
**华夏国证半导体芯片交易型开放式指数
证券投资基金
2022 年年度报告
2022 年 12 月 31 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年三月三十日

§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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中的财务资料经审计，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2022 年 1 月 1 日起至 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	6
§4 管理人报告.....	6
§5 托管人报告.....	12
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	14
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	17
7.4 报表附注.....	18
§8 投资组合报告.....	223
8.1 期末基金资产组合情况.....	223
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	224
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	226
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	227
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	228
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	228
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	228
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	228
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	228
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	228
8.12 投资组合报告附注.....	228
§9 基金份额持有人信息.....	229
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	229
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	230
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况.....	230
§10 开放式基金份额变动.....	230
§11 重大事件揭示.....	230
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	234
§13 备查文件目录.....	235

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏国证半导体芯片 ETF
场内简称	芯片 ETF
基金主代码	159995
交易代码	159995
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 1 月 20 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	20,435,563,006.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020 年 2 月 10 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。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。
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，衍生品投资策略，债券投资策略，资产支持证券投资策略，融资、转融通证券出借业务投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即国证半导体芯片指数收益率。
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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王小飞
	联系电话	021-6063 7103
	电子邮箱	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话	400-818-6666	021-60637228
传真	010-63136700	021-60635778
注册地址	北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码	100033	100033
法定代表人	杨明辉	田国立

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《证券时报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年 1 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-3,180,376,885.17	5,067,485,095.05	1,234,368,526.61
本期利润	-8,639,117,531.17	5,928,466,707.79	1,703,889,026.52
加权平均基金份额本期利润	-0.5645	0.4475	0.1090
本期加权平均净值利润率	-48.06%	31.99%	9.44%
本期基金份额净值增长率	-38.74%	33.61%	21.97%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-34,330,280.06	6,782,765,929.72	3,490,647,186.55
期末可供分配基金份额利润	-0.0017	0.6297	0.1784
期末基金资产净值	20,401,232,725.94	17,554,128,935.72	23,872,163,797.39
期末基金份额净值	0.9983	1.6297	1.2197
3.1.3 累计期末指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
基金份额累计净值增长率	-0.17%	62.97%	21.97%

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

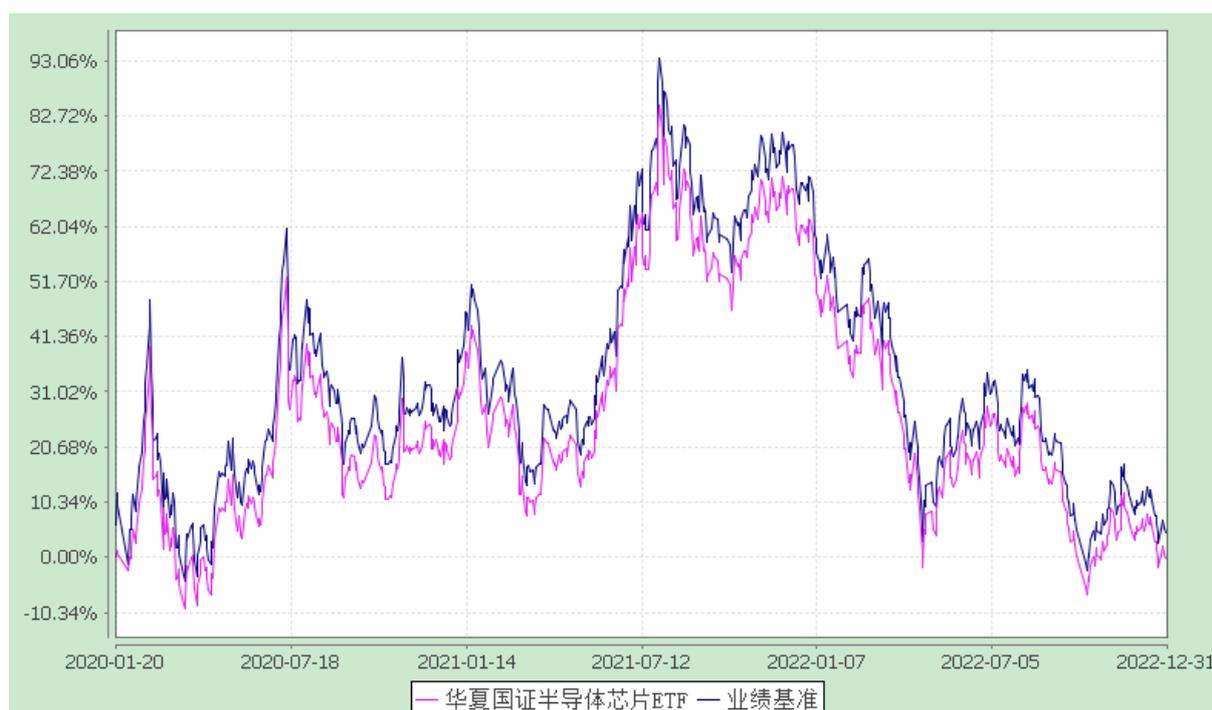
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去三个月	-0.63%	1.93%	-0.57%	1.93%	-0.06%	0.00%

过去六个月	-22.17%	1.81%	-22.18%	1.81%	0.01%	0.00%
过去一年	-38.74%	2.12%	-38.85%	2.12%	0.11%	0.00%
自基金合同生效起至今	-0.17%	2.37%	4.59%	2.43%	-4.76%	-0.06%

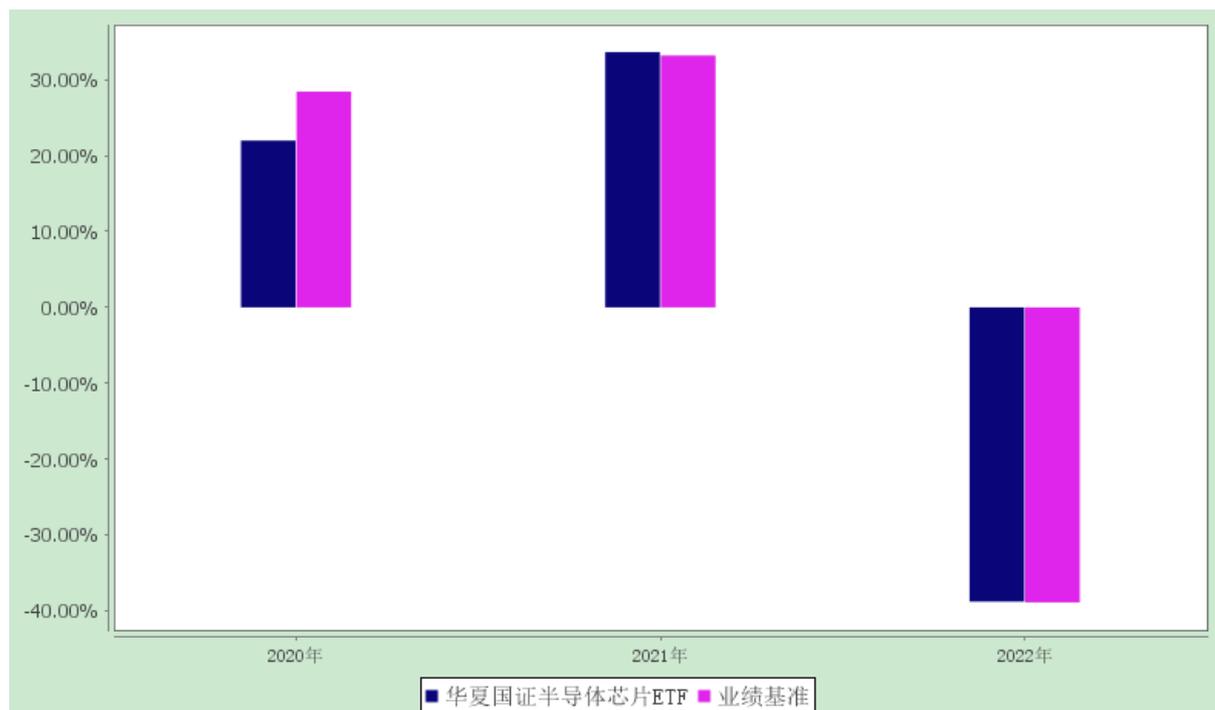
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏国证半导体芯片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
 (2020 年 1 月 20 日至 2022 年 12 月 31 日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金
 自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2020 年 1 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

§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、首批个人养老金基金管理人、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、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题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、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，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 12 月 31 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 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏互联网龙头混合(A 类)排名第 2/22；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；在 TMT 与信息技术行业股票型基金(A 类)中华夏科技成长股票排名第 4/20；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排名第 8/60、华夏乐享健康混合(A 类)排名第 17/60；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 12/61；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 12/307；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 12/451、华夏新锦升混合(A 类)排名第 18/451、华夏新趋势混合(A 类)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 17/211、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 38/211、华夏蓝筹混合(LOF)(A 类)排名第 44/211、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 45/211、华夏兴华混合(A 类)排名第 49/211；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)排名第 28/461；在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏价值精选混合排名第 60/1177。

固收与固收+产品：在信用债指数债券型基金(A 类)中华夏亚债中国指数(A 类)排名第 2/14；在普通债券型基金(二级)(A 类)中华夏恒融债券排名第 6/336、华夏稳健增利 4 个月债券(A 类)排名第 16/336；在利率债指数债券型基金(A 类)中华夏中债 1-3 年政金债指数(A 类)排名第 21/107；在普通债券型基金(可投转债)(A 类)中华夏鼎禄三个月定开债券(A 类)排名第 33/357；在长期纯债债券型基金(A 类)中华夏鼎隆债券(A 类)排名第 59/1158、华夏鼎英债券(A 类)排名第 60/1158。

指数与量化产品：在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/23；在规模指数股票 ETF 基金中华夏沪港通恒生 ETF 排名第 1/131、华夏中证沪港深 500ETF 排名第 26/131、华夏上证 50ETF 排名第 30/131；在规模指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏沪港通恒生 ETF 联接(A 类)排名第 1/92、华夏上证 50ETF 联接(A 类)排名第 25/92；在行业指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证银行 ETF 联接(A 类)排名第 2/28、华夏中证全指房地产 ETF 联接

(A 类)排名第 7/28; 在增强规模指数股票型基金(A 类)中华夏中证 500 指数增强(A 类)排名第 2/123、华夏中证 500 指数智选增强(A 类)排名第 4/123、华夏沪深 300 指数增强(A 类)排名第 38/123; 在行业指数股票 ETF 基金中华夏中证银行 ETF 排名第 6/51、华夏中证全指房地产 ETF 排名第 16/51; 在主题指数股票 ETF 基金中华夏金融 ETF 发起式排名第 11/257、华夏中证浙江国资创新发展 ETF 排名第 37/257、华夏中证细分食品饮料产业主题 ETF 排名第 40/257、华夏中证央企 ETF 排名第 47/257、华夏中证细分有色金属产业主题 ETF 排名第 67/257; 在主题指数股票 ETF 联接基金(A 类)中华夏中证浙江国资创新发展 ETF 联接(A 类)排名第 21/89、华夏中证央企 ETF 联接(A 类)排名第 27/89。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”, 成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。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“年度十大明星基金公司奖”评选中, 华夏基金成功获奖。此外, 华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动上, 华夏基金将三大金基金奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”; 产品层面, 华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”, 华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面, 2022 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; 养老专区升级, 为个人养老金账户的开立、充值及交易提供一站式服务, 提升客户整体操作感受; (3) 与兰州银行、晋商银行、成都银行、九州证券、瑞银基金销售等代销机构合作, 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”、“童言童语话理财”、“寻找代言人”、“成为首批 Y 星人”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	2020-01-20	-	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。
--	--	--	--	--	-----------------------------

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 基金经理薪酬机制

本基金管理人旗下基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的，不存在基金经理薪酬激励与其在管私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《华夏基金管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 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。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人一贯严格执行公平交易原则，对兼任基金经理的交易情况进行持续监测。本年度所有相关组合的交易行为均符合法规、制度和流程要求，未发现违反公平交易原则的情况。本年度同一基金经理管理的不同组合在邻近交易日的同向和反向交易，交易时机和交易价差均可合理解释，未发现异常。

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对

同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

4.3.3 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 113 次，其中 110 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 3 次为投资策略需要所致，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。

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国证半导体芯片指数。国证半导体芯片指数反映 A 股市场芯片产业中业务范畴属于材料、设备、设计、制造、封装和测试相关上市公司的市场表现，截至 2022 年 12 月 31 日，国证半导体芯片指数成份股 30 只。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。

2022 年，国际环境风高浪急，地缘政治冲突、疫情蔓延和能源食品危机等多重超预期因素冲击全球经济。美联储激进加息，在高通胀和高利率双重压力下，美国消费者支出减少，就业市场放缓；欧元区受到能源价格飙升的影响更加显著，核心通胀压力持续，对通胀预期上升的担忧超过了对经济衰退的恐惧；日本央行受困于国内需求疲软、经济复苏乏力，一直坚持超宽松货币政策。国内方面，在受到疫情散发多发、极端高温天气等多重超预期因素反复冲击的情况下，国民经济顶住压力持续发展，经济总量再上新台阶，经济增速仍快于多数主要经济体；随着稳经济一揽子政策和接续政策落地显效，消费规模持续扩大，投资关键作用有效发挥，净出口较快增长，三大需求共同发力；消费价格温和上涨，就业保持总体稳定。

市场方面，受全球流动性紧缩与风险事件冲击影响，A 股市场系统性估值调整，2022 年全年呈现“W”震荡回落走势。伴随市场风险偏好变化和地产、消费预期变化，A 股市场发生了多轮大小盘市值风格切换，但全年大小盘风格收益基本持平，大中小盘分化并不明显；金融、周期、消费、成长等行业风格轮番演绎，成长风格回撤较大。

基金投资运作方面，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、成份股调整和转融通证券出借等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，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包括中信证券股份有限公司、中国国际金融有限

公司、海通证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、广发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 12 月 31 日，本基金份额净值为 0.9983 元，本报告期份额净值增长率为-38.74%，同期业绩比较基准增长率-38.85%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.11%，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 2023 年，全球通胀将高位回落，经济复苏动能趋弱，增速预计低于 2022 年。激进加息后，美国经济存在下行风险；欧元区能源危机或仍将扰乱经济复苏步伐；日本经济料将勉强避免衰退并处于复苏通道；亚洲有望在经济前景回暖、基本面增强的支撑下吸引大量资本流入而大放异彩。国内方面，随着疫情防控优化措施逐步落实，生产生活秩序逐步回归常态，企业生产经营逐步改善，都将给 2023 年的经济增长创造更好的条件。

