2021121400001093	英科医疗	2021-12-14	102,102.00	1,700.00	14	3.40%	134.96	-	-
华泰证券	2021121400001095	华大基因	2021-12-14	1,034,520.00	11,100.00	14	3.40%	1,367.94	-	-
华泰证券	2021121400001097	东方财富	2021-12-14	11,493,000.00	300,000.00	14	3.40%	15,196.30	-	-
华泰证券	2021121400012760	华大基因	2021-12-14	671,040.00	7,200.00	14	3.40%	887.32	-	-
华泰证券	2021121500001919	华大基因	2021-12-15	451,000.00	5,000.00	14	3.40%	596.26	-	-
华泰证券	2021121500001923	沪硅产业	2021-12-15	5,420,000.00	200,000.00	14	3.40%	7,166.46	-	-
华泰证券	2021121500015539	传音控股	2021-12-15	12,234,120.00	80,700.00	14	3.40%	16,176.30	-	-
华泰证券	2021121500015541	健帆生物	2021-12-15	633,072.00	12,100.00	14	3.40%	837.06	-	-
华泰证券	2021121600000912	沪硅产业	2021-12-16	677,500.00	25,000.00	14	3.40%	895.86	-	-
华泰证券	2021121600000916	爱尔眼科	2021-12-16	100,050.00	2,300.00	14	3.40%	132.30	-	-
华泰证券	2021121600008325	传音控股	2021-12-16	1,539,300.00	10,000.00	14	3.40%	2,035.32	-	-
华泰证券	2021120300020565	汇川技术	2021-12-03	1,389,646.00	21,100.00	28	3.40%	3,674.72	-	-
华泰证券	2021120300020569	沃森生物	2021-12-03	10,204,812.00	154,900.00	28	3.40%	26,986.12	-	-
华泰证券	2021120300023551	沃森生物	2021-12-03	678,564.00	10,300.00	28	3.40%	1,794.52	-	-
华泰证券	2021120300023553	温氏股份	2021-12-03	1,830,500.00	104,600.00	28	3.40%	4,840.64	-	-
华泰证券	2021120300023557	欧普康视	2021-12-03	2,736,012.00	49,200.00	28	3.40%	7,235.20	-	-
华泰证券	2021120300023559	温氏股份	2021-12-03	1,340,500.00	76,600.00	28	3.40%	3,544.80	-	-
华泰证券	2021120300023561	澜起科技	2021-12-03	1,126,682.00	14,600.00	28	3.40%	2,979.48	-	-
华泰证券	2021121700001494	华大基因	2021-12-17	360,440.00	4,000.00	14	3.40%	476.56	-	-
华泰证券	2021121700024228	英科医疗	2021-12-17	448,640.00	8,000.00	14	3.40%	593.18	-	-
华泰证券	2021121700025310	爱尔眼科	2021-12-17	389,753.00	9,100.00	14	3.40%	515.34	-	-
华泰证券	2021121700026110	阳光电源	2021-12-17	29,300,000.00	200,000.00	14	3.40%	38,741.08	-	-
华泰证券	2021121700027152	英科医疗	2021-12-17	336,480.00	6,000.00	14	3.40%	444.92	-	-
华泰证券	2021121700027160	沃森生物	2021-12-17	1,171,280.00	17,600.00	14	3.40%	1,548.68	-	-
华泰证券	2021121700027964	蓝思科技	2021-12-17	237,100.00	10,000.00	14	3.40%	313.46	-	-

华泰证券	2021120700008237	英科医疗	2021-12-07	590,000.00	10,000.00	28	3.40%	1,337.28	578,400.00	1,337.28
华泰证券	2021120700008243	芒果超媒	2021-12-07	384,115.00	8,500.00	28	3.40%	870.72	486,370.00	870.72
华泰证券	2021120700008245	芒果超媒	2021-12-07	3,086,477.00	68,300.00	28	3.40%	6,996.00	3,908,126.00	6,996.00
华泰证券	2021122000009179	欧普康视	2021-12-20	1,498,000.00	25,000.00	14	3.40%	1,556.28	1,434,250.00	1,556.28
华泰证券	2021122000009187	英科医疗	2021-12-20	227,848.00	3,800.00	14	3.40%	236.72	219,792.00	236.72
华泰证券	2021122000009331	中微公司	2021-12-20	4,244,295.00	31,900.00	14	3.40%	4,409.35	4,038,540.00	4,409.35
华泰证券	2021122000009333	东方财富	2021-12-20	8,622,315.00	229,500.00	14	3.40%	8,957.63	8,516,745.00	8,957.63
华泰证券	2021122100001105	中微公司	2021-12-21	2,638,400.00	20,000.00	14	3.40%	2,491.80	2,532,000.00	2,491.80
华泰证券	2021122100001107	蓝思科技	2021-12-21	1,247,664.00	52,800.00	14	3.40%	1,178.40	1,213,344.00	1,178.40
华泰证券	2021122100019181	沃森生物	2021-12-21	692,048.00	11,200.00	14	3.40%	653.60	629,440.00	653.60
华泰证券	2021122100020059	温氏股份	2021-12-21	4,255,200.00	236,400.00	14	3.40%	4,018.80	4,553,064.00	4,018.80
华泰证券	2021120800007238	温氏股份	2021-12-08	1,044,153.00	59,700.00	28	3.40%	2,268.03	1,149,822.00	2,268.03
华泰证券	2021120800007350	东方财富	2021-12-08	4,570,445.00	126,500.00	28	3.40%	9,927.95	4,694,415.00	9,927.95
华泰证券	2021122200001223	英科医疗	2021-12-22	115,160.00	2,000.00	14	3.40%	97.92	115,680.00	97.92
华泰证券	2021122200011790	英科医疗	2021-12-22	575,800.00	10,000.00	14	3.40%	489.42	578,400.00	489.42
华泰证券	2021122200011792	英科医疗	2021-12-22	570,042.00	9,900.00	14	3.40%	484.56	572,616.00	484.56
华泰证券	2021122200011794	阳光电源	2021-12-22	1,154,160.00	8,400.00	14	3.40%	981.00	1,224,720.00	981.00
华泰证券	2021122200011796	阳光电源	2021-12-22	4,341,840.00	31,600.00	14	3.40%	3,690.54	4,607,280.00	3,690.54
华泰证券	2021122200011798	智飞生物	2021-12-22	2,686,944.00	20,800.00	14	3.40%	2,283.93	2,591,680.00	2,283.93
华泰证券	2021122200011800	同花顺	2021-12-22	2,813,188.00	19,600.00	14	3.40%	2,391.21	2,833,768.00	2,391.21
华泰证券	2021122200011866	智飞生物	2021-12-22	3,952,908.00	30,600.00	14	3.40%	3,359.97	3,812,760.00	3,359.97
华泰证券	2021120900008231	芒果超媒	2021-12-09	1,454,858.00	31,100.00	28	3.40%	3,022.80	1,779,542.00	3,022.80

华泰证券	2021122300000566	蓝思科技	2021-12-23	1,724,800.00	70,000.00	14	3.40%	1,303.20	1,608,600.00	1,303.20
华泰证券	2021122300011355	华大基因	2021-12-23	1,642,985.00	18,500.00	14	3.40%	1,241.36	1,624,300.00	1,241.36
华泰证券	2021122300011357	沃森生物	2021-12-23	1,644,548.00	27,400.00	14	3.40%	1,242.56	1,539,880.00	1,242.56
华泰证券	2021121000003405	澜起科技	2021-12-10	3,870,000.00	51,600.00	28	3.40%	7,675.50	4,327,692.00	7,675.50
华泰证券	2021122400001144	金龙鱼	2021-12-24	1,074,164.00	16,900.00	14	3.40%	710.15	1,063,517.00	710.15
华泰证券	2021122400011144	华大基因	2021-12-24	133,440.00	1,500.00	14	3.40%	88.20	131,700.00	88.20
华泰证券	2021121300001028	康泰生物	2021-12-13	167,010.00	1,500.00	28	3.40%	283.86	147,810.00	283.86
华泰证券	2021121300001030	华大基因	2021-12-13	305,019.00	3,300.00	28	3.40%	518.58	289,740.00	518.58
华泰证券	2021121300001032	欧普康视	2021-12-13	88,578.00	1,400.00	28	3.40%	150.66	80,318.00	150.66
华泰证券	2021121300001036	贝达药业	2021-12-13	246,570.00	3,000.00	28	3.40%	419.22	239,490.00	419.22
华泰证券	2021122700001064	阳光电源	2021-12-27	936,330.00	6,900.00	14	3.40%	353.72	1,006,020.00	353.72
华泰证券	2021122700001066	金龙鱼	2021-12-27	1,370,792.00	21,200.00	14	3.40%	517.84	1,334,116.00	517.84
华泰证券	20211227000008154	东方财富	2021-12-27	11,091,000.00	300,000.00	14	3.40%	4,189.92	11,133,000.00	4,189.92
华泰证券	20211227000008156	宋城演艺	2021-12-27	406,406.00	28,600.00	14	3.40%	153.52	409,552.00	153.52
华泰证券	20211227000008158	亿纬锂能	2021-12-27	1,659,000.00	14,000.00	14	3.40%	626.72	1,654,520.00	626.72
华泰证券	2021122800001197	华大基因	2021-12-28	1,329,750.00	15,000.00	14	3.40%	376.77	1,317,000.00	376.77
华泰证券	2021122800001199	爱尔眼科	2021-12-28	7,817,480.00	179,300.00	14	3.40%	2,214.96	7,580,804.00	2,214.96
华泰证券	2021122800014204	东方财富	2021-12-28	11,298,000.00	300,000.00	14	3.40%	3,201.09	11,133,000.00	3,201.09
华泰证券	2021122800014206	华大基因	2021-12-28	984,015.00	11,100.00	14	3.40%	278.82	974,580.00	278.82
华泰证券	2021122800014210	英科医疗	2021-12-28	96,441.00	1,700.00	14	3.40%	27.33	98,328.00	27.33
华泰证券	2021122800014214	华大基因	2021-12-28	638,280.00	7,200.00	14	3.40%	180.84	632,160.00	180.84

