

**华夏沪深 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：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二二年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2022 年 8 月 26 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 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
§2 基金简介	3
§3 主要财务指标和基金净值表现	4
3.1 主要会计数据和财务指标	4
3.2 基金净值表现	4
§4 管理人报告	5
§5 托管人报告	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	162
7.1 期末基金资产组合情况	162
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	162
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	163
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	171
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	172
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	173
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	173
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	173
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	173
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	173
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	173
7.12 投资组合报告附注	174
§8 基金份额持有人信息	175
§9 开放式基金份额变动	176
§10 重大事件揭示	176
§11 影响投资者决策的其他重要信息	179
§12 备查文件目录	180

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：300ETF 基金）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
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	5,122,149,828 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	2013 年 1 月 16 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、股指期货投资策略、权证投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为沪深 300 指数。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

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		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	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	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

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 日至 2022 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-1,275,625,907.00
本期利润	-2,424,367,232.81
加权平均基金份额本期利润	-0.4460
本期加权平均净值利润率	-10.29%
本期基金份额净值增长率	-8.55%
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	10,613,091,462.47
期末可供分配基金份额利润	2.0720
期末基金资产净值	23,126,715,197.06
期末基金份额净值	4.5150
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	121.34%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	10.32%	1.06%	9.62%	1.07%	0.70%	-0.01%
过去三个	7.11%	1.43%	6.21%	1.43%	0.90%	0.00%

月						
过去六个月	-8.55%	1.45%	-9.22%	1.45%	0.67%	0.00%
过去一年	-12.79%	1.25%	-14.15%	1.25%	1.36%	0.00%
过去三年	23.04%	1.27%	17.24%	1.27%	5.80%	0.00%
自基金合同生效起至今	121.34%	1.44%	88.35%	1.44%	32.99%	0.00%

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

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2012 年 12 月 25 日至 2022 年 6 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

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日,是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京,在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司,在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、

境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人，首批商品期货 ETF 基金管理人，以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、Smart Beta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2022 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏兴和混合排序第 1/188、华夏兴华混合(A 类)排序第 16/188；在养老目标日期 FOF(2040)(A 类)中华夏养老 2040 三年持有混合（FOF）排序第 2/14；在定开偏股型基金(A 类)中华夏磐利一年定开混合(A 类)排序第 2/77、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排序第 10/77、华夏磐益一年定开混合排序第 11/77、华夏成长精选 6 个月定开混合(A 类)排序第 24/77；在医药医疗健康行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排序第 9/52；在消费行业偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排序第 10/53；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排序第 22/134；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏行业景气混合排序第 29/905、华夏产业升级混合(A 类)排序第 55/905、华夏盛世混合排序第 67/905；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排序第 59/286；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排序第 74/436。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中华夏大中华信用债券(QDII)(A 类)排序第 1/25；在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排序第 3/13；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 3-5 年政金债指数(A 类)排序第 7/98；在中短期纯债债券型基金(A 类)中华夏中短债债券(A 类)排序第 21/84；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎航债券(A 类)排序第 28/642；在偏债型基金(A 类)中华夏磐泰混合（LOF）(A 类)排序第 32/350、华夏睿磐泰盛混合排序第 36/350、华夏永康添福混合(A 类)排序第 46/350、华夏睿磐泰利混合(A 类)排序第 63/350。

指数与量化产品：在 QDII 跨境股票 ETF 基金中华夏纳斯达克 100ETF（QDII）排序第 4/19；在规模指数股票 ETF 基金中华夏中证 1000ETF 排序第 3/116、华夏中证 500ETF 排序第 18/116；在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证四川国改 ETF 联接(A 类)排序第 3/60、华夏中证央企 ETF

联接(A类)排序第 15/60;在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证全指房地产 ETF 联接(A类)排序第 4/24、华夏中证银行 ETF 联接(A类)排序第 6/24;在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证全指房地产 ETF 排序第 7/41、华夏中证银行 ETF 排序第 10/41;在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中华夏中证 500ETF 联接(A类)排序第 15/80;在主题指数股票 ETF 基金中华夏中证新能源 ETF 排序第 14/169、华夏中证四川国改 ETF 排序第 17/169、华夏中证新能源汽车 ETF 排序第 24/169。

在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上,在最具含金量、最能体现基金公司综合实力的“年度十大明星基金公司奖”评选中,华夏基金凭借在多项业务中的优异中长期表现,成功获奖。此外,凭借 QDII 基金的良好业绩表现,以及在境内外市场的持续布局,华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。

在客户服务方面,2022 年上半年,华夏基金继续以客户需求为导向,努力提高客户使用的便利性和服务体验:(1)华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式,拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升,满足客户支付需求;(2)华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能,增加客户操作便利性;(3)与兰州银行、九江银行、晋商银行、九州证券等代销机构合作,拓展更加丰富的客户理财渠道;(4)开展“压岁钱手账”、“基金视力表”、“与干饭人灵魂相认”、“童言童语话理财”、“FOF 产品不是小透明”等活动,为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
赵宗庭	本基金的基金经理	2017-04-17	-	14 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员,嘉实基金管理有限公司指数投资部基金经理助理,嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2012-12-25	-	22 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间)、恒生交易型开放式指数证券投资

					基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间）、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理（2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理（2019 年 2 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理（2021 年 1 月 6 日至 2021 年
--	--	--	--	--	--

					5 月 26 日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理(2013 年 3 月 28 日至 2021 年 5 月 27 日期间)等。
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②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。

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

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
张弘弢	公募基金	8	123,100,702,178.27	2009-07-10
	私募资产管理计划	1	12,438,747.76	2021-11-18
	其他组合	-	-	-
	合计	9	123,113,140,926.03	

注：报告期内，张弘弢管理的 1 个私募资产管理计划已于 2022 年 4 月 27 日终止。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《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》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 54 次，其中 3 次为投资策略需要所致，为不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据；其余均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为沪深 300 指数，沪深 300 指数由沪深 A 股中规模大、流动性好、最具代表性的 300 只股票组成，自 2005 年 4 月 8 日起正式发布，以综合反映沪深 A 股市场整体表现。沪深 300 指数是内地首只股指期货的标的指数。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，外部形势较为复杂，全球通胀和衰退风险给中国外需带来了一定的压力。美国与欧洲均面临高通胀的困扰，全球 PMI 进入下降周期，多个指标表明全球经济面临衰退风险。国内方面，上半年疫情对经济带来了一定程度的冲击，但近期负面影响正在逐步消退。在克服了国际环境复杂多变、国内疫情反复冲击等诸多不利因素后，5 月主要经济指标降幅收窄，6 月多项经济数据企稳回升，二季度经济实现正增长。6 月我国消费增速由负转正，同比增长 3.1%；服务业生产指数同比增长 1.3%；总体来看，上半年国内生产总值同比增长 2.5%，其中二季度国内生产总值同比增长 0.4%。

市场方面，受通胀及地缘政治的影响，海外市场上半年大多呈现单边下跌的走势；而国内在稳健的货币政策以及稳中向好的宏观经济形势的支撑下，今年前六个月，A 股市场的走势呈现 V 型反转。一季度，受疫情冲击与俄乌冲突影响，A 股呈现出震荡下行的总体走势；而进入二季度以来，虽国际大环境的不确定性程度依然较高，但 A 股市场却体现出了十足的韧性，走势相对独立，收获了较高的涨幅。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回、成份股调整、转融通证券出借等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经上海证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商为中信证券股份有限公司、中国银河证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、招商证券股份有限公司、粤开证券股份有限公司、东方证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、西部证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、申万宏源股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、华安证券股份有限公司、国盛证券有限责任公司、中信建投证券股份有限公司、国信证券股份有限公司、光大证券股份有限公司、海通证券股份有限公司等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 4.5150 元，本报告期份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准增长率-9.22%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.67%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国际方面，全球通胀水平持续攀升，主要经济体偿债压力不断加大，稳定外需难度也在明显增加，外部环境更趋复杂严峻。随着美联储等海外主要央行货币紧缩进程的加快，当前国际金融市场的关注焦点正从通胀转向衰退。国内方面，下半年外部不稳定、不确定的因素仍较多，但随着一系列稳增长政策措施的落地见效，以及高效统筹疫情防控和经济社会发展成效的持续显现，下半年我国经济有望继续回升并运行在合理区间。

市场方面，下半年股市结构性机会仍存，业绩增速较快、具有较高景气度与盈利确定性的板块值得重点关注；此外，国内外压力之下，市场仍存在一定的不确定性，从降低风险的角度来看，低估值、高股息板块具有一定的配置价值。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一分投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》及本基金的基金合同等规定，本基金本报告期实施利润分配 1 次，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、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——华夏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

本托管人依法对华夏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 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏沪深 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	167,589,619.99	27,638,718.23
结算备付金		137,266,766.75	188,358,586.41
存出保证金		34,279,572.53	27,128,180.22
交易性金融资产	6.4.7.2	22,852,332,013.79	28,697,060,869.42
其中：股票投资		22,848,870,755.87	28,697,060,869.42
基金投资		-	-
债券投资		3,461,257.92	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		9,588,242.62	111,273,067.79
应收股利		2,830,033.11	2,024.70

应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	840,316.73	1,563,446.91
资产总计		23,204,726,565.52	29,053,024,893.68
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		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		28,013,000.53	105,353,159.01
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,137,296.60	11,676,773.42
应付托管费		1,827,459.30	2,335,354.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		89,009.55	141,194.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	38,944,602.48	24,671,881.60
负债合计		78,011,368.46	144,178,363.03
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	12,513,623,734.59	14,070,329,670.83
未分配利润	6.4.7.8	10,613,091,462.47	14,838,516,859.82
净资产合计		23,126,715,197.06	28,908,846,530.65
负债和净资产总计		23,204,726,565.52	29,053,024,893.68

注：①报告截止日 2022 年 6 月 30 日，基金份额净值 4.5150 元，基金份额总额 5,122,149,828.00 份。

②以下比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表中“其他资产”项目的“上年度末”余额，2021 年年度报告资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在 2022 年中期报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

6.2 利润表

会计主体：华夏沪深 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 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
一、营业总收入		-2,350,199,172.47	688,856,522.13
1.利息收入		16,938,086.75	27,444,705.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,475,992.18	2,227,021.28
债券利息收入		-	7,697.77
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	43,134.24
证券出借利息收入		15,462,094.57	25,166,852.50
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,221,432,325.13	3,313,552,583.88
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,418,663,854.16	3,085,540,630.65
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	4,217,550.32	7,774,193.64
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-30,310,557.64	11,213,811.84
股利收益	6.4.7.14	223,324,536.35	209,023,947.75
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	-1,148,741,325.81	-2,659,065,276.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	3,036,391.72	6,924,508.53
减：二、营业总支出		74,168,060.34	103,090,547.83
1.管理人报酬		58,719,557.24	70,516,967.71
2.托管费		11,743,911.43	14,103,393.58
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		55,626.25	120,427.24
8.其他费用	6.4.7.18	3,648,965.42	18,349,759.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,424,367,232.81	585,765,974.30
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,424,367,232.81	585,765,974.30
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,424,367,232.81	585,765,974.30

注：以下比较数据已根据本年《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>》中的利润表格式的要求进行列示：2021 年中期报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目

的“本期”金额合并列示在 2022 年中期报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏沪深 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(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	14,070,329,670.83	-	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65
二、本期期初净资产（基金净值）	14,070,329,670.83	-	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-1,556,705,936.24	-	-4,225,425,397.35	-5,782,131,333.59
（一）、综合收益总额	-	-	-2,424,367,232.81	-2,424,367,232.81
（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）	-1,556,705,936.24	-	-1,378,206,728.10	-2,934,912,664.34
其中：1.基金申购款	5,182,423,576.78	-	3,829,694,435.38	9,012,118,012.16
2.基金赎回款	-6,739,129,513.02	-	-5,207,901,163.48	-11,947,030,676.50
（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）	-	-	-422,851,436.44	-422,851,436.44
四、本期期末净资产（基金净值）	12,513,623,734.59	-	10,613,091,462.47	23,126,715,197.06
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(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	14,083,522,094.73	-	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58

二、本期期初净资产（基金净值）	14,083,522,094.73	-	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-648,627,473.92	-	-991,791,502.75	-1,640,418,976.67
（一）、综合收益总额	-	-	585,765,974.30	585,765,974.30
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-648,627,473.92	-	-1,043,581,493.53	-1,692,208,967.45
其中：1.基金申购款	7,581,245,859.51	-	8,763,088,782.90	16,344,334,642.41
2.基金赎回款	-8,229,873,333.43	-	-9,806,670,276.43	-18,036,543,609.86
（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）	-	-	-533,975,983.52	-533,975,983.52
四、本期期末净资产（基金净值）	13,434,894,620.81	-	15,512,876,477.10	28,947,771,097.91

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

华夏沪深 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]1653 号《关于核准华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金募集的批复》的核准，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金运作管理办法》、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自 2012 年 12 月 17 日至 2012 年 12 月 19 日期间共募集 602,764,295.00 元（不含认购资金利息），业经德勤华永会计师事务所有限公司德师报（验）字（12）第 0075 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利

息折合 44,550 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证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。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

根据《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》，基金管理人华夏基金管理有限公司确定 2013 年 1 月 9 日为基金份额折算日。折算后的基金份额净值与 2013 年 1 月 9 日沪深 300 指数收盘值的千分之一基本一致。折算前基金份额总额为 16,020,609,566 份，本次基金份额折算比例为 0.40932601，折算后基金份额总额为 6,557,649,828 份。

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颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、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》、中国证监会发布的《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>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 6.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

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

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

除下述变更后的会计政策外，本基金报告期所采用的其他会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》(统称“新金融工具准则”)、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日起执行新金融工具准则。根据衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则的累积影响数调整本报告期期初未分配利润。

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。

于 2021 年 12 月 31 日，银行存款、结算备付金、存出保证金、买入返售金融资产、交易性金融资产、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，同时以摊余成本法计量的金融资产按照预期信用损失为基准，计提损失准备 0.00 元，对本基金期初未分配利润无影响。

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、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 27,638,718.23 元、188,358,586.41 元、27,128,180.22 元、1,563,446.91 元、111,273,067.79 元和 2,024.70 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、应收清算款和应收股利，金额分别为 27,643,491.91 元、188,471,426.68 元、27,128,816.90 元、1,445,196.28 元、111,273,067.79 元和 2,024.70 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 28,697,060,869.42 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 28,697,060,869.42 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 105,353,159.01 元、11,676,773.42 元、2,335,354.69 元、2,879,002.64 元和 21,792,878.96 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 105,353,159.01 元、11,676,773.42 元、2,335,354.69 元、2,879,002.64 元和 21,792,878.96 元。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、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[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、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《财政部、国家税务总局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《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。
- (2) 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。
- (3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。
- (4) 存款利息收入不征收增值税。
- (5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。
- (6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- (7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。
- (8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时

代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，全额计入应纳税所得额，持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

（9）基金在境内卖出股票按 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。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

（10）基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

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

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	167,589,619.99
等于：本金	167,576,221.31
加：应计利息	13,398.68
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
合计	167,589,619.99

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	23,212,963,568.58	-	22,848,870,755.87	-364,092,812.71
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	257.92	3,461,257.92	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	257.92	3,461,257.92	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,216,424,568.58	257.92	22,852,332,013.79	-364,092,812.71

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

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			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	249,443,356.10	-	-	-
其中：股指期货	249,443,356.10	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	249,443,356.10	-	-	-

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
IF2209	沪深 300 期货 IF2209 合约	200.00	266,832,000.00	17,388,643.90
合计	-	-	-	17,388,643.90
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	17,388,643.90
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，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/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债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。

6.4.7.4 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

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 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	840,316.73
待摊费用	-
合计	840,316.73

6.4.7.6 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	1,886,635.14
其中：交易所市场	1,886,635.14
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	123,972.33
应付指数使用费	3,523,173.32
应退替代款	33,340,067.65
可退替代款	70,754.04
合计	38,944,602.48

6.4.7.7 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	5,759,349,828.00	14,070,329,670.83
本期申购	2,121,300,000.00	5,182,423,576.78
本期赎回（以“-”号填列）	-2,758,500,000.00	-6,739,129,513.02
本期末	5,122,149,828.00	12,513,623,734.59

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	23,782,737,048.88	-8,944,220,189.06	14,838,516,859.82
本期利润	-1,275,625,907.00	-1,148,741,325.81	-2,424,367,232.81
本期基金份额交易产生的变动数	-2,539,983,176.70	1,161,776,448.60	-1,378,206,728.10
其中：基金申购款	8,383,440,394.57	-4,553,745,959.19	3,829,694,435.38
基金赎回款	-10,923,423,571.27	5,715,522,407.79	-5,207,901,163.48
本期已分配利润	-422,851,436.44	-	-422,851,436.44
本期末	19,544,276,528.74	-8,931,185,066.27	10,613,091,462.47

6.4.7.9 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	133,601.66
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	1,325,293.90
其他	17,096.62
合计	1,475,992.18

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 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	-973,312,307.36
股票投资收益——赎回差价收入	-445,351,546.80
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	-1,418,663,854.16

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	7,213,369,254.19
减：卖出股票成本总额	8,177,267,370.78
减：交易费用	9,414,190.77
买卖股票差价收入	-973,312,307.36

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	11,947,030,676.50
减：现金支付赎回款总额	4,891,805,310.50
减：赎回股票成本总额	7,500,576,912.80
减：交易费用	-
赎回差价收入	-445,351,546.80

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
债券投资收益——利息收入	2,387.02
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,215,163.30
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	4,217,550.32

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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	20,623,700.54

交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	16,406,300.00
减：应计利息总额	2,167.06
减：交易费用	70.18
买卖债券差价收入	4,215,163.30

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

6.4.7.13 衍生工具收益

6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年6月30日
股指期货投资收益	-30,310,557.64

6.4.7.14 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	223,324,536.35
其中：证券出借权益补偿收入	14,324,142.59
基金投资产生的股利收益	-
合计	223,324,536.35

6.4.7.15 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	-1,168,879,169.71
——股票投资	-1,168,879,169.71
——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	20,137,843.90
——权证投资	-
——期货投资	20,137,843.90

4.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	-1,148,741,325.81

6.4.7.16 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	-
基金申购费收入	-
替代损益	3,036,391.72
合计	3,036,391.72

6.4.7.17 信用减值损失

无。

6.4.7.18 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	64,464.96
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	1,819.78
指数使用费	3,523,173.31
合计	3,648,965.42

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无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

本基金本报告期不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。

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
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(“华夏沪深 300ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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
中信证券	5,221,250,264.87	40.66%	3,925,986,846.13	19.58%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券	20,623,700.54	100.00%	43,031,975.00	64.69%

6.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	20,000,000.00	28.57%

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期	占当期佣金	期末应付佣金余额	占期末应付佣金

	佣金	总量的比例		总额的比例
中信证券	424,481.76	40.65%	325,241.09	17.24%
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
中信证券	319,200.25	19.57%	310,275.67	9.77%

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

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

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	58,719,557.24	70,516,967.71
其中：支付销售机构的客户维护费	145,406.71	93,254.99

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	11,743,911.43	14,103,393.58

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

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	期末证券出借业务余额
中信证券	3,960,551,263.31	4,258,270.40	368,165,260.25	185,301.55
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	期末证券出借业务余额
中信证券	4,645,534,490.42	5,195,178.72	207,681,798.00	109,938.21

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
中信证券	2022010400021237	华大基因	2022-01-04	586,278.00	6,600.00	28	2.50	1,384.27	-	-
中信证券	2022010400021239	阳光电源	2022-01-04	1,787,280.00	13,200.00	28	3.00	5,063.96	-	-
中信证券	2022010400021241	英科医疗	2022-01-04	381,810.00	6,600.00	28	3.30	1,189.98	-	-
中	202201040002	泰	2022-01-	782,364.00	6,600.00	28	2.40	1,773.3	-	-

信 证 券	1243	格 医 药	04					6		
中 信 证 券	202201040002 1245	先 导 智 能	2022-01- 04	943,800.00	13,200.0 0	28	2.80	2,495.8 3	-	-
中 信 证 券	202201040002 1247	汇 川 技 术	2022-01- 04	1,382,040. 00	19,800.0 0	28	2.80	3,654.7 3	-	-
中 信 证 券	202201040002 1249	温 氏 股 份	2022-01- 04	1,364,880. 00	66,000.0 0	28	3.20	4,124.9 7	-	-
中 信 证 券	202201040002 1251	同 花 顺	2022-01- 04	954,360.00	6,600.00	28	2.90	2,613.8 8	-	-
中 信 证 券	202201040002 1271	贝 达 药 业	2022-01- 04	529,848.00	6,600.00	28	2.90	1,451.1 9	-	-
中 信 证 券	202201040002 1273	中 国 通 号	2022-01- 04	199,188.00	39,600.0 0	28	2.10	395.06	-	-
中 信 证 券	202201040002 1275	蓝 思 科 技	2022-01- 04	464,904.00	19,800.0 0	28	2.50	1,097.6 9	-	-
中 信 证 券	202201040002 1277	沪 硅 产 业	2022-01- 04	336,468.00	13,200.0 0	28	3.30	1,048.6 6	-	-
中 信 证 券	202201040002 1279	东 方 财 富	2022-01- 04	4,496,844. 00	125,400. 00	28	3.20	13,590. 47	-	-
中 信 证 券	202201040002 1281	宋 城 演 艺	2022-01- 04	401,280.00	26,400.0 0	28	3.30	1,250.6 5	-	-
中	202201040002	宋	2022-01-	304,000.00	20,000.0	14	3.40	401.96	-	-

信 证 券	1283	城 演 艺	04		0					
中 信 证 券	202201040002 1285	爱 尔 眼 科	2022-01- 04	253,260.00	6,000.00	14	3.30	325.02	-	-
中 信 证 券	202201040002 1287	爱 尔 眼 科	2022-01- 04	1,671,516. 00	39,600.0 0	28	3.20	5,051.7 0	-	-
中 信 证 券	202201040002 1289	亿 联 网 络	2022-01- 04	515,988.00	6,600.00	28	2.80	1,364.5 0	-	-
中 信 证 券	202201040002 1291	沃 森 生 物	2022-01- 04	1,454,112. 00	26,400.0 0	28	2.90	3,982.6 5	-	-
中 信 证 券	202201060000 0403	爱 尔 眼 科	2022-01- 06	3,585,120. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,509.5 8	-	-
中 信 证 券	202201060000 0411	智 飞 生 物	2022-01- 06	3,756,490. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,629.5 4	-	-
中 信 证 券	202201060000 0421	东 方 财 富	2022-01- 06	7,481,388. 00	220,300. 00	14	1.80	5,236.9 7	-	-
中 信 证 券	202201060000 0422	沃 森 生 物	2022-01- 06	4,112,584. 00	72,100.0 0	14	1.80	2,878.8 1	-	-
中 信 证 券	202201060000 1232	迈 瑞 医 疗	2022-01- 06	2,602,600. 00	7,700.00	14	2.90	2,935.1 5	-	-
中 信 证 券	202201060001 0033	宋 城 演 艺	2022-01- 06	260,440.00	17,000.0 0	14	3.40	344.36	-	-
中	202201060001	爱	2022-01-	1,474,400.	38,000.0	14	3.30	1,892.1	-	-

信 证 券	0035	尔 眼 科	06	00	0			5		
中 信 证 券	202201070001 0579	中 国 通 号	2022-01- 07	200,376.00	39,600.0 0	28	2.10	362.35	-	-
中 信 证 券	202201070001 0581	同 花 顺	2022-01- 07	854,634.00	6,600.00	28	2.90	2,134.2 1	-	-
中 信 证 券	202201070001 0583	贝 达 药 业	2022-01- 07	513,480.00	6,600.00	28	2.90	1,282.2 7	-	-
中 信 证 券	202201070001 0585	爱 尔 眼 科	2022-01- 07	1,533,708. 00	39,600.0 0	28	3.20	4,226.2 2	-	-
中 信 证 券	202201070001 0587	东 方 财 富	2022-01- 07	4,232,250. 00	125,400. 00	28	3.20	11,662. 20	-	-
中 信 证 券	202201070001 0589	亿 纬 锂 能	2022-01- 07	2,086,722. 00	19,800.0 0	28	2.80	5,031.3 2	-	-
中 信 证 券	202201070001 0591	阳 光 电 源	2022-01- 07	1,693,560. 00	13,200.0 0	28	3.00	4,375.0 3	-	-
中 信 证 券	202201070001 0593	汇 川 技 术	2022-01- 07	1,314,522. 00	19,800.0 0	28	2.80	3,169.4 6	-	-
中 信 证 券	202201070001 0595	沃 森 生 物	2022-01- 07	1,548,360. 00	26,400.0 0	28	2.90	3,866.6 0	-	-
中 信 证 券	202201070001 0597	华 大 基 因	2022-01- 07	600,402.00	6,600.00	28	2.50	1,292.5 3	-	-
中	202201070001	澜	2022-01-	996,336.00	13,200.0	28	2.70	2,316.4	-	-

信 证 券	0599	起 科 技	07		0			9		
中 信 证 券	202201070001 0601	英 科 医 疗	2022-01- 07	398,442.00	6,600.00	28	3.30	1,132.2 4	-	-
中 信 证 券	202201070001 0603	乐 普 医 疗	2022-01- 07	452,430.00	19,800.0 0	28	3.10	1,207.7 4	-	-
中 信 证 券	202201070001 0605	亿 联 网 络	2022-01- 07	551,100.00	6,600.00	28	2.80	1,328.7 6	-	-
中 信 证 券	202201070001 0607	康 泰 生 物	2022-01- 07	594,594.00	6,600.00	28	2.60	1,331.2 3	-	-
中 信 证 券	202201070001 0609	欧 普 康 视	2022-01- 07	346,500.00	6,600.00	28	2.70	805.61	-	-
中 信 证 券	202201070001 0611	智 飞 生 物	2022-01- 07	1,507,836. 00	13,200.0 0	28	2.40	3,116.2 0	-	-
中 信 证 券	202201070001 0613	沪 硅 产 业	2022-01- 07	335,148.00	13,200.0 0	28	3.30	952.38	-	-
中 信 证 券	202201070001 0615	蓝 思 科 技	2022-01- 07	429,660.00	19,800.0 0	28	2.50	924.96	-	-
中 信 证 券	202201070001 0617	温 氏 股 份	2022-01- 07	1,328,580. 00	66,000.0 0	28	3.20	3,660.9 8	-	-
中 信 证 券	202201070001 0619	健 帆 生 物	2022-01- 07	355,938.00	6,600.00	28	3.20	980.81	-	-
中	202201070001	先	2022-01-	891,000.00	13,200.0	28	2.80	2,148.3	-	-

信 证 券	0621	导 智 能	07		0			0		
中 信 证 券	202201070001 0625	芒 果 超 媒	2022-01- 07	724,812.00	13,200.0 0	28	3.40	2,122.0 9	-	-
中 信 证 券	202201070001 0627	三 环 集 团	2022-01- 07	558,360.00	13,200.0 0	28	2.60	1,250.1 1	-	-
中 信 证 券	202201070001 0629	泰 格 医 药	2022-01- 07	733,260.00	6,600.00	28	2.40	1,515.4 0	-	-
中 信 证 券	202201070001 0631	宋 城 演 艺	2022-01- 07	399,432.00	26,400.0 0	28	3.30	1,135.0 5	-	-
中 信 证 券	202201100001 0795	爱 尔 眼 科	2022-01- 10	1,726,527. 00	46,300.0 0	14	3.00	2,014.2 8	-	-
中 信 证 券	202201110001 2139	阳 光 电 源	2022-01- 11	362,940.00	3,000.00	14	3.20	451.66	-	-
中 信 证 券	202201110001 4177	健 帆 生 物	2022-01- 11	214,520.00	4,000.00	14	1.80	150.16	-	-
中 信 证 券	202201110001 4179	爱 尔 眼 科	2022-01- 11	689,320.00	19,000.0 0	14	1.80	482.52	-	-
中 信 证 券	202201110001 4181	迈 瑞 医 疗	2022-01- 11	638,000.00	2,000.00	14	1.80	446.60	-	-
中 信 证 券	202201110001 4185	乐 普 医 疗	2022-01- 11	259,930.00	11,000.0 0	14	1.80	181.95	-	-
中	202201130000	宁	2022-01-	7,288,500.	12,900.0	28	3.10	17,573.	-	-

信 证 券	9626	德 时 代	13	00	0			38		
中 信 证 券	202201130000 9628	同 花 顺	2022-01- 13	224,766.00	1,800.00	28	2.90	506.97	-	-
中 信 证 券	202201130000 9820	中 芯 国 际	2022-01- 13	1,436,856. 00	27,600.0 0	28	1.80	2,011.6 0	-	-
中 信 证 券	202201130000 9840	亿 纬 锂 能	2022-01- 13	1,075,400. 00	10,000.0 0	28	2.80	2,341.9 8	-	-
中 信 证 券	202201130000 9842	稳 健 医 疗	2022-01- 13	702,720.00	8,000.00	28	2.80	1,530.3 7	-	-
中 信 证 券	202201130000 9844	安 克 创 新	2022-01- 13	627,321.00	6,700.00	28	3.20	1,561.3 3	-	-
中 信 证 券	202201130000 9846	爱 美 客	2022-01- 13	903,982.00	1,900.00	28	2.90	2,038.9 8	-	-
中 信 证 券	202201130000 9848	卓 胜 微	2022-01- 13	1,083,420. 00	3,600.00	28	2.50	2,106.6 5	-	-
中 信 证 券	202201130000 9850	英 科 医 疗	2022-01- 13	214,710.00	3,400.00	28	3.20	534.39	-	-
中 信 证 券	202201130000 9852	澜 起 科 技	2022-01- 13	304,138.00	4,100.00	28	2.30	544.07	-	-
中 信 证 券	202201130000 9854	华 润 微	2022-01- 13	144,960.00	2,400.00	28	1.90	214.22	-	-
中	202201130000	华	2022-01-	206,536.00	2,200.00	28	3.00	481.92	-	-

信 证 券	9856	大 基 因	13							
中 信 证 券	202201130000 9858	华 熙 生 物	2022-01- 13	136,980.00	1,000.00	28	2.80	298.31	-	-
中 信 证 券	202201130000 9860	天 合 光 能	2022-01- 13	892,860.00	13,800.0 0	28	4.80	3,333.3 4	-	-
中 信 证 券	202201130000 9862	沪 硅 产 业	2022-01- 13	173,316.00	6,600.00	28	2.20	296.56	-	-
中 信 证 券	202201130000 9864	迈 瑞 医 疗	2022-01- 13	1,876,242. 00	5,800.00	28	2.40	3,502.3 2	-	-
中 信 证 券	202201130000 9866	中 国 通 号	2022-01- 13	115,645.00	22,900.0 0	28	1.60	143.91	-	-
中 信 证 券	202201130000 9868	奇 安 信	2022-01- 13	672,160.00	8,000.00	28	2.00	1,045.5 8	-	-
中 信 证 券	202201130000 9870	中 微 公 司	2022-01- 13	256,344.00	2,200.00	28	2.40	478.51	-	-
中 信 证 券	202201130001 1588	蓝 思 科 技	2022-01- 13	345,270.00	17,000.0 0	28	2.00	537.09	-	-
中 信 证 券	202201130001 1590	乐 普 医 疗	2022-01- 13	271,600.00	11,200.0 0	28	2.80	591.48	-	-
中 信 证 券	202201130001 1592	金 龙 鱼	2022-01- 13	827,405.00	12,700.0 0	28	3.10	1,994.9 7	-	-
中	202201130001	康	2022-01-	771,438.00	5,700.00	28	2.40	1,440.0	-	-