市场方面，2023 年是我国重新开放之年，面临的风险正在减弱，政策方面也在全力支持重启经济，科技和房地产等困境行业将会有更为宽松的环境，这将提升投资者对中国企业盈利复苏的信心，伴随经济回暖，中国 A 股有望引领新兴市场跑赢全球股票。

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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人持续加强合规管理、风险控制和监察稽核工作。在合规管理方面，公司通过合规审核、合规检查、合规咨询、合规宣传与合规培训等对合规风险进行管理，确保公司合规体系高效运行，合规风险有效控制。公司不断强化合规制度建设，在投资者适当性管理和员工投资行为合规管理等方面修订多项管理制度。持续强化合规队伍专业能力建设，提升合规人员解读政策法律、预判防控合规风险的能力。公司通过法律法规答题、合规培训、合规谈话等形式，多措并举厚植合规经营文化。公司严格落实信息披露法规要求，依法合规开展信息披露工作。在风险控制方面，公司秉承数字化管理理念，持续完善内部风险管理系统建设，稳步夯实投资风险管理基础。在严格管控基金日常投资运作风险的同时，持续完善风险管理制度建设，提升基金流动性风险、市场风险、合规风险、操作风险等关键风险的管控水平，努力保障各项风险管理措施落实到位。在监察稽核方面，公司定期和不定期开展内部稽核及离任审计工作，排查业务风险隐患，促进公司整体业务合规运作、稳健经营。

报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金合规稳健运作。

4.7 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。会计师事务所在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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

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

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 25648 号

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

6.1 审计意见

(一) 我们审计的内容

我们审计了华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏国证半导体芯片 ETF”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。

(二) 我们的意见

我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华夏国证半导体芯片 ETF 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。

按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华夏国证半导体芯片 ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。

6.3 管理层和治理层对财务报表的责任

华夏国证半导体芯片 ETF 的基金管理人华夏基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华夏国证半导体芯片 ETF 的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华夏国证半导体芯片 ETF、终止运营或别无其他现实的选择。

基金管理人治理层负责监督华夏国证半导体芯片 ETF 的财务报告过程。

6.4 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏国证半导体芯片 ETF 持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏国证半导体芯片 ETF 不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

朱宏宇 程红粤

上海市浦东新区东育路 588 号前滩中心 42 楼

2023 年 3 月 28 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	41,247,714.61	49,471,379.67
结算备付金		7,957,200.76	8,531,300.09
存出保证金		1,943,603.33	1,798,993.75
交易性金融资产	7.4.7.2	20,378,542,062.75	17,539,294,913.97
其中：股票投资		20,378,542,062.75	17,539,294,913.97
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		344,804,270.13	10,849,244.85
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	966,309.23	865,730.24
资产总计		20,775,461,160.81	17,610,811,562.57
负债和净资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		307,668,305.90	5,670,328.22
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,623,718.34	7,697,257.92
应付托管费		1,724,743.66	1,539,451.59
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		103,958.86	94,791.42
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	56,107,708.11	41,680,797.70
负债合计		374,228,434.87	56,682,626.85
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	20,435,563,006.00	10,771,363,006.00
未分配利润	7.4.7.8	-34,330,280.06	6,782,765,929.72
净资产合计		20,401,232,725.94	17,554,128,935.72

负债和净资产总计		20,775,461,160.81	17,610,811,562.57
----------	--	-------------------	-------------------

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9983 元，基金份额总额 20,435,563,006.00 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 年年度报告资产负债表中“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 年年度报告资产负债表“其他负债”项目的“上年度末”余额。

7.2 利润表

会计主体：华夏国证半导体芯片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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-8,526,095,144.89	6,097,881,180.45
1.利息收入		29,931,127.62	31,864,105.11
其中：存款利息收入	7.4.7.9	408,210.22	653,737.02
债券利息收入		-	6,743.18
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		9,438.36	33,710.96
证券出借利息收入		29,513,479.04	31,169,913.95
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,148,750,764.67	5,163,661,305.21
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-3,213,557,075.47	5,093,197,694.27
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	3,143,574.30	30,430,008.65
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	61,662,736.50	40,033,602.29
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-5,458,740,646.00	860,981,612.74
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	51,465,138.16	41,374,157.39
减：二、营业总支出		113,022,386.28	169,414,472.66
1.管理人报酬		89,423,632.71	92,854,499.88
2.托管费		17,884,726.51	18,570,899.93
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	7.4.7.17	-	-
7.税金及附加		106,256.26	99,885.52
8.其他费用	7.4.7.18	5,607,770.80	57,889,187.33
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,639,117,531.17	5,928,466,707.79
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,639,117,531.17	5,928,466,707.79
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-8,639,117,531.17	5,928,466,707.79

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 年年度报告利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在 2022 年年度报告利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏国证半导体芯片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 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	10,771,363,006.00	-	6,782,765,929.72	17,554,128,935.72
二、本期期初净资产（基金净值）	10,771,363,006.00	-	6,782,765,929.72	17,554,128,935.72
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	9,664,200,000.00	-	-6,817,096,209.78	2,847,103,790.22
（一）、综合收益总额	-	-	-8,639,117,531.17	-8,639,117,531.17
（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）	9,664,200,000.00	-	1,822,021,321.39	11,486,221,321.39
其中：1.基金申购款	23,485,000,000.00	-	4,400,269,513.86	27,885,269,513.86
2.基金赎回款	-13,820,800,000.00	-	-2,578,248,192.47	-16,399,048,192.47
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的	-	-	-	-

基金净值变动 (净值减少以“-” 号填列)				
四、本期期末净 资产(基金净 值)	20,435,563,006.00	-	-34,330,280.06	20,401,232,725.94
项目	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净 资产(基金净 值)	19,571,763,006.00	-	4,300,400,791.39	23,872,163,797.39
二、本期期初净 资产(基金净 值)	19,571,763,006.00	-	4,300,400,791.39	23,872,163,797.39
三、本期增减变 动额(减少以 “-”号填列)	-8,800,400,000.00	-	2,482,365,138.33	-6,318,034,861.67
(一)、综合收 益总额	-	-	5,928,466,707.79	5,928,466,707.79
(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)	-8,800,400,000.00	-	-3,446,101,569.46	-12,246,501,569.46
其中: 1.基金申 购款	25,467,400,000.00	-	10,622,383,067.69	36,089,783,067.69
2.基金赎 回款	-34,267,800,000.00	-	-14,068,484,637.15	-48,336,284,637.15
(三)、本期向 基金份额持有 人分配利润产 生的基金净值 变动(净值 减少以“-” 号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净 资产(基金净 值)	10,771,363,006.00	-	6,782,765,929.72	17,554,128,935.72

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4，财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019] 2662 号《关于准予华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，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》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏国证半导体芯片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 2019 年 12 月 24 日至 2020 年 1 月 14 日共募集 5,388,033,992.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337_A04 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 1 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 5,388,463,006.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 429,014.00 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，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本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（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与转融通证券出借业务。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》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 7.4.4 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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

1、金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时分类为：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。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

(1) 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益。基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、资产支持证券投资 and 基金投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

(2) 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

2、金融负债的分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付

款项等。

3、衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

1、金融资产的分类

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

本基金目前持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益。

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产

生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。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。

对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况。当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产。当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日

至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

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

II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

转融通证券出借业务中，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

针对基金合同约定费率和计算方法的费用，本基金在费用涵盖期间按合同约定进行确认。

其他以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的按直线法近似计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现收益的孰低数。基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1% 以上，方可进行收益分配。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票

投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

1、对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13 号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

2、对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

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》、《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14 号)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、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 49,471,379.67 元、8,531,300.09 元、1,798,993.75 元、865,730.24 元和 10,849,244.85 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 49,476,349.10 元、8,535,856.81 元、1,799,884.20 元、855,313.64 元和 10,849,244.85 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 17,539,294,913.97 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 17,539,294,913.97 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,670,328.22 元、7,697,257.92 元、1,539,451.59 元、10,075,998.63 元和 31,604,799.07 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,670,328.22 元、7,697,257.92 元、1,539,451.59 元、10,075,998.63 元和 31,604,799.07 元。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	41,247,714.61	49,471,379.67
等于：本金	41,242,642.10	49,471,379.67
加：应计利息	5,072.51	-
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	41,247,714.61	49,471,379.67

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	24,506,780,596.10	-	20,378,542,062.75	-4,128,238,533.35
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券 交 易 所 市	-	-	-	-

	场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	24,506,780,596.10	-	20,378,542,062.75	-4,128,238,533.35
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日				
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
	股票	16,208,792,801.32	-	17,539,294,913.97	1,330,502,112.65
	贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
	资产支持证券	-	-	-	-
	基金	-	-	-	-
	其他	-	-	-	-
	合计	16,208,792,801.32	-	17,539,294,913.97	1,330,502,112.65

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。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	865,730.24
其他应收款	966,309.23	-

待摊费用	-	-
合计	966,309.23	865,730.24

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	9,768,980.77	10,075,998.63
其中：交易所市场	9,768,980.77	10,075,998.63
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	240,000.00	130,000.00
应付指数使用费	4,132,954.54	4,020,134.28
应退替代款	41,905,600.52	27,431,661.99
可退替代款	60,172.28	23,002.80
合计	56,107,708.11	41,680,797.70

7.4.7.7 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 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,771,363,006.00	10,771,363,006.00
本期申购	23,485,000,000.00	23,485,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-13,820,800,000.00	-13,820,800,000.00
本期末	20,435,563,006.00	20,435,563,006.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,834,022,678.06	-51,256,748.34	6,782,765,929.72
本期利润	-3,180,376,885.17	-5,458,740,646.00	-8,639,117,531.17
本期基金份额交易产生的变动数	5,056,386,662.31	-3,234,365,340.92	1,822,021,321.39
其中：基金申购款	12,287,632,993.36	-7,887,363,479.50	4,400,269,513.86
基金赎回款	-7,231,246,331.05	4,652,998,138.58	-2,578,248,192.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,710,032,455.20	-8,744,362,735.26	-34,330,280.06

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

活期存款利息收入	169,634.59	257,694.85
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	210,469.29	346,913.57
其他	28,106.34	49,128.60
合计	408,210.22	653,737.02

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-2,742,932,051.95	1,742,306,580.85
股票投资收益——赎回差价收入	-470,625,023.52	3,350,891,113.42
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	-3,213,557,075.47	5,093,197,694.27

7.4.7.10.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	14,192,946,578.06	26,973,429,763.96
减：卖出股票成本总额	16,904,760,153.14	25,231,123,183.11
减：交易费用	31,118,476.87	-
买卖股票差价收入	-2,742,932,051.95	1,742,306,580.85

7.4.7.10.3 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	16,399,048,192.47	48,336,284,637.15
减：现金支付赎回款总额	8,288,461,227.47	23,612,703,950.15
减：赎回股票成本总额	8,581,211,988.52	21,372,689,573.58
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-470,625,023.52	3,350,891,113.42

7.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

7.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
债券投资收益——利息收入	1,792.44	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差 价收入	3,141,781.86	30,430,008.65
债券投资收益——赎回差价收 入	-	-
债券投资收益——申购差价收 入	-	-
合计	3,143,574.30	30,430,008.65

7.4.7.11.2 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券(债转股及债券到期 兑付)成交总额	14,375,202.73	94,936,422.50
减: 卖出债券(债转股及债券 到期兑付)成本总额	11,231,000.00	64,499,200.00
减: 应计利息总额	1,846.19	7,213.85
减: 交易费用	574.68	-
买卖债券差价收入	3,141,781.86	30,430,008.65

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
股票投资产生的股利收益	61,662,736.50	40,033,602.29
其中: 证券出借权益补偿收入	3,904,615.27	5,427,917.95

基金投资产生的股利收益	-	-
合计	61,662,736.50	40,033,602.29

7.4.7.15 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12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-5,458,740,646.00	860,981,612.74
——股票投资	-5,458,740,646.00	860,981,612.74
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-5,458,740,646.00	860,981,612.74

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	51,465,138.16	41,374,157.39
合计	51,465,138.16	41,374,157.39

7.4.7.17 信用减值损失

无。

7.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
审计费用	120,000.00	130,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	2,352.82	19,426.65
指数使用费	5,365,417.98	5,571,270.00
其他	-	52,048,490.68
合计	5,607,770.80	57,889,187.33

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
中国建设银行股份有限公司（“中国建设银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏国证半导体芯片 ETF 联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：①根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	14,355,992,373.82	41.64%	2,239,371,327.08	4.66%

7.4.10.1.2 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	14,375,202.73	100.00%	34,531,672.80	36.37%

7.4.10.1.3 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12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31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	36.36%

7.4.10.1.4 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	6,194,308.24	44.32%	840,524.02	8.60%
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	966,278.19	4.66%	564,846.77	5.61%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	89,423,632.71	92,854,499.88
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	17,884,726.51	18,570,899.93

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。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	3,072,392,982.70	2,425,915.50	165,708,907.00	82,421.39
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
中信证券	6,716,251,494.11	7,449,345.35	313,693,438.00	294,692.04

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位：)	出借期限 (单位：)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末利息
中信证券	2022010400000920	捷捷微电	2022-01-04	4,995,200.00	160,000.00	14	3.60	6,993.28	-	
中信证券	2022010400000927	上海新阳	2022-01-04	2,971,400.00	71,600.00	14	3.10	3,582.19	-	
中信证券	2022010400021253	北京君正	2022-01-04	3,123,750.00	24,500.00	14	3.60	4,373.25	-	
中信	2022010400021255	上海	2022-01-04	2,377,950.00	57,300.00	14	3.40	3,144.18	-	