华泰证券	2021121500001925	东方财富	2021-12-15	2,126,850.00	55,000.00	28	3.40%	3,213.92	2,041,050.00	3,213.92
华泰证券	2021121500015543	亿纬锂能	2021-12-15	14,823,600.00	112,300.00	28	3.40%	22,400.16	13,271,614.00	22,400.16
华泰证券	2021122900000845	中芯国际	2021-12-29	6,628,161.00	125,700.00	14	3.40%	1,251.98	6,660,843.00	1,251.98
华泰证券	2021122900000848	华大基因	2021-12-29	458,588.00	5,200.00	14	3.40%	86.62	456,560.00	86.62
华泰证券	2021122900010504	华大基因	2021-12-29	440,950.00	5,000.00	14	3.40%	83.30	439,000.00	83.30
华泰证券	2021122900010984	沪硅产业	2021-12-29	5,106,000.00	200,000.00	14	3.40%	964.46	5,164,000.00	964.46
华泰证券	2021122900010992	健帆生物	2021-12-29	631,862.00	12,100.00	14	3.40%	119.36	644,930.00	119.36
华泰证券	2021121600000914	东方财富	2021-12-16	3,878,000.00	100,000.00	28	3.40%	5,493.90	3,711,000.00	5,493.90
华泰证券	2021121600008321	东方财富	2021-12-16	19,843,726.00	511,700.00	28	3.40%	28,111.95	18,989,187.00	28,111.95
华泰证券	2021121700001496	东方财富	2021-12-17	3,793,000.00	100,000.00	28	3.40%	5,015.22	3,711,000.00	5,015.22
华泰证券	2021122000001209	中芯国际	2021-12-20	31,722,000.00	600,000.00	28	3.40%	32,955.67	31,794,000.00	32,955.67
华泰证券	2021122000001213	阳光电源	2021-12-20	5,600,320.00	40,700.00	28	3.40%	5,818.12	5,934,060.00	5,818.12
华泰证券	2021122000009327	汇川技术	2021-12-20	1,082,928.00	15,400.00	28	3.40%	1,125.08	1,056,440.00	1,125.08
华泰证券	2021122100001109	爱尔眼科	2021-12-21	5,139,904.00	119,200.00	28	3.40%	4,854.40	5,039,776.00	4,854.40
华泰证券	2021123000000728	爱尔眼科	2021-12-30	2,706,300.00	62,000.00	28	3.40%	255.60	2,621,360.00	255.60
华泰证券	2021123000008920	爱尔眼科	2021-12-30	100,395.00	2,300.00	14	3.40%	9.48	97,244.00	9.48
华泰证券	2021123000008922	沪硅产业	2021-12-30	647,500.00	25,000.00	14	3.40%	61.15	645,500.00	61.15
华泰证券	2021123100000915	智飞生物	2021-12-31	124,600.00	1,000.00	14	3.40%	-	124,600.00	-
华泰证券	2021123100000917	中芯国际	2021-12-31	5,611,641.00	105,900.00	14	2.00%	-	5,611,641.00	-
华泰证券	2021123100023486	欧普康视	2021-12-31	2,822,604.00	49,200.00	28	3.40%	-	2,822,604.00	-

华泰证券	2021123100023496	沃森生物	2021-12-31	989,120.00	17,600.00	14	3.40%	-	989,120.00	-
华泰证券	2021123100027210	汇川技术	2021-12-31	1,447,460.00	21,100.00	28	3.40%	-	1,447,460.00	-
华泰证券	2021123100027214	英科医疗	2021-12-31	347,040.00	6,000.00	14	3.40%	-	347,040.00	-
华泰证券	2021123100027216	爱尔眼科	2021-12-31	384,748.00	9,100.00	14	3.40%	-	384,748.00	-
华泰证券	2021123100027218	温氏股份	2021-12-31	1,475,316.00	76,600.00	28	3.40%	-	1,475,316.00	-
华泰证券	2021123100027220	沃森生物	2021-12-31	8,705,380.00	154,900.00	28	3.40%	-	8,705,380.00	-
华泰证券	2021123100027228	华大基因	2021-12-31	351,200.00	4,000.00	14	3.40%	-	351,200.00	-
上年度可比期间 2020年1月1日至2020年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:张)	出借期限(单位:天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2020121800008187	亿纬锂能	2020-12-18	11,281,734.00	156,300	14	3.40%	13,851.50	12,738,450.00	13,851.50
华泰证券	2020122100000212	亿纬锂能	2020-12-21	536,410.00	7,000	14	4.40%	655.60	570,500.00	655.60
华泰证券	2020122200000763	亿纬锂能	2020-12-22	1,035,860.00	14,000	14	4.40%	1,139.49	1,141,000.00	1,139.49
华泰证券	2020122200000765	沃森生物	2020-12-22	998,250.00	25,000	14	4.40%	1,098.09	964,000.00	1,098.09
华泰证券	20201222010229	沃森生物	2020-12-22	79,860.00	2,000	14	3.40%	67.86	77,120.00	67.86
华泰证券	2020122300000409	华大基因	2020-12-23	462,490.00	3,500	14	4.40%	452.24	449,960.00	452.24
华泰证券	2020122300000411	蓝思科技	2020-12-23	1,423,365.00	46,500	14	4.40%	1,391.76	1,423,365.00	1,391.76
华泰证券	2020122300007338	沃森生物	2020-12-23	585,150.00	15,000	14	3.40%	442.08	578,400.00	442.08
华泰证券	2020122400001116	东方财富	2020-12-24	557,130.00	21,000	14	4.40%	476.63	651,000.00	476.63
华泰证券	2020122400013241	亿纬锂能	2020-12-24	758,835.00	10,500	14	3.40%	501.69	855,750.00	501.69
华泰证券	2020122400013317	沃森生物	2020-12-24	4,683,175.00	122,500	14	3.40%	3,096.10	4,723,600.00	3,096.10
华泰证券	2020122500007015	沃森生物	2020-12-25	1,819,370.00	49,000	14	3.40%	1,030.98	1,889,440.00	1,030.98
华泰证券	2020122500007017	蓝思科技	2020-12-25	1,074,150.00	35,000	14	4.40%	787.74	1,071,350.00	787.74
华泰证券	2020122800007755	泰格医药	2020-12-28	2,905,000.00	17,500	14	3.40%	823.08	2,828,175.00	823.08
华泰证券	2020122800008255	蓝思科技	2020-12-28	1,070,300.00	35,000	14	3.40%	303.24	1,071,350.00	303.24
华泰证券	2020122800008257	蓝思科技	2020-12-28	428,120.00	14,000	14	3.40%	121.29	428,540.00	121.29
华泰证券	2020122800008481	智飞生物	2020-12-28	3,939,460.00	26,600	14	3.40%	1,116.18	3,934,406.00	1,116.18
华泰证券	2020122900000214	沃森生物	2020-12-29	268,520.00	7,000	14	4.40%	65.64	269,920.00	65.64
华泰证券	2020122900007221	信维通信	2020-12-29	1,168,429.00	31,300	14	3.40%	220.70	1,123,044.00	220.70
华泰证券	2020122900007327	蓝思科技	2020-12-29	46,035.00	1,500	14	3.40%	8.70	45,915.00	8.70
华泰证券	2020122900007649	智飞生物	2020-12-29	506,415.00	3,500	14	3.40%	95.66	517,685.00	95.66
华泰证券	2020122900007651	智飞生物	2020-12-29	434,070.00	3,000	14	3.40%	82.00	443,730.00	82.00
华泰证券	2020123100009978	健帆生物	2020-12-31	1,329,272.00	19,600	14	4.40%	-	1,329,272.00	-

华泰证券	2020123100010400	同花顺	2020-12-31	3,719,400.00	30,000	14	3.40%	-	3,719,400.00	-
华泰证券	2020122200000767	亿纬锂能	2020-12-22	776,895.00	10,500	28	4.40%	854.55	855,750.00	854.55
华泰证券	2020122200000769	沃森生物	2020-12-22	55,902.00	1,400	28	4.40%	61.47	53,984.00	61.47
华泰证券	2020122200000771	智飞生物	2020-12-22	4,028,570.00	26,600	28	4.40%	4,431.42	3,934,406.00	4,431.42
华泰证券	2020122900000216	沃森生物	2020-12-29	268,520.00	7,000	28	4.40%	65.64	269,920.00	65.64
华泰证券	2020123100000181	东方财富	2020-12-31	434,000.00	14,000	28	4.40%	-	434,000.00	-

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自有资金投资本基金的情况

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

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 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份 额的比例 (%)
华泰柏瑞沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	481,477,669.00	4.2457	389,256,221.00	4.4961
华泰证券股份有限公司	228,708,740.00	2.0167	133,523,814.00	1.5423

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 2021年1月1日至2021年12月31日		上年度可比期间 2020年1月1日至2020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
中国工商银行	235,699,884.97	656,448.03	49,601,507.93	1,102,919.63

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2021年1月1日至2021年12月31日	
				基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张）	总金额

华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	10,533	638,931.78
华泰联合证券	688192	迪哲医药	网下申购	8,926	469,329.08
华泰联合证券	688151	华强科技	网下申购	12,238	429,431.42
华泰联合证券	688280	精进电动	网下申购	21,211	292,287.58
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	301093	华兰股份	网下申购	4,088	237,431.04
华泰联合证券	601728	中国电信	网上配售	29,000	131,370.00
华泰联合证券	301179	泽宇智能	网下申购	2,941	129,374.59
华泰联合证券	688236	春立医疗	网下申购	4,052	120,790.12
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上配售	34,000	90,100.00
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688787	海天瑞声	网下申购	817	30,179.98
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688722	同益中	网下申购	3,687	16,628.37
华泰联合证券	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49
上年度可比期间 2020 年 1 月 1 日至 2020 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位: 张)	总金额
华泰联合证券	300919	中伟股份	网下申购	6,093	149,887.80
华泰联合证券	300907	康平科技	网下申购	4,724	67,553.20

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有 88,151,757.00 股中国工商银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 426,055,609.28 元, 估值总额为人民币 408,142,634.91 元, 占基金资产净值的比例为 0.72%(2020 年 12 月 31 日: 本基金持有 79,548,457 股中国工商银行的 A 股普通股, 成本总额为人民币 408,700,927.25 元, 估值总额为人民币 396,946,800.43 元, 占基金资产净值的比例为 0.87%)。

于 2021 年 12 月 31 日, 本基金持有 12,817,531 股华泰证券的 A 股普通股, 成本总额为人民

币 217,637,975.43 元，估值总额为人民币 227,639,350.56 元，占基金资产净值的比例为 0.40%(2020年12月31日:本基金持有13,357,106股华泰证券,成本总额为人民币265,689,155.55元,估值总额为人民币240,561,479.06元,占基金资产净值的比例为0.53%)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2021年01月15日	-	2021年1月18日	0.7200	635,399,113.28	-	635,399,113.28	-
合计	-	-	-	0.7200	635,399,113.28	-	635,399,113.28	-

7.4.12 期末(2021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
688262	国芯科技	2021年12月28日	2022年1月6日	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688800	瑞可达	2021年7月14日	2022年1月24日	新股锁定期内	15.02	133.53	1,967	29,544.34	262,653.51	-
688121	卓然股份	2021年8月30日	2022年3月7日	新股锁定期内	18.16	36.42	3,681	66,846.96	134,062.02	-
301155	海力风电	2021年11月17日	2022年5月24日	新股锁定期内	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
688697	纽威数控	2021年9月9日	2022年3月17日	新股锁定期内	7.55	16.03	5,837	44,069.35	93,567.11	-
301177	迪阿股份	2021年12月08日	2022年6月15日	新股锁定期内	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
301136	招标	2021年	2022年	新股未	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-