信 证 券	2154	龙 化 成	13					2		
中 信 证 券	202201130001 2156	宋 城 演 艺	2022-01- 13	209,890.00	13,900.0 0	28	2.90	473.42	-	-
中 信 证 券	202201130001 2158	金 山 办 公	2022-01- 13	431,817.00	1,700.00	28	2.90	973.99	-	-
中 信 证 券	202201130001 2160	晶 盛 机 电	2022-01- 13	802,710.00	13,500.0 0	28	2.40	1,498.3 9	-	-
中 信 证 券	202201130001 2162	泰 格 医 药	2022-01- 13	578,758.00	4,700.00	28	3.10	1,395.4 5	-	-
中 信 证 券	202201130001 2164	阳 光 电 源	2022-01- 13	1,144,365. 00	9,300.00	28	2.80	2,492.1 7	-	-
中 信 证 券	202201130001 2166	传 音 控 股	2022-01- 13	317,284.00	2,200.00	28	3.10	765.01	-	-
中 信 证 券	202201130001 2168	沃 森 生 物	2022-01- 13	800,400.00	13,800.0 0	28	2.50	1,556.3 3	-	-
中 信 证 券	202201130001 2170	爱 尔 眼 科	2022-01- 13	851,724.00	23,600.0 0	28	3.20	2,119.8 5	-	-
中 信 证 券	202201130001 2172	汇 川 技 术	2022-01- 13	1,041,600. 00	16,000.0 0	28	2.40	1,944.3 2	-	-
中 信 证 券	202201130001 2174	东 方 财 富	2022-01- 13	2,290,112. 00	70,400.0 0	28	3.00	5,343.5 9	-	-
中	202201130001	亿	2022-01-	261,280.00	3,200.00	28	2.00	406.44	-	-

信 证 券	2176	联 网 网 络	13							
中 信 证 券	202201130001 2178	智 飞 生 物	2022-01- 13	800,660.00	7,000.00	28	2.00	1,245.4 7	-	-
中 信 证 券	202201130001 2180	贝 达 药 业	2022-01- 13	168,520.00	2,200.00	28	2.50	327.68	-	-
中 信 证 券	202201130001 2182	温 氏 股 份	2022-01- 13	763,551.00	38,700.0 0	28	3.00	1,781.6 2	-	-
中 信 证 券	202201130001 2184	健 帆 生 物	2022-01- 13	232,974.00	4,200.00	28	3.10	561.73	-	-
中 信 证 券	202201130001 2186	欧 普 康 视	2022-01- 13	225,324.00	4,400.00	28	1.80	315.45	-	-
中 信 证 券	202201130001 2188	先 导 智 能	2022-01- 13	688,603.00	9,700.00	28	1.90	1,017.6 0	-	-
中 信 证 券	202201130001 2190	康 泰 生 物	2022-01- 13	340,326.00	3,700.00	28	2.40	635.28	-	-
中 信 证 券	202201130001 2192	芒 果 超 媒	2022-01- 13	285,634.00	6,200.00	28	3.20	710.91	-	-
中 信 证 券	202201130001 2194	三 环 集 团	2022-01- 13	472,340.00	11,300.0 0	28	2.00	734.75	-	-
中 信 证 券	202201140002 0858	爱 尔 眼 科	2022-01- 14	5,317,500. 00	150,000. 00	14	3.30	6,824.1 3	-	-
中	202201140002	汇	2022-01-	64,000.00	1,000.00	14	1.80	44.80	-	-

信 证 券	1472	川 技 术	14							
中 信 证 券	202201140002 3528	蓝 思 科 技	2022-01- 14	34,374.00	1,700.00	14	1.80	24.06	-	-
中 信 证 券	202201170000 2799	贝 达 药 业	2022-01- 17	409,136.00	5,200.00	28	2.50	795.54	-	-
中 信 证 券	202201180000 1393	乐 普 医 疗	2022-01- 18	1,117,920. 00	48,000.0 0	14	3.10	1,925.3 0	-	-
中 信 证 券	202201180002 5768	爱 尔 眼 科	2022-01- 18	216,360.00	6,000.00	14	3.30	396.66	-	-
中 信 证 券	202201180002 5770	宋 城 演 艺	2022-01- 18	301,400.00	20,000.0 0	14	3.00	502.33	-	-
中 信 证 券	202201200000 1278	温 氏 股 份	2022-01- 20	463,910.00	23,000.0 0	14	3.20	742.26	-	-
中 信 证 券	202201200000 9804	爱 尔 眼 科	2022-01- 20	1,331,900. 00	38,000.0 0	14	3.30	2,197.6 3	-	-
中 信 证 券	202201200000 9808	宋 城 演 艺	2022-01- 20	265,710.00	17,000.0 0	14	3.00	398.57	-	-
中 信 证 券	202201200001 0874	爱 尔 眼 科	2022-01- 20	1,331,900. 00	38,000.0 0	28	3.20	3,314.9 5	-	-
中 信 证 券	202201200001 1178	沃 森 生 物	2022-01- 20	3,888,353. 00	72,100.0 0	14	1.80	3,499.5 2	-	-
中	202201200001	爱	2022-01-	3,238,620.	92,400.0	14	1.80	2,914.7	-	-

信 证 券	1182	尔 眼 科	20	00	0			5		
中 信 证 券	202201200001 1184	智 飞 生 物	2022-01- 20	3,456,100. 00	32,300.0 0	14	1.80	3,110.4 9	-	-
中 信 证 券	202201200001 1186	东 方 财 富	2022-01- 20	7,430,719. 00	220,300. 00	14	1.80	6,687.6 4	-	-
中 信 证 券	202201240001 0302	爱 尔 眼 科	2022-01- 24	1,595,498. 00	46,300.0 0	14	3.30	2,047.5 6	-	-
中 信 证 券	202201250001 0174	乐 普 医 疗	2022-01- 25	242,000.00	11,000.0 0	14	1.80	169.40	-	-
中 信 证 券	202201250001 0176	爱 尔 眼 科	2022-01- 25	641,250.00	19,000.0 0	14	1.80	448.88	-	-
中 信 证 券	202201250001 0216	阳 光 电 源	2022-01- 25	378,030.00	3,000.00	14	2.60	382.23	-	-
中 信 证 券	202201250001 0310	迈 瑞 医 疗	2022-01- 25	682,000.00	2,000.00	14	1.80	477.40	-	-
中 信 证 券	202201250001 0716	健 帆 生 物	2022-01- 25	183,400.00	4,000.00	14	1.80	128.38	-	-
中 信 证 券	202201260000 9806	爱 尔 眼 科	2022-01- 26	573,104.00	17,200.0 0	28	3.20	1,426.3 9	-	-
中 信 证 券	202201260001 0238	先 导 智 能	2022-01- 26	529,305.00	7,100.00	28	1.90	782.20	-	-
中	202201260001	三	2022-01-	323,368.00	8,300.00	28	2.40	603.62	-	-

信 证 券	0240	环 集 团	26							
中 信 证 券	202201260001 0242	温 氏 股 份	2022-01- 26	546,756.00	28,300.0 0	28	3.10	1,318.2 9	-	-
中 信 证 券	202201260001 0244	蓝 思 科 技	2022-01- 26	225,184.00	12,400.0 0	28	2.70	472.89	-	-
中 信 证 券	202201260001 0246	澜 起 科 技	2022-01- 26	227,700.00	3,000.00	28	2.60	460.46	-	-
中 信 证 券	202201260001 0248	中 国 通 号	2022-01- 26	81,496.00	16,700.0 0	28	1.90	120.43	-	-
中 信 证 券	202201260001 0250	芒 果 超 媒	2022-01- 26	162,810.00	4,500.00	28	3.00	379.89	-	-
中 信 证 券	202201260001 0252	华 大 基 因	2022-01- 26	135,200.00	1,600.00	28	2.70	283.92	-	-
中 信 证 券	202201260001 0254	英 科 医 疗	2022-01- 26	139,475.00	2,500.00	28	3.10	336.29	-	-
中 信 证 券	202201260001 0256	健 帆 生 物	2022-01- 26	146,723.00	3,100.00	28	2.90	330.94	-	-
中 信 证 券	202201260001 0260	中 微 公 司	2022-01- 26	201,200.00	1,600.00	28	2.40	375.57	-	-
中 信 证 券	202201260001 0262	亿 联 网 络	2022-01- 26	186,024.00	2,300.00	28	2.10	303.84	-	-
中	202201260001	东	2022-01-	1,679,752.	51,400.0	28	2.80	3,658.1	-	-

信 证 券	0264	方 财 富	26	00	0			3		
中 信 证 券	202201260001 0266	智 飞 生 物	2022-01- 26	550,494.00	5,100.00	28	2.20	941.96	-	-
中 信 证 券	202201260001 0268	同 花 顺	2022-01- 26	169,156.00	1,300.00	28	2.50	328.91	-	-
中 信 证 券	202201260001 0270	汇 川 技 术	2022-01- 26	763,659.00	11,700.0 0	28	2.90	1,722.4 8	-	-
中 信 证 券	202201260001 0272	亿 纬 锂 能	2022-01- 26	722,846.00	7,300.00	28	3.10	1,742.8 6	-	-
中 信 证 券	202201260001 0274	乐 普 医 疗	2022-01- 26	177,940.00	8,200.00	28	3.00	415.19	-	-
中 信 证 券	202201260001 0276	沃 森 生 物	2022-01- 26	493,284.00	10,100.0 0	28	2.60	997.53	-	-
中 信 证 券	202201260001 0278	阳 光 电 源	2022-01- 26	880,260.00	6,800.00	28	2.50	1,711.6 2	-	-
中 信 证 券	202201260001 0280	宋 城 演 艺	2022-01- 26	153,510.00	10,200.0 0	28	2.30	274.61	-	-
中 信 证 券	202201260001 0284	华 熙 生 物	2022-01- 26	123,040.00	1,000.00	28	2.80	267.95	-	-
中 信 证 券	202201260001 0286	华 润 微	2022-01- 26	103,446.00	1,800.00	28	3.30	265.51	-	-
中	202201260001	沪	2022-01-	124,704.00	4,800.00	28	2.60	252.18	-	-

信 证 券	0288	硅 产 业	26							
中 信 证 券	202201260001 0290	金 山 办 公	2022-01- 26	306,924.00	1,200.00	28	3.10	740.03	-	-
中 信 证 券	202201260001 0292	传 音 控 股	2022-01- 26	217,280.00	1,600.00	28	2.50	422.49	-	-
中 信 证 券	202201260001 0336	泰 格 医 药	2022-01- 26	370,566.00	3,400.00	28	2.40	691.72	-	-
中 信 证 券	202201260001 0342	欧 普 康 视	2022-01- 26	127,424.00	3,200.00	28	2.70	267.59	-	-
中 信 证 券	202201260001 0344	康 泰 生 物	2022-01- 26	220,185.00	2,700.00	28	2.60	445.26	-	-
中 信 证 券	202201260001 1490	贝 达 药 业	2022-01- 26	106,320.00	1,600.00	28	2.90	239.81	-	-
中 信 证 券	202201270000 0935	宋 城 演 艺	2022-01- 27	1,390,080. 00	96,000.0 0	14	2.00	1,081.1 7	-	-
中 信 证 券	202201280002 2092	亿 联 网 络	2022-01- 28	140,940.00	1,800.00	28	2.10	230.20	-	-
中 信 证 券	202201280002 2094	华 大 基 因	2022-01- 28	151,200.00	1,800.00	28	2.70	317.52	-	-
中 信 证 券	202201280002 2096	爱 尔 眼 科	2022-01- 28	4,840,500. 00	150,000. 00	14	3.30	6,211.9 8	-	-
中	202201280002	澜	2022-01-	263,625.00	3,700.00	28	2.60	533.11	-	-

信 证 券	2098	起 科 技	28							
中 信 证 券	202201280002 2100	中 国 通 号	2022-01- 28	53,020.00	11,000.0 0	28	1.90	78.35	-	-
中 信 证 券	202201280002 2102	沪 硅 产 业	2022-01- 28	86,580.00	3,700.00	28	2.60	175.08	-	-
中 信 证 券	202201280002 2112	三 环 集 团	2022-01- 28	140,600.00	3,700.00	28	2.40	262.45	-	-
中 信 证 券	202201280002 2114	芒 果 超 媒	2022-01- 28	128,612.00	3,700.00	28	3.00	300.09	-	-
中 信 证 券	202201280002 2116	阳 光 电 源	2022-01- 28	421,763.00	3,700.00	28	2.50	820.09	-	-
中 信 证 券	202201280002 2118	蓝 思 科 技	2022-01- 28	93,005.00	5,500.00	28	2.70	195.31	-	-
中 信 证 券	202201280002 2120	欧 普 康 视	2022-01- 28	68,094.00	1,800.00	28	2.70	143.00	-	-
中 信 证 券	202201280002 2122	泰 格 医 药	2022-01- 28	185,886.00	1,800.00	28	2.40	346.99	-	-
中 信 证 券	202201280002 2124	贝 达 药 业	2022-01- 28	112,140.00	1,800.00	28	2.90	252.94	-	-
中 信 证 券	202201280002 2126	康 泰 生 物	2022-01- 28	144,144.00	1,800.00	28	2.60	291.49	-	-
中	202201280002	先	2022-01-	265,882.00	3,700.00	28	1.90	392.91	-	-

信 证 券	2128	导 智 能	28							
中 信 证 券	202201280002 2130	温 氏 股 份	2022-01- 28	368,745.00	18,300.0 0	28	3.10	889.09	-	-
中 信 证 券	202201280002 2132	乐 普 医 疗	2022-01- 28	113,960.00	5,500.00	28	3.00	265.91	-	-
中 信 证 券	202201280002 2134	健 帆 生 物	2022-01- 28	84,960.00	1,800.00	28	2.90	191.63	-	-
中 信 证 券	202201280002 2136	亿 纬 锂 能	2022-01- 28	512,985.00	5,500.00	28	3.10	1,236.8 6	-	-
中 信 证 券	202201280002 2138	宋 城 演 艺	2022-01- 28	111,617.00	7,300.00	28	2.30	199.67	-	-
中 信 证 券	202201280002 2140	爱 尔 眼 科	2022-01- 28	354,970.00	11,000.0 0	28	3.20	883.48	-	-
中 信 证 券	202201280002 2142	东 方 财 富	2022-01- 28	784,000.00	25,000.0 0	28	2.80	1,707.3 8	-	-
中 信 证 券	202201280002 2144	汇 川 技 术	2022-01- 28	329,945.00	5,500.00	28	2.90	744.21	-	-
中 信 证 券	202201280002 2146	沃 森 生 物	2022-01- 28	351,860.00	7,300.00	28	2.60	711.54	-	-
中 信 证 券	202201280002 2148	智 飞 生 物	2022-01- 28	390,794.00	3,700.00	28	2.20	668.69	-	-
中	202201280002	同	2022-01-	225,126.00	1,800.00	28	2.50	437.75	-	-

信 证 券	2150	花 顺	28							
中 信 证 券	202201280002 2170	蓝 思 科 技	2022-01- 28	28,747.00	1,700.00	14	1.80	20.12	-	-
中 信 证 券	202201280002 2176	汇 川 技 术	2022-01- 28	59,990.00	1,000.00	14	1.80	41.99	-	-
中 信 证 券	202202070004 7197	沃 森 生 物	2022-02- 07	3,622,304. 00	72,100.0 0	14	1.80	2,535.6 1	-	-
中 信 证 券	202202070004 7203	爱 尔 眼 科	2022-02- 07	2,966,964. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,076.8 7	-	-
中 信 证 券	202202070004 7207	智 飞 生 物	2022-02- 07	3,568,181. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,497.7 3	-	-
中 信 证 券	202202070004 7211	东 方 财 富	2022-02- 07	7,098,066. 00	220,300. 00	14	1.80	4,968.6 5	-	-
中 信 证 券	202202070005 5547	爱 尔 眼 科	2022-02- 07	192,660.00	6,000.00	14	3.60	269.72	-	-
中 信 证 券	202202070005 5549	宋 城 演 艺	2022-02- 07	256,190.00	17,000.0 0	14	2.00	199.26	-	-
中 信 证 券	202202070005 5551	宋 城 演 艺	2022-02- 07	301,400.00	20,000.0 0	14	2.00	234.42	-	-
中 信 证 券	202202070005 5553	乐 普 医 疗	2022-02- 07	998,880.00	48,000.0 0	14	3.00	1,165.3 6	-	-
中	202202070005	温	2022-02-	474,950.00	23,000.0	14	2.50	461.76	-	-

信 证 券	5555	氏 股 份	07		0					
中 信 证 券	202202070005 5557	爱 尔 眼 科	2022-02- 07	1,220,180. 00	38,000.0 0	14	3.60	1,708.2 5	-	-
中 信 证 券	202202070005 5559	爱 尔 眼 科	2022-02- 07	1,486,693. 00	46,300.0 0	14	3.60	2,081.3 7	-	-
中 信 证 券	202202080001 3618	乐 普 医 疗	2022-02- 08	231,220.00	11,000.0 0	14	1.80	161.85	-	-
中 信 证 券	202202080001 3622	爱 尔 眼 科	2022-02- 08	623,770.00	19,000.0 0	14	1.80	436.64	-	-
中 信 证 券	202202080001 3630	健 帆 生 物	2022-02- 08	186,000.00	4,000.00	14	1.80	130.20	-	-
中 信 证 券	202202080001 3634	迈 瑞 医 疗	2022-02- 08	636,220.00	2,000.00	14	1.80	445.35	-	-
中 信 证 券	202202080001 3638	阳 光 电 源	2022-02- 08	321,360.00	3,000.00	14	2.50	312.43	-	-
中 信 证 券	202202100000 1628	安 克 创 新	2022-02- 10	1,965,744. 00	20,400.0 0	14	3.50	2,675.6 0	-	-
中 信 证 券	202202100001 3426	中 微 公 司	2022-02- 10	256,696.00	2,200.00	28	3.30	658.85	-	-
中 信 证 券	202202100001 3428	传 音 控 股	2022-02- 10	290,312.00	2,200.00	28	1.90	429.02	-	-
中	202202100001	中	2022-02-	114,729.00	22,900.0	28	2.00	178.47	-	-

信 证 券	3430	国 通 号	10		0					
中 信 证 券	202202100001 3432	澜 起 科 技	2022-02- 10	305,573.00	4,100.00	28	2.40	570.40	-	-
中 信 证 券	202202100001 3434	奇 安 信	2022-02- 10	581,840.00	8,000.00	28	5.60	2,534.2 4	-	-
中 信 证 券	202202100001 3436	天 合 光 能	2022-02- 10	788,946.00	13,800.0 0	28	3.60	2,209.0 5	-	-
中 信 证 券	202202100001 3438	金 山 办 公	2022-02- 10	363,596.00	1,700.00	28	2.60	735.27	-	-
中 信 证 券	202202100001 3440	中 芯 国 际	2022-02- 10	1,413,120. 00	27,600.0 0	28	1.70	1,868.4 6	-	-
中 信 证 券	202202100001 3442	沪 硅 产 业	2022-02- 10	152,988.00	6,600.00	28	3.10	368.87	-	-
中 信 证 券	202202100001 3444	华 润 微	2022-02- 10	137,040.00	2,400.00	28	2.90	309.10	-	-
中 信 证 券	202202100001 3446	华 熙 生 物	2022-02- 10	118,500.00	1,000.00	28	2.00	184.33	-	-
中 信 证 券	202202100001 3454	爱 尔 眼 科	2022-02- 10	792,724.00	23,600.0 0	28	3.50	2,157.9 7	-	-
中 信 证 券	202202100001 3456	亿 纬 锂 能	2022-02- 10	858,700.00	10,000.0 0	28	2.80	1,870.0 6	-	-
中	202202100001	同	2022-02-	211,140.00	1,800.00	28	2.00	328.44	-	-

信 证 券	3458	花 顺	10							
中 信 证 券	202202100001 3460	乐 普 医 疗	2022-02- 10	240,688.00	11,200.0 0	28	2.90	542.89	-	-
中 信 证 券	202202100001 3488	宁 德 时 代	2022-02- 10	6,683,490. 00	12,900.0 0	28	3.40	17,674. 12	-	-
中 信 证 券	202202100001 3490	亿 联 网 络	2022-02- 10	240,768.00	3,200.00	28	2.00	374.53	-	-
中 信 证 券	202202100001 3492	康 龙 化 成	2022-02- 10	619,932.00	5,700.00	28	2.80	1,350.0 7	-	-
中 信 证 券	202202100001 3494	华 大 基 因	2022-02- 10	190,894.00	2,200.00	28	3.20	475.11	-	-
中 信 证 券	202202100001 3496	贝 达 药 业	2022-02- 10	136,400.00	2,200.00	28	3.00	318.27	-	-
中 信 证 券	202202100001 3498	欧 普 康 视	2022-02- 10	174,768.00	4,400.00	28	2.20	299.05	-	-
中 信 证 券	202202100001 3500	康 泰 生 物	2022-02- 10	308,099.00	3,700.00	28	2.80	670.97	-	-
中 信 证 券	202202100001 3502	爱 美 客	2022-02- 10	841,605.00	1,900.00	28	3.70	2,421.9 5	-	-
中 信 证 券	202202100001 3504	金 龙 鱼	2022-02- 10	737,870.00	12,700.0 0	28	2.80	1,606.9 2	-	-
中	202202100001	迈	2022-02-	1,792,200.	5,800.00	28	2.00	2,787.8	-	-

信 证 券	3506	瑞 医 疗	10	00				7		
中 信 证 券	202202100001 3508	安 克 创 新	2022-02- 10	645,612.00	6,700.00	28	2.70	1,355.7 9	-	-
中 信 证 券	202202100001 3510	健 帆 生 物	2022-02- 10	198,114.00	4,200.00	28	3.20	493.08	-	-
中 信 证 券	202202100001 3512	卓 胜 微	2022-02- 10	945,360.00	3,600.00	28	2.80	2,058.7 8	-	-
中 信 证 券	202202100001 3514	宋 城 演 艺	2022-02- 10	236,022.00	13,900.0 0	28	1.90	348.79	-	-
中 信 证 券	202202100001 3516	阳 光 电 源	2022-02- 10	940,230.00	9,300.00	28	2.40	1,755.1 0	-	-
中 信 证 券	202202100001 3518	宋 城 演 艺	2022-02- 10	1,630,080. 00	96,000.0 0	14	2.00	1,267.8 4	-	-
中 信 证 券	202202100001 3520	智 飞 生 物	2022-02- 10	872,760.00	7,000.00	28	2.40	1,629.1 5	-	-
中 信 证 券	202202100001 3522	蓝 思 科 技	2022-02- 10	258,230.00	17,000.0 0	28	2.10	421.78	-	-
中 信 证 券	202202100001 3590	英 科 医 疗	2022-02- 10	183,056.00	3,400.00	28	3.10	441.37	-	-
中 信 证 券	202202100001 3592	稳 健 医 疗	2022-02- 10	603,680.00	8,000.00	28	3.20	1,502.4 9	-	-
中	202202100001	先	2022-02-	625,165.00	9,700.00	28	1.90	923.85	-	-

信 证 券	4152	导 智 能	10							
中 信 证 券	202202100001 4154	沃 森 生 物	2022-02- 10	721,188.00	13,800.0 0	28	2.10	1,177.9 4	-	-
中 信 证 券	202202100001 4156	泰 格 医 药	2022-02- 10	430,520.00	4,700.00	28	1.90	636.21	-	-
中 信 证 券	202202100001 4158	晶 盛 机 电	2022-02- 10	770,850.00	13,500.0 0	28	3.00	1,798.6 5	-	-
中 信 证 券	202202100001 4160	汇 川 技 术	2022-02- 10	966,400.00	16,000.0 0	28	2.60	1,954.2 8	-	-
中 信 证 券	202202100001 4162	东 方 财 富	2022-02- 10	2,262,656. 00	70,400.0 0	28	2.80	4,927.5 6	-	-
中 信 证 券	202202100001 4164	温 氏 股 份	2022-02- 10	850,626.00	38,700.0 0	28	2.40	1,587.8 4	-	-
中 信 证 券	202202100001 4166	三 环 集 团	2022-02- 10	413,693.00	11,300.0 0	28	2.00	643.52	-	-
中 信 证 券	202202100001 4168	芒 果 超 媒	2022-02- 10	225,866.00	6,200.00	28	2.90	509.45	-	-
中 信 证 券	202202110002 0210	蓝 思 科 技	2022-02- 11	25,194.00	1,700.00	14	1.80	17.64	-	-
中 信 证 券	202202110002 0212	汇 川 技 术	2022-02- 11	61,110.00	1,000.00	14	1.80	42.78	-	-
中	202202110002	爱	2022-02-	4,860,000.	150,000.	14	2.90	5,481.0	-	-

信 证 券	0220	尔 眼 科	11	00	00			0		
中 信 证 券	202202140000 3670	贝 达 药 业	2022-02- 14	304,200.00	5,200.00	28	3.00	709.80	-	-
中 信 证 券	202202150000 0933	泰 格 医 药	2022-02- 15	591,960.00	6,000.00	14	3.20	736.66	-	-
中 信 证 券	202202170000 2950	爱 尔 眼 科	2022-02- 17	1,330,000. 00	38,000.0 0	28	2.80	2,896.4 4	-	-
中 信 证 券	202202210004 0251	宋 城 演 艺	2022-02- 21	318,000.00	20,000.0 0	14	3.30	408.10	-	-
中 信 证 券	202202210004 2839	乐 普 医 疗	2022-02- 21	1,038,240. 00	48,000.0 0	14	2.70	1,090.1 5	-	-
中 信 证 券	202202210004 2841	温 氏 股 份	2022-02- 21	475,410.00	23,000.0 0	14	2.90	536.16	-	-
中 信 证 券	202202210004 2863	爱 尔 眼 科	2022-02- 21	207,060.00	6,000.00	14	2.90	233.52	-	-
中 信 证 券	202202210004 2885	爱 尔 眼 科	2022-02- 21	1,597,813. 00	46,300.0 0	14	2.90	1,801.9 8	-	-
中 信 证 券	202202210004 2887	宋 城 演 艺	2022-02- 21	270,300.00	17,000.0 0	14	2.80	294.33	-	-
中 信 证 券	202202210004 2889	爱 尔 眼 科	2022-02- 21	1,311,380. 00	38,000.0 0	14	2.90	1,478.9 5	-	-
中	202202210004	沃	2022-02-	3,614,373.	72,100.0	14	1.80	2,530.0	-	-

信 证 券	5471	森 生 物	21	00	0			6		
中 信 证 券	202202210004 5475	东 方 财 富	2022-02- 21	5,760,845. 00	220,300. 00	14	1.80	4,032.5 9	-	-
中 信 证 券	202202210004 5477	智 飞 生 物	2022-02- 21	4,057,203. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,840.0 4	-	-
中 信 证 券	202202210004 5489	爱 尔 眼 科	2022-02- 21	3,188,724. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,232.1 1	-	-
中 信 证 券	202202220000 1301	华 大 基 因	2022-02- 22	684,560.00	8,000.00	14	3.00	798.65	-	-
中 信 证 券	202202220001 2001	阳 光 电 源	2022-02- 22	322,950.00	3,000.00	14	2.70	339.10	-	-
中 信 证 券	202202220001 3167	爱 尔 眼 科	2022-02- 22	647,140.00	19,000.0 0	14	1.80	453.00	-	-
中 信 证 券	202202220001 3169	健 帆 生 物	2022-02- 22	184,960.00	4,000.00	14	1.80	129.47	-	-
中 信 证 券	202202220001 3171	迈 瑞 医 疗	2022-02- 22	635,400.00	2,000.00	14	1.80	444.78	-	-
中 信 证 券	202202220001 3173	乐 普 医 疗	2022-02- 22	234,080.00	11,000.0 0	14	1.80	163.86	-	-
中 信 证 券	202202230001 3358	宋 城 演 艺	2022-02- 23	157,488.00	10,200.0 0	28	2.70	330.72	-	-
中	202202230001	智	2022-02-	617,100.00	5,100.00	28	1.90	911.94	-	-

信 证 券	3360	飞 生 物	23							
中 信 证 券	202202230001 3362	传 音 控 股	2022-02- 23	210,528.00	1,600.00	28	1.90	311.11	-	-
中 信 证 券	202202230001 3364	三 环 集 团	2022-02- 23	291,911.00	8,300.00	28	1.80	408.68	-	-
中 信 证 券	202202230001 3366	欧 普 康 视	2022-02- 23	132,256.00	3,200.00	28	2.30	236.59	-	-
中 信 证 券	202202230001 3368	贝 达 药 业	2022-02- 23	96,528.00	1,600.00	28	3.00	225.23	-	-
中 信 证 券	202202230001 3370	爱 尔 眼 科	2022-02- 23	593,916.00	17,200.0 0	28	2.80	1,293.4 2	-	-
中 信 证 券	202202230001 3372	华 熙 生 物	2022-02- 23	119,900.00	1,000.00	28	2.80	261.12	-	-
中 信 证 券	202202230001 3374	同 花 顺	2022-02- 23	141,557.00	1,300.00	28	2.30	253.23	-	-
中 信 证 券	202202230001 3376	芒 果 超 媒	2022-02- 23	158,580.00	4,500.00	28	2.60	320.68	-	-
中 信 证 券	202202230001 3378	先 导 智 能	2022-02- 23	455,749.00	7,100.00	28	2.00	708.94	-	-
中 信 证 券	202202230001 3380	亿 联 网 络	2022-02- 23	173,949.00	2,300.00	28	2.00	270.59	-	-
中	202202230001	康	2022-02-	223,992.00	2,700.00	28	2.20	383.28	-	-

信 证 券	3382	泰 生 物	23							
中 信 证 券	202202230001 3384	澜 起 科 技	2022-02- 23	237,210.00	3,000.00	28	1.80	332.09	-	-
中 信 证 券	202202230001 3386	健 帆 生 物	2022-02- 23	145,421.00	3,100.00	28	2.80	316.69	-	-
中 信 证 券	202202230001 3388	蓝 思 科 技	2022-02- 23	187,364.00	12,400.0 0	28	2.10	306.03	-	-
中 信 证 券	202202230001 3390	温 氏 股 份	2022-02- 23	571,377.00	28,300.0 0	28	2.80	1,244.3 3	-	-
中 信 证 券	202202230001 3392	中 国 通 号	2022-02- 23	81,997.00	16,700.0 0	28	2.20	140.31	-	-
中 信 证 券	202202230001 3394	泰 格 医 药	2022-02- 23	341,870.00	3,400.00	28	1.90	505.21	-	-
中 信 证 券	202202230001 3396	沪 硅 产 业	2022-02- 23	114,384.00	4,800.00	28	3.00	266.90	-	-
中 信 证 券	202202230001 3398	华 大 基 因	2022-02- 23	138,416.00	1,600.00	28	2.90	312.20	-	-
中 信 证 券	202202230001 3406	阳 光 电 源	2022-02- 23	760,512.00	6,800.00	28	2.60	1,537.9 2	-	-
中 信 证 券	202202230001 3408	沃 森 生 物	2022-02- 23	495,910.00	10,100.0 0	28	2.30	887.13	-	-
中	202202230001	华	2022-02-	104,868.00	1,800.00	28	2.10	171.28	-	-