证 券		新 阳									
中 信 证 券	2022010400021257	卓 胜 微	2022- 01-04	2,004,460.00	6,100.00	14	2.80	2,182.63	-		
中 信 证 券	2022010400021259	景 嘉 微	2022- 01-04	16,431,240.00	108,500.00	14	3.60	23,003.74	-		
中 信 证 券	2022010400021261	景 嘉 微	2022- 01-04	3,786,000.00	25,000.00	14	3.60	5,300.40	-		
中 信 证 券	2022010400021263	捷 捷 微 电	2022- 01-04	4,558,120.00	146,000.00	14	3.70	6,558.63	-		
中 信 证 券	2022010400021265	北 京 君 正	2022- 01-04	5,865,000.00	46,000.00	14	3.60	8,211.00	-		
中 信 证 券	2022010400021267	扬 杰 科 技	2022- 01-04	2,459,020.00	37,000.00	14	3.40	3,251.37	-		
中 信 证 券	2022010400021269	扬 杰 科 技	2022- 01-04	1,129,820.00	17,000.00	14	3.40	1,493.87	-		
中 信 证 券	2022010600000417	卓 胜 微	2022- 01-06	2,191,000.00	7,000.00	14	1.80	1,533.70	-		
中 信 证 券	2022010600001226	北 京 君 正	2022- 01-06	3,035,500.00	25,000.00	14	3.60	4,249.70	-		
中 信 证 券	2022010600010017	卓 胜 微	2022- 01-06	6,260,000.00	20,000.00	14	1.90	4,625.44	-		
中 信 证 券	2022010600010023	南 大 光 电	2022- 01-06	2,562,000.00	56,000.00	14	3.70	3,686.43	-		
中 信 证 券	2022010600010025	北 京 君 正	2022- 01-06	1,214,200.00	10,000.00	14	3.60	1,699.88	-		
中 信 证 券	2022010600010027	北 京 君 正	2022- 01-06	6,435,260.00	53,000.00	14	3.60	9,009.36	-		

信 证 券		京 君 正	01-06								
中 信 证 券	2022010600010029	扬 杰 科 技	2022-01-06	2,562,800.00	40,000.00	14	3.40	3,388.59	-		
中 信 证 券	2022010600010031	全 志 科 技	2022-01-06	1,261,050.00	21,000.00	14	3.40	1,667.39	-		
中 信 证 券	2022010700010623	南 大 光 电	2022-01-07	6,736,500.00	150,000.00	14	3.70	9,693.08	-		
中 信 证 券	2022011000010797	北 京 君 正	2022-01-10	12,227,241.00	113,100.00	14	3.60	17,118.14	-		
中 信 证 券	2022011100001447	上 海 新 阳	2022-01-11	3,403,400.00	85,000.00	14	3.20	4,235.34	-		
中 信 证 券	2022011100012125	景 嘉 微	2022-01-11	1,748,600.00	14,000.00	14	3.40	2,312.04	-		
中 信 证 券	2022011100012127	上 海 新 阳	2022-01-11	120,120.00	3,000.00	14	3.10	144.81	-		
中 信 证 券	2022011100012129	捷 捷 微 电	2022-01-11	1,653,696.00	57,600.00	14	3.60	2,315.17	-		
中 信 证 券	2022011100012131	南 大 光 电	2022-01-11	2,423,160.00	53,000.00	14	3.80	3,580.89	-		
中 信 证 券	2022011100012133	上 海 新 阳	2022-01-11	1,721,720.00	43,000.00	14	3.10	2,075.63	-		
中 信 证 券	2022011100012135	扬 杰 科 技	2022-01-11	2,316,600.00	39,000.00	14	3.40	3,063.06	-		
中 信 证 券	2022011100012137	全 志 科 技	2022-01-11	599,500.00	10,000.00	14	3.10	722.73	-		

中信证券	2022011200015813	北京君正	2022-01-12	4,125,050.00	39,100.00	14	3.60	5,775.07	-	
中信证券	2022011200015815	捷捷微电	2022-01-12	1,838,865.00	63,300.00	14	3.60	2,574.41	-	
中信证券	2022011300001161	圣邦股份	2022-01-13	1,907,990.00	7,000.00	14	2.60	1,929.19	-	
中信证券	2022011300009822	全志科技	2022-01-13	5,880,000.00	100,000.00	14	3.10	7,088.67	-	
中信证券	2022011300009824	北京君正	2022-01-13	716,100.00	7,000.00	14	3.50	974.69	-	
中信证券	2022011300009826	上海新阳	2022-01-13	1,955,590.00	49,000.00	14	3.20	2,433.62	-	
中信证券	2022011300009828	捷捷微电	2022-01-13	1,837,976.00	64,400.00	14	3.70	2,644.64	-	
中信证券	2022011300009830	上海新阳	2022-01-13	1,756,040.00	44,000.00	14	3.20	2,185.29	-	
中信证券	2022011300009832	全志科技	2022-01-13	1,911,000.00	32,500.00	14	3.10	2,303.82	-	
中信证券	2022011300009834	南大光电	2022-01-13	2,340,520.00	52,000.00	14	3.50	3,185.71	-	
中信证券	2022011300009836	上海新阳	2022-01-13	2,286,843.00	57,300.00	14	3.20	2,845.85	-	
中信证券	2022011300009838	南大光电	2022-01-13	4,501,000.00	100,000.00	14	3.50	6,126.36	-	
中信证	2022011300011598	捷捷微	2022-01-13	4,109,760.00	144,000.00	14	3.60	5,753.66	-	

券		电								
中信证	2022011300011600	扬杰科技	2022-01-13	2,316,400.00	40,000.00	14	3.40	3,062.80	-	
券		南								
中信证	2022011400020850	大光电	2022-01-14	2,267,000.00	50,000.00	14	3.50	3,085.64	-	
券		景								
中信证	2022011400020852	嘉微	2022-01-14	2,060,400.00	17,000.00	14	3.30	2,644.18	-	
券		全								
中信证	2022011400020854	志科技	2022-01-14	947,322.00	15,900.00	14	3.10	1,142.05	-	
券		南								
中信证	2022011400020856	大光电	2022-01-14	2,316,874.00	51,100.00	14	3.50	3,153.52	-	
券		扬								
中信证	2022011400023514	杰科技	2022-01-14	1,749,789.00	28,300.00	14	3.40	2,313.61	-	
券		北								
中信证	2022011400023516	京君正	2022-01-14	4,117,230.00	39,100.00	14	3.60	5,764.12	-	
券		扬								
中信证	2022011400023518	杰科技	2022-01-14	1,811,619.00	29,300.00	14	3.40	2,395.36	-	
券		晶								
中信证	2022011400023524	盛机电	2022-01-14	153,125.00	2,500.00	14	1.80	107.19	-	
券		晶								
中信证	2022011800001346	盛机电	2022-01-18	687,170.00	11,000.00	14	3.20	1,221.63	-	
券		捷								
中信证	2022011800001366	捷微电	2022-01-18	207,200.00	7,000.00	28	3.40	547.93	-	
券		捷								
中信证	2022011800025772	捷微电	2022-01-18	4,321,600.00	146,000.00	14	3.70	8,883.29	-	
券		扬								
中信	2022011800025774	杰	2022-01-18	1,097,690.00	17,000.00	14	3.30	2,012.43	-	

证券		科技								
中信证券	2022011800025776	扬杰科技	2022-01-18	3,615,920.00	56,000.00	28	3.20	8,999.62	-	
中信证券	2022011800025778	捷捷微电	2022-01-18	4,736,000.00	160,000.00	14	3.70	9,735.11	-	
中信证券	2022011800025780	扬杰科技	2022-01-18	2,389,090.00	37,000.00	14	3.30	4,380.00	-	
中信证券	2022011800025782	北京君正	2022-01-18	2,756,740.00	24,500.00	14	3.50	5,360.33	-	
中信证券	2022011800025784	北京君正	2022-01-18	5,175,920.00	46,000.00	14	3.50	10,064.29	-	
中信证券	2022011800025786	卓胜微	2022-01-18	1,778,150.00	6,100.00	14	2.60	2,568.44	-	
中信证券	2022011800025788	上海新阳	2022-01-18	2,330,964.00	57,300.00	14	3.20	4,143.94	-	
中信证券	2022011800025790	上海新阳	2022-01-18	2,912,688.00	71,600.00	14	3.20	5,178.11	-	
中信证券	2022011800025792	景嘉微	2022-01-18	13,778,415.00	108,500.00	14	3.30	25,260.43	-	
中信证券	2022011800025794	景嘉微	2022-01-18	3,174,750.00	25,000.00	14	3.30	5,820.37	-	
中信证券	2022012000009798	扬杰科技	2022-01-20	2,572,800.00	40,000.00	14	3.30	4,245.12	-	
中信证券	2022012000009800	北京君正	2022-01-20	1,117,600.00	10,000.00	14	3.50	1,955.80	-	
中	2022012000009806	北	2022-	2,794,000.00	25,000.00	14	3.50	4,889.50	-	

信 证 券		京 君 正	01-20								
中 信 证 券	2022012000009810	北 京 君 正	2022- 01-20	5,923,280.00	53,000.00	14	3.50	10,365.74	-		
中 信 证 券	2022012000009812	全 志 科 技	2022- 01-20	1,232,910.00	21,000.00	14	3.10	1,911.01	-		
中 信 证 券	2022012000009814	南 大 光 电	2022- 01-20	2,454,480.00	56,000.00	14	3.50	4,295.34	-		
中 信 证 券	2022012000009894	卓 胜 微	2022- 01-20	5,374,200.00	20,000.00	14	1.90	5,105.49	-		
中 信 证 券	2022012000011210	卓 胜 微	2022- 01-20	1,880,970.00	7,000.00	14	1.80	1,692.87	-		
中 信 证 券	2022012100011688	南 大 光 电	2022- 01-21	6,394,500.00	150,000.00	14	3.50	10,568.69	-		
中 信 证 券	2022012400010304	北 京 君 正	2022- 01-24	12,979,356.00	113,100.00	14	2.90	14,637.83	-		
中 信 证 券	2022012500010204	全 志 科 技	2022- 01-25	552,500.00	10,000.00	14	3.30	709.04	-		
中 信 证 券	2022012500010206	景 嘉 微	2022- 01-25	1,627,220.00	14,000.00	14	3.10	1,961.70	-		
中 信 证 券	2022012500010208	全 志 科 技	2022- 01-25	337,025.00	6,100.00	28	3.20	838.82	-		
中 信 证 券	2022012500010210	扬 杰 科 技	2022- 01-25	2,536,170.00	39,000.00	14	3.30	3,254.75	-		
中 信 证 券	2022012500010212	捷 捷 微 电	2022- 01-25	1,535,616.00	57,600.00	14	3.50	2,090.14	-		

中信证券	2022012500010214	上海新阳	2022-01-25	114,120.00	3,000.00	14	3.30	146.45	-	
中信证券	2022012500010218	南大光电	2022-01-25	2,231,300.00	53,000.00	14	3.50	3,037.05	-	
中信证券	2022012500010220	上海新阳	2022-01-25	1,635,720.00	43,000.00	14	3.30	2,099.17	-	
中信证券	2022012500010222	上海新阳	2022-01-25	3,233,400.00	85,000.00	14	3.30	4,149.53	-	
中信证券	2022012600010236	全志科技	2022-01-26	206,423.00	3,700.00	28	3.20	513.76	-	
中信证券	2022012600010258	捷捷微电	2022-01-26	1,716,063.00	63,300.00	14	3.50	2,335.75	-	
中信证券	2022012600010282	北京君正	2022-01-26	4,541,465.00	39,100.00	14	2.90	5,121.76	-	
中信证券	2022012700000924	北京君正	2022-01-27	1,348,920.00	12,000.00	14	3.10	1,626.20	-	
中信证券	2022012700011441	上海新阳	2022-01-27	2,086,866.00	57,300.00	14	3.30	2,678.14	-	
中信证券	2022012700011443	南大光电	2022-01-27	2,100,800.00	52,000.00	14	3.50	2,859.42	-	
中信证券	2022012700011445	南大光电	2022-01-27	4,040,000.00	100,000.00	14	3.50	5,498.89	-	
中信证券	2022012700011447	全志科技	2022-01-27	1,725,425.00	32,500.00	14	3.30	2,214.30	-	
中信证	2022012700011449	捷捷微	2022-01-27	3,808,800.00	144,000.00	14	3.50	5,184.20	-	

券		电								
中信证券	2022012700011451	上海新阳	2022-01-27	1,602,480.00	44,000.00	14	3.30	2,056.52	-	
中信证券	2022012700011453	北京君正	2022-01-27	786,870.00	7,000.00	14	2.90	887.41	-	
中信证券	2022012700011455	上海新阳	2022-01-27	1,784,580.00	49,000.00	14	3.30	2,290.21	-	
中信证券	2022012700011457	全志科技	2022-01-27	5,309,000.00	100,000.00	14	3.30	6,813.22	-	
中信证券	2022012700011459	扬杰科技	2022-01-27	2,532,000.00	40,000.00	14	3.30	3,249.40	-	
中信证券	2022012700011461	捷捷微电	2022-01-27	1,703,380.00	64,400.00	14	3.50	2,318.49	-	
中信证券	2022012700011463	圣邦股份	2022-01-27	1,976,800.00	7,000.00	14	2.90	2,229.39	-	
中信证券	2022012800022104	北京君正	2022-01-28	4,257,990.00	39,100.00	14	2.90	4,802.07	-	
中信证券	2022012800022106	南大光电	2022-01-28	2,106,342.00	51,100.00	14	3.50	2,866.97	-	
中信证券	2022012800022108	南大光电	2022-01-28	2,061,000.00	50,000.00	14	3.50	2,805.25	-	
中信证券	2022012800022110	景嘉微	2022-01-28	1,923,720.00	17,000.00	14	3.10	2,319.15	-	
中信证券	2022012800022152	扬杰科技	2022-01-28	1,743,846.00	28,300.00	14	3.30	2,237.94	-	
中信	2022012800022154	全志	2022-01-28	826,800.00	15,900.00	14	3.30	1,061.06	-	