	股份	12月31日	1月11日	上市						
301087	可孚医疗	2021年10月15日	2022年4月25日	新股锁定期内	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301050	雷电微力	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定期内	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
301035	润丰股份	2021年7月21日	2022年1月28日	新股锁定期内	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021年10月19日	2022年4月26日	新股锁定期内	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301039	中集车辆	2021年7月1日	2022年1月10日	新股锁定期内	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301058	中粮工科	2021年9月1日	2022年3月9日	新股锁定期内	3.55	18.24	1,386	4,920.30	25,280.64	-
301099	雅创电子	2021年11月10日	2022年5月23日	新股锁定期内	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301189	奥尼电子	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定期内	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021年12月21日	2022年6月28日	新股锁定期内	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期内	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021年12月13日	2022年6月20日	新股锁定期内	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021年10月21日	2022年5月5日	新股锁定期内	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021年6月28日	2022年1月7日	新股锁定期内	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.92	-
301149	隆华新材	2021年11月03日	2022年5月10日	新股锁定期内	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-

301100	风光股份	2021年 12月10 日	2022年 6月17 日	新股锁 定期内	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021年 9月6 日	2022年 3月14 日	新股锁 定期内	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021年 10月19 日	2022年 4月28 日	新股锁 定期内	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021年 12月02 日	2022年 6月10 日	新股锁 定期内	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021年 12月09 日	2022年 6月16 日	新股锁 定期内	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-
301190	善水科技	2021年 12月17 日	2022年 6月24 日	新股锁 定期内	27.85	27.46	575	16,013.75	15,789.50	-
301118	恒光股份	2021年 11月09 日	2022年 5月18 日	新股锁 定期内	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301108	洁雅股份	2021年 11月25 日	2022年 6月6 日	新股锁 定期内	57.27	53.71	280	16,035.60	15,038.80	-
301179	泽宇智能	2021年 12月01 日	2022年 6月8 日	新股锁 定期内	43.99	50.77	295	12,977.05	14,977.15	-
301089	拓新药业	2021年 10月20 日	2022年 4月27 日	新股锁 定期内	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301180	万祥科技	2021年 11月09 日	2022年 5月16 日	新股锁 定期内	12.20	22.72	654	7,978.80	14,858.88	-
301111	粤万年青	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301188	力诺特玻	2021年 11月04 日	2022年 5月11 日	新股锁 定期内	13.00	20.48	647	8,411.00	13,250.56	-
301017	漱玉平民	2021年 6月23 日	2022年 1月5 日	新股锁 定期内	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-

		日	日								
301020	密封科技	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24		-
301138	华研精机	2021年 12月08 日	2022年 6月15 日	新股锁 定期内	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10		-
301026	浩通科技	2021年 7月8 日	2022年 1月17 日	新股锁 定期内	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19		-
301126	达嘉维康	2021年 11月30 日	2022年 6月7 日	新股锁 定期内	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26		-
301021	英诺激光	2021年 6月28 日	2022年 1月6 日	新股锁 定期内	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70		-
301092	争光股份	2021年 10月21 日	2022年 5月5 日	新股锁 定期内	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96		-
301048	金鹰重工	2021年 8月11 日	2022年 2月28 日	新股锁 定期内	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28		-
301028	东亚机械	2021年 7月12 日	2022年 1月20 日	新股锁 定期内	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50		-
301078	孩子王	2021年 9月30 日	2022年 4月14 日	新股锁 定期内	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84		-
301182	凯旺科技	2021年 12月16 日	2022年 6月23 日	新股锁 定期内	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52		-
301062	上海艾录	2021年 9月7 日	2022年 3月14 日	新股锁 定期内	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23		-
300814	中富电路	2021年 8月4 日	2022年 2月14 日	新股锁 定期内	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64		-
301055	张小泉	2021年 8月26 日	2022年 3月7 日	新股锁 定期内	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90		-
301133	金钟股份	2021年 11月19 日	2022年 5月26 日	新股锁 定期内	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70		-
301198	喜悦	2021年	2022年	新股锁	21.76	29.20	262	5,701.12	7,650.40		-

	智行	11月25日	6月2日	定期内						
301081	严牌股份	2021年10月13日	2022年4月20日	新股锁定期内	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021年11月04日	2022年5月12日	新股锁定期内	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021年7月15日	2022年1月26日	新股锁定期内	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021年8月17日	2022年2月24日	新股锁定期内	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021年7月15日	2022年1月24日	新股锁定期内	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021年8月27日	2022年3月7日	新股锁定期内	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021年7月21日	2022年2月16日	新股锁定期内	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021年8月2日	2022年2月11日	新股锁定期内	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021年9月22日	2022年3月29日	新股锁定期内	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-
300854	中兰环保	2021年9月8日	2022年3月16日	新股锁定期内	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021年9月9日	2022年3月24日	新股锁定期内	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021年12月31日	2022年1月11日	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301059	金三江	2021年9月3日	2022年3月14日	新股锁定期内	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301027	华蓝集团	2021年7月8日	2022年1月19日	新股锁定期内	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

301073	君亭酒店	2021年9月22日	2022年3月30日	新股锁定期内	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301057	汇隆新材	2021年8月31日	2022年3月9日	新股锁定期内	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-
301068	大地海洋	2021年9月16日	2022年3月28日	新股锁定期内	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021年10月11日	2022年4月19日	新股锁定期内	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

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

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

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

注：本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
----	------	------	-------	--------	----------	--------

1	000333	美的集团	2022年1月5日-2022年1月28日	73.81	1,697,400	38,700,720.00
2	300059	东方财富	2022年1月4日-2022年1月28日	37.11	117,200	10,290,160.00
3	601012	隆基股份	2022年1月5日-2022年1月28日	86.20	340,500	4,174,530.00
4	002475	立讯精密	2022年1月4日-2022年1月28日	49.20	637,400	12,327,316.00
5	300015	爱尔眼科	2022年1月4日-2022年1月28日	42.28	212,000	10,326,520.00
6	002594	比亚迪	2022年1月4日-2022年1月14日	268.12	280,400	11,706,700.00
7	688981	中芯国际	2022年1月11日-2022年1月17日	52.99	5,000	182,750.00
8	002415	海康威视	2022年1月4日-2022年1月12日	52.32	101,200	12,609,520.00
9	601919	中远海控	2022年1月4日-2022年1月14日	18.69	157,000	2,111,650.00
10	600031	三一重工	2022年1月4日-2022年1月28日	22.80	1,008,900	7,233,813.00
11	000002	万科 A	2022年1月6日-2022年1月14日	19.76	2,620,100	97,231,911.00
12	600111	北方稀土	2022年1月4日-2022年1月14日	45.80	794,300	6,243,198.00
13	000858	五粮液	2022年1月4日-2022年1月18日	222.66	3,044,500	25,269,350.00
14	600745	闻泰科技	2022年1月6日-2022年1月14日	129.30	154,300	4,868,165.00
15	002352	顺丰控股	2022年1月4日-2022年1月18日	68.92	1,614,200	13,042,736.00
16	600809	山西汾酒	2022年1月5日-2022年1月28日	315.78	158,700	4,775,283.00
17	002241	歌尔股份	2022年1月6日-2022年1月14日	54.10	937,800	14,245,182.00
18	000661	长春高新	2022年1月4日-2022年1月12日	271.40	109,100	29,609,740.00
19	000338	潍柴动力	2022年1月4日-2022年1月14日	17.89	1,860,100	36,755,576.00
20	002142	宁波银行	2022年1月11日-2022年1月14日	38.28	804,000	15,485,040.00
21	600010	包钢股份	2022年1月4日-2022年1月28日	2.79	96,100	7,712,986.00
22	600905	三峡能源	2022年1月4日-2022年1月14日	7.51	920,500	4,446,015.00

23	600588	用友网络	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	35.88	138,600	4,966,038.00
24	300014	亿纬锂能	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	118.18	1,476,200	10,525,306.00
25	603799	华友钴业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	110.31	3,000	1,142,400.00
26	600958	东方证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	14.74	26,000	4,349,800.00
27	601985	中国核电	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	8.30	423,600	1,957,032.00
28	002714	牧原股份	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	53.36	203,900	11,010,600.00
29	300142	沃森生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	56.20	44,800	10,080,000.00
30	600438	通威股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	44.96	135,300	5,452,590.00
31	600346	恒力石化	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	22.97	274,600	5,623,808.00
32	600196	复星医药	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 18 日	48.94	58,800	5,794,152.00
33	600519	贵州茅台	2022 年 1 月 28 日	2,050.00	41,700	5,329,260.00
34	601600	中国铝业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	6.09	289,000	3,017,160.00
35	002371	北方华创	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	347.02	871,500	13,011,495.00
36	600406	国电南瑞	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	40.03	96,200	5,518,994.00
37	002230	科大讯飞	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	52.51	489,800	15,242,576.00
38	000625	长安汽车	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	15.19	95,100	30,030,678.00
39	000725	京东方 A	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	5.05	9,858,200	27,504,378.00
40	300274	阳光电源	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 17 日	145.80	152,000	9,805,520.00
41	002460	赣锋锂业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	142.85	1,961,100	12,551,040.00
42	002812	恩捷股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	250.40	1,257,500	10,789,350.00
43	600011	华能国际	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	9.69	982,000	7,698,880.00
44	002179	中航光电	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	100.56	144,200	15,429,400.00

45	000063	中兴通讯	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 19 日	33.50	945,200	81,476,240.00
46	300498	温氏股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	19.26	1,694,800	9,456,984.00
47	688012	中微公司	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 27 日	126.60	2,000	530,000.00
48	002466	天齐锂业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	107.00	499,900	12,392,521.00
49	601877	正泰电器	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	53.89	23,000	2,357,500.00
50	002001	新和成	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	31.12	3,286,400	20,014,176.00
51	601766	中国中车	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	6.09	845,400	2,578,470.00
52	601238	广汽集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	15.19	113,200	3,298,648.00
53	000425	徐工机械	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.99	798,500	36,571,300.00
54	000538	云南白药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	104.65	159,000	35,402,940.00
55	000596	古井贡酒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	244.00	436,600	30,090,472.00
56	002202	金风科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	16.47	285,300	15,374,817.00
57	601669	中国电建	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	8.08	71,300	2,772,144.00
58	601788	光大证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	14.93	128,500	2,553,295.00
59	603019	中科曙光	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	27.57	148,900	1,774,888.00
60	600989	宝丰能源	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	17.36	548,100	4,302,585.00
61	300122	智飞生物	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	124.60	923,300	10,267,096.00
62	601006	大秦铁路	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	6.40	100,900	4,248,899.00
63	600150	中国船舶	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	24.79	1,451,400	5,979,768.00
64	000301	东方盛虹	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 18 日	19.34	2,121,700	39,654,573.00
65	601633	长城汽车	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	48.54	195,900	2,805,288.00
66	603288	海天味业	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	105.11	232,200	1,634,688.00

