

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年中期报告

2022 年 6 月 30 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 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 2022 年 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§ 7 投资组合报告	75
7.1 期末基金资产组合情况	75
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	76
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	77
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	86
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	87
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	87

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	88
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	88
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	88
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	88
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	88
7.12 投资组合报告附注	88
§ 8 基金份额持有人信息	89
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	89
8.2 期末上市基金前十名持有人	90
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	90
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	91
§ 9 开放式基金份额变动	91
§ 10 重大事件揭示	91
10.1 基金份额持有人大会决议	91
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	91
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	91
10.4 基金投资策略的改变	91
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	91
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	92
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
10.8 其他重大事件	94
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	95
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	95
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	96
§ 12 备查文件目录	96
12.1 备查文件目录	96
12.2 存放地点	96
12.3 查阅方式	96

§ 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)
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	10,797,787,690.00 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金中期报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2022 年 1 月 1 日-2022 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-4,945,244,411.77
本期利润	-4,357,156,121.34
加权平均基金份额本期利润	-0.3813
本期加权平均净值利润率	-8.79%
本期基金份额净值增长率	-8.56%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	19,657,667,583.54
期末可供分配基金份额利润	1.8205
期末基金资产净值	48,766,203,965.78
期末基金份额净值	4.5163
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2022 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	94.98%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、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

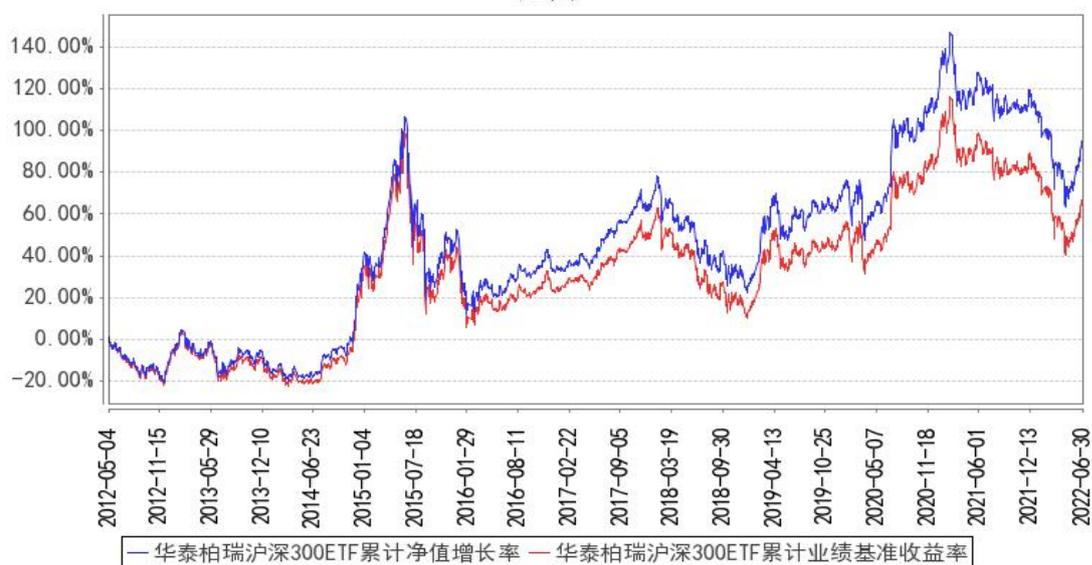
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净	份额净值	业绩比较基	业绩比较基准	①-③	②-④
----	-----	------	-------	--------	-----	-----

	值增长率①	增长率标准差②	准收益率③	收益率标准差④		
过去一个月	10.27%	1.06%	9.62%	1.07%	0.65%	-0.01%
过去三个月	7.03%	1.43%	6.21%	1.43%	0.82%	0.00%
过去六个月	-8.56%	1.45%	-9.22%	1.45%	0.66%	0.00%
过去一年	-12.88%	1.24%	-14.15%	1.25%	1.27%	-0.01%
过去三年	22.49%	1.26%	17.24%	1.27%	5.25%	-0.01%
自基金合同生效起至今	94.98%	1.42%	66.63%	1.43%	28.35%	-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 2022 年 06 月 30 日。

§ 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、华泰柏瑞享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、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金（QDII）、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金。截至 2022 年 6 月 30 日，公司基金管理规模为 2750.48 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	-	21 年	21 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。

					<p>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。</p>
--	--	--	--	--	---

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。任职日期和离任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遵规守信情况的说明

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。

4.3.2 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

2022 年上半年 A 股市场波动较大，先抑后扬，多数行业表现一般，未录得正收益。煤炭、交通运输、综合板块的表现较好，涨跌幅分别为 31.38%、-0.71%、-1.46%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-9.22%、-12.30%、-12.67%、和-15.41%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-6.52%和-13.14%，中证 500 价值相对中证 500 成长亦同样获得了显著的超额收益。

同比港股市场，恒生能源业、恒生电讯业等行业录得正收益，恒生能源业的涨跌幅为 18.92%。恒生指数、恒生中国企业指数和恒生综指在上半年表现一般，涨跌幅分别为-6.57%、-6.91%和-8.84%。

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 0.013%，期间日跟踪误差为 0.021%，较好地实现了本基金的投资目标。

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 4.5163 元；本报告期基金份额净值增长率为-8.56%，业绩比较基准收益率为-9.22%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上海新冠疫情的爆发使得国内经济短期受到影响，中美利差开始倒挂，市场情绪恐慌，迎来短暂的股债汇三杀，上证指数最低收于 2863 点。4 月底至今的反弹，在稳增长措施不断发力以及国内疫情逐步得到控制的背景下，市场交易最差的时期已经过去，经济迎来修复。5 月，经济基本面有所恢复，工业增加值出现正增长，设备制造业受益于物流打通和供应链修复，改善幅度较大。复工复产推动企业加快赶工，出口大超预期。疫情对消费的负面影响约为 4 月的 70%，未来有望继续修复。4 月之前房地产由于政策预期的反转，如期看到基本面的大幅改善，地产成交数据降幅大幅收窄。汽车销售 5 月改善，新能源车 6 月同比继续高增长。猪肉周期底部回升以及成品油价格上升带来的输入性通胀压力下，预计下半年国内通胀中枢或将小幅抬升，温和通胀的环境下利率中枢难以大幅下行。

从配置的角度，中国经济从衰退到复苏，美国经济从过热到衰退，中美经济周期持续错位，使得中国市场走出了相对独立的行情。从年初至今市场交易逻辑来看，房地产和消费的交易逻辑是正相关的，受到“稳增长预期兑现”或者“复苏预期”的牵引；从投资主线来看，依然关注下半年稳增长政策的落地以及复苏逻辑两条主线。受此影响，大盘股或将更加受益。

4.6 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。

4.7 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。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2022 年 1 月 19 日进行分配，每 10 份基金份额派发现金红利 0.75 元。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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 2022 年中期报告中财务指标、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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	234,917,672.44	235,699,884.97
结算备付金		963,288,844.18	1,222,370,183.37
存出保证金		133,811,706.55	142,546,631.84
交易性金融资产	6.4.7.2	47,627,534,843.73	55,381,502,659.10
其中：股票投资		47,621,167,369.26	55,381,502,659.10
基金投资		-	-
债券投资		6,367,474.47	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资	6.4.7.5	-	-

其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	6.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-	-
应收清算款		11,065,940.90	19,407,797.62
应收股利		2,758,856.04	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	912,811.32	1,708,435.57
资产总计		48,974,290,675.16	57,003,235,592.47
负债和净资产	附注号	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		8,726,456.41	67,951.26
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		37,022,558.37	5,546,645.91
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		19,336,752.01	20,251,085.76
应付托管费		3,867,350.41	4,050,217.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		14.73	308,093.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.9	139,133,577.45	86,952,361.26
负债合计		208,086,709.38	117,176,355.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.10	29,108,536,382.24	30,571,540,020.08
其他综合收益	6.4.7.11	-	-
未分配利润	6.4.7.12	19,657,667,583.54	26,314,519,217.38
净资产合计		48,766,203,965.78	56,886,059,237.46
负债和净资产总计		48,974,290,675.16	57,003,235,592.47

注：报告截止日 2022 年 06 月 30 日，基金份额净值 4.5163 元，基金份额总额 10,797,787,690.00 份。

6.2 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：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期	上年度可比期间
		2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-4,200,775,137.18	1,154,938,926.61
1. 利息收入		30,250,214.19	58,019,756.09
其中：存款利息收入	6.4.7.13	7,988,070.49	9,632,066.59
债券利息收入		-	13,444.22
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		22,262,143.70	48,374,245.28
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-4,818,040,052.30	4,896,025,835.50
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-5,085,405,710.51	4,459,463,454.89
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	7,182,991.14	10,029,699.32
资产支持证券投资	6.4.7.16	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.17	-	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-188,225,527.28	78,504,291.26
股利收益	6.4.7.19	448,408,194.35	348,028,390.03
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.20	588,088,290.43	-3,850,093,705.54
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	-1,073,589.50	50,987,040.56
减：二、营业总支出		156,380,984.16	184,252,834.78
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	123,970,021.84	112,263,868.29
2. 托管费	6.4.10.2.2	24,794,004.34	22,452,773.66
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		29.51	282,656.91

8. 其他费用	6.4.7.23	7,616,928.47	49,253,535.92
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-4,357,156,121.34	970,686,091.83
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-4,357,156,121.34	970,686,091.83
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-4,357,156,121.34	970,686,091.83

6.3 净资产(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: 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-1,463,003,637.84	-	-6,656,851,633.84	-8,119,855,271.68
(一)、综合收益总额	-	-	-4,357,156,121.34	-4,357,156,121.34
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动	-1,463,003,637.84	-	-1,436,131,430.35	-2,899,135,068.19

数 (净值减少以“-”号填列)				
其中：1. 基金申购款	33,717,017,554.05	-	19,467,252,514.58	53,184,270,068.63
2. 基金赎回款	-35,180,021,191.89	-	-20,903,383,944.93	-56,083,405,136.82
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-863,564,082.15	-863,564,082.15
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	29,108,536,382.24	-	19,657,667,583.54	48,766,203,965.78
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	23,339,012,905.15	-	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	23,339,012,905.15	-	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28

三、本期 增减变动 额（减少 以“-”号 填列）	1,426,610,514.46	-	1,190,068,668.71	2,616,679,183.17
（一）、综 合收益总 额	-	-	970,686,091.83	970,686,091.83
（二）、本 期基金份 额交易产 生的基金 净值变动 数 （净值减 少以“-” 号填列）	1,426,610,514.46	-	854,781,690.16	2,281,392,204.62
其中：1. 基金申购 款	33,180,825,503.81	-	31,578,653,837.02	64,759,479,340.83
2. 基金赎回 款	-31,754,214,989.35	-	-30,723,872,146.86	-62,478,087,136.21
（三）、本 期向基金 份额持有 人分配利 润产生的 基金净值 变动（净 值减少以 “-”号填 列）	-	-	-635,399,113.28	-635,399,113.28
（四）、其 他综合收 益结转留 存收益	-	-	-	-
四、本期 期末净资 产（基金 净值）	24,765,623,419.61	-	23,599,461,650.84	48,365,085,070.45

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

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

6.4 报表附注

6.4.1 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管理人华泰柏瑞基金管理有限公司于 2022 年 8 月 30 日批准报出。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于 2006 年 2 月 15 日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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 6.4.4 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间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 2022 年 6 月 30 日的财务状况以及 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

除 6.4.5 的会计政策变更外，其他项目于上年度一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于 2017 年颁布了修订后的《企业会计准则第 22 号——金融工具确认和计量》、《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》及《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”)，财政部、中国银行保险监督管理委员会于 2020 年 12 月 30 日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于 2022 年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，将金融工具分类为以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

新金融工具准则要求对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。金融资产减值计量方式的变更对于本基金的影响不重大。

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 235,699,884.97 元、1,222,370,183.37 元、142,546,631.84 元、1,708,435.57 元和 19,407,797.62 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 235,739,584.30 元、1,222,958,695.23 元、142,548,983.86 元、1,077,872.36 元和 19,407,797.62 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 55,381,502,659.10 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 55,381,502,659.10 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,546,645.91 元、20,251,085.76 元、4,050,217.15 元、3,337,919.65 元和 83,236,770.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,546,645.91 元、20,251,085.76 元、4,050,217.15 元、3,337,919.65 元和 83,236,770.49 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 67,951.26 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融负债为交易性金融负债，金额为 67,951.26 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息

分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，本基金无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
活期存款	234,917,672.44
等于：本金	234,897,153.15
加：应计利息	20,519.29
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	234,917,672.44

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	47,295,880,302.97	-	47,621,167,369.26	325,287,066.29
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	474.47	6,367,474.47	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	474.47	6,367,474.47	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	47,302,247,302.97	474.47	47,627,534,843.73	325,287,066.29

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 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	959,630,040.00	-	-	
其中：股指期货投资	959,630,040.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	959,630,040.00	-	-	

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。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2207	沪深 300 期货 2207 合约	460.00	617,301,600.00	40,236,300.00

IF2209	沪深 300 期货 2209 合约	310.00	413,589,600.00	31,024,860.00
合计				71,261,160.00
减：可抵销 期货暂收款				71,261,160.00
净额				-

6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末未持有黄金衍生品。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

6.4.7.5 债权投资

6.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.6 其他债权投资

6.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

6.4.7.7 其他权益工具投资

6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

6.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2022 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	912,811.32
待摊费用	-
合计	912,811.32

6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	3,895,917.11
其中：交易所市场	3,895,917.11
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	133,891.13
应付指数使用费	7,438,201.24
其他应付款	500,000.00
应退退补款	127,165,567.97
合计	139,133,577.45

6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,340,487,690.00	30,571,540,020.08
本期申购	12,507,300,000.00	33,717,017,554.05
本期赎回（以“-”号填列）	-13,050,000,000.00	-35,180,021,191.89
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	10,797,787,690.00	29,108,536,382.24

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。

6.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期无其他综合收益。

6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	43,552,108,324.03	-17,237,589,106.65	26,314,519,217.38

本期利润	-4,945,244,411.77	588,088,290.43	-4,357,156,121.34
本期基金份额交易产生的变动数	-1,699,620,475.93	263,489,045.58	-1,436,131,430.35
其中：基金申购款	44,469,945,494.61	-25,002,692,980.03	19,467,252,514.58
基金赎回款	-46,169,565,970.54	25,266,182,025.61	-20,903,383,944.93
本期已分配利润	-863,564,082.15	-	-863,564,082.15
本期末	36,043,679,354.18	-16,386,011,770.64	19,657,667,583.54

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
活期存款利息收入	402,252.30
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	7,522,016.38
其他	63,801.81
合计	7,988,070.49

6.4.7.14 股票投资收益

6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,091,040,454.37
股票投资收益——赎回差价收入	-1,994,365,256.14
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	-5,085,405,710.51

6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出股票成交总额	25,817,802,665.91
减：卖出股票成本总额	28,871,976,939.85
减：交易费用	36,866,180.43
买卖股票差价收入	-3,091,040,454.37

6.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
赎回基金份额对价总额	56,083,405,136.82

减：现金支付赎回款总额	23,835,237,692.82
减：赎回股票成本总额	34,242,532,700.14
减：交易费用	-
赎回差价收入	-1,994,365,256.14

6.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-申购差价收入。

6.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	9,299.69
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,173,691.45
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	7,182,991.14

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	40,119,690.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	32,936,800.00
减：应计利息总额	9,071.11
减：交易费用	128.20
买卖债券差价收入	7,173,691.45

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.18 衍生工具收益

6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：无。

6.4.7.18.2 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
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-188,225,527.28

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	448,408,194.35
其中：证券出借权益补偿收入	18,734,667.34
基金投资产生的股利收益	-
合计	448,408,194.35

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	491,983,710.43
股票投资	491,983,710.43
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	96,104,580.00
权证投资	-
期货投资	96,104,580.00
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	588,088,290.43

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	-1,073,589.50
合计	-1,073,589.50

注：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。

6.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
审计费用	74,383.76
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	7,438,201.24
注册登记费	42,328.88
银行划款手续费	2,507.22
合计	7,616,928.47

6.4.7.24 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，不需要进行分部报告的披露。

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金无其它需作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
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（“中国工商银行股份有限公司”）	基金托管人
华泰证券（“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
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
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：关联方与基金进行的关联交易均在正常业务范围内按照一般商业条款而订立的。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票 成交总额的比例 (%)
华泰证券	12,431,878,258.66	24.83	2,786,515,122.83	4.78

6.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期本基金与关联方未进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	1,699,651.56	25.12	1,699,651.56	43.63
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例 (%)	期末应付佣金余 额	占期末应付佣金 总额的比例 (%)
华泰证券	365,869.95	4.64	320,787.11	8.07

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6 月30日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	123,970,021.84	112,263,868.29
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金应支付基金管理人报酬，按前一日基金资产净值的 0.50% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.50\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的管理人报酬 E 为前一日的基金资

产净值 基金管理人报酬每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	24,794,004.34	22,452,773.66

注：本基金应支付基金托管人托管费，按前一日基金资产净值的 0.10% 的年费率计提，计算方法如下： $H = E \times 0.10\% \div \text{当年天数}$ H 为每日应支付的托管费 E 为前一日的基金资产净值 基金托管费每日计提，逐日累计至每月月底，按月支付，由基金托管人于次月前三个工作日内从基金资产中一次性支取。

6.4.10.2.3 销售服务费

注：本基金本期与上年度可比期间无发生关联方销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

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。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	7,845,376,637.00	5,641,863.42	424,087,545.60	220,029.04
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	27,657,146,239.32	27,108,651.80	2,889,145,399.20	1,755,159.52

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日				

关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单位:天)	费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2022010400000462	泰格医药	2022年1月4日	11,854,000.00	100,000	14	3.400	15,673.62	-	-
华泰证券	2022010400023069	欧普康视	2022年1月4日	1,405,250.00	25,000	14	3.400	1,858.05	-	-
华泰证券	2022010400023081	沃森生物	2022年1月4日	616,896.00	11,200	14	3.400	815.67	-	-
华泰证券	2022010400023091	中微公司	2022年1月4日	2,402,200.00	20,000	14	3.400	3,176.24	-	-
华泰证券	2022010400023095	温氏股份	2022年1月4日	4,888,752.00	236,400	14	3.400	6,464.02	-	-
华泰证券	2022010400023097	东方财富	2022年1月4日	8,229,870.00	229,500	14	3.400	10,881.72	-	-
华泰证券	2022010400023107	英科医疗	2022年1月4日	219,830.00	3,800	14	3.400	290.66	-	-
华泰证券	2022010400023111	中微公司	2022年1月4日	3,831,509.00	31,900	14	3.400	5,066.11	-	-
华泰证券	2022010400023117	蓝思科技	2022年1月4日	1,239,744.00	52,800	14	3.400	1,639.22	-	-
华泰证券	2022010500000791	安克创新	2022年1月5日	968,060.00	9,700	14	3.400	1,279.99	-	-
华泰证券	2022010500000793	华大基因	2022年1月5日	1,298,848.00	14,800	14	3.400	1,717.37	-	-
华泰证券	2022010500000797	华熙生物	2022年1月5日	1,480,000.00	10,000	14	3.400	1,956.89	-	-
华泰证券	2022010500009047	英科医疗	2022年1月5日	113,460.00	2,000	14	3.400	150.02	-	-
华泰证券	2022010500009049	智飞生物	2022年1月5日	2,467,712.00	20,800	14	3.400	3,262.86	-	-
华泰证券	2022010500009051	智飞生物	2022年1月5日	3,630,384.00	30,600	14	3.400	4,800.17	-	-
华泰证券	2022010500009053	英科医疗	2022年1月5日	561,627.00	9,900	14	3.400	742.60	-	-
华泰证券	2022010500009055	阳光电源	2022年1月5日	1,083,600.00	8,400	14	3.400	1,432.76	-	-
华泰证券	2022010500009059	同花顺	2022年1月5日	2,802,604.00	19,600	14	3.400	3,705.67	-	-
华泰证券	2022010600000607	华大基因	2022年1月6日	355,600.00	4,000	14	3.400	470.18	-	-
华泰证券	2022010600000608	金龙鱼	2022年1月6日	9,475,752.00	145,200	14	3.400	12,529.05	-	-
华泰证券	2022010600010077	华大基因	2022年1月6日	1,644,650.00	18,500	14	3.400	2,174.59	-	-
华泰证券	2022010600010085	沃森生物	2022年1月6日	1,562,896.00	27,400	14	3.400	2,066.50	-	-
华泰证券	2022010700000651	华大基因	2022年1月7日	1,364,550.00	15,000	14	3.400	1,804.24	-	-
华泰证券	2022010700000654	中微公司	2022年1月7日	3,621,000.00	30,000	14	3.400	4,787.77	-	-
华泰证券	2022010700009903	华大基因	2022年1月7日	136,455.00	1,500	14	3.400	180.42	-	-
华泰证券	2022010700010145	金龙鱼	2022年1月7日	1,107,119.00	16,900	14	3.400	1,463.86	-	-
华泰证券	2022011000001142	金龙鱼	2022年1月10日	65,340.00	1,000	14	3.400	86.39	-	-
华泰证券	2022011000001144	健帆生物	2022年1月10日	929,900.00	17,000	14	3.400	1,229.53	-	-
华泰证券	2022011000001146	宋城演艺	2022年1月10日	288,028.00	19,100	14	3.400	380.84	-	-
华泰证券	2022011000011417	亿纬锂能	2022年1月10日	1,451,800.00	14,000	14	3.400	1,919.60	-	-
华泰证券	2022011000011421	东方财富	2022年1月10日	10,059,000.00	300,000	14	3.400	13,300.23	-	-
华泰证券	2022011000011425	金龙鱼	2022年1月10日	1,385,208.00	21,200	14	3.400	1,831.55	-	-
华泰证券	2022011000011431	宋城演艺	2022年1月10日	431,288.00	28,600	14	3.400	570.26	-	-
华泰证券	202201100001250	汇川技术	2022年1月11日	6,520,000.00	100,000	14	3.400	8,620.89	-	-
华泰证券	2022011000011737	华大基因	2022年1月11日	1,412,100.00	15,000	14	3.400	1,867.11	-	-
华泰证券	2022011000011739	英科医疗	2022年1月11日	105,111.00	1,700	14	3.400	138.98	-	-
华泰证券	202201100013271	东方财富	2022年1月11日	10,020,000.00	300,000	14	3.400	13,248.67	-	-