信 证 券	3410	润 微	23							
中 信 证 券	202202230001 3412	亿 纬 锂 能	2022-02- 23	650,284.00	7,300.00	28	1.90	960.98	-	-
中 信 证 券	202202230001 3414	乐 普 医 疗	2022-02- 23	177,120.00	8,200.00	28	2.60	358.18	-	-
中 信 证 券	202202230001 3416	中 微 公 司	2022-02- 23	207,680.00	1,600.00	28	1.80	290.75	-	-
中 信 证 券	202202230001 3418	英 科 医 疗	2022-02- 23	130,475.00	2,500.00	28	3.10	314.59	-	-
中 信 证 券	202202230001 3420	金 山 办 公	2022-02- 23	263,160.00	1,200.00	28	2.10	429.83	-	-
中 信 证 券	202202230001 3422	东 方 财 富	2022-02- 23	1,356,960. 00	51,400.0 0	28	3.20	3,377.3 2	-	-
中 信 证 券	202202230001 3424	汇 川 技 术	2022-02- 23	755,001.00	11,700.0 0	28	2.40	1,409.3 4	-	-
中 信 证 券	202202240000 0802	康 泰 生 物	2022-02- 24	161,340.00	2,000.00	28	2.70	338.81	-	-
中 信 证 券	202202240000 0816	金 龙 鱼	2022-02- 24	876,792.00	16,800.0 0	14	3.10	1,057.0 2	-	-
中 信 证 券	202202240001 2435	宋 城 演 艺	2022-02- 24	1,452,480. 00	96,000.0 0	14	3.30	1,864.0 2	-	-
中	202202240001	安	2022-02-	1,958,400.	20,400.0	14	3.50	2,665.6	-	-

信 证 券	2441	克 创 新	24	00	0			0		
中 信 证 券	202202250001 7909	汇 川 技 术	2022-02- 25	63,700.00	1,000.00	14	1.80	44.59	-	-
中 信 证 券	202202250001 7911	蓝 思 科 技	2022-02- 25	24,973.00	1,700.00	14	1.80	17.48	-	-
中 信 证 券	202202250001 7925	爱 尔 眼 科	2022-02- 25	5,307,000. 00	150,000. 00	14	3.10	6,397.8 8	-	-
中 信 证 券	202203010000 1292	英 科 医 疗	2022-03- 01	51,020.00	1,000.00	14	2.80	55.56	-	-
中 信 证 券	202203010000 1314	宋 城 演 艺	2022-03- 01	203,580.00	13,000.0 0	14	1.90	150.42	-	-
中 信 证 券	202203030000 1512	宁 德 时 代	2022-03- 03	25,649,500 .00	50,000.0 0	14	3.50	34,911. 82	-	-
中 信 证 券	202203070003 8368	爱 尔 眼 科	2022-03- 07	3,016,860. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,111.8 0	-	-
中 信 证 券	202203070003 8372	东 方 财 富	2022-03- 07	5,481,064. 00	220,300. 00	14	1.80	3,836.7 4	-	-
中 信 证 券	202203070004 4310	智 飞 生 物	2022-03- 07	3,938,339. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,756.8 4	-	-
中 信 证 券	202203070004 4394	宋 城 演 艺	2022-03- 07	290,000.00	20,000.0 0	14	1.90	214.28	-	-
中	202203070004	宋	2022-03-	246,500.00	17,000.0	14	1.90	182.14	-	-

信 证 券	4396	城 演 艺	07		0					
中 信 证 券	202203070004 4398	爱 尔 眼 科	2022-03- 07	195,900.00	6,000.00	14	2.40	182.84	-	-
中 信 证 券	202203080001 3136	华 大 基 因	2022-03- 08	615,360.00	8,000.00	14	3.20	765.78	-	-
中 信 证 券	202203080001 3138	阳 光 电 源	2022-03- 08	380,700.00	3,000.00	14	2.90	429.35	-	-
中 信 证 券	202203080001 3738	健 帆 生 物	2022-03- 08	169,360.00	4,000.00	14	1.80	118.55	-	-
中 信 证 券	202203080001 3740	爱 尔 眼 科	2022-03- 08	627,190.00	19,000.0 0	14	1.80	439.03	-	-
中 信 证 券	202203080001 3744	迈 瑞 医 疗	2022-03- 08	593,040.00	2,000.00	14	1.80	415.13	-	-
中 信 证 券	202203080001 5568	乐 普 医 疗	2022-03- 08	213,400.00	11,000.0 0	14	1.80	149.38	-	-
中 信 证 券	202203100001 3196	宋 城 演 艺	2022-03- 10	186,399.00	13,900.0 0	28	1.80	260.96	-	-
中 信 证 券	202203100001 3198	健 帆 生 物	2022-03- 10	181,440.00	4,200.00	28	3.00	423.36	-	-
中 信 证 券	202203100001 3200	芒 果 超 媒	2022-03- 10	189,596.00	6,200.00	28	1.80	265.43	-	-
中	202203100001	卓	2022-03-	846,000.00	3,600.00	28	3.10	2,039.8	-	-

信 证 券	3202	胜 微	10					0		
中 信 证 券	202203100001 3204	奇 安 信	2022-03- 10	497,600.00	8,000.00	28	1.80	696.64	-	-
中 信 证 券	202203100001 3206	爱 尔 眼 科	2022-03- 10	756,144.00	23,600.0 0	28	2.30	1,352.6 6	-	-
中 信 证 券	202203100001 3208	华 熙 生 物	2022-03- 10	112,540.00	1,000.00	28	2.20	192.57	-	-
中 信 证 券	202203100001 3210	亿 联 网 络	2022-03- 10	245,952.00	3,200.00	28	1.80	344.33	-	-
中 信 证 券	202203100001 3212	华 润 微	2022-03- 10	133,296.00	2,400.00	28	3.00	311.02	-	-
中 信 证 券	202203100001 3214	沪 硅 产 业	2022-03- 10	168,300.00	6,600.00	28	5.00	654.50	-	-
中 信 证 券	202203100001 3216	天 合 光 能	2022-03- 10	1,015,956. 00	13,800.0 0	28	4.40	3,476.8 3	-	-
中 信 证 券	202203100001 3218	康 龙 化 成	2022-03- 10	599,583.00	5,700.00	28	3.10	1,445.6 6	-	-
中 信 证 券	202203100001 3220	亿 纬 锂 能	2022-03- 10	751,500.00	10,000.0 0	28	2.60	1,519.7 0	-	-
中 信 证 券	202203100001 3222	宁 德 时 代	2022-03- 10	6,331,449. 00	12,900.0 0	28	3.10	15,265. 83	-	-
中	202203100001	金	2022-03-	319,600.00	1,700.00	28	2.90	720.88	-	-

信 证 券	3224	山 办 公	10							
中 信 证 券	202203100001 3226	中 芯 国 际	2022-03- 10	1,386,348. 00	27,600.0 0	28	1.60	1,725.2 3	-	-
中 信 证 券	202203100001 3228	同 花 顺	2022-03- 10	175,086.00	1,800.00	28	2.80	381.30	-	-
中 信 证 券	202203100001 3230	贝 达 药 业	2022-03- 10	118,448.00	2,200.00	28	1.90	175.04	-	-
中 信 证 券	202203100001 3232	欧 普 康 视	2022-03- 10	159,060.00	4,400.00	28	2.00	247.43	-	-
中 信 证 券	202203100001 3234	阳 光 电 源	2022-03- 10	1,199,793. 00	9,300.00	28	2.80	2,612.8 8	-	-
中 信 证 券	202203100001 3236	金 龙 鱼	2022-03- 10	639,699.00	12,700.0 0	28	3.00	1,492.6 3	-	-
中 信 证 券	202203100001 3238	华 大 基 因	2022-03- 10	177,210.00	2,200.00	28	3.10	427.27	-	-
中 信 证 券	202203100001 3240	迈 瑞 医 疗	2022-03- 10	1,724,862. 00	5,800.00	28	1.90	2,548.9 6	-	-
中 信 证 券	202203100001 3242	爱 美 客	2022-03- 10	898,700.00	1,900.00	28	2.60	1,817.3 7	-	-
中 信 证 券	202203100001 3244	英 科 医 疗	2022-03- 10	159,256.00	3,400.00	28	2.70	334.44	-	-
中	202203100001	安	2022-03-	488,899.00	6,700.00	28	3.30	1,254.8	-	-

信 证 券	3246	克 创 新	10					4		
中 信 证 券	202203100001 3248	稳 健 医 疗	2022-03- 10	549,680.00	8,000.00	28	3.30	1,410.8 5	-	-
中 信 证 券	202203100001 3250	智 飞 生 物	2022-03- 10	835,660.00	7,000.00	28	2.50	1,624.8 9	-	-
中 信 证 券	202203100001 3252	康 泰 生 物	2022-03- 10	267,991.00	3,700.00	28	2.10	437.72	-	-
中 信 证 券	202203100001 3254	蓝 思 科 技	2022-03- 10	218,960.00	17,000.0 0	28	2.00	340.60	-	-
中 信 证 券	202203100001 3256	晶 盛 机 电	2022-03- 10	849,555.00	13,500.0 0	28	2.80	1,850.1 4	-	-
中 信 证 券	202203100001 3258	温 氏 股 份	2022-03- 10	761,616.00	38,700.0 0	28	2.70	1,599.3 9	-	-
中 信 证 券	202203100001 3260	三 环 集 团	2022-03- 10	359,566.00	11,300.0 0	28	1.90	531.36	-	-
中 信 证 券	202203100001 3262	先 导 智 能	2022-03- 10	571,136.00	9,700.00	28	2.40	1,066.1 2	-	-
中 信 证 券	202203100001 3264	沃 森 生 物	2022-03- 10	584,568.00	13,800.0 0	28	2.40	1,091.1 9	-	-
中 信 证 券	202203100001 3266	泰 格 医 药	2022-03- 10	404,670.00	4,700.00	28	2.20	692.44	-	-
中	202203100001	东	2022-03-	1,728,320.	70,400.0	28	2.10	2,822.9	-	-

信 证 券	3272	方 财 富	10	00	0			2		
中 信 证 券	202203100001 3274	中 微 公 司	2022-03- 10	277,420.00	2,200.00	28	3.00	647.31	-	-
中 信 证 券	202203100001 3276	中 国 通 号	2022-03- 10	106,256.00	22,900.0 0	28	1.80	148.76	-	-
中 信 证 券	202203100001 3278	澜 起 科 技	2022-03- 10	302,498.00	4,100.00	28	2.00	470.55	-	-
中 信 证 券	202203100001 3280	传 音 控 股	2022-03- 10	255,200.00	2,200.00	28	2.70	535.92	-	-
中 信 证 券	202203100001 3282	金 龙 鱼	2022-03- 10	846,216.00	16,800.0 0	14	3.10	1,020.1 6	-	-
中 信 证 券	202203100001 3286	安 克 创 新	2022-03- 10	1,488,588. 00	20,400.0 0	14	3.40	1,968.2 4	-	-
中 信 证 券	202203100001 3320	乐 普 医 疗	2022-03- 10	212,576.00	11,200.0 0	28	2.80	462.94	-	-
中 信 证 券	202203100001 3322	汇 川 技 术	2022-03- 10	924,960.00	16,000.0 0	28	2.10	1,510.7 7	-	-
中 信 证 券	202203110001 7348	蓝 思 科 技	2022-03- 11	22,066.00	1,700.00	14	1.80	15.45	-	-
中 信 证 券	202203110002 0392	汇 川 技 术	2022-03- 11	58,180.00	1,000.00	14	1.80	40.73	-	-
中	202203140000	贝	2022-03-	289,172.00	5,200.00	28	2.80	629.75	-	-

信 证 券	6184	达 药 业	14							
中 信 证 券	202203150001 1423	宋 城 演 艺	2022-03- 15	159,250.00	13,000.0 0	14	3.30	204.37	-	-
中 信 证 券	202203150001 1425	英 科 医 疗	2022-03- 15	47,320.00	1,000.00	14	3.30	60.73	-	-
中 信 证 券	202203210003 0575	爱 尔 眼 科	2022-03- 21	2,632,476. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,105.9 8	-	-
中 信 证 券	202203210003 4915	智 飞 生 物	2022-03- 21	4,566,897. 00	32,300.0 0	14	1.80	3,653.5 2	-	-
中 信 证 券	202203210003 4927	宋 城 演 艺	2022-03- 21	280,800.00	20,000.0 0	14	3.00	374.40	-	-
中 信 证 券	202203210003 4969	爱 尔 眼 科	2022-03- 21	170,940.00	6,000.00	14	1.40	106.37	-	-
中 信 证 券	202203210003 7157	宋 城 演 艺	2022-03- 21	238,680.00	17,000.0 0	14	3.00	318.24	-	-
中 信 证 券	202203220000 0969	宋 城 演 艺	2022-03- 22	1,962,225. 00	142,500. 00	14	3.30	2,698.0 6	-	-
中 信 证 券	202203220001 3435	乐 普 医 疗	2022-03- 22	229,900.00	11,000.0 0	14	1.80	172.43	-	-
中 信 证 券	202203220001 3517	迈 瑞 医 疗	2022-03- 22	609,160.00	2,000.00	14	1.80	456.87	-	-
中	202203220001	健	2022-03-	180,000.00	4,000.00	14	1.80	135.00	-	-

信 证 券	3519	帆 生 物	22							
中 信 证 券	202203220001 3525	爱 尔 眼 科	2022-03- 22	532,570.00	19,000.0 0	14	1.80	399.43	-	-
中 信 证 券	202203220001 4135	阳 光 电 源	2022-03- 22	340,230.00	3,000.00	14	2.20	311.88	-	-
中 信 证 券	202203220001 4137	华 大 基 因	2022-03- 22	673,680.00	8,000.00	14	3.50	982.45	-	-
中 信 证 券	202203230001 2325	东 方 财 富	2022-03- 23	1,297,850. 00	51,400.0 0	28	1.70	1,716.0 5	-	-
中 信 证 券	202203230001 2327	英 科 医 疗	2022-03- 23	118,250.00	2,500.00	28	3.10	285.11	-	-
中 信 证 券	202203230001 2329	金 山 办 公	2022-03- 23	228,108.00	1,200.00	28	2.30	408.06	-	-
中 信 证 券	202203230001 2331	亿 纬 锂 能	2022-03- 23	605,900.00	7,300.00	28	2.10	989.64	-	-
中 信 证 券	202203230001 2333	沃 森 生 物	2022-03- 23	589,436.00	10,100.0 0	28	1.40	641.83	-	-
中 信 证 券	202203230001 2335	贝 达 药 业	2022-03- 23	89,184.00	1,600.00	28	2.50	173.41	-	-
中 信 证 券	202203230001 2337	华 润 微	2022-03- 23	107,640.00	1,800.00	28	2.80	234.42	-	-
中	202203230001	阳	2022-03-	780,164.00	6,800.00	28	2.10	1,274.2	-	-

信 证 券	2339	光 电 源	23					7		
中 信 证 券	202203230001 2341	乐 普 医 疗	2022-03- 23	174,004.00	8,200.00	28	3.10	419.54	-	-
中 信 证 券	202203230001 2343	中 微 公 司	2022-03- 23	191,152.00	1,600.00	28	1.90	282.48	-	-
中 信 证 券	202203230001 2345	亿 联 网 络	2022-03- 23	175,651.00	2,300.00	28	2.90	396.19	-	-
中 信 证 券	202203230001 2347	沪 硅 产 业	2022-03- 23	118,896.00	4,800.00	28	2.50	231.19	-	-
中 信 证 券	202203230001 2349	同 花 顺	2022-03- 23	126,386.00	1,300.00	28	3.10	304.73	-	-
中 信 证 券	202203230001 2351	先 导 智 能	2022-03- 23	429,834.00	7,100.00	28	1.90	635.20	-	-
中 信 证 券	202203230001 2353	芒 果 超 媒	2022-03- 23	142,920.00	4,500.00	28	3.00	333.48	-	-
中 信 证 券	202203230001 2355	华 大 基 因	2022-03- 23	135,024.00	1,600.00	28	3.40	357.06	-	-
中 信 证 券	202203230001 2357	汇 川 技 术	2022-03- 23	669,825.00	11,700.0 0	28	1.90	989.85	-	-
中 信 证 券	202203230001 2359	欧 普 康 视	2022-03- 23	119,904.00	3,200.00	28	3.20	298.43	-	-
中	202203230001	传	2022-03-	162,400.00	1,600.00	28	2.10	265.25	-	-

信 证 券	2361	音 控 股	23							
中 信 证 券	202203230001 3633	智 飞 生 物	2022-03- 23	686,205.00	5,100.00	28	1.00	533.72	-	-
中 信 证 券	202203230001 3635	三 环 集 团	2022-03- 23	254,146.00	8,300.00	28	2.70	533.71	-	-
中 信 证 券	202203230001 3637	宋 城 演 艺	2022-03- 23	139,638.00	10,200.0 0	28	2.90	314.96	-	-
中 信 证 券	202203230001 3639	华 熙 生 物	2022-03- 23	116,840.00	1,000.00	28	2.80	254.45	-	-
中 信 证 券	202203230001 3645	澜 起 科 技	2022-03- 23	220,350.00	3,000.00	28	1.90	325.63	-	-
中 信 证 券	202203230001 3647	健 帆 生 物	2022-03- 23	140,895.00	3,100.00	28	3.10	339.71	-	-
中 信 证 券	202203230001 3649	康 泰 生 物	2022-03- 23	234,549.00	2,700.00	28	2.90	529.04	-	-
中 信 证 券	202203230001 3651	泰 格 医 药	2022-03- 23	344,828.00	3,400.00	28	0.90	241.38	-	-
中 信 证 券	202203230001 3653	爱 尔 眼 科	2022-03- 23	511,356.00	17,200.0 0	28	1.30	517.04	-	-
中 信 证 券	202203230001 3655	温 氏 股 份	2022-03- 23	615,808.00	28,300.0 0	28	1.30	622.65	-	-
中	202203230001	蓝	2022-03-	151,776.00	12,400.0	28	2.20	259.71	-	-

信 证 券	3657	思 科 技	23		0					
中 信 证 券	202203230001 3659	中 国 通 号	2022-03- 23	75,150.00	16,700.0 0	28	2.60	151.97	-	-
中 信 证 券	202203240000 0822	乐 普 医 疗	2022-03- 24	320,850.00	15,000.0 0	28	3.20	798.56	-	-
中 信 证 券	202203240000 0858	温 氏 股 份	2022-03- 24	1,089,000. 00	50,000.0 0	28	1.40	1,185.8 0	-	-
中 信 证 券	202203240001 0529	康 泰 生 物	2022-03- 24	185,320.00	2,000.00	28	2.90	418.00	-	-
中 信 证 券	202203240001 0533	金 龙 鱼	2022-03- 24	823,200.00	16,800.0 0	14	3.30	1,056.4 4	-	-
中 信 证 券	202203240001 0535	安 克 创 新	2022-03- 24	1,493,484. 00	20,400.0 0	14	3.00	1,742.4 0	-	-
中 信 证 券	202203250001 5822	蓝 思 科 技	2022-03- 25	19,941.00	1,700.00	14	1.80	13.96	-	-
中 信 证 券	202203250001 5836	汇 川 技 术	2022-03- 25	54,830.00	1,000.00	14	1.80	38.38	-	-
中 信 证 券	202203290000 5746	英 科 医 疗	2022-03- 29	46,600.00	1,000.00	14	3.40	61.62	-	-
中 信 证 券	202203290000 5750	宋 城 演 艺	2022-03- 29	171,340.00	13,000.0 0	14	3.30	219.89	-	-
中	202203290000	同	2022-03-	3,240.00	-	28	2.80	-	-	-

信 证 券	5860	花 顺	10							
中 信 证 券	202203290000 5942	同 花 顺	2022-03- 23	2,340.00	-	28	3.10	-	-	-
中 信 证 券	202203310000 0914	蓝 思 科 技	2022-03- 31	115,533.00	9,900.00	28	1.80	161.75	-	-
中 信 证 券	202203310000 0923	乐 普 医 疗	2022-03- 31	123,037.00	6,100.00	28	1.80	172.25	-	-
中 信 证 券	202203310000 0930	先 导 智 能	2022-03- 31	946,728.00	16,200.0 0	28	1.80	1,325.4 2	-	-
中 信 证 券	202203310000 0987	沃 森 生 物	2022-03- 31	411,525.00	7,500.00	28	1.80	576.14	-	-
中 信 证 券	202203310000 1121	三 环 集 团	2022-03- 31	159,543.00	5,700.00	28	1.80	223.36	-	-
中 信 证 券	202204060005 0773	宋 城 演 艺	2022-04- 06	278,000.00	20,000.0 0	14	3.30	356.77	-	-
中 信 证 券	202204060005 0775	宋 城 演 艺	2022-04- 06	236,300.00	17,000.0 0	14	3.30	303.25	-	-
中 信 证 券	202204060005 0777	爱 尔 眼 科	2022-04- 06	190,200.00	6,000.00	14	2.80	207.11	-	-
中 信 证 券	202204060005 0779	阳 光 电 源	2022-04- 06	307,740.00	3,000.00	14	3.10	371.00	-	-
中	202204060005	宋	2022-04-	1,980,750.	142,500.	14	3.30	2,541.9	-	-

信 证 券	0781	城 演 艺	06	00	00			6		
中 信 证 券	202204060005 0783	华 大 基 因	2022-04- 06	654,480.00	8,000.00	14	3.40	865.37	-	-
中 信 证 券	202204060005 6293	健 帆 生 物	2022-04- 06	185,560.00	4,000.00	14	1.80	129.89	-	-
中 信 证 券	202204060005 6299	迈 瑞 医 疗	2022-04- 06	602,920.00	2,000.00	14	1.80	422.04	-	-
中 信 证 券	202204060005 6301	乐 普 医 疗	2022-04- 06	220,000.00	11,000.0 0	14	1.80	154.00	-	-
中 信 证 券	202204060005 6307	爱 尔 眼 科	2022-04- 06	602,300.00	19,000.0 0	14	1.80	421.61	-	-
中 信 证 券	202204060005 6311	智 飞 生 物	2022-04- 06	4,406,366. 00	32,300.0 0	14	1.80	3,084.4 6	-	-
中 信 证 券	202204060005 9899	爱 尔 眼 科	2022-04- 06	2,929,080. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,050.3 6	-	-
中 信 证 券	202204070001 3972	健 帆 生 物	2022-04- 07	192,276.00	4,200.00	28	3.20	478.55	-	-
中 信 证 券	202204070001 3974	芒 果 超 媒	2022-04- 07	194,680.00	6,200.00	28	3.20	484.54	-	-
中 信 证 券	202204070001 3976	宋 城 演 艺	2022-04- 07	187,650.00	13,900.0 0	28	3.20	467.04	-	-
中	202204070001	卓	2022-04-	721,764.00	3,600.00	28	3.20	1,796.3	-	-

信 证 券	3978	胜 微	07					9		
中 信 证 券	202204070001 3980	澜 起 科 技	2022-04- 07	240,342.00	4,100.00	28	1.20	224.32	-	-
中 信 证 券	202204070001 3982	汇 川 技 术	2022-04- 07	886,720.00	16,000.0 0	28	2.00	1,379.3 4	-	-
中 信 证 券	202204070001 3984	传 音 控 股	2022-04- 07	203,280.00	2,200.00	28	2.40	379.46	-	-
中 信 证 券	202204070001 3986	英 科 医 疗	2022-04- 07	155,652.00	3,400.00	28	3.20	387.40	-	-
中 信 证 券	202204070001 3988	爱 尔 眼 科	2022-04- 07	749,300.00	23,600.0 0	28	2.70	1,573.5 3	-	-
中 信 证 券	202204070001 3990	华 熙 生 物	2022-04- 07	113,710.00	1,000.00	28	3.10	274.17	-	-
中 信 证 券	202204070001 3992	迈 瑞 医 疗	2022-04- 07	1,759,720. 00	5,800.00	28	3.10	4,242.8 8	-	-
中 信 证 券	202204070001 3994	爱 美 客	2022-04- 07	910,100.00	1,900.00	28	3.10	2,194.3 5	-	-
中 信 证 券	202204070001 3996	亿 联 网 络	2022-04- 07	238,976.00	3,200.00	28	3.00	557.61	-	-
中 信 证 券	202204070001 3998	宁 德 时 代	2022-04- 07	6,388,338. 00	12,900.0 0	28	3.10	15,402. 99	-	-
中	202204070001	金	2022-04-	306,476.00	1,700.00	28	2.60	619.76	-	-

信 证 券	4000	山 办 公	07							
中 信 证 券	202204070001 4002	奇 安 信	2022-04- 07	462,160.00	8,000.00	28	2.90	1,042.4 3	-	-
中 信 证 券	202204070001 4004	康 龙 化 成	2022-04- 07	649,857.00	5,700.00	28	3.10	1,566.8 8	-	-
中 信 证 券	202204070001 4006	亿 纬 锂 能	2022-04- 07	746,800.00	10,000.0 0	28	3.00	1,742.5 3	-	-
中 信 证 券	202204070001 4008	华 润 微	2022-04- 07	126,816.00	2,400.00	28	2.40	236.72	-	-
中 信 证 券	202204070001 4010	沪 硅 产 业	2022-04- 07	145,134.00	6,600.00	28	3.40	383.80	-	-
中 信 证 券	202204070001 4012	天 合 光 能	2022-04- 07	721,740.00	13,800.0 0	28	4.00	2,245.4 1	-	-
中 信 证 券	202204070001 4014	阳 光 电 源	2022-04- 07	942,555.00	9,300.00	28	3.00	2,199.3 0	-	-
中 信 证 券	202204070001 4016	华 大 基 因	2022-04- 07	174,790.00	2,200.00	28	3.30	448.63	-	-
中 信 证 券	202204070001 4018	金 龙 鱼	2022-04- 07	609,727.00	12,700.0 0	28	3.10	1,470.1 2	-	-
中 信 证 券	202204070001 4020	同 花 顺	2022-04- 07	167,490.00	1,800.00	28	3.20	416.86	-	-
中	202204070001	中	2022-04-	1,251,384.	27,600.0	28	1.40	1,362.6	-	-

信 证 券	4022	芯 国 际	07	00	0			2		
中 信 证 券	202204070001 4024	欧 普 康 视	2022-04- 07	153,648.00	4,400.00	28	3.20	382.41	-	-
中 信 证 券	202204070001 4026	贝 达 药 业	2022-04- 07	118,668.00	2,200.00	28	3.20	295.35	-	-
中 信 证 券	202204070001 4028	乐 普 医 疗	2022-04- 07	216,048.00	11,200.0 0	28	3.20	537.72	-	-
中 信 证 券	202204070001 4030	稳 健 医 疗	2022-04- 07	484,400.00	8,000.00	28	3.30	1,243.2 9	-	-
中 信 证 券	202204070001 4032	智 飞 生 物	2022-04- 07	924,840.00	7,000.00	28	2.50	1,798.3 0	-	-
中 信 证 券	202204070001 4034	安 克 创 新	2022-04- 07	431,480.00	6,700.00	28	3.20	1,073.9 1	-	-
中 信 证 券	202204070001 4036	中 国 通 号	2022-04- 07	103,737.00	22,900.0 0	28	2.60	209.78	-	-
中 信 证 券	202204070001 4038	蓝 思 科 技	2022-04- 07	190,230.00	17,000.0 0	28	3.20	473.46	-	-
中 信 证 券	202204070001 4040	康 泰 生 物	2022-04- 07	322,270.00	3,700.00	28	3.30	827.16	-	-
中 信 证 券	202204070001 4042	三 环 集 团	2022-04- 07	311,654.00	11,300.0 0	28	3.10	751.43	-	-
中	202204070001	晶	2022-04-	754,380.00	13,500.0	28	2.80	1,642.8	-	-

信 证 券	4044	盛 机 电	07		0			7		
中 信 证 券	202204070001 4046	先 导 智 能	2022-04- 07	519,920.00	9,700.00	28	2.90	1,172.7 1	-	-
中 信 证 券	202204070001 4048	温 氏 股 份	2022-04- 07	827,793.00	38,700.0 0	28	2.60	1,673.9 8	-	-
中 信 证 券	202204070001 4050	东 方 财 富	2022-04- 07	1,795,200. 00	70,400.0 0	28	2.40	3,351.0 4	-	-
中 信 证 券	202204070001 4052	中 微 公 司	2022-04- 07	251,460.00	2,200.00	28	1.40	273.81	-	-
中 信 证 券	202204070001 4054	沃 森 生 物	2022-04- 07	787,980.00	13,800.0 0	28	2.40	1,470.9 0	-	-
中 信 证 券	202204070001 4056	泰 格 医 药	2022-04- 07	486,356.00	4,700.00	28	2.20	832.21	-	-
中 信 证 券	202204070001 4070	安 克 创 新	2022-04- 07	1,313,760. 00	20,400.0 0	14	3.30	1,685.9 9	-	-
中 信 证 券	202204070001 4072	金 龙 鱼	2022-04- 07	806,568.00	16,800.0 0	14	3.20	1,003.7 3	-	-
中 信 证 券	202204080001 5423	汇 川 技 术	2022-04- 08	56,040.00	1,000.00	14	1.80	39.23	-	-
中 信 证 券	202204080001 5429	蓝 思 科 技	2022-04- 08	18,938.00	1,700.00	14	1.80	13.26	-	-
中	202204150000	爱	2022-04-	3,990.00	-	28	3.10	-	-	-

信 证 券	5444	美 客	07							
中 信 证 券	202204190000 3974	东 方 财 富	2022-04- 07	5,632.00	-	28	2.40	-	-	-
中 信 证 券	202204190000 4196	东 方 财 富	2022-03- 23	4,112.00	-	28	1.70	-	-	-
中 信 证 券	202204190000 4208	东 方 财 富	2022-03- 23	-	10,280.0 0	28	1.70	-	-	-
中 信 证 券	202204190000 4296	东 方 财 富	2022-04- 07	-	14,080.0 0	28	2.40	-	-	-
中 信 证 券	202204200003 9098	健 帆 生 物	2022-04- 20	174,360.00	4,000.00	14	1.80	130.77	-	-
中 信 证 券	202204200003 9158	欧 普 康 视	2022-04- 20	111,840.00	3,200.00	28	3.10	269.66	-	-
中 信 证 券	202204200003 9160	汇 川 技 术	2022-04- 20	621,855.00	11,700.0 0	28	3.60	1,741.1 9	-	-
中 信 证 券	202204200003 9162	传 音 控 股	2022-04- 20	143,152.00	1,600.00	28	2.30	256.08	-	-
中 信 证 券	202204200004 9586	华 润 微	2022-04- 20	87,570.00	1,800.00	28	3.70	252.01	-	-
中 信 证 券	202204200004 9588	中 国 通 号	2022-04- 20	73,981.00	16,700.0 0	28	2.90	166.87	-	-
中	202204200004	智	2022-04-	548,199.00	5,100.00	28	2.00	852.75	-	-

信 证 券	9590	飞 生 物	20							
中 信 证 券	202204200004 9592	蓝 思 科 技	2022-04- 20	131,936.00	12,400.0 0	28	2.00	205.23	-	-
中 信 证 券	202204200004 9594	爱 尔 眼 科	2022-04- 20	579,296.00	17,200.0 0	28	2.90	1,306.6 3	-	-
中 信 证 券	202204200004 9596	泰 格 医 药	2022-04- 20	329,426.00	3,400.00	28	3.40	871.15	-	-
中 信 证 券	202204200004 9598	温 氏 股 份	2022-04- 20	615,808.00	28,300.0 0	28	3.40	1,628.4 7	-	-
中 信 证 券	202204200004 9600	康 泰 生 物	2022-04- 20	205,740.00	2,700.00	28	3.00	480.06	-	-
中 信 证 券	202204200004 9602	澜 起 科 技	2022-04- 20	179,490.00	3,000.00	28	2.60	362.97	-	-
中 信 证 券	202204200004 9604	健 帆 生 物	2022-04- 20	135,129.00	3,100.00	28	3.00	315.30	-	-
中 信 证 券	202204200004 9606	三 环 集 团	2022-04- 20	233,645.00	8,300.00	28	3.60	654.21	-	-
中 信 证 券	202204200004 9608	华 熙 生 物	2022-04- 20	117,430.00	1,000.00	28	3.00	274.00	-	-
中 信 证 券	202204200004 9610	宋 城 演 艺	2022-04- 20	146,472.00	10,200.0 0	28	3.50	398.73	-	-
中	202204200004	贝	2022-04-	74,672.00	1,600.00	28	2.60	151.00	-	-