67	603986	兆易创新	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	175.85	10,000	598,300.00
68	002129	中环股份	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	41.75	469,100	15,714,850.00
69	601888	中国中免	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	219.41	101,100	2,276,772.00
70	002602	世纪华通	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	8.39	169,500	11,627,700.00
71	300124	汇川技术	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	68.60	557,300	10,120,568.00
72	000066	中国长城	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	14.16	1,176,100	57,864,120.00
73	000568	泸州老窖	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	253.87	236,000	30,514,800.00
74	002008	大族激光	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	54.00	483,500	19,354,505.00
75	603501	韦尔股份	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 12 日	310.77	10,000	1,319,700.00
76	000768	中航西飞	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	36.50	3,572,100	26,826,471.00
77	601800	中国交建	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	8.58	100,400	2,540,120.00
78	002555	三七互娱	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	27.02	113,800	11,961,518.00
79	601865	福莱特	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	57.94	557,500	2,358,225.00
80	600795	国电电力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.17	561,400	4,788,742.00
81	601899	紫金矿业	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	9.70	666,200	2,211,784.00
82	601229	上海银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	7.13	149,800	3,422,930.00
83	600036	招商银行	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 28 日	48.71	1,340,200	6,915,432.00
84	601288	农业银行	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	2.94	20,000	3,294,600.00
85	300676	华大基因	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	87.80	113,100	9,251,580.00
86	601108	财通证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	11.12	384,000	3,951,360.00
87	002493	荣盛石化	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	18.16	249,200	12,096,168.00
88	002049	紫光国微	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	225.00	126,400	18,056,240.00

89	600085	同仁堂	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	44.98	139,700	6,585,458.00
90	603899	晨光文具	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	64.51	10,000	1,010,000.00
91	600426	华鲁恒升	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	31.30	46,400	5,502,112.00
92	601989	中国重工	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.22	158,100	1,884,552.00
93	600104	上汽集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	20.63	1,259,000	6,584,570.00
94	601111	中国国航	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	9.13	204,600	3,895,584.00
95	300413	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	57.22	1,050,700	9,592,891.00
96	002601	龙佰集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	28.59	1,390,400	11,665,456.00
97	603993	洛阳钼业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.58	9,200	594,320.00
98	000876	新 希 望	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	15.21	472,000	25,185,920.00
99	000703	恒逸石化	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	10.62	1,608,500	28,776,065.00
100	300033	同花顺	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	144.58	3,500,100	10,290,294.00
101	601318	中国平安	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 28 日	50.41	59,100	3,257,001.00
102	600009	上海机场	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	46.69	249,600	7,742,592.00
103	601100	恒立液压	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	81.80	791,500	3,957,500.00
104	600109	国金证券	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	11.33	36,100	6,555,399.00
105	688126	沪硅产业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	25.82	2,100	329,490.00
106	600547	山东黄金	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	18.82	661,300	5,158,140.00
107	002271	东方雨虹	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	52.68	133,600	13,981,240.00
108	002027	分众传媒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	8.19	1,229,000	18,668,510.00
109	002624	完美世界	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	20.31	45,300	11,500,311.00
110	600050	中国联通	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	3.93	45,900	6,770,250.00

111	601360	三六零	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.72	20,000	3,212,200.00
112	000100	TCL 科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	6.17	182,500	48,931,900.00
113	600489	中金黄金	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	8.23	811,900	5,350,421.00
114	600584	长电科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	31.02	32,000	4,969,600.00
115	603338	浙江鼎力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	80.26	148,000	1,466,680.00
116	601901	方正证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	7.84	376,000	2,203,360.00
117	600362	江西铜业	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	22.33	50,000	5,568,500.00
118	300003	乐普医疗	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	22.63	1,088,000	10,553,600.00
119	600690	海尔智家	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	29.89	60,100	4,892,140.00
120	300433	蓝思科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	22.98	167,600	9,590,072.00
121	002410	广联达	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	63.98	460,900	12,707,013.00
122	600352	浙江龙盛	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.63	445,200	5,600,616.00
123	600061	国投资本	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	8.22	80,700	6,768,309.00
124	601088	中国神华	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	22.52	20,000	3,980,000.00
125	000157	中联重科	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.17	879,000	46,578,210.00
126	600115	中国东航	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	5.16	182,000	6,224,400.00
127	300677	英科医疗	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	57.84	790,900	8,960,897.00
128	603833	欧派家居	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	147.50	301,100	1,053,850.00
129	688008	澜起科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	83.87	49,500	568,260.00
130	600886	国投电力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	11.47	631,200	4,519,392.00
131	600660	福耀玻璃	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	47.14	893,800	4,898,024.00
132	601216	君正集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.23	56,800	3,574,424.00

133	002791	坚朗五金	2022 年 1 月 12 日	181.59	295,800	10,796,700.00
134	002607	中公教育	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.86	821,000	11,625,360.00
135	600332	白云山	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	34.20	1,394,100	5,646,105.00
136	603369	今世缘	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	54.40	193,600	1,459,744.00
137	300450	先导智能	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	74.37	335,400	9,589,086.00
138	002024	苏宁易购	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.12	357,600	18,777,576.00
139	002600	领益智造	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.36	53,200	11,672,612.00
140	002236	大华股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	23.48	2,479,600	15,100,764.00
141	002120	韵达股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	20.46	161,700	16,260,552.00
142	300601	康泰生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	98.54	185,000	9,325,850.00
143	000963	华东医药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	40.20	932,200	21,412,634.00
144	002157	正邦科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	9.66	121,900	15,432,540.00
145	601933	永辉超市	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.05	75,800	2,055,696.00
146	000708	中信特钢	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	20.48	740,700	28,353,996.00
147	600143	金发科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.58	80,600	5,994,222.00
148	603882	金域医学	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	111.37	11,500	1,011,080.00
149	000166	申万宏源	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 6 日	5.12	865,400	45,277,728.00
150	300595	欧普康视	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	57.37	65,000	9,397,700.00
151	603259	药明康德	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 28 日	118.58	385,900	1,674,806.00
152	601021	春秋航空	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	56.80	109,500	4,157,715.00
153	600585	海螺水泥	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 28 日	40.30	790,000	4,969,100.00
154	600025	华能水电	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	6.59	117,300	7,504,854.00

155	300347	泰格医药	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	127.80	2,298,000	9,697,560.00
156	601186	中国铁建	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.80	123,900	3,609,207.00
157	601390	中国中铁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.79	454,500	3,099,690.00
158	688363	华熙生物	2022 年 1 月 5 日	155.30	1,000	326,800.00
159	601898	中煤能源	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	6.29	201,700	2,257,023.00
160	000977	浪潮信息	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	35.83	424,900	20,794,606.00
161	002414	高德红外	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	24.21	729,200	12,658,912.00
162	600600	青岛啤酒	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	99.00	204,600	4,953,366.00
163	600383	金地集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.97	1,085,300	5,556,736.00
164	600018	上港集团	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.48	253,300	7,571,137.00
165	002841	视源股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	81.40	183,800	10,649,372.00
166	002916	深南电路	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	121.82	3,337,600	10,580,192.00
167	000895	双汇发展	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	31.55	430,700	24,205,340.00
168	601066	中信建投	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	29.25	1,015,400	4,112,370.00
169	603160	汇顶科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	107.77	374,400	1,759,680.00
170	600000	浦发银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	8.53	950,600	7,823,438.00
171	601628	中国人寿	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	30.09	42,000	2,869,860.00
172	603806	福斯特	2022 年 1 月 10 日	130.55	21,900	1,073,757.00
173	300408	三环集团	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	44.60	470,000	9,696,100.00
174	600132	重庆啤酒	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 28 日	151.32	112,800	6,136,320.00
175	001979	招商蛇口	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	13.34	10,000	20,500,000.00
176	600019	宝钢股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.16	327,900	7,535,142.00

177	300628	亿联网络	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	81.45	199,700	9,323,993.00
178	601799	星宇股份	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	204.25	258,400	2,552,992.00
179	600183	生益科技	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	23.55	287,000	5,872,020.00
180	601816	京沪高铁	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.83	514,300	2,525,213.00
181	601225	陕西煤业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.20	219,800	3,529,988.00
182	600436	片仔癀	2022 年 1 月 12 日	437.15	96,400	5,475,520.00
183	002821	凯莱英	2022 年 1 月 12 日	435.00	397,300	10,735,046.00
184	603195	公牛集团	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 7 日	167.30	42,000	1,741,320.00
185	002044	美年健康	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.85	126,600	18,458,280.00
186	600015	华夏银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.60	343,200	7,663,656.00
187	603233	大参林	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	42.11	22,000	1,735,800.00
188	600176	中国巨石	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	18.20	253,800	5,959,224.00
189	600837	海通证券	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	12.26	36,400	4,752,020.00
190	600872	中炬高新	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	37.97	339,200	4,524,928.00
191	601162	天风证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.05	205,300	3,672,817.00
192	600763	通策医疗	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	199.00	44,600	4,806,542.00
193	601668	中国建筑	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	5.00	40,000	2,780,000.00
194	000800	一汽解放	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	10.29	1,749,000	25,780,260.00
195	601166	兴业银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	19.04	629,200	3,668,236.00
196	300558	贝达药业	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	79.83	887,000	9,419,940.00
197	600570	恒生电子	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	62.15	874,700	5,064,513.00
198	601211	国泰君安	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	17.89	776,300	3,578,743.00

199	600919	江苏银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	5.83	10,000	4,371,500.00
200	002032	苏泊尔	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	62.24	3,687,700	18,622,885.00
201	601155	新城控股	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	29.13	59,800	3,716,570.00
202	601328	交通银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.61	474,400	3,230,664.00
203	300999	金龙鱼	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 11 日	62.93	1,271,700	7,846,389.00
204	601231	环旭电子	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	16.06	262,000	3,358,840.00
205	000938	紫光股份	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	22.85	516,600	23,226,336.00
206	600926	杭州银行	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 28 日	12.82	10,000	4,350,000.00
207	600893	航发动力	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	63.46	22,000	4,493,500.00
208	002007	华兰生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	29.14	56,300	19,537,226.00
209	002304	洋河股份	2022 年 1 月 14 日-2022 年 1 月 28 日	164.73	56,600	13,810,400.00
210	603939	益丰药房	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	55.11	30,800	757,372.00
211	600016	民生银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.90	335,100	7,583,313.00
212	600029	南方航空	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	6.81	902,900	7,421,838.00
213	601398	工商银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.63	135,400	3,073,580.00
214	603659	璞泰来	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 28 日	160.61	17,100	1,163,484.00
215	300529	健帆生物	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	53.30	620,400	9,436,284.00
216	002252	上海莱士	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	6.82	2,334,300	13,982,457.00
217	600900	长江电力	2022 年 1 月 10 日	22.70	189,800	4,469,790.00
218	002064	华峰化学	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 12 日	10.44	1,735,100	16,813,119.00
219	600999	招商证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	17.65	760,800	4,260,480.00
220	601688	华泰证券	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	17.76	186,100	2,767,307.00