				0							
华泰证券	2022011100013273	华大基因	2022 年 1 月 11 日	1,044,954.00	11,100	14	3.400	1,381.66	-	-	
华泰证券	2022011100013275	华大基因	2022 年 1 月 11 日	677,808.00	7,200	14	3.400	896.21	-	-	
华泰证券	2022011200000558	阳光电源	2022 年 1 月 12 日	2,384,310.00	19,000	14	3.400	3,152.59	-	-	
华泰证券	2022011200000560	金山办公	2022 年 1 月 12 日	7,816,500.00	30,000	14	3.400	10,335.15	-	-	
华泰证券	2022011200016601	华大基因	2022 年 1 月 12 日	478,550.00	5,000	14	3.400	632.75	-	-	
华泰证券	2022011200016865	健帆生物	2022 年 1 月 12 日	654,489.00	12,100	14	3.400	865.38	-	-	
华泰证券	2022011200016999	华大基因	2022 年 1 月 12 日	497,692.00	5,200	14	3.400	658.06	-	-	
华泰证券	2022011200017003	沪硅产业	2022 年 1 月 12 日	5,280,000.00	200,000	14	3.400	6,981.33	-	-	
华泰证券	2022011300000678	蓝思科技	2022 年 1 月 13 日	4,364,619.00	214,900	14	3.400	5,771.00	-	-	
华泰证券	2022011300000679	英科医疗	2022 年 1 月 13 日	378,900.00	6,000	14	3.400	500.99	-	-	
华泰证券	2022011300000690	金山办公	2022 年 1 月 13 日	5,080,200.00	20,000	14	3.600	7,112.28	-	-	
华泰证券	2022011300010154	沪硅产业	2022 年 1 月 13 日	656,500.00	25,000	14	3.400	868.04	-	-	
华泰证券	2022011300012276	爱尔眼科	2022 年 1 月 13 日	83,007.00	2,300	14	3.400	109.75	-	-	
华泰证券	2022011400000575	智飞生物	2022 年 1 月 14 日	192,508.00	1,700	14	3.400	254.54	-	-	
华泰证券	2022011400020420	爱尔眼科	2022 年 1 月 14 日	322,595.00	9,100	14	3.400	426.54	-	-	
华泰证券	2022011400024078	华大基因	2022 年 1 月 14 日	404,720.00	4,000	14	3.400	535.13	-	-	
华泰证券	2022011400024080	沃森生物	2022 年 1 月 14 日	1,007,600.00	17,600	14	3.400	1,332.27	-	-	
华泰证券	2022011400024102	智飞生物	2022 年 1 月 14 日	113,240.00	1,000	14	3.400	149.73	-	-	
华泰证券	2022010400023075	英科医疗	2022 年 1 月 4 日	578,500.00	10,000	28	3.400	1,857.63	-	-	
华泰证券	2022010400023115	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日	4,003,063.00	68,300	28	3.400	12,854.28	-	-	
华泰证券	2022010400023119	芒果超媒	2022 年 1 月 4 日	498,185.00	8,500	28	3.400	1,599.73	-	-	
华泰证券	2022010500009057	温氏股份	2022 年 1 月 5 日	1,244,745.00	59,700	28	3.400	3,879.46	-	-	
华泰证券	2022010600010081	芒果超媒	2022 年 1 月 6 日	1,701,792.00	31,100	28	3.400	5,143.19	-	-	
华泰证券	2022010700009907	澜起科技	2022 年 1 月 7 日	3,894,768.00	51,600	28	3.400	11,403.02	-	-	
华泰证券	2022011000011429	华大基因	2022 年 1 月 10 日	313,269.00	3,300	28	3.400	828.42	-	-	
华泰证券	2022011800000726	健帆生物	2022 年 1 月 18 日	1,665,000.00	30,000	14	3.400	3,145.00	-	-	
华泰证券	2022011800000728	先导智能	2022 年 1 月 18 日	133,740.00	1,800	14	3.400	252.62	-	-	
华泰证券	2022011800023946	温氏股份	2022 年 1 月 18 日	4,645,260.00	236,400	14	3.400	8,774.38	-	-	
华泰证券	2022011800023950	欧普康视	2022 年 1 月 18 日	1,228,250.00	25,000	14	3.400	2,320.03	-	-	
华泰证券	2022011800023954	中微公司	2022 年 1 月 18 日	2,367,400.00	20,000	14	3.400	4,471.76	-	-	
华泰证券	2022011800023962	沃森生物	2022 年 1 月 18 日	619,472.00	11,200	14	3.400	1,170.11	-	-	
华泰证券	2022011800023968	中微公司	2022 年 1 月 18 日	3,776,003.00	31,900	14	3.400	7,132.45	-	-	
华泰证券	2022011800023974	东方财富	2022 年 1 月 18 日	7,591,860.00	229,500	14	3.400	14,340.18	-	-	
华泰证券	2022011800023976	泰格医药	2022 年 1 月 18 日	12,202,000.00	100,000	14	3.400	23,048.22	-	-	
华泰证券	2022011800023982	英科医疗	2022 年 1 月 18 日	242,630.00	3,800	14	3.400	458.30	-	-	
华泰证券	2022011900000656	汇川技术	2022 年 1 月 19 日	6,619,800.00	100,300	14	3.400	11,878.86	-	-	
华泰证券	2022011900000658	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	3,882,870.00	36,500	14	3.400	6,967.59	-	-	
华泰证券	2022011900009857	英科医疗	2022 年 1 月 19 日	630,927.00	9,900	14	3.400	1,132.16	-	-	
华泰证券	2022011900009859	安克创新	2022 年 1 月 19 日	908,696.00	9,700	14	3.400	1,630.60	-	-	
华泰证券	2022011900009861	华大基因	2022 年 1 月 19 日	1,364,708.00	14,800	14	3.400	2,448.89	-	-	

华泰证券	2022011900009863	英科医疗	2022 年 1 月 19 日	127,460.00	2,000	14	3.400	228.72	-	-
华泰证券	2022011900009865	华熙生物	2022 年 1 月 19 日	1,334,800.00	10,000	14	3.400	2,395.22	-	-
华泰证券	2022011900009867	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	3,255,228.00	30,600	14	3.400	5,841.33	-	-
华泰证券	2022011900009869	阳光电源	2022 年 1 月 19 日	1,013,964.00	8,400	14	3.400	1,819.50	-	-
华泰证券	2022011900010333	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	2,212,704.00	20,800	14	3.400	3,970.57	-	-
华泰证券	202201200000805	康龙化成	2022 年 1 月 20 日	5,755,950.00	45,000	14	3.400	9,785.12	-	-
华泰证券	2022012000008878	华大基因	2022 年 1 月 20 日	1,675,175.00	18,500	14	3.400	2,847.80	-	-
华泰证券	2022012000009666	沃森生物	2022 年 1 月 20 日	1,477,682.00	27,400	14	3.400	2,512.06	-	-
华泰证券	2022012000009668	华大基因	2022 年 1 月 20 日	362,200.00	4,000	14	3.400	615.74	-	-
华泰证券	2022012100011150	华大基因	2022 年 1 月 21 日	1,335,000.00	15,000	14	3.400	2,143.42	-	-
华泰证券	2022012100011242	中微公司	2022 年 1 月 21 日	3,394,500.00	30,000	14	3.400	5,450.06	-	-
华泰证券	2022012100011244	华大基因	2022 年 1 月 21 日	133,500.00	1,500	14	3.400	214.34	-	-
华泰证券	2022012400000415	华大基因	2022 年 1 月 24 日	706,240.00	8,000	14	3.400	933.81	-	-
华泰证券	2022012400009128	东方财富	2022 年 1 月 24 日	9,777,000.00	300,000	14	3.400	12,927.37	-	-
华泰证券	2022012400009130	宋城演艺	2022 年 1 月 24 日	299,870.00	19,100	14	3.400	396.49	-	-
华泰证券	2022012400009132	亿纬锂能	2022 年 1 月 24 日	1,399,860.00	14,000	14	3.400	1,850.93	-	-
华泰证券	2022012400009216	金龙鱼	2022 年 1 月 24 日	1,294,048.00	21,200	14	3.400	1,711.02	-	-
华泰证券	2022012400009218	宋城演艺	2022 年 1 月 24 日	449,020.00	28,600	14	3.400	593.70	-	-
华泰证券	2022012400009220	健帆生物	2022 年 1 月 24 日	854,080.00	17,000	14	3.400	1,129.28	-	-
华泰证券	2022012500000526	华大基因	2022 年 1 月 25 日	254,220.00	3,000	14	3.400	336.14	-	-
华泰证券	2022012500000528	宋城演艺	2022 年 1 月 25 日	615,060.00	40,200	14	3.400	813.25	-	-
华泰证券	2022012500000530	英科医疗	2022 年 1 月 25 日	56,000.00	1,000	14	3.400	74.04	-	-
华泰证券	2022012500009194	汇川技术	2022 年 1 月 25 日	6,649,000.00	100,000	14	3.400	8,791.46	-	-
华泰证券	2022012500009200	华大基因	2022 年 1 月 25 日	940,614.00	11,100	14	3.400	1,243.70	-	-
华泰证券	2022012500011626	华大基因	2022 年 1 月 25 日	1,271,100.00	15,000	14	3.400	1,680.68	-	-
华泰证券	2022012500011628	华大基因	2022 年 1 月 25 日	610,128.00	7,200	14	3.400	806.72	-	-
华泰证券	2022012500011630	东方财富	2022 年 1 月 25 日	9,516,000.00	300,000	14	3.400	12,582.27	-	-
华泰证券	2022012500011636	英科医疗	2022 年 1 月 25 日	95,200.00	1,700	14	3.400	125.88	-	-
华泰证券	2022012600010786	阳光电源	2022 年 1 月 26 日	2,459,550.00	19,000	14	3.400	3,252.07	-	-
华泰证券	2022012600011942	华大基因	2022 年 1 月 26 日	422,500.00	5,000	14	3.400	558.64	-	-
华泰证券	2022012600011944	华大基因	2022 年 1 月 26 日	439,400.00	5,200	14	3.400	580.98	-	-
华泰证券	2022012600011948	沪硅产业	2022 年 1 月 26 日	5,196,000.00	200,000	14	3.400	6,870.27	-	-
华泰证券	2022012600011964	金山办公	2022 年 1 月 26 日	7,673,100.00	30,000	14	3.400	10,145.54	-	-
华泰证券	2022012600011970	健帆生物	2022 年 1 月 26 日	572,693.00	12,100	14	3.400	757.23	-	-
华泰证券	2022011300010162	东方财富	2022 年 1 月 13 日	16,645,601.00	511,700	28	3.400	44,018.37	-	-
华泰证券	2022012700000541	康龙化成	2022 年 1 月 27 日	10,422,405.00	86,100	14	3.400	13,780.74	-	-
华泰证券	2022012700000543	中国通号	2022 年 1 月 27 日	5,255,406.00	1,092,600	14	3.400	6,948.81	-	-
华泰证券	2022012700009925	金山办公	2022 年 1 月 27 日	4,937,400.00	20,000	14	3.600	6,912.36	-	-
华泰证券	2022012700009931	爱尔眼科	2022 年 1 月 27 日	74,129.00	2,300	14	3.400	98.02	-	-
华泰证券	2022012700009937	沪硅产业	2022 年 1 月 27 日	600,750.00	25,000	14	3.400	794.33	-	-

华泰证券	2022012700009945	英科医疗	2022 年 1 月 27 日	321,600.00	6,000	14	3.400	425.23	-	-
华泰证券	2022011400024520	东方财富	2022 年 1 月 14 日	3,222,000.00	100,000	28	3.400	8,520.40	-	-
华泰证券	2022012800000260	英科医疗	2022 年 1 月 28 日	523,314.00	9,900	14	3.400	691.94	-	-
华泰证券	2022012800018798	华大基因	2022 年 1 月 28 日	336,000.00	4,000	14	3.400	444.27	-	-
华泰证券	2022012800018812	爱尔眼科	2022 年 1 月 28 日	293,657.00	9,100	14	3.400	388.28	-	-
华泰证券	2022012800018824	智飞生物	2022 年 1 月 28 日	105,620.00	1,000	14	3.400	139.65	-	-
华泰证券	2022011700002563	阳光电源	2022 年 1 月 17 日	5,075,290.00	40,700	28	3.400	13,421.32	-	-
华泰证券	2022011700002793	汇川技术	2022 年 1 月 17 日	986,524.00	15,400	28	3.400	2,608.81	-	-
华泰证券	2022020700001159	宋城演艺	2022 年 2 月 7 日	123,574.00	8,200	14	3.400	163.39	-	-
华泰证券	2022020700043903	华熙生物	2022 年 2 月 7 日	1,200,100.00	10,000	14	3.400	1,586.80	-	-
华泰证券	2022020700043921	汇川技术	2022 年 2 月 7 日	6,042,072.00	100,300	14	3.400	7,988.96	-	-
华泰证券	2022020700043927	中微公司	2022 年 2 月 7 日	3,600,900.00	30,000	14	3.400	4,761.19	-	-
华泰证券	2022020700043929	东方财富	2022 年 2 月 7 日	7,394,490.00	229,500	14	3.400	9,777.16	-	-
华泰证券	2022020700043945	阳光电源	2022 年 2 月 7 日	948,276.00	8,400	14	3.400	1,253.83	-	-
华泰证券	2022020700043951	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	2,297,776.00	20,800	14	3.400	3,038.17	-	-
华泰证券	2022020700043953	康龙化成	2022 年 2 月 7 日	5,453,100.00	45,000	14	3.400	7,210.21	-	-
华泰证券	2022020700043955	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	4,032,155.00	36,500	14	3.400	5,331.40	-	-
华泰证券	2022020700043961	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	3,380,382.00	30,600	14	3.400	4,469.62	-	-
华泰证券	2022020700043977	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,294,350.00	15,000	14	3.400	1,711.42	-	-
华泰证券	2022020700043979	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,277,092.00	14,800	14	3.400	1,688.60	-	-
华泰证券	2022020700043981	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,596,365.00	18,500	14	3.400	2,110.75	-	-
华泰证券	2022020700043983	华大基因	2022 年 2 月 7 日	129,435.00	1,500	14	3.400	171.14	-	-
华泰证券	2022020700043985	华大基因	2022 年 2 月 7 日	345,160.00	4,000	14	3.400	456.38	-	-
华泰证券	2022020700043987	沃森生物	2022 年 2 月 7 日	1,376,576.00	27,400	14	3.400	1,820.14	-	-
华泰证券	2022020700044001	英科医疗	2022 年 2 月 7 日	202,046.00	3,800	14	3.400	267.15	-	-
华泰证券	2022020700044005	英科医疗	2022 年 2 月 7 日	106,340.00	2,000	14	3.400	140.61	-	-
华泰证券	2022020700046337	温氏股份	2022 年 2 月 7 日	4,881,660.00	236,400	14	3.400	6,454.64	-	-
华泰证券	2022020700046355	华大基因	2022 年 2 月 7 日	690,320.00	8,000	14	3.400	912.76	-	-
华泰证券	2022020700046359	亿纬锂能	2022 年 2 月 7 日	1,320,200.00	14,000	14	3.400	1,745.60	-	-
华泰证券	2022020700046361	东方财富	2022 年 2 月 7 日	9,666,000.00	300,000	14	3.400	12,780.60	-	-
华泰证券	2022020700046377	健帆生物	2022 年 2 月 7 日	788,460.00	17,000	14	3.400	1,042.52	-	-
华泰证券	2022020700046381	金龙鱼	2022 年 2 月 7 日	1,216,244.00	21,200	14	3.400	1,608.14	-	-
华泰证券	2022020700046387	宋城演艺	2022 年 2 月 7 日	287,837.00	19,100	14	3.400	380.58	-	-
华泰证券	2022020700049251	沃森生物	2022 年 2 月 7 日	562,688.00	11,200	14	3.400	744.00	-	-
华泰证券	2022020700054829	泰格医药	2022 年 2 月 7 日	10,468,000.00	100,000	14	3.400	13,841.02	-	-
华泰证券	2022020700054863	欧普康视	2022 年 2 月 7 日	945,000.00	25,000	14	3.400	1,249.50	-	-
华泰证券	2022020700054867	健帆生物	2022 年 2 月 7 日	1,391,400.00	30,000	14	3.400	1,839.74	-	-
华泰证券	2022020700054887	安克创新	2022 年 2 月 7 日	931,782.00	9,700	14	3.400	1,232.02	-	-
华泰证券	2022020800001017	沪硅产业	2022 年 2 月 8 日	964,400.00	40,000	14	3.400	1,275.15	-	-
华泰证券	2022020800001021	康龙化成	2022 年 2 月 8 日	553,749.00	4,900	14	3.400	732.18	-	-
华泰证券	2022020800001023	先导智能	2022 年 2 月 8 日	84,344.00	1,300	14	3.400	111.52	-	-

华泰证券	2022020800001025	蓝思科技	2022年2月8日	65,317.00	4,300	14	3.400	86.36	-	-
华泰证券	2022020800001027	宋城演艺	2022年2月8日	170,130.00	10,700	14	3.400	224.95	-	-
华泰证券	2022020800015248	英科医疗	2022年2月8日	92,242.00	1,700	14	3.400	121.96	-	-
华泰证券	2022020800015250	英科医疗	2022年2月8日	54,260.00	1,000	14	3.400	71.74	-	-
华泰证券	2022020800015254	华大基因	2022年2月8日	1,299,450.00	15,000	14	3.400	1,718.16	-	-
华泰证券	2022020800015258	宋城演艺	2022年2月8日	639,180.00	40,200	14	3.400	845.14	-	-
华泰证券	2022020800015658	汇川技术	2022年2月8日	5,970,000.00	100,000	14	3.400	7,893.67	-	-
华泰证券	2022020800015664	华大基因	2022年2月8日	961,593.00	11,100	14	3.400	1,271.44	-	-
华泰证券	2022020800015666	华大基因	2022年2月8日	623,736.00	7,200	14	3.400	824.72	-	-
华泰证券	2022020800015668	华大基因	2022年2月8日	259,890.00	3,000	14	3.400	343.63	-	-
华泰证券	2022020800015672	东方财富	2022年2月8日	9,639,000.00	300,000	14	3.400	12,744.90	-	-
华泰证券	2022020900000842	先导智能	2022年2月9日	4,852,680.00	76,300	14	3.400	6,416.32	-	-
华泰证券	2022020900000844	健帆生物	2022年2月9日	85,266.00	1,800	14	3.400	112.74	-	-
华泰证券	2022020900000846	蓝思科技	2022年2月9日	174,608.00	11,200	14	3.400	230.87	-	-
华泰证券	2022020900000848	泰格医药	2022年2月9日	4,343,208.00	43,800	14	3.400	5,742.69	-	-
华泰证券	2022020900000849	宋城演艺	2022年2月9日	1,025,010.00	63,000	14	3.400	1,355.29	-	-
华泰证券	2022020900016386	沪硅产业	2022年2月9日	4,836,000.00	200,000	14	3.400	6,394.27	-	-
华泰证券	2022020900016390	阳光电源	2022年2月9日	2,033,950.00	19,000	14	3.400	2,689.33	-	-
华泰证券	2022020900016394	华大基因	2022年2月9日	450,580.00	5,200	14	3.400	595.77	-	-
华泰证券	2022020900016396	华大基因	2022年2月9日	433,250.00	5,000	14	3.400	572.85	-	-
华泰证券	2022020900017372	金山办公	2022年2月9日	6,867,000.00	30,000	14	3.400	9,079.70	-	-
华泰证券	2022012700009939	爱尔眼科	2022年1月27日	1,998,260.00	62,000	28	3.400	5,284.29	-	-
华泰证券	202201200000694	爱尔眼科	2022年2月10日	100,770.00	3,000	14	3.400	133.24	-	-
华泰证券	2022012000013168	康龙化成	2022年2月10日	9,364,236.00	86,100	14	3.400	12,381.60	-	-
华泰证券	2022012000013174	沪硅产业	2022年2月10日	579,500.00	25,000	14	3.400	766.23	-	-
华泰证券	2022012000014024	金山办公	2022年2月10日	4,277,600.00	20,000	14	3.600	5,988.64	-	-
华泰证券	2022012800018800	汇川技术	2022年1月28日	1,265,789.00	21,100	28	3.400	3,347.31	-	-
华泰证券	2022012800018804	沃森生物	2022年1月28日	7,466,180.00	154,900	28	3.400	19,743.90	-	-
华泰证券	2022012800018808	欧普康视	2022年1月28日	1,861,236.00	49,200	28	3.400	4,921.94	-	-
华泰证券	2022021100018612	英科医疗	2022年2月11日	506,484.00	9,900	14	3.400	669.68	-	-
华泰证券	2022021100018616	华大基因	2022年2月11日	345,960.00	4,000	14	3.400	457.44	-	-
华泰证券	2022021100018618	爱尔眼科	2022年2月11日	294,840.00	9,100	14	3.400	389.84	-	-
华泰证券	2022021400000399	英科医疗	2022年2月14日	848,924.00	16,600	14	3.400	1,122.47	-	-
华泰证券	2022021600000439	英科医疗	2022年2月16日	540,853.00	10,300	14	3.400	715.13	-	-
华泰证券	2022021700000373	金龙鱼	2022年2月17日	57,590.00	1,000	14	3.400	76.15	-	-
华泰证券	2022020700043933	澜起科技	2022年2月7日	3,713,136.00	51,600	28	3.400	9,819.18	-	-
华泰证券	2022020700043993	芒果超媒	2022年2月7日	292,400.00	8,500	28	3.400	773.24	-	-
华泰证券	2022020700044003	英科医疗	2022年2月7日	531,700.00	10,000	28	3.400	1,406.05	-	-
华泰证券	2022020700048421	华大基因	2022年2月7日	284,757.00	3,300	28	3.400	753.02	-	-
华泰证券	2022022100035695	汇川技术	2022年2月21日	6,449,290.00	100,300	14	3.400	8,527.39	-	-
华泰证券	2022022100035699	英科医疗	2022年2月21日	105,960.00	2,000	14	3.400	140.10	-	-
华泰证券	2022022100035703	智飞生物	2022年2月21日	3,843,666.00	30,600	14	3.400	5,082.18	-	-