证 券		科 技									
中 信 证 券	2022012800022182	晶 盛 机 电	2022- 01-28	143,225.00	2,500.00	14	1.80	100.26	-		
中 信 证 券	2022020700047157	卓 胜 微	2022- 02-07	1,835,540.00	7,000.00	14	1.80	1,284.88	-		
中 信 证 券	2022020700047165	卓 胜 微	2022- 02-07	5,244,400.00	20,000.00	14	1.90	3,875.03	-		
中 信 证 券	2022020700055433	南 大 光 电	2022- 02-07	2,316,160.00	56,000.00	14	3.50	3,152.55	-		
中 信 证 券	2022020700055435	景 嘉 微	2022- 02-07	12,318,005.00	108,500.00	14	3.50	16,766.17	-		
中 信 证 券	2022020700055437	全 志 科 技	2022- 02-07	1,106,700.00	21,000.00	14	3.40	1,463.30	-		
中 信 证 券	2022020700055439	景 嘉 微	2022- 02-07	2,838,250.00	25,000.00	14	3.50	3,863.17	-		
中 信 证 券	2022020700055441	上 海 新 阳	2022- 02-07	2,157,345.00	57,300.00	14	3.40	2,852.49	-		
中 信 证 券	2022020700055443	北 京 君 正	2022- 02-07	2,678,830.00	24,500.00	14	3.10	3,229.48	-		
中 信 证 券	2022020700055445	卓 胜 微	2022- 02-07	1,599,542.00	6,100.00	14	2.90	1,803.93	-		
中 信 证 券	2022020700055447	捷 捷 微 电	2022- 02-07	3,978,500.00	146,000.00	14	7.60	11,758.68	-		
中 信 证 券	2022020700055449	北 京 君 正	2022- 02-07	5,029,640.00	46,000.00	14	3.10	6,063.51	-		
中 信 证 券	2022020700055451	扬 州	2022-	1,048,390.00	17,000.00	14	3.30	1,345.43	-		

信 证 券		杰 科 技	02-07								
中 信 证 券	2022020700055453	扬 杰 科 技	2022- 02-07	2,466,800.00	40,000.00	14	3.30	3,165.73	-		
中 信 证 券	2022020700055455	北 京 君 正	2022- 02-07	5,795,020.00	53,000.00	14	3.10	6,986.22	-		
中 信 证 券	2022020700055457	北 京 君 正	2022- 02-07	1,093,400.00	10,000.00	14	3.10	1,318.15	-		
中 信 证 券	2022020700055459	扬 杰 科 技	2022- 02-07	2,281,790.00	37,000.00	14	3.30	2,928.30	-		
中 信 证 券	2022020700055461	北 京 君 正	2022- 02-07	12,366,354.00	113,100.00	14	3.10	14,908.33	-		
中 信 证 券	2022020700055463	晶 盛 机 电	2022- 02-07	653,730.00	11,000.00	14	3.10	788.11	-		
中 信 证 券	2022020700055465	南 大 光 电	2022- 02-07	6,204,000.00	150,000.00	14	3.50	8,444.33	-		
中 信 证 券	2022020700055467	北 京 君 正	2022- 02-07	2,733,500.00	25,000.00	14	3.10	3,295.39	-		
中 信 证 券	2022020700055469	捷 捷 微 电	2022- 02-07	4,360,000.00	160,000.00	14	7.60	12,886.22	-		
中 信 证 券	2022020700055471	上 海 新 阳	2022- 02-07	2,695,740.00	71,600.00	14	3.40	3,564.37	-		
中 信 证 券	2022020800002208	南 大 光 电	2022- 02-08	1,002,480.00	24,000.00	28	3.00	2,339.12	-		
中 信 证 券	2022020800002213	北 京 君 正	2022- 02-08	2,118,600.00	20,000.00	14	3.40	2,801.26	-		

中信证券	2022020800002265	卓胜微	2022-02-08	256,270.00	1,000.00	14	1.90	189.36	-	
中信证券	2022020800002297	捷捷微电	2022-02-08	1,045,980.00	39,000.00	14	7.10	2,888.07	-	
中信证券	2022020800013652	捷捷微电	2022-02-08	1,544,832.00	57,600.00	14	7.60	4,565.84	-	
中信证券	2022020800013654	景嘉微	2022-02-08	1,577,940.00	14,000.00	14	3.50	2,147.75	-	
中信证券	2022020800013656	扬杰科技	2022-02-08	2,328,300.00	39,000.00	14	3.30	2,987.99	-	
中信证券	2022020800013658	上海新阳	2022-02-08	112,410.00	3,000.00	14	3.40	148.63	-	
中信证券	2022020800013660	上海新阳	2022-02-08	1,611,210.00	43,000.00	14	3.40	2,130.38	-	
中信证券	2022020800013662	上海新阳	2022-02-08	3,184,950.00	85,000.00	14	3.40	4,211.21	-	
中信证券	2022020800013664	南大光电	2022-02-08	2,213,810.00	53,000.00	14	3.50	3,013.24	-	
中信证券	2022020800013666	全志科技	2022-02-08	530,000.00	10,000.00	14	3.40	700.78	-	
中信证券	2022020900018018	捷捷微电	2022-02-09	1,731,255.00	63,300.00	14	7.60	5,116.82	-	
中信证券	2022020900018020	北京君正	2022-02-09	4,227,883.00	39,100.00	14	3.10	5,096.95	-	
中信证	2022021000001527	扬杰科	2022-02-10	1,998,756.00	32,400.00	14	3.70	2,875.99	-	

券		技								
中信证券	2022021000013462	全志科技	2022-02-10	1,740,375.00	32,500.00	14	3.40	2,301.16	-	
中信证券	2022021000013464	捷捷微电	2022-02-10	3,925,440.00	144,000.00	14	7.60	11,601.86	-	
中信证券	2022021000013466	捷捷微电	2022-02-10	1,755,544.00	64,400.00	14	7.60	5,188.61	-	
中信证券	2022021000013468	圣邦股份	2022-02-10	2,134,300.00	7,000.00	14	2.70	2,241.02	-	
中信证券	2022021000013470	全志科技	2022-02-10	5,355,000.00	100,000.00	14	3.40	7,080.50	-	
中信证券	2022021000013472	扬杰科技	2022-02-10	2,467,600.00	40,000.00	14	3.30	3,166.75	-	
中信证券	2022021000013474	北京君正	2022-02-10	744,100.00	7,000.00	14	3.10	897.05	-	
中信证券	2022021000013476	南大光电	2022-02-10	2,194,400.00	52,000.00	14	3.50	2,986.82	-	
中信证券	2022021000013478	南大光电	2022-02-10	4,220,000.00	100,000.00	14	3.50	5,743.89	-	
中信证券	2022021000013480	北京君正	2022-02-10	1,275,600.00	12,000.00	14	3.10	1,537.81	-	
中信证券	2022021000013482	上海新阳	2022-02-10	2,177,400.00	57,300.00	14	3.40	2,879.01	-	
中信证券	2022021000013484	上海新阳	2022-02-10	1,862,000.00	49,000.00	14	3.40	2,461.98	-	
中信	2022021000013486	上海	2022-02-10	1,672,000.00	44,000.00	14	3.40	2,210.76	-	

证 券		新 阳								
中 信 证 券	2022021100020192	晶 盛 机 电	2022- 02-11	135,100.00	2,500.00	14	1.80	94.57	-	
中 信 证 券	2022021100020216	南 大 光 电	2022- 02-11	2,047,500.00	50,000.00	14	3.10	2,468.38	-	
中 信 证 券	2022021100020218	景 嘉 微	2022- 02-11	1,815,430.00	17,000.00	14	2.10	1,482.60	-	
中 信 证 券	2022021100020222	南 大 光 电	2022- 02-11	2,092,545.00	51,100.00	14	3.10	2,522.68	-	
中 信 证 券	2022021100020224	扬 杰 科 技	2022- 02-11	1,683,001.00	28,300.00	14	3.70	2,421.65	-	
中 信 证 券	2022021100020226	北 京 君 正	2022- 02-11	4,078,912.00	39,100.00	14	3.40	5,393.23	-	
中 信 证 券	2022021100020228	全 志 科 技	2022- 02-11	829,980.00	15,900.00	14	3.40	1,097.42	-	
中 信 证 券	2022021500007673	捷 捷 微 电	2022- 02-15	187,670.00	7,000.00	28	7.00	1,021.76	-	
中 信 证 券	2022021700001214	北 京 君 正	2022- 02-17	2,069,480.00	19,000.00	14	3.40	2,736.31	-	
中 信 证 券	2022022100038033	卓 胜 微	2022- 02-21	1,753,990.00	7,000.00	14	1.80	1,227.79	-	
中 信 证 券	2022022100042847	上 海 新 阳	2022- 02-21	2,809,584.00	71,600.00	14	3.70	4,042.68	-	
中 信 证 券	2022022100042849	北 京 君 正	2022- 02-21	2,562,500.00	25,000.00	14	3.40	3,388.19	-	
中 信 证 券	2022022100042851	捷 捷 微 电	2022-	4,376,000.00	160,000.00	14	7.10	12,082.62	-	

信 证 券		捷 微 电	02-21								
中 信 证 券	2022022100042853	晶 盛 机 电	2022- 02-21	630,410.00	11,000.00	14	2.10	514.83	-		
中 信 证 券	2022022100042855	捷 捷 微 电	2022- 02-21	3,993,100.00	146,000.00	14	7.10	11,025.39	-		
中 信 证 券	2022022100042857	上 海 新 阳	2022- 02-21	2,248,452.00	57,300.00	14	3.70	3,235.27	-		
中 信 证 券	2022022100042859	南 大 光 电	2022- 02-21	6,177,000.00	150,000.00	14	3.10	7,446.72	-		
中 信 证 券	2022022100042861	北 京 君 正	2022- 02-21	11,592,750.00	113,100.00	14	3.40	15,328.19	-		
中 信 证 券	2022022100042865	扬 杰 科 技	2022- 02-21	2,326,400.00	40,000.00	14	3.70	3,347.43	-		
中 信 证 券	2022022100042867	扬 杰 科 技	2022- 02-21	988,720.00	17,000.00	14	3.70	1,422.66	-		
中 信 证 券	2022022100042869	景 嘉 微	2022- 02-21	12,134,640.00	108,500.00	14	2.10	9,909.96	-		
中 信 证 券	2022022100042871	北 京 君 正	2022- 02-21	2,511,250.00	24,500.00	14	3.40	3,320.43	-		
中 信 证 券	2022022100042873	卓 胜 微	2022- 02-21	1,528,477.00	6,100.00	14	1.90	1,129.37	-		
中 信 证 券	2022022100042875	南 大 光 电	2022- 02-21	2,306,080.00	56,000.00	14	3.10	2,780.11	-		
中 信 证 券	2022022100042877	北 京 君 正	2022- 02-21	4,715,000.00	46,000.00	14	3.40	6,234.28	-		

中信证券	2022022100042879	北京君正	2022-02-21	1,025,000.00	10,000.00	14	3.40	1,355.28	-	
中信证券	2022022100042881	北京君正	2022-02-21	5,432,500.00	53,000.00	14	3.40	7,182.97	-	
中信证券	2022022100042883	扬杰科技	2022-02-21	2,151,920.00	37,000.00	14	3.70	3,096.37	-	
中信证券	2022022100045467	卓胜微	2022-02-21	5,011,400.00	20,000.00	14	1.90	3,702.87	-	
中信证券	2022022200001288	扬杰科技	2022-02-22	971,360.00	16,000.00	14	3.30	1,246.58	-	
中信证券	2022022200011981	上海新阳	2022-02-22	3,303,950.00	85,000.00	14	3.70	4,754.02	-	
中信证券	2022022200011983	北京君正	2022-02-22	2,065,000.00	20,000.00	14	3.40	2,730.39	-	
中信证券	2022022200011985	卓胜微	2022-02-22	244,210.00	1,000.00	14	1.90	180.44	-	
中信证券	2022022200011987	捷捷微电子	2022-02-22	1,557,504.00	57,600.00	14	7.10	4,300.44	-	
中信证券	2022022200011989	南大光电	2022-02-22	2,187,840.00	53,000.00	14	3.10	2,637.56	-	
中信证券	2022022200011991	捷捷微电子	2022-02-22	1,054,560.00	39,000.00	14	7.10	2,911.76	-	
中信证券	2022022200011993	扬杰科技	2022-02-22	2,367,690.00	39,000.00	14	3.70	3,406.84	-	
中信证	2022022200011995	上海新	2022-02-22	1,671,410.00	43,000.00	14	3.70	2,404.97	-	

券		阳								
中信证券	2022022200011997	上海新阳	2022-02-22	116,610.00	3,000.00	14	3.70	167.79	-	
中信证券	2022022200011999	景嘉微	2022-02-22	1,526,840.00	14,000.00	14	2.10	1,246.92	-	
中信证券	2022022300013400	全志科技	2022-02-23	203,685.00	3,700.00	28	3.30	522.79	-	
中信证券	2022022300013402	北京君正	2022-02-23	4,414,390.00	39,100.00	14	3.40	5,836.80	-	
中信证券	2022022300013404	捷捷微电	2022-02-23	1,846,461.00	63,300.00	14	7.10	5,098.28	-	
中信证券	2022022400000794	扬杰科技	2022-02-24	1,964,700.00	30,000.00	14	3.30	2,521.37	-	
中信证券	2022022400012437	捷捷微电	2022-02-24	1,802,556.00	64,400.00	14	7.60	5,327.55	-	
中信证券	2022022400012439	捷捷微电	2022-02-24	4,030,560.00	144,000.00	14	7.60	11,912.54	-	
中信证券	2022022400012443	南大光电	2022-02-24	2,288,520.00	52,000.00	14	3.50	3,114.93	-	
中信证券	2022022400012445	上海新阳	2022-02-24	1,931,090.00	49,000.00	14	3.70	2,778.62	-	
中信证券	2022022400012447	上海新阳	2022-02-24	1,734,040.00	44,000.00	14	3.70	2,495.09	-	
中信证券	2022022400012449	全志科技	2022-02-24	5,305,000.00	100,000.00	14	3.40	7,014.39	-	
中信	2022022400012451	南大	2022-02-24	4,401,000.00	100,000.00	14	3.50	5,990.25	-	