信 证 券	9612	达 药 业	20							
中 信 证 券	202204200004 9614	亿 纬 锂 能	2022-04- 20	493,480.00	7,300.00	28	2.90	1,113.0 7	-	-
中 信 证 券	202204200004 9616	沃 森 生 物	2022-04- 20	576,508.00	10,100.0 0	28	2.50	1,120.9 9	-	-
中 信 证 券	202204200004 9618	东 方 财 富	2022-04- 20	1,059,354. 00	51,400.0 0	28	1.20	988.73	-	-
中 信 证 券	202204200004 9620	英 科 医 疗	2022-04- 20	106,325.00	2,500.00	28	3.40	281.17	-	-
中 信 证 券	202204200004 9622	金 山 办 公	2022-04- 20	218,160.00	1,200.00	28	1.90	322.39	-	-
中 信 证 券	202204200004 9628	先 导 智 能	2022-04- 20	332,990.00	7,100.00	28	0.90	233.09	-	-
中 信 证 券	202204200004 9630	宋 城 演 艺	2022-04- 20	287,200.00	20,000.0 0	14	3.60	430.80	-	-
中 信 证 券	202204200004 9632	爱 尔 眼 科	2022-04- 20	202,080.00	6,000.00	14	3.00	252.60	-	-
中 信 证 券	202204200004 9634	宋 城 演 艺	2022-04- 20	2,046,300. 00	142,500. 00	14	3.60	3,069.4 5	-	-
中 信 证 券	202204200004 9636	华 大 基 因	2022-04- 20	584,560.00	8,000.00	14	3.70	901.20	-	-
中	202204200004	宋	2022-04-	244,120.00	17,000.0	14	3.60	366.18	-	-

信 证 券	9638	城 演 艺	20		0					
中 信 证 券	202204200004 9640	阳 光 电 源	2022-04- 20	490,144.00	6,800.00	28	3.20	1,219.9 1	-	-
中 信 证 券	202204200004 9642	乐 普 医 疗	2022-04- 20	156,456.00	8,200.00	28	3.20	389.40	-	-
中 信 证 券	202204200004 9644	华 大 基 因	2022-04- 20	116,912.00	1,600.00	28	3.60	327.35	-	-
中 信 证 券	202204200004 9646	沪 硅 产 业	2022-04- 20	107,520.00	4,800.00	28	3.10	259.24	-	-
中 信 证 券	202204200004 9648	同 花 顺	2022-04- 20	117,962.00	1,300.00	28	3.40	311.94	-	-
中 信 证 券	202204200004 9650	中 微 公 司	2022-04- 20	169,920.00	1,600.00	28	2.00	264.32	-	-
中 信 证 券	202204200004 9652	芒 果 超 媒	2022-04- 20	133,560.00	4,500.00	28	3.40	353.19	-	-
中 信 证 券	202204200004 9654	亿 联 网 络	2022-04- 20	178,572.00	2,300.00	28	3.30	458.33	-	-
中 信 证 券	202204200004 9662	阳 光 电 源	2022-04- 20	216,240.00	3,000.00	14	3.30	297.33	-	-
中 信 证 券	202204200004 9870	智 飞 生 物	2022-04- 20	3,471,927. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,603.9 5	-	-
中	202204200004	爱	2022-04-	639,920.00	19,000.0	14	1.80	479.94	-	-

信 证 券	9872	尔 眼 科	20		0					
中 信 证 券	202204200004 9874	迈 瑞 医 疗	2022-04- 20	599,400.00	2,000.00	14	1.80	449.55	-	-
中 信 证 券	202204200004 9876	爱 尔 眼 科	2022-04- 20	3,112,032. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,334.0 2	-	-
中 信 证 券	202204200004 9878	乐 普 医 疗	2022-04- 20	209,880.00	11,000.0 0	14	1.80	157.41	-	-
中 信 证 券	202204210001 2761	康 泰 生 物	2022-04- 21	147,760.00	2,000.00	28	3.00	344.77	-	-
中 信 证 券	202204210001 2763	安 克 创 新	2022-04- 21	1,182,588. 00	20,400.0 0	14	3.70	1,701.6 1	-	-
中 信 证 券	202204210001 2773	温 氏 股 份	2022-04- 21	1,035,000. 00	50,000.0 0	28	3.40	2,737.0 0	-	-
中 信 证 券	202204210001 2775	金 龙 鱼	2022-04- 21	796,320.00	16,800.0 0	14	3.70	1,145.8 2	-	-
中 信 证 券	202204220001 5180	蓝 思 科 技	2022-04- 22	18,360.00	1,700.00	14	1.80	12.85	-	-
中 信 证 券	202204220001 5192	汇 川 技 术	2022-04- 22	50,430.00	1,000.00	14	1.80	35.30	-	-
中 信 证 券	202204250000 6102	沃 森 生 物	2022-03- 31	202.50	-	28	1.80	-	-	-
中	202204250000	沃	2022-04-	272.70	-	28	2.50	-	-	-

信 证 券	6312	森 生 物	20							
中 信 证 券	202204250000 6686	沃 森 生 物	2022-04- 07	372.60	-	28	2.40	-	-	-
中 信 证 券	202204270000 0940	同 花 顺	2022-04- 27	921,147.00	12,300.0 0	14	3.40	1,217.9 6	-	-
中 信 证 券	202204280000 1170	宋 城 演 艺	2022-04- 28	1,201,200. 00	100,100. 00	14	3.20	1,494.8 3	-	-
中 信 证 券	202204280000 8964	沃 森 生 物	2022-04- 28	373,725.00	7,500.00	28	1.80	523.22	-	-
中 信 证 券	202204280000 8970	乐 普 医 疗	2022-04- 28	97,966.00	6,100.00	28	1.80	137.15	-	-
中 信 证 券	202204280000 8994	先 导 智 能	2022-04- 28	684,288.00	16,200.0 0	28	1.80	958.00	-	-
中 信 证 券	202204280000 8996	三 环 集 团	2022-04- 28	140,505.00	5,700.00	28	1.80	196.71	-	-
中 信 证 券	202204280000 8998	蓝 思 科 技	2022-04- 28	90,981.00	9,900.00	28	1.80	127.37	-	-
中 信 证 券	202205050005 7235	迈 瑞 医 疗	2022-05- 05	633,940.00	2,000.00	14	1.80	443.76	-	-
中 信 证 券	202205050005 7241	爱 尔 眼 科	2022-05- 05	681,910.00	19,000.0 0	14	1.80	477.34	-	-
中	202205050005	乐	2022-05-	191,290.00	11,000.0	14	1.80	133.90	-	-

信 证 券	7245	普 医 疗	05		0					
中 信 证 券	202205050005 7251	健 帆 生 物	2022-05- 05	170,160.00	4,000.00	14	1.80	119.11	-	-
中 信 证 券	202205050005 8583	澜 起 科 技	2022-05- 05	250,100.00	4,100.00	28	2.60	505.76	-	-
中 信 证 券	202205050005 8585	沃 森 生 物	2022-05- 05	711,804.00	13,800.0 0	28	3.00	1,660.8 8	-	-
中 信 证 券	202205050005 8587	汇 川 技 术	2022-05- 05	933,280.00	16,000.0 0	28	2.00	1,451.7 7	-	-
中 信 证 券	202205050005 8589	智 飞 生 物	2022-05- 05	686,000.00	7,000.00	28	2.50	1,333.8 9	-	-
中 信 证 券	202205050005 8591	晶 盛 机 电	2022-05- 05	693,225.00	13,500.0 0	28	2.30	1,240.1 0	-	-
中 信 证 券	202205050005 8593	阳 光 电 源	2022-05- 05	591,666.00	9,300.00	28	3.00	1,380.5 5	-	-
中 信 证 券	202205050005 8595	宋 城 演 艺	2022-05- 05	170,692.00	13,900.0 0	28	3.10	411.56	-	-
中 信 证 券	202205050005 8597	乐 普 医 疗	2022-05- 05	194,768.00	11,200.0 0	28	2.10	318.12	-	-
中 信 证 券	202205050005 8601	东 方 财 富	2022-05- 05	1,576,960. 00	70,400.0 0	28	2.10	2,575.7 0	-	-
中	202205050005	同	2022-05-	145,998.00	1,800.00	28	3.30	374.73	-	-

信 证 券	8603	花 顺	05							
中 信 证 券	202205050005 8605	亿 纬 锂 能	2022-05- 05	658,800.00	10,000.0 0	28	2.20	1,127.2 8	-	-
中 信 证 券	202205050005 8607	爱 尔 眼 科	2022-05- 05	847,004.00	23,600.0 0	28	2.70	1,778.7 1	-	-
中 信 证 券	202205050005 8609	康 泰 生 物	2022-05- 05	241,536.00	3,700.00	28	2.80	526.01	-	-
中 信 证 券	202205050005 8611	宁 德 时 代	2022-05- 05	4,850,400. 00	12,900.0 0	28	3.20	12,072. 11	-	-
中 信 证 券	202205050005 8613	欧 普 康 视	2022-05- 05	163,372.00	4,400.00	28	2.90	368.49	-	-
中 信 证 券	202205050005 8615	英 科 医 疗	2022-05- 05	97,614.00	3,400.00	28	2.90	220.17	-	-
中 信 证 券	202205050005 8617	贝 达 药 业	2022-05- 05	96,646.00	2,200.00	28	2.30	172.89	-	-
中 信 证 券	202205050005 8619	华 大 基 因	2022-05- 05	141,944.00	2,200.00	28	3.00	331.20	-	-
中 信 证 券	202205050005 8621	泰 格 医 药	2022-05- 05	413,271.00	4,700.00	28	2.30	739.30	-	-
中 信 证 券	202205050005 8623	亿 联 网 络	2022-05- 05	242,304.00	3,200.00	28	3.10	584.22	-	-
中	202205050005	蓝	2022-05-	171,190.00	17,000.0	28	3.20	426.07	-	-

信 证 券	8625	思 科 技	05		0					
中 信 证 券	202205050005 8627	芒 果 超 媒	2022-05- 05	217,620.00	6,200.00	28	2.70	457.00	-	-
中 信 证 券	202205050005 8629	健 帆 生 物	2022-05- 05	178,668.00	4,200.00	28	3.20	444.68	-	-
中 信 证 券	202205050005 8631	三 环 集 团	2022-05- 05	323,293.00	11,300.0 0	28	2.00	502.90	-	-
中 信 证 券	202205050005 8633	温 氏 股 份	2022-05- 05	720,981.00	38,700.0 0	28	3.30	1,850.5 2	-	-
中 信 证 券	202205050005 8635	先 导 智 能	2022-05- 05	433,396.00	9,700.00	28	2.00	674.17	-	-
中 信 证 券	202205050005 8637	卓 胜 微	2022-05- 05	658,152.00	3,600.00	28	2.60	1,330.9 3	-	-
中 信 证 券	202205050005 8639	迈 瑞 医 疗	2022-05- 05	1,838,426. 00	5,800.00	28	2.20	3,145.7 5	-	-
中 信 证 券	202205050005 8641	金 龙 鱼	2022-05- 05	560,959.00	12,700.0 0	28	2.70	1,178.0 1	-	-
中 信 证 券	202205050005 8643	康 龙 化 成	2022-05- 05	665,760.00	5,700.00	28	3.20	1,657.0 0	-	-
中 信 证 券	202205050005 8645	爱 美 客	2022-05- 05	949,981.00	1,900.00	28	2.60	1,921.0 7	-	-
中	202205050005	稳	2022-05-	463,120.00	8,000.00	28	3.40	1,224.7	-	-

信 证 券	8647	健 医 疗	05					0		
中 信 证 券	202205050005 8649	安 克 创 新	2022-05- 05	381,699.00	6,700.00	28	2.10	623.44	-	-
中 信 证 券	202205050005 8651	中 国 通 号	2022-05- 05	100,989.00	22,900.0 0	28	2.10	164.95	-	-
中 信 证 券	202205050005 8667	中 芯 国 际	2022-05- 05	1,113,936. 00	27,600.0 0	28	1.90	1,646.1 5	-	-
中 信 证 券	202205050005 8669	天 合 光 能	2022-05- 05	718,704.00	13,800.0 0	28	4.90	2,739.0 6	-	-
中 信 证 券	202205050005 8671	金 山 办 公	2022-05- 05	327,607.00	1,700.00	28	2.20	560.57	-	-
中 信 证 券	202205050006 5391	传 音 控 股	2022-05- 05	185,900.00	2,200.00	28	2.70	390.39	-	-
中 信 证 券	202205050006 5393	中 微 公 司	2022-05- 05	229,350.00	2,200.00	28	2.40	428.12	-	-
中 信 证 券	202205050006 5395	沪 硅 产 业	2022-05- 05	139,590.00	6,600.00	28	5.90	640.56	-	-
中 信 证 券	202205050006 5397	华 熙 生 物	2022-05- 05	133,000.00	1,000.00	28	3.20	331.02	-	-
中 信 证 券	202205050006 5401	奇 安 信	2022-05- 05	394,800.00	8,000.00	28	4.30	1,320.3 9	-	-
中	202205050006	华	2022-05-	116,328.00	2,400.00	28	3.10	280.48	-	-

信 证 券	5403	润 微	05							
中 信 证 券	202205050006 8693	智 飞 生 物	2022-05- 05	3,165,400. 00	32,300.0 0	14	1.80	2,215.7 8	-	-
中 信 证 券	202205050006 8695	爱 尔 眼 科	2022-05- 05	3,316,236. 00	92,400.0 0	14	1.80	2,321.3 7	-	-
中 信 证 券	202205050007 0539	宋 城 演 艺	2022-05- 05	208,760.00	17,000.0 0	14	3.20	259.79	-	-
中 信 证 券	202205050007 0541	爱 尔 眼 科	2022-05- 05	215,340.00	6,000.00	14	2.80	234.48	-	-
中 信 证 券	202205050007 0543	阳 光 电 源	2022-05- 05	190,860.00	3,000.00	14	3.10	230.09	-	-
中 信 证 券	202205050007 0545	华 大 基 因	2022-05- 05	516,160.00	8,000.00	14	3.10	622.26	-	-
中 信 证 券	202205050007 0547	安 克 创 新	2022-05- 05	1,162,188. 00	20,400.0 0	14	2.20	994.32	-	-
中 信 证 券	202205050007 0549	金 龙 鱼	2022-05- 05	742,056.00	16,800.0 0	14	2.80	808.02	-	-
中 信 证 券	202205050007 4773	欧 普 康 视	2022-05- 05	642.40	-	28	2.90	-	-	-
中 信 证 券	202205050007 4911	欧 普 康 视	2022-04- 20	467.20	-	28	3.10	-	-	-
中	202205060001	蓝	2022-05-	16,337.00	1,700.00	14	1.80	11.44	-	-

信 证 券	4637	思 科 技	06							
中 信 证 券	202205060001 7627	汇 川 技 术	2022-05- 06	55,810.00	1,000.00	14	1.80	39.07	-	-
中 信 证 券	202205100000 0562	爱 美 客	2022-05- 10	509,993.00	1,100.00	14	3.60	713.99	-	-
中 信 证 券	202205100000 0564	东 方 财 富	2022-05- 10	440,994.00	20,100.0 0	14	1.90	325.85	-	-
中 信 证 券	202205100000 0565	安 克 创 新	2022-05- 10	404,680.00	6,700.00	14	3.70	582.29	-	-
中 信 证 券	202205100000 0566	智 飞 生 物	2022-05- 10	419,078.00	4,300.00	14	2.30	374.84	-	-
中 信 证 券	202205100000 0567	卓 胜 微	2022-05- 10	403,128.00	2,200.00	14	3.80	595.73	-	-
中 信 证 券	202205100000 0570	沃 森 生 物	2022-05- 10	599,165.00	11,900.0 0	14	3.10	722.33	-	-
中 信 证 券	202205100000 0572	汇 川 技 术	2022-05- 10	468,300.00	8,400.00	14	3.30	600.99	-	-
中 信 证 券	202205100000 0574	晶 盛 机 电	2022-05- 10	418,237.00	8,300.00	14	3.50	569.27	-	-
中 信 证 券	202205100000 0577	阳 光 电 源	2022-05- 10	262,704.00	3,900.00	14	3.30	337.14	-	-
中	202205100000	宋	2022-05-	409,680.00	36,000.0	14	2.00	318.64	-	-

信 证 券	0580	城 演 艺	10		0					
中 信 证 券	202205100000 0582	同 花 顺	2022-05- 10	401,900.00	5,000.00	14	3.50	547.03	-	-
中 信 证 券	202205100000 0584	爱 尔 眼 科	2022-05- 10	510,682.00	15,100.0 0	14	3.20	635.52	-	-
中 信 证 券	202205100000 0586	乐 普 医 疗	2022-05- 10	480,396.00	25,800.0 0	14	2.80	523.10	-	-
中 信 证 券	202205100000 0588	亿 纬 锂 能	2022-05- 10	494,410.00	7,000.00	14	3.40	653.72	-	-
中 信 证 券	202205100000 0590	华 大 基 因	2022-05- 10	305,118.00	4,600.00	14	3.60	427.17	-	-
中 信 证 券	202205100000 0591	泰 格 医 药	2022-05- 10	457,710.00	5,700.00	14	2.80	498.40	-	-
中 信 证 券	202205100000 0594	亿 联 网 络	2022-05- 10	455,762.00	6,200.00	14	3.00	531.72	-	-
中 信 证 券	202205100000 0596	康 泰 生 物	2022-05- 10	445,536.00	6,800.00	14	3.10	537.12	-	-
中 信 证 券	202205100000 0597	康 龙 化 成	2022-05- 10	514,603.00	4,700.00	14	4.10	820.51	-	-
中 信 证 券	202205100000 0598	迈 瑞 医 疗	2022-05- 10	515,270.00	1,700.00	14	1.30	260.50	-	-
中	202205100000	宁	2022-05-	417,087.00	1,100.00	14	3.20	519.04	-	-

信 证 券	0600	德 时 代	10							
中 信 证 券	202205100000 0601	英 科 医 疗	2022-05- 10	294,424.00	10,400.0 0	14	3.40	389.29	-	-
中 信 证 券	202205100000 0606	欧 普 康 视	2022-05- 10	510,736.00	13,700.0 0	14	3.60	715.03	-	-
中 信 证 券	202205100000 0607	蓝 思 科 技	2022-05- 10	367,630.00	37,900.0 0	14	3.10	443.20	-	-
中 信 证 券	202205100000 0608	先 导 智 能	2022-05- 10	392,400.00	9,000.00	14	2.10	320.46	-	-
中 信 证 券	202205100000 0609	芒 果 超 媒	2022-05- 10	539,010.00	15,900.0 0	14	3.20	670.77	-	-
中 信 证 券	202205100000 0612	三 环 集 团	2022-05- 10	448,385.00	16,100.0 0	14	2.90	505.68	-	-
中 信 证 券	202205100000 0615	温 氏 股 份	2022-05- 10	467,232.00	24,800.0 0	14	3.10	563.27	-	-
中 信 证 券	202205100000 0616	健 帆 生 物	2022-05- 10	495,600.00	11,800.0 0	14	3.70	713.11	-	-
中 信 证 券	202205100000 0617	贝 达 药 业	2022-05- 10	414,129.00	9,300.00	14	2.70	434.84	-	-
中 信 证 券	202205100000 0704	沪 硅 产 业	2022-05- 10	474,652.00	21,400.0 0	14	2.60	479.93	-	-
中	202205100000	天	2022-05-	369,240.00	6,800.00	14	3.00	430.78	-	-

信 证 券	0706	合 光 能	10							
中 信 证 券	202205100000 0708	中 微 公 司	2022-05- 10	426,000.00	4,000.00	14	1.30	215.37	-	-
中 信 证 券	202205100000 0709	澜 起 科 技	2022-05- 10	417,996.00	6,800.00	14	2.60	422.64	-	-
中 信 证 券	202205100000 0712	金 山 办 公	2022-05- 10	527,580.00	2,700.00	14	2.70	553.96	-	-
中 信 证 券	202205100000 0714	传 音 控 股	2022-05- 10	340,300.00	4,100.00	14	2.20	291.15	-	-
中 信 证 券	202205100000 0716	石 头 科 技	2022-05- 10	550,000.00	1,000.00	14	2.70	577.50	-	-
中 信 证 券	202205100000 0718	华 润 微	2022-05- 10	448,448.00	9,100.00	14	2.90	505.75	-	-
中 信 证 券	202205100000 0720	中 芯 国 际	2022-05- 10	412,888.00	10,100.0 0	14	2.00	321.14	-	-
中 信 证 券	202205100000 0722	奇 安 信	2022-05- 10	386,370.00	8,100.00	14	3.00	450.77	-	-
中 信 证 券	202205100000 0724	华 熙 生 物	2022-05- 10	567,000.00	4,500.00	14	2.70	595.35	-	-
中 信 证 券	202205100000 0726	中 国 通 号	2022-05- 10	459,194.00	104,600. 00	14	2.00	357.15	-	-
中	202205110000	同	2022-05-	1,003,434.	12,300.0	14	3.40	1,326.7	-	-

信 证 券	9522	花 顺	11	00	0			6		
中 信 证 券	202205120000 8972	宋 城 演 艺	2022-05- 12	1,196,195. 00	100,100. 00	14	3.10	1,442.0 8	-	-
中 信 证 券	202205130000 6852	华 熙 生 物	2022-04- 20	490.00	-	28	3.00	-	-	-
中 信 证 券	202205130000 6946	华 熙 生 物	2022-05- 05	490.00	-	28	3.20	-	-	-
中 信 证 券	202205130000 7035	华 熙 生 物	2022-05- 10	2,205.00	-	14	2.70	-	-	-
中 信 证 券	202205180000 3191	金 山 办 公	2022-05- 18	249,600.00	1,200.00	28	2.60	504.75	-	-
中 信 证 券	202205180000 3193	传 音 控 股	2022-05- 18	134,624.00	1,600.00	28	2.10	219.89	-	-
中 信 证 券	202205180000 3195	华 润 微	2022-05- 18	91,530.00	1,800.00	28	2.80	199.33	-	-
中 信 证 券	202205180000 3197	华 熙 生 物	2022-05- 18	125,600.00	1,000.00	28	2.60	253.99	-	-
中 信 证 券	202205180000 3199	沪 硅 产 业	2022-05- 18	108,816.00	4,800.00	28	2.50	211.59	-	-
中 信 证 券	202205180000 3203	中 微 公 司	2022-05- 18	176,832.00	1,600.00	28	1.20	165.04	-	-
中	202205180000	澜	2022-05-	190,830.00	3,000.00	28	2.50	371.06	-	-

信 证 券	3205	起 科 技	18							
中 信 证 券	202205180000 3349	亿 联 网 络	2022-05- 18	166,865.00	2,300.00	28	2.90	376.37	-	-
中 信 证 券	202205180000 3351	康 泰 生 物	2022-05- 18	156,411.00	2,700.00	28	3.00	364.96	-	-
中 信 证 券	202205180000 3353	东 方 财 富	2022-05- 18	1,144,678. 00	51,400.0 0	28	1.80	1,602.5 5	-	-
中 信 证 券	202205180000 3355	智 飞 生 物	2022-05- 18	476,391.00	5,100.00	28	2.20	815.16	-	-
中 信 证 券	202205180000 3357	沃 森 生 物	2022-05- 18	485,305.00	10,100.0 0	28	3.00	1,132.3 8	-	-
中 信 证 券	202205180000 3359	同 花 顺	2022-05- 18	106,860.00	1,300.00	28	3.40	282.59	-	-
中 信 证 券	202205180000 3361	乐 普 医 疗	2022-05- 18	143,254.00	8,200.00	28	2.70	300.83	-	-
中 信 证 券	202205180000 3363	汇 川 技 术	2022-05- 18	684,450.00	11,700.0 0	28	3.20	1,703.5 2	-	-
中 信 证 券	202205180000 3365	温 氏 股 份	2022-05- 18	511,664.00	28,300.0 0	28	3.00	1,193.8 8	-	-
中 信 证 券	202205180000 3367	爱 尔 眼 科	2022-05- 18	590,648.00	17,200.0 0	28	3.10	1,424.1 2	-	-
中	202205180000	先	2022-05-	340,800.00	7,100.00	28	2.00	530.13	-	-

信 证 券	3369	导 智 能	18							
中 信 证 券	202205180000 3371	欧 普 康 视	2022-05- 18	118,560.00	3,200.00	28	3.50	322.75	-	-
中 信 证 券	202205180000 3373	亿 纬 锂 能	2022-05- 18	573,707.00	7,300.00	28	3.30	1,472.5 1	-	-
中 信 证 券	202205180000 3375	健 帆 生 物	2022-05- 18	129,766.00	3,100.00	28	3.60	363.34	-	-
中 信 证 券	202205180000 3377	阳 光 电 源	2022-05- 18	523,668.00	6,800.00	28	3.20	1,303.3 5	-	-
中 信 证 券	202205180000 3379	芒 果 超 媒	2022-05- 18	159,885.00	4,500.00	28	3.10	385.50	-	-
中 信 证 券	202205180000 3381	蓝 思 科 技	2022-05- 18	122,760.00	12,400.0 0	28	3.00	286.44	-	-
中 信 证 券	202205180000 3383	三 环 集 团	2022-05- 18	249,996.00	8,300.00	28	2.80	544.44	-	-
中 信 证 券	202205180000 3385	泰 格 医 药	2022-05- 18	290,054.00	3,400.00	28	2.70	609.11	-	-
中 信 证 券	202205180000 4839	迈 瑞 医 疗	2022-05- 05	7,000.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205180000 4861	迈 瑞 医 疗	2022-05- 05	20,300.00	-	28	2.20	-	-	-
中	202205180000	迈	2022-05-	5,950.00	-	14	1.30	-	-	-

信 证 券	5002	瑞 医 疗	10							
中 信 证 券	202205180000 5147	安 克 创 新	2022-05- 05	5,360.00	-	28	2.10	-	-	-
中 信 证 券	202205180000 5201	安 克 创 新	2022-05- 05	16,320.00	-	14	2.20	-	-	-
中 信 证 券	202205180000 5252	安 克 创 新	2022-05- 10	5,360.00	-	14	3.70	-	-	-
中 信 证 券	202205190004 1523	温 氏 股 份	2022-05- 19	880,500.00	50,000.0 0	28	3.00	2,054.5 0	-	-
中 信 证 券	202205190004 3097	乐 普 医 疗	2022-05- 19	193,050.00	11,000.0 0	14	1.80	135.14	-	-
中 信 证 券	202205190004 3121	爱 尔 眼 科	2022-05- 19	651,130.00	19,000.0 0	14	1.80	455.79	-	-
中 信 证 券	202205190004 3123	迈 瑞 医 疗	2022-05- 19	604,060.00	2,000.00	14	1.80	422.84	-	-
中 信 证 券	202205190004 3125	健 帆 生 物	2022-05- 19	171,440.00	4,000.00	14	1.80	120.01	-	-
中 信 证 券	202205190005 2265	阳 光 电 源	2022-05- 19	246,960.00	3,000.00	14	3.30	316.93	-	-
中 信 证 券	202205190005 2275	安 克 创 新	2022-05- 19	1,248,888. 00	20,400.0 0	14	3.70	1,797.0 1	-	-
中	202205190005	金	2022-05-	727,104.00	16,800.0	14	3.50	989.67	-	-

信 证 券	2285	龙 鱼	19		0					
中 信 证 券	202205190005 3583	宋 城 演 艺	2022-05- 19	197,030.00	17,000.0 0	14	2.00	153.25	-	-
中 信 证 券	202205190005 3591	华 大 基 因	2022-05- 19	518,960.00	8,000.00	14	3.60	726.54	-	-
中 信 证 券	202205200001 3630	汇 川 技 术	2022-05- 20	60,100.00	1,000.00	14	1.80	51.09	-	-
中 信 证 券	202205200001 5870	蓝 思 科 技	2022-05- 20	17,459.00	1,700.00	14	1.80	14.84	-	-
中 信 证 券	202205240000 0904	宁 德 时 代	2022-05- 24	4,020,400. 00	10,000.0 0	14	3.50	5,472.2 1	-	-
中 信 证 券	202205240000 7004	沃 森 生 物	2022-05- 24	568,701.00	11,900.0 0	14	3.20	707.72	-	-
中 信 证 券	202205240000 7492	天 合 光 能	2022-05- 24	425,000.00	6,800.00	14	4.70	776.81	-	-
中 信 证 券	202205240000 7494	华 润 微	2022-05- 24	451,542.00	9,100.00	14	3.20	561.92	-	-
中 信 证 券	202205240000 7496	石 头 科 技	2022-05- 24	605,160.00	1,000.00	14	2.10	494.21	-	-
中 信 证 券	202205240000 7498	沪 硅 产 业	2022-05- 24	471,442.00	21,400.0 0	14	3.60	660.02	-	-
中	202205240000	华	2022-05-	593,730.00	4,500.00	14	3.00	692.69	-	-

信 证 券	7500	熙 生 物	24							
中 信 证 券	202205240000 7502	传 音 控 股	2022-05- 24	345,015.00	4,100.00	14	2.80	375.68	-	-
中 信 证 券	202205240000 7504	金 山 办 公	2022-05- 24	534,492.00	2,700.00	14	3.00	623.57	-	-
中 信 证 券	202205240000 7506	中 国 通 号	2022-05- 24	455,010.00	104,600. 00	14	2.10	371.59	-	-
中 信 证 券	202205240000 7508	澜 起 科 技	2022-05- 24	421,804.00	6,800.00	14	2.30	377.28	-	-
中 信 证 券	202205240000 7510	奇 安 信	2022-05- 24	379,809.00	8,100.00	14	3.20	472.65	-	-
中 信 证 券	202205240000 7512	中 芯 国 际	2022-05- 24	420,261.00	10,100.0 0	14	1.70	277.84	-	-
中 信 证 券	202205240000 7514	中 微 公 司	2022-05- 24	436,000.00	4,000.00	14	1.40	237.38	-	-
中 信 证 券	202205240000 7548	东 方 财 富	2022-05- 24	443,808.00	20,100.0 0	14	2.60	448.74	-	-
中 信 证 券	202205240000 7550	同 花 顺	2022-05- 24	402,500.00	5,000.00	14	3.50	547.85	-	-
中 信 证 券	202205240000 7552	卓 胜 微	2022-05- 24	418,220.00	2,200.00	14	2.30	374.07	-	-
中	202205240000	阳	2022-05-	302,679.00	3,900.00	14	3.40	400.21	-	-