华泰证券	2022022100035705	英科医疗	2022 年 2 月 21 日	201,324.00	3,800	14	3.400	266.20	-	-
华泰证券	2022022100035707	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	4,584,765.00	36,500	14	3.400	6,062.08	-	-
华泰证券	2022022100035711	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	2,612,688.00	20,800	14	3.400	3,454.55	-	-
华泰证券	2022022100035753	泰格医药	2022 年 2 月 21 日	9,995,000.00	100,000	14	3.400	13,215.61	-	-
华泰证券	2022022100035757	沃森生物	2022 年 2 月 21 日	1,373,562.00	27,400	14	3.400	1,816.15	-	-
华泰证券	2022022100035759	欧普康视	2022 年 2 月 21 日	1,008,750.00	25,000	14	3.400	1,333.79	-	-
华泰证券	2022022100035761	沃森生物	2022 年 2 月 21 日	561,456.00	11,200	14	3.400	742.37	-	-
华泰证券	2022022100037687	安克创新	2022 年 2 月 21 日	947,496.00	9,700	14	3.400	1,252.80	-	-
华泰证券	2022022100043357	宋城演艺	2022 年 2 月 21 日	303,690.00	19,100	14	3.400	401.55	-	-
华泰证券	2022022100043359	宋城演艺	2022 年 2 月 21 日	130,380.00	8,200	14	3.400	172.39	-	-
华泰证券	2022022100047301	康龙化成	2022 年 2 月 21 日	5,200,200.00	45,000	14	3.400	6,875.82	-	-
华泰证券	2022022100047307	阳光电源	2022 年 2 月 21 日	890,820.00	8,400	14	3.400	1,177.86	-	-
华泰证券	2022022100047311	华大基因	2022 年 2 月 21 日	706,080.00	8,000	14	3.400	933.59	-	-
华泰证券	2022022100047313	华大基因	2022 年 2 月 21 日	1,306,248.00	14,800	14	3.400	1,727.15	-	-
华泰证券	2022022100047315	华大基因	2022 年 2 月 21 日	353,040.00	4,000	14	3.400	466.80	-	-
华泰证券	2022022100047317	华大基因	2022 年 2 月 21 日	1,323,900.00	15,000	14	3.400	1,750.49	-	-
华泰证券	2022022100047319	华大基因	2022 年 2 月 21 日	132,390.00	1,500	14	3.400	175.05	-	-
华泰证券	2022022100047321	华大基因	2022 年 2 月 21 日	1,632,810.00	18,500	14	3.400	2,158.94	-	-
华泰证券	2022022100047323	东方财富	2022 年 2 月 21 日	7,845,000.00	300,000	14	3.400	10,372.83	-	-
华泰证券	2022022100047325	东方财富	2022 年 2 月 21 日	6,001,425.00	229,500	14	3.400	7,935.22	-	-
华泰证券	2022022100047329	亿纬锂能	2022 年 2 月 21 日	1,201,900.00	14,000	14	3.400	1,589.18	-	-
华泰证券	2022022100047335	华熙生物	2022 年 2 月 21 日	1,169,000.00	10,000	14	3.400	1,545.68	-	-
华泰证券	2022022100047351	温氏股份	2022 年 2 月 21 日	4,886,388.00	236,400	14	3.400	6,460.89	-	-
华泰证券	2022022200000463	晶盛机电	2022 年 2 月 22 日	120,200.00	2,000	14	3.400	158.93	-	-
华泰证券	2022022200011069	英科医疗	2022 年 2 月 22 日	87,159.00	1,700	14	3.400	115.24	-	-
华泰证券	2022022200011071	蓝思科技	2022 年 2 月 22 日	62,952.00	4,300	14	3.400	83.24	-	-
华泰证券	2022022200011075	英科医疗	2022 年 2 月 22 日	51,270.00	1,000	14	3.400	67.79	-	-
华泰证券	2022022200011081	沪硅产业	2022 年 2 月 22 日	903,200.00	40,000	14	3.400	1,194.23	-	-
华泰证券	2022022200011083	宋城演艺	2022 年 2 月 22 日	166,813.00	10,700	14	3.400	220.56	-	-
华泰证券	2022022200011085	宋城演艺	2022 年 2 月 22 日	626,718.00	40,200	14	3.400	828.66	-	-
华泰证券	2022022200011087	华大基因	2022 年 2 月 22 日	949,827.00	11,100	14	3.400	1,255.88	-	-
华泰证券	2022022200011091	华大基因	2022 年 2 月 22 日	616,104.00	7,200	14	3.400	814.63	-	-
华泰证券	2022022200011093	华大基因	2022 年 2 月 22 日	1,283,550.00	15,000	14	3.400	1,697.14	-	-
华泰证券	2022022200011095	华大基因	2022 年 2 月 22 日	256,710.00	3,000	14	3.400	339.43	-	-
华泰证券	2022022200011097	康龙化成	2022 年 2 月 22 日	558,110.00	4,900	14	3.400	737.95	-	-
华泰证券	2022022200011099	东方财富	2022 年 2 月 22 日	7,614,000.00	300,000	14	3.400	10,067.40	-	-
华泰证券	2022022200011101	汇川技术	2022 年 2 月 22 日	6,295,000.00	100,000	14	3.400	8,323.39	-	-
华泰证券	2022022300011588	蓝思科技	2022 年 2 月 23 日	169,232.00	11,200	14	3.400	223.76	-	-
华泰证券	2022022300011596	健帆生物	2022 年 2 月 23 日	84,438.00	1,800	14	3.400	111.65	-	-
华泰证券	2022022300013526	宋城演艺	2022 年 2 月 23 日	972,720.00	63,000	14	3.400	1,286.15	-	-
华泰证券	2022022300013530	先导智能	2022 年 2 月 23 日	4,897,697.00	76,300	14	3.400	6,475.84	-	-
华泰证券	2022022300013538	金山办公	2022 年 2 月 23 日	6,579,000.00	30,000	14	3.400	8,698.90	-	-

华泰证券	2022022300013544	沪硅产业	2022 年 2 月 23 日	4,766,000.00	200,000	14	3.400	6,301.71	-	-
华泰证券	2022021000013528	东方财富	2022 年 2 月 10 日	16,446,038.00	511,700	28	3.400	43,490.63	-	-
华泰证券	2022022400011333	金山办公	2022 年 2 月 24 日	4,153,000.00	20,000	14	3.600	5,814.20	-	-
华泰证券	2022022400011987	康龙化成	2022 年 2 月 24 日	10,008,264.00	86,100	14	3.400	13,233.15	-	-
华泰证券	2022022400011989	沪硅产业	2022 年 2 月 24 日	586,750.00	25,000	14	3.400	775.81	-	-
华泰证券	2022021100020144	东方财富	2022 年 2 月 11 日	3,173,000.00	100,000	28	3.400	8,390.82	-	-
华泰证券	2022022500018961	爱尔眼科	2022 年 2 月 25 日	321,958.00	9,100	14	3.400	425.70	-	-
华泰证券	2022022500018979	英科医疗	2022 年 2 月 25 日	500,247.00	9,900	14	3.400	661.44	-	-
华泰证券	2022021400003324	阳光电源	2022 年 2 月 14 日	3,890,106.00	40,700	28	3.400	10,287.17	-	-
华泰证券	2022022800003341	英科医疗	2022 年 2 月 28 日	850,418.00	16,600	14	3.400	1,124.44	-	-
华泰证券	2022030100001220	天合光能	2022 年 3 月 1 日	3,392,100.00	45,000	14	3.400	4,485.11	-	-
华泰证券	2022030200003459	英科医疗	2022 年 3 月 2 日	524,785.00	10,300	14	3.400	693.88	-	-
华泰证券	2022030300000777	天合光能	2022 年 3 月 3 日	8,382,000.00	110,000	14	3.400	11,082.87	-	-
华泰证券	2022030700036372	亿纬锂能	2022 年 3 月 7 日	1,047,060.00	14,000	14	3.400	1,384.45	-	-
华泰证券	2022030700036374	沃森生物	2022 年 3 月 7 日	486,304.00	11,200	14	3.400	643.00	-	-
华泰证券	2022030700036376	沃森生物	2022 年 3 月 7 日	1,189,708.00	27,400	14	3.400	1,573.06	-	-
华泰证券	2022030700036380	温氏股份	2022 年 3 月 7 日	4,893,480.00	236,400	14	3.400	6,470.27	-	-
华泰证券	2022030700036386	阳光电源	2022 年 3 月 7 日	1,040,928.00	8,400	14	3.400	1,376.34	-	-
华泰证券	2022030700036388	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	2,536,144.00	20,800	14	3.400	3,353.35	-	-
华泰证券	2022030700036390	汇川技术	2022 年 3 月 7 日	6,018,000.00	100,300	14	3.400	7,957.13	-	-
华泰证券	2022030700036392	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	3,731,058.00	30,600	14	3.400	4,933.29	-	-
华泰证券	2022030700036394	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	4,450,445.00	36,500	14	3.400	5,884.48	-	-
华泰证券	2022030700036676	康龙化成	2022 年 3 月 7 日	4,860,000.00	45,000	14	3.400	6,426.00	-	-
华泰证券	2022030700036678	华大基因	2022 年 3 月 7 日	1,214,784.00	14,800	14	3.400	1,606.21	-	-
华泰证券	2022030700036680	华大基因	2022 年 3 月 7 日	1,231,200.00	15,000	14	3.400	1,627.92	-	-
华泰证券	2022030700036684	华大基因	2022 年 3 月 7 日	1,518,480.00	18,500	14	3.400	2,007.77	-	-
华泰证券	2022030700036686	华大基因	2022 年 3 月 7 日	656,640.00	8,000	14	3.400	868.22	-	-
华泰证券	2022030700036690	华大基因	2022 年 3 月 7 日	328,320.00	4,000	14	3.400	434.11	-	-
华泰证券	2022030700036694	华大基因	2022 年 3 月 7 日	123,120.00	1,500	14	3.400	162.79	-	-
华泰证券	2022030700036696	泰格医药	2022 年 3 月 7 日	9,126,000.00	100,000	14	3.400	12,066.60	-	-
华泰证券	2022030700036700	华熙生物	2022 年 3 月 7 日	1,151,500.00	10,000	14	3.400	1,522.54	-	-
华泰证券	2022030700036710	欧普康视	2022 年 3 月 7 日	930,000.00	25,000	14	3.400	1,229.67	-	-
华泰证券	2022030700037856	英科医疗	2022 年 3 月 7 日	100,440.00	2,000	14	3.400	132.80	-	-
华泰证券	2022030700037858	东方财富	2022 年 3 月 7 日	7,464,000.00	300,000	14	3.400	9,869.07	-	-
华泰证券	2022030700037860	英科医疗	2022 年 3 月 7 日	190,836.00	3,800	14	3.400	252.33	-	-
华泰证券	2022030800012444	东方财富	2022 年 3 月 8 日	7,458,000.00	300,000	14	3.400	9,861.13	-	-
华泰证券	2022030800012956	汇川技术	2022 年 3 月 8 日	5,947,000.00	100,000	14	3.400	7,863.26	-	-
华泰证券	2022030800012966	蓝思科技	2022 年 3 月 8 日	56,674.00	4,300	14	3.400	74.94	-	-
华泰证券	2022030800012970	华大基因	2022 年 3 月 8 日	853,812.00	11,100	14	3.400	1,128.93	-	-
华泰证券	2022030800012972	沪硅产业	2022 年 3 月 8 日	936,000.00	40,000	14	3.400	1,237.60	-	-

华泰证券	2022030800012974	康龙化成	2022 年 3 月 8 日	523,124.00	4,900	14	3.400	691.69	-	-
华泰证券	2022030800012976	华大基因	2022 年 3 月 8 日	230,760.00	3,000	14	3.400	305.12	-	-
华泰证券	2022030800012978	华大基因	2022 年 3 月 8 日	1,153,800.00	15,000	14	3.400	1,525.58	-	-
华泰证券	2022030800012980	华大基因	2022 年 3 月 8 日	553,824.00	7,200	14	3.400	732.28	-	-
华泰证券	2022030800012984	晶盛机电	2022 年 3 月 8 日	120,880.00	2,000	14	3.400	159.83	-	-
华泰证券	2022030800012986	英科医疗	2022 年 3 月 8 日	48,050.00	1,000	14	3.400	63.53	-	-
华泰证券	2022030800012988	英科医疗	2022 年 3 月 8 日	81,685.00	1,700	14	3.400	108.01	-	-
华泰证券	2022030900015781	先导智能	2022 年 3 月 9 日	4,191,922.00	76,300	14	3.400	5,542.65	-	-
华泰证券	2022030900015785	宋城演艺	2022 年 3 月 9 日	846,720.00	63,000	14	3.400	1,119.55	-	-
华泰证券	2022030900018107	金山办公	2022 年 3 月 9 日	5,460,000.00	30,000	14	3.400	7,219.33	-	-
华泰证券	2022030900018111	蓝思科技	2022 年 3 月 9 日	143,248.00	11,200	14	3.400	189.41	-	-
华泰证券	2022030900018113	沪硅产业	2022 年 3 月 9 日	4,812,000.00	200,000	14	3.400	6,362.53	-	-
华泰证券	2022031000012554	沪硅产业	2022 年 3 月 10 日	637,500.00	25,000	14	3.400	842.92	-	-
华泰证券	2022031000013042	康龙化成	2022 年 3 月 10 日	9,056,859.00	86,100	14	3.400	11,975.18	-	-
华泰证券	2022031100016146	英科医疗	2022 年 3 月 11 日	483,813.00	9,900	14	3.400	639.71	-	-
华泰证券	2022030100001222	天合光能	2022 年 3 月 1 日	753,800.00	10,000	28	3.400	1,993.38	-	-
华泰证券	2022031500010183	天合光能	2022 年 3 月 15 日	3,199,500.00	45,000	14	3.400	4,230.45	-	-
华泰证券	2022030300000782	天合光能	2022 年 3 月 3 日	9,144,000.00	120,000	28	3.400	24,180.80	-	-
华泰证券	2022031700004902	天合光能	2022 年 3 月 17 日	7,493,200.00	110,000	14	3.400	9,907.68	-	-
华泰证券	2022030700037846	华大基因	2022 年 3 月 7 日	270,864.00	3,300	28	3.400	767.45	-	-
华泰证券	2022030700037852	英科医疗	2022 年 3 月 7 日	502,200.00	10,000	28	3.400	1,422.90	-	-
华泰证券	2022032100032895	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,322,084.00	14,800	14	3.400	1,997.82	-	-
华泰证券	2022032100032897	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,339,950.00	15,000	14	3.400	2,024.81	-	-
华泰证券	2022032100032899	华大基因	2022 年 3 月 21 日	357,320.00	4,000	14	3.400	539.95	-	-
华泰证券	2022032100032903	泰格医药	2022 年 3 月 21 日	9,437,000.00	100,000	14	3.400	14,260.36	-	-
华泰证券	2022032100032905	温氏股份	2022 年 3 月 21 日	4,978,584.00	236,400	14	3.400	7,523.19	-	-
华泰证券	2022032100033065	亿纬锂能	2022 年 3 月 21 日	1,195,600.00	14,000	14	3.400	1,806.68	-	-
华泰证券	2022032100033069	汇川技术	2022 年 3 月 21 日	5,777,280.00	100,300	14	3.400	8,730.11	-	-
华泰证券	2022032100033071	欧普康视	2022 年 3 月 21 日	911,500.00	25,000	14	3.400	1,377.38	-	-
华泰证券	2022032100033073	英科医疗	2022 年 3 月 21 日	98,120.00	2,000	14	3.400	148.27	-	-
华泰证券	2022032100033075	英科医疗	2022 年 3 月 21 日	186,428.00	3,800	14	3.400	281.71	-	-
华泰证券	2022032100035023	华熙生物	2022 年 3 月 21 日	1,154,200.00	10,000	14	3.400	1,744.12	-	-
华泰证券	2022032100035025	沃森生物	2022 年 3 月 21 日	1,641,260.00	27,400	14	3.400	2,480.13	-	-
华泰证券	2022032100035029	沃森生物	2022 年 3 月 21 日	670,880.00	11,200	14	3.400	1,013.77	-	-
华泰证券	2022032100035045	华大基因	2022 年 3 月 21 日	1,652,605.00	18,500	14	3.400	2,497.27	-	-
华泰证券	2022032100035047	华大基因	2022 年 3 月 21 日	714,640.00	8,000	14	3.400	1,079.90	-	-
华泰证券	2022032100035049	华大基因	2022 年 3 月 21 日	133,995.00	1,500	14	3.400	202.48	-	-
华泰证券	2022032200014275	华大基因	2022 年 3 月 22 日	1,263,150.00	15,000	14	3.400	1,789.46	-	-
华泰证券	2022032200014277	华大基因	2022 年 3 月 22 日	934,731.00	11,100	14	3.400	1,324.20	-	-
华泰证券	2022032200014281	华大基因	2022 年 3 月 22 日	606,312.00	7,200	14	3.400	858.94	-	-
华泰证券	2022032200014283	华大基因	2022 年 3 月 22 日	252,630.00	3,000	14	3.400	357.89	-	-
华泰证券	2022032200014285	汇川技术	2022 年 3 月 22 日	5,740,000.00	100,000	14	3.400	8,131.67	-	-

华泰证券	2022032200014293	沪硅产业	2022 年 3 月 22 日	1,004,400.00	40,000	14	3.400	1,422.90	-	-
华泰证券	2022032200014295	英科医疗	2022 年 3 月 22 日	47,800.00	1,000	14	3.400	67.72	-	-
华泰证券	2022032200014297	东方财富	2022 年 3 月 22 日	7,536,000.00	300,000	14	3.400	10,676.00	-	-
华泰证券	2022032200014299	英科医疗	2022 年 3 月 22 日	81,260.00	1,700	14	3.400	115.12	-	-
华泰证券	2022032200014301	晶盛机电	2022 年 3 月 22 日	124,000.00	2,000	14	3.400	175.67	-	-
华泰证券	2022032200014305	蓝思科技	2022 年 3 月 22 日	52,546.00	4,300	14	3.400	74.44	-	-
华泰证券	2022032300012491	先导智能	2022 年 3 月 23 日	4,619,202.00	76,300	14	3.400	6,107.61	-	-
华泰证券	2022032300012513	金山办公	2022 年 3 月 23 日	5,702,700.00	30,000	14	3.400	7,540.24	-	-
华泰证券	2022032300012515	沪硅产业	2022 年 3 月 23 日	4,954,000.00	200,000	14	3.400	6,550.29	-	-
华泰证券	2022032300012527	蓝思科技	2022 年 3 月 23 日	137,088.00	11,200	14	3.400	181.26	-	-
华泰证券	2022032400012803	沪硅产业	2022 年 3 月 24 日	601,250.00	25,000	14	3.400	794.99	-	-
华泰证券	2022032500018794	英科医疗	2022 年 3 月 25 日	455,202.00	9,900	14	3.400	601.88	-	-
华泰证券	2022033000000740	宋城演艺	2022 年 3 月 30 日	844,272.00	62,400	14	3.400	1,036.58	-	-
华泰证券	2022033100005960	天合光能	2022 年 3 月 31 日	7,068,000.00	120,000	28	3.400	8,010.40	-	-
华泰证券	2022033100005962	天合光能	2022 年 3 月 31 日	6,479,000.00	110,000	14	3.400	7,342.87	-	-
华泰证券	2022040600048665	沪硅产业	2022 年 4 月 6 日	885,600.00	40,000	14	3.400	1,170.96	-	-
华泰证券	2022040600048669	晶盛机电	2022 年 4 月 6 日	113,980.00	2,000	14	3.400	150.71	-	-
华泰证券	2022040600064091	温氏股份	2022 年 4 月 6 日	5,264,628.00	236,400	14	3.400	6,961.01	-	-
华泰证券	2022040600064093	华大基因	2022 年 4 月 6 日	1,513,485.00	18,500	14	3.400	2,001.16	-	-
华泰证券	2022040600064095	华大基因	2022 年 4 月 6 日	122,715.00	1,500	14	3.400	162.26	-	-
华泰证券	2022040600064097	华大基因	2022 年 4 月 6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.400	1,622.57	-	-
华泰证券	2022040600064099	华大基因	2022 年 4 月 6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.400	1,622.57	-	-
华泰证券	2022040600064101	华大基因	2022 年 4 月 6 日	327,240.00	4,000	14	3.400	432.68	-	-
华泰证券	2022040600064103	华大基因	2022 年 4 月 6 日	245,430.00	3,000	14	3.400	324.51	-	-
华泰证券	2022040600064105	华大基因	2022 年 4 月 6 日	908,091.00	11,100	14	3.400	1,200.70	-	-
华泰证券	2022040600064107	华大基因	2022 年 4 月 6 日	589,032.00	7,200	14	3.400	778.83	-	-
华泰证券	2022040600064109	华大基因	2022 年 4 月 6 日	654,480.00	8,000	14	3.400	865.37	-	-
华泰证券	2022040600064113	华大基因	2022 年 4 月 6 日	1,210,788.00	14,800	14	3.400	1,600.93	-	-
华泰证券	2022040600064119	金山办公	2022 年 4 月 6 日	5,542,800.00	30,000	14	3.400	7,328.81	-	-
华泰证券	2022040600065857	东方财富	2022 年 4 月 6 日	7,788,000.00	300,000	14	3.400	10,297.47	-	-
华泰证券	2022040600065859	蓝思科技	2022 年 4 月 6 日	49,751.00	4,300	14	3.400	65.78	-	-
华泰证券	2022040600065861	蓝思科技	2022 年 4 月 6 日	129,584.00	11,200	14	3.400	171.34	-	-
华泰证券	2022040600065863	亿纬锂能	2022 年 4 月 6 日	1,110,200.00	14,000	14	3.400	1,467.93	-	-
华泰证券	2022040600066089	沃森生物	2022 年 4 月 6 日	646,800.00	11,200	14	3.400	855.21	-	-
华泰证券	2022040600066091	沃森生物	2022 年 4 月 6 日	1,582,350.00	27,400	14	3.400	2,092.22	-	-
华泰证券	2022040600066097	先导智能	2022 年 4 月 6 日	4,129,356.00	76,300	14	3.400	5,459.93	-	-
华泰证券	2022040600066101	泰格医药	2022 年 4 月 6 日	10,588,000.00	100,000	14	3.400	13,999.69	-	-
华泰证券	2022040600066107	欧普康视	2022 年 4 月 6 日	881,250.00	25,000	14	3.400	1,165.21	-	-
华泰证券	2022040800014673	英科医疗	2022 年 4 月 8 日	441,738.00	9,900	14	3.400	584.08	-	-
华泰证券	2022041300010362	宋城演艺	2022 年 4 月 13 日	834,912.00	62,400	14	3.400	1,103.94	-	-
华泰证券	2022041400006337	天合光能	2022 年 4 月 14 日	5,320,700.00	110,000	14	3.400	7,035.15	-	-

华泰证券	2022040600000812	中国通号	2022 年 4 月 6 日	179,601.00	39,300	28	3.400	491.91	-	-
华泰证券	2022040600064111	华大基因	2022 年 4 月 6 日	269,973.00	3,300	28	3.400	739.43	-	-
华泰证券	2022042000000614	同花顺	2022 年 4 月 20 日	1,143,324.00	12,600	14	3.400	1,619.71	-	-
华泰证券	2022042000000616	华润微	2022 年 4 月 20 日	486,500.00	10,000	14	3.400	689.21	-	-
华泰证券	2022042000038494	温氏股份	2022 年 4 月 20 日	5,144,064.00	236,400	14	3.400	7,287.42	-	-
华泰证券	2022042000038496	华大基因	2022 年 4 月 20 日	584,560.00	8,000	14	3.400	828.13	-	-
华泰证券	2022042000038498	华大基因	2022 年 4 月 20 日	811,077.00	11,100	14	3.400	1,149.03	-	-
华泰证券	2022042000038500	华大基因	2022 年 4 月 20 日	109,605.00	1,500	14	3.400	155.27	-	-
华泰证券	2022042000038502	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,096,050.00	15,000	14	3.400	1,552.74	-	-
华泰证券	2022042000038504	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,351,795.00	18,500	14	3.400	1,915.04	-	-
华泰证券	2022042000038508	华大基因	2022 年 4 月 20 日	292,280.00	4,000	14	3.400	414.06	-	-
华泰证券	2022042000038510	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,096,050.00	15,000	14	3.400	1,552.74	-	-
华泰证券	2022042000038512	华大基因	2022 年 4 月 20 日	219,210.00	3,000	14	3.400	310.55	-	-
华泰证券	2022042000038514	华大基因	2022 年 4 月 20 日	526,104.00	7,200	14	3.400	745.31	-	-
华泰证券	2022042000038516	华大基因	2022 年 4 月 20 日	1,081,436.00	14,800	14	3.400	1,532.03	-	-
华泰证券	2022042000038864	东方财富	2022 年 4 月 20 日	6,183,000.00	300,000	14	3.400	8,759.25	-	-
华泰证券	2022042000038866	先导智能	2022 年 4 月 20 日	3,578,470.00	76,300	14	3.400	5,069.50	-	-
华泰证券	2022042000046432	沃森生物	2022 年 4 月 20 日	1,563,992.00	27,400	14	3.400	2,215.66	-	-
华泰证券	2022042000046436	沃森生物	2022 年 4 月 20 日	639,296.00	11,200	14	3.400	905.67	-	-
华泰证券	2022042000046438	金山办公	2022 年 4 月 20 日	5,454,000.00	30,000	14	3.400	7,726.50	-	-
华泰证券	2022042000046446	欧普康视	2022 年 4 月 20 日	873,750.00	25,000	14	3.400	1,237.81	-	-
华泰证券	2022042000046904	沪硅产业	2022 年 4 月 20 日	896,000.00	40,000	14	3.400	1,269.33	-	-
华泰证券	2022042200017046	英科医疗	2022 年 4 月 22 日	395,406.00	9,900	14	3.400	522.81	-	-
华泰证券	2022042700011717	宋城演艺	2022 年 4 月 27 日	760,032.00	62,400	14	3.400	1,004.93	-	-
华泰证券	20220428000006890	天合光能	2022 年 4 月 28 日	5,346,000.00	110,000	14	3.400	7,068.60	-	-
华泰证券	2022050500070241	华润微	2022 年 5 月 5 日	484,700.00	10,000	14	3.400	640.88	-	-
华泰证券	2022050500070243	华大基因	2022 年 5 月 5 日	1,193,620.00	18,500	14	3.400	1,578.23	-	-
华泰证券	2022050500070245	华大基因	2022 年 5 月 5 日	967,800.00	15,000	14	3.400	1,279.65	-	-
华泰证券	2022050500070247	华大基因	2022 年 5 月 5 日	954,896.00	14,800	14	3.400	1,262.58	-	-
华泰证券	2022050500070249	华大基因	2022 年 5 月 5 日	258,080.00	4,000	14	3.400	341.24	-	-
华泰证券	2022050500070253	华大基因	2022 年 5 月 5 日	716,172.00	11,100	14	3.400	946.94	-	-
华泰证券	2022050500070255	华大基因	2022 年 5 月 5 日	516,160.00	8,000	14	3.400	682.48	-	-
华泰证券	2022050500070261	华大基因	2022 年 5 月 5 日	96,780.00	1,500	14	3.400	127.96	-	-
华泰证券	2022050500070263	华大基因	2022 年 5 月 5 日	967,800.00	15,000	14	3.400	1,279.65	-	-
华泰证券	2022050500070269	华大基因	2022 年 5 月 5 日	193,560.00	3,000	14	3.400	255.93	-	-
华泰证券	2022050500070271	欧普康视	2022 年 5 月 5 日	928,250.00	25,000	14	3.400	1,227.35	-	-
华泰证券	2022050500070273	金山办公	2022 年 5 月 5 日	5,781,300.00	30,000	14	3.400	7,644.16	-	-
华泰证券	2022050500070287	东方财富	2022 年 5 月 5 日	6,720,000.00	300,000	14	3.400	8,885.33	-	-
华泰证券	2022050500070291	沃森生物	2022 年 5 月 5 日	1,413,292.00	27,400	14	3.400	1,868.69	-	-
华泰证券	2022050500070305	沃森生物	2022 年 5 月 5 日	577,696.00	11,200	14	3.400	763.84	-	-
华泰证券	2022050500070329	同花顺	2022 年 5 月 5 日	1,021,986.00	12,600	14	3.400	1,351.29	-	-
华泰证券	2022050500070333	沪硅产业	2022 年 5 月 5 日	846,000.00	40,000	14	3.400	1,118.60	-	-