221	600655	豫园股份	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	10.30	379,600	4,923,412.00
222	603517	绝味食品	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 28 日	68.33	46,100	1,217,501.00
223	300144	宋城演艺	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	14.32	221,800	9,976,564.00
224	601169	北京银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.44	58,000	3,609,920.00
225	300316	晶盛机电	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 18 日	69.50	313,100	9,800,030.00
226	601336	新华保险	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	38.88	694,400	3,215,072.00
227	600848	上海临港	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	14.87	30,000	4,539,600.00
228	601838	成都银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	12.00	635,900	2,435,497.00
229	300750	宁德时代	2022 年 1 月 13 日	588.00	340,000	8,778,800.00
230	601988	中国银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.05	51,700	1,914,451.00
231	601607	上海医药	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	19.87	165,600	2,941,056.00
232	601377	兴业证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	9.88	59,000	3,144,700.00
233	002050	三花智控	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	25.30	70,000	17,528,000.00
234	601857	中国石油	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.91	467,000	2,381,700.00
235	600918	中泰证券	2022 年 1 月 7 日-2022 年 1 月 14 日	9.97	362,200	4,418,840.00
236	601618	中国中冶	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.83	283,800	2,923,140.00
237	601658	邮储银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	5.10	628,100	2,788,764.00
238	600028	中国石化	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.23	588,100	7,427,703.00
239	300866	安克创新	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 13 日	102.50	407,600	8,278,356.00
240	000786	北新建材	2022 年 1 月 10 日-2022 年 1 月 28 日	35.83	234,800	25,900,788.00
241	600048	保利发展	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 12 日	15.63	118,100	6,830,904.00
242	600079	人福医药	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 28 日	22.52	577,400	6,622,778.00

243	601881	中国银河	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	11.19	147,200	2,300,736.00
244	601818	光大银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	3.32	249,600	2,488,512.00
245	601939	建设银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	5.86	224,200	2,008,832.00
246	300888	稳健医疗	2022 年 1 月 12 日	82.45	2,104,800	8,271,864.00
247	601696	中银证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 14 日	13.45	222,500	2,670,000.00
248	601601	中国太保	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	27.12	170,200	3,004,030.00
249	601009	南京银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	8.96	232,400	4,229,680.00
250	600161	天坛生物	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 28 日	28.96	811,000	5,968,960.00
251	601998	中信银行	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.62	124,000	1,784,360.00
252	000651	格力电器	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	37.03	547,600	29,625,160.00
253	601236	红塔证券	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	11.92	52,200	3,312,612.00
254	600741	华域汽车	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	28.30	40,000	4,872,800.00
255	600845	宝信软件	2022 年 1 月 11 日-2022 年 1 月 28 日	60.83	103,100	4,598,260.00
256	601698	中国卫通	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 14 日	14.39	4,400	2,587,200.00
257	601138	工业富联	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	11.92	46,600	3,720,078.00
258	601319	中国人保	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	4.70	834,400	3,254,160.00
259	600887	伊利股份	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	41.46	55,400	4,512,330.00
260	688599	天合光能	2022 年 1 月 10 日	78.90	12,100	199,408.00
261	600606	绿地控股	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	4.34	50,000	4,950,000.00
262	603658	安图生物	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 28 日	55.06	16,000	1,172,800.00
263	000069	华侨城 A	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	7.04	1,203,000	50,862,840.00
264	601990	南京证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 28 日	9.91	66,300	1,876,290.00

265	000783	长江证券	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 28 日	7.54	219,900	25,987,782.00
266	603260	合盛硅业	2022 年 1 月 6 日	131.97	30,000	1,651,800.00
267	600030	中信证券	2022 年 1 月 12 日-2022 年 1 月 14 日	26.41	322,700	7,267,204.00
268	002311	海大集团	2022 年 1 月 14 日	73.30	803,800	13,238,586.00
269	600760	中航沈飞	2022 年 1 月 14 日	68.04	165,900	4,852,575.00
270	300760	迈瑞医疗	2022 年 1 月 13 日	380.80	164,000	8,639,520.00
271	601995	中金公司	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 14 日	49.03	30,000	1,824,900.00
272	601916	浙商银行	2022 年 1 月 4 日-2022 年 1 月 28 日	3.50	26,000	2,143,700.00
273	688561	奇安信	2022 年 1 月 12 日	87.92	1,600	226,032.00
274	600309	万华化学	2022 年 1 月 6 日	101.00	587,900	5,679,114.00
275	000776	广发证券	2022 年 1 月 14 日	24.59	742,000	26,622,960.00
276	002568	百润股份	2022 年 1 月 10 日	59.83	67,000	11,781,950.00
277	688396	华润微	2022 年 1 月 12 日	64.60	61,700	307,266.00
278	002736	国信证券	2022 年 1 月 6 日-2022 年 1 月 12 日	11.48	34,800	10,814,796.00
279	300896	爱美客	2022 年 1 月 7 日	536.11	647,200	8,232,384.00
280	688111	金山办公	2022 年 1 月 12 日	265.00	35,000	461,300.00
281	600276	恒瑞医药	2022 年 1 月 5 日	50.71	142,100	5,712,420.00
282	601878	浙商证券	2022 年 1 月 5 日-2022 年 1 月 11 日	13.18	65,000	2,328,950.00
283	688036	传音控股	2022 年 1 月 12 日	156.90	10,200	517,242.00
284	300782	卓胜微	2022 年 1 月 5 日	326.80	1,024,100	8,387,379.00
285	688009	中国通号	2022 年 1 月 12 日	4.98	1,000	536,110.00
286	300759	康龙化成	2022 年 1 月 5 日	141.27	466,300	8,775,766.00

287	000001	平安银行	2022 年 1 月 14 日	16.48	1,734,000	127,986,540.00
288	601966	玲珑轮胎	2022 年 1 月 13 日	36.55	67,800	1,963,488.00
合 计					150,844,100	2,893,128,283.00

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。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争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所

进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：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 2021 年 12 月 31 日	上年度末 2020 年 12 月 31 日
AAA	-	29,270,000.00
AAA 以下	-	2,546,000.00
未评级	-	-
合计	-	31,816,000.00

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

7.4.13.3 流动性风险

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

于 2021 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为 2.09%。

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

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

交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	235,699,884.97	-	-	-	-	-	235,699,884.97
结算备付金	1,222,370,183.37	-	-	-	-	-	1,222,370,183.37
存出保证金	4,751,631.44	-	-	-	-	137,795,000.40	142,546,631.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,381,502,659.10	55,381,502,659.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,407,797.62	19,407,797.62
应收利息	-	-	-	-	-	1,708,435.57	1,708,435.57
资产总计	1,462,821,699.78	-	-	-	-	55,540,413,892.69	57,003,235,592.47
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	67,951.26	67,951.26
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,546,645.91	5,546,645.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,251,085.76	20,251,085.76
应付托管费	-	-	-	-	-	4,050,217.15	4,050,217.15
应付交易费用	-	-	-	-	-	3,337,919.65	3,337,919.65
应交税费	-	-	-	-	-	308,093.67	308,093.67
其他负债	-	-	-	-	-	83,614,441.61	83,614,441.61
负债总计	-	-	-	-	-	117,176,355.01	117,176,355.01

利率敏感度缺口	1,462,821,699.78	-	-	-	-	55,423,237,537.68	56,886,059,237.46
上年度末 2020 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	49,601,507.93	-	-	-	-	-	49,601,507.93
结算备付金	1,073,316,400.59	-	-	-	-	-	1,073,316,400.59
存出保证金	5,590,554.80	-	-	-	-	145,079,740.80	150,670,295.60
交易性金融资产	-	-	-	-	31,816,000.00	44,448,766,821.95	44,480,582,821.95
应收证券清算款	-	-	-	-	-	96,792,226.64	96,792,226.64
应收利息	-	-	-	-	-	3,033,489.50	3,033,489.50
应收股利	-	-	-	-	-	3,085.50	3,085.50
资产总计	1,128,508,463.32	-	-	-	31,816,000.00	44,693,675,364.39	45,853,999,827.71
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	18,498,144.84	18,498,144.84
应付托管费	-	-	-	-	-	3,699,628.99	3,699,628.99
应付交易费用	-	-	-	-	-	2,748,200.68	2,748,200.68
应交税费	-	-	-	-	-	1,421,149.09	1,421,149.09
其他负债	-	-	-	-	-	79,213,977.41	79,213,977.41
交易性金融负债	-	-	-	-	-	12,839.42	12,839.42
负债总计	-	-	-	-	-	105,593,940.43	105,593,940.43
利率敏感度缺口	1,128,508,463.32	-	-	-	31,816,000.00	44,588,081,423.96	45,748,405,887.28

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

注：于 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有交易性债券投资（2020 年 12 月 31 日：0.07%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020 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。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，原则上采用完全复制的方法，按照个股在标的指数中的基准权重构建投资组合。基金所构建的指数化投资组合将根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。同时，本基金还将根据法律法规中的投资比例限制、申购赎回变动情况、新股增发等变化，

对基金投资组合进行相应调整，以保证基金份额净值增长率与标的指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金主要投资于指数的成份股及其备选成份股，其投资比例不低于基金资产净值的 95%。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 2021 年 12 月 31 日		上年度末 2020 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	55,381,502,659.10	97.36	44,448,766,821.95	97.16
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	-67,951.26	—	-12,839.42	—
合计	55,381,434,707.84	97.36	44,448,753,982.53	97.16

注：其他包含：1、可退替代款。2、在期货交易所交易的期货投资(附注 7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为 0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数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 (2021 年 12 月 31 日)	上年度末 (2020 年 12 月 31 日)	
沪深 300 指数上升 5%	2,815,474,920.97	2,283,087,706.27	
沪深 300 指数下降 5%	-2,815,474,920.97	-2,283,087,706.27	

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) 基金申购款

于 2021 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 115,491,478,987.32 元(2020 年度：88,455,343,763.93 元)，其中包括以股票支付的申购款 68,224,286,895.92 元和以现金支付的申购款 47,267,192,091.40 元(2020 年度：其中包括以股票支付的申购款 54,743,377,016.93 元和以现金支付的申购款 33,711,966,747.00 元)。

(2) 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 2021 年 12 月 31 日，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 55,379,541,438.20 元，属于第二层次的余额为 1,961,220.90 元，无属于第三层次的余额(2020 年 12 月 31 日：第一层次 44,411,372,431.97 元，第二层次 69,210,389.98 元，无第三层次)。