信 证 券	7554	光 电 源	24							
中 信 证 券	202205240000 7556	宋 城 演 艺	2022-05- 24	410,760.00	36,000.0 0	14	3.10	495.19	-	-
中 信 证 券	202205240000 7558	安 克 创 新	2022-05- 24	401,196.00	6,700.00	14	3.90	608.48	-	-
中 信 证 券	202205240000 7560	汇 川 技 术	2022-05- 24	497,196.00	8,400.00	14	1.70	328.70	-	-
中 信 证 券	202205240000 7562	华 大 基 因	2022-05- 24	317,400.00	4,600.00	14	3.30	407.33	-	-
中 信 证 券	202205240000 7564	宁 德 时 代	2022-05- 24	442,244.00	1,100.00	14	2.60	447.16	-	-
中 信 证 券	202205240000 7566	康 龙 化 成	2022-05- 24	515,590.00	4,700.00	14	4.00	802.03	-	-
中 信 证 券	202205240000 7568	三 环 集 团	2022-05- 24	466,900.00	16,100.0 0	14	2.90	526.56	-	-
中 信 证 券	202205240000 7570	贝 达 药 业	2022-05- 24	414,873.00	9,300.00	14	2.80	451.75	-	-
中 信 证 券	202205240000 7572	欧 普 康 视	2022-05- 24	481,829.00	13,700.0 0	14	3.40	637.09	-	-
中 信 证 券	202205240000 7574	迈 瑞 医 疗	2022-05- 24	493,850.00	1,700.00	14	2.60	499.34	-	-
中	202205240000	英	2022-05-	286,416.00	10,400.0	14	3.30	367.57	-	-

信 证 券	7588	科 医 疗	24		0					
中 信 证 券	202205240000 7590	温 氏 股 份	2022-05- 24	435,240.00	24,800.0 0	14	3.40	575.48	-	-
中 信 证 券	202205240000 7598	健 帆 生 物	2022-05- 24	493,594.00	11,800.0 0	14	3.70	710.23	-	-
中 信 证 券	202205240000 7600	芒 果 超 媒	2022-05- 24	595,296.00	15,900.0 0	14	3.60	833.41	-	-
中 信 证 券	202205240000 7602	先 导 智 能	2022-05- 24	419,400.00	9,000.00	14	2.70	440.37	-	-
中 信 证 券	202205240000 7604	蓝 思 科 技	2022-05- 24	363,840.00	37,900.0 0	14	2.20	311.29	-	-
中 信 证 券	202205240000 7606	晶 盛 机 电	2022-05- 24	456,334.00	8,300.00	14	3.30	585.63	-	-
中 信 证 券	202205240000 7608	泰 格 医 药	2022-05- 24	465,120.00	5,700.00	14	1.30	235.14	-	-
中 信 证 券	202205240000 7610	康 泰 生 物	2022-05- 24	414,800.00	6,800.00	14	3.30	532.33	-	-
中 信 证 券	202205240000 7612	亿 纬 锂 能	2022-05- 24	530,600.00	7,000.00	14	3.10	639.67	-	-
中 信 证 券	202205240000 7614	乐 普 医 疗	2022-05- 24	446,340.00	25,800.0 0	14	3.20	555.45	-	-
中	202205240000	亿	2022-05-	450,306.00	6,200.00	14	3.30	577.89	-	-

信 证 券	7616	联 网 网 络	24							
中 信 证 券	202205240000 7618	爱 尔 眼 科	2022-05- 24	510,531.00	15,100.0 0	14	4.00	794.16	-	-
中 信 证 券	202205240000 7620	智 飞 生 物	2022-05- 24	383,560.00	4,300.00	14	3.20	477.32	-	-
中 信 证 券	202205240000 7622	爱 美 客	2022-05- 24	535,700.00	1,100.00	14	5.40	1,124.9 7	-	-
中 信 证 券	202205250000 7177	同 花 顺	2022-05- 25	996,300.00	12,300.0 0	14	3.50	1,356.0 8	-	-
中 信 证 券	202205250001 1473	金 山 办 公	2022-05- 05	1,190.00	-	28	2.20	-	-	-
中 信 证 券	202205250001 1527	金 山 办 公	2022-05- 18	840.00	-	28	2.60	-	-	-
中 信 证 券	202205250001 1729	金 山 办 公	2022-05- 24	1,890.00	-	14	3.00	-	-	-
中 信 证 券	202205260000 0795	东 方 财 富	2022-05- 26	22,450.00	1,000.00	28	2.30	40.16	-	-
中 信 证 券	202205260000 0811	东 方 财 富	2022-05- 26	22,450.00	1,000.00	14	2.40	20.95	-	-
中 信 证 券	202205260000 6918	三 环 集 团	2022-05- 26	167,295.00	5,700.00	14	1.80	117.11	-	-
中	202205260000	宋	2022-05-	1,198,197.	100,100.	14	3.10	1,444.4	-	-

信 证 券	8416	城 演 艺	26	00	00			9		
中 信 证 券	202205260001 0530	沃 森 生 物	2022-05- 26	358,050.00	7,500.00	14	1.80	250.64	-	-
中 信 证 券	202205260001 0568	先 导 智 能	2022-05- 26	739,692.00	16,200.0 0	14	1.80	517.78	-	-
中 信 证 券	202205260001 1522	蓝 思 科 技	2022-05- 26	99,198.00	9,900.00	14	1.80	69.44	-	-
中 信 证 券	202205260001 1540	乐 普 医 疗	2022-05- 26	108,885.00	6,100.00	14	1.80	76.22	-	-
中 信 证 券	202205260001 2444	稳 健 医 疗	2022-05- 05	7,200.00	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202205270000 7388	贝 达 药 业	2022-05- 05	550.00	-	28	2.30	-	-	-
中 信 证 券	202205270000 7498	贝 达 药 业	2022-05- 24	2,325.00	-	14	2.80	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5580	泰 格 医 药	2022-05- 05	2,350.00	-	28	2.30	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5602	泰 格 医 药	2022-05- 18	1,700.00	-	28	2.70	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5694	泰 格 医 药	2022-05- 24	2,850.00	-	14	1.30	-	-	-
中	202205300000	亿	2022-05-	2,560.00	-	28	3.10	-	-	-

信 证 券	5824	联 网 网 络	05							
中 信 证 券	202205300000 5844	亿 联 网 网 络	2022-05- 18	1,840.00	-	28	2.90	-	-	-
中 信 证 券	202205300000 5924	亿 联 网 网 络	2022-05- 24	4,960.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0221	蓝 思 科 技	2022-05- 05	1,700.00	-	28	3.20	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0279	蓝 思 科 技	2022-05- 18	1,240.00	-	28	3.00	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0411	蓝 思 科 技	2022-05- 20	170.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0451	蓝 思 科 技	2022-05- 24	3,790.00	-	14	2.20	-	-	-
中 信 证 券	202205310001 0589	蓝 思 科 技	2022-05- 26	990.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 1137	亿 纬 锂 能	2022-06- 01	432,650.00	5,000.00	14	2.80	471.11	-	-
中 信 证 券	202206010000 1142	东 方 财 富	2022-06- 01	5,748,672. 00	252,800. 00	14	2.70	6,036.1 1	-	-
中 信 证 券	202206010000 1469	先 导 智 能	2022-06- 01	1,058,960. 00	21,700.0 0	14	1.80	741.27	-	-
中	202206010000	晶	2022-05-	3,780.00	-	28	2.30	-	-	-

信 证 券	6154	盛 机 电	05							
中 信 证 券	202206010000 6296	晶 盛 机 电	2022-05- 24	2,324.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6470	康 泰 生 物	2022-05- 05	3,145.00	-	28	2.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6490	康 泰 生 物	2022-05- 18	2,295.00	-	28	3.00	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6612	康 泰 生 物	2022-05- 24	5,780.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6840	康 泰 生 物	2022-05- 05	-	2,220.00	28	2.80	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6860	康 泰 生 物	2022-05- 18	-	1,620.00	28	3.00	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 6982	康 泰 生 物	2022-05- 24	-	4,080.00	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 8258	宋 城 演 艺	2022-05- 05	695.00	-	28	3.10	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 8304	宋 城 演 艺	2022-05- 19	850.00	-	14	2.00	-	-	-
中 信 证 券	202206010000 8318	宋 城 演 艺	2022-05- 24	1,800.00	-	14	3.10	-	-	-
中	202206010000	宋	2022-05-	5,005.00	-	14	3.10	-	-	-

信 证 券	8342	城 演 艺	26							
中 信 证 券	202206020001 6174	金 龙 鱼	2022-06- 02	759,528.00	16,800.0 0	14	3.50	1,033.8 0	-	-
中 信 证 券	202206020001 6176	阳 光 电 源	2022-06- 02	255,000.00	3,000.00	14	2.00	198.33	-	-
中 信 证 券	202206020001 6180	安 克 创 新	2022-06- 02	1,311,720. 00	20,400.0 0	14	4.10	2,091.4 6	-	-
中 信 证 券	202206060001 0314	汇 川 技 术	2022-06- 06	65,650.00	1,000.00	14	1.80	45.96	-	-
中 信 证 券	202206070000 1424	安 克 创 新	2022-06- 07	984,600.00	15,000.0 0	14	3.80	1,455.0 2	-	-
中 信 证 券	202206070000 1430	亿 纬 锂 能	2022-06- 07	89,850.00	1,000.00	14	3.20	111.81	-	-
中 信 证 券	202206070000 1432	康 泰 生 物	2022-06- 07	48,480.00	1,200.00	14	3.70	69.76	-	-
中 信 证 券	202206070000 1436	宁 德 时 代	2022-06- 07	459,000.00	1,000.00	14	2.70	481.95	-	-
中 信 证 券	202206070000 1447	康 泰 生 物	2022-06- 07	969,600.00	24,000.0 0	14	3.70	1,395.1 5	-	-
中 信 证 券	202206070000 7004	澜 起 科 技	2022-06- 07	464,984.00	6,800.00	14	2.30	415.90	-	-
中	202206070000	中	2022-06-	456,722.00	10,100.0	14	2.30	408.51	-	-

信 证 券	7006	芯 国 际	07		0					
中 信 证 券	202206070000 7008	传 音 控 股	2022-06- 07	416,560.00	4,100.00	14	2.90	469.79	-	-
中 信 证 券	202206070000 7010	华 润 微	2022-06- 07	527,891.00	9,100.00	14	2.80	574.81	-	-
中 信 证 券	202206070000 7012	奇 安 信	2022-06- 07	427,275.00	8,100.00	14	2.80	465.26	-	-
中 信 证 券	202206070000 7014	天 合 光 能	2022-06- 07	443,700.00	6,800.00	14	3.90	672.95	-	-
中 信 证 券	202206070000 7016	中 微 公 司	2022-06- 07	507,200.00	4,000.00	14	2.40	473.39	-	-
中 信 证 券	202206070000 7018	金 山 办 公	2022-06- 07	589,410.00	2,700.00	14	2.40	550.12	-	-
中 信 证 券	202206070000 7020	沪 硅 产 业	2022-06- 07	523,016.00	21,400.0 0	14	3.30	671.20	-	-
中 信 证 券	202206070000 7022	石 头 科 技	2022-06- 07	682,530.00	1,000.00	14	3.30	875.91	-	-
中 信 证 券	202206070000 7028	三 环 集 团	2022-06- 07	506,989.00	16,100.0 0	14	2.50	492.91	-	-
中 信 证 券	202206070000 7030	迈 瑞 医 疗	2022-06- 07	531,624.00	1,700.00	14	2.40	496.18	-	-
中	202206070000	阳	2022-06-	370,851.00	3,900.00	14	2.90	418.24	-	-

信 证 券	7032	光 电 源	07							
中 信 证 券	202206070000 7034	安 克 创 新	2022-06- 07	439,788.00	6,700.00	14	3.80	649.91	-	-
中 信 证 券	202206070000 7036	东 方 财 富	2022-06- 07	479,586.00	20,100.0 0	14	2.70	503.57	-	-
中 信 证 券	202206070000 7038	同 花 顺	2022-06- 07	442,750.00	5,000.00	14	3.70	637.07	-	-
中 信 证 券	202206070000 7040	卓 胜 微	2022-06- 07	466,290.00	2,200.00	14	3.10	562.14	-	-
中 信 证 券	202206070000 7042	康 龙 化 成	2022-06- 07	599,250.00	4,700.00	14	3.50	815.65	-	-
中 信 证 券	202206070000 7044	汇 川 技 术	2022-06- 07	549,276.00	8,400.00	14	2.10	448.58	-	-
中 信 证 券	202206070000 7046	欧 普 康 视	2022-06- 07	606,910.00	13,700.0 0	14	3.40	802.47	-	-
中 信 证 券	202206070000 7048	健 帆 生 物	2022-06- 07	554,718.00	11,800.0 0	14	3.30	711.89	-	-
中 信 证 券	202206070000 7050	晶 盛 机 电	2022-06- 07	498,000.00	8,300.00	14	3.70	716.57	-	-
中 信 证 券	202206070000 7052	泰 格 医 药	2022-06- 07	528,390.00	5,700.00	14	3.40	698.65	-	-
中	202206070000	亿	2022-06-	482,422.00	6,200.00	14	3.30	619.11	-	-

信 证 券	7054	联 网 网 络	07							
中 信 证 券	202206070000 7056	康 泰 生 物	2022-06- 07	274,720.00	6,800.00	14	3.20	341.87	-	-
中 信 证 券	202206070000 7058	芒 果 超 媒	2022-06- 07	564,132.00	15,900.0 0	14	3.50	767.85	-	-
中 信 证 券	202206070000 7062	蓝 思 科 技	2022-06- 07	391,886.00	37,900.0 0	14	2.40	365.76	-	-
中 信 证 券	202206070000 7064	亿 纬 锂 能	2022-06- 07	628,950.00	7,000.00	14	2.80	684.86	-	-
中 信 证 券	202206070000 7066	先 导 智 能	2022-06- 07	474,300.00	9,000.00	14	2.10	387.35	-	-
中 信 证 券	202206070000 7068	智 飞 生 物	2022-06- 07	380,636.00	4,300.00	14	1.80	266.45	-	-
中 信 证 券	202206070000 7070	爱 美 客	2022-06- 07	580,459.00	1,100.00	14	5.60	1,264.1 1	-	-
中 信 证 券	202206070000 7072	爱 尔 眼 科	2022-06- 07	542,694.00	15,100.0 0	14	3.90	823.09	-	-
中 信 证 券	202206070000 7986	华 熙 生 物	2022-06- 07	662,940.00	4,500.00	14	3.20	824.99	-	-
中 信 证 券	202206070000 7992	宁 德 时 代	2022-06- 07	504,900.00	1,100.00	14	3.30	647.96	-	-
中	202206070000	温	2022-06-	441,688.00	24,800.0	14	3.20	549.66	-	-

信 证 券	7996	氏 股 份	07		0					
中 信 证 券	202206070000 7998	乐 普 医 疗	2022-06- 07	453,306.00	25,800.0 0	14	3.00	528.86	-	-
中 信 证 券	202206070000 8288	宁 德 时 代	2022-06- 07	4,590,000. 00	10,000.0 0	14	3.30	5,890.5 0	-	-
中 信 证 券	202206070000 8310	沃 森 生 物	2022-06- 07	552,398.00	11,900.0 0	14	2.90	622.98	-	-
中 信 证 券	202206080000 5541	同 花 顺	2022-06- 08	1,106,877. 00	12,300.0 0	14	3.70	1,592.6 7	-	-
中 信 证 券	202206080000 9652	天 合 光 能	2022-06- 07	1,564.00	-	14	3.90	-	-	-
中 信 证 券	202206090000 6995	三 环 集 团	2022-06- 09	167,466.00	5,700.00	14	1.80	117.23	-	-
中 信 证 券	202206090000 7015	先 导 智 能	2022-06- 09	876,258.00	16,200.0 0	14	1.80	613.38	-	-
中 信 证 券	202206090000 7035	乐 普 医 疗	2022-06- 09	105,042.00	6,100.00	14	1.80	73.53	-	-
中 信 证 券	202206090000 7053	沃 森 生 物	2022-06- 09	338,250.00	7,500.00	14	1.80	236.78	-	-
中 信 证 券	202206090001 1463	三 环 集 团	2022-05- 18	2,656.00	-	28	2.80	-	-	-
中	202206090001	三	2022-06-	5,152.00	-	14	2.50	-	-	-

信 证 券	1603	环 集 团	07							
中 信 证 券	202206090001 1677	三 环 集 团	2022-06- 09	1,824.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206090001 1719	健 帆 生 物	2022-05- 18	2,790.00	-	28	3.60	-	-	-
中 信 证 券	202206090001 1777	健 帆 生 物	2022-06- 07	10,620.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202206130000 2700	健 帆 生 物	2022-06- 13	46,630.00	1,000.00	28	3.20	70.47	51,024.77	70.47
中 信 证 券	202206130000 2702	康 泰 生 物	2022-06- 13	86,284.00	2,200.00	28	3.30	134.46	99,396.00	134.46
中 信 证 券	202206130000 2704	迈 为 股 份	2022-06- 13	382,100.00	1,000.00	28	3.80	685.66	490,900.00	685.66
中 信 证 券	202206130000 2705	温 氏 股 份	2022-06- 13	179,352.00	9,400.00	28	3.40	287.96	200,126.00	287.96
中 信 证 券	202206130000 2706	亿 联 网 络	2022-06- 13	77,170.00	1,000.00	28	3.30	120.26	76,150.00	120.26
中 信 证 券	202206130000 2710	中 科 创 达	2022-06- 13	124,640.00	1,000.00	28	3.30	194.23	130,480.00	194.23
中 信 证 券	202206130000 2711	圣 邦 股 份	2022-06- 13	251,500.00	1,000.00	28	3.40	403.80	182,353.33	403.80
中	202206130000	康	2022-06-	200,880.00	1,600.00	28	3.30	313.04	152,397.02	313.04

信 证 券	2712	龙 化 成	13							
中 信 证 券	202206130000 2714	宁 德 时 代	2022-06- 13	1,905,029. 00	4,300.00	28	2.50	2,248.9 9	2,296,200. 00	2,248.9 9
中 信 证 券	202206130000 2718	阳 光 电 源	2022-06- 13	179,780.00	2,000.00	28	2.80	237.71	196,700.57	237.71
中 信 证 券	202206130000 2720	晶 盛 机 电	2022-06- 13	227,392.00	3,800.00	28	3.10	332.88	256,842.00	332.88
中 信 证 券	202206130000 2722	欣 旺 达	2022-06- 13	94,891.00	3,100.00	28	3.00	134.43	97,960.00	134.43
中 信 证 券	202206130000 2724	北 京 君 正	2022-06- 13	90,840.00	1,000.00	28	2.80	120.11	106,269.00	120.11
中 信 证 券	202206130000 2726	泰 格 医 药	2022-06- 13	275,190.00	3,000.00	28	2.60	337.88	343,350.00	337.88
中 信 证 券	202206130000 2728	先 导 智 能	2022-06- 13	188,220.00	3,000.00	28	3.10	275.53	190,559.96	275.53
中 信 证 券	202206130000 2729	深 信 服	2022-06- 13	101,700.00	1,000.00	28	3.40	163.29	103,781.41	163.29
中 信 证 券	202206130000 2732	三 环 集 团	2022-06- 13	218,526.00	7,700.00	28	2.80	288.94	232,066.27	288.94
中 信 证 券	202206130000 2734	中 伟 股 份	2022-06- 13	128,500.00	1,000.00	28	4.50	273.06	123,900.00	273.06
中	202206130000	爱	2022-06-	517,220.00	1,000.00	28	5.50	1,343.3	600,010.00	1,343.3

信 证 券	2735	美 客	13					3		3
中 信 证 券	202206130000 2737	迈 瑞 医 疗	2022-06- 13	922,064.00	3,100.00	28	3.30	1,436.8 8	970,920.00	1,436.8 8
中 信 证 券	202206130000 2739	芒 果 超 媒	2022-06- 13	84,456.00	2,400.00	28	3.20	127.62	80,064.00	127.62
中 信 证 券	202206130000 2741	卓 胜 微	2022-06- 13	284,850.00	1,500.00	28	2.70	363.19	203,156.25	363.19
中 信 证 券	202206130000 2743	安 克 创 新	2022-06- 13	61,750.00	1,000.00	28	3.80	110.81	66,320.00	110.81
中 信 证 券	202206130000 2745	贝 泰 妮	2022-06- 13	197,010.00	1,000.00	28	3.80	353.52	217,530.00	353.52
中 信 证 券	202206130000 2748	华 利 集 团	2022-06- 13	94,471.00	1,300.00	28	3.30	147.22	95,004.00	147.22
中 信 证 券	202206130000 2749	金 龙 鱼	2022-06- 13	124,956.00	2,700.00	28	3.30	194.72	145,854.00	194.72
中 信 证 券	202206130000 2750	沃 森 生 物	2022-06- 13	479,467.00	10,700.0 0	28	2.30	520.75	517,773.00	520.75
中 信 证 券	202206130000 2754	乐 普 医 疗	2022-06- 13	17,260.00	1,000.00	28	2.50	20.38	18,845.00	20.38
中 信 证 券	202206130000 2756	亿 纬 锂 能	2022-06- 13	219,076.00	2,200.00	28	3.20	331.05	214,500.00	331.05
中	202206130000	智	2022-06-	89,050.00	1,000.00	28	2.30	96.72	111,010.00	96.72

信 证 券	2758	飞 生 物	13							
中 信 证 券	202206130000 2760	爱 尔 眼 科	2022-06- 13	213,846.00	5,800.00	28	2.70	272.66	259,666.00	272.66
中 信 证 券	202206130000 2762	汇 川 技 术	2022-06- 13	379,620.00	5,700.00	28	1.90	340.60	377,072.44	340.60
中 信 证 券	202206130000 2764	同 花 顺	2022-06- 13	89,450.00	1,000.00	28	3.40	143.62	96,150.00	143.62
中 信 证 券	202206130000 2766	东 方 财 富	2022-06- 13	1,532,096. 00	64,700.0 0	28	2.70	1,953.4 2	1,643,380. 00	1,953.4 2
中 信 证 券	202206130000 2852	金 山 办 公	2022-06- 13	247,404.00	1,200.00	28	2.70	315.44	236,544.00	315.44
中 信 证 券	202206130000 2854	传 音 控 股	2022-06- 13	146,970.00	1,500.00	28	2.50	173.51	135,579.64	173.51
中 信 证 券	202206130000 2856	天 合 光 能	2022-06- 13	313,040.00	5,200.00	28	3.20	473.04	339,405.62	473.04
中 信 证 券	202206130000 2858	凯 赛 生 物	2022-06- 13	104,170.00	1,000.00	28	2.90	142.65	111,800.00	142.65
中 信 证 券	202206130000 2860	中 芯 国 际	2022-06- 13	182,960.00	4,000.00	28	2.00	172.79	180,680.00	172.79
中 信 证 券	202206130000 2862	沪 硅 产 业	2022-06- 13	118,727.00	4,900.00	28	3.40	190.62	112,602.00	190.62
中	202206130000	华	2022-06-	88,800.00	1,500.00	28	2.50	104.84	88,862.70	104.84

信 证 券	2864	润 微	13							
中 信 证 券	202206130000 2866	石 头 科 技	2022-06- 13	670,730.00	1,000.00	28	3.30	1,045.2 2	616,700.00	1,045.2 2
中 信 证 券	202206130000 2868	奇 安 信	2022-06- 13	86,054.00	1,700.00	28	1.90	77.21	94,860.00	77.21
中 信 证 券	202206130000 2870	中 微 公 司	2022-06- 13	187,605.00	1,500.00	28	2.70	239.20	175,125.00	239.20
中 信 证 券	202206130000 2872	容 百 科 技	2022-06- 13	106,170.00	1,000.00	28	3.30	165.45	129,440.00	165.45
中 信 证 券	202206130000 2874	澜 起 科 技	2022-06- 13	62,930.00	1,000.00	28	2.30	68.35	60,580.00	68.35
中 信 证 券	202206130002 2392	深 信 服	2022-06- 13	70.00	-	28	3.40	-	0.00	-
中 信 证 券	202206130002 2809	康 龙 化 成	2022-06- 07	2,115.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 2952	康 龙 化 成	2022-06- 13	720.00	-	28	3.30	-	0.00	-
中 信 证 券	202206130002 3133	康 龙 化 成	2022-06- 07	-	2,350.00	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	202206130002 3276	康 龙 化 成	2022-06- 13	-	800.00	28	3.30	-	76,198.51	-
中	202206150002	亿	2022-06-	488,250.00	5,000.00	14	3.20	607.60	-	-

信 证 券	3139	纬 锂 能	15							
中 信 证 券	202206150002 3775	先 导 智 能	2022-06- 15	1,312,633. 00	21,700.0 0	14	1.80	918.84	-	-
中 信 证 券	202206160000 1346	迈 为 股 份	2022-06- 16	393,680.00	1,000.00	14	3.90	597.08	-	-
中 信 证 券	202206160000 1348	深 信 服	2022-06- 16	104,500.00	1,000.00	14	3.50	142.24	-	-
中 信 证 券	202206160000 1371	宁 德 时 代	2022-06- 16	11,507,500 .00	25,000.0 0	28	1.80	8,055.2 5	13,350,000 .00	8,055.2 5
中 信 证 券	202206160001 6577	安 克 创 新	2022-06- 16	1,261,944. 00	20,400.0 0	14	3.80	1,864.8 7	-	-
中 信 证 券	202206160001 6581	金 龙 鱼	2022-06- 16	801,360.00	16,800.0 0	14	4.10	1,277.7 2	-	-
中 信 证 券	202206160001 6585	温 氏 股 份	2022-06- 16	1,027,500. 00	50,000.0 0	14	3.40	1,358.5 8	-	-
中 信 证 券	202206200000 1690	爱 尔 眼 科	2022-06- 20	577,536.00	14,100.0 0	14	3.00	481.28	631,257.00	481.28
中 信 证 券	202206200000 1692	亿 纬 锂 能	2022-06- 20	5,062,500. 00	50,000.0 0	14	2.60	3,656.2 5	4,875,000. 00	3,656.2 5
中 信 证 券	202206200001 5625	北 京 君 正	2022-06- 13	190.00	-	28	2.80	-	0.00	-
中	202206210000	康	2022-06-	88,880.00	1,000.00	14	2.90	64.44	95,248.14	64.44

信 证 券	1522	龙 化 成	21							
中 信 证 券	202206210000 1539	温 氏 股 份	2022-06- 21	6,258,000. 00	300,000. 00	14	2.90	4,537.0 5	6,387,000. 00	4,537.0 5
中 信 证 券	202206210000 7402	宁 德 时 代	2022-06- 21	5,078,500. 00	10,000.0 0	14	2.60	3,301.0 3	5,340,000. 00	3,301.0 3
中 信 证 券	202206210000 7486	安 克 创 新	2022-06- 21	938,100.00	15,000.0 0	14	3.90	914.65	994,800.00	914.65
中 信 证 券	202206210000 7528	亿 纬 锂 能	2022-06- 21	100,300.00	1,000.00	14	3.30	82.75	97,500.00	82.75
中 信 证 券	202206210000 7530	宁 德 时 代	2022-06- 21	507,850.00	1,000.00	14	2.60	330.10	534,000.00	330.10
中 信 证 券	202206210000 8378	智 飞 生 物	2022-06- 21	434,472.00	4,300.00	14	2.40	260.69	477,343.00	260.69
中 信 证 券	202206210000 8380	蓝 思 科 技	2022-06- 21	423,722.00	37,900.0 0	14	3.20	338.98	419,553.00	338.98
中 信 证 券	202206210000 8522	康 泰 生 物	2022-06- 21	51,120.00	1,200.00	14	3.40	43.45	54,216.00	43.45
中 信 证 券	202206210000 8918	澜 起 科 技	2022-06- 21	389,640.00	6,800.00	14	2.40	233.78	411,944.00	233.78
中 信 证 券	202206210000 8920	华 润 微	2022-06- 21	519,792.00	9,100.00	14	2.60	337.87	539,100.38	337.87
中	202206210000	天	2022-06-	437,512.00	6,800.00	14	3.30	360.95	443,838.12	360.95

信 证 券	8922	合 光 能	21							
中 信 证 券	202206210000 8930	东 方 财 富	2022-06- 21	486,219.00	20,100.0 0	14	2.80	340.35	510,540.00	340.35
中 信 证 券	202206210000 8932	金 山 办 公	2022-06- 21	540,000.00	2,700.00	14	2.80	378.00	532,224.00	378.00
中 信 证 券	202206210000 8934	欧 普 康 视	2022-06- 21	729,799.00	13,700.0 0	14	2.90	529.10	783,503.00	529.10
中 信 证 券	202206210000 8936	汇 川 技 术	2022-06- 21	556,500.00	8,400.00	14	2.00	278.25	555,685.70	278.25
中 信 证 券	202206210000 8942	阳 光 电 源	2022-06- 21	342,693.00	3,900.00	14	2.90	248.45	383,566.11	248.45
中 信 证 券	202206210000 8944	康 龙 化 成	2022-06- 21	417,736.00	4,700.00	14	3.40	355.08	447,666.25	355.08
中 信 证 券	202206210000 8946	迈 瑞 医 疗	2022-06- 21	536,095.00	1,700.00	14	3.40	455.68	532,440.00	455.68
中 信 证 券	202206210000 8948	卓 胜 微	2022-06- 21	443,234.00	2,200.00	14	2.80	310.26	297,962.50	310.26
中 信 证 券	202206210000 8950	石 头 科 技	2022-06- 21	671,060.00	1,000.00	14	3.40	570.40	616,700.00	570.40
中 信 证 券	202206210000 8952	亿 联 网 络	2022-06- 21	455,018.00	6,200.00	14	3.40	386.76	472,130.00	386.76
中	202206210000	泰	2022-06-	571,026.00	5,700.00	14	2.70	385.44	652,365.00	385.44

信 证 券	8954	格 医 药	21							
中 信 证 券	202206210000 8960	康 泰 生 物	2022-06- 21	289,680.00	6,800.00	14	3.40	246.23	307,224.00	246.23
中 信 证 券	202206210000 8962	爱 美 客	2022-06- 21	619,399.00	1,100.00	14	5.60	867.16	660,011.00	867.16
中 信 证 券	202206210000 8964	先 导 智 能	2022-06- 21	577,800.00	9,000.00	14	3.20	462.24	571,679.89	462.24
中 信 证 券	202206210000 8966	芒 果 超 媒	2022-06- 21	578,919.00	15,900.0 0	14	3.30	477.61	530,424.00	477.61
中 信 证 券	202206210000 8990	乐 普 医 疗	2022-06- 21	473,946.00	25,800.0 0	14	2.60	308.06	486,201.00	308.06
中 信 证 券	202206210000 8992	温 氏 股 份	2022-06- 21	517,328.00	24,800.0 0	14	3.50	452.66	527,992.00	452.66
中 信 证 券	202206210000 9402	沃 森 生 物	2022-06- 21	570,129.00	11,900.0 0	14	2.40	342.08	575,841.00	342.08
中 信 证 券	202206210000 9492	中 芯 国 际	2022-06- 21	456,116.00	10,100.0 0	14	2.10	239.46	456,217.00	239.46
中 信 证 券	202206210000 9494	中 微 公 司	2022-06- 21	485,120.00	4,000.00	14	2.80	339.58	467,000.00	339.58
中 信 证 券	202206210000 9496	传 音 控 股	2022-06- 21	394,789.00	4,100.00	14	2.60	256.62	370,584.34	256.62
中	202206210000	奇	2022-06-	445,014.00	8,100.00	14	2.00	222.51	451,980.00	222.51