华泰证券	2022050500070351	先导智能	2022 年 5 月 5 日	3,409,084.00	76,300	14	3.400	4,507.57	-	-
华泰证券	2022050600000395	爱美客	2022 年 5 月 6 日	3,022,720.00	6,400	14	3.400	3,996.71	-	-
华泰证券	2022050600014325	英科医疗	2022 年 5 月 6 日	274,824.00	9,900	14	3.400	363.38	-	-
华泰证券	2022051100008740	宋城演艺	2022 年 5 月 11 日	732,576.00	62,400	14	3.400	968.63	-	-
华泰证券	2022042800006892	天合光能	2022 年 4 月 28 日	5,832,000.00	120,000	28	3.400	15,422.40	-	-
华泰证券	2022051200008304	天合光能	2022 年 5 月 12 日	6,118,200.00	110,000	14	3.400	8,089.62	-	-
华泰证券	2022050500070251	华大基因	2022 年 5 月 5 日	212,916.00	3,300	28	3.400	563.04	-	-
华泰证券	2022050500070289	中国通号	2022 年 5 月 5 日	173,313.00	39,300	28	3.400	458.32	-	-
华泰证券	2022051900044979	东方财富	2022 年 5 月 19 日	6,651,000.00	300,000	14	3.400	8,794.10	-	-
华泰证券	2022051900044985	先导智能	2022 年 5 月 19 日	3,740,226.00	76,300	14	3.400	4,945.41	-	-
华泰证券	2022051900044993	金山办公	2022 年 5 月 19 日	6,228,000.00	30,000	14	3.400	8,234.80	-	-
华泰证券	2022051900045001	同花顺	2022 年 5 月 19 日	1,026,774.00	12,600	14	3.400	1,357.62	-	-
华泰证券	2022052300000531	欧普康视	2022 年 5 月 23 日	816,640.00	22,000	14	3.400	1,079.78	-	-
华泰证券	2022052400000820	欧普康视	2022 年 5 月 24 日	703,400.00	20,000	14	3.400	930.05	-	-
华泰证券	2022052700000410	石头科技	2022 年 5 月 27 日	5,659,900.00	10,000	14	3.400	7,483.65	-	-
华泰证券	2022053000000479	温氏股份	2022 年 5 月 30 日	38,852.00	2,200	14	3.400	51.37	-	-
华泰证券	2022053000000481	康泰生物	2022 年 5 月 30 日	5,993,417.00	95,300	14	3.400	7,924.63	-	-
华泰证券	2022060100000871	天合光能	2022 年 6 月 1 日	12,899,052.00	212,400	14	3.400	17,055.41	-	-
华泰证券	2022060200016756	同花顺	2022 年 6 月 2 日	1,072,386.00	12,600	14	3.400	1,417.93	-	-
华泰证券	2022060200022086	金山办公	2022 年 6 月 2 日	6,306,900.00	30,000	14	3.400	8,339.12	-	-
华泰证券	2022060200022094	先导智能	2022 年 6 月 2 日	3,918,005.00	76,300	14	3.400	5,180.47	-	-
华泰证券	2022060600000632	爱尔眼科	2022 年 6 月 6 日	1,025,451.00	28,700	14	3.400	1,355.87	-	-
华泰证券	2022060600009622	欧普康视	2022 年 6 月 6 日	1,004,300.00	22,000	14	3.400	1,327.91	-	-
华泰证券	2022060700008702	欧普康视	2022 年 6 月 7 日	886,000.00	20,000	14	3.400	1,171.49	-	-
华泰证券	2022060800000839	温氏股份	2022 年 6 月 8 日	9,130,000.00	500,000	14	3.400	12,071.89	-	-
华泰证券	2022061000004043	石头科技	2022 年 6 月 10 日	6,893,400.00	10,000	14	3.400	9,114.61	-	-
华泰证券	2022061300002227	天合光能	2022 年 6 月 13 日	3,913,000.00	65,000	14	3.400	5,173.86	-	-
华泰证券	2022061300002235	贝泰妮	2022 年 6 月 13 日	6,304,320.00	32,000	14	3.400	8,335.71	-	-
华泰证券	2022061300002237	中伟股份	2022 年 6 月 13 日	6,425,000.00	50,000	14	3.400	8,495.28	-	-
华泰证券	2022061300019249	康泰生物	2022 年 6 月 13 日	3,737,666.00	95,300	14	3.400	4,942.03	-	-
华泰证券	2022061500001692	亿联网络	2022 年 6 月 15 日	2,865,240.00	37,800	14	3.400	3,788.48	-	-
华泰证券	2022061500022653	天合光能	2022 年 6 月 15 日	11,735,100.00	212,400	14	3.400	15,516.41	-	-
华泰证券	2022061600014943	先导智能	2022 年 6 月 16 日	4,693,213.00	76,300	14	3.400	6,205.47	-	-
华泰证券	2022061600015563	金山办公	2022 年 6 月 16 日	6,212,100.00	30,000	14	3.400	8,213.78	-	-
华泰证券	2022061600015577	同花顺	2022 年 6 月 16 日	1,201,788.00	12,600	14	3.400	1,589.03	-	-
华泰证券	2022062000009933	华润微	2022 年 6 月 20 日	911,818.00	15,800	14	3.400	1,205.63	-	-
华泰证券	2022062000011958	欧普康视	2022 年 6 月 20 日	1,200,760.00	22,000	14	3.400	1,587.67	-	-
华泰证券	2022062000012290	爱尔眼科	2022 年 6 月 20 日	1,175,552.00	28,700	14	3.400	1,554.34	-	-
华泰证券	2022061500001693	同花顺	2022 年 6 月 15 日	180,810.00	1,800	28	3.400	358.61	173,070.00	358.61

华泰证券	2022061500001698	爱尔眼科	2022 年 6 月 15 日	5,354,240.00	142,400	28	3.400	10,619.24	6,375,248.00	10,619.24
华泰证券	2022062100009082	欧普康视	2022 年 6 月 21 日	1,065,400.00	20,000	14	3.400	1,408.70	1,143,800.00	1,408.70
华泰证券	2022062200000621	爱美客	2022 年 6 月 22 日	1,039,756.00	1,900	14	3.400	1,374.79	1,140,019.00	1,374.79
华泰证券	2022062200013491	温氏股份	2022 年 6 月 22 日	11,005,000.00	500,000	14	3.400	14,551.06	10,645,000.00	14,551.06
华泰证券	2022062400008692	石头科技	2022 年 6 月 24 日	6,410,000.00	10,000	14	3.400	7,264.67	6,167,000.00	7,264.67
华泰证券	2022062700015376	贝泰妮	2022 年 6 月 27 日	7,130,560.00	32,000	14	3.400	6,060.98	6,960,960.00	6,060.98
华泰证券	2022062700015378	中伟股份	2022 年 6 月 27 日	6,378,000.00	50,000	14	3.400	5,421.30	6,195,000.00	5,421.30
华泰证券	2022062700015382	天合光能	2022 年 6 月 27 日	4,386,850.00	65,000	14	3.400	3,728.82	4,241,250.00	3,728.82
华泰证券	2022062900001182	阳光电源	2022 年 6 月 29 日	8,832,390.00	95,900	14	3.400	5,839.19	9,422,175.00	5,839.19
华泰证券	2022062900024444	天合光能	2022 年 6 月 29 日	14,135,220.00	212,400	14	3.400	9,344.95	13,859,100.00	9,344.95
华泰证券	2022063000016007	先导智能	2022 年 6 月 30 日	4,820,634.00	76,300	14	3.400	2,731.69	4,820,634.00	2,731.69
华泰证券	2022063000016009	同花顺	2022 年 6 月 30 日	1,211,490.00	12,600	14	3.400	686.51	1,211,490.00	686.51
上年度可比期间										
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位: 股)	出借期限 (单位: 天)	费率 (%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2021010400000197	东方财富	2021 年 01 月 04 日	27,370,000.00	850,000	14	5.400	57,477.00	-	-
华泰证券	2021010400013120	亿纬锂能	2021 年 01 月 04 日	14,612,487.00	156,300	14	3.400	19,320.96	-	-
华泰证券	2021010500000360	沃森生物	2021 年 01 月 05 日	152,120.00	4,000	14	3.400	201.14	-	-
华泰证券	2021010500010640	沃森生物	2021 年 01 月 05 日	76,060.00	2,000	14	3.400	100.57	-	-
华泰证券	2021010500010642	沃森生物	2021 年 01 月 05 日	950,750.00	25,000	14	4.400	1,626.84	-	-
华泰证券	2021010600000415	蓝思科技	2021 年 01 月 06 日	311,322.00	8,900	14	3.400	411.64	-	-
华泰证券	2021010600007229	蓝思科技	2021 年 01 月 06 日	1,626,570.00	46,500	14	4.400	2,783.24	-	-
华泰证券	2021010600007919	沃森生物	2021 年 01 月 06 日	579,900.00	15,000	14	3.400	766.76	-	-
华泰证券	2021010700011772	沃森生物	2021 年 01 月 07 日	4,661,125.00	122,500	14	3.400	6,163.04	-	-
华泰证券	2021010700011774	东方财富	2021 年 01 月 07 日	728,700.00	21,000	14	4.400	1,246.89	-	-
华泰证券	2021011100008228	泰格医药	2021 年 01 月 11 日	2,885,400.00	17,500	14	3.400	3,815.14	-	-
华泰证券	2021011100008992	蓝思科技	2021 年 01 月 11 日	1,295,000.00	35,000	14	3.400	1,712.28	-	-
华泰证券	2021011100008994	蓝思科技	2021 年 01 月 11 日	518,000.00	14,000	14	3.400	684.91	-	-
华泰证券	2021011200006485	蓝思科技	2021 年 01 月 12 日	56,025.00	1,500	14	3.400	74.08	-	-

华泰证券	2021011500000417	蓝思科技	2021 年 01 月 15 日	3,095,001.00	81,900	14	6.400	7,703.11	-	-
华泰证券	2021011500000421	亿纬锂能	2021 年 01 月 15 日	644,000.00	7,000	14	4.400	1,101.96	-	-
华泰证券	2021010400000191	同花顺	2021 年 01 月 04 日	1,134,270.00	9,000	28	4.400	3,881.72	-	-
华泰证券	2021010400000195	东方财富	2021 年 01 月 04 日	15,134,000.00	470,000	28	5.400	63,562.80	-	-
华泰证券	2021011800000218	东方财富	2021 年 01 月 18 日	32,113,000.00	850,000	14	5.400	67,437.30	-	-
华泰证券	2021011800009332	亿纬锂能	2021 年 01 月 18 日	14,707,830.00	156,300	14	3.400	19,447.02	-	-
华泰证券	2021010500000358	东方财富	2021 年 01 月 05 日	45,402.00	1,400	28	3.400	120.06	-	-
华泰证券	2021010500000362	沃森生物	2021 年 01 月 05 日	1,064,840.00	28,000	28	3.400	2,815.91	-	-
华泰证券	2021011900000165	华大基因	2021 年 01 月 19 日	624,204.00	4,200	14	4.400	1,068.08	-	-
华泰证券	2021012000000224	东方财富	2021 年 01 月 20 日	524,300.00	14,000	14	4.400	897.14	-	-
华泰证券	2021012000005916	蓝思科技	2021 年 01 月 20 日	1,807,920.00	46,500	14	4.400	3,093.55	-	-
华泰证券	2021012000005918	蓝思科技	2021 年 01 月 20 日	346,032.00	8,900	14	3.400	457.53	-	-
华泰证券	2021012100000315	华大基因	2021 年 01 月 21 日	1,163,400.00	7,000	14	3.400	1,538.27	-	-
华泰证券	2021012100012311	沃森生物	2021 年 01 月 21 日	4,575,375.00	122,500	14	3.400	6,049.66	-	-
华泰证券	2021012100012313	东方财富	2021 年 01 月 21 日	833,280.00	21,000	14	4.400	1,425.83	-	-
华泰证券	2021012200000351	华大基因	2021 年 01 月 22 日	1,993,712.00	11,200	14	5.400	4,186.80	-	-
华泰证券	2021011100000305	澜起科技	2021 年 01 月 11 日	18,164,000.00	200,000	28	3.400	48,033.69	-	-
华泰证券	2021012500000264	智飞生物	2021 年 01 月 25 日	918,500.00	5,500	14	3.400	1,214.46	-	-
华泰证券	2021012500008568	蓝思科技	2021 年 01 月 25 日	496,720.00	14,000	14	3.400	656.77	-	-
华泰证券	2021012500008570	蓝思科技	2021 年 01 月 25 日	1,241,800.00	35,000	14	3.400	1,641.94	-	-
华泰证券	2021012500008766	泰格医药	2021 年 01 月 25 日	3,351,425.00	17,500	14	3.400	4,431.33	-	-
华泰证券	2021012600006530	蓝思科技	2021 年 01 月 26 日	52,665.00	1,500	14	3.400	69.63	-	-
华泰证券	2021011500000419	亿纬锂能	2021 年 01 月 15 日	1,932,000.00	21,000	28	4.400	8,028.53	-	-
华泰证券	2021011800000287	中国通号	2021 年 01 月 18 日	2,999,934.00	492,600	28	2.000	5,166.55	-	-
华泰证券	2021011800000289	亿纬锂能	2021 年 01 月 18 日	1,646,750.00	17,500	28	4.400	6,239.35	-	-
华泰证券	2021011900007934	亿纬锂能	2021 年 01 月 19 日	960,750.00	10,500	28	4.400	3,522.75	-	-
华泰证券	2021012000000220	亿纬锂能	2021 年 01 月 20 日	8,400,938.00	80,600	28	4.400	29,776.66	-	-
华泰证券	2021012000000222	智飞生物	2021 年 01 月 20 日	3,978,800.00	28,000	28	4.400	14,102.64	-	-
华泰证券	2021012900001805	亿纬锂能	2021 年 01 月 29 日	745,500.00	7,000	14	4.400	1,822.33	-	-
华泰证券	2021012900001807	蓝思科技	2021 年 01 月 29 日	2,735,460.00	81,900	14	6.400	9,726.08	-	-
华泰证券	2021020100000238	东方财富	2021 年 02 月 01 日	186,576.00	5,200	14	4.400	387.66	-	-
华泰证券	2021020100009316	东方财富	2021 年 02 月 01 日	30,498,000.00	850,000	14	5.400	77,769.90	-	-
华泰证券	2021020100009320	亿纬锂能	2021 年 02 月 01 日	16,072,329.00	156,300	14	3.400	25,805.02	-	-
华泰证券	2021020200000375	沃森生物	2021 年 02 月 02 日	600,990.00	13,800	14	4.400	1,175.27	-	-
华泰证券	20210202000008615	华大基因	2021 年 02 月 02 日	613,116.00	4,200	14	4.400	1,198.98	-	-
华泰证券	2021020300006532	东方财富	2021 年 02 月 03 日	494,760.00	14,000	14	4.400	907.06	-	-
华泰证券	2021020300006818	蓝思科技	2021 年 02 月 03 日	1,442,895.00	46,500	14	4.400	2,645.31	-	-
华泰证券	2021020400013799	沃森生物	2021 年 02 月 04 日	5,258,925.00	122,500	14	3.400	6,953.47	-	-
华泰证券	2021020400013801	东方财富	2021 年 02 月 04 日	743,190.00	21,000	14	4.400	1,271.68	-	-
华泰证券	2021020800000380	乐普医疗	2021 年 02 月 08 日	1,668,744.00	53,900	14	3.400	2,206.45	-	-
华泰证券	2021020800008536	泰格医药	2021 年 02 月 08 日	3,253,425.00	17,500	14	3.400	4,301.75	-	-
华泰证券	2021012600006182	沃森生物	2021 年 01 月 26 日	280,140.00	7,000	28	4.400	958.70	-	-

华泰证券	202102090000451	传音控股	2021 年 02 月 09 日	637,520.00	2,600	14	3.800	942.11	-	-
华泰证券	2021012700000576	中国通号	2021 年 01 月 27 日	2,727,244.00	465,400	28	2.000	4,242.38	-	-
华泰证券	2021012800009720	东方财富	2021 年 01 月 28 日	506,800.00	14,000	28	4.400	1,734.38	-	-
华泰证券	2021012900000184	沃森生物	2021 年 01 月 29 日	546,480.00	13,800	28	5.400	2,295.22	-	-
华泰证券	2021020100000240	华大基因	2021 年 02 月 01 日	435,860.00	3,100	28	4.400	1,491.61	-	-
华泰证券	2021020100009318	东方财富	2021 年 02 月 01 日	16,863,600.00	470,000	28	5.400	70,827.12	-	-
华泰证券	2021020200000377	同花顺	2021 年 02 月 02 日	456,475.00	3,100	28	4.400	1,562.16	-	-
华泰证券	2021020200000379	乐普医疗	2021 年 02 月 02 日	433,048.00	14,800	28	4.400	1,481.99	-	-
华泰证券	2021020200009125	沃森生物	2021 年 02 月 02 日	1,219,400.00	28,000	28	3.400	3,224.64	-	-
华泰证券	2021020200009127	东方财富	2021 年 02 月 02 日	51,590.00	1,400	28	3.400	136.43	-	-
华泰证券	2021020400000303	康泰生物	2021 年 02 月 04 日	434,520.00	2,400	28	5.400	1,824.98	-	-
华泰证券	2021021800000877	智飞生物	2021 年 02 月 18 日	703,259.00	3,700	14	4.400	1,203.35	-	-
华泰证券	2021021800000881	沃森生物	2021 年 02 月 18 日	1,314,873.00	24,300	14	4.400	2,249.89	-	-
华泰证券	2021021800000883	蓝思科技	2021 年 02 月 18 日	675,990.00	21,000	14	4.400	1,156.69	-	-
华泰证券	2021021800040046	亿纬锂能	2021 年 02 月 18 日	16,192,680.00	156,300	14	3.400	21,410.32	-	-
华泰证券	2021021800041546	沃森生物	2021 年 02 月 18 日	6,628,475.00	122,500	14	3.400	8,764.32	-	-
华泰证券	2021021900000537	温氏股份	2021 年 02 月 19 日	1,201,959.00	63,900	14	3.400	1,589.26	-	-
华泰证券	2021021900001423	同花顺	2021 年 02 月 19 日	1,523,018.00	9,800	14	3.400	2,013.77	-	-
华泰证券	2021020800007670	澜起科技	2021 年 02 月 08 日	19,100,000.00	200,000	28	3.400	50,508.89	-	-
华泰证券	2021022300000207	乐普医疗	2021 年 02 月 23 日	1,060,076.00	33,200	14	3.400	1,401.66	-	-
华泰证券	2021030100000244	爱尔眼科	2021 年 03 月 01 日	1,284,825.00	18,500	14	3.400	1,698.82	-	-
华泰证券	2021030100000246	同花顺	2021 年 03 月 01 日	1,112,211.00	8,100	14	3.400	1,470.59	-	-
华泰证券	2021030100000247	东方财富	2021 年 03 月 01 日	1,369,121.00	43,700	14	3.400	1,810.28	-	-
华泰证券	2021030200000190	蓝思科技	2021 年 03 月 02 日	504,966.00	15,400	14	3.400	667.68	-	-
华泰证券	2021030200000192	亿纬锂能	2021 年 03 月 02 日	5,879,720.00	64,400	14	3.400	7,774.30	-	-
华泰证券	2021021800000879	爱尔眼科	2021 年 02 月 18 日	2,738,044.00	31,100	28	3.400	7,240.61	-	-
华泰证券	2021021800040040	中国通号	2021 年 02 月 18 日	2,748,708.00	492,600	28	2.000	4,275.77	-	-
华泰证券	2021021800041548	智飞生物	2021 年 02 月 18 日	5,321,960.00	28,000	28	4.400	18,212.93	-	-
华泰证券	2021021800041550	亿纬锂能	2021 年 02 月 18 日	2,175,600.00	21,000	28	4.400	7,445.39	-	-
华泰证券	2021030500000410	康泰生物	2021 年 03 月 05 日	1,541,916.00	10,800	14	3.400	2,038.76	-	-
华泰证券	2021030500000416	泰格医药	2021 年 03 月 05 日	1,621,155.00	11,500	14	3.400	2,143.53	-	-
华泰证券	20210223000006710	沃森生物	2021 年 02 月 23 日	360,850.00	7,000	28	4.400	1,234.91	-	-
华泰证券	2021022400006458	中国通号	2021 年 02 月 24 日	2,722,590.00	465,400	28	2.000	4,235.14	-	-
华泰证券	2021022500000588	中国通号	2021 年 02 月 25 日	189,120.00	32,000	28	1.800	264.77	-	-
华泰证券	2021031100000307	智飞生物	2021 年 03 月 11 日	159,000.00	1,000	14	3.400	210.23	-	-
华泰证券	20210226000003840	沃森生物	2021 年 02 月 26 日	632,178.00	13,800	28	5.400	2,655.15	-	-
华泰证券	2021031200000271	智飞生物	2021 年 03 月 12 日	1,526,760.00	9,000	14	3.400	2,018.72	-	-
华泰证券	2021030200004713	同花顺	2021 年 03 月 02 日	397,420.00	3,100	28	4.400	1,360.06	-	-
华泰证券	2021030200004715	东方财富	2021 年 03 月 02 日	43,022.00	1,400	28	3.400	113.77	-	-
华泰证券	2021030200004837	沃森生物	2021 年 03 月 02 日	1,278,480.00	28,000	28	3.400	3,380.87	-	-
华泰证券	2021030200004839	乐普医疗	2021 年 03 月 02 日	459,984.00	14,800	28	4.400	1,574.17	-	-
华泰证券	2021031600006418	亿纬锂能	2021 年 03 月 16 日	5,267,920.00	64,400	14	3.400	6,965.36	-	-