证 券		光 电								
中 信 证 券	2022022400012453	北 京 君 正	2022- 02-24	1,316,520.00	12,000.00	14	3.40	1,740.73	-	
中 信 证 券	2022022400012455	扬 杰 科 技	2022- 02-24	2,121,876.00	32,400.00	14	3.30	2,723.07	-	
中 信 证 券	2022022400012457	圣 邦 股 份	2022- 02-24	2,375,100.00	7,000.00	14	3.00	2,770.95	-	
中 信 证 券	2022022400012459	扬 杰 科 技	2022- 02-24	2,619,600.00	40,000.00	14	3.30	3,361.82	-	
中 信 证 券	2022022400012461	北 京 君 正	2022- 02-24	767,970.00	7,000.00	14	3.40	1,015.43	-	
中 信 证 券	2022022500017915	晶 盛 机 电	2022- 02-25	159,000.00	2,500.00	14	1.80	111.30	-	
中 信 证 券	2022022500017923	南 大 光 电	2022- 02-25	2,242,779.00	51,100.00	14	3.50	3,052.67	-	
中 信 证 券	2022022500017927	扬 杰 科 技	2022- 02-25	1,913,080.00	28,300.00	14	3.30	2,455.12	-	
中 信 证 券	2022022500017929	北 京 君 正	2022- 02-25	4,375,290.00	39,100.00	14	3.40	5,785.11	-	
中 信 证 券	2022022500017931	景 嘉 微	2022- 02-25	2,125,000.00	17,000.00	14	3.10	2,561.81	-	
中 信 证 券	2022030100001260	北 京 君 正	2022- 03-01	236,670.00	2,100.00	14	3.40	312.93	-	
中 信 证 券	2022030100001270	全 志 科 技	2022- 03-01	4,133,640.00	74,000.00	14	2.20	3,536.56	-	
中 信 证 券	2022030100001278	南 大 光 电	2022- 03-01	834,670.00	19,000.00	14	3.50	1,136.08	-	

信 证 券		大 光 电	03-01								
中 信 证 券	2022030100001285	景 嘉 微	2022- 03-01	846,300.00	7,000.00	14	2.60	855.70	-		
中 信 证 券	2022030100001323	捷 捷 微 电	2022- 03-01	2,347,240.00	83,000.00	14	7.60	6,937.40	-		
中 信 证 券	2022030300001514	南 大 光 电	2022- 03-03	4,367,200.00	103,000.00	14	3.50	5,944.24	-		
中 信 证 券	2022030300001523	卓 胜 微	2022- 03-03	9,644,635.00	38,500.00	14	3.20	12,002.21	-		
中 信 证 券	2022030300004194	北 京 君 正	2022- 03-03	1,994,050.00	19,000.00	14	3.20	2,481.48	-		
中 信 证 券	2022030700033578	卓 胜 微	2022- 03-07	1,677,200.00	7,000.00	14	1.80	1,174.04	-		
中 信 证 券	2022030700033798	南 大 光 电	2022- 03-07	2,290,400.00	56,000.00	14	3.50	3,117.49	-		
中 信 证 券	2022030700033800	卓 胜 微	2022- 03-07	1,461,560.00	6,100.00	14	3.20	1,818.83	-		
中 信 证 券	2022030700033802	景 嘉 微	2022- 03-07	12,369,000.00	108,500.00	14	2.60	12,506.43	-		
中 信 证 券	2022030700033804	扬 杰 科 技	2022- 03-07	2,434,600.00	37,000.00	14	3.40	3,219.08	-		
中 信 证 券	2022030700033806	北 京 君 正	2022- 03-07	5,512,000.00	53,000.00	14	3.40	7,288.09	-		
中 信 证 券	2022030700033808	北 京 君 正	2022- 03-07	2,548,000.00	24,500.00	14	3.40	3,369.02	-		

中信证券	2022030700035268	捷捷微电	2022-03-07	3,895,280.00	146,000.00	14	7.60	11,512.72	-	
中信证券	2022030700035270	捷捷微电	2022-03-07	4,268,800.00	160,000.00	14	7.60	12,616.68	-	
中信证券	2022030700035272	晶盛机电	2022-03-07	668,140.00	11,000.00	14	2.90	753.51	-	
中信证券	2022030700035274	北京君正	2022-03-07	1,040,000.00	10,000.00	14	3.40	1,375.11	-	
中信证券	2022030700035276	扬杰科技	2022-03-07	1,118,600.00	17,000.00	14	3.40	1,479.04	-	
中信证券	2022030700035278	扬杰科技	2022-03-07	2,632,000.00	40,000.00	14	3.40	3,480.09	-	
中信证券	2022030700035280	北京君正	2022-03-07	4,784,000.00	46,000.00	14	3.40	6,325.51	-	
中信证券	2022030700044316	卓胜微	2022-03-07	4,792,000.00	20,000.00	14	1.90	3,540.76	-	
中信证券	2022030700044400	南大光电	2022-03-07	6,135,000.00	150,000.00	14	3.50	8,350.42	-	
中信证券	2022030700044402	北京君正	2022-03-07	11,762,400.00	113,100.00	14	3.40	15,552.51	-	
中信证券	2022030700044404	上海新阳	2022-03-07	2,644,904.00	71,600.00	14	3.50	3,600.01	-	
中信证券	2022030700044406	上海新阳	2022-03-07	2,116,662.00	57,300.00	14	3.50	2,881.01	-	
中信证	2022030800013120	捷捷微	2022-03-08	1,049,100.00	39,000.00	14	7.60	3,100.67	-	

券		电								
中信证	2022030800013122	南大光电	2022-03-08	1,006,800.00	24,000.00	28	3.40	2,757.52	-	
券		卓胜微	2022-03-08	231,990.00	1,000.00	14	3.20	288.70	-	
中信证	2022030800013124	北京君正	2022-03-08	2,117,000.00	20,000.00	14	3.40	2,799.14	-	
券		扬杰科技	2022-03-08	1,103,520.00	16,000.00	14	3.40	1,459.10	-	
中信证	2022030800013126	上海新阳	2022-03-08	3,162,000.00	85,000.00	14	3.50	4,303.83	-	
券		扬杰科技	2022-03-08	2,689,830.00	39,000.00	14	3.40	3,556.55	-	
中信证	2022030800013128	上海新阳	2022-03-08	111,600.00	3,000.00	14	3.50	151.90	-	
券		景嘉微	2022-03-08	1,626,940.00	14,000.00	14	2.60	1,645.02	-	
中信证	2022030800014868	捷捷微电	2022-03-08	1,549,440.00	57,600.00	14	7.60	4,579.46	-	
券		南大光电	2022-03-08	2,223,350.00	53,000.00	14	3.50	3,026.23	-	
中信证	2022030800015616	上海新阳	2022-03-08	1,599,600.00	43,000.00	14	3.50	2,177.23	-	
券		北京君正	2022-03-09	4,085,950.00	39,100.00	14	3.40	5,402.53	-	
中信证	2022030900015805	捷捷	2022-03-09	1,747,713.00	63,300.00	14	7.60	5,165.46	-	
券										

证券		微电								
中信证券	2022031000000780	扬杰科技	2022-03-10	6,364,920.00	87,000.00	28	3.40	16,831.68	-	
中信证券	2022031000000783	北京君正	2022-03-10	1,902,360.00	19,100.00	28	3.10	4,586.80	-	
中信证券	2022031000013268	北京君正	2022-03-10	1,195,200.00	12,000.00	14	3.40	1,580.32	-	
中信证券	2022031000013270	圣邦股份	2022-03-10	2,304,190.00	7,000.00	14	3.00	2,688.22	-	
中信证券	2022031000013284	扬杰科技	2022-03-10	2,194,800.00	30,000.00	14	3.40	2,902.01	-	
中信证券	2022031000013288	捷捷微电	2022-03-10	1,774,220.00	64,400.00	14	7.60	5,243.81	-	
中信证券	2022031000013290	扬杰科技	2022-03-10	2,370,384.00	32,400.00	14	3.40	3,134.17	-	
中信证券	2022031000013292	捷捷微电	2022-03-10	3,967,200.00	144,000.00	14	7.60	11,725.28	-	
中信证券	2022031000013294	南大光电	2022-03-10	2,224,560.00	52,000.00	14	3.50	3,027.87	-	
中信证券	2022031000013300	扬杰科技	2022-03-10	2,926,400.00	40,000.00	14	3.40	3,869.35	-	
中信证券	2022031000013306	上海新阳	2022-03-10	1,844,360.00	49,000.00	14	3.50	2,510.38	-	
中信证券	2022031000013308	北京君正	2022-03-10	697,200.00	7,000.00	14	3.40	921.85	-	
中	2022031000013310	上	2022-	1,656,160.00	44,000.00	14	3.50	2,254.22	-	

信 证 券		海 新 阳	03-10								
中 信 证 券	2022031000013312	南 大 光 电	2022- 03-10	4,278,000.00	100,000.00	14	3.50	5,822.83	-		
中 信 证 券	2022031000013314	全 志 科 技	2022- 03-10	4,915,000.00	100,000.00	14	2.20	4,205.06	-		
中 信 证 券	2022031100017356	晶 盛 机 电	2022- 03-11	157,075.00	2,500.00	14	1.80	109.95	-		
中 信 证 券	2022031100020384	扬 杰 科 技	2022- 03-11	2,089,672.00	28,300.00	14	3.40	2,763.01	-		
中 信 证 券	2022031100020386	南 大 光 电	2022- 03-11	2,158,975.00	51,100.00	14	3.50	2,938.60	-		
中 信 证 券	2022031100020388	北 京 君 正	2022- 03-11	3,991,719.00	39,100.00	14	3.40	5,277.94	-		
中 信 证 券	2022031500001193	景 嘉 微	2022- 03-15	778,640.00	8,000.00	28	3.90	2,361.87	-		
中 信 证 券	2022031500001194	捷 捷 微 电	2022- 03-15	122,700.00	5,000.00	28	3.40	324.47	-		
中 信 证 券	2022031500011411	全 志 科 技	2022- 03-15	3,348,500.00	74,000.00	14	2.60	3,385.71	-		
中 信 证 券	2022031500011413	北 京 君 正	2022- 03-15	195,762.00	2,100.00	14	3.20	243.61	-		
中 信 证 券	2022031500011415	捷 捷 微 电	2022- 03-15	171,780.00	7,000.00	28	7.20	961.97	-		
中 信 证 券	2022031500011417	捷 捷 微 电	2022- 03-15	2,036,820.00	83,000.00	14	7.30	5,782.31	-		

中信证券	2022031500011419	南大光电	2022-03-15	744,610.00	19,000.00	14	3.60	1,042.45	-	
中信证券	2022031700001105	上海新阳	2022-03-17	292,720.00	8,000.00	28	3.30	751.31	-	
中信证券	2022031700001106	扬杰科技	2022-03-17	12,144,249.00	153,900.00	28	3.40	32,114.79	-	
中信证券	2022031700001108	全志科技	2022-03-17	1,014,300.00	21,000.00	28	3.10	2,445.59	-	
中信证券	2022031700001114	捷捷微电	2022-03-17	2,289,320.00	86,000.00	28	3.40	6,053.98	-	
中信证券	2022031700004738	南大光电	2022-03-17	4,527,880.00	103,000.00	14	3.60	6,339.03	-	
中信证券	2022031700004742	北京君正	2022-03-17	1,919,190.00	19,000.00	14	3.20	2,388.33	-	
中信证券	2022031700005016	卓胜微	2022-03-17	9,490,250.00	38,500.00	14	1.70	6,274.11	-	
中信证券	2022032100028641	卓胜微	2022-03-21	4,740,000.00	20,000.00	14	1.90	4,002.66	-	
中信证券	2022032100030579	卓胜微	2022-03-21	1,659,000.00	7,000.00	14	1.80	1,327.20	-	
中信证券	2022032100034923	晶盛机电	2022-03-21	693,220.00	11,000.00	14	3.20	985.91	-	
中信证券	2022032100034925	捷捷微电	2022-03-21	3,934,700.00	146,000.00	14	3.50	6,120.64	-	
中信证	2022032100034929	卓胜微	2022-03-21	1,445,700.00	6,100.00	14	1.70	1,092.31	-	

券										
中信证券	2022032100034931	扬杰科技	2022-03-21	2,992,560.00	37,000.00	14	3.50	4,655.10	-	
中信证券	2022032100034933	扬杰科技	2022-03-21	1,374,960.00	17,000.00	14	3.50	2,138.82	-	
中信证券	2022032100034935	上海新阳	2022-03-21	2,133,279.00	57,300.00	14	3.40	3,223.62	-	
中信证券	2022032100034937	上海新阳	2022-03-21	2,665,668.00	71,600.00	14	3.40	4,028.13	-	
中信证券	2022032100034939	南大光电	2022-03-21	6,624,000.00	150,000.00	14	4.00	11,776.00	-	
中信证券	2022032100034941	南大光电	2022-03-21	2,472,960.00	56,000.00	14	4.00	4,396.38	-	
中信证券	2022032100034943	捷捷微电	2022-03-21	4,312,000.00	160,000.00	14	3.50	6,707.55	-	
中信证券	2022032100034945	景嘉微	2022-03-21	11,718,000.00	108,500.00	14	4.00	20,832.00	-	
中信证券	2022032100034951	北京君正	2022-03-21	4,568,260.00	46,000.00	14	3.50	7,106.18	-	
中信证券	2022032100034953	北京君正	2022-03-21	993,100.00	10,000.00	14	3.50	1,544.82	-	
中信证券	2022032100034955	北京君正	2022-03-21	2,433,095.00	24,500.00	14	3.50	3,784.81	-	
中信证券	2022032100034957	北京君正	2022-03-21	5,263,430.00	53,000.00	14	3.50	8,187.55	-	
中信	2022032100034959	北京	2022-03-21	11,231,961.00	113,100.00	14	3.50	17,471.94	-	

证券		君正								
中信证券	2022032200000921	扬杰科技	2022-03-22	5,258,001.00	68,100.00	14	3.50	7,667.91	-	
中信证券	2022032200000951	晶盛机电	2022-03-22	186,000.00	3,000.00	14	3.00	232.50	-	
中信证券	2022032200000955	捷捷微电	2022-03-22	211,520.00	8,000.00	14	3.50	308.46	-	
中信证券	2022032200000959	上海新阳	2022-03-22	151,760.00	4,000.00	14	3.30	208.67	-	
中信证券	2022032200000964	捷捷微电	2022-03-22	1,961,848.00	74,200.00	14	3.50	2,861.03	-	
中信证券	2022032200014109	卓胜微	2022-03-22	235,620.00	1,000.00	14	1.70	166.90	-	
中信证券	2022032200014111	捷捷微电	2022-03-22	1,031,160.00	39,000.00	14	3.50	1,503.77	-	
中信证券	2022032200014113	捷捷微电	2022-03-22	1,522,944.00	57,600.00	14	3.50	2,220.96	-	
中信证券	2022032200014115	扬杰科技	2022-03-22	1,235,360.00	16,000.00	14	3.50	1,801.56	-	
中信证券	2022032200014117	景嘉微	2022-03-22	1,517,880.00	14,000.00	14	4.00	2,529.80	-	
中信证券	2022032200014119	扬杰科技	2022-03-22	3,011,190.00	39,000.00	14	3.50	4,391.31	-	
中信证券	2022032200014121	上海新阳	2022-03-22	3,224,900.00	85,000.00	14	3.40	4,568.60	-	
中	2022032200014123	上	2022-	1,631,420.00	43,000.00	14	3.40	2,311.18	-	