信 证 券	9498	安 信	21							
中 信 证 券	202206210000 9500	三 环 集 团	2022-06- 21	489,762.00	16,100.0 0	14	2.90	355.08	485,229.47	355.08
中 信 证 券	202206210000 9502	健 帆 生 物	2022-06- 21	579,262.00	11,800.0 0	14	3.30	477.89	602,092.30	477.89
中 信 证 券	202206210000 9504	沪 硅 产 业	2022-06- 21	494,982.00	21,400.0 0	14	3.50	433.11	491,772.00	433.11
中 信 证 券	202206210000 9506	同 花 顺	2022-06- 21	474,500.00	5,000.00	14	3.50	415.19	480,750.00	415.19
中 信 证 券	202206210000 9508	安 克 创 新	2022-06- 21	419,018.00	6,700.00	14	3.90	408.54	444,344.00	408.54
中 信 证 券	202206210000 9510	晶 盛 机 电	2022-06- 21	529,540.00	8,300.00	14	3.20	423.63	560,997.00	423.63
中 信 证 券	202206210000 9512	亿 纬 锂 能	2022-06- 21	702,100.00	7,000.00	14	3.30	579.23	682,500.00	579.23
中 信 证 券	202206210000 9514	爱 尔 眼 科	2022-06- 21	615,627.00	15,100.0 0	14	2.80	430.94	676,027.00	430.94
中 信 证 券	202206210000 9530	宁 德 时 代	2022-06- 21	558,635.00	1,100.00	14	2.60	363.11	587,400.00	363.11
中 信 证 券	202206210000 9532	华 熙 生 物	2022-06- 21	663,840.00	4,500.00	14	2.70	448.09	639,810.00	448.09
中	202206210001	圣	2022-06-	500.00	-	28	3.40	-	0.00	-

信 证 券	0117	邦 股 份	13							
中 信 证 券	202206210001 0359	圣 邦 股 份	2022-06- 13	-	500.00	28	3.40	-	91,176.67	-
中 信 证 券	202206220000 2592	欣 旺 达	2022-06- 22	162,900.00	5,000.00	14	2.90	104.98	158,000.00	104.98
中 信 证 券	202206220001 6828	传 音 控 股	2022-06- 13	2,250.00	-	28	2.50	-	0.00	-
中 信 证 券	202206220001 7065	传 音 控 股	2022-06- 21	6,150.00	-	14	2.60	-	0.00	-
中 信 证 券	202206230000 1768	爱 尔 眼 科	2022-06- 23	168,305.00	4,100.00	28	1.80	58.91	183,557.00	58.91
中 信 证 券	202206230000 1796	阳 光 电 源	2022-06- 23	3,610,885.00	39,100.00	14	2.90	2,036.14	3,845,496.15	2,036.14
中 信 证 券	202206230000 1841	康 泰 生 物	2022-06- 23	41,960.00	1,000.00	14	2.30	18.77	45,180.00	18.77
中 信 证 券	202206230000 1880	欣 旺 达	2022-06- 23	314,910.00	9,000.00	14	2.90	177.58	284,400.00	177.58
中 信 证 券	202206230000 9117	乐 普 医 疗	2022-06- 23	110,532.00	6,100.00	14	1.80	38.69	114,954.50	38.69
中 信 证 券	202206230000 9125	先 导 智 能	2022-06- 23	1,104,516.00	16,200.00	14	1.80	386.58	1,029,023.79	386.58
中	202206230000	沃	2022-06-	353,625.00	7,500.00	14	1.80	123.77	362,925.00	123.77

信 证 券	9143	森 生 物	23							
中 信 证 券	202206230000 9439	东 方 财 富	2022-06- 23	24,880.00	1,000.00	28	2.70	13.06	25,400.00	13.06
中 信 证 券	202206230000 9559	三 环 集 团	2022-06- 23	167,238.00	5,700.00	14	1.80	58.54	171,789.32	58.54
中 信 证 券	202206230001 1726	华 润 微	2022-06- 13	257.70	-	28	2.50	-	0.00	-
中 信 证 券	202206230001 2027	华 润 微	2022-06- 21	1,563.38	-	14	2.60	-	0.00	-
中 信 证 券	202206240000 1491	阳 光 电 源	2022-06- 24	2,156,266. 00	22,600.0 0	28	1.80	646.88	2,222,716. 44	646.88
中 信 证 券	202206240000 1492	欣 旺 达	2022-06- 24	2,348,808. 00	68,200.0 0	28	1.80	704.64	2,155,120. 00	704.64
中 信 证 券	202206240000 9647	先 导 智 能	2022-06- 13	1,500.00	-	28	3.10	-	0.00	-
中 信 证 券	202206240000 9732	先 导 智 能	2022-06- 15	10,850.00	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	202206240000 9890	先 导 智 能	2022-06- 21	4,500.00	-	14	3.20	-	0.00	-
中 信 证 券	202206240000 9954	先 导 智 能	2022-06- 23	8,100.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中	202206270001	阳	2022-06-	220.96	-	28	2.80	-	0.00	-

信 证 券	6939	光 电 源	13							
中 信 证 券	202206270001 7292	阳 光 电 源	2022-06- 21	430.88	-	14	2.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202206270001 7371	阳 光 电 源	2022-06- 23	4,319.86	-	14	2.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202206270001 7399	阳 光 电 源	2022-06- 24	2,496.90	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280001 2311	汇 川 技 术	2022-06- 13	1,710.00	-	28	1.90	-	0.00	-
中 信 证 券	202206280001 2536	汇 川 技 术	2022-06- 21	2,520.00	-	14	2.00	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 1548	亿 纬 锂 能	2022-06- 29	487,900.00	5,000.00	14	2.60	35.24	487,500.00	35.24
中 信 证 券	202206290002 3872	先 导 智 能	2022-06- 29	1,405,726. 00	21,700.0 0	14	1.80	70.29	1,378,383. 72	70.29
中 信 证 券	202206290002 7007	乐 普 医 疗	2022-06- 13	275.00	-	28	2.50	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7140	乐 普 医 疗	2022-06- 21	7,095.00	-	14	2.60	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7186	乐 普 医 疗	2022-06- 23	1,677.50	-	14	1.80	-	0.00	-
中	202206290002	卓	2022-06-	1,050.00	-	28	2.70	-	0.00	-

信 证 券	7441	胜 微	13							
中 信 证 券	202206290002 7606	卓 胜 微	2022-06- 21	1,540.00	-	14	2.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202206290002 7793	卓 胜 微	2022-06- 13	-	900.00	28	2.70	-	121,893.75	-
中 信 证 券	202206290002 7958	卓 胜 微	2022-06- 21	-	1,320.00	14	2.80	-	178,777.50	-
中 信 证 券	202206300001 8531	深 信 服	2022-06- 30	103,780.00	1,000.00	14	3.20	129.15	103,781.41	-
中 信 证 券	202206300001 8533	迈 为 股 份	2022-06- 30	490,900.00	1,000.00	14	3.60	687.26	490,900.00	-
中 信 证 券	202206300001 8543	温 氏 股 份	2022-06- 30	1,064,500. 00	50,000.0 0	14	2.90	1,200.5 2	1,064,500. 00	-
中 信 证 券	202206300001 8547	安 克 创 新	2022-06- 30	1,352,928. 00	20,400.0 0	14	3.30	1,736.2 6	1,352,928. 00	-
中 信 证 券	202206300001 8549	金 龙 鱼	2022-06- 30	907,536.00	16,800.0 0	14	2.90	1,023.5 0	907,536.00	-
中 信 证 券	202207050001 1745	芒 果 超 媒	2022-06- 13	312.00	-	28	3.20	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 0104	欣 旺 达	2022-06- 13	217.04	-	28	3.00	-	0.00	-
中	202207070001	欣	2022-06-	4,774.91	-	28	1.80	-	0.00	-

信 证 券	0142	旺 达	24							
中 信 证 券	202207070001 1264	亿 纬 锂 能	2022-06- 13	352.00	-	28	3.20	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 1389	亿 纬 锂 能	2022-06- 29	800.00	-	14	2.60	-	0.00	-
中 信 证 券	202207070001 2138	石 头 科 技	2022-06- 13	2,100.00	-	28	3.30	-	0.00	-
中 信 证 券	202207080000 8743	石 头 科 技	2022-06- 13	-	400.00	28	3.30	-	246,680.00	-
中 信 证 券	202207080000 9403	爱 尔 眼 科	2022-06- 13	694.06	-	28	2.70	-	0.00	-
中 信 证 券	202207080000 9423	爱 尔 眼 科	2022-06- 23	490.63	-	28	1.80	-	0.00	-
中 信 证 券	202207080000 9695	爱 尔 眼 科	2022-06- 13	-	1,735.00	28	2.70	-	77,675.95	-
中 信 证 券	202207080000 9715	爱 尔 眼 科	2022-06- 23	-	1,227.00	28	1.80	-	54,932.79	-
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

						天)				
中 信 证 券	202101040001 3626	东 方 财 富	2021-01- 04	2,630,740. 00	81,700.0 0	28	3.30	6,752.2 3	-	-
中 信 证 券	202101040001 3636	沃 森 生 物	2021-01- 04	1,608,600. 00	42,000.0 0	28	3.50	4,378.9 7	-	-
中 信 证 券	202101040001 3638	宋 城 演 艺	2021-01- 04	377,970.00	21,500.0 0	28	3.30	970.12	-	-
中 信 证 券	202101050001 0242	蓝 思 科 技	2021-01- 05	2,068,200. 00	60,000.0 0	14	4.20	3,378.0 6	-	-
中 信 证 券	202101050001 0250	蓝 思 科 技	2021-01- 05	517,050.00	15,000.0 0	14	4.20	844.52	-	-
中 信 证 券	202101070001 2502	蓝 思 科 技	2021-01- 07	351,800.00	10,000.0 0	28	4.10	1,121.8 5	-	-
中 信 证 券	202101070001 2514	亿 纬 锂 能	2021-01- 07	1,585,600. 00	16,000.0 0	14	3.50	2,158.1 8	-	-
中 信 证 券	202101120000 0339	泰 格 医 药	2021-01- 12	2,779,500. 00	17,000.0 0	28	3.40	7,350.2 3	-	-
中 信 证 券	202101140000 9381	温 氏 股 份	2021-01- 14	8,523,800. 00	460,000. 00	28	3.30	27,347. 19	-	-
中 信 证 券	202101140000 9383	东 方 财 富	2021-01- 14	5,478,000. 00	150,000. 00	28	3.40	18,107. 84	-	-
中	202101190000	温	2021-01-	201,190.00	11,000.0	14	3.30	258.19	-	-

信 证 券	0360	氏 股 份	19		0					
中 信 证 券	202101190000 7462	蓝 思 科 技	2021-01- 19	581,100.00	15,000.0 0	14	3.80	858.74	-	-
中 信 证 券	202101190000 7464	蓝 思 科 技	2021-01- 19	2,324,400. 00	60,000.0 0	14	3.80	3,434.9 5	-	-
中 信 证 券	202101210001 3263	亿 纬 锂 能	2021-01- 21	1,689,760. 00	16,000.0 0	14	3.50	2,299.9 5	-	-
中 信 证 券	202101260000 6598	亿 联 网 络	2021-01- 26	1,320,624. 00	16,200.0 0	28	3.40	3,492.3 2	-	-
中 信 证 券	202101260000 6600	东 方 财 富	2021-01- 26	7,829,356. 00	213,800. 00	28	3.50	21,313. 25	-	-
中 信 证 券	202102010000 9072	东 方 财 富	2021-02- 01	2,931,396. 00	81,700.0 0	28	3.30	7,523.9 2	-	-
中 信 证 券	202102010000 9090	宋 城 演 艺	2021-02- 01	367,005.00	21,500.0 0	28	3.40	970.52	-	-
中 信 证 券	202102020000 8849	蓝 思 科 技	2021-02- 02	1,944,000. 00	60,000.0 0	14	3.80	3,283.2 0	-	-
中 信 证 券	202102040000 0436	乐 普 医 疗	2021-02- 04	338,010.00	11,400.0 0	28	3.50	920.14	-	-
中 信 证 券	202102040001 3621	蓝 思 科 技	2021-02- 04	306,600.00	10,000.0 0	28	3.70	882.33	-	-
中	202102090000	乐	2021-02-	322,300.00	10,000.0	14	3.60	451.22	-	-

信 证 券	0489	普 医 疗	09		0					
中 信 证 券	202102090000 0493	东 方 财 富	2021-02- 09	3,816,000. 00	100,000. 00	14	3.50	5,194.0 0	-	-
中 信 证 券	202102090000 0497	传 音 控 股	2021-02- 09	2,452,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	3,051.3 8	-	-
中 信 证 券	202102180003 8544	东 方 财 富	2021-02- 18	5,643,000. 00	150,000. 00	28	3.30	14,483. 70	-	-
中 信 证 券	202102180003 8548	蓝 思 科 技	2021-02- 18	1,931,400. 00	60,000.0 0	14	4.60	3,455.0 6	-	-
中 信 证 券	202102230000 6566	乐 普 医 疗	2021-02- 23	319,300.00	10,000.0 0	14	3.60	447.02	-	-
中 信 证 券	202102230000 6568	东 方 财 富	2021-02- 23	3,355,000. 00	100,000. 00	14	3.50	4,566.5 3	-	-
中 信 证 券	202102230000 7000	传 音 控 股	2021-02- 23	2,008,300. 00	10,000.0 0	14	3.20	2,499.2 2	-	-
中 信 证 券	202102230000 7206	亿 联 网 络	2021-02- 23	1,343,304. 00	16,200.0 0	28	3.20	3,343.3 3	-	-
中 信 证 券	202102230000 7208	东 方 财 富	2021-02- 23	7,172,990. 00	213,800. 00	28	3.30	18,410. 67	-	-
中 信 证 券	202102240000 0630	宋 城 演 艺	2021-02- 24	197,500.00	10,000.0 0	28	3.30	506.92	-	-
中	202102240000	蓝	2021-02-	519,255.00	16,500.0	28	4.00	1,615.4	-	-

信 证 券	6560	思 科 技	24		0			6		
中 信 证 券	202102240000 6562	信 维 通 信	2021-02- 24	341,800.00	10,000.0 0	28	3.50	930.46	-	-
中 信 证 券	202102240000 6564	爱 尔 眼 科	2021-02- 24	1,720,170. 00	23,000.0 0	28	3.40	4,548.8 9	-	-
中 信 证 券	202102240000 6566	宋 城 演 艺	2021-02- 24	339,700.00	17,200.0 0	28	3.50	924.74	-	-
中 信 证 券	202102240000 6568	汇 川 技 术	2021-02- 24	1,087,185. 00	12,100.0 0	28	3.30	2,790.4 4	-	-
中 信 证 券	202102240000 6570	三 环 集 团	2021-02- 24	642,492.00	16,200.0 0	28	3.40	1,699.0 3	-	-
中 信 证 券	202102240000 6614	泰 格 医 药	2021-02- 24	1,529,000. 00	10,000.0 0	28	3.40	4,043.3 6	-	-
中 信 证 券	202102240000 6616	亿 纬 锂 能	2021-02- 24	938,100.00	10,600.0 0	28	3.20	2,334.8 3	-	-
中 信 证 券	202102240000 6618	温 氏 股 份	2021-02- 24	951,860.00	52,300.0 0	28	3.20	2,369.0 7	-	-
中 信 证 券	202102240000 6620	智 飞 生 物	2021-02- 24	2,176,200. 00	13,500.0 0	28	3.50	5,924.1 0	-	-
中 信 证 券	202102240000 6622	乐 普 医 疗	2021-02- 24	471,135.00	14,700.0 0	28	3.50	1,282.5 3	-	-
中	202102240000	沃	2021-02-	1,279,161.	26,100.0	28	4.00	3,979.6	-	-

信 证 券	6624	森 生 物	24	00	0			1		
中 信 证 券	202102240000 6626	芒 果 超 媒	2021-02- 24	671,200.00	10,000.0 0	28	3.20	1,670.5 4	-	-
中 信 证 券	202103040003 4637	乐 普 医 疗	2021-03- 04	355,338.00	11,400.0 0	28	3.40	939.67	-	-
中 信 证 券	202103040003 4651	蓝 思 科 技	2021-03- 04	1,852,800. 00	60,000.0 0	14	3.60	2,593.9 2	-	-
中 信 证 券	202103040003 5033	蓝 思 科 技	2021-03- 04	308,800.00	10,000.0 0	28	3.50	840.62	-	-
中 信 证 券	202103090000 7663	传 音 控 股	2021-03- 09	1,761,100. 00	10,000.0 0	14	3.20	2,191.5 9	-	-
中 信 证 券	202103090000 7667	乐 普 医 疗	2021-03- 09	285,000.00	10,000.0 0	14	3.60	399.00	-	-
中 信 证 券	202103090000 7687	东 方 财 富	2021-03- 09	2,753,000. 00	100,000. 00	14	3.40	3,640.0 8	-	-
中 信 证 券	202103110000 0509	汇 川 技 术	2021-03- 11	1,047,600. 00	12,000.0 0	28	3.20	2,607.3 6	-	-
中 信 证 券	202103110000 0529	汇 川 技 术	2021-03- 11	1,021,410. 00	11,700.0 0	14	3.30	1,310.8 1	-	-
中 信 证 券	202103180003 8094	蓝 思 科 技	2021-03- 18	1,555,800. 00	60,000.0 0	14	3.50	2,117.6 2	-	-
中	202103180003	东	2021-03-	4,236,000.	150,000.	28	3.40	11,201.	-	-

信 证 券	8112	方 财 富	18	00	00			87		
中 信 证 券	202103230000 7721	传 音 控 股	2021-03- 23	2,021,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	2,515.0 2	-	-
中 信 证 券	202103230000 7735	东 方 财 富	2021-03- 23	2,715,000. 00	100,000. 00	14	3.40	3,589.8 3	-	-
中 信 证 券	202103230000 7737	东 方 财 富	2021-03- 23	5,804,670. 00	213,800. 00	28	3.30	14,898. 65	-	-
中 信 证 券	202103230000 7745	亿 联 网 络	2021-03- 23	1,072,440. 00	16,200.0 0	28	3.20	2,669.1 8	-	-
中 信 证 券	202103240000 6284	宋 城 演 艺	2021-03- 24	203,500.00	10,000.0 0	28	3.40	538.14	-	-
中 信 证 券	202103240000 6288	沃 森 生 物	2021-03- 24	1,191,204. 00	26,100.0 0	28	3.40	3,150.0 7	-	-
中 信 证 券	202103240000 6290	宋 城 演 艺	2021-03- 24	350,020.00	17,200.0 0	28	3.40	925.61	-	-
中 信 证 券	202103240000 6292	泰 格 医 药	2021-03- 24	1,292,700. 00	10,000.0 0	28	3.50	3,519.0 2	-	-
中 信 证 券	202103240000 6294	乐 普 医 疗	2021-03- 24	418,803.00	14,700.0 0	28	3.40	1,107.5 0	-	-
中 信 证 券	202103240000 6296	亿 纬 锂 能	2021-03- 24	739,456.00	10,600.0 0	28	3.40	1,955.4 5	-	-
中	202103240000	汇	2021-03-	973,566.00	12,100.0	28	3.20	2,423.1	-	-

信 证 券	6298	川 技 术	24		0			0		
中 信 证 券	202103240000 6300	爱 尔 眼 科	2021-03- 24	1,373,560. 00	23,000.0 0	28	3.20	3,418.6 4	-	-
中 信 证 券	202103240000 6302	信 维 通 信	2021-03- 24	270,200.00	10,000.0 0	28	4.20	882.65	-	-
中 信 证 券	202103240000 6304	智 飞 生 物	2021-03- 24	2,387,475. 00	13,500.0 0	28	3.40	6,313.5 5	-	-
中 信 证 券	202103240000 6306	三 环 集 团	2021-03- 24	590,976.00	16,200.0 0	28	3.90	1,792.6 3	-	-
中 信 证 券	202103240000 6308	芒 果 超 媒	2021-03- 24	565,500.00	10,000.0 0	28	3.30	1,451.4 5	-	-
中 信 证 券	202103240000 6312	蓝 思 科 技	2021-03- 24	400,950.00	16,500.0 0	28	3.40	1,060.2 9	-	-
中 信 证 券	202103240000 6314	温 氏 股 份	2021-03- 24	895,899.00	52,300.0 0	28	3.20	2,229.7 9	-	-
中 信 证 券	202104010000 0476	康 泰 生 物	2021-04- 01	1,380,200. 00	10,000.0 0	14	3.40	1,824.9 3	-	-
中 信 证 券	202104060000 0654	沃 森 生 物	2021-04- 06	442,000.00	10,000.0 0	14	3.50	601.61	-	-
中 信 证 券	202104060000 0750	温 氏 股 份	2021-04- 06	167,300.00	10,000.0 0	14	3.40	221.21	-	-
中	202104060001	东	2021-04-	2,861,000.	100,000.	14	3.30	3,671.6	-	-

信 证 券	7104	方 财 富	06	00	00			2		
中 信 证 券	202104060001 7132	传 音 控 股	2021-04- 06	2,049,800. 00	10,000.0 0	14	3.20	2,550.8 6	-	-
中 信 证 券	202104080000 0526	温 氏 股 份	2021-04- 08	164,400.00	10,000.0 0	14	3.40	217.37	-	-
中 信 证 券	202104190000 4123	乐 普 医 疗	2021-03- 24	1,799.66	-	28	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202104200000 1151	东 方 财 富	2021-04- 20	297,800.00	10,000.0 0	14	3.30	436.78	-	-
中 信 证 券	202104200000 1153	宋 城 演 艺	2021-04- 20	208,600.00	10,000.0 0	14	2.70	250.32	-	-
中 信 证 券	202104200000 1155	乐 普 医 疗	2021-04- 20	277,600.00	10,000.0 0	14	3.40	419.49	-	-
中 信 证 券	202104200001 5606	沃 森 生 物	2021-04- 20	522,600.00	10,000.0 0	14	3.50	812.94	-	-
中 信 证 券	202104200001 5610	东 方 财 富	2021-04- 20	2,978,000. 00	100,000. 00	14	3.00	3,970.6 6	-	-
中 信 证 券	202104200001 5630	传 音 控 股	2021-04- 20	1,705,200. 00	10,000.0 0	14	2.30	1,743.1 0	-	-
中 信 证 券	202104210000 7489	宋 城 演 艺	2021-04- 21	218,100.00	10,000.0 0	28	3.20	542.83	-	-
中	202104210000	温	2021-03-	2,504.60	-	28	3.20	-	-	-

信 证 券	8225	氏 股 份	24							
中 信 证 券	202104220000 0612	温 氏 股 份	2021-04- 22	151,600.00	10,000.0 0	14	3.40	200.45	-	-
中 信 证 券	202104220000 0624	爱 尔 眼 科	2021-04- 22	9,547,500. 00	150,000. 00	28	3.30	24,505. 25	-	-
中 信 证 券	202104270000 0839	乐 普 医 疗	2021-04- 27	315,000.00	10,000.0 0	14	3.20	392.00	-	-
中 信 证 券	202104290000 0601	东 方 财 富	2021-04- 29	319,900.00	10,000.0 0	14	3.30	410.54	-	-
中 信 证 券	202104290000 0605	乐 普 医 疗	2021-04- 29	320,300.00	10,000.0 0	14	3.20	398.60	-	-
中 信 证 券	202104290000 0621	温 氏 股 份	2021-04- 29	296,430.00	20,500.0 0	14	3.30	380.42	-	-
中 信 证 券	202105060000 0893	温 氏 股 份	2021-05- 06	141,700.00	10,000.0 0	14	3.30	181.85	-	-
中 信 证 券	202105060002 8236	东 方 财 富	2021-05- 06	3,130,000. 00	100,000. 00	14	3.30	4,016.8 3	-	-
中 信 证 券	202105060002 8238	东 方 财 富	2021-05- 06	313,000.00	10,000.0 0	14	3.30	401.68	-	-
中 信 证 券	202105060002 8244	宋 城 演 艺	2021-05- 06	205,600.00	10,000.0 0	14	2.70	215.88	-	-
中	202105060002	传	2021-05-	1,636,300.	10,000.0	14	2.50	1,590.8	-	-

信 证 券	8252	音 控 股	06	00	0			5		
中 信 证 券	202105060002 8810	乐 普 医 疗	2021-05- 06	310,000.00	10,000.0 0	14	3.20	385.78	-	-
中 信 证 券	202105060002 8816	沃 森 生 物	2021-05- 06	557,500.00	10,000.0 0	14	3.60	780.50	-	-
中 信 证 券	202105060002 8818	温 氏 股 份	2021-05- 06	141,700.00	10,000.0 0	14	3.30	181.85	-	-
中 信 证 券	202105110000 0946	智 飞 生 物	2021-05- 11	2,098,200. 00	10,000.0 0	14	3.40	2,774.2 9	-	-
中 信 证 券	202105110000 0948	温 氏 股 份	2021-05- 11	284,074.00	20,600.0 0	14	3.20	353.51	-	-
中 信 证 券	202105110000 0960	芒 果 超 媒	2021-05- 11	1,090,320. 00	16,800.0 0	14	3.30	1,399.2 4	-	-
中 信 证 券	202105110000 0968	沃 森 生 物	2021-05- 11	1,456,000. 00	26,000.0 0	14	3.50	1,981.7 8	-	-
中 信 证 券	202105130002 7746	东 方 财 富	2021-05- 13	305,000.00	10,000.0 0	14	3.30	391.42	-	-
中 信 证 券	202105180000 2865	沃 森 生 物	2021-05- 11	1,300.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	202105180000 2924	沃 森 生 物	2021-05- 06	500.00	-	14	3.60	-	-	-
中	202105190000	宋	2021-05-	190,700.00	10,000.0	28	3.20	474.63	-	-

信 证 券	2613	城 演 艺	19		0					
中 信 证 券	202105200000 0559	宋 城 演 艺	2021-05- 20	549,263.00	29,900.0 0	14	3.40	726.25	-	-
中 信 证 券	202105200001 7891	爱 尔 眼 科	2021-05- 20	11,649,000 .00	150,000. 00	28	3.30	29,899. 10	-	-
中 信 证 券	202105200001 7893	传 音 控 股	2021-05- 20	1,603,800. 00	10,000.0 0	14	2.10	1,309.7 7	-	-
中 信 证 券	202105200001 7895	宋 城 演 艺	2021-05- 20	183,700.00	10,000.0 0	14	3.30	235.75	-	-
中 信 证 券	202105200001 7897	沃 森 生 物	2021-05- 20	688,400.00	10,000.0 0	14	3.50	936.99	-	-
中 信 证 券	202105200001 7899	东 方 财 富	2021-05- 20	3,572,000. 00	100,000. 00	14	3.40	4,722.9 8	-	-
中 信 证 券	202105200001 7901	东 方 财 富	2021-05- 20	357,200.00	10,000.0 0	14	3.40	472.30	-	-
中 信 证 券	202105200001 7907	温 氏 股 份	2021-05- 20	141,000.00	10,000.0 0	14	3.20	175.47	-	-
中 信 证 券	202105200001 7909	温 氏 股 份	2021-05- 20	141,000.00	10,000.0 0	14	3.20	175.47	-	-
中 信 证 券	202105200001 7941	乐 普 医 疗	2021-05- 20	321,900.00	10,000.0 0	14	3.30	413.11	-	-
中	202105250000	温	2021-05-	140,100.00	10,000.0	14	3.20	174.35	-	-

信 证 券	1029	氏 股 份	25		0					
中 信 证 券	202105250000 1037	亿 纬 锂 能	2021-05- 25	3,647,860. 00	34,000.0 0	14	3.50	4,965.1 4	-	-
中 信 证 券	202105250001 0280	温 氏 股 份	2021-05- 25	288,606.00	20,600.0 0	14	3.30	370.38	-	-
中 信 证 券	202105250001 0282	沃 森 生 物	2021-05- 25	1,765,660. 00	26,000.0 0	14	3.30	2,265.9 3	-	-
中 信 证 券	202105250001 0286	智 飞 生 物	2021-05- 25	2,031,900. 00	10,000.0 0	14	3.50	2,765.6 4	-	-
中 信 证 券	202105260001 1360	东 方 财 富	2021-05- 20	6,000.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202105260001 1362	东 方 财 富	2021-05- 20	600.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202105260001 1496	东 方 财 富	2021-05- 13	600.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202105260001 1758	东 方 财 富	2021-05- 20	-	20,000.0 0	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202105260001 1760	东 方 财 富	2021-05- 20	-	2,000.00	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202105260001 1894	东 方 财 富	2021-05- 13	-	2,000.00	14	3.30	-	-	-
中	202105270001	东	2021-05-	314,200.00	10,000.0	14	3.40	415.44	-	-

信 证 券	8719	方 财 富	27		0					
中 信 证 券	202106010000 0692	温 氏 股 份	2021-06- 01	1,353,726. 00	95,400.0 0	14	3.40	1,789.9 3	-	-
中 信 证 券	202106010000 0706	乐 普 医 疗	2021-06- 01	1,223,365. 00	37,700.0 0	14	3.30	1,569.9 9	-	-
中 信 证 券	202106010000 2805	宋 城 演 艺	2021-05- 20	500.00	-	14	3.30	-	-	-
中 信 证 券	202106010000 2822	宋 城 演 艺	2021-05- 20	1,495.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202106010000 2827	宋 城 演 艺	2021-05- 19	500.00	-	28	3.20	-	-	-
中 信 证 券	202106030000 0851	亿 纬 锂 能	2021-06- 03	15,771,000 .00	150,000. 00	14	3.40	20,852. 77	-	-
中 信 证 券	202106030000 9788	沃 森 生 物	2021-06- 03	643,300.00	10,000.0 0	14	3.40	850.59	-	-
中 信 证 券	202106030000 9790	乐 普 医 疗	2021-06- 03	320,800.00	10,000.0 0	14	3.60	449.12	-	-
中 信 证 券	202106030000 9798	温 氏 股 份	2021-06- 03	141,200.00	10,000.0 0	14	3.20	175.72	-	-
中 信 证 券	202106030000 9800	温 氏 股 份	2021-06- 03	141,200.00	10,000.0 0	14	3.20	175.72	-	-
中	202106030001	宋	2021-06-	540,293.00	29,900.0	14	3.50	735.40	-	-

信 证 券	0572	城 演 艺	03		0					
中 信 证 券	202106030001 0574	东 方 财 富	2021-06- 03	3,086,000. 00	100,000. 00	14	3.50	4,200.3 9	-	-
中 信 证 券	202106030001 0576	东 方 财 富	2021-06- 03	308,600.00	10,000.0 0	14	3.50	420.04	-	-
中 信 证 券	202106030001 0590	传 音 控 股	2021-06- 03	1,639,600. 00	10,000.0 0	14	1.30	828.91	-	-
中 信 证 券	202106080000 6081	温 氏 股 份	2021-06- 08	306,116.00	20,600.0 0	14	3.40	404.75	-	-
中 信 证 券	202106080000 6085	温 氏 股 份	2021-06- 08	148,600.00	10,000.0 0	14	3.40	196.48	-	-
中 信 证 券	202106080000 6089	沃 森 生 物	2021-06- 08	1,721,460. 00	26,000.0 0	14	3.30	2,209.2 1	-	-
中 信 证 券	202106080000 6193	智 飞 生 物	2021-06- 08	1,869,800. 00	10,000.0 0	14	3.30	2,399.5 8	-	-
中 信 证 券	202106080000 6195	亿 纬 锂 能	2021-06- 08	3,322,820. 00	34,000.0 0	14	3.40	4,393.5 1	-	-
中 信 证 券	202106090000 0677	温 氏 股 份	2021-06- 09	147,700.00	10,000.0 0	14	3.40	195.29	-	-
中 信 证 券	202106090000 0687	中 微 公 司	2021-06- 09	6,691,500. 00	50,000.0 0	28	3.90	15,223. 16	8,296,000. 00	15,223. 16
中	202106100000	东	2021-06-	312,900.00	10,000.0	14	3.30	401.56	-	-

信 证 券	7776	方 财 富	10		0					
中 信 证 券	202106100001 0288	传 音 控 股	2021-06- 03	10,800.00	-	14	1.30	-	-	-
中 信 证 券	202106150000 1748	乐 普 医 疗	2021-06- 15	613,206.00	19,800.0 0	14	3.40	810.79	-	-
中 信 证 券	202106150001 6030	温 氏 股 份	2021-06- 15	1,312,704. 00	95,400.0 0	14	3.40	1,735.6 9	-	-
中 信 证 券	202106160000 7005	宋 城 演 艺	2021-06- 16	170,300.00	10,000.0 0	28	2.50	165.57	168,000.00	165.57
中 信 证 券	202106170000 1949	先 导 智 能	2021-06- 17	1,423,200. 00	24,000.0 0	14	3.40	1,881.7 9	-	1,881.7 9
中 信 证 券	202106170001 6477	宋 城 演 艺	2021-06- 17	504,413.00	29,900.0 0	14	2.60	510.02	-	510.02
中 信 证 券	202106170001 6479	沃 森 生 物	2021-06- 17	593,000.00	10,000.0 0	14	3.30	761.02	-	761.02
中 信 证 券	202106170001 6481	温 氏 股 份	2021-06- 17	137,500.00	10,000.0 0	14	3.40	181.81	-	181.81
中 信 证 券	202106170001 6483	温 氏 股 份	2021-06- 17	137,500.00	10,000.0 0	14	3.40	181.81	-	181.81
中 信 证 券	202106170001 6491	传 音 控 股	2021-06- 17	1,744,300. 00	10,000.0 0	14	1.40	949.67	-	949.67
中	202106170001	亿	2021-06-	15,180,000	150,000.	14	3.40	20,071.	-	20,071.