华泰证券	2021030300000704	信维通信	2021 年 03 月 03 日	420,000.00	12,500	28	3.400	1,110.67	-	-
华泰证券	2021030300000706	沃森生物	2021 年 03 月 03 日	1,625,900.00	35,500	28	3.400	4,299.60	-	-
华泰证券	2021030300000708	爱尔眼科	2021 年 03 月 03 日	6,208,466.00	90,200	28	3.400	16,417.94	-	-
华泰证券	2021031900000191	泰格医药	2021 年 03 月 19 日	1,516,620.00	11,500	14	3.400	2,005.31	-	-
华泰证券	2021030800009001	澜起科技	2021 年 03 月 08 日	14,900,000.00	200,000	28	3.400	40,809.44	-	-
华泰证券	2021030900000367	华大基因	2021 年 03 月 09 日	1,854,930.00	15,400	28	3.400	4,905.26	-	-
华泰证券	2021030900000369	爱尔眼科	2021 年 03 月 09 日	4,766,817.00	87,900	28	1.800	6,673.54	-	-
华泰证券	2021031000000164	中国通号	2021 年 03 月 10 日	265,080.00	47,000	28	1.800	371.11	-	-
华泰证券	2021031000000166	华大基因	2021 年 03 月 10 日	565,551.00	4,700	28	3.400	1,495.57	-	-
华泰证券	2021031100000309	智飞生物	2021 年 03 月 11 日	1,113,000.00	7,000	28	3.400	2,943.27	-	-
华泰证券	2021031100000310	华大基因	2021 年 03 月 11 日	169,960.00	1,400	28	3.400	449.45	-	-
华泰证券	2021040200000265	东方财富	2021 年 04 月 02 日	34,644,000.00	1,200,000	7	3.400	22,903.53	-	-
华泰证券	2021031600000626	智飞生物	2021 年 03 月 16 日	2,323,300.00	14,000	28	3.400	6,143.84	-	-
华泰证券	2021033000008607	亿纬锂能	2021 年 03 月 30 日	4,810,680.00	64,400	14	3.400	6,360.79	-	-
华泰证券	2021031700000620	亿纬锂能	2021 年 03 月 17 日	593,600.00	7,000	28	3.400	1,569.74	-	-
华泰证券	2021031800030404	亿纬锂能	2021 年 03 月 18 日	1,782,900.00	21,000	28	4.400	6,101.48	-	-
华泰证券	2021031800035262	爱尔眼科	2021 年 03 月 18 日	1,873,775.00	31,100	28	3.400	4,955.09	-	-
华泰证券	2021031800035264	智飞生物	2021 年 03 月 18 日	4,922,400.00	28,000	28	4.400	16,845.55	-	-
华泰证券	2021031900000189	智飞生物	2021 年 03 月 19 日	2,361,800.00	14,000	28	3.400	6,245.65	-	-
华泰证券	20210324000006250	中国通号	2021 年 03 月 24 日	2,657,434.00	465,400	28	2.000	4,133.79	-	-
华泰证券	2021040700000297	芒果超媒	2021 年 04 月 07 日	685,190.00	11,000	14	3.400	905.97	-	-
华泰证券	2021032500000472	亿纬锂能	2021 年 03 月 25 日	373,410.00	5,400	28	3.400	987.46	-	-
华泰证券	20210325000006340	中国通号	2021 年 03 月 25 日	181,120.00	32,000	28	1.800	253.57	-	-
华泰证券	2021032600000331	亿纬锂能	2021 年 03 月 26 日	3,005,200.00	40,000	28	3.400	7,947.08	-	-
华泰证券	2021033000008601	东方财富	2021 年 03 月 30 日	39,130.00	1,400	28	3.400	103.48	-	-
华泰证券	2021033000008603	沃森生物	2021 年 03 月 30 日	1,302,280.00	28,000	28	3.400	3,443.81	-	-
华泰证券	2021033000008605	乐普医疗	2021 年 03 月 30 日	430,532.00	14,800	28	4.400	1,473.38	-	-
华泰证券	2021033000008845	同花顺	2021 年 03 月 30 日	383,501.00	3,100	28	4.400	1,312.43	-	-
华泰证券	2021033000009175	同花顺	2021 年 03 月 30 日	3,720.00	-	28	4.400	-	-	-
华泰证券	2021041300007917	亿纬锂能	2021 年 04 月 13 日	4,482,240.00	64,400	14	3.400	5,926.52	-	-
华泰证券	20210423000006120	东方财富	2021 年 03 月 30 日	770.45	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021033100006114	沃森生物	2021 年 03 月 31 日	1,604,245.00	35,500	28	3.400	4,242.34	-	-
华泰证券	2021033100006766	信维通信	2021 年 03 月 31 日	354,875.00	12,500	28	3.400	938.45	-	-
华泰证券	2021040600016598	爱尔眼科	2021 年 04 月 06 日	5,534,184.00	87,900	28	1.800	8,301.28	-	-
华泰证券	2021040700008547	中国通号	2021 年 04 月 07 日	269,310.00	47,000	28	1.800	390.50	-	-
华泰证券	2021040800004889	华大基因	2021 年 04 月 08 日	170,646.00	1,400	28	3.400	451.26	-	-
华泰证券	2021040800005125	智飞生物	2021 年 04 月 08 日	1,326,500.00	7,000	28	3.400	3,507.86	-	-
华泰证券	2021041900000468	沃森生物	2021 年 04 月 19 日	843,972.00	15,900	14	3.400	1,355.04	-	-
华泰证券	2021042000000929	东方财富	2021 年 04 月 20 日	988,696.00	33,200	14	3.400	1,494.03	-	-
华泰证券	2021042000000931	澜起科技	2021 年 04 月 20 日	10,035,000.00	150,000	14	3.400	15,164.00	-	-
华泰证券	2021041300008407	智飞生物	2021 年 04 月 13 日	2,528,400.00	14,000	28	3.400	6,686.21	-	-
华泰证券	2021042700011518	亿纬锂能	2021 年 04 月 27 日	5,302,696.00	64,400	14	3.400	7,011.34	-	-

华泰证券	202104140000188	宋城演艺	2021 年 04 月 14 日	232,560.00	11,400	28	3.400	614.99	-	-
华泰证券	202104140000190	健帆生物	2021 年 04 月 14 日	435,855.00	4,900	28	3.400	1,152.59	-	-
华泰证券	2021051100011594	健帆生物	2021 年 04 月 14 日	3,234.00	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021041500000208	智飞生物	2021 年 04 月 15 日	1,265,600.00	7,000	28	3.400	3,346.81	-	-
华泰证券	2021041500030086	智飞生物	2021 年 04 月 15 日	5,062,400.00	28,000	28	4.400	17,324.66	-	-
华泰证券	2021041500031038	爱尔眼科	2021 年 04 月 15 日	1,858,225.00	31,100	28	3.400	4,913.97	-	-
华泰证券	2021042900000355	沃森生物	2021 年 04 月 29 日	669,978.00	11,400	14	3.400	885.86	-	-
华泰证券	2021042100007957	中国通号	2021 年 04 月 21 日	2,671,396.00	465,400	28	2.000	4,155.50	-	-
华泰证券	2021042200000358	康泰生物	2021 年 04 月 22 日	451,825.00	3,100	28	3.400	1,194.83	-	-
华泰证券	2021042200007384	中国通号	2021 年 04 月 22 日	184,000.00	32,000	28	1.800	257.60	-	-
华泰证券	2021050600000539	宋城演艺	2021 年 05 月 06 日	26,728.00	1,300	14	3.400	35.34	-	-
华泰证券	2021050600000541	沃森生物	2021 年 05 月 06 日	3,902,500.00	70,000	14	3.400	5,159.97	-	-
华泰证券	2021050600000543	温氏股份	2021 年 05 月 06 日	28,340.00	2,000	14	3.400	37.47	-	-
华泰证券	2021050600000545	蓝思科技	2021 年 05 月 06 日	28,391.00	1,100	14	3.400	37.54	-	-
华泰证券	2021050600000547	乐普医疗	2021 年 05 月 06 日	31,000.00	1,000	14	3.400	40.99	-	-
华泰证券	2021051800002985	沃森生物	2021 年 05 月 06 日	3,500.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021042300005720	亿纬锂能	2021 年 04 月 23 日	3,424,000.00	40,000	28	3.400	9,054.58	-	-
华泰证券	2021050700000312	乐普医疗	2021 年 05 月 07 日	29,950.00	1,000	14	3.400	39.60	-	-
华泰证券	2021050700000314	宋城演艺	2021 年 05 月 07 日	25,285.00	1,300	14	3.400	33.43	-	-
华泰证券	2021050700000316	温氏股份	2021 年 05 月 07 日	28,340.00	2,000	14	3.400	37.47	-	-
华泰证券	2021042600000637	亿纬锂能	2021 年 04 月 26 日	591,990.00	7,000	28	3.400	1,565.48	-	-
华泰证券	2021051000000279	温氏股份	2021 年 05 月 10 日	27,400.00	2,000	14	3.400	36.23	-	-
华泰证券	2021051000000281	宋城演艺	2021 年 05 月 10 日	25,740.00	1,300	14	3.400	34.03	-	-
华泰证券	2021051000000283	乐普医疗	2021 年 05 月 10 日	30,030.00	1,000	14	3.400	39.71	-	-
华泰证券	2021042700000282	同花顺	2021 年 04 月 27 日	389,130.00	3,500	28	3.400	1,029.03	-	-
华泰证券	2021042700011436	同花顺	2021 年 04 月 27 日	344,658.00	3,100	28	4.400	1,179.50	-	-
华泰证券	2021042700011438	东方财富	2021 年 04 月 27 日	42,294.00	1,400	28	3.400	111.84	-	-
华泰证券	2021042700011516	沃森生物	2021 年 04 月 27 日	1,727,320.00	28,000	28	3.400	4,567.80	-	-
华泰证券	2021051100000448	温氏股份	2021 年 05 月 11 日	27,580.00	2,000	14	3.400	36.47	-	-
华泰证券	2021051100000452	宋城演艺	2021 年 05 月 11 日	25,454.00	1,300	14	3.400	33.66	-	-
华泰证券	2021051100000454	乐普医疗	2021 年 05 月 11 日	30,410.00	1,000	14	3.400	40.21	-	-
华泰证券	2021051100009773	亿纬锂能	2021 年 05 月 11 日	5,569,312.00	64,400	14	3.400	7,363.87	-	-
华泰证券	2021051800002994	沃森生物	2021 年 04 月 27 日	1,400.00	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052400006948	亿纬锂能	2021 年 05 月 11 日	1,610.34	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021042800009122	信维通信	2021 年 04 月 28 日	350,625.00	12,500	28	3.400	927.21	-	-
华泰证券	2021042800010642	沃森生物	2021 年 04 月 28 日	2,180,765.00	35,500	28	3.400	5,766.91	-	-
华泰证券	2021051200000590	康泰生物	2021 年 05 月 12 日	2,312,604.00	12,600	14	3.400	3,057.78	-	-
华泰证券	2021051200000592	温氏股份	2021 年 05 月 12 日	27,960.00	2,000	14	3.400	36.97	-	-
华泰证券	2021051200000594	乐普医疗	2021 年 05 月 12 日	30,480.00	1,000	14	3.400	40.30	-	-
华泰证券	2021051200000596	宋城演艺	2021 年 05 月 12 日	24,570.00	1,300	14	3.400	32.49	-	-
华泰证券	2021051200000598	三环集团	2021 年 05 月 12 日	36,420.00	1,000	14	3.400	48.16	-	-
华泰证券	2021051800002984	沃森生物	2021 年 04 月 28 日	1,775.00	-	28	3.400	-	-	-

华泰证券	202105130000355	温氏股份	2021 年 05 月 13 日	19,292.00	1,400	14	3.400	25.51	-	-
华泰证券	202105130000357	三环集团	2021 年 05 月 13 日	35,900.00	1,000	14	3.400	47.47	-	-
华泰证券	202105130000359	乐普医疗	2021 年 05 月 13 日	30,430.00	1,000	14	3.400	40.24	-	-
华泰证券	202105130000361	沃森生物	2021 年 05 月 13 日	555,408.00	8,700	14	3.400	734.37	-	-
华泰证券	202105130000363	信维通信	2021 年 05 月 13 日	25,520.00	1,000	14	3.400	33.74	-	-
华泰证券	202105130000365	同花顺	2021 年 05 月 13 日	2,830,575.00	27,500	14	3.400	3,742.65	-	-
华泰证券	2021051300025172	沃森生物	2021 年 05 月 13 日	727,776.00	11,400	14	3.400	962.28	-	-
华泰证券	2021051800002814	沃森生物	2021 年 05 月 13 日	570.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051800002831	沃森生物	2021 年 05 月 13 日	435.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051700000478	温氏股份	2021 年 05 月 17 日	14,030.00	1,000	14	3.400	18.55	-	-
华泰证券	2021051700000480	三环集团	2021 年 05 月 17 日	38,000.00	1,000	14	3.400	50.24	-	-
华泰证券	2021051700000482	沃森生物	2021 年 05 月 17 日	1,470,000.00	21,000	14	3.400	1,943.67	-	-
华泰证券	2021051800002781	沃森生物	2021 年 05 月 17 日	1,050.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051800000304	三环集团	2021 年 05 月 18 日	37,400.00	1,000	14	3.400	49.45	-	-
华泰证券	2021051800000306	信维通信	2021 年 05 月 18 日	26,600.00	1,000	14	3.400	35.17	-	-
华泰证券	2021051800000308	沃森生物	2021 年 05 月 18 日	144,501.00	2,100	14	3.400	191.06	-	-
华泰证券	2021051800002773	沃森生物	2021 年 05 月 18 日	105.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021050600028126	中国通号	2021 年 05 月 06 日	264,140.00	47,000	28	1.800	369.80	-	-
华泰证券	2021050600028128	爱尔眼科	2021 年 05 月 06 日	6,363,081.00	87,900	28	1.800	8,908.31	-	-
华泰证券	2021050600029208	华大基因	2021 年 05 月 06 日	170,030.00	1,400	28	3.400	449.63	-	-
华泰证券	2021052000000391	信维通信	2021 年 05 月 20 日	26,800.00	1,000	14	3.400	35.44	-	-
华泰证券	2021052000016849	温氏股份	2021 年 05 月 20 日	28,200.00	2,000	14	3.400	37.29	-	-
华泰证券	2021052000016851	宋城演艺	2021 年 05 月 20 日	23,881.00	1,300	14	3.400	31.58	-	-
华泰证券	2021052000016853	乐普医疗	2021 年 05 月 20 日	32,190.00	1,000	14	3.400	42.56	-	-
华泰证券	2021052000017059	沃森生物	2021 年 05 月 20 日	4,818,800.00	70,000	14	3.400	6,371.52	-	-
华泰证券	2021052000017061	蓝思科技	2021 年 05 月 20 日	30,998.00	1,100	14	3.400	40.99	-	-
华泰证券	2021060100002817	宋城演艺	2021 年 05 月 20 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052100000363	汇川技术	2021 年 05 月 21 日	273,450.00	3,000	14	3.400	361.56	-	-
华泰证券	2021052100005938	温氏股份	2021 年 05 月 21 日	27,560.00	2,000	14	3.400	36.44	-	-
华泰证券	2021052100005940	乐普医疗	2021 年 05 月 21 日	31,730.00	1,000	14	3.400	41.95	-	-
华泰证券	2021052100005942	宋城演艺	2021 年 05 月 21 日	23,582.00	1,300	14	3.400	31.18	-	-
华泰证券	2021060100002771	宋城演艺	2021 年 05 月 21 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060300011971	汇川技术	2021 年 05 月 21 日	1,080.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060300012131	汇川技术	2021 年 05 月 21 日	-	1,500	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052400005448	温氏股份	2021 年 05 月 24 日	27,380.00	2,000	14	3.400	36.20	-	-
华泰证券	2021052400005450	宋城演艺	2021 年 05 月 24 日	23,647.00	1,300	14	3.400	31.27	-	-
华泰证券	2021052400005452	乐普医疗	2021 年 05 月 24 日	31,220.00	1,000	14	3.400	41.28	-	-
华泰证券	2021060100002775	宋城演艺	2021 年 05 月 24 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051100009775	智飞生物	2021 年 05 月 11 日	2,937,480.00	14,000	28	3.400	7,768.00	-	-
华泰证券	2021052500008938	宋城演艺	2021 年 05 月 25 日	23,998.00	1,300	14	3.400	31.73	-	-
华泰证券	2021052500008940	亿纬锂能	2021 年 05 月 25 日	6,909,476.00	64,400	14	3.400	9,135.86	-	-
华泰证券	2021052500008942	温氏股份	2021 年 05 月 25 日	28,020.00	2,000	14	3.400	37.05	-	-

华泰证券	2021052500008944	乐普医疗	2021 年 05 月 25 日	31,890.00	1,000	14	3.400	42.17	-	-
华泰证券	2021060100002753	宋城演艺	2021 年 05 月 25 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051200009919	宋城演艺	2021 年 05 月 12 日	215,460.00	11,400	28	3.400	569.77	-	-
华泰证券	2021052600010270	康泰生物	2021 年 05 月 26 日	2,250,486.00	12,600	14	3.400	2,975.64	-	-
华泰证券	2021052600010736	温氏股份	2021 年 05 月 26 日	28,120.00	2,000	14	3.400	37.18	-	-
华泰证券	2021052600010740	三环集团	2021 年 05 月 26 日	37,080.00	1,000	14	3.400	49.03	-	-
华泰证券	2021052600010742	宋城演艺	2021 年 05 月 26 日	23,959.00	1,300	14	3.400	31.68	-	-
华泰证券	2021052600010744	乐普医疗	2021 年 05 月 26 日	32,760.00	1,000	14	3.400	43.32	-	-
华泰证券	2021060100002743	宋城演艺	2021 年 05 月 26 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060100002839	宋城演艺	2021 年 05 月 12 日	570.00	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051300025174	爱尔眼科	2021 年 05 月 13 日	2,332,189.00	31,100	28	3.400	6,167.34	-	-
华泰证券	2021051300025176	智飞生物	2021 年 05 月 13 日	5,846,400.00	28,000	28	4.400	20,007.68	-	-
华泰证券	2021051300025178	智飞生物	2021 年 05 月 13 日	1,461,600.00	7,000	28	3.400	3,865.12	-	-
华泰证券	2021052700000652	温氏股份	2021 年 05 月 27 日	28,540.00	2,000	14	3.400	37.74	-	-
华泰证券	2021052700000654	宋城演艺	2021 年 05 月 27 日	23,738.00	1,300	14	3.400	31.39	-	-
华泰证券	2021052700000656	沃森生物	2021 年 05 月 27 日	614,341.00	9,100	14	3.400	812.30	-	-
华泰证券	2021052700018443	乐普医疗	2021 年 05 月 27 日	34,840.00	1,000	14	3.400	46.07	-	-
华泰证券	2021052700018445	沃森生物	2021 年 05 月 27 日	587,337.00	8,700	14	3.400	776.59	-	-
华泰证券	2021052700018447	信维通信	2021 年 05 月 27 日	28,120.00	1,000	14	3.400	37.18	-	-
华泰证券	2021052700018449	三环集团	2021 年 05 月 27 日	38,420.00	1,000	14	3.400	50.80	-	-
华泰证券	2021052700018451	沃森生物	2021 年 05 月 27 日	769,614.00	11,400	14	3.400	1,017.60	-	-
华泰证券	2021052700018453	温氏股份	2021 年 05 月 27 日	19,978.00	1,400	14	3.400	26.42	-	-
华泰证券	2021060100002734	宋城演艺	2021 年 05 月 27 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060800006641	信维通信	2021 年 05 月 27 日	100.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052800000468	温氏股份	2021 年 05 月 28 日	19,698.00	1,400	14	3.400	26.05	-	-
华泰证券	2021052800000470	三环集团	2021 年 05 月 28 日	37,590.00	1,000	14	3.400	49.70	-	-
华泰证券	2021052800000472	宋城演艺	2021 年 05 月 28 日	23,231.00	1,300	14	3.400	30.72	-	-
华泰证券	2021052800000474	乐普医疗	2021 年 05 月 28 日	33,950.00	1,000	14	3.400	44.89	-	-
华泰证券	2021060100002720	宋城演艺	2021 年 05 月 28 日	65.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060100002563	三环集团	2021 年 06 月 01 日	37,820.00	1,000	14	3.400	50.01	-	-
华泰证券	2021060100002565	信维通信	2021 年 06 月 01 日	29,080.00	1,000	14	3.400	38.45	-	-
华泰证券	2021060800006619	信维通信	2021 年 06 月 01 日	100.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021051900002611	中国通号	2021 年 05 月 19 日	2,638,818.00	465,400	28	1.800	3,694.35	-	-
华泰证券	2021052000016913	中国通号	2021 年 05 月 20 日	181,760.00	32,000	28	1.800	254.46	-	-
华泰证券	2021060300010758	蓝思科技	2021 年 06 月 03 日	31,856.00	1,100	14	3.400	42.12	-	-
华泰证券	2021052100006036	亿纬锂能	2021 年 05 月 21 日	4,028,800.00	40,000	28	3.400	10,653.94	-	-
华泰证券	2021052400006812	亿纬锂能	2021 年 05 月 21 日	1,000.21	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060400000256	汇川技术	2021 年 06 月 04 日	335,280.00	5,500	14	3.400	443.31	-	-
华泰证券	2021060400000258	信维通信	2021 年 06 月 04 日	229,360.00	8,000	14	3.400	303.26	-	-
华泰证券	2021060400005333	汇川技术	2021 年 06 月 04 日	182,880.00	3,000	14	3.400	241.81	-	-
华泰证券	2021060800006584	信维通信	2021 年 06 月 04 日	800.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052400006150	亿纬锂能	2021 年 05 月 24 日	715,400.00	7,000	28	3.400	1,891.84	-	-