信 证 券		海 新 阳	03-22								
中 信 证 券	2022032200014125	南 大 光 电	2022- 03-22	2,302,320.00	53,000.00	14	4.00	3,837.20	-		
中 信 证 券	2022032200014127	上 海 新 阳	2022- 03-22	113,820.00	3,000.00	14	3.40	161.25	-		
中 信 证 券	2022032200014133	北 京 君 正	2022- 03-22	1,962,200.00	20,000.00	14	3.50	2,861.54	-		
中 信 证 券	2022032300013641	捷 捷 微 电	2022- 03-23	1,695,174.00	63,300.00	14	3.50	2,307.32	-		
中 信 证 券	2022032300013643	北 京 君 正	2022- 03-23	3,817,333.00	39,100.00	14	3.50	5,195.81	-		
中 信 证 券	2022032400000849	全 志 科 技	2022- 03-24	48,130.00	1,000.00	14	3.30	61.77	-		
中 信 证 券	2022032400000851	扬 杰 科 技	2022- 03-24	1,931,540.00	26,000.00	14	3.50	2,629.04	-		
中 信 证 券	2022032400000853	扬 杰 科 技	2022- 03-24	1,782,960.00	24,000.00	28	3.40	4,714.94	-		
中 信 证 券	2022032400010531	扬 杰 科 技	2022- 03-24	2,228,700.00	30,000.00	14	3.50	3,033.51	-		
中 信 证 券	2022032400010539	扬 杰 科 技	2022- 03-24	2,971,600.00	40,000.00	14	3.50	4,044.68	-		
中 信 证 券	2022032400010541	上 海 新 阳	2022- 03-24	1,853,180.00	49,000.00	14	3.40	2,450.32	-		
中 信 证 券	2022032400010543	扬 杰 科 技	2022- 03-24	2,406,996.00	32,400.00	14	3.50	3,276.19	-		

中信证券	2022032400010545	南大光电	2022-03-24	2,214,160.00	52,000.00	14	4.00	3,444.25	-	
中信证券	2022032400010547	上海新阳	2022-03-24	1,664,080.00	44,000.00	14	3.40	2,200.28	-	
中信证券	2022032400010549	南大光电	2022-03-24	4,258,000.00	100,000.00	14	4.00	6,623.56	-	
中信证券	2022032400010551	圣邦股份	2022-03-24	2,338,000.00	7,000.00	14	3.20	2,909.51	-	
中信证券	2022032400010553	北京君正	2022-03-24	672,070.00	7,000.00	14	3.50	914.76	-	
中信证券	2022032400010555	捷捷微电	2022-03-24	1,672,468.00	64,400.00	14	3.50	2,276.41	-	
中信证券	2022032400010557	捷捷微电	2022-03-24	3,739,680.00	144,000.00	14	3.50	5,090.12	-	
中信证券	2022032400010559	全志科技	2022-03-24	4,813,000.00	100,000.00	14	3.20	5,989.51	-	
中信证券	2022032500015466	扬杰科技	2022-03-25	2,112,312.00	28,300.00	14	3.50	2,875.09	-	
中信证券	2022032500015468	南大光电	2022-03-25	2,141,090.00	51,100.00	14	4.00	3,330.58	-	
中信证券	2022032500015470	北京君正	2022-03-25	3,675,791.00	39,100.00	14	3.50	5,003.16	-	
中信证券	2022032500015818	晶盛机电	2022-03-25	149,550.00	2,500.00	14	1.80	104.69	-	
中信证	2022032900000945	全志科	2022-03-29	252,200.00	5,000.00	28	3.10	608.08	-	

券		技								
中信证券	2022032900000951	南大光电	2022-03-29	1,919,000.00	47,500.00	28	4.00	5,970.22	-	
中信证券	2022032900000959	扬杰科技	2022-03-29	1,934,123.00	28,100.00	28	3.40	5,114.68	-	
中信证券	2022032900005748	捷捷微电	2022-03-29	2,076,660.00	83,000.00	14	3.50	2,826.57	-	
中信证券	2022032900005752	南大光电	2022-03-29	767,600.00	19,000.00	14	4.00	1,194.04	-	
中信证券	2022032900005754	全志科技	2022-03-29	3,732,560.00	74,000.00	14	3.30	4,790.12	-	
中信证券	2022033100000919	圣邦股份	2022-03-31	326,520.00	1,000.00	28	1.80	457.13	-	
中信证券	2022033100000928	晶盛机电	2022-03-31	180,000.00	3,000.00	28	1.80	252.00	-	
中信证券	2022033100000933	北京君正	2022-03-31	91,470.00	1,000.00	28	1.80	128.06	-	
中信证券	2022033100005884	北京君正	2022-03-31	1,737,930.00	19,000.00	14	2.70	1,824.83	-	
中信证券	2022033100005886	卓胜微	2022-03-31	8,081,920.00	38,500.00	14	1.70	5,343.05	-	
中信证券	2022033100005888	南大光电	2022-03-31	4,185,920.00	103,000.00	14	4.00	6,511.43	-	
中信证券	2022040600050753	北京君正	2022-04-06	2,217,495.00	24,500.00	14	3.20	2,759.55	-	
中信	2022040600050755	北京	2022-04-06	905,100.00	10,000.00	14	3.20	1,126.35	-	

证券		君正								
中信证券	2022040600050757	景嘉微	2022-04-06	1,291,780.00	14,000.00	14	3.30	1,657.78	-	
中信证券	2022040600050759	北京君正	2022-04-06	4,163,460.00	46,000.00	14	3.20	5,181.19	-	
中信证券	2022040600050761	北京君正	2022-04-06	4,797,030.00	53,000.00	14	3.20	5,969.64	-	
中信证券	2022040600050763	北京君正	2022-04-06	10,236,681.00	113,100.00	14	3.20	12,738.98	-	
中信证券	2022040600050765	北京君正	2022-04-06	1,810,200.00	20,000.00	14	3.20	2,252.69	-	
中信证券	2022040600050767	北京君正	2022-04-06	3,538,941.00	39,100.00	14	3.20	4,404.02	-	
中信证券	2022040600050771	景嘉微	2022-04-06	5,443,930.00	108,500.00	14	3.30	12,847.83	-	
中信证券	2022040600050785	捷捷微电	2022-04-06	1,573,638.00	63,300.00	14	3.60	2,203.09	-	
中信证券	2022040600050787	晶盛机电	2022-04-06	626,890.00	11,000.00	14	2.90	706.99	-	
中信证券	2022040600050789	捷捷微电	2022-04-06	1,431,936.00	57,600.00	14	3.60	2,004.71	-	
中信证券	2022040600050791	捷捷微电	2022-04-06	3,629,560.00	146,000.00	14	3.60	5,081.38	-	
中信证券	2022040600050793	捷捷微电	2022-04-06	969,540.00	39,000.00	14	3.60	1,357.36	-	
中	2022040600050795	捷	2022-	1,844,612.00	74,200.00	14	3.60	2,582.46	-	

信 证 券		捷 微 电	04-06								
中 信 证 券	2022040600050797	捷 捷 微 电	2022- 04-06	3,977,600.00	160,000.00	14	3.60	5,568.64	-		
中 信 证 券	2022040600050799	南 大 光 电	2022- 04-06	5,940,000.00	150,000.00	14	4.10	9,471.00	-		
中 信 证 券	2022040600050801	扬 杰 科 技	2022- 04-06	4,651,911.00	68,100.00	14	3.50	6,331.77	-		
中 信 证 券	2022040600050803	卓 胜 微	2022- 04-06	1,250,256.00	6,100.00	14	3.30	1,604.50	-		
中 信 证 券	2022040600050805	扬 杰 科 技	2022- 04-06	2,527,470.00	37,000.00	14	3.50	3,440.17	-		
中 信 证 券	2022040600050807	扬 杰 科 技	2022- 04-06	2,664,090.00	39,000.00	14	3.50	3,626.12	-		
中 信 证 券	2022040600050809	南 大 光 电	2022- 04-06	950,400.00	24,000.00	28	4.00	3,062.40	-		
中 信 证 券	2022040600050811	扬 杰 科 技	2022- 04-06	1,092,960.00	16,000.00	14	3.50	1,487.64	-		
中 信 证 券	2022040600050813	南 大 光 电	2022- 04-06	2,217,600.00	56,000.00	14	4.10	3,535.84	-		
中 信 证 券	2022040600050815	卓 胜 微	2022- 04-06	204,960.00	1,000.00	14	3.30	263.03	-		
中 信 证 券	2022040600050817	上 海 新 阳	2022- 04-06	1,501,560.00	43,000.00	14	3.40	1,985.40	-		
中 信 证 券	2022040600050819	上 海 新 阳	2022- 04-06	104,760.00	3,000.00	14	3.40	138.52	-		

中信证券	2022040600050821	南大光电	2022-04-06	2,098,800.00	53,000.00	14	4.10	3,346.42	-	
中信证券	2022040600050823	上海新阳	2022-04-06	2,500,272.00	71,600.00	14	3.40	3,305.92	-	
中信证券	2022040600050825	上海新阳	2022-04-06	2,968,200.00	85,000.00	14	3.40	3,924.62	-	
中信证券	2022040600050827	上海新阳	2022-04-06	2,000,916.00	57,300.00	14	3.40	2,645.66	-	
中信证券	2022040600056329	卓胜微	2022-04-06	1,434,720.00	7,000.00	14	1.80	1,004.30	-	
中信证券	2022040600056331	卓胜微	2022-04-06	4,099,200.00	20,000.00	14	1.90	3,028.85	-	
中信证券	2022040700014060	全志科技	2022-04-07	4,869,000.00	100,000.00	14	3.20	6,059.20	-	
中信证券	2022040700014062	圣邦股份	2022-04-07	2,155,720.00	7,000.00	14	2.90	2,431.17	-	
中信证券	2022040700014074	捷捷微电	2022-04-07	3,481,920.00	144,000.00	14	3.60	4,874.69	-	
中信证券	2022040700014076	捷捷微电	2022-04-07	1,557,192.00	64,400.00	14	3.60	2,180.07	-	
中信证券	2022040700014078	扬杰科技	2022-04-07	1,759,680.00	26,000.00	14	3.50	2,395.12	-	
中信证券	2022040700014080	上海新阳	2022-04-07	1,518,000.00	44,000.00	14	3.40	2,007.13	-	
中信证	2022040700014082	上海新	2022-04-07	1,690,500.00	49,000.00	14	3.40	2,235.22	-	

券		阳								
中信证券	2022040700014084	南大光电	2022-04-07	1,994,200.00	52,000.00	14	4.10	3,179.64	-	
中信证券	2022040700014086	扬杰科技	2022-04-07	2,030,400.00	30,000.00	14	3.50	2,763.60	-	
中信证券	2022040700014088	扬杰科技	2022-04-07	2,192,832.00	32,400.00	14	3.50	2,984.69	-	
中信证券	2022040700014090	扬杰科技	2022-04-07	2,707,200.00	40,000.00	14	3.50	3,684.80	-	
中信证券	2022040700014092	南大光电	2022-04-07	3,835,000.00	100,000.00	14	4.10	6,114.69	-	
中信证券	2022040800014879	晶盛机电	2022-04-08	137,750.00	2,500.00	14	1.80	96.43	-	
中信证券	2022040800017465	北京君正	2022-04-08	3,435,326.00	39,100.00	14	3.20	4,275.07	-	
中信证券	2022040800017467	扬杰科技	2022-04-08	1,924,966.00	28,300.00	14	3.50	2,620.09	-	
中信证券	2022040800017469	南大光电	2022-04-08	2,016,406.00	51,100.00	14	4.10	3,215.05	-	
中信证券	2022041200011237	捷捷微电	2022-04-12	163,170.00	7,000.00	28	3.50	444.19	-	
中信证券	2022041200011239	南大光电	2022-04-12	758,480.00	19,000.00	14	4.10	1,209.35	-	
中信证券	2022041200011241	捷捷微电	2022-04-12	116,550.00	5,000.00	28	3.50	317.28	-	
中信	2022041200011243	捷捷	2022-04-12	1,934,730.00	83,000.00	14	3.60	2,708.62	-	

证 券		微 电									
中 信 证 券	2022041200011245	全 志 科 技	2022- 04-12	3,392,900.00	74,000.00	14	3.20	4,222.28	-		
中 信 证 券	2022041400005559	全 志 科 技	2022- 04-14	948,150.00	21,000.00	28	3.20	2,359.84	-		
中 信 证 券	2022041400005561	扬 杰 科 技	2022- 04-14	10,074,294.00	153,900.00	28	3.40	26,640.91	-		
中 信 证 券	2022041400005563	北 京 君 正	2022- 04-14	1,554,770.00	19,000.00	14	3.30	1,995.29	-		
中 信 证 券	2022041400005565	上 海 新 阳	2022- 04-14	269,760.00	8,000.00	28	3.20	671.40	-		
中 信 证 券	2022041400005567	捷 捷 微 电	2022- 04-14	2,008,960.00	86,000.00	28	3.20	5,000.08	-		
中 信 证 券	2022041400005569	南 大 光 电	2022- 04-14	4,196,220.00	103,000.00	14	4.10	6,690.64	-		
中 信 证 券	2022041400006653	卓 胜 微	2022- 04-14	7,019,705.00	38,500.00	14	3.30	9,008.62	-		
中 信 证 券	2022042000047622	景 嘉 微	2022- 04-20	5,138,900.00	59,000.00	14	2.10	4,496.54	-		
中 信 证 券	2022042000049626	北 京 君 正	2022- 04-20	3,231,615.00	39,100.00	14	3.20	4,308.82	-		
中 信 证 券	2022042000049656	卓 胜 微	2022- 04-20	1,231,590.00	6,100.00	14	2.50	1,282.91	-		
中 信 证 券	2022042000049658	北 京 君 正	2022- 04-20	2,024,925.00	24,500.00	14	3.20	2,699.90	-		
中 信 证 券	2022042000049660	南 大 光 电	2022- 04-20	5,850,000.00	150,000.00	14	2.00	4,875.00	-		