信 证 券	6497	纬 锂 能	17	.00	00			33		33
中 信 证 券	202106170001 6499	爱 尔 眼 科	2021-06- 17	12,372,000 .00	150,000. 00	28	3.20	14,296. 53	10,647,000 .00	14,296. 53
中 信 证 券	202106170001 6505	乐 普 医 疗	2021-06- 17	309,400.00	10,000.0 0	14	3.40	409.10	-	409.10
中 信 证 券	202106220001 1720	温 氏 股 份	2021-06- 22	139,000.00	10,000.0 0	14	3.50	108.11	143,700.00	108.11
中 信 证 券	202106220001 1728	智 飞 生 物	2021-06- 22	1,712,900. 00	10,000.0 0	14	3.60	1,370.3 2	1,867,300. 00	1,370.3 2
中 信 证 券	202106220001 1950	亿 纬 锂 能	2021-06- 22	3,451,000. 00	34,000.0 0	14	3.50	2,684.1 1	3,533,620. 00	2,684.1 1
中 信 证 券	202106230001 9314	爱 尔 眼 科	2021-06- 17	22,243.40	-	28	3.20	-	0.00	-
中 信 证 券	202106230001 9628	爱 尔 眼 科	2021-06- 17	-	44,487.0 0	28	3.20	-	3,157,687. 26	-
中 信 证 券	202106240000 9959	乐 普 医 疗	2021-06- 17	2,280.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202106240000 9998	乐 普 医 疗	2021-06- 15	4,514.40	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	202106290000 1185	爱 尔 眼 科	2021-06- 29	1,108,160. 00	16,000.0 0	14	3.20	98.50	1,135,680. 00	98.50
中	202106290001	温	2021-06-	1,370,898.	95,400.0	14	3.00	114.24	1,370,898.	114.24

信 证 券	7983	氏 股 份	29	00	0				00	
中 信 证 券	202107070001 7859	温 氏 股 份	2021-06- 29	19,080.00	-	14	3.00	-	0.00	-

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

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
华夏沪深 300ETF 联接	2,139,572,491.00	41.77%	2,141,945,591.00	37.19%
中信证券	30,649,761.00	0.60%	60,540,609.00	1.05%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

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
中国工商银行活期存款	167,589,619.99	133,601.66	77,405,103.28	113,721.53

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

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

				股/张)	
中信证券	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88
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： 股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	网下申购	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688819	天能股份	网下申购	28,382	1,186,083.78
中信证券	688660	电气风电	网下申购	51,238	278,734.72
中信证券	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
中信证券	688617	惠泰医疗	网下申购	1,673	124,571.58
中信证券	688575	亚辉龙	网下申购	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	网下申购	3,170	50,181.10
中信证券	300993	玉马遮阳	网下申购	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	网下申购	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	网下申购	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	网下申购	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	网下申购	3,220	42,214.20
中信证券	603529	爱玛科技	网下申购	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	网下申购	3,477	28,059.39
中信证券	300966	共同药业	网下申购	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	网下申购	2,464	23,136.96
中信证券	688226	威腾电气	网下申购	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	网下申购	3,371	16,821.29
中信证券	605060	联德股份	网下申购	883	13,765.97
中信证券	605488	福莱新材	网下申购	416	8,498.88
中信证券	001208	华菱线缆	网下申购	1,754	6,437.18
中信证券	003040	楚天龙	网下申购	1,101	5,086.62

中信证券	601279	英利汽车	网下申购	2,004	4,148.28
------	--------	------	------	-------	----------

注：本期“网上申购”和“网下申购”两种发行方式合并披露为“新股发行”。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 845,750,640.00 元（上年度可比期间：1,553,681,340.00 元），支付给中信期货的佣金为 27,909.74 元（上年度可比期间为：51,271.44 元）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 230,084,866.20 元，占基金资产净值的比例为 0.99%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 290,985,142.31 元，占基金资产净值的比例为 1.01%）。

于 2022 年 6 月 30 日，本基金（因指数成份股包括工商银行而被动）持有的工商银行股票估值总额为人民币 181,961,853.03 元，占基金资产净值的比例为 0.79%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括工商银行而被动）持有的工商银行股票估值总额为人民币 209,823,909.57 元，占基金资产净值的比例为 0.73%）。

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 (场外)	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	利润分配合计	备注
1	2022-01-14	-	0.790	422,851,436.44	-	422,851,436.44	-
合计			0.790	422,851,436.44	-	422,851,436.44	-

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	流 通 受 限 类 型	认 购 价 格	期 末 估 值 单 价	数量(股)	期 末 成 本 总 额	期 末 估 值 总 额	备注
600938	中	2022-04-14	6 个月	新	10.80	15.86	84,004	907,243.20	1,332,303.44	-

	国海油			发 流 通 受 限						
688322	奥 比 中 光	2022-06-30	1 个月 内(含)	新 发 流 通 受 限	30.99	30.99	8,529	264,313.71	264,313.71	-
301139	元 道 通 信	2022-06-30	1 个月 内(含)	新 发 流 通 受 限	38.46	38.46	5,085	195,569.10	195,569.10	-
688209	英 集 芯	2022-04-12	6 个月	新 发 流 通 受 限	24.23	27.58	6,822	165,297.06	188,150.76	-
301236	软 通 动 力	2022-03-08	6 个月	新 发 流 通 受 限	72.88	31.38	2,076	100,865.92	65,144.88	含 证 券 送 配
301219	腾 远 钻 业	2022-03-10	6 个月	新 发 流 通 受 限	173.98	87.82	578	55,847.58	50,759.96	含 证 券 送 配
301200	大 族 数 控	2022-02-18	6 个月	新 发 流 通 受 限	76.56	51.92	857	65,611.92	44,495.44	-
301206	三 元 生	2022-01-26	6 个月	新 发 流	109.30	45.69	945	68,859.00	43,177.05	含 证 券

	物			通 受 限						送 配
301150	中一科技	2022-04-14	6 个月	新发 流通 受限	163.56	82.76	404	43,997.64	33,435.04	含 证 券 送 配
301109	军信股份	2022-04-06	6 个月	新发 流通 受限	34.81	16.14	1,838	42,642.25	29,665.32	含 证 券 送 配
301302	华如科技	2022-06-16	6 个月	新发 流通 受限	52.03	56.42	466	24,245.98	26,291.72	-
301268	铭利达	2022-03-29	6 个月	新发 流通 受限	28.50	34.87	641	18,268.50	22,351.67	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发 流通 受限	38.46	38.46	566	21,768.36	21,768.36	-
301122	采纳股份	2022-01-19	6 个月	新发 流通 受限	50.31	70.37	301	15,143.31	21,181.37	-
301102	兆讯传媒	2022-03-15	6 个月	新发 流通 受	39.88	31.09	642	25,602.96	19,959.78	-

				限						
301162	国能日新	2022-04-19	6 个月	新发流通受限	45.13	54.11	334	15,073.42	18,072.74	-
301123	奕东电子	2022-01-14	6 个月	新发流通受限	37.23	25.39	656	24,422.88	16,655.84	-
301103	何氏眼科	2022-03-14	6 个月	新发流通受限	42.50	32.02	507	16,575.00	16,234.14	含 证 券 送 配
301286	侨源股份	2022-06-06	6 个月	新发流通受限	16.91	19.79	784	13,257.44	15,515.36	-
301248	杰创智能	2022-04-13	6 个月	新发流通受限	39.07	29.87	472	18,441.04	14,098.64	-
301212	联盛化学	2022-04-07	6 个月	新发流通受限	29.67	33.28	416	12,342.72	13,844.48	-
301298	东利机械	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	12.68	20.83	634	8,039.12	13,206.22	-
301148	嘉	2022-04-14	6 个月	新	38.39	23.90	516	19,809.24	12,332.40	-

	戎技术			发流通受限						
301259	艾布鲁	2022-04-18	6 个月	新发流通受限	18.39	24.94	483	8,882.37	12,046.02	-
301097	天益医疗	2022-03-25	6 个月	新发流通受限	52.37	47.83	249	13,040.13	11,909.67	-
301220	亚香股份	2022-06-15	6 个月	新发流通受限	35.98	39.15	285	10,254.30	11,157.75	-
301237	和顺科技	2022-03-16	6 个月	新发流通受限	56.69	41.86	261	14,796.09	10,925.46	-
301196	唯科科技	2022-01-04	6 个月	新发流通受限	64.08	37.52	271	17,365.68	10,167.92	-
301125	腾亚精工	2022-05-27	6 个月	新发流通受限	22.49	27.42	327	7,354.23	8,966.34	-
301163	宏德股	2022-04-11	6 个月	新发流	26.27	32.33	277	7,276.79	8,955.41	-

	份			通受限						
301130	西点药业	2022-02-16	6 个月	新发流通受限	22.55	37.70	237	5,344.35	8,934.90	-
301135	瑞德智能	2022-04-01	6 个月	新发流通受限	31.98	26.26	338	10,809.24	8,875.88	-
301181	标榜股份	2022-02-11	6 个月	新发流通受限	40.25	30.59	257	10,344.25	7,861.63	-
301228	实朴检测	2022-01-21	6 个月	新发流通受限	20.08	20.34	373	7,489.84	7,586.82	-
301279	金道科技	2022-04-06	6 个月	新发流通受限	31.20	22.81	296	9,235.20	6,751.76	-
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(张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙 22 转债	2022-06-15	1 个月内(含)	新发流通	100.00	100.01	34,610	3,461,000.00	3,461,257.92	期末估值

				受限						单价为含息价格
--	--	--	--	----	--	--	--	--	--	---------

注：①本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后 6 个月内，不得转让所受让的股份。本基金所认购非公开发行股份，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④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。

⑤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

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

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	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估	数量（股）	期末估值总额
---	------	------	-------	-----	-------	--------

号				值单价		
1	300750	宁德时代	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	534.00	411,800.00	219,901,200.00
2	000651	格力电器	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 26 日	33.72	1,099,700.00	37,081,884.00
3	002466	天齐锂业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	124.80	275,100.00	34,332,480.00
4	000792	盐湖股份	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 21 日	29.96	1,035,700.00	31,029,572.00
5	002714	牧原股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	55.27	452,300.00	24,998,621.00
6	000002	万科 A	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	20.50	1,206,200.00	24,727,100.00
7	002812	恩捷股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 13 日	250.45	95,100.00	23,817,795.00
8	300498	温氏股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	21.29	1,108,600.00	23,602,094.00
9	300059	东方财富	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	25.40	901,500.00	22,898,100.00
10	002594	比亚迪	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	333.49	66,900.00	22,310,481.00
11	002709	天赐材料	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	62.06	337,400.00	20,939,044.00
12	002271	东方雨虹	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	51.47	390,800.00	20,114,476.00
13	000625	长安汽车	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	17.32	1,147,590.00	19,876,258.80
14	002352	顺丰控股	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	55.81	333,900.00	18,634,959.00
15	000858	五粮液	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	201.93	90,700.00	18,315,051.00
16	600111	北方稀土	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	35.16	515,600.00	18,128,496.00
17	601888	中国中免	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	232.93	76,200.00	17,749,266.00
18	300014	亿纬锂能	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	97.50	159,600.00	15,561,000.00
19	002460	赣锋锂业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	148.70	104,400.00	15,524,280.00
20	300274	阳光电源	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 22 日	98.25	144,100.00	14,157,825.00
21	000001	平安银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	14.98	895,700.00	13,417,586.00
22	601225	陕西煤业	2022 年 7 月 4 日	21.18	596,300.00	12,629,634.00

			-2022 年 7 月 20 日			
23	600010	包钢股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	2.35	5,257,300.00	12,354,655.00
24	300760	迈瑞医疗	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	313.20	39,100.00	12,246,120.00
25	601633	长城汽车	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	37.04	308,000.00	11,408,320.00
26	601088	中国神华	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	33.30	331,100.00	11,025,630.00
27	601009	南京银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	10.42	989,000.00	10,305,380.00
28	000776	广发证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	18.70	550,700.00	10,298,090.00
29	000661	长春高新	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	233.42	43,800.00	10,223,796.00
30	600009	上海机场	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	56.70	180,000.00	10,206,000.00
31	300015	爱尔眼科	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	44.77	227,600.00	10,189,652.00
32	600795	国电电力	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.91	2,565,600.00	10,031,496.00
33	300450	先导智能	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	63.18	157,800.00	9,969,804.00
34	600763	通策医疗	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 14 日	174.44	57,000.00	9,943,080.00
35	300142	沃森生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	48.39	201,900.00	9,769,941.00
36	601600	中国铝业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.75	2,049,100.00	9,733,225.00
37	002415	海康威视	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	36.20	268,500.00	9,719,700.00
38	601988	中国银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	3.26	2,970,000.00	9,682,200.00
39	300759	康龙化成	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	95.22	100,750.00	9,593,415.00
40	002074	国轩高科	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 14 日	45.60	210,000.00	9,576,000.00
41	300595	欧普康视	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	57.19	158,200.00	9,047,458.00
42	601800	中国交建	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	9.28	964,200.00	8,947,776.00
43	002129	TCL 中环	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	58.89	151,400.00	8,915,946.00
44	600188	兖矿能源	2022 年 7 月 5 日	39.48	224,100.00	8,847,468.00

			-2022 年 7 月 21 日			
45	600346	恒力石化	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	22.24	384,300.00	8,546,832.00
46	601211	国泰君安	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	15.20	560,000.00	8,512,000.00
47	600089	特变电工	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 21 日	27.39	309,400.00	8,474,466.00
48	002311	海大集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	60.01	140,100.00	8,407,401.00
49	300751	迈为股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	490.90	17,000.00	8,345,300.00
50	601857	中国石油	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.30	1,546,400.00	8,195,920.00
51	603799	华友钴业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	95.62	84,500.00	8,079,890.00
52	000876	新希望	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	15.30	527,100.00	8,064,630.00
53	601788	光大证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	15.76	507,200.00	7,993,472.00
54	600085	同仁堂	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	52.88	149,800.00	7,921,424.00
55	002555	三七互娱	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	21.23	373,000.00	7,918,790.00
56	300628	亿联网络	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	76.15	102,300.00	7,790,145.00
57	600196	复星医药	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	44.09	175,000.00	7,715,750.00
58	000301	东方盛虹	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	16.91	448,000.00	7,575,680.00
59	000100	TCL 科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.79	1,580,000.00	7,568,200.00
60	600570	恒生电子	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	43.54	173,600.00	7,558,544.00
61	601100	恒立液压	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	61.72	122,200.00	7,542,184.00
62	600660	福耀玻璃	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	41.81	177,000.00	7,400,370.00
63	300207	欣旺达	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 22 日	31.60	232,900.00	7,359,640.00
64	000425	徐工机械	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	5.39	1,363,800.00	7,350,882.00
65	300413	芒果超媒	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	33.36	219,000.00	7,305,840.00
66	002001	新和成	2022 年 7 月 4 日	22.81	319,100.00	7,278,671.00

			-2022 年 7 月 20 日			
67	600436	片仔癀	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	356.73	20,000.00	7,134,600.00
68	603259	药明康德	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	103.99	68,200.00	7,092,118.00
69	601186	中国铁建	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	7.90	891,800.00	7,045,220.00
70	601012	隆基绿能	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	66.63	105,400.00	7,022,802.00
71	300347	泰格医药	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	114.45	61,000.00	6,981,450.00
72	300122	智飞生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	111.01	62,800.00	6,971,428.00
73	600029	南方航空	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	7.31	950,500.00	6,948,155.00
74	601669	中国电建	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	7.87	874,000.00	6,878,380.00
75	603288	海天味业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	90.36	74,200.00	6,704,712.00
76	600150	中国船舶	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	18.98	345,600.00	6,559,488.00
77	600600	青岛啤酒	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	103.92	62,600.00	6,505,392.00
78	600809	山西汾酒	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 14 日	324.80	20,000.00	6,496,000.00
79	601238	广汽集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	15.24	422,900.00	6,444,996.00
80	601799	星宇股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 14 日	171.00	37,000.00	6,327,000.00
81	002410	广联达	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	54.44	115,600.00	6,293,264.00
82	000963	华东医药	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	45.16	139,300.00	6,290,788.00
83	601111	中国国航	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	11.61	538,000.00	6,246,180.00
84	000333	美的集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	60.39	103,100.00	6,226,209.00
85	600309	万华化学	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	96.99	63,600.00	6,168,564.00
86	600588	用友网络	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	21.71	284,000.00	6,165,640.00
87	000703	恒逸石化	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	10.51	575,400.00	6,047,454.00
88	002493	荣盛石化	2022 年 7 月 4 日	15.39	388,700.00	5,982,093.00

			-2022 年 7 月 20 日			
89	000977	浪潮信息	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	26.48	221,900.00	5,875,912.00
90	002241	歌尔股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	33.60	174,600.00	5,866,560.00
91	601877	正泰电器	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	35.78	163,100.00	5,835,718.00
92	600011	华能国际	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	7.04	828,900.00	5,835,456.00
93	002050	三花智控	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	27.48	212,200.00	5,831,256.00
94	600383	金地集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	13.44	430,700.00	5,788,608.00
95	002821	凯莱英	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	289.00	20,000.00	5,780,000.00
96	000786	北新建材	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	34.62	166,600.00	5,767,692.00
97	603806	福斯特	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 26 日	65.52	88,000.00	5,765,760.00
98	002841	视源股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	75.32	75,000.00	5,649,000.00
99	000538	云南白药	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	60.39	92,200.00	5,567,958.00
100	603260	合盛硅业	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 14 日	117.96	46,900.00	5,532,324.00
101	002230	科大讯飞	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	41.22	134,200.00	5,531,724.00
102	002007	华兰生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	22.80	240,600.00	5,485,680.00
103	002120	韵达股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	17.06	318,300.00	5,430,198.00
104	000725	京东方 A	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.94	1,369,200.00	5,394,648.00
105	002179	中航光电	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	63.32	84,600.00	5,356,872.00
106	601021	春秋航空	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	58.35	91,200.00	5,321,520.00
107	600745	闻泰科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	85.11	61,200.00	5,208,732.00
108	300454	深信服	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	103.78	49,500.00	5,137,110.00
109	603882	金域医学	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	82.55	62,200.00	5,134,610.00
110	603369	今世缘	2022 年 7 月 4 日	51.00	99,600.00	5,079,600.00

			-2022 年 7 月 20 日			
111	600958	东方证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 22 日	10.21	496,800.00	5,072,328.00
112	688599	天合光能	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	65.25	77,000.00	5,024,250.00
113	002475	立讯精密	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	33.79	148,200.00	5,007,678.00
114	601318	中国平安	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	46.69	106,700.00	4,981,823.00
115	600741	华域汽车	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	23.00	212,700.00	4,892,100.00
116	600438	通威股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	59.86	81,200.00	4,860,632.00
117	601898	中煤能源	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	10.38	467,300.00	4,850,574.00
118	601995	中金公司	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	44.49	107,400.00	4,778,226.00
119	300033	同花顺	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	96.15	49,000.00	4,711,350.00
120	300601	康泰生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	45.18	103,600.00	4,680,648.00
121	601229	上海银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.55	707,900.00	4,636,745.00
122	601838	成都银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	16.58	279,400.00	4,632,452.00
123	688981	中芯国际	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	45.17	102,500.00	4,629,925.00
124	000768	中航西飞	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	30.29	152,700.00	4,625,283.00
125	601155	新城控股	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	25.43	180,800.00	4,597,744.00
126	002236	大华股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	16.42	279,700.00	4,592,674.00
127	600332	白云山	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	31.59	144,400.00	4,561,596.00
128	002142	宁波银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	35.81	126,400.00	4,526,384.00
129	603993	洛阳钼业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	5.73	783,100.00	4,487,163.00
130	600845	宝信软件	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	54.60	81,000.00	4,422,600.00
131	600048	保利发展	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	17.46	251,000.00	4,382,460.00
132	002027	分众传媒	2022 年 7 月 4 日	6.73	650,800.00	4,379,884.00

			-2022 年 7 月 20 日			
133	300999	金龙鱼	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	54.02	79,700.00	4,305,394.00
134	002202	金风科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	14.80	289,800.00	4,289,040.00
135	601377	兴业证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	7.05	601,000.00	4,237,050.00
136	600989	宝丰能源	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	14.65	286,800.00	4,201,620.00
137	600690	海尔智家	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	27.46	152,000.00	4,173,920.00
138	600036	招商银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	42.20	98,300.00	4,148,260.00
139	601966	玲珑轮胎	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	25.37	162,800.00	4,130,236.00
140	300316	晶盛机电	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	67.59	61,000.00	4,122,990.00
141	601618	中国中冶	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.50	1,172,900.00	4,105,150.00
142	600760	中航沈飞	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	60.45	67,800.00	4,098,510.00
143	600585	海螺水泥	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	35.28	116,000.00	4,092,480.00
144	600031	三一重工	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	19.06	214,300.00	4,084,558.00
145	002736	国信证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.57	422,800.00	4,046,196.00
146	000166	申万宏源	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.29	941,500.00	4,039,035.00
147	300408	三环集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	30.10	133,900.00	4,030,390.00
148	300529	健帆生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	50.89	78,800.00	4,010,132.00
149	688363	华熙生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	142.18	28,000.00	3,981,040.00
150	601688	华泰证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	14.20	278,000.00	3,947,600.00
151	601865	福莱特	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	38.10	103,300.00	3,935,730.00
152	000063	中兴通讯	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	25.53	152,500.00	3,893,325.00
153	002791	坚朗五金	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 13 日	129.72	30,000.00	3,891,600.00
154	600019	宝钢股份	2022 年 7 月 4 日	6.02	646,100.00	3,889,522.00

			-2022 年 7 月 20 日			
155	600183	生益科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	16.99	228,000.00	3,873,720.00
156	601901	方正证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.71	573,400.00	3,847,514.00
157	600893	航发动力	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	45.51	84,400.00	3,841,044.00
158	300896	爱美客	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	600.01	6,400.00	3,840,064.00
159	600918	中泰证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	7.65	497,100.00	3,802,815.00
160	601398	工商银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.77	796,000.00	3,796,920.00
161	601360	三六零	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	8.52	444,400.00	3,786,288.00
162	600900	长江电力	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	23.12	163,100.00	3,770,872.00
163	603160	汇顶科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	61.93	60,500.00	3,746,765.00
164	601066	中信建投	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	28.91	129,600.00	3,746,736.00
165	601390	中国中铁	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.14	609,400.00	3,741,716.00
166	600018	上港集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	5.83	631,200.00	3,679,896.00
167	300433	蓝思科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	11.07	331,900.00	3,674,133.00
168	002304	洋河股份	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 11 日	183.15	20,000.00	3,663,000.00
169	300124	汇川技术	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	65.87	54,900.00	3,616,263.00
170	001979	招商蛇口	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	13.43	265,500.00	3,565,665.00
171	600000	浦发银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	8.01	445,100.00	3,565,251.00
172	600926	杭州银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	14.98	235,900.00	3,533,782.00
173	002008	大族激光	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	33.13	105,900.00	3,508,467.00
174	600276	恒瑞医药	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	37.09	94,300.00	3,497,587.00
175	601006	大秦铁路	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.59	529,900.00	3,492,041.00
176	601899	紫金矿业	2022 年 7 月 4 日	9.33	374,100.00	3,490,353.00

			-2022 年 7 月 20 日			
177	600919	江苏银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	7.12	488,800.00	3,480,256.00
178	603501	韦尔股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	173.03	20,000.00	3,460,600.00
179	601985	中国核电	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	6.86	500,500.00	3,433,430.00
180	601288	农业银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.02	1,132,900.00	3,421,358.00
181	300866	安克创新	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	66.32	49,800.00	3,302,736.00
182	601166	兴业银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	19.90	164,700.00	3,277,530.00
183	601117	中国化学	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	9.41	342,700.00	3,224,807.00
184	600584	长电科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	27.00	119,200.00	3,218,400.00
185	601816	京沪高铁	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.02	628,400.00	3,154,568.00
186	600887	伊利股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	38.95	80,200.00	3,123,790.00
187	000066	中国长城	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 19 日	10.82	286,900.00	3,104,258.00
188	688169	石头科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	616.70	5,000.00	3,083,500.00
189	603833	欧派家居	2022 年 7 月 5 日 -2022 年 7 月 11 日	150.68	20,000.00	3,013,600.00
190	601328	交通银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.98	605,100.00	3,013,398.00
191	002600	领益智造	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.02	599,600.00	3,009,992.00
192	600406	国电南瑞	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	27.00	110,660.00	2,987,820.00
193	600606	绿地控股	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.96	750,600.00	2,972,376.00
194	601628	中国人寿	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	31.08	95,300.00	2,961,924.00
195	600132	重庆啤酒	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 11 日	146.60	20,000.00	2,932,000.00
196	600030	中信证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	21.66	134,900.00	2,921,934.00
197	600362	江西铜业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	17.83	163,600.00	2,916,988.00
198	002607	中公教育	2022 年 7 月 4 日	5.79	503,300.00	2,914,107.00

			-2022 年 7 月 28 日			
199	601216	君正集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	4.88	596,200.00	2,909,456.00
200	002601	龙佰集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	20.05	145,100.00	2,909,255.00
201	600104	上汽集团	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	17.81	162,400.00	2,892,344.00
202	002568	百润股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	30.04	96,080.00	2,886,243.20
203	000895	双汇发展	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	29.30	98,400.00	2,883,120.00
204	000708	中信特钢	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	20.15	142,400.00	2,869,360.00
205	601919	中远海控	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	13.90	205,300.00	2,853,670.00
206	601878	浙商证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	11.38	248,800.00	2,831,344.00
207	600426	华鲁恒升	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	29.20	96,800.00	2,826,560.00
208	603899	晨光股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	56.08	49,800.00	2,792,784.00
209	600050	中国联通	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.46	807,000.00	2,792,220.00
210	300919	中伟股份	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 21 日	123.90	22,500.00	2,787,750.00
211	600028	中国石化	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.08	679,900.00	2,773,992.00
212	002032	苏泊尔	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	56.34	49,200.00	2,771,928.00
213	002371	北方华创	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	277.12	10,000.00	2,771,200.00
214	600176	中国巨石	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	17.41	157,000.00	2,733,370.00
215	601668	中国建筑	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	5.32	510,200.00	2,714,264.00
216	601336	新华保险	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	32.19	83,300.00	2,681,427.00
217	600837	海通证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.81	272,500.00	2,673,225.00
218	600025	华能水电	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.99	376,100.00	2,628,939.00
219	601998	中信银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.75	542,600.00	2,577,350.00
220	600015	华夏银行	2022 年 7 月 4 日	5.21	490,700.00	2,556,547.00

			-2022 年 7 月 21 日			
221	600547	山东黄金	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	18.56	137,000.00	2,542,720.00
222	002252	上海莱士	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.93	426,800.00	2,530,924.00
223	000596	古井贡酒	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	249.66	10,000.00	2,496,600.00
224	000568	泸州老窖	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	246.54	10,000.00	2,465,400.00
225	002064	华峰化学	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	8.44	291,400.00	2,459,416.00
226	603019	中科曙光	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	29.02	83,900.00	2,434,778.00
227	601601	中国太保	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	23.53	102,400.00	2,409,472.00
228	300003	乐普医疗	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	18.57	127,700.00	2,371,389.00
229	688111	金山办公	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	197.12	12,000.00	2,365,440.00
230	688008	澜起科技	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	60.58	38,200.00	2,314,156.00
231	601319	中国人保	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.06	453,600.00	2,295,216.00
232	000800	一汽解放	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.34	244,600.00	2,284,564.00
233	600886	国投电力	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	10.50	215,200.00	2,259,600.00
234	002648	卫星化学	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 26 日	25.85	87,100.00	2,251,535.00
235	688396	华润微	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	59.07	37,900.00	2,238,753.00
236	300782	卓胜微	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	135.00	16,480.00	2,224,800.00
237	601939	建设银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.06	365,200.00	2,213,112.00
238	601658	邮储银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.39	407,900.00	2,198,581.00
239	000338	潍柴动力	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	12.47	175,100.00	2,183,497.00
240	601236	红塔证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.13	238,200.00	2,174,766.00
241	002414	高德红外	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	12.87	166,300.00	2,140,281.00
242	000938	紫光股份	2022 年 7 月 4 日	19.40	107,600.00	2,087,440.00

			-2022 年 7 月 20 日			
243	601169	北京银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.54	459,600.00	2,086,584.00
244	601881	中国银河	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.67	215,200.00	2,080,984.00
245	000157	中联重科	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 28 日	6.16	337,800.00	2,080,848.00
246	688126	沪硅产业	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	22.98	90,500.00	2,079,690.00
247	688012	中微公司	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	116.75	17,500.00	2,043,125.00
248	601916	浙商银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.32	601,600.00	1,997,312.00
249	601138	工业富联	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	9.84	201,500.00	1,982,760.00
250	600016	民生银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	3.72	529,600.00	1,970,112.00
251	601808	中海油服	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	13.95	141,200.00	1,969,740.00
252	601989	中国重工	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	3.71	528,900.00	1,962,219.00
253	600905	三峡能源	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	6.29	308,000.00	1,937,320.00
254	601766	中国中车	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	5.20	367,600.00	1,911,520.00
255	688561	奇安信	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	55.80	34,100.00	1,902,780.00
256	002049	紫光国微	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	189.72	10,000.00	1,897,200.00
257	600460	士兰微	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	52.00	36,400.00	1,892,800.00
258	600061	国投资本	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	6.36	292,400.00	1,859,664.00
259	601818	光大银行	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	3.01	616,000.00	1,854,160.00
260	600219	南山铝业	2022 年 7 月 7 日 -2022 年 7 月 21 日	3.69	463,400.00	1,709,946.00
261	002602	世纪华通	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	4.82	348,400.00	1,679,288.00
262	688036	传音控股	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 21 日	89.23	17,900.00	1,597,217.00
263	600161	天坛生物	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	24.28	65,500.00	1,590,340.00
264	603185	上机数控	2022 年 7 月 11 日	155.99	10,000.00	1,559,900.00