华泰证券	2021052400006796	亿纬锂能	2021 年 05 月 24 日	175.04	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060700000879	沃森生物	2021 年 06 月 07 日	2,269,355.00	34,100	14	3.400	3,000.59	-	-
华泰证券	2021052500008982	同花顺	2021 年 05 月 25 日	421,960.00	3,500	28	3.400	1,115.85	-	-
华泰证券	2021052500009192	东方财富	2021 年 05 月 25 日	53,172.00	1,400	28	3.400	140.61	-	-
华泰证券	2021052500009684	沃森生物	2021 年 05 月 25 日	1,901,480.00	28,000	28	3.400	5,028.36	-	-
华泰证券	2021052600011252	东方财富	2021 年 05 月 25 日	84.00	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021052600011650	东方财富	2021 年 05 月 25 日	-	280	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021060800000552	亿联网络	2021 年 06 月 08 日	424,050.00	5,500	14	3.400	560.69	-	-
华泰证券	2021060800000554	沃森生物	2021 年 06 月 08 日	1,132,191.00	17,100	14	3.400	1,497.01	-	-
华泰证券	2021060800000556	汇川技术	2021 年 06 月 08 日	3,027,500.00	50,000	14	3.400	4,003.03	-	-
华泰证券	2021060800005761	亿纬锂能	2021 年 06 月 08 日	6,293,812.00	64,400	14	3.400	8,321.82	-	-
华泰证券	2021052600010738	沃森生物	2021 年 05 月 26 日	2,440,625.00	35,500	28	3.400	6,454.10	-	-
华泰证券	2021052600010746	信维通信	2021 年 05 月 26 日	346,250.00	12,500	28	3.400	915.64	-	-
华泰证券	2021060800006657	信维通信	2021 年 05 月 26 日	1,250.00	-	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021061000007334	沃森生物	2021 年 06 月 10 日	585,949.00	9,100	14	3.400	774.75	-	-
华泰证券	2021061000007336	沃森生物	2021 年 06 月 10 日	560,193.00	8,700	14	3.400	740.70	-	-
华泰证券	2021061000007338	沃森生物	2021 年 06 月 10 日	734,046.00	11,400	14	3.400	970.57	-	-
华泰证券	2021061000007926	信维通信	2021 年 06 月 10 日	28,400.00	1,000	14	3.400	37.55	-	-
华泰证券	2021061100003556	乐普医疗	2021 年 06 月 11 日	30,930.00	1,000	14	3.400	40.90	-	-
华泰证券	2021062400010017	乐普医疗	2021 年 06 月 11 日	228.00	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021061500000797	中微公司	2021 年 06 月 15 日	6,710,500.00	50,000	14	3.400	8,872.77	-	-
华泰证券	2021061500000799	华润微	2021 年 06 月 15 日	759,000.00	10,000	14	3.400	1,003.57	-	-
华泰证券	2021061600009148	华润微	2021 年 06 月 15 日	737.30	-	14	3.400	-	-	-
华泰证券	2021061600000534	康泰生物	2021 年 06 月 16 日	1,471,600.00	10,000	14	3.400	1,945.78	-	-
华泰证券	2021061600000536	欧普康视	2021 年 06 月 16 日	577,551.00	5,900	14	3.400	763.65	-	-
华泰证券	2021060300010556	中国通号	2021 年 06 月 03 日	266,490.00	47,000	28	1.800	373.09	266,490.00	373.09
华泰证券	2021060300010760	爱尔眼科	2021 年 06 月 03 日	7,515,450.00	87,900	28	1.800	10,521.63	7,515,450.00	10,521.63
华泰证券	2021061700000599	欧普康视	2021 年 06 月 17 日	579,675.00	5,900	14	3.400	766.46	579,675.00	766.46
华泰证券	2021062300019328	爱尔眼科	2021 年 06 月 03 日	13,034.63	-	28	1.800	-	13,034.63	-
华泰证券	2021062300019569	爱尔眼科	2021 年 06 月 03 日	-	26,069	28	1.800	-	-	-
华泰证券	2021061800000932	先导智能	2021 年 06 月 18 日	1,829,100.00	30,000	14	3.400	2,418.48	1,829,100.00	2,418.48
华泰证券	2021061800000934	英科医疗	2021 年 06 月 18 日	583,687.00	5,900	14	3.400	771.76	583,687.00	771.76
华泰证券	2021061800000940	华润微	2021 年 06 月 18 日	1,471,572.00	16,400	14	3.400	1,945.75	1,471,572.00	1,945.75
华泰证券	2021061800000944	阳光电源	2021 年 06 月 18 日	1,989,800.00	20,000	14	3.400	2,630.96	1,989,800.00	2,630.96

华泰证券	2021061800000946	芒果超媒	2021 年 06 月 18 日	17,082,500.00	250,000	14	3.400	22,586.86	17,082,500.00	22,586.86
华泰证券	2021061800000954	亿纬锂能	2021 年 06 月 18 日	1,054,500.00	10,000	14	3.400	1,394.28	1,054,500.00	1,394.28
华泰证券	2021062100000661	华熙生物	2021 年 06 月 21 日	7,763,700.00	30,000	14	3.400	10,265.34	7,763,700.00	10,265.34
华泰证券	2021062100000667	先导智能	2021 年 06 月 21 日	1,220,400.00	20,000	14	3.400	1,613.64	1,220,400.00	1,613.64
华泰证券	2021062100000671	阳光电源	2021 年 06 月 21 日	2,056,000.00	20,000	14	3.400	2,718.49	2,056,000.00	2,718.49
华泰证券	2021062100000713	沪硅产业	2021 年 06 月 21 日	1,501,000.00	50,000	14	3.400	1,984.66	1,501,000.00	1,984.66
华泰证券	2021062100011643	沃森生物	2021 年 06 月 21 日	2,034,065.00	34,100	14	3.400	2,689.49	2,034,065.00	2,689.49
华泰证券	2021060800005759	智飞生物	2021 年 06 月 08 日	2,617,720.00	14,000	28	3.400	6,922.42	2,617,720.00	6,922.42
华泰证券	2021062200001296	华润微	2021 年 06 月 22 日	1,181,040.00	13,300	14	3.400	1,561.60	1,181,040.00	1,561.60
华泰证券	2021062200001298	温氏股份	2021 年 06 月 22 日	1,251,000.00	90,000	14	3.400	1,654.10	1,251,000.00	1,654.10
华泰证券	2021062200001300	先导智能	2021 年 06 月 22 日	1,198,000.00	20,000	14	3.400	1,584.02	1,198,000.00	1,584.02
华泰证券	2021062200001302	阳光电源	2021 年 06 月 22 日	1,020,900.00	10,000	14	3.400	1,349.86	1,020,900.00	1,349.86
华泰证券	2021062200011578	亿联网络	2021 年 06 月 22 日	415,250.00	5,500	14	3.400	549.05	415,250.00	549.05
华泰证券	2021062200011654	汇川技术	2021 年 06 月 22 日	3,375,500.00	50,000	14	3.400	4,463.16	3,375,500.00	4,463.16
华泰证券	2021062200011656	沃森生物	2021 年 06 月 22 日	1,050,282.00	17,100	14	3.400	1,388.71	1,050,282.00	1,388.71
华泰证券	2021062200011768	亿纬锂能	2021 年 06 月 22 日	6,536,600.00	64,400	14	3.400	8,642.84	6,536,600.00	8,642.84
华泰证券	2021062300000994	先导智能	2021 年 06 月 23 日	1,769,700.00	30,000	14	3.400	2,339.94	1,769,700.00	2,339.94
华泰证券	2021062300000996	阳光电源	2021 年 06 月 23 日	1,025,000.00	10,000	14	3.400	1,355.28	1,025,000.00	1,355.28
华泰证券	2021061000007928	爱尔眼科	2021 年 06 月 10 日	2,706,011.00	31,100	28	3.400	7,155.90	2,706,011.00	7,155.90
华泰证券	2021061000008082	智飞生物	2021 年 06 月 10 日	1,281,000.00	7,000	28	3.400	3,387.53	1,281,000.00	3,387.53
华泰证券	2021061000008084	智飞生物	2021 年 06 月 10 日	5,124,000.00	28,000	28	4.400	17,535.47	5,124,000.00	17,535.47
华泰证券	2021062300019348	爱尔眼科	2021 年 06 月 10 日	4,611.80	-	28	3.400	-	4,611.80	-

华泰证券	2021062300019696	爱尔眼科	2021 年 06 月 10 日	-	9,224	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021062400000692	沪硅产业	2021 年 06 月 24 日	1,125,930.00	39,000	14	3.400	1,488.73	1,125,930.00	1,488.73
华泰证券	2021062400000694	华润微	2021 年 06 月 24 日	880,600.00	10,000	14	3.400	1,164.35	880,600.00	1,164.35
华泰证券	2021062400000718	英科医疗	2021 年 06 月 24 日	1,021,100.00	10,000	14	3.400	1,350.12	1,021,100.00	1,350.12
华泰证券	2021062400000720	阳光电源	2021 年 06 月 24 日	1,069,100.00	10,000	14	3.400	1,413.59	1,069,100.00	1,413.59
华泰证券	2021062400000722	先导智能	2021 年 06 月 24 日	1,120,000.00	20,000	14	3.400	1,480.89	1,120,000.00	1,480.89
华泰证券	2021062400000869	沃森生物	2021 年 06 月 24 日	543,543.00	9,100	14	3.400	718.68	543,543.00	718.68
华泰证券	2021062400000871	沃森生物	2021 年 06 月 24 日	519,651.00	8,700	14	3.400	687.09	519,651.00	687.09
华泰证券	2021062400000873	沃森生物	2021 年 06 月 24 日	680,922.00	11,400	14	3.400	900.33	680,922.00	900.33
华泰证券	2021062400009067	信维通信	2021 年 06 月 24 日	31,690.00	1,000	14	3.400	41.90	31,690.00	41.90
华泰证券	2021062500000484	英科医疗	2021 年 06 月 25 日	1,050,000.00	10,000	14	3.400	1,388.33	1,050,000.00	1,388.33
华泰证券	2021062500000486	沪硅产业	2021 年 06 月 25 日	795,984.00	27,600	14	3.400	1,052.47	795,984.00	1,052.47
华泰证券	2021062500000488	华润微	2021 年 06 月 25 日	1,111,446.00	12,600	14	3.400	1,469.58	1,111,446.00	1,469.58
华泰证券	2021062800000462	华润微	2021 年 06 月 28 日	890,300.00	10,000	14	3.400	1,177.17	890,300.00	1,177.17
华泰证券	2021062900017921	中微公司	2021 年 06 月 29 日	8,094,500.00	50,000	14	3.400	10,702.73	8,094,500.00	10,702.73
华泰证券	2021061600007187	中国通号	2021 年 06 月 16 日	2,592,278.00	465,400	28	1.800	3,629.19	2,592,278.00	3,629.19
华泰证券	2021063000000595	中微公司	2021 年 06 月 30 日	3,318,400.00	20,000	14	3.400	4,387.66	3,318,400.00	4,387.66
华泰证券	20210630000006121	欧普康视	2021 年 06 月 30 日	610,945.00	5,900	14	3.400	807.81	610,945.00	807.81
华泰证券	20210630000006123	康泰生物	2021 年 06 月 30 日	1,490,000.00	10,000	14	3.400	1,970.11	1,490,000.00	1,970.11
华泰证券	2021061700017115	中国通号	2021 年 06 月 17 日	180,160.00	32,000	28	1.800	252.22	180,160.00	252.22
华泰证券	2021071400008893	中国通号	2021 年 06 月 17 日	6,400.00	-	28	1.800	-	6,400.00	-
华泰证券	2021061800000956	沃森生物	2021 年 06 月 18 日	1,768,500.00	30,000	28	3.400	4,676.70	1,768,500.00	4,676.70
华泰证券	2021062200001304	爱尔眼科	2021 年 06 月 22 日	1,746,000.00	20,000	28	3.400	4,617.20	1,746,000.00	4,617.20

									0.00	
华泰证券	2021062300019424	爱尔眼科	2021 年 06 月 22 日	2,965.79	-	28	3.400	-	2,965.79	-
华泰证券	2021062300019659	爱尔眼科	2021 年 06 月 22 日	-	5,932	28	3.400	-	-	-
华泰证券	2021062300018432	沃森生物	2021 年 06 月 23 日	2,167,985.00	35,500	28	3.400	5,733.12	2,167,985.00	5,733.12
华泰证券	2021062300018492	信维通信	2021 年 06 月 23 日	395,125.00	12,500	28	3.400	1,044.89	395,125.00	1,044.89

注：本基金本报告期及上年度可比期间未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本报告期内与上年度可比期间，基金管理人未投资本基金。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	505,570,777.00	4.6822	481,477,669.00	4.2457
华泰证券股份有限公司	22,066,967.00	0.2044	228,708,740.00	2.0167

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	234,917,672.44	402,252.30	214,518,913.20	327,584.81

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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
				基金在承销期内买入	
				数量 (单位:)	总金额

				张)	
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量 (单位: 张)	总金额
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	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
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	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
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	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
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	600905	三峡能源	网上申购	34,000	90,100.00
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	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

注：本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

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	2022 年 1 月 19 日	2022 年 1 月 19 日	-	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-
合计	-	-	-	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-

6.4.12 期末(2022 年 6 月 30 日)本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购日	受限期 限	流通受 限类型	认购 价格	期末估 值单价	数量 (单位:	期末 成本总额	期末估值总额	备注

							股)				
300834	星辉环材	2022年1月6日	6个月	新股锁定期内	55.57	30.03	635	35,286.95	19,069.05	-	
301102	兆讯传媒	2022年3月15日	6个月	新股锁定期内	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-	
301103	何氏眼科	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	-	
301110	青木股份	2022年3月4日	6个月	新股锁定期内	63.10	39.85	202	12,746.20	8,049.70	-	
301112	信邦智能	2022年6月20日	6个月	新股锁定期内	27.53	45.04	399	10,984.47	17,970.96	-	
301116	益客食品	2022年1月10日	6个月	新股锁定期内	11.40	20.46	577	6,577.80	11,805.42	-	
301117	佳缘科技	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	46.80	54.44	262	12,261.60	14,263.28	-	
301122	采纳股份	2022年1月19日	6个月	新股锁定期内	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-	
301125	腾亚精工	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-	
301130	西点药业	2022年2月16日	6个月	新股锁定期内	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-	
301137	哈焊华通	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	15.37	15.99	644	9,898.28	10,297.56	-	
301139	元道通信	2022年6月30日	1个月内(含)	新股未上市	38.46	38.46	5,651	217,337.46	217,337.46	-	
301153	中科江南	2022年5月10日	6个月	新股锁定期内	33.68	43.98	398	13,404.64	17,504.04	-	
301158	德石股份	2022年1月7日	6个月	新股锁定期内	15.64	20.38	379	5,927.56	7,724.02	-	
301160	翔楼	2022	6个月	新股锁	31.56	37.66	392	12,371.52	14,762.72	-	

	新材	年 5 月 25 日		定期内							
301175	中科 环保	2022 年 6 月 30 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	3.82	3.82	63,694	243,311.08	243,311.08		-
301181	标榜 股份	2022 年 2 月 11 日	6 个月	新股锁 定期内	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63		-
301196	唯科 科技	2022 年 1 月 4 日	6 个月	新股锁 定期内	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92		-
301200	大族 数控	2022 年 2 月 18 日	6 个月	新股锁 定期内	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44		-
301201	诚达 药业	2022 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期内	72.69	71.54	353	25,659.57	25,253.62		-
301206	三元 生物	2022 年 1 月 26 日	6 个月	新股锁 定期内	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05		-
301207	华兰 疫苗	2022 年 2 月 10 日	6 个月	新股锁 定期内	56.88	56.42	569	32,364.72	32,102.98		-
301212	联盛 化学	2022 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期内	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48		-
301215	中汽 股份	2022 年 2 月 28 日	6 个月	新股锁 定期内	3.80	6.39	4,743	18,023.40	30,307.77		-
301219	腾远 钴业	2022 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期内	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96		-
301220	亚香 股份	2022 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期内	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75		-
301222	浙江 恒威	2022 年 3 月 2 日	6 个月	新股锁 定期内	33.98	28.96	332	11,281.36	9,614.72		-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	1 个月 内(含)	新股未 上市	41.52	41.52	1,418	58,875.36	58,875.36		-
301233	盛帮 股份	2022 年 6 月 24 日	6 个月	新股锁 定期内	41.52	41.52	158	6,560.16	6,560.16		-

301235	华康医疗	2022年1月21日	6个月	新股锁定期内	39.30	37.93	418	16,427.40	15,854.74	-
301237	和顺科技	2022年3月16日	6个月	新股锁定期内	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	1个月内(含)	新股未上市	33.65	33.65	5,172	174,037.80	174,037.80	-
301239	普瑞眼科	2022年6月22日	6个月	新股锁定期内	33.65	33.65	575	19,348.75	19,348.75	-
301256	华融化学	2022年3月14日	6个月	新股锁定期内	8.05	10.08	1,831	14,739.55	18,456.48	-
301258	富士莱	2022年3月21日	6个月	新股锁定期内	48.30	41.68	295	14,248.50	12,295.60	-
301259	艾布鲁	2022年4月18日	6个月	新股锁定期内	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301266	宇邦新材	2022年5月30日	6个月	新股锁定期内	26.86	47.07	517	13,886.62	24,335.19	-
301279	金道科技	2022年4月6日	6个月	新股锁定期内	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
301288	清研环境	2022年4月14日	6个月	新股锁定期内	19.09	19.98	452	8,628.68	9,030.96	-
301298	东利机械	2022年5月27日	6个月	新股锁定期内	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301302	华如科技	2022年6月16日	6个月	新股锁定期内	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
688223	晶科能源	2022年1月19日	6个月	新股锁定期内	5.00	14.47	213,000	1,065,000.00	3,082,110.00	-
688234	天岳先进	2022年1月5日	6个月	新股锁定期内	82.79	65.19	6,759	559,577.61	440,619.21	-
688237	超卓航科	2022年6月	1个月内(含)	新股未上市	41.27	41.27	2,891	119,311.57	119,311.57	-

		24 日								
688251	井松智能	2022 年 5 月 27 日	6 个月	新股锁定期内	35.62	36.66	3,392	120,823.04	124,350.72	-
688322	奥比中光	2022 年 6 月 30 日	1 个月内(含)	新股未上市	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
688400	凌云光	2022 年 6 月 27 日	1 个月内(含)	新股未上市	21.93	21.93	13,111	287,524.23	287,524.23	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022 年 06 月 15 日	1 个月内	配债未上市	100.00	100.00	63,670	6,367,000.00	6,367,474.47	-

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：截至本报告期末，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2022 年 6 月 30 日止，本基金从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回

购证券余额 0 元，无债券作为质押。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	000001	平安银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.98	120,600	1,806,588.00
2	000333	美的集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	60.39	56,800	3,430,152.00
3	300496	中科创达	2022 年 7 月 28 日	130.48	2,400	313,152.00
4	300498	温氏股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	21.29	2,774,900	59,077,621.00
5	300529	健帆生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	50.89	125,900	6,407,051.00
6	300595	欧普康视	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	57.19	261,000	14,926,590.00
7	300601	康泰生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	45.18	26,700	1,206,306.00
8	300628	亿联网络	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	76.15	111,100	8,460,265.00
9	300661	圣邦股份	2022 年 7 月 13 日-2022 年 7 月 28 日	182.02	13,000	2,366,260.00
10	300750	宁德时代	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	534.00	314,600	167,996,400.00
11	300751	迈为股份	2022 年 7 月 4 日	490.90	3,500	1,718,150.00
12	300759	康龙化成	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	95.22	145,850	13,887,837.00
13	000338	潍柴动力	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	12.47	96,300	1,200,861.00
14	300760	迈瑞医疗	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	313.20	13,100	4,102,920.00
15	300782	卓胜微	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	135.00	14,520	1,960,200.00
16	300866	安克创新	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	66.32	34,700	2,301,304.00
17	300896	爱美客	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	600.01	4,100	2,460,041.00
18	300919	中伟股份	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 28 日	123.90	51,500	6,380,850.00
19	300957	贝泰妮	2022 年 7 月 11 日	217.53	32,000	6,960,960.00
20	300979	华利集团	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 13 日	73.08	36,000	2,630,880.00
21	300999	金龙鱼	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	54.02	123,800	6,687,676.00
22	600000	浦发银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	8.01	185,300	1,484,253.00
23	600009	上海机场	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	56.70	279,600	15,853,320.00
24	000425	徐工机械	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.39	1,732,800	9,339,792.00
25	600010	包钢股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	2.35	8,323,200	19,559,520.00
26	600011	华能国际	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.04	979,900	6,898,496.00
27	600015	华夏银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.21	1,102,100	5,741,941.00
28	600016	民生银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.72	1,211,900	4,508,268.00
29	600018	上港集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.83	641,600	3,740,528.00
30	600019	宝钢股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.02	186,200	1,120,924.00
31	600025	华能水电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.99	383,800	2,682,762.00
32	600028	中国石化	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.08	464,600	1,895,568.00
33	600029	南方航空	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.31	1,783,200	13,035,192.00
34	600030	中信证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	21.66	47,400	1,026,684.00

35	000538	云南白药	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	60.39	106,800	6,449,652.00
36	600031	三一重工	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	19.06	1,771,900	33,772,414.00
37	600036	招商银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	42.20	88,900	3,751,580.00
38	600048	保利发展	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.46	193,800	3,383,748.00
39	600050	中国联通	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.46	384,400	1,330,024.00
40	600061	国投资本	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.36	168,900	1,074,204.00
41	600085	同仁堂	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	52.88	54,800	2,897,824.00
42	600089	特变电工	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	27.39	201,800	5,527,302.00
43	600104	上汽集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.81	366,300	6,523,803.00
44	600111	北方稀土	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	35.16	1,027,000	36,109,320.00
45	600115	中国东航	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.49	1,522,500	8,358,525.00
46	000568	泸州老窖	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	246.54	136,200	33,578,748.00
47	600132	重庆啤酒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	146.60	10,000	1,466,000.00
48	600150	中国船舶	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	18.98	200,400	3,803,592.00
49	600161	天坛生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	24.28	97,800	2,374,584.00
50	600176	中国巨石	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.41	98,600	1,716,626.00
51	600183	生益科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	16.99	390,300	6,631,197.00
52	600196	复星医药	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	44.09	484,000	21,339,560.00
53	600219	南山铝业	2022 年 7 月 28 日	3.69	58,500	215,865.00
54	600276	恒瑞医药	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	37.09	118,900	4,410,001.00
55	600309	万华化学	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	96.99	40,000	3,879,600.00
56	600332	白云山	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	31.59	45,000	1,421,550.00
57	000596	古井贡酒	2022 年 7 月 21 日	249.66	10,000	2,496,600.00
58	600346	恒力石化	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	22.24	381,600	8,486,784.00
59	600352	浙江龙盛	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.18	595,900	6,066,262.00
60	600362	江西铜业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.83	56,800	1,012,744.00
61	600383	金地集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	13.44	386,000	5,187,840.00
62	600406	国电南瑞	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	27.00	62,980	1,700,460.00
63	600426	华鲁恒升	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	29.20	40,400	1,179,680.00
64	600436	片仔癀	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	356.73	10,000	3,567,300.00
65	600438	通威股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	59.86	1,078,000	64,529,080.00
66	600460	士兰微	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 13 日	52.00	192,100	9,989,200.00
67	600489	中金黄金	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.39	337,900	2,497,081.00
68	000625	长安汽车	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.32	2,264,560	39,222,179.20
69	600547	山东黄金	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	18.56	197,700	3,669,312.00
70	600570	恒生电子	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	43.54	115,100	5,011,454.00
71	600584	长电科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	27.00	274,800	7,419,600.00
72	600585	海螺水泥	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	35.28	69,000	2,434,320.00
73	600588	用友网络	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	21.71	1,031,500	22,393,865.00
74	600600	青岛啤酒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	103.92	142,400	14,798,208.00
75	600606	绿地控股	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.96	511,800	2,026,728.00
76	600655	豫园股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.44	277,700	2,621,488.00
77	600660	福耀玻璃	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	41.81	391,100	16,351,891.00