信 证 券		大 光 电	04-20								
中 信 证 券	2022042000049664	北 京 君 正	2022- 04-20	1,653,000.00	20,000.00	14	3.20	2,204.00	-		
中 信 证 券	2022042000049666	北 京 君 正	2022- 04-20	4,380,450.00	53,000.00	14	3.20	5,840.60	-		
中 信 证 券	2022042000049668	上 海 新 阳	2022- 04-20	2,803,300.00	85,000.00	14	3.70	4,321.76	-		
中 信 证 券	2022042000049670	上 海 新 阳	2022- 04-20	1,889,754.00	57,300.00	14	3.70	2,913.37	-		
中 信 证 券	2022042000049672	上 海 新 阳	2022- 04-20	1,418,140.00	43,000.00	14	3.70	2,186.30	-		
中 信 证 券	2022042000049674	北 京 君 正	2022- 04-20	9,347,715.00	113,100.00	14	3.20	12,463.62	-		
中 信 证 券	2022042000049676	捷 捷 微 电	2022- 04-20	884,910.00	39,000.00	14	1.90	700.55	-		
中 信 证 券	2022042000049678	捷 捷 微 电	2022- 04-20	1,436,277.00	63,300.00	14	1.90	1,137.05	-		
中 信 证 券	2022042000049680	景 嘉 微	2022- 04-20	1,219,400.00	14,000.00	14	2.10	1,066.97	-		
中 信 证 券	2022042000049682	晶 盛 机 电	2022- 04-20	581,900.00	11,000.00	14	3.70	897.10	-		
中 信 证 券	2022042000049684	卓 胜 微	2022- 04-20	201,900.00	1,000.00	14	2.50	210.31	-		
中 信 证 券	2022042000049686	南 大 光 电	2022- 04-20	2,184,000.00	56,000.00	14	2.00	1,820.00	-		

中信证券	2022042000049688	捷捷微电	2022-04-20	3,630,400.00	160,000.00	14	1.90	2,874.06	-	
中信证券	2022042000049690	南大光电	2022-04-20	2,067,000.00	53,000.00	14	2.00	1,722.50	-	
中信证券	2022042000049882	卓胜微	2022-04-20	4,038,000.00	20,000.00	14	1.90	3,196.75	-	
中信证券	2022042000049896	卓胜微	2022-04-20	1,413,300.00	7,000.00	14	1.80	1,059.98	-	
中信证券	2022042100012755	南大光电	2022-04-21	1,990,040.00	52,000.00	14	2.00	1,547.81	-	
中信证券	2022042100012757	南大光电	2022-04-21	3,827,000.00	100,000.00	14	2.00	2,976.56	-	
中信证券	2022042100012759	捷捷微电	2022-04-21	1,408,428.00	64,400.00	14	1.90	1,040.67	-	
中信证券	2022042100012765	扬杰科技	2022-04-21	2,209,032.00	32,400.00	14	3.20	2,749.02	-	
中信证券	2022042100012767	圣邦股份	2022-04-21	2,022,160.00	7,000.00	14	3.10	2,437.83	-	
中信证券	2022042100012769	上海新阳	2022-04-21	1,422,080.00	44,000.00	14	3.70	2,046.22	-	
中信证券	2022042100012771	扬杰科技	2022-04-21	1,636,320.00	24,000.00	28	3.10	3,945.35	-	
中信证券	2022042200012900	北京君正	2022-04-22	3,030,250.00	39,100.00	14	3.20	3,770.98	-	
中信证	2022042200012902	扬杰科	2022-04-22	1,825,350.00	28,300.00	14	3.20	2,271.55	-	

券		技								
中信证	2022042200012904	南大光电	2022-04-22	1,737,911.00	51,100.00	14	2.00	1,351.71	-	
券		晶盛机电	2022-04-22	123,575.00	2,500.00	14	1.80	86.50	-	
中信证	2022042200015186	扬杰科技	2022-04-26	1,663,200.00	28,000.00	14	3.40	2,199.12	-	
券		卓胜微	2022-04-26	996,420.00	6,000.00	14	2.70	1,046.24	-	
中信证	2022042600001171	全志科技	2022-04-26	200,940.00	6,000.00	14	3.40	265.69	-	
券		景嘉微	2022-04-26	580,080.00	8,000.00	14	2.70	609.08	-	
中信证	2022042600001181	捷捷微电	2022-04-26	1,475,740.00	83,000.00	14	4.20	2,410.38	-	
券		全志科技	2022-04-26	2,478,260.00	74,000.00	14	3.50	3,373.19	-	
中信证	2022042600007539	南大光电	2022-04-26	1,393,175.00	47,500.00	28	2.90	3,142.38	-	
券		扬杰科技	2022-04-26	1,669,140.00	28,100.00	28	3.30	4,284.13	-	
中信证	2022042600007543	南大光电	2022-04-26	557,270.00	19,000.00	14	3.00	650.15	-	
券		全志科技	2022-04-26	167,450.00	5,000.00	28	3.40	442.81	-	
中信证	2022042600007547	南大	2022-04-27	1,182,672.00	38,200.00	14	3.10	1,425.78	-	
券										

证 券		光 电								
中 信 证 券	2022042700011977	全 志 科 技	2022- 04-14	10,500.00	-	28	3.20	-	-	
中 信 证 券	2022042700012080	全 志 科 技	2022- 04-26	3,000.00	-	14	3.40	-	-	
中 信 证 券	2022042700012093	全 志 科 技	2022- 04-26	37,000.00	-	14	3.50	-	-	
中 信 证 券	2022042700012095	全 志 科 技	2022- 04-26	2,500.00	-	28	3.40	-	-	
中 信 证 券	2022042700012119	全 志 科 技	2022- 04-14	-	18,900.00	28	3.20	-	-	
中 信 证 券	2022042700012222	全 志 科 技	2022- 04-26	-	5,400.00	14	3.40	-	-	
中 信 证 券	2022042700012235	全 志 科 技	2022- 04-26	-	66,600.00	14	3.50	-	-	
中 信 证 券	2022042700012237	全 志 科 技	2022- 04-26	-	4,500.00	28	3.40	-	-	
中 信 证 券	2022042800001173	卓 胜 微	2022- 04-28	2,052,960.00	11,200.00	14	2.70	2,155.61	-	
中 信 证 券	2022042800008436	卓 胜 微	2022- 04-28	7,057,050.00	38,500.00	14	2.70	7,409.90	-	
中 信 证 券	2022042800008924	南 大 光 电	2022- 04-28	3,123,990.00	103,000.00	14	3.00	3,644.66	-	
中 信 证 券	2022042800008926	北 京 君 正	2022- 04-28	1,390,420.00	19,000.00	14	3.20	1,730.30	-	
中 信 证 券	2022042800008962	北 京 君 正	2022- 04-28	73,180.00	1,000.00	28	1.80	102.45	-	

信 证 券		京 君 正	04-28								
中 信 证 券	2022042800008986	圣 邦 股 份	2022- 04-28	275,060.00	1,000.00	28	1.80	385.08	-		
中 信 证 券	2022042800008990	晶 盛 机 电	2022- 04-28	145,770.00	3,000.00	28	1.80	204.08	-		
中 信 证 券	2022050500001647	扬 杰 科 技	2022- 05-05	3,299,280.00	46,600.00	14	3.40	4,362.38	-		
中 信 证 券	2022050500001651	北 京 君 正	2022- 05-05	2,862,120.00	39,100.00	14	3.30	3,673.05	-		
中 信 证 券	2022050500001653	全 志 科 技	2022- 05-05	2,007,780.00	109,000.00	14	3.40	2,654.73	-		
中 信 证 券	2022050500058599	南 大 光 电	2022- 05-05	3,418,000.00	100,000.00	14	3.10	4,120.59	-		
中 信 证 券	2022050500058683	北 京 君 正	2022- 05-05	8,278,920.00	113,100.00	14	2.90	9,336.78	-		
中 信 证 券	2022050500058685	南 大 光 电	2022- 05-05	820,320.00	24,000.00	28	3.00	1,914.08	-		
中 信 证 券	2022050500058687	卓 胜 微	2022- 05-05	1,115,202.00	6,100.00	14	2.70	1,170.96	-		
中 信 证 券	2022050500058689	卓 胜 微	2022- 05-05	182,820.00	1,000.00	14	2.70	191.96	-		
中 信 证 券	2022050500059441	卓 胜 微	2022- 05-05	1,279,740.00	7,000.00	14	1.80	895.82	-		
中 信 证 券	2022050500059461	卓 胜 微	2022- 05-05	3,656,400.00	20,000.00	14	1.90	2,701.67	-		

中信证券	2022050500070527	南大光电	2022-05-05	1,811,540.00	53,000.00	14	3.10	2,183.91	-	
中信证券	2022050500070529	上海新阳	2022-05-05	1,196,360.00	44,000.00	14	2.90	1,349.23	-	
中信证券	2022050500070531	南大光电	2022-05-05	1,777,360.00	52,000.00	14	3.10	2,142.71	-	
中信证券	2022050500070533	南大光电	2022-05-05	1,914,080.00	56,000.00	14	3.10	2,307.53	-	
中信证券	2022050500070535	上海新阳	2022-05-05	1,557,987.00	57,300.00	14	2.90	1,757.06	-	
中信证券	2022050500070537	上海新阳	2022-05-05	1,169,170.00	43,000.00	14	2.90	1,318.56	-	
中信证券	2022050500070555	北京君正	2022-05-05	1,464,000.00	20,000.00	14	2.90	1,651.07	-	
中信证券	2022050500070557	北京君正	2022-05-05	1,793,400.00	24,500.00	14	2.90	2,022.56	-	
中信证券	2022050500070559	北京君正	2022-05-05	2,862,120.00	39,100.00	14	2.90	3,227.84	-	
中信证券	2022050500070561	捷捷微电	2022-05-05	3,036,800.00	160,000.00	14	3.10	3,661.03	-	
中信证券	2022050500070563	捷捷微电	2022-05-05	1,201,434.00	63,300.00	14	3.10	1,448.40	-	
中信证券	2022050500070565	捷捷微电	2022-05-05	1,222,312.00	64,400.00	14	3.10	1,473.57	-	
中信证	2022050500070567	扬杰科	2022-05-05	2,293,920.00	32,400.00	14	3.40	3,033.07	-	

券		技								
中信证券	2022050500070569	晶盛机电	2022-05-05	564,850.00	11,000.00	14	2.40	527.19	-	
中信证券	2022050500070571	圣邦股份	2022-05-05	2,026,500.00	7,000.00	14	2.80	2,206.63	-	
中信证券	2022050500070573	捷捷微电	2022-05-05	740,220.00	39,000.00	14	3.10	892.38	-	
中信证券	2022050600014639	晶盛机电	2022-05-06	127,300.00	2,500.00	14	1.80	89.11	-	
中信证券	2022050600018451	北京君正	2022-05-06	2,775,318.00	39,100.00	14	2.90	3,129.94	-	
中信证券	2022050600018453	扬杰科技	2022-05-06	2,029,393.00	28,300.00	14	3.40	2,683.31	-	
中信证券	2022050600018455	南大光电	2022-05-06	1,766,527.00	51,100.00	14	3.10	2,129.65	-	
中信证券	2022050900011405	南大光电	2022-05-06	2,555.00	-	14	3.10	-	-	
中信证券	2022050900011427	南大光电	2022-05-05	2,800.00	-	14	3.10	-	-	
中信证券	2022050900011435	南大光电	2022-05-05	2,650.00	-	14	3.10	-	-	
中信证券	2022050900011437	南大光电	2022-05-05	2,600.00	-	14	3.10	-	-	
中信证券	2022050900011475	南大光电	2022-05-05	1,200.00	-	28	3.00	-	-	
中信	2022050900011483	南大	2022-05-05	5,000.00	-	14	3.10	-	-	

证 券		光 电								
中 信 证 券	2022050900011505	南 大 光 电	2022- 04-28	5,150.00	-	14	3.00	-	-	
中 信 证 券	2022050900011536	南 大 光 电	2022- 04-27	1,910.00	-	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011541	南 大 光 电	2022- 04-26	950.00	-	14	3.00	-	-	
中 信 证 券	2022050900011551	南 大 光 电	2022- 04-26	2,375.00	-	28	2.90	-	-	
中 信 证 券	2022050900011581	南 大 光 电	2022- 05-06	-	15,330.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011603	南 大 光 电	2022- 05-05	-	16,800.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011611	南 大 光 电	2022- 05-05	-	15,900.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011613	南 大 光 电	2022- 05-05	-	15,600.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011651	南 大 光 电	2022- 05-05	-	7,200.00	28	3.00	-	-	
中 信 证 券	2022050900011659	南 大 光 电	2022- 05-05	-	30,000.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011681	南 大 光 电	2022- 04-28	-	30,900.00	14	3.00	-	-	
中 信 证 券	2022050900011712	南 大 光 电	2022- 04-27	-	11,460.00	14	3.10	-	-	
中 信 证 券	2022050900011717	南 大 光 电	2022- 04-27	-	5,700.00	14	3.00	-	-	

信 证 券		大 光 电	04-26							
中 信 证 券	2022050900011727	南 大 光 电	2022- 04-26	-	14,250.00	28	2.90	-	-	
中 信 证 券	2022051000001009	全 志 科 技	2022- 05-10	54,870.00	3,000.00	14	3.40	72.55	-	
中 信 证 券	2022051000001014	景 嘉 微	2022- 05-10	435,000.00	5,000.00	14	3.20	541.33	-	
中 信 证 券	2022051000001021	捷 捷 微 电	2022- 05-10	57,420.00	3,000.00	14	3.70	82.62	-	
中 信 证 券	2022051000001031	全 志 科 技	2022- 05-10	274,350.00	15,000.00	14	3.40	362.75	-	
中 信 证 券	2022051000001041	圣 邦 股 份	2022- 05-10	56,400,000.00	200,000.00	14	3.20	70,186.67	-	
中 信 证 券	2022051000014347	捷 捷 微 电	2022- 05-10	1,588,620.00	83,000.00	14	3.10	1,915.17	-	
中 信 证 券	2022051000014349	全 志 科 技	2022- 05-10	1,353,460.00	74,000.00	14	3.40	1,789.57	-	
中 信 证 券	2022051000014351	扬 杰 科 技	2022- 05-10	2,046,800.00	28,000.00	14	3.40	2,706.32	-	
中 信 证 券	2022051000014353	南 大 光 电	2022- 05-10	523,450.00	19,000.00	14	3.10	631.05	-	
中 信 证 券	2022051100000692	南 大 光 电	2022- 05-11	2,084,150.00	73,000.00	14	3.50	2,836.76	-	
中 信 证 券	2022051100009524	南 大 光 电	2022- 05-11	1,090,610.00	38,200.00	14	3.10	1,314.79	-	