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

(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 2021 年 12 月 31 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020 年 12 月 31 日：同)。

(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。

(3) 根据财政部发布的《企业会计准则第 22 号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第 23 号—金融资产转移》、《企业会计准则第 24 号—套期会计》和《企业会计准则第 37 号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于 2020 年 12 月 30 日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。截至 2021 年 12 月 31 日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自 2022 年 1 月 1 日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021 年的比较数据将不作重述。

(3)除基金申购款和公允价值和执行新金融工具准则外，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	55,381,502,659.10	97.16
	其中：股票	55,381,502,659.10	97.16
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,458,070,068.34	2.56
8	其他各项资产	163,662,865.03	0.29
9	合计	57,003,235,592.47	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 2,893,128,283.00 元，

占本基金期末资产净值的 5.09%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 3,512,307 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 1,236,295,607.00 元。

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	601,669,821.00	1.06
B	采矿业	1,219,451,112.04	2.14
C	制造业	32,467,293,699.22	57.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,360,218,270.27	2.39
E	建筑业	936,422,131.09	1.65
F	批发和零售业	354,280,131.20	0.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,475,636,568.52	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,801,872,175.98	3.17
J	金融业	11,747,542,231.18	20.65
K	房地产业	979,918,035.82	1.72
L	租赁和商务服务业	749,032,167.54	1.32
M	科学研究和技术服务业	946,261,092.72	1.66
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	37,105,126.44	0.07
Q	卫生和社会工作	530,778,761.63	0.93
R	文化、体育和娱乐业	171,771,547.32	0.30
S	综合	-	-
	合计	55,379,252,871.97	97.35

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	1,305,758.31	0.00

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	11,519.99	0.00
F	批发和零售业	357,374.80	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	314,252.57	0.00
J	金融业	69,749.68	0.00
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	126,852.14	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	11,992.19	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	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	29,517.67	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,249,787.13	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

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	600519	贵州茅台	1,495,769	3,066,326,450.00	5.39
2	300750	宁德时代	3,465,451	2,037,685,188.00	3.58
3	600036	招商银行	31,125,872	1,516,141,225.12	2.67
4	601318	中国平安	27,238,064	1,373,070,806.24	2.41
5	000858	五粮液	4,892,710	1,089,410,808.60	1.92
6	601012	隆基股份	10,967,898	945,432,807.60	1.66
7	000333	美的集团	12,332,688	910,275,701.28	1.60
8	300059	东方财富	20,863,640	774,249,680.40	1.36
9	601166	兴业银行	36,727,977	699,300,682.08	1.23
10	600900	长江电力	29,362,432	666,527,206.40	1.17
11	002594	比亚迪	2,324,418	623,222,954.16	1.10

12	002415	海康威视	11,774,487	616,041,159.84	1.08
13	002475	立讯精密	12,416,574	610,895,440.80	1.07
14	603259	药明康德	5,086,124	603,112,583.92	1.06
15	600276	恒瑞医药	11,235,847	569,769,801.37	1.00
16	600030	中信证券	21,348,704	563,819,272.64	0.99
17	600887	伊利股份	13,440,021	557,223,270.66	0.98
18	601888	中国中免	2,457,528	539,206,218.48	0.95
19	300760	迈瑞医疗	1,223,485	465,903,088.00	0.82
20	000651	格力电器	12,031,421	445,523,519.63	0.78
21	000568	泸州老窖	1,725,299	438,001,657.13	0.77
22	601398	工商银行	88,151,757	408,142,634.91	0.72
23	000001	平安银行	24,549,538	404,576,386.24	0.71
24	603501	韦尔股份	1,292,655	401,718,394.35	0.71
25	600309	万华化学	3,910,529	394,963,429.00	0.69
26	600809	山西汾酒	1,228,696	387,997,622.88	0.68
27	002142	宁波银行	9,964,637	381,446,304.36	0.67
28	000725	京东方 A	75,532,447	381,438,857.35	0.67
29	600436	片仔癀	872,520	381,422,118.00	0.67
30	300274	阳光电源	2,578,722	375,977,667.60	0.66
31	601899	紫金矿业	36,200,493	351,144,782.10	0.62
32	002714	牧原股份	6,531,930	348,543,784.80	0.61
33	603288	海天味业	3,303,757	347,257,898.27	0.61
34	600031	三一重工	14,934,993	340,517,840.40	0.60
35	002352	顺丰控股	4,934,707	340,100,006.44	0.60
36	000002	万科 A	17,198,385	339,840,087.60	0.60
37	002812	恩捷股份	1,319,305	330,353,972.00	0.58
38	300014	亿纬锂能	2,782,606	328,848,377.08	0.58
39	002241	歌尔股份	6,049,893	327,299,211.30	0.58
40	300124	汇川技术	4,675,935	320,769,141.00	0.56
41	601328	交通银行	69,189,302	318,962,682.22	0.56
42	600438	通威股份	6,809,748	306,166,270.08	0.54
43	002460	赣锋锂业	2,129,259	304,164,648.15	0.53
44	600837	海通证券	24,454,983	299,818,091.58	0.53
45	601919	中远海控	15,987,570	298,807,683.30	0.53
46	300015	爱尔眼科	6,903,850	291,894,778.00	0.51
47	600690	海尔智家	9,601,908	287,001,030.12	0.50
48	600048	保利发展	18,195,393	284,393,992.59	0.50
49	600406	国电南瑞	7,078,969	283,371,129.07	0.50
50	002371	北方华创	798,395	277,059,032.90	0.49
51	002466	天齐锂业	2,566,440	274,609,080.00	0.48
52	603799	华友钴业	2,455,947	270,915,513.57	0.48
53	601668	中国建筑	52,982,045	264,910,225.00	0.47

54	300122	智飞生物	2,120,869	264,260,277.40	0.46
55	000063	中兴通讯	7,878,262	263,921,777.00	0.46
56	601288	农业银行	88,028,206	258,802,925.64	0.45
57	688981	中芯国际	4,880,105	258,596,763.95	0.45
58	600745	闻泰科技	1,976,775	255,597,007.50	0.45
59	600000	浦发银行	29,602,202	252,506,783.06	0.44
60	002049	紫光国微	1,108,000	249,300,000.00	0.44
61	000661	长春高新	915,171	248,377,409.40	0.44
62	002230	科大讯飞	4,701,459	246,873,612.09	0.43
63	600111	北方稀土	5,382,492	246,518,133.60	0.43
64	600585	海螺水泥	6,066,382	244,475,194.60	0.43
65	600104	上汽集团	11,839,859	244,256,291.17	0.43
66	600016	民生银行	62,376,317	243,267,636.30	0.43
67	002129	中环股份	5,805,509	242,380,000.75	0.43
68	002271	东方雨虹	4,559,855	240,213,161.40	0.42
69	601816	京沪高铁	49,440,304	238,796,668.32	0.42
70	002304	洋河股份	1,447,912	238,514,543.76	0.42
71	601601	中国太保	8,627,740	233,984,308.80	0.41
72	603986	兆易创新	1,315,731	231,371,296.35	0.41
73	601688	华泰证券	12,817,531	227,639,350.56	0.40
74	300142	沃森生物	3,903,176	219,358,491.20	0.39
75	000100	TCL 科技	35,421,473	218,550,488.41	0.38
76	600893	航发动力	3,407,401	216,233,667.46	0.38
77	000338	潍柴动力	12,077,686	216,069,802.54	0.38
78	300498	温氏股份	11,176,070	215,251,108.20	0.38
79	002027	分众传媒	25,619,774	209,825,949.06	0.37
80	601211	国泰君安	11,307,180	202,285,450.20	0.36
81	300450	先导智能	2,670,832	198,629,775.84	0.35
82	601088	中国神华	8,374,435	188,592,276.20	0.33
83	601766	中国中车	30,733,109	187,164,633.81	0.33
84	600050	中国联通	46,866,201	184,184,169.93	0.32
85	000776	广发证券	7,453,920	183,291,892.80	0.32
86	601229	上海银行	24,969,667	178,033,725.71	0.31
87	600570	恒生电子	2,853,179	177,325,074.85	0.31
88	600919	江苏银行	29,689,547	173,090,059.01	0.30
89	600660	福耀玻璃	3,567,816	168,186,846.24	0.30
90	600999	招商证券	9,459,154	166,954,068.10	0.29
91	300347	泰格医药	1,298,400	165,935,520.00	0.29
92	601169	北京银行	37,230,088	165,301,590.72	0.29
93	601988	中国银行	53,089,969	161,924,405.45	0.28
94	600905	三峡能源	21,381,900	160,578,069.00	0.28
95	600019	宝钢股份	22,396,045	160,355,682.20	0.28

96	600010	包钢股份	57,262,068	159,761,169.72	0.28
97	002311	海大集团	2,179,337	159,745,402.10	0.28
98	601669	中国电建	19,401,785	156,766,422.80	0.28
99	600958	东方证券	10,515,781	155,002,611.94	0.27
100	002410	广联达	2,408,999	154,127,756.02	0.27
101	688599	天合光能	1,949,297	153,799,533.30	0.27
102	603659	璞泰来	948,917	152,405,559.37	0.27
103	601633	长城汽车	3,120,575	151,472,710.50	0.27
104	601390	中国中铁	25,759,371	149,146,758.09	0.26
105	000625	长安汽车	9,628,611	146,258,601.09	0.26
106	601985	中国核电	17,505,320	145,294,156.00	0.26
107	000166	申万宏源	28,320,499	145,000,954.88	0.25
108	002709	天赐材料	1,260,316	144,495,229.40	0.25
109	600588	用友网络	4,010,309	143,889,886.92	0.25
110	600196	复星医药	2,928,104	143,301,409.76	0.25
111	300408	三环集团	3,209,930	143,162,878.00	0.25
112	601877	正泰电器	2,646,421	142,615,627.69	0.25
113	600028	中国石化	33,628,074	142,246,753.02	0.25
114	000895	双汇发展	4,471,523	141,076,550.65	0.25
115	601658	邮储银行	27,347,800	139,473,780.00	0.25
116	601818	光大银行	41,807,107	138,799,595.24	0.24
117	002493	荣盛石化	7,601,651	138,045,982.16	0.24
118	300782	卓胜微	422,192	137,972,345.60	0.24
119	002179	中航光电	1,347,053	135,459,649.68	0.24
120	601377	兴业证券	13,537,332	133,748,840.16	0.24
121	603806	福斯特	1,023,149	133,572,101.95	0.23
122	000538	云南白药	1,272,619	133,179,578.35	0.23
123	002821	凯莱英	300,600	130,761,000.00	0.23
124	000768	中航西飞	3,536,655	129,087,907.50	0.23
125	002459	晶澳科技	1,377,500	127,694,250.00	0.22
126	601628	中国人寿	4,099,833	123,363,974.97	0.22
127	601857	中国石油	24,571,618	120,646,644.38	0.21
128	600346	恒力石化	5,247,039	120,524,485.83	0.21
129	601989	中国重工	28,544,138	120,456,262.36	0.21
130	601600	中国铝业	19,721,129	120,101,675.61	0.21
131	002008	大族激光	2,223,363	120,061,602.00	0.21
132	002001	新和成	3,847,803	119,743,629.36	0.21
133	601225	陕西煤业	9,813,627	119,726,249.40	0.21
134	601138	工业富联	9,943,900	118,531,288.00	0.21
135	002050	三花智控	4,615,750	116,778,475.00	0.21
136	002202	金风科技	7,059,635	116,272,188.45	0.20
137	600426	华鲁恒升	3,713,177	116,222,440.10	0.20