78	600690	海尔智家	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	27.46	138,300	3,797,718.00
79	000651	格力电器	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.72	2,073,500	69,918,420.00
80	600741	华域汽车	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	23.00	271,700	6,249,100.00
81	600745	闻泰科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	85.11	133,600	11,370,696.00
82	600760	中航沈飞	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	60.45	63,500	3,838,575.00
83	600763	通策医疗	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	174.44	87,400	15,246,056.00
84	600795	国电电力	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.91	1,213,900	4,746,349.00
85	600809	山西汾酒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 25 日	324.80	32,700	10,620,960.00
86	600837	海通证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.81	186,300	1,827,603.00
87	600845	宝信软件	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	54.60	62,300	3,401,580.00
88	600886	国投电力	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.50	203,100	2,132,550.00
89	600887	伊利股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	38.95	74,000	2,882,300.00
90	000661	长春高新	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 21 日	233.42	31,300	7,306,046.00
91	600893	航发动力	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	45.51	79,600	3,622,596.00
92	600900	长江电力	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	23.12	207,400	4,795,088.00
93	600905	三峡能源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.29	754,900	4,748,321.00
94	600918	中泰证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.65	231,800	1,773,270.00
95	600919	江苏银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.12	215,400	1,533,648.00
96	600926	杭州银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.98	453,400	6,791,932.00
97	600958	东方证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.21	165,200	1,686,692.00
98	600989	宝丰能源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.65	388,500	5,691,525.00
99	600999	招商证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.41	176,900	2,549,129.00
100	601006	大秦铁路	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.59	855,400	5,637,086.00
101	000703	恒逸石化	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.51	498,300	5,237,133.00
102	601009	南京银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.42	125,800	1,310,836.00
103	601012	隆基绿能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	66.63	64,600	4,304,298.00
104	601021	春秋航空	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	58.35	134,600	7,853,910.00
105	601066	中信建投	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	28.91	281,400	8,135,274.00
106	601088	中国神华	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.30	257,300	8,568,090.00
107	601100	恒立液压	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	61.72	207,500	12,806,900.00
108	601111	中国国航	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	11.61	1,204,000	13,978,440.00
109	601117	中国化学	2022 年 7 月 28 日	9.41	30,100	283,241.00
110	601138	工业富联	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.84	115,800	1,139,472.00
111	601155	新城控股	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	25.43	116,700	2,967,681.00
112	000002	万 科 A	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	20.50	1,134,100	23,249,050.00
113	000708	中信特钢	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	20.15	461,700	9,303,255.00
114	601166	兴业银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	19.90	141,500	2,815,850.00
115	601169	北京银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.54	370,300	1,681,162.00
116	601186	中国铁建	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.90	673,600	5,321,440.00
117	601211	国泰君安	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	15.20	107,600	1,635,520.00
118	601216	君正集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.88	1,132,000	5,524,160.00
119	601225	陕西煤业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	21.18	152,200	3,223,596.00
120	601229	上海银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.55	1,121,400	7,345,170.00

121	601236	红塔证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.13	523,400	4,778,642.00
122	601238	广汽集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	15.24	558,500	8,511,540.00
123	601288	农业银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.02	524,100	1,582,782.00
124	000725	京东方 A	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.94	3,984,600	15,699,324.00
125	601318	中国平安	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	46.69	99,900	4,664,331.00
126	601319	中国人保	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.06	237,900	1,203,774.00
127	601328	交通银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.98	416,200	2,072,676.00
128	601336	新华保险	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	32.19	37,400	1,203,906.00
129	601360	三六零	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	8.52	432,200	3,682,344.00
130	601377	兴业证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.05	573,800	4,045,290.00
131	601390	中国中铁	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.14	553,300	3,397,262.00
132	601398	工商银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.77	403,700	1,925,649.00
133	601600	中国铝业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.75	3,035,500	14,418,625.00
134	601601	中国太保	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	23.53	59,100	1,390,623.00
135	000768	中航西飞	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	30.29	237,800	7,202,962.00
136	601618	中国中冶	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.50	1,325,100	4,637,850.00
137	601628	中国人寿	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	31.08	117,900	3,664,332.00
138	601633	长城汽车	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	37.04	567,000	21,001,680.00
139	601658	邮储银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.39	237,500	1,280,125.00
140	601668	中国建筑	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.32	1,500,800	7,984,256.00
141	601669	中国电建	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	7.87	1,115,400	8,778,198.00
142	601688	华泰证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.20	114,300	1,623,060.00
143	601698	中国卫通	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	11.31	174,800	1,976,988.00
144	601766	中国中车	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.20	302,300	1,571,960.00
145	601788	光大证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	15.76	892,000	14,057,920.00
146	000776	广发证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	18.70	134,500	2,515,150.00
147	601799	星宇股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	171.00	59,900	10,242,900.00
148	601800	中国交建	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.28	1,784,300	16,558,304.00
149	601808	中海油服	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	13.95	266,000	3,710,700.00
150	601816	京沪高铁	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.02	364,100	1,827,782.00
151	601818	光大银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.01	391,300	1,177,813.00
152	601838	成都银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	16.58	176,900	2,933,002.00
153	601857	中国石油	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.30	273,200	1,447,960.00
154	601865	福莱特	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	38.10	212,700	8,103,870.00
155	601877	正泰电器	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	35.78	220,600	7,893,068.00
156	601878	浙商证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	11.38	803,000	9,138,140.00
157	000786	北新建材	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	34.62	229,400	7,941,828.00
158	601881	中国银河	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.67	140,700	1,360,569.00
159	601888	中国中免	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	232.93	30,000	6,987,900.00
160	601898	中煤能源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.38	613,200	6,365,016.00
161	601899	紫金矿业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.33	165,200	1,541,316.00
162	601901	方正证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.71	164,200	1,101,782.00
163	601916	浙商银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.32	341,300	1,133,116.00

164	601919	中远海控	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	13.90	2,773,000	38,544,700.00
165	601939	建设银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.06	254,300	1,541,058.00
166	601966	玲珑轮胎	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	25.37	297,400	7,545,038.00
167	601985	中国核电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.86	694,300	4,762,898.00
168	000792	盐湖股份	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 28 日	29.96	535,400	16,040,584.00
169	601988	中国银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.26	4,432,300	14,449,298.00
170	601989	中国重工	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	3.71	666,400	2,472,344.00
171	601995	中金公司	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	44.49	107,600	4,787,124.00
172	601998	中信银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.75	236,900	1,125,275.00
173	603019	中科曙光	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	29.02	91,400	2,652,428.00
174	603160	汇顶科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	61.93	102,000	6,316,860.00
175	603185	上机数控	2022 年 7 月 11 日	155.99	73,000	11,387,270.00
176	603195	公牛集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	152.91	20,300	3,104,073.00
177	603259	药明康德	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	103.99	30,700	3,192,493.00
178	603260	合盛硅业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 12 日	117.96	34,000	4,010,640.00
179	000800	一汽解放	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.34	385,000	3,595,900.00
180	603288	海天味业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	90.36	370,000	33,433,200.00
181	603369	今世缘	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	51.00	41,800	2,131,800.00
182	603501	韦尔股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	173.03	29,800	5,156,294.00
183	603659	璞泰来	2022 年 7 月 4 日	84.40	29,200	2,464,480.00
184	603799	华友钴业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	95.62	101,000	9,657,620.00
185	603806	福斯特	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	65.52	202,100	13,241,592.00
186	603833	欧派家居	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	150.68	74,000	11,150,320.00
187	603882	金域医学	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	82.55	169,000	13,950,950.00
188	603899	晨光股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	56.08	97,900	5,490,232.00
189	603986	兆易创新	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	142.21	75,500	10,736,855.00
190	000858	五 粮 液	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	201.93	62,500	12,620,625.00
191	603993	洛阳钼业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.73	814,900	4,669,377.00
192	688005	容百科技	2022 年 7 月 4 日	129.44	100,000	12,944,000.00
193	688008	澜起科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 6 日	60.58	23,400	1,417,572.00
194	688111	金山办公	2022 年 7 月 14 日	197.12	40,000	7,884,800.00
195	688126	沪硅产业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	22.98	389,700	8,955,306.00
196	688169	石头科技	2022 年 7 月 8 日	616.70	10,000	6,167,000.00
197	688363	华熙生物	2022 年 7 月 12 日	142.18	1,000	142,180.00
198	688396	华润微	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	59.07	207,900	12,280,653.00
199	688599	天合光能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	65.25	442,000	28,840,500.00
200	688981	中芯国际	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	45.17	30,900	1,395,753.00
201	000876	新 希 望	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	15.30	548,300	8,388,990.00
202	000877	天山股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	12.30	243,000	2,988,900.00
203	000063	中兴通讯	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	25.53	364,400	9,303,132.00
204	000895	双汇发展	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	29.30	118,000	3,457,400.00

205	000938	紫光股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	19.40	183,100	3,552,140.00
206	000963	华东医药	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	45.16	325,000	14,677,000.00
207	000977	浪潮信息	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	26.48	355,700	9,418,936.00
208	001979	招商蛇口	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	13.43	426,300	5,725,209.00
209	002001	新 和 成	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	22.81	40,000	912,400.00
210	002007	华兰生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	22.80	372,600	8,495,280.00
211	002008	大族激光	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.13	52,600	1,742,638.00
212	002027	分众传媒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.73	458,500	3,085,705.00
213	002032	苏 泊 尔	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	56.34	66,000	3,718,440.00
214	000066	中国长城	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	10.82	919,200	9,945,744.00
215	002049	紫光国微	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	189.72	21,800	4,135,896.00
216	002050	三花智控	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	27.48	220,700	6,064,836.00
217	002064	华峰化学	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	8.44	108,400	914,896.00
218	002074	国轩高科	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 11 日	45.60	328,100	14,961,360.00
219	002120	韵达股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	17.06	313,300	5,344,898.00
220	002129	TCL 中环	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	58.89	446,900	26,317,941.00
221	002142	宁波银行	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	35.81	48,800	1,747,528.00
222	002179	中航光电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	63.32	66,000	4,179,120.00
223	002202	金风科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	14.80	283,900	4,201,720.00
224	002230	科大讯飞	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	41.22	98,000	4,039,560.00
225	000069	华侨城 A	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.49	590,300	3,831,047.00
226	002236	大华股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	16.42	509,700	8,369,274.00
227	002241	歌尔股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.60	586,300	19,699,680.00
228	002252	上海莱士	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.93	447,300	2,652,489.00
229	002271	东方雨虹	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	51.47	96,900	4,987,443.00
230	002304	洋河股份	2022 年 7 月 4 日	183.15	10,000	1,831,500.00
231	002311	海大集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	60.01	46,000	2,760,460.00
232	002352	顺丰控股	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	55.81	850,700	47,477,567.00
233	002371	北方华创	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 18 日	277.12	42,500	11,777,600.00
234	002410	广联达	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	54.44	132,100	7,191,524.00
235	002414	高德红外	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	12.87	237,100	3,051,477.00
236	000100	TCL 科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.79	482,200	2,309,738.00
237	002415	海康威视	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	36.20	1,487,000	53,829,400.00
238	002460	赣锋锂业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	148.70	75,800	11,271,460.00
239	002466	天齐锂业	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	124.80	481,800	60,128,640.00
240	002475	立讯精密	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.79	73,800	2,493,702.00
241	002493	荣盛石化	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	15.39	135,100	2,079,189.00
242	002555	三七互娱	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	21.23	605,300	12,850,519.00
243	002568	百润股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	30.04	158,280	4,754,731.20
244	002594	比亚迪	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	333.49	54,400	18,141,856.00
245	002600	领益智造	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	5.02	363,900	1,826,778.00
246	002601	龙佰集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	20.05	281,700	5,648,085.00

247	000157	中联重科	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	6.16	1,077,500	6,637,400.00
248	002602	世纪华通	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.82	973,700	4,693,234.00
249	002607	中公教育	2022 年 7 月 5 日-2022 年 7 月 28 日	5.79	789,800	4,572,942.00
250	002648	卫星化学	2022 年 7 月 28 日	25.85	10,100	261,085.00
251	002709	天赐材料	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	62.06	546,000	33,884,760.00
252	002714	牧原股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	55.27	107,800	5,958,106.00
253	002736	国信证券	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	9.57	301,300	2,883,441.00
254	002791	坚朗五金	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	129.72	50,700	6,576,804.00
255	002812	恩捷股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 14 日	250.45	134,000	33,560,300.00
256	002821	凯莱英	2022 年 7 月 6 日	289.00	39,200	11,328,800.00
257	002841	视源股份	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	75.32	137,100	10,326,372.00
258	000166	申万宏源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	4.29	662,100	2,840,409.00
259	002916	深南电路	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 20 日	93.71	88,000	8,246,480.00
260	002920	德赛西威	2022 年 7 月 6 日	148.00	10,000	1,480,000.00
261	300003	乐普医疗	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	18.57	503,400	9,348,138.00
262	300014	亿纬锂能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	97.50	45,500	4,436,250.00
263	300015	爱尔眼科	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	44.77	283,200	12,678,864.00
264	300033	同花顺	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	96.15	88,000	8,461,200.00
265	300059	东方财富	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	25.40	1,353,300	34,373,820.00
266	300122	智飞生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	111.01	52,700	5,850,227.00
267	300124	汇川技术	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	65.87	87,100	5,737,277.00
268	300142	沃森生物	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	48.39	168,500	8,153,715.00
269	000301	东方盛虹	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	16.91	822,200	13,903,402.00
270	300207	欣旺达	2022 年 7 月 6 日-2022 年 7 月 28 日	31.60	32,800	1,036,480.00
271	300223	北京君正	2022 年 7 月 11 日-2022 年 7 月 28 日	106.25	37,700	4,005,625.00
272	300274	阳光电源	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	98.25	272,600	26,782,950.00
273	300316	晶盛机电	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	67.59	133,400	9,016,506.00
274	300347	泰格医药	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	114.45	35,700	4,085,865.00
275	300408	三环集团	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	30.10	89,800	2,702,980.00
276	300413	芒果超媒	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	33.36	213,200	7,112,352.00
277	300433	蓝思科技	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	11.07	992,900	10,991,403.00
278	300450	先导智能	2022 年 7 月 4 日-2022 年 7 月 28 日	63.18	121,200	7,657,416.00
279	300454	深信服	2022 年 7 月 28 日	103.78	1,900	197,182.00
合计	-	-	-	-	116,969,490	2,445,359,845.40

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为被动式指数基金，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。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

注：无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年6月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	6,367,474.47	-
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	6,367,474.47	-

注：债券信用评级取自第三方评级机构的评级。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：无。

6.4.13.3 流动性风险

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

于 2022 年 6 月 30 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及

《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 6 月 30 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 2.83%。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的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、存出保证金和债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 6 月 30 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	234,917,672.44	-	-	-	-	-	234,917,672.44
结算备付金	963,288,844.18	-	-	-	-	-	963,288,844.18
存出保证金	133,811,706.55	-	-	-	-	-	133,811,706.55
交易性金融资产	-	-	6,367,474.47	-	-	47,621,167,369.26	47,627,534,843.73
应收股利	-	-	-	-	-	2,758,856.04	2,758,856.04
应收清算款	-	-	-	-	-	11,065,940.90	11,065,940.90
其他资产	-	-	-	-	-	912,811.32	912,811.32
资产总计	1,332,018,223.17	-	6,367,474.47	-	-	47,635,904,977.52	48,974,290,675.16
负债							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	8,726,456.41	8,726,456.41
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	19,336,752.01	19,336,752.01
应付托管费	-	-	-	-	-	3,867,350.41	3,867,350.41
应付清算款	-	-	-	-	-	37,022,558.37	37,022,558.37
应交税费	-	-	-	-	-	14.73	14.73
其他负债	-	-	-	-	-	139,133,577.45	139,133,577.45
负债总计	-	-	-	-	-	208,086,709.38	208,086,709.38
利率敏感度缺口	1,332,018,223.17	-	6,367,474.47	-	-	47,427,818,268.14	48,766,203,965.78
上年度末 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
其他资产	-	-	-	-	-	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
应交税费	-	-	-	-	-	308,093.67	308,093.67
其他负债	-	-	-	-	-	86,952,361.26	86,952,361.26
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

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

注：于 2022 年 6 月 30 日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 0.01%(2021 年 12 月 31 日：无)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2021 年 12 月 31 日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为被动式指数基金，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 6 月 30 日		上年度末 2021 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	47,621,167,369.26	97.65	55,381,502,659.10	97.36
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	-8,726,456.41	-0.02	-67,951.26	-
合计	47,612,440,912.85	97.63	55,381,434,707.84	97.36

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。

6.4.13.4.3.2 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(2022 年 6 月 30 日)	上年度末(2021 年 12 月 31 日)
分析	沪深 300 指数上升 5%	2,428,031,318.14	2,815,474,920.97
	沪深 300 指数下降 5%	-2,428,031,318.14	-2,815,474,920.97

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	47,615,505,008.46	55,379,541,438.20
第二层次	7,758,094.59	1,961,220.90
第三层次	4,271,740.68	-

合计	47,627,534,843.73	55,381,502,659.10
----	-------------------	-------------------

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2022 年 6 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

无。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	47,621,167,369.26	97.24
	其中：股票	47,621,167,369.26	97.24
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	6,367,474.47	0.01
	其中：债券	6,367,474.47	0.01
	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	1,198,206,516.62	2.45
8	其他各项资产	148,549,314.81	0.30
9	合计	48,974,290,675.16	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 2,445,359,845.40 元，占本基金期末资产净值的 5.01%。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 4,433,167 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 496,442,291.60 元。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	581,106,038.97	1.19
B	采矿业	1,341,714,920.03	2.75
C	制造业	28,343,695,602.99	58.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,194,843,685.51	2.45
E	建筑业	927,002,446.97	1.90
F	批发和零售业	123,149,673.92	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	1,261,719,046.68	2.59
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,460,539,134.39	2.99
J	金融业	9,592,975,723.38	19.67
K	房地产业	892,702,782.32	1.83
L	租赁和商务服务业	670,090,746.06	1.37
M	科学研究和技术服务业	726,319,976.54	1.49
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	24,303,258.66	0.05
Q	卫生和社会工作	417,424,960.03	0.86
R	文化、体育和娱乐业	57,868,858.08	0.12
S	综合	-	-
	合计	47,615,456,854.53	97.64

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	4,895,968.45	0.01

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	283,446.20	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	19,959.78	0.00
M	科学研究和技术服务业	46,162.51	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	255,357.10	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	209,620.69	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,710,514.73	0.01

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	1,422,069	2,908,131,105.00	5.96
2	300750	宁德时代	3,182,687	1,699,554,858.00	3.49
3	600036	招商银行	28,059,802	1,184,123,644.40	2.43
4	601318	中国平安	24,544,806	1,145,996,992.14	2.35
5	601012	隆基绿能	13,738,077	915,368,070.51	1.88
6	000858	五粮液	4,416,272	891,777,804.96	1.83
7	002594	比亚迪	2,066,851	689,274,139.99	1.41
8	000333	美的集团	11,151,173	673,419,337.47	1.38
9	601166	兴业银行	32,942,077	655,547,332.30	1.34
10	300059	东方财富	24,048,399	610,829,334.60	1.25
11	600900	长江电力	25,750,063	595,341,456.56	1.22

12	601888	中国中免	2,213,028	515,480,612.04	1.06
13	603259	药明康德	4,643,624	482,890,459.76	0.99
14	600030	中信证券	22,135,365	479,452,005.90	0.98
15	600887	伊利股份	11,600,623	451,844,265.85	0.93
16	000568	泸州老窖	1,670,899	411,943,439.46	0.84
17	002415	海康威视	10,725,242	388,253,760.40	0.80
18	002475	立讯精密	11,289,434	381,469,974.86	0.78
19	601398	工商银行	79,327,457	378,391,969.89	0.78
20	600276	恒瑞医药	10,111,947	375,052,114.23	0.77
21	600438	通威股份	6,115,148	366,052,759.28	0.75
22	000651	格力电器	10,753,921	362,622,216.12	0.74
23	600809	山西汾酒	1,105,096	358,935,180.80	0.74
24	300760	迈瑞医疗	1,103,685	345,674,142.00	0.71
25	600309	万华化学	3,554,248	344,726,513.52	0.71
26	000725	京东方 A	85,290,547	336,044,755.18	0.69
27	002714	牧原股份	6,056,621	334,749,442.67	0.69
28	000001	平安银行	22,056,438	330,405,441.24	0.68
29	002142	宁波银行	9,021,970	323,076,745.70	0.66
30	000002	万 科 A	15,488,205	317,508,202.50	0.65
31	601328	交通银行	62,203,102	309,771,447.96	0.64
32	002812	恩捷股份	1,218,018	305,052,608.10	0.63
33	601899	紫金矿业	32,657,931	304,698,496.23	0.62
34	002129	TCL 中环	5,164,009	304,108,490.01	0.62
35	000792	盐湖股份	9,896,278	296,492,488.88	0.61
36	002466	天齐锂业	2,353,840	293,759,232.00	0.60
37	603288	海天味业	3,148,738	284,519,965.68	0.58
38	600048	保利发展	16,287,393	284,377,881.78	0.58
39	603799	华友钴业	2,910,347	278,287,380.14	0.57
40	300124	汇川技术	4,204,398	276,943,696.26	0.57
41	300015	爱尔眼科	6,169,350	276,201,799.50	0.57
42	002460	赣锋锂业	1,836,553	273,095,431.10	0.56
43	600031	三一重工	13,485,000	257,024,100.00	0.53
44	601668	中国建筑	47,531,245	252,866,223.40	0.52
45	300014	亿纬锂能	2,583,706	251,911,335.00	0.52
46	002304	洋河股份	1,370,012	250,917,697.80	0.51
47	601088	中国神华	7,489,735	249,408,175.50	0.51
48	002352	顺丰控股	4,452,407	248,488,834.67	0.51
49	300498	温氏股份	11,571,470	246,356,596.30	0.51
50	600436	片仔癀	684,610	244,220,925.30	0.50
51	002271	东方雨虹	4,586,703	236,077,603.41	0.48
52	600690	海尔智家	8,591,308	235,917,317.68	0.48
53	600089	特变电工	8,564,862	234,591,570.18	0.48