			-2022 年 7 月 11 日			
265	603195	公牛集团	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	152.91	10,000.00	1,529,100.00
266	002920	德赛西威	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	148.00	10,000.00	1,480,000.00
267	600352	浙江龙盛	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	10.18	142,600.00	1,451,668.00
268	603986	兆易创新	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	142.21	10,000.00	1,422,100.00
269	600489	中金黄金	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	7.39	190,200.00	1,405,578.00
270	000069	华侨城 A	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 14 日	6.49	212,800.00	1,381,072.00
271	000877	天山股份	2022 年 7 月 6 日 -2022 年 7 月 21 日	12.30	100,200.00	1,232,460.00
272	601698	中国卫通	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 20 日	11.31	107,400.00	1,214,694.00
273	600115	中国东航	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	5.49	203,400.00	1,116,666.00
274	600999	招商证券	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	14.41	76,000.00	1,095,160.00
275	300223	北京君正	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	106.25	10,000.00	1,062,500.00
276	600655	豫园股份	2022 年 7 月 4 日 -2022 年 7 月 11 日	9.44	111,100.00	1,048,784.00
277	002916	深南电路	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	93.71	10,000.00	937,100.00
278	603659	璞泰来	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	84.40	10,000.00	844,000.00
279	300957	贝泰妮	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	217.53	3,700.00	804,861.00
280	688065	凯赛生物	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 13 日	111.80	5,400.00	603,720.00
281	300979	华利集团	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 21 日	73.08	4,200.00	306,936.00
282	300661	圣邦股份	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	182.02	1,500.00	273,030.00
283	300496	中科创达	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	130.48	1,000.00	130,480.00
284	688005	容百科技	2022 年 7 月 11 日 -2022 年 7 月 11 日	129.44	1,000.00	129,440.00
合计	-	-	-	-	91,916,960.00	1,847,569,464.00

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；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的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围內。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

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。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 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	22,848,870,755.87	98.80	28,697,060,869.42	99.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	3,461,257.92	0.01	-	-

交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	22,852,332,013.79	98.81	28,697,060,869.42	99.27

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②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。

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		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 6 月 30 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%	-1,169,128,112.26	-1,421,312,479.96
	+5%	1,169,128,112.26	1,421,312,479.96

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
第一层次	22,849,739,346.81
第二层次	481,651.17
第三层次	2,111,015.81
合计	22,852,332,013.79

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金政策以报告期初作为

确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 6 月 30 日止，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

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	22,848,870,755.87	98.47
	其中：股票	22,848,870,755.87	98.47
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,461,257.92	0.01
	其中：债券	3,461,257.92	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	304,856,386.74	1.31
8	其他各项资产	47,538,164.99	0.20
9	合计	23,204,726,565.52	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 1,847,569,464.00 元，占本基金期末资产净值的 7.99%。

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	277,819,823.97	1.20
B	采矿业	645,064,353.34	2.79
C	制造业	13,596,272,601.79	58.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	574,248,780.28	2.48
E	建筑业	445,416,291.44	1.93
F	批发和零售业	58,973,632.88	0.26
G	交通运输、仓储和邮政业	605,814,556.32	2.62
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	701,937,224.40	3.04
J	金融业	4,606,054,205.47	19.92
K	房地产业	428,347,273.42	1.85
L	租赁和商务服务业	321,575,705.01	1.39
M	科学研究和技术服务业	348,761,089.00	1.51
N	水利、环境和公共设施管理业	72,797.79	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	11,656,428.00	0.05
Q	卫生和社会工作	199,680,833.64	0.86
R	文化、体育和娱乐业	27,185,631.12	0.12
S	综合	-	-
	合计	22,848,881,227.87	98.80

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例 （%）
1	600519	贵州茅台	683,815	1,398,401,675.00	6.05
2	300750	宁德时代	1,521,746	812,612,364.00	3.51
3	600036	招商银行	13,470,847	568,469,743.40	2.46
4	601318	中国平安	11,789,716	550,461,840.04	2.38
5	601012	隆基绿能	6,597,868	439,615,944.84	1.90
6	000858	五粮液	2,112,015	426,479,188.95	1.84
7	002594	比亚迪	986,392	328,951,868.08	1.42
8	000333	美的集团	5,331,203	321,951,349.17	1.39
9	601166	兴业银行	15,826,870	314,954,713.00	1.36
10	300059	东方财富	11,509,793	292,348,742.20	1.26
11	600900	长江电力	12,375,563	286,123,016.56	1.24
12	601888	中国中免	1,062,400	247,464,832.00	1.07
13	603259	药明康德	2,232,145	232,120,758.55	1.00
14	600030	中信证券	10,622,570	230,084,866.20	0.99
15	600887	伊利股份	5,572,396	217,044,824.20	0.94
16	000568	泸州老窖	801,329	197,559,651.66	0.85
17	002415	海康威视	5,133,500	185,832,700.00	0.80
18	002475	立讯精密	5,397,816	182,392,202.64	0.79

19	601398	工商银行	38,147,139	181,961,853.03	0.79
20	600276	恒瑞医药	4,860,472	180,274,906.48	0.78
21	600438	通威股份	2,939,817	175,977,445.62	0.76
22	000651	格力电器	5,149,780	173,650,581.60	0.75
23	600809	山西汾酒	531,093	172,499,006.40	0.75
24	600309	万华化学	1,708,646	165,721,575.54	0.72
25	300760	迈瑞医疗	527,745	165,289,734.00	0.71
26	000725	京东方 A	40,825,400	160,852,076.00	0.70
27	002714	牧原股份	2,896,337	160,080,545.99	0.69
28	000001	平安银行	10,559,977	158,188,455.46	0.68
29	002142	宁波银行	4,311,815	154,406,095.15	0.67
30	000002	万科 A	7,408,490	151,874,045.00	0.66
31	601328	交通银行	29,904,367	148,923,747.66	0.64
32	601899	紫金矿业	15,689,142	146,379,694.86	0.63
33	002812	恩捷股份	582,776	145,956,249.20	0.63
34	002129	TCL 中环	2,462,513	145,017,390.57	0.63
35	000792	盐湖股份	4,730,800	141,734,768.00	0.61
36	002466	天齐锂业	1,125,273	140,434,070.40	0.61
37	603288	海天味业	1,512,622	136,680,523.92	0.59
38	600048	保利发展	7,816,593	136,477,713.78	0.59
39	300124	汇川技术	2,007,973	132,265,181.51	0.57
40	603799	华友钴业	1,382,807	132,224,005.34	0.57
41	300015	爱尔眼科	2,950,606	132,098,630.62	0.57
42	002460	赣锋锂业	875,048	130,119,637.60	0.56
43	600031	三一重工	6,471,168	123,340,462.08	0.53
44	601668	中国建筑	22,821,622	121,411,029.04	0.52
45	300014	亿纬锂能	1,233,389	120,255,427.50	0.52
46	002304	洋河股份	656,252	120,192,553.80	0.52
47	601088	中国神华	3,590,068	119,549,264.40	0.52
48	002352	顺丰控股	2,130,832	118,921,733.92	0.51
49	300498	温氏股份	5,530,262	117,739,277.98	0.51
50	600436	片仔癀	327,816	116,941,801.68	0.51
51	600690	海尔智家	4,119,933	113,133,360.18	0.49
52	600089	特变电工	4,125,313	112,992,323.07	0.49
53	002271	东方雨虹	2,193,720	112,910,768.40	0.49
54	300274	阳光电源	1,131,531	111,172,920.75	0.48
55	601816	京沪高铁	21,378,029	107,317,705.58	0.46
56	601288	农业银行	34,745,825	104,932,391.50	0.45
57	603986	兆易创新	726,742	103,349,979.82	0.45
58	600837	海通证券	10,508,369	103,087,099.89	0.45
59	600000	浦发银行	12,779,001	102,359,798.01	0.44
60	600016	民生银行	27,017,753	100,506,041.16	0.43
61	603501	韦尔股份	572,669	99,088,917.07	0.43

62	600406	国电南瑞	3,643,617	98,377,659.00	0.43
63	300122	智飞生物	870,624	96,647,970.24	0.42
64	601919	中远海控	6,889,252	95,760,602.80	0.41
65	688981	中芯国际	2,109,453	95,283,992.01	0.41
66	000625	长安汽车	5,407,702	93,661,398.64	0.40
67	600585	海螺水泥	2,611,433	92,131,356.24	0.40
68	600919	江苏银行	12,860,545	91,567,080.40	0.40
69	002709	天赐材料	1,465,900	90,973,754.00	0.39
70	601688	华泰证券	6,406,566	90,973,237.20	0.39
71	600104	上汽集团	5,086,336	90,587,644.16	0.39
72	601225	陕西煤业	4,221,129	89,403,512.22	0.39
73	000063	中兴通讯	3,464,182	88,440,566.46	0.38
74	002049	紫光国微	462,140	87,677,200.80	0.38
75	601601	中国太保	3,724,524	87,638,049.72	0.38
76	002241	歌尔股份	2,602,287	87,436,843.20	0.38
77	300142	沃森生物	1,743,160	84,351,512.40	0.36
78	600111	北方稀土	2,372,651	83,422,409.16	0.36
79	002230	科大讯飞	2,022,841	83,381,506.02	0.36
80	000661	长春高新	351,963	82,155,203.46	0.36
81	002459	晶澳科技	1,020,540	80,520,606.00	0.35
82	002371	北方华创	286,394	79,365,505.28	0.34
83	688599	天合光能	1,179,654	76,972,423.50	0.33
84	300450	先导智能	1,191,492	75,278,464.56	0.33
85	601988	中国银行	22,938,452	74,779,353.52	0.32
86	601211	国泰君安	4,908,062	74,602,542.40	0.32
87	002027	分众传媒	11,009,051	74,090,913.23	0.32
88	000338	潍柴动力	5,906,833	73,658,207.51	0.32
89	000100	TCL 科技	15,270,466	73,145,532.14	0.32
90	601169	北京银行	16,108,397	73,132,122.38	0.32
91	600660	福耀玻璃	1,744,116	72,921,489.96	0.32
92	601229	上海银行	10,823,500	70,893,925.00	0.31
93	601985	中国核电	10,257,407	70,365,812.02	0.30
94	600050	中国联通	20,235,500	70,014,830.00	0.30
95	600745	闻泰科技	814,381	69,311,966.91	0.30
96	601766	中国中车	13,239,201	68,843,845.20	0.30
97	601390	中国中铁	11,174,109	68,609,029.26	0.30
98	600893	航发动力	1,450,082	65,993,231.82	0.29
99	601669	中国电建	8,325,180	65,519,166.60	0.28
100	300347	泰格医药	570,877	65,336,872.65	0.28
101	603659	璞泰来	757,310	63,916,964.00	0.28
102	601658	邮储银行	11,840,379	63,819,642.81	0.28
103	000776	广发证券	3,220,814	60,229,221.80	0.26
104	600009	上海机场	1,048,426	59,445,754.20	0.26

105	600028	中国石化	14,561,037	59,409,030.96	0.26
106	600905	三峡能源	9,345,463	58,782,962.27	0.25
107	601009	南京银行	5,608,108	58,436,485.36	0.25
108	600019	宝钢股份	9,694,597	58,361,473.94	0.25
109	600010	包钢股份	24,806,325	58,294,863.75	0.25
110	600999	招商证券	4,039,028	58,202,393.48	0.25
111	600958	东方证券	5,690,731	58,102,363.51	0.25
112	600196	复星医药	1,313,577	57,915,609.93	0.25
113	300896	爱美客	94,381	56,629,543.81	0.24
114	002410	广联达	1,036,311	56,416,770.84	0.24
115	601628	中国人寿	1,813,265	56,356,276.20	0.24
116	601857	中国石油	10,573,502	56,039,560.60	0.24
117	600570	恒生电子	1,272,848	55,419,801.92	0.24
118	000895	双汇发展	1,885,740	55,252,182.00	0.24
119	002179	中航光电	865,669	54,814,161.08	0.24
120	002311	海大集团	903,491	54,218,494.91	0.23
121	601818	光大银行	18,002,682	54,188,072.82	0.23
122	002050	三花智控	1,954,724	53,715,815.52	0.23
123	600760	中航沈飞	854,061	51,627,987.45	0.22
124	300759	康龙化成	538,709	51,295,870.98	0.22
125	600346	恒力石化	2,298,426	51,116,994.24	0.22
126	002493	荣盛石化	3,305,856	50,877,123.84	0.22
127	601633	长城汽车	1,341,051	49,672,529.04	0.21
128	002074	国轩高科	1,086,968	49,565,740.80	0.21
129	300661	圣邦股份	270,700	49,272,814.00	0.21
130	600926	杭州银行	3,226,841	48,338,078.18	0.21
131	300496	中科创达	369,700	48,238,456.00	0.21
132	600460	士兰微	924,288	48,062,976.00	0.21
133	300316	晶盛机电	700,300	47,333,277.00	0.20
134	000538	云南白药	782,354	47,246,358.06	0.20
135	600426	华鲁恒升	1,616,878	47,212,837.60	0.20
136	688012	中微公司	403,201	47,073,716.75	0.20
137	300782	卓胜微	348,117	46,995,795.00	0.20
138	001979	招商蛇口	3,451,259	46,350,408.37	0.20
139	002821	凯莱英	160,072	46,260,808.00	0.20
140	601989	中国重工	12,408,364	46,035,030.44	0.20
141	002001	新和成	2,017,957	46,029,599.17	0.20
142	000768	中航西飞	1,506,308	45,626,069.32	0.20
143	600176	中国巨石	2,613,661	45,503,838.01	0.20
144	002920	德赛西威	301,655	44,644,940.00	0.19
145	000596	古井贡酒	178,209	44,491,658.94	0.19
146	002202	金风科技	3,005,539	44,481,977.20	0.19
147	601939	建设银行	7,308,885	44,291,843.10	0.19

148	603993	洛阳钼业	7,691,380	44,071,607.40	0.19
149	000963	华东医药	951,858	42,985,907.28	0.19
150	601006	大秦铁路	6,471,600	42,647,844.00	0.18
151	601138	工业富联	4,323,664	42,544,853.76	0.18
152	600763	通策医疗	243,632	42,499,166.08	0.18
153	000166	申万宏源	9,811,312	42,090,528.48	0.18
154	601877	正泰电器	1,170,070	41,865,104.60	0.18
155	600584	长电科技	1,549,195	41,828,265.00	0.18
156	300207	欣旺达	1,309,900	41,392,840.00	0.18
157	601377	兴业证券	5,831,095	41,109,219.75	0.18
158	601066	中信建投	1,413,399	40,861,365.09	0.18
159	600588	用友网络	1,869,407	40,584,825.97	0.18
160	601600	中国铝业	8,540,746	40,568,543.50	0.18
161	600029	南方航空	5,518,044	40,336,901.64	0.17
162	600600	青岛啤酒	385,636	40,075,293.12	0.17
163	688111	金山办公	201,084	39,637,678.08	0.17
164	600383	金地集团	2,948,354	39,625,877.76	0.17
165	601186	中国铁建	5,007,724	39,561,019.60	0.17
166	600085	同仁堂	746,676	39,484,226.88	0.17
167	600741	华域汽车	1,715,717	39,461,491.00	0.17
168	600188	兖矿能源	995,209	39,290,851.32	0.17
169	601838	成都银行	2,359,059	39,113,198.22	0.17
170	600132	重庆啤酒	262,800	38,526,480.00	0.17
171	000786	北新建材	1,103,260	38,194,861.20	0.17
172	603806	福斯特	579,653	37,978,864.56	0.16
173	600795	国电电力	9,705,985	37,950,401.35	0.16
174	688005	容百科技	293,145	37,944,688.80	0.16
175	601111	中国国航	3,252,471	37,761,188.31	0.16
176	300408	三环集团	1,251,694	37,675,989.40	0.16
177	601117	中国化学	3,989,618	37,542,305.38	0.16
178	000876	新希望	2,451,911	37,514,238.30	0.16
179	300751	迈为股份	75,499	37,062,459.10	0.16
180	603019	中科曙光	1,274,294	36,980,011.88	0.16
181	600150	中国船舶	1,947,491	36,963,379.18	0.16
182	601238	广汽集团	2,405,160	36,654,638.40	0.16
183	600547	山东黄金	1,967,481	36,516,447.36	0.16
184	003816	中国广核	12,842,900	35,960,120.00	0.16
185	601800	中国交建	3,835,364	35,592,177.92	0.15
186	600989	宝丰能源	2,394,652	35,081,651.80	0.15
187	601100	恒立液压	568,255	35,072,698.60	0.15
188	300999	金龙鱼	649,200	35,069,784.00	0.15
189	600015	华夏银行	6,698,562	34,899,508.02	0.15
190	603369	今世缘	682,868	34,826,268.00	0.15

191	300763	锦浪科技	161,948	34,494,924.00	0.15
192	600886	国投电力	3,244,900	34,071,450.00	0.15
193	688396	华润微	573,613	33,883,319.91	0.15
194	002648	卫星化学	1,310,052	33,864,844.20	0.15
195	600011	华能国际	4,788,269	33,709,413.76	0.15
196	601788	光大证券	2,125,664	33,500,464.64	0.14
197	601868	中国能建	14,117,600	33,458,712.00	0.14
198	000157	中联重科	5,403,808	33,287,457.28	0.14
199	300601	康泰生物	732,014	33,072,392.52	0.14
200	000301	东方盛虹	1,942,086	32,840,674.26	0.14
201	600115	中国东航	5,962,728	32,735,376.72	0.14
202	603185	上机数控	208,714	32,557,296.86	0.14
203	000425	徐工机械	5,968,712	32,171,357.68	0.14
204	002236	大华股份	1,955,958	32,116,830.36	0.14
205	300595	欧普康视	547,218	31,295,397.42	0.14
206	002601	龙佰集团	1,554,699	31,171,714.95	0.13
207	002555	三七互娱	1,447,832	30,737,473.36	0.13
208	603486	科沃斯	249,200	30,374,988.00	0.13
209	002008	大族激光	915,348	30,325,479.24	0.13
210	601916	浙商银行	9,095,900	30,198,388.00	0.13
211	000938	紫光股份	1,556,154	30,189,387.60	0.13
212	601901	方正证券	4,479,700	30,058,787.00	0.13
213	002736	国信证券	3,139,148	30,041,646.36	0.13
214	603833	欧派家居	199,313	30,032,482.84	0.13
215	300628	亿联网络	392,706	29,904,561.90	0.13
216	603392	万泰生物	191,997	29,817,134.10	0.13
217	688008	澜起科技	491,928	29,800,998.24	0.13
218	600941	中国移动	491,116	29,712,518.00	0.13
219	000977	浪潮信息	1,107,445	29,325,143.60	0.13
220	601336	新华保险	907,469	29,211,427.11	0.13
221	000069	华侨城 A	4,463,127	28,965,694.23	0.13
222	600352	浙江龙盛	2,832,613	28,836,000.34	0.12
223	600219	南山铝业	7,803,650	28,795,468.50	0.12
224	603290	斯达半导	74,400	28,710,960.00	0.12
225	601995	中金公司	636,538	28,319,575.62	0.12
226	300454	深信服	270,814	28,105,076.92	0.12
227	603260	合盛硅业	233,200	27,508,272.00	0.12
228	002841	视源股份	362,544	27,306,814.08	0.12
229	688126	沪硅产业	1,184,371	27,216,845.58	0.12
230	601618	中国中冶	7,771,800	27,201,300.00	0.12
231	300413	芒果超媒	814,917	27,185,631.12	0.12
232	002007	华兰生物	1,191,440	27,164,832.00	0.12
233	002120	韵达股份	1,579,453	26,945,468.18	0.12

234	600845	宝信软件	493,342	26,936,473.20	0.12
235	300529	健帆生物	525,942	26,765,188.38	0.12
236	601799	星宇股份	155,801	26,641,971.00	0.12
237	601360	三六零	3,110,174	26,498,682.48	0.11
238	002252	上海莱士	4,401,602	26,101,499.86	0.11
239	300003	乐普医疗	1,375,274	25,538,838.18	0.11
240	000703	恒逸石化	2,394,416	25,165,312.16	0.11
241	603882	金城医学	303,656	25,066,802.80	0.11
242	601155	新城控股	985,196	25,053,534.28	0.11
243	300919	中伟股份	198,300	24,569,370.00	0.11
244	600332	白云山	765,420	24,179,617.80	0.10
245	601878	浙商证券	2,110,100	24,012,938.00	0.10
246	300433	蓝思科技	2,165,015	23,966,716.05	0.10
247	002602	世纪华通	4,867,363	23,460,689.66	0.10
248	688036	传音控股	262,268	23,402,173.64	0.10
249	600489	中金黄金	3,166,012	23,396,828.68	0.10
250	601021	春秋航空	398,656	23,261,577.60	0.10
251	600918	中泰证券	3,034,130	23,211,094.50	0.10
252	002938	鹏鼎控股	758,300	22,908,243.00	0.10
253	000066	中国长城	2,106,200	22,789,084.00	0.10
254	603899	晨光股份	403,221	22,612,633.68	0.10
255	688169	石头科技	36,425	22,463,297.50	0.10
256	300033	同花顺	233,444	22,445,640.60	0.10
257	300223	北京君正	208,944	22,200,300.00	0.10
258	000708	中信特钢	1,098,562	22,136,024.30	0.10
259	601728	中国电信	5,913,621	22,057,806.33	0.10
260	600183	生益科技	1,260,194	21,410,696.06	0.09
261	601865	福莱特	554,006	21,107,628.60	0.09
262	002916	深南电路	222,613	20,861,064.23	0.09
263	601898	中煤能源	1,992,700	20,684,226.00	0.09
264	600018	上港集团	3,547,239	20,680,403.37	0.09
265	600362	江西铜业	1,129,269	20,134,866.27	0.09
266	300957	贝泰妮	92,388	20,097,161.64	0.09
267	002414	高德红外	1,430,726	18,413,443.62	0.08
268	002791	坚朗五金	140,237	18,191,543.64	0.08
269	600161	天坛生物	747,652	18,152,990.56	0.08
270	601216	君正集团	3,672,866	17,923,586.08	0.08
271	600061	国投资本	2,797,127	17,789,727.72	0.08
272	601319	中国人保	3,477,300	17,595,138.00	0.08
273	002568	百润股份	571,464	17,166,778.56	0.07
274	000408	藏格矿业	515,900	16,993,746.00	0.07
275	688561	奇安信	297,518	16,601,504.40	0.07
276	600606	绿地控股	4,172,109	16,521,551.64	0.07

277	601966	玲珑轮胎	646,310	16,396,884.70	0.07
278	600655	豫园股份	1,693,615	15,987,725.60	0.07
279	601998	中信银行	3,335,478	15,843,520.50	0.07
280	002600	领益智造	3,075,750	15,440,265.00	0.07
281	603160	汇顶科技	248,860	15,411,899.80	0.07
282	688065	凯赛生物	136,315	15,240,017.00	0.07
283	688363	华熙生物	104,923	14,917,952.14	0.06
284	600025	华能水电	1,959,568	13,697,380.32	0.06
285	002064	华峰化学	1,620,200	13,674,488.00	0.06
286	601881	中国银河	1,402,600	13,563,142.00	0.06
287	603195	公牛集团	85,245	13,034,812.95	0.06
288	300866	安克创新	177,300	11,758,536.00	0.05
289	603087	甘李药业	243,800	11,695,086.00	0.05
290	002607	中公教育	2,013,200	11,656,428.00	0.05
291	002032	苏泊尔	176,381	9,937,305.54	0.04
292	000800	一汽解放	1,012,800	9,459,552.00	0.04
293	601236	红塔证券	1,026,556	9,372,456.28	0.04
294	601808	中海油服	644,518	8,991,026.10	0.04
295	605499	东鹏饮料	48,000	8,201,280.00	0.04
296	000877	天山股份	660,194	8,120,386.20	0.04
297	300979	华利集团	101,788	7,438,667.04	0.03
298	601825	沪农商行	1,049,500	6,580,365.00	0.03
299	601698	中国卫通	478,738	5,414,526.78	0.02
300	001289	龙源电力	164,900	3,588,224.00	0.02
301	600938	中国海油	84,004	1,332,303.44	0.01
302	688322	奥比中光	8,529	264,313.71	0.00
303	301139	元道通信	5,651	217,337.46	0.00
304	688209	英集芯	6,822	188,150.76	0.00
305	301236	软通动力	2,076	65,144.88	0.00
306	301219	腾远钴业	578	50,759.96	0.00
307	301200	大族数控	857	44,495.44	0.00
308	301206	三元生物	945	43,177.05	0.00
309	601089	福元医药	1,749	36,816.45	0.00
310	301150	中一科技	404	33,435.04	0.00
311	301109	军信股份	1,838	29,665.32	0.00
312	301302	华如科技	466	26,291.72	0.00
313	301268	铭利达	641	22,351.67	0.00
314	301122	采纳股份	301	21,181.37	0.00
315	301102	兆讯传媒	642	19,959.78	0.00
316	301127	天源环保	1,685	18,754.05	0.00
317	301162	国能日新	334	18,072.74	0.00
318	301123	奕东电子	656	16,655.84	0.00
319	301103	何氏眼科	507	16,234.14	0.00

320	301286	侨源股份	784	15,515.36	0.00
321	301248	杰创智能	472	14,098.64	0.00
322	301212	联盛化学	416	13,844.48	0.00
323	301298	东利机械	634	13,206.22	0.00
324	301148	嘉戎技术	516	12,332.40	0.00
325	301259	艾布鲁	483	12,046.02	0.00
326	301097	天益医疗	249	11,909.67	0.00
327	001268	联合精密	409	11,337.48	0.00
328	301220	亚香股份	285	11,157.75	0.00
329	301237	和顺科技	261	10,925.46	0.00
330	301196	唯科科技	271	10,167.92	0.00
331	301125	腾亚精工	327	8,966.34	0.00
332	301163	宏德股份	277	8,955.41	0.00
333	301130	西点药业	237	8,934.90	0.00
334	301135	瑞德智能	338	8,875.88	0.00
335	301181	标榜股份	257	7,861.63	0.00
336	301228	实朴检测	373	7,586.82	0.00
337	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	352,567,760.90	1.22
2	000858	五粮液	168,744,198.00	0.58
3	000792	盐湖股份	163,758,014.00	0.57
4	000333	美的集团	142,534,211.36	0.49
5	002594	比亚迪	130,267,198.25	0.45
6	300059	东方财富	127,000,451.44	0.44
7	600089	特变电工	106,530,250.48	0.37
8	002415	海康威视	88,770,494.23	0.31
9	000725	京东方 A	87,829,248.77	0.30
10	002371	北方华创	83,253,846.41	0.29
11	002475	立讯精密	81,522,714.64	0.28
12	300760	迈瑞医疗	75,321,121.48	0.26
13	000651	格力电器	73,679,742.43	0.25
14	300782	卓胜微	69,895,112.24	0.24
15	000001	平安银行	69,485,607.10	0.24
16	002142	宁波银行	69,088,184.81	0.24
17	002714	牧原股份	65,675,799.72	0.23
18	002460	赣锋锂业	64,478,543.66	0.22
19	000002	万科 A	62,046,756.89	0.21

20	000568	泸州老窖	58,987,903.23	0.20
----	--------	------	---------------	------

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	494,181,239.34	1.71
2	000858	五粮液	247,120,174.39	0.85
3	000333	美的集团	205,257,785.12	0.71
4	002594	比亚迪	185,936,134.07	0.64
5	300059	东方财富	165,244,093.10	0.57
6	600519	贵州茅台	156,806,399.85	0.54
7	002415	海康威视	126,045,632.39	0.44
8	002475	立讯精密	123,319,907.67	0.43
9	000651	格力电器	107,998,557.61	0.37
10	300760	迈瑞医疗	107,442,740.03	0.37
11	000001	平安银行	98,977,892.20	0.34
12	002371	北方华创	98,195,334.55	0.34
13	002142	宁波银行	97,134,255.42	0.34
14	000568	泸州老窖	93,515,190.64	0.32
15	002714	牧原股份	92,982,513.50	0.32
16	300782	卓胜微	88,824,428.32	0.31
17	002460	赣锋锂业	87,519,554.29	0.30
18	000002	万科 A	87,492,309.25	0.30
19	000725	京东方 A	84,397,309.00	0.29
20	300124	汇川技术	81,868,514.22	0.28

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	5,692,708,883.91
卖出股票收入（成交）总额	7,213,369,254.19

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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）	3,461,257.92	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,461,257.92	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	34,610	3,461,257.92	0.01
2	-	-	-	-	-
3	-	-	-	-	-
4	-	-	-	-	-
5	-	-	-	-	-

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，招商银行、兴业银行系标的指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,279,572.53
2	应收清算款	9,588,242.62
3	应收股利	2,830,033.11
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	840,316.73
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	47,538,164.99

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	219,901,200.00	0.95	转融通出借证券受限
2	300059	东方财富	22,898,100.00	0.10	转融通出借证券受限
3	002594	比亚迪	22,310,481.00	0.10	转融通出借证券受限
4	000858	五粮液	18,315,051.00	0.08	转融通出借证券受限
5	601012	隆基绿能	7,022,802.00	0.03	转融通出借证券受限
6	000333	美的集团	6,226,209.00	0.03	转融通出借证券受限
7	601318	中国平安	4,981,823.00	0.02	转融通出借证券受限

					限
8	600036	招商银行	4,148,260.00	0.02	转融通出借证券受 限
9	601166	兴业银行	3,277,530.00	0.01	转融通出借证券受 限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的基金份 额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏沪深 300ETF 联接	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
23,121	221,536.69	2,713,319,332.00	52.97%	269,258,005.00	5.26%	2,139,572,491.00	41.77%

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	1,790,942,652.00	34.96%
2	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	110,760,019.00	2.16%
3	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	93,717,000.00	1.83%
4	中国人寿保险股份有限公司	68,015,968.00	1.33%
5	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	61,824,600.00	1.21%
6	申万宏源证券—工商银行	48,819,000.00	0.95%

	一申万宏源万利增享 2 号集合资产管理计划		
7	泰康养老保险股份有限公司—自有资金	40,905,200.00	0.80%
8	中国太平洋人寿保险股份有限公司—分红—个人分红	34,786,100.00	0.68%
9	黄秀芬	31,748,900.00	0.62%
10	中海信托股份有限公司—金海 1 号证券投资集合资金信托	30,676,500.00	0.60%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,139,572,491.00	41.77%

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	-	-

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 12 月 25 日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	5,759,349,828
本报告期基金总申购份额	2,121,300,000
减：本报告期基金总赎回份额	2,758,500,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,122,149,828

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，桂勇先生担任华夏基金管理有限公司首席信息官，李一梅女士不再兼任。华夏基金管理有限公司已根据法律法规的规定完成财务负责人孙立强先生的有关备案工作。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

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

本基金管理人、基金托管人涉及托管业务的部门及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

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	
国泰君安证券	2	6,459,094,801.64	50.29%	525,149.84	50.30%	-
中信证券	7	5,221,250,264.87	40.66%	424,481.76	40.65%	-
招商证券	4	1,162,360,131.96	9.05%	94,506.30	9.05%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

- i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。
- ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了安信证券、长江证券、东北证券、东方证券、方正证券、广发证券、国金证券、华安证券、上海证券、新时代证券、信达证券、兴业证券、银河证券、粤开证券、中国银河证券、中金财富、中金公司、中泰证券、中投证券、中信建投证券、中银国际证券的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④在上述租用的券商交易单元中，中泰证券的部分交易单元、国盛证券的交易单元为本基金本期剔除的交易单元，本期没有新增的券商交易单元。

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		基金交易	
	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	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	20,623,700.54	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-11
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23

7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
13	华夏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	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
15	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
16	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25

§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	2022-01-01 至 2022-06-30	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	34.96%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2022-01-01 至 2022-06-30	2,141,945,591.00	230,454,000.00	232,827,100.00	2,139,572,491.00	41.77%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20% 的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，							

有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。
在特定情况下，若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二二年八月三十日