138	300413	芒果超媒	2,022,990	115,755,487.80	0.20
139	300433	蓝思科技	4,985,589	114,568,835.22	0.20
140	600150	中国船舶	4,605,777	114,177,211.83	0.20
141	600009	上海机场	2,433,031	113,598,217.39	0.20
142	601009	南京银行	12,545,833	112,410,663.68	0.20
143	600741	华域汽车	3,923,044	111,022,145.20	0.20
144	300759	康龙化成	785,440	110,959,108.80	0.20
145	600176	中国巨石	6,075,484	110,573,808.80	0.19
146	002236	大华股份	4,620,471	108,488,659.08	0.19
147	600011	华能国际	11,105,052	107,607,953.88	0.19
148	300601	康泰生物	1,083,817	106,799,327.18	0.19
149	601100	恒立液压	1,293,832	105,835,457.60	0.19
150	001979	招商蛇口	7,863,614	104,900,610.76	0.18
151	600584	长电科技	3,269,300	101,413,686.00	0.18
152	601939	建设银行	17,024,709	99,764,794.74	0.18
153	603993	洛阳钼业	17,698,928	98,760,018.24	0.17
154	601066	中信建投	3,353,500	98,089,875.00	0.17
155	600760	中航沈飞	1,420,940	96,680,757.60	0.17
156	600600	青岛啤酒	973,800	96,406,200.00	0.17
157	600926	杭州银行	7,464,582	95,695,941.24	0.17
158	300316	晶盛机电	1,376,900	95,694,550.00	0.17
159	601006	大秦铁路	14,940,033	95,616,211.20	0.17
160	688008	澜起科技	1,138,213	95,461,924.31	0.17
161	600989	宝丰能源	5,421,400	94,115,504.00	0.17
162	002602	世纪华通	11,144,043	93,498,520.77	0.16
163	688111	金山办公	352,316	93,363,740.00	0.16
164	003816	中国广核	29,696,800	92,950,984.00	0.16
165	002555	三七互娱	3,433,628	92,776,628.56	0.16
166	603882	金城医学	829,979	92,434,761.23	0.16
167	601360	三六零	7,216,805	91,797,759.60	0.16
168	600763	通策医疗	459,062	91,353,338.00	0.16
169	000963	华东医药	2,263,800	91,004,760.00	0.16
170	000977	浪潮信息	2,536,612	90,886,807.96	0.16
171	000786	北新建材	2,529,111	90,618,047.13	0.16
172	601186	中国铁建	11,486,650	89,595,870.00	0.16
173	000157	中联重科	12,355,515	88,589,042.55	0.16
174	601868	中国能建	32,428,500	88,529,805.00	0.16
175	000876	新希望	5,790,685	88,076,318.85	0.15
176	600547	山东黄金	4,641,131	87,346,085.42	0.15
177	600015	华夏银行	15,531,526	86,976,545.60	0.15
178	600029	南方航空	12,767,041	86,943,549.21	0.15
179	600886	国投电力	7,474,332	85,730,588.04	0.15

180	300896	爱美客	159,890	85,718,627.90	0.15
181	601336	新华保险	2,186,424	85,008,165.12	0.15
182	002736	国信证券	7,292,533	83,718,278.84	0.15
183	002601	龙佰集团	2,898,945	82,880,837.55	0.15
184	000938	紫光股份	3,623,107	82,787,994.95	0.15
185	600352	浙江龙盛	6,481,032	81,855,434.16	0.14
186	000425	徐工机械	13,654,743	81,791,910.57	0.14
187	601238	广汽集团	5,372,540	81,608,882.60	0.14
188	603369	今世缘	1,496,386	81,403,398.40	0.14
189	601901	方正证券	10,261,728	80,451,947.52	0.14
190	300628	亿联网络	978,878	79,729,613.10	0.14
191	688012	中微公司	620,154	78,511,496.40	0.14
192	002007	华兰生物	2,684,768	78,234,139.52	0.14
193	603019	中科曙光	2,813,575	77,570,262.75	0.14
194	002841	视源股份	932,976	75,944,246.40	0.13
195	601800	中国交建	8,831,405	75,773,454.90	0.13
196	600383	金地集团	5,793,300	75,139,101.00	0.13
197	300003	乐普医疗	3,305,054	74,793,372.02	0.13
198	600132	重庆啤酒	492,979	74,597,582.28	0.13
199	000783	长江证券	9,805,591	73,934,156.14	0.13
200	601916	浙商银行	21,046,803	73,663,810.50	0.13
201	601788	光大证券	4,921,424	73,476,860.32	0.13
202	600085	同仁堂	1,632,347	73,422,968.06	0.13
203	601865	福莱特	1,265,311	73,312,119.34	0.13
204	300595	欧普康视	1,270,067	72,863,743.79	0.13
205	688036	传音控股	459,515	72,097,903.50	0.13
206	000069	华侨城 A	10,227,829	72,003,916.16	0.13
207	600795	国电电力	22,405,735	71,026,179.95	0.12
208	000301	东方盛虹	3,651,000	70,610,340.00	0.12
209	600918	中泰证券	7,078,900	70,576,633.00	0.12
210	300999	金龙鱼	1,119,200	70,431,256.00	0.12
211	600115	中国东航	13,647,956	70,423,452.96	0.12
212	002938	鹏鼎控股	1,655,400	70,238,622.00	0.12
213	601108	财通证券	6,262,100	69,634,552.00	0.12
214	601618	中国中冶	18,134,248	69,454,169.84	0.12
215	600109	国金证券	6,108,568	69,210,075.44	0.12
216	601111	中国国航	7,518,802	68,646,662.26	0.12
217	002252	上海莱士	10,034,495	68,435,255.90	0.12
218	603517	绝味食品	996,428	68,085,925.24	0.12
219	601155	新城控股	2,320,067	67,583,551.71	0.12
220	600183	生益科技	2,831,635	66,685,004.25	0.12
221	300676	华大基因	754,600	66,253,880.00	0.12

222	300529	健帆生物	1,217,670	64,901,811.00	0.11
223	603899	晨光文具	1,005,293	64,851,451.43	0.11
224	000066	中国长城	4,558,400	64,546,944.00	0.11
225	601838	成都银行	5,356,211	64,274,532.00	0.11
226	300558	贝达药业	772,154	61,641,053.82	0.11
227	600489	中金黄金	7,318,136	60,228,259.28	0.11
228	002568	百润股份	1,003,337	60,029,652.71	0.11
229	603486	科沃斯	396,500	59,851,675.00	0.11
230	300033	同花顺	411,296	59,465,175.68	0.10
231	300677	英科医疗	1,022,775	59,157,306.00	0.10
232	688561	奇安信	666,265	58,578,018.80	0.10
233	600143	金发科技	4,630,198	58,247,890.84	0.10
234	002120	韵达股份	2,837,468	58,054,595.28	0.10
235	002414	高德红外	2,388,170	57,817,595.70	0.10
236	002624	完美世界	2,842,960	57,740,517.60	0.10
237	600845	宝信软件	946,319	57,564,584.77	0.10
238	000703	恒逸石化	5,417,410	57,532,894.20	0.10
239	600362	江西铜业	2,575,629	57,513,795.57	0.10
240	000596	古井贡酒	234,400	57,193,600.00	0.10
241	600332	白云山	1,670,052	57,115,778.40	0.10
242	601021	春秋航空	996,500	56,601,200.00	0.10
243	601607	上海医药	2,823,566	56,104,256.42	0.10
244	300144	宋城演艺	3,911,736	56,016,059.52	0.10
245	601799	星宇股份	273,100	55,780,675.00	0.10
246	600079	人福医药	2,464,900	55,509,548.00	0.10
247	002044	美年健康	7,018,584	55,095,884.40	0.10
248	601990	南京证券	5,514,000	54,643,740.00	0.10
249	603939	益丰药房	978,964	53,950,706.04	0.09
250	601966	玲珑轮胎	1,450,022	52,998,304.10	0.09
251	002600	领益智造	7,185,121	52,882,490.56	0.09
252	600061	国投资本	6,417,644	52,753,033.68	0.09
253	000708	中信特钢	2,521,459	51,639,480.32	0.09
254	688126	沪硅产业	1,995,554	51,525,204.28	0.09
255	603833	欧派家居	349,306	51,522,635.00	0.09
256	600872	中炬高新	1,344,408	51,047,171.76	0.09
257	603160	汇顶科技	468,252	50,463,518.04	0.09
258	601728	中国电信	11,641,200	50,406,396.00	0.09
259	601878	浙商证券	3,804,836	50,147,738.48	0.09
260	603392	万泰生物	223,940	49,602,710.00	0.09
261	600018	上港集团	8,767,942	48,048,322.16	0.08
262	600161	天坛生物	1,638,931	47,463,441.76	0.08
263	601696	中银证券	3,524,892	47,409,797.40	0.08

264	002916	深南电路	374,051	45,566,892.82	0.08
265	601216	君正集团	8,561,609	44,777,215.07	0.08
266	601995	中金公司	907,549	44,497,127.47	0.08
267	601162	天风证券	10,986,580	44,495,649.00	0.08
268	688396	华润微	664,255	42,910,873.00	0.08
269	600606	绿地控股	9,733,969	42,245,425.46	0.07
270	688169	石头科技	51,044	41,498,772.00	0.07
271	603338	浙江鼎力	506,161	40,624,481.86	0.07
272	002791	坚朗五金	223,100	40,512,729.00	0.07
273	600655	豫园股份	3,862,918	39,788,055.40	0.07
274	002024	苏宁易购	9,494,080	39,115,609.60	0.07
275	002157	正邦科技	3,920,800	37,874,928.00	0.07
276	603233	大参林	895,184	37,696,198.24	0.07
277	601881	中国银河	3,354,752	37,539,674.88	0.07
278	002607	中公教育	4,720,754	37,105,126.44	0.07
279	603260	合盛硅业	280,200	36,977,994.00	0.07
280	002064	华峰化学	3,529,795	36,851,059.80	0.06
281	601933	永辉超市	9,042,110	36,620,545.50	0.06
282	600848	上海临港	2,424,800	36,056,776.00	0.06
283	601998	中信银行	7,659,466	35,386,732.92	0.06
284	601319	中国人保	7,185,800	33,773,260.00	0.06
285	688009	中国通号	6,440,345	32,072,918.10	0.06
286	600025	华能水电	4,628,700	30,503,133.00	0.05
287	601898	中煤能源	4,663,600	29,334,044.00	0.05
288	300866	安克创新	282,000	28,905,000.00	0.05
289	601236	红塔证券	2,394,610	28,543,751.20	0.05
290	688363	华熙生物	180,565	28,041,744.50	0.05
291	601231	环旭电子	1,562,896	25,100,109.76	0.04
292	603195	公牛集团	149,500	25,011,350.00	0.04
293	603658	安图生物	443,920	24,442,235.20	0.04
294	000800	一汽解放	2,372,100	24,408,909.00	0.04
295	601808	中海油服	1,428,400	21,426,000.00	0.04
296	603087	甘李药业	303,980	21,381,953.20	0.04
297	002032	苏泊尔	309,180	19,243,363.20	0.03
298	601698	中国卫通	1,137,900	16,374,381.00	0.03
299	605499	东鹏饮料	76,300	13,874,392.00	0.02
300	300888	稳健医疗	147,400	12,153,130.00	0.02