54	300274	阳光电源	2,364,222	232,284,811.50	0.48
55	601816	京沪高铁	44,458,304	223,180,686.08	0.46
56	601288	农业银行	72,429,506	218,737,108.12	0.45
57	603986	兆易创新	1,526,331	217,059,531.51	0.45
58	600837	海通证券	21,859,756	214,444,206.36	0.44
59	600000	浦发银行	26,583,102	212,930,647.02	0.44
60	600016	民生银行	56,208,417	209,095,311.24	0.43
61	603501	韦尔股份	1,191,055	206,088,246.65	0.42
62	600406	国电南瑞	7,606,883	205,385,841.00	0.42
63	300122	智飞生物	1,822,351	202,299,184.51	0.41
64	601919	中远海控	14,351,260	199,482,514.00	0.41
65	688981	中芯国际	4,385,097	198,074,831.49	0.41
66	000625	长安汽车	11,344,214	196,481,786.48	0.40
67	600585	海螺水泥	5,434,782	191,739,108.96	0.39
68	600919	江苏银行	26,749,647	190,457,486.64	0.39
69	002709	天赐材料	3,062,438	190,054,902.28	0.39
70	600104	上汽集团	10,593,011	188,661,525.91	0.39
71	601688	XD 华泰证	13,266,470	188,383,874.00	0.39
72	601225	陕西煤业	8,811,407	186,625,600.26	0.38
73	000063	中兴通讯	7,227,762	184,524,763.86	0.38
74	002049	紫光国微	969,500	183,933,540.00	0.38
75	002241	歌尔股份	5,439,393	182,763,604.80	0.37
76	601601	中国太保	7,756,340	182,506,680.20	0.37
77	300142	沃森生物	3,637,054	175,997,043.06	0.36
78	002230	科大讯飞	4,232,089	174,446,708.58	0.36
79	600111	北方稀土	4,936,592	173,570,574.72	0.36
80	000661	长春高新	739,371	172,583,978.82	0.35
81	002371	北方华创	606,795	168,155,030.40	0.34
82	002459	晶澳科技	2,115,640	166,923,996.00	0.34
83	688599	天合光能	2,431,174	158,634,103.50	0.33
84	300450	先导智能	2,490,250	157,333,995.00	0.32
85	601988	中国银行	47,694,569	155,484,294.94	0.32
86	601211	国泰君安	10,208,680	155,171,936.00	0.32
87	002027	分众传媒	22,973,274	154,610,134.02	0.32
88	000338	潍柴动力	12,363,186	154,168,929.42	0.32
89	000100	TCL 科技	31,888,873	152,747,701.67	0.31
90	601169	北京银行	33,469,788	151,952,837.52	0.31
91	600660	福耀玻璃	3,632,412	151,871,145.72	0.31
92	601229	上海银行	22,525,267	147,540,498.85	0.30
93	600745	闻泰科技	1,725,775	146,880,710.25	0.30
94	601985	中国核电	21,350,640	146,465,390.40	0.30
95	600050	中国联通	42,083,701	145,609,605.46	0.30

96	601766	中国中车	27,564,509	143,335,446.80	0.29
97	601390	中国中铁	23,263,671	142,838,939.94	0.29
98	600893	航发动力	3,021,901	137,526,714.51	0.28
99	601669	中国电建	17,334,285	136,420,822.95	0.28
100	300347	泰格医药	1,191,100	136,321,395.00	0.28
101	603659	璞泰来	1,577,834	133,169,189.60	0.27
102	601658	邮储银行	24,638,400	132,800,976.00	0.27
103	000776	广发证券	6,729,520	125,842,024.00	0.26
104	600009	上海机场	2,181,891	123,713,219.70	0.25
105	600028	中国石化	30,288,200	123,575,856.00	0.25
106	600905	三峡能源	19,440,900	122,283,261.00	0.25
107	601009	南京银行	11,660,133	121,498,585.86	0.25
108	600019	宝钢股份	20,179,345	121,479,656.90	0.25
109	600010	包钢股份	51,628,068	121,325,959.80	0.25
110	600999	招商证券	8,395,590	120,980,451.90	0.25
111	600958	东方证券	11,843,452	120,921,644.92	0.25
112	600196	复星医药	2,741,004	120,850,866.36	0.25
113	002410	广联达	2,167,377	117,992,003.88	0.24
114	300896	爱美客	196,490	117,895,964.90	0.24
115	002179	中航光电	1,859,411	117,737,904.52	0.24
116	601628	中国人寿	3,770,333	117,181,949.64	0.24
117	601857	中国石油	21,970,818	116,445,335.40	0.24
118	600570	恒生电子	2,656,779	115,676,157.66	0.24
119	000895	双汇发展	3,938,023	115,384,073.90	0.24
120	002311	海大集团	1,895,037	113,721,170.37	0.23
121	002050	三花智控	4,103,790	112,772,149.20	0.23
122	601818	光大银行	37,443,907	112,706,160.07	0.23
123	300759	康龙化成	1,124,849	107,108,121.78	0.22
124	600760	中航沈飞	1,767,940	106,871,973.00	0.22
125	600346	恒力石化	4,777,239	106,245,795.36	0.22
126	002493	荣盛石化	6,899,451	106,182,550.89	0.22
127	601633	长城汽车	2,807,675	103,996,282.00	0.21
128	002074	国轩高科	2,252,494	102,713,726.40	0.21
129	300496	中科创达	776,678	101,340,945.44	0.21
130	688012	中微公司	860,331	100,443,644.25	0.21
131	600926	杭州银行	6,703,082	100,412,168.36	0.21
132	600460	士兰微	1,918,333	99,753,316.00	0.20
133	000538	云南白药	1,647,109	99,468,912.51	0.20
134	300782	卓胜微	732,147	98,839,845.00	0.20
135	300316	晶盛机电	1,456,300	98,431,317.00	0.20
136	600426	华鲁恒升	3,358,777	98,076,288.40	0.20
137	300661	圣邦股份	537,150	97,772,043.00	0.20

138	002821	凯莱英	335,600	96,988,400.00	0.20
139	001979	招商蛇口	7,196,814	96,653,212.02	0.20
140	002001	新和成	4,218,935	96,233,907.35	0.20
141	601989	中国重工	25,816,638	95,779,726.98	0.20
142	000768	中航西飞	3,149,255	95,390,933.95	0.20
143	600176	中国巨石	5,439,984	94,710,121.44	0.19
144	002202	金风科技	6,304,014	93,299,407.20	0.19
145	601939	建设银行	15,188,709	92,043,576.54	0.19
146	002920	德赛西威	621,871	92,036,908.00	0.19
147	603993	洛阳铝业	15,976,528	91,545,505.44	0.19
148	000596	古井贡酒	365,600	91,275,696.00	0.19
149	000963	华东医药	1,991,200	89,922,592.00	0.18
150	600763	通策医疗	513,207	89,523,829.08	0.18
151	601006	大秦铁路	13,508,233	89,019,255.47	0.18
152	000166	申万宏源	20,662,659	88,642,807.11	0.18
153	601138	XD 工业富	8,981,200	88,375,008.00	0.18
154	601877	正泰电器	2,432,421	87,032,023.38	0.18
155	600584	长电科技	3,214,000	86,778,000.00	0.18
156	601377	兴业证券	12,152,542	85,675,421.10	0.18
157	300207	欣旺达	2,698,949	85,286,788.40	0.17
158	601066	中信建投	2,941,100	85,027,201.00	0.17
159	601600	中国铝业	17,781,129	84,460,362.75	0.17
160	600029	南方航空	11,463,041	83,794,829.71	0.17
161	600600	青岛啤酒	801,860	83,329,291.20	0.17
162	688111	金山办公	421,556	83,097,118.72	0.17
163	600085	同仁堂	1,566,847	82,854,869.36	0.17
164	600588	用友网络	3,810,409	82,723,979.39	0.17
165	601186	中国铁建	10,404,750	82,197,525.00	0.17
166	600741	华域汽车	3,565,644	82,009,812.00	0.17
167	600188	兖矿能源	2,072,410	81,818,746.80	0.17
168	600383	金地集团	6,082,300	81,746,112.00	0.17
169	601838	成都银行	4,904,411	81,315,134.38	0.17
170	600132	重庆啤酒	553,279	81,110,701.40	0.17
171	000786	北新建材	2,301,311	79,671,386.82	0.16
172	688005	容百科技	611,051	79,094,441.44	0.16
173	600795	国电电力	20,203,235	78,994,648.85	0.16
174	603806	福斯特	1,205,009	78,952,189.68	0.16
175	000876	新希望	5,149,285	78,784,060.50	0.16
176	300408	三环集团	2,612,630	78,640,163.00	0.16
177	601111	中国国航	6,756,202	78,439,505.22	0.16
178	601117	中国化学	8,302,744	78,128,821.04	0.16
179	600150	中国船舶	4,084,100	77,516,218.00	0.16

180	600547	山东黄金	4,170,331	77,401,343.36	0.16
181	603019	中科曙光	2,650,575	76,919,686.50	0.16
182	601238	广汽集团	4,969,640	75,737,313.60	0.16
183	003816	中国广核	26,822,900	75,104,120.00	0.15
184	601800	中国交建	7,968,405	73,946,798.40	0.15
185	688396	华润微	1,248,104	73,725,503.28	0.15
186	300751	迈为股份	149,079	73,182,881.10	0.15
187	600989	宝丰能源	4,979,100	72,943,815.00	0.15
188	601100	恒立液压	1,181,034	72,893,418.48	0.15
189	600015	华夏银行	13,919,526	72,520,730.46	0.15
190	603369	今世缘	1,421,286	72,485,586.00	0.15
191	300999	金龙鱼	1,339,000	72,332,780.00	0.15
192	002648	卫星化学	2,749,785	71,081,942.25	0.15
193	600886	国投电力	6,740,199	70,772,089.50	0.15
194	600011	华能国际	9,948,452	70,037,102.08	0.14
195	601868	中国能建	29,371,300	69,609,981.00	0.14
196	601788	XD 光大证	4,407,224	69,457,850.24	0.14
197	300601	康泰生物	1,536,802	69,432,714.36	0.14
198	000157	中联重科	11,268,315	69,412,820.40	0.14
199	000301	东方盛虹	4,050,400	68,492,264.00	0.14
200	300763	锦浪科技	319,750	68,106,750.00	0.14
201	600115	中国东航	12,387,156	68,005,486.44	0.14
202	002236	大华股份	4,106,447	67,427,859.74	0.14
203	000425	徐工机械	12,446,943	67,089,022.77	0.14
204	300595	欧普康视	1,160,467	66,367,107.73	0.14
205	002601	龙佰集团	3,246,045	65,083,202.25	0.13
206	688008	XD 澜起科	1,071,079	64,885,965.82	0.13
207	002555	三七互娱	3,028,328	64,291,403.44	0.13
208	603185	上机数控	410,100	63,971,499.00	0.13
209	603486	科沃斯	524,000	63,870,360.00	0.13
210	002008	大族激光	1,915,734	63,468,267.42	0.13
211	000938	紫光股份	3,244,927	62,951,583.80	0.13
212	601916	浙商银行	18,936,303	62,868,525.96	0.13
213	603833	欧派家居	416,206	62,713,920.08	0.13
214	300628	亿联网络	823,032	62,673,886.80	0.13
215	002736	国信证券	6,543,900	62,625,123.00	0.13
216	603392	万泰生物	402,228	62,466,008.40	0.13
217	601901	方正证券	9,308,947	62,463,034.37	0.13
218	600941	中国移动	1,020,308	61,728,634.00	0.13
219	000977	浪潮信息	2,310,212	61,174,413.76	0.13
220	601336	新华保险	1,886,052	60,712,013.88	0.12
221	000069	华侨城 A	9,310,329	60,424,035.21	0.12

222	600352	浙江龙盛	5,887,032	59,929,985.76	0.12
223	600219	南山铝业	16,227,230	59,878,478.70	0.12
224	601995	中金公司	1,330,349	59,187,227.01	0.12
225	300413	芒果超媒	1,734,678	57,868,858.08	0.12
226	002841	视源股份	760,676	57,294,116.32	0.12
227	603290	斯达半导	147,300	56,843,070.00	0.12
228	002007	华兰生物	2,486,268	56,686,910.40	0.12
229	601618	中国中冶	16,147,348	56,515,718.00	0.12
230	002120	韵达股份	3,289,168	56,113,206.08	0.12
231	300529	健帆生物	1,096,770	55,814,625.30	0.11
232	600845	宝信软件	1,021,054	55,749,548.40	0.11
233	300454	深信服	535,126	55,535,376.28	0.11
234	601799	星宇股份	324,700	55,523,700.00	0.11
235	688126	沪硅产业	2,395,531	55,049,302.38	0.11
236	601360	三六零	6,456,605	55,010,274.60	0.11
237	002252	上海莱士	9,181,295	54,445,079.35	0.11
238	300003	乐普医疗	2,903,754	53,922,711.78	0.11
239	000703	恒逸石化	4,996,510	52,513,320.10	0.11
240	601155	新城控股	2,044,567	51,993,338.81	0.11
241	603882	金域医学	626,279	51,699,331.45	0.11
242	600332	白云山	1,610,052	50,861,542.68	0.10
243	300433	蓝思科技	4,515,589	49,987,570.23	0.10
244	601878	浙商证券	4,377,736	49,818,635.68	0.10
245	688036	传音控股	549,823	49,060,706.29	0.10
246	002602	世纪华通	10,149,517	48,920,671.94	0.10
247	603260	合盛硅业	412,900	48,705,684.00	0.10
248	600489	中金黄金	6,573,336	48,576,953.04	0.10
249	600918	中泰证券	6,341,500	48,512,475.00	0.10
250	300919	中伟股份	390,422	48,373,285.80	0.10
251	601021	春秋航空	827,747	48,299,037.45	0.10
252	002938	鹏鼎控股	1,583,900	47,849,619.00	0.10
253	000066	中国长城	4,392,300	47,524,686.00	0.10
254	300033	同花顺	490,496	47,161,190.40	0.10
255	603899	晨光股份	840,593	47,140,455.44	0.10
256	688169	石头科技	75,065	46,292,585.50	0.09
257	000708	中信特钢	2,291,454	46,172,798.10	0.09
258	601728	中国电信	12,281,500	45,809,995.00	0.09
259	600183	生益科技	2,621,335	44,536,481.65	0.09
260	300223	北京君正	415,600	44,157,500.00	0.09
261	601865	福莱特	1,151,211	43,861,139.10	0.09
262	002916	深南电路	464,151	43,495,590.21	0.09
263	600018	上港集团	7,406,942	43,182,471.86	0.09

264	601898	中煤能源	4,134,100	42,911,958.00	0.09
265	600362	江西铜业	2,346,929	41,845,744.07	0.09
266	300957	贝泰妮	182,100	39,612,213.00	0.08
267	002414	高德红外	2,979,818	38,350,257.66	0.08
268	002791	坚朗五金	293,600	38,085,792.00	0.08
269	600161	天坛生物	1,557,031	37,804,712.68	0.08
270	601216	君正集团	7,660,709	37,384,259.92	0.08
271	600061	国投资本	5,812,644	36,968,415.84	0.08
272	601319	中国人保	7,182,400	36,342,944.00	0.07
273	002568	百润股份	1,208,812	36,312,712.48	0.07
274	688561	奇安信	644,922	35,986,647.60	0.07
275	000408	藏格矿业	1,073,100	35,347,914.00	0.07
276	600606	绿地控股	8,706,469	34,477,617.24	0.07
277	601966	玲珑轮胎	1,344,661	34,114,049.57	0.07
278	600655	豫园股份	3,519,818	33,227,081.92	0.07
279	601998	中信银行	6,930,166	32,918,288.50	0.07
280	603160	汇顶科技	523,252	32,404,996.36	0.07
281	002600	领益智造	6,452,521	32,391,655.42	0.07
282	688363	华熙生物	217,560	30,932,680.80	0.06
283	688065	凯赛生物	269,332	30,111,317.60	0.06
284	601881	中国银河	3,035,952	29,357,655.84	0.06
285	600025	华能水电	4,109,200	28,723,308.00	0.06
286	002064	华峰化学	3,379,095	28,519,561.80	0.06
287	603195	公牛集团	176,500	26,988,615.00	0.06
288	300866	安克创新	367,100	24,346,072.00	0.05
289	002607	中公教育	4,197,454	24,303,258.66	0.05
290	603087	甘李药业	501,680	24,065,589.60	0.05
291	002032	苏泊尔	368,680	20,771,431.20	0.04
292	000800	一汽解放	2,111,800	19,724,212.00	0.04
293	601236	红塔证券	2,116,210	19,320,997.30	0.04
294	601808	中海油服	1,341,000	18,706,950.00	0.04
295	605499	东鹏饮料	99,100	16,932,226.00	0.03
296	000877	天山股份	1,350,400	16,609,920.00	0.03
297	300979	华利集团	201,500	14,725,620.00	0.03
298	601825	沪农商行	2,136,000	13,392,720.00	0.03
299	601698	中国卫通	993,300	11,234,223.00	0.02
300	001289	龙源电力	327,312	7,122,309.12	0.01

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688223	晶科能源	213,000	3,082,110.00	0.01
2	688234	天岳先进	6,759	440,619.21	0.00
3	688400	凌云光	13,111	287,524.23	0.00
4	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.00
5	301175	中科环保	63,694	243,311.08	0.00
6	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
7	301239	普瑞眼科	5,747	193,386.55	0.00
8	688251	井松智能	3,392	124,350.72	0.00
9	688237	超卓航科	2,891	119,311.57	0.00
10	301233	盛帮股份	1,576	65,435.52	0.00
11	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
12	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
13	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
14	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
15	301207	华兰疫苗	569	32,102.98	0.00
16	301215	中汽股份	4,743	30,307.77	0.00
17	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
18	301201	诚达药业	353	25,253.62	0.00
19	301266	宇邦新材	517	24,335.19	0.00
20	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
21	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
22	300834	星辉环材	635	19,069.05	0.00
23	301256	华融化学	1,831	18,456.48	0.00
24	301112	信邦智能	399	17,970.96	0.00
25	301153	中科江南	398	17,504.04	0.00
26	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00
27	301235	华康医疗	418	15,854.74	0.00
28	301160	翔楼新材	392	14,762.72	0.00
29	301117	佳缘科技	262	14,263.28	0.00
30	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
31	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
32	301258	富士莱	295	12,295.60	0.00
33	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
34	301116	益客食品	577	11,805.42	0.00
35	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
36	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
37	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
38	301137	哈焊华通	644	10,297.56	0.00
39	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
40	301222	浙江恒威	332	9,614.72	0.00
41	301288	清研环境	452	9,030.96	0.00

42	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
43	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
44	301110	青木股份	202	8,049.70	0.00
45	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
46	301158	德石股份	379	7,724.02	0.00
47	301279	金道科技	296	6,751.76	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	1,988,392,054.16	3.50
2	000858	五粮液	976,440,873.84	1.72
3	000333	美的集团	832,862,926.26	1.46
4	002594	比亚迪	709,242,300.35	1.25
5	300059	东方财富	689,968,299.63	1.21
6	002415	海康威视	520,392,386.97	0.91
7	002475	立讯精密	481,862,172.16	0.85
8	300760	迈瑞医疗	434,483,863.11	0.76
9	000651	格力电器	424,880,626.63	0.75
10	000725	京东方 A	416,303,601.40	0.73
11	000001	平安银行	407,823,641.95	0.72
12	002142	宁波银行	405,519,278.76	0.71
13	002714	牧原股份	377,387,955.10	0.66
14	002371	北方华创	375,906,165.82	0.66
15	000002	万科 A	370,897,108.61	0.65
16	000792	盐湖股份	364,347,609.67	0.64
17	002460	赣锋锂业	335,734,885.26	0.59
18	300124	汇川技术	324,972,644.46	0.57
19	300122	智飞生物	304,552,089.25	0.54
20	002812	恩捷股份	303,870,754.00	0.53

注：不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,169,618,328.97	3.81
2	000858	五粮液	1,074,757,805.75	1.89
3	000333	美的集团	910,793,225.40	1.60
4	002594	比亚迪	811,959,585.75	1.43
5	300059	东方财富	726,298,669.46	1.28
6	002415	海康威视	557,675,054.80	0.98

7	002475	立讯精密	543,499,179.00	0.96
8	000651	格力电器	476,228,623.72	0.84
9	300760	迈瑞医疗	473,049,205.19	0.83
10	000001	平安银行	441,598,515.72	0.78
11	002142	宁波银行	435,468,065.66	0.77
12	002371	北方华创	432,918,145.29	0.76
13	002714	牧原股份	404,287,655.03	0.71
14	000002	万 科 A	396,780,671.81	0.70
15	002460	赣锋锂业	393,282,629.38	0.69
16	000725	京东方 A	385,126,330.34	0.68
17	300124	汇川技术	367,348,034.97	0.65
18	002812	恩捷股份	342,148,658.72	0.60
19	300122	智飞生物	338,367,946.63	0.59
20	002352	顺丰控股	328,372,733.44	0.58

注：不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	24,350,229,331.36
卖出股票收入（成交）总额	25,817,802,665.91

注：不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	6,367,474.47	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,367,474.47	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113060	浙 22 转债	63,670	6,367,474.47	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属投资。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

注：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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

注：本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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情况，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

7.12.2 基金投资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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	133,811,706.55
2	应收清算款	11,065,940.90
3	应收股利	2,758,856.04
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	912,811.32
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	148,549,314.81

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	167,996,400.00	0.34	转融通证券出借
2	300059	东方财富	34,373,820.00	0.07	转融通证券出借
3	002594	比亚迪	18,141,856.00	0.04	转融通证券出借
4	000858	五粮液	12,620,625.00	0.03	转融通证券出借
5	601318	中国平安	4,664,331.00	0.01	转融通证券出借
6	601012	隆基绿能	4,304,298.00	0.01	转融通证券出借
7	600036	招商银行	3,751,580.00	0.01	转融通证券出借
8	000333	美的集团	3,430,152.00	0.01	转融通证券出借
9	601166	兴业银行	2,815,850.00	0.01	转融通证券出借

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688223	晶科能源	3,082,110.00	0.01	新股流通受限
2	688234	天岳先进	440,619.21	0.00	新股流通受限
3	688400	凌云光	287,524.23	0.00	新股流通受限
4	688322	奥比中光	264,313.71	0.00	新股流通受限
5	301175	中科环保	243,311.08	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

8.1.1 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

	额	持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
427,806	25,239.92	6,938,679,287.00	64.26	3,859,108,403.00	35.74

8.1.2 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	505,570,777.00	4.6822

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	中央汇金投资有限责任公司	2,423,958,601.00	22.45
2	国泰君安证券股份有限公司	731,213,133.00	6.77
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	152,775,000.00	1.41
4	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	144,560,852.00	1.34
5	易方达基金—中央汇金资产管理有限责任公司—易方达基金—汇金资管单一资产管理计划	122,500,000.00	1.13
6	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	95,277,100.00	0.88
7	泰康养老保险股份有限公司—自有资金	73,759,100.00	0.68
8	申万宏源证券—工商银行—申万宏源万利增享 2 号集合资产管理计划	66,700,000.00	0.62
9	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	64,331,300.00	0.60
10	兴业财富资管—兴业银行—兴业财富—兴业集合资产管理计划	64,100,100.00	0.59

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（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	11,340,487,690.00
本报告期基金总申购份额	12,507,300,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,050,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	10,797,787,690.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2022 年 3 月 15 日，公司股东批准 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	4	30,630,902,617.77	61.17	4,092,089.59	60.48	-
华泰证券	2	12,431,878,258.66	24.83	1,699,651.56	25.12	-
中信建投	2	6,353,420,753.67	12.69	887,703.04	13.12	-
方正证券	2	660,251,272.40	1.32	86,676.03	1.28	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	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	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：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。

3、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	40,119,690.76	100.00	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-
山西证券	-	-	-	-	-	-
上海证券	-	-	-	-	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
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	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022年6月17日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市ETF实施申赎业务多码合一的公告	证监会规定报刊和网站	2022年6月17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	2022年5月28日
4	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	2022年5月26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	2022年5月11日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022年4月29日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司	证监会规定报刊和网站	2022年4月18日

	行 E 通平台费率优惠活动的公告		
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与财通证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
9	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 12 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 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	2022 年 1 月 1 日

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20220101-20220121;20220214-20220425;20220517-20220527;20220531-20220630;	2,423,958,601.00	0.00	0.00	2,423,958,601.00	22.4487

产品特有风险

本基金报告期内有单一机构持有基金份额超过 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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 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

12.2 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

12.3 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 8 月 30 日