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.00
2	688800	瑞可达	1,967	262,653.51	0.00
3	301088	戎美股份	7,036	181,366.48	0.00
4	688121	卓然股份	3,681	134,062.02	0.00
5	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.00
6	688697	纽威数控	5,837	93,567.11	0.00
7	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
8	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
9	600927	永安期货	1,859	69,749.68	0.00
10	301087	可孚医疗	876	66,097.80	0.00
11	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
12	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
13	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
14	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
15	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
16	301058	中粮工科	1,386	25,280.64	0.00
17	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
18	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
19	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
20	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
21	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
22	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
23	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
24	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
25	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
26	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
27	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00
28	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
29	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
30	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
31	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
32	301108	洁雅股份	280	15,038.80	0.00
33	301179	泽宇智能	295	14,977.15	0.00
34	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
35	301180	万祥科技	654	14,858.88	0.00
36	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
37	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
38	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
39	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
40	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
41	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00

42	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
43	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
44	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
45	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
46	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
47	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
48	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
49	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
50	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
51	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
52	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
53	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
54	301198	喜悦智行	262	7,650.40	0.00
55	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
56	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
57	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
58	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
59	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
60	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
61	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
62	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
63	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
64	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
65	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
66	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
67	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
68	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
69	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
70	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
71	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
72	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
73	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	000858	五粮液	3,002,811,726.81	6.56
2	300750	宁德时代	2,315,772,512.71	5.06
3	000333	美的集团	2,263,644,600.66	4.95
4	000651	格力电器	1,446,321,509.07	3.16
5	300059	东方财富	1,432,154,391.09	3.13

6	002415	海康威视	1,421,692,882.80	3.11
7	000001	平安银行	1,159,962,582.35	2.54
8	002594	比亚迪	1,153,811,710.88	2.52
9	002475	立讯精密	1,125,068,152.67	2.46
10	000568	泸州老窖	1,114,309,680.94	2.44
11	000725	京东方 A	1,050,723,043.06	2.30
12	000002	万科 A	971,689,097.87	2.12
13	000661	长春高新	969,615,995.74	2.12
14	002714	牧原股份	900,036,025.62	1.97
15	300122	智飞生物	868,910,528.24	1.90
16	300015	爱尔眼科	794,102,216.66	1.74
17	002142	宁波银行	770,965,772.64	1.69
18	300014	亿纬锂能	735,283,465.32	1.61
19	002352	顺丰控股	733,681,628.17	1.60
20	002371	北方华创	690,380,723.33	1.51

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五粮液	2,954,754,359.04	6.46
2	000333	美的集团	2,192,026,821.11	4.79
3	000651	格力电器	1,439,882,181.12	3.15
4	300059	东方财富	1,360,798,857.55	2.97
5	002415	海康威视	1,273,044,808.67	2.78
6	000001	平安银行	1,124,687,503.31	2.46
7	002594	比亚迪	1,110,335,866.44	2.43
8	000568	泸州老窖	1,099,764,877.68	2.40
9	002475	立讯精密	1,025,443,703.70	2.24
10	000725	京东方 A	986,985,552.50	2.16
11	000002	万科 A	948,985,482.89	2.07
12	000661	长春高新	912,763,887.77	2.00
13	002714	牧原股份	860,635,337.46	1.88
14	300122	智飞生物	766,820,304.89	1.68
15	300014	亿纬锂能	733,763,899.05	1.60
16	300015	爱尔眼科	716,184,772.28	1.57
17	002352	顺丰控股	694,396,307.43	1.52
18	002142	宁波银行	650,175,894.16	1.42
19	002460	赣锋锂业	649,107,825.51	1.42
20	000100	TCL 科技	623,968,306.82	1.36

注：不考虑相关交易费用。

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	54,742,133,457.89
卖出股票收入（成交）总额	49,224,520,823.75

注：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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有债券。

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

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

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

注：本基金本报告期末未持有权证。

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
IF2203	沪深 300 期货 2203 合约	770	1,143,588,60 0.00	-24,843,420.00	-
公允价值变动总额合计（元）					-24,843,420.00
股指期货投资本期收益（元）					87,673,689.32
股指期货投资本期公允价值变动（元）					-99,019,560.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

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

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

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

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

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

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	142,546,631.84
2	应收证券清算款	19,407,797.62
3	应收股利	-
4	应收利息	1,708,435.57
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	163,662,865.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

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	000333	美的集团	127,986,540.00	0.22	转融通证券出借
2	300059	东方财富	97,231,911.00	0.17	转融通证券出借
3	601012	隆基股份	81,476,240.00	0.14	转融通证券出借
4	000858	五粮液	35,402,940.00	0.06	转融通证券出借
5	600519	贵州茅台	20,500,000.00	0.04	转融通证券出借
6	600036	招商银行	10,326,520.00	0.02	转融通证券出借
7	601318	中国平安	9,325,850.00	0.02	转融通证券出借
8	601166	兴业银行	3,895,584.00	0.01	转融通证券出借

9	600900	长江电力	3,073,580.00	0.01	转融通证券出借
10	300750	宁德时代	2,587,200.00	0.00	转融通证券出借

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	688262	国芯科技	299,275.42	0.00	新股未上市
2	688800	瑞可达	262,653.51	0.00	新股锁定期内
3	688121	卓然股份	134,062.02	0.00	新股锁定期内
4	301155	海力风电	101,974.50	0.00	新股锁定期内
5	301088	戎美股份	17,367.68	0.00	新股锁定期内

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 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 (%)
365,424	31,033.78	8,326,332,463.00	73.42	3,014,155,227.00	26.58

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 (%)
联接基金	481,477,669.00	4.245652

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	中央汇金投资有限责任公司	2,423,958,601.00	21.37
2	上海东证期货—工商银行—东证期货工银慧享一号集合资产管理计划	332,763,211.00	2.93
3	国泰君安证券股份有	244,214,740.00	2.15

	限公司		
4	华泰证券股份有限公司	199,327,500.00	1.76
5	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	184,318,500.00	1.63
6	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	172,389,952.00	1.52
7	广发证券股份有限公司	149,829,903.00	1.32
8	方正中期期货有限公司—方正中期稳盈 1 号资产管理计划	146,748,152.00	1.29
9	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	140,418,400.00	1.24
10	招商证券股份有限公司	137,614,493.00	1.21

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例（%）
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,000.00	0.0001

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（2012 年 5 月 4 日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	8,657,587,690.00
本报告期基金总申购份额	22,485,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	19,802,700,000.00
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	11,340,487,690.00

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

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

基金管理人的重大人事变动：

2021 年 5 月 19 日，经公司董事会批准陈晖女士不再担任公司督察长，刘万方先生担任公司督察长并不再担任公司副总经理。

2021 年 12 月 9 日，经公司董事会批准满黎先生担任公司副总经理。

上述人事变动已按相关规定备案、公告。

基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动：

中国工商银行股份有限公司（以下简称“本公司”）根据工作需要，任命刘彤女士担任本公司资产托管部总经理，全面主持资产托管部相关工作。刘彤女士的托管人高级管理人员任职信息已经在中国证券投资基金业协会备案。李勇先生不再担任本公司资产托管部总经理职务。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 150,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 10 年的审计服务。

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

报告期内基金管理人、基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	

广发证券	4	61,976,568,309.00	59.64%	8,137,705.64	58.65%	-
方正证券	2	32,398,607,748.40	31.18%	4,254,019.54	30.66%	-
中信建投	2	5,235,991,777.99	5.04%	687,489.08	4.95%	-
华泰证券	2	3,196,733,220.10	3.08%	419,732.99	3.03%	-
平安证券	2	821,569,703.82	0.79%	107,876.52	0.78%	-
中信证券	3	236,319,887.89	0.23%	220,095.17	1.59%	-
长江证券	2	36,627,630.09	0.04%	33,378.71	0.24%	-
申万宏源	2	16,487,657.50	0.02%	15,025.68	0.11%	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 具备基金运作所需的

高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服务；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	57,044,987.20	42.49%	-	-	-	-
中信建投	8,410,854.20	6.27%	-	-	-	-
华泰证券	68,795,386.33	51.24%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
国都证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
湘财证券	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-

银河证券	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-
中金财富 证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-

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	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 24 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于聘任副总经理的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 10 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 4 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与宁波银行股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 3 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 12 月 2 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 11 月 30 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 11 月 18 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 22 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 20 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 9 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 10 月 1 日
12	华泰柏瑞基金关于网上直销直连招商银行支付服务的补充提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 9 月 27 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 12 日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于新增办公地址的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 9 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 8 月 6 日
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 7 月 16 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 24 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与华安证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 11 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 3 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与珠海盈米基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 6 月 2 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 21 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 20 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 14 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 5 月 12 日
25	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参加浙商银行股份有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 30 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于终止上海尚善基金销售有限公司办理旗下基金相关业务公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 27 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与蚂蚁（杭州）基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 4 月 20 日
28	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金根据《公开募集证券投资基金	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 27 日

	金运作指引第 3 号指数基金指引》修改基金合同和托管协议的公告		
29	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 5 日
30	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 3 月 4 日
31	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 27 日
32	关于终止包商银行股份有限公司办理本公司旗下基金销售业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 2 月 9 日
33	关于华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金开通集合申购业务的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 23 日
34	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 22 日
35	华泰柏瑞基金管理有限公司关于网上直销直连招商银行升级签约方式的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 14 日
36	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金收益分配公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 11 日
37	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参加北京增财基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 日
38	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2021 年 1 月 7 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	1	20210101-20211231;	2,423,958,601.00	0.00	0.00	2,423,958,601.00	21.37

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
 托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。 投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。 客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2022 年 3 月 31 日