中信证券	202205120000888	南大光电	2022-05-12	866,579.00	30,100.00	14	3.50	1,179.51	-	
中信证券	2022051200008960	南大光电	2022-05-12	2,965,370.00	103,000.00	14	3.10	3,574.92	-	
中信证券	2022051200008962	捷捷微电	2022-05-12	1,709,680.00	86,000.00	28	4.70	6,249.83	-	
中信证券	2022051200008964	全志科技	2022-05-12	410,340.00	21,000.00	28	3.30	1,053.21	-	
中信证券	2022051200008966	卓胜微	2022-05-12	2,189,600.00	11,200.00	14	3.20	2,724.84	-	
中信证券	2022051200008968	卓胜微	2022-05-12	7,526,750.00	38,500.00	14	3.20	9,366.62	-	
中信证券	2022051200008970	北京君正	2022-05-12	1,489,220.00	19,000.00	14	3.30	1,911.17	-	
中信证券	2022051200008974	上海新阳	2022-05-12	234,800.00	8,000.00	28	3.20	584.39	-	
中信证券	2022051700000909	北京君正	2022-05-17	2,057,146.00	25,400.00	14	3.40	2,720.00	-	
中信证券	2022051800000850	全志科技	2022-05-18	1,989,868.00	100,600.00	14	3.60	2,785.82	-	
中信证券	2022051900041525	扬杰科技	2022-05-19	1,889,280.00	24,000.00	28	3.40	4,996.10	-	
中信证券	2022051900043099	卓胜微	2022-05-19	3,990,000.00	20,000.00	14	1.90	2,948.17	-	
中信证	2022051900043141	南大光	2022-05-19	2,944,000.00	100,000.00	14	3.50	4,007.11	-	

券		电								
中信证	2022051900046691	扬杰科技	2022-05-19	3,668,352.00	46,600.00	14	3.50	4,993.03	-	
券		圣邦股份	2022-05-19	2,109,870.00	7,000.00	14	3.20	2,625.62	-	
中信证	2022051900052267	卓胜微	2022-05-19	199,500.00	1,000.00	14	3.80	294.82	-	
券		捷捷微电	2022-05-19	797,160.00	39,000.00	14	3.70	1,147.02	-	
中信证	2022051900052273	全志科技	2022-05-19	2,231,230.00	109,000.00	14	3.40	2,950.18	-	
券		捷捷微电	2022-05-19	1,316,336.00	64,400.00	14	3.70	1,894.06	-	
中信证	2022051900052279	扬杰科技	2022-05-19	2,550,528.00	32,400.00	14	3.50	3,471.55	-	
券		捷捷微电	2022-05-19	1,293,852.00	63,300.00	14	3.70	1,861.71	-	
中信证	2022051900052281	捷捷微电	2022-05-19	3,270,400.00	160,000.00	14	3.70	4,705.74	-	
券		北京君正	2022-05-19	3,358,690.00	39,100.00	14	3.50	4,571.55	-	
中信证	2022051900052289	北京君正	2022-05-19	9,715,290.00	113,100.00	14	3.50	13,223.59	-	
券		北京君正	2022-05-19	3,358,690.00	39,100.00	14	3.50	4,571.55	-	
中信证	2022051900052291	北京	2022-05-19	1,718,000.00	20,000.00	14	3.50	2,338.39	-	
券										

证券		君正								
中信证券	2022051900053575	上海新阳	2022-05-19	1,267,640.00	43,000.00	14	3.40	1,676.10	-	
中信证券	2022051900053577	南大光电	2022-05-19	1,648,640.00	56,000.00	14	3.50	2,243.98	-	
中信证券	2022051900053579	晶盛机电	2022-05-19	618,200.00	11,000.00	14	3.50	841.44	-	
中信证券	2022051900053581	南大光电	2022-05-19	1,530,880.00	52,000.00	14	3.50	2,083.70	-	
中信证券	2022051900053585	南大光电	2022-05-19	1,560,320.00	53,000.00	14	3.50	2,123.77	-	
中信证券	2022051900053587	上海新阳	2022-05-19	1,297,120.00	44,000.00	14	3.40	1,715.08	-	
中信证券	2022051900053589	上海新阳	2022-05-19	1,689,204.00	57,300.00	14	3.40	2,233.50	-	
中信证券	2022052000013632	晶盛机电	2022-05-20	140,125.00	2,500.00	14	1.80	119.11	-	
中信证券	2022052000013830	南大光电	2022-05-20	1,529,423.00	51,100.00	14	3.50	2,527.79	-	
中信证券	2022052000013832	扬杰科技	2022-05-20	2,160,705.00	28,300.00	14	3.50	3,571.17	-	
中信证券	2022052000013834	北京君正	2022-05-20	3,321,936.00	39,100.00	14	3.50	5,490.42	-	
中信证券	2022052400006982	南大光电	2022-05-24	557,460.00	19,000.00	14	3.60	780.44	-	
中	2022052400006984	捷	2022-	1,644,230.00	83,000.00	14	6.80	4,348.07	-	

信 证 券		捷 微 电	05-24								
中 信 证 券	2022052400006986	全 志 科 技	2022- 05-24	1,434,860.00	74,000.00	14	3.60	2,008.80	-		
中 信 证 券	2022052400007522	圣 邦 股 份	2022- 05-24	58,300,000.00	200,000.00	14	3.40	77,085.56	-		
中 信 证 券	2022052400007528	全 志 科 技	2022- 05-24	58,170.00	3,000.00	14	3.60	81.44	-		
中 信 证 券	2022052400007530	景 嘉 微	2022- 05-24	426,400.00	5,000.00	14	3.40	563.80	-		
中 信 证 券	2022052400007582	全 志 科 技	2022- 05-24	290,850.00	15,000.00	14	3.60	407.19	-		
中 信 证 券	2022052400007626	捷 捷 微 电	2022- 05-24	59,430.00	3,000.00	14	6.80	157.16	-		
中 信 证 券	2022052400007634	全 志 科 技	2022- 05-24	96,950.00	5,000.00	28	3.50	141.39	-		
中 信 证 券	2022052500000741	卓 胜 微	2022- 05-25	4,227,411.00	22,300.00	14	3.00	4,931.98	-		
中 信 证 券	2022052500007175	南 大 光 电	2022- 05-25	1,130,720.00	38,200.00	14	3.60	1,583.01	-		
中 信 证 券	2022052500007179	南 大 光 电	2022- 05-25	2,160,800.00	73,000.00	14	3.60	3,025.12	-		
中 信 证 券	2022052500010573	扬 杰 科 技	2022- 05-19	5,280.00	-	28	3.40	-	-		
中 信 证 券	2022052500010607	扬 杰 科 技	2022- 05-19	10,252.00	-	14	3.50	-	-		

中信证券	2022052500010635	扬杰科技	2022-05-19	7,128.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2022052500010661	扬杰科技	2022-05-20	6,226.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2022052600000789	扬杰科技	2022-05-26	74,510.00	1,000.00	28	2.80	162.27	-	
中信证券	2022052600008410	南大光电	2022-05-26	3,054,980.00	103,000.00	14	3.60	4,276.97	-	
中信证券	2022052600008412	南大光电	2022-05-26	892,766.00	30,100.00	14	3.60	1,249.87	-	
中信证券	2022052600010574	北京君正	2022-05-26	88,460.00	1,000.00	14	1.80	61.92	-	
中信证券	2022052600011514	晶盛机电	2022-05-26	163,800.00	3,000.00	14	1.80	114.66	-	
中信证券	2022052600011520	圣邦股份	2022-05-26	277,220.00	1,000.00	14	1.80	194.05	-	
中信证券	2022060100006258	晶盛机电	2022-05-19	3,080.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2022060100006272	晶盛机电	2022-05-20	700.00	-	14	1.80	-	-	
中信证券	2022060100006396	晶盛机电	2022-05-26	840.00	-	14	1.80	-	-	
中信证券	2022060200016172	晶盛机电	2022-06-02	624,140.00	11,000.00	14	2.80	679.62	-	
中信证	2022060200016178	扬杰科	2022-06-02	2,358,720.00	32,400.00	14	2.90	2,660.11	-	

券		技								
中信证券	2022060200017186	扬杰科技	2022-06-02	3,392,480.00	46,600.00	14	2.90	3,825.96	-	
中信证券	2022060200017188	圣邦股份	2022-06-02	2,082,220.00	7,000.00	14	3.50	2,834.13	-	
中信证券	2022060200017190	北京君正	2022-06-02	1,845,600.00	20,000.00	14	3.50	2,512.07	-	
中信证券	2022060200017192	卓胜微	2022-06-02	198,540.00	1,000.00	14	3.00	231.63	-	
中信证券	2022060200020796	捷捷微电	2022-06-02	1,358,196.00	64,400.00	14	4.10	2,165.57	-	
中信证券	2022060200020798	捷捷微电	2022-06-02	822,510.00	39,000.00	14	4.10	1,311.45	-	
中信证券	2022060200020800	捷捷微电	2022-06-02	1,334,997.00	63,300.00	14	4.10	2,128.58	-	
中信证券	2022060200020802	捷捷微电	2022-06-02	3,374,400.00	160,000.00	14	4.10	5,380.29	-	
中信证券	2022060600009788	扬杰科技	2022-06-06	2,112,029.00	28,300.00	14	2.90	2,381.90	-	
中信证券	2022060600010312	晶盛机电	2022-06-06	149,400.00	2,500.00	14	1.80	104.58	-	
中信证券	2022060600011596	北京君正	2022-06-06	3,752,036.00	39,100.00	14	3.50	5,106.94	-	
中信证券	2022060700001434	扬杰科技	2022-06-07	76,010.00	1,000.00	14	3.50	103.46	-	
中信	2022060700001445	扬杰	2022-06-07	760,100.00	10,000.00	14	3.50	1,034.58	-	

证券		科技								
中信证券	2022060700003255	全志科技	2022-05-24	96,950.00	5,000.00	15	3.50	141.39	-	
中信证券	2022060700007024	圣邦股份	2022-06-07	57,200,000.00	200,000.00	14	3.50	77,855.56	-	
中信证券	2022060700007026	景嘉微	2022-06-07	469,900.00	5,000.00	14	2.90	529.94	-	
中信证券	2022060700007078	捷捷微电	2022-06-07	64,020.00	3,000.00	14	4.10	102.08	-	
中信证券	2022060700008308	捷捷微电	2022-06-07	1,771,220.00	83,000.00	14	4.10	2,824.11	-	
中信证券	2022060700010010	景嘉微	2022-06-07	950.00	-	14	2.90	-	-	
中信证券	2022060700010170	景嘉微	2022-06-07	-	2,500.00	14	2.90	-	-	
中信证券	2022060800005539	卓胜微	2022-06-08	4,656,240.00	22,300.00	14	3.10	5,613.36	-	
中信证券	2022060900000867	扬杰科技	2022-06-09	342,450.00	5,000.00	14	3.50	466.11	-	
中信证券	2022060900006963	圣邦股份	2022-06-09	274,910.00	1,000.00	14	1.80	192.44	-	
中信证券	2022060900007007	晶盛机电	2022-06-09	173,400.00	3,000.00	14	1.80	121.38	-	
中信证券	2022060900007031	北京君正	2022-06-09	89,900.00	1,000.00	14	1.80	62.93	-	
中	2022061300022643	捷	2022-	8,114.40	-	14	4.10	-	-	

信 证 券		捷 微 电	06-02							
中 信 证 券	2022061300022645	捷 微 电	2022- 06-02	4,914.00	-	14	4.10	-	-	
中 信 证 券	2022061300022647	捷 微 电	2022- 06-02	7,975.80	-	14	4.10	-	-	
中 信 证 券	2022061300022649	捷 微 电	2022- 06-02	20,160.00	-	14	4.10	-	-	
中 信 证 券	2022061300022653	捷 微 电	2022- 06-07	378.00	-	14	4.10	-	-	
中 信 证 券	2022061300022657	捷 微 电	2022- 06-07	10,458.00	-	14	4.10	-	-	
中 信 证 券	2022061600014057	扬 杰 科 技	2022- 06-16	2,179,548.00	32,400.00	14	3.50	2,966.61	-	
中 信 证 券	2022061600014061	晶 盛 机 电	2022- 06-16	680,460.00	11,000.00	14	3.20	846.79	-	
中 信 证 券	2022061600014063	卓 胜 微	2022- 06-16	192,460.00	1,000.00	14	2.70	202.08	-	
中 信 证 券	2022061600016579	捷 微 电	2022- 06-16	871,650.00	39,000.00	14	3.70	1,254.21	-	
中 信 证 券	2022061600016583	扬 杰 科 技	2022- 06-16	1,614,480.00	24,000.00	14	3.50	2,197.49	-	
中 信 证 券	2022061600016587	圣 邦 股 份	2022- 06-16	1,785,000.00	7,000.00	14	3.40	2,360.17	-	
中 信 证 券	2022061600016589	北 京 君 正	2022- 06-16	1,814,000.00	20,000.00	14	3.30	2,327.97	-	

中信证券	2022061600016591	扬杰科技	2022-06-16	3,134,782.00	46,600.00	14	3.50	4,266.79	-	
中信证券	2022061600016593	捷捷微电	2022-06-16	3,576,000.00	160,000.00	14	3.70	5,145.47	-	
中信证券	2022062000015604	北京君正	2022-06-09	190.00	-	14	1.80	-	-	
中信证券	2022062000015720	北京君正	2022-06-16	3,800.00	-	14	3.30	-	-	
中信证券	2022062100001531	捷捷微电	2022-06-21	2,026,530.00	89,000.00	14	3.60	2,837.14	-	
中信证券	2022062100007404	捷捷微电	2022-06-21	1,889,910.00	83,000.00	14	3.80	2,792.87	-	
中信证券	2022062100007488	扬杰科技	2022-06-21	662,500.00	10,000.00	14	3.50	901.74	-	
中信证券	2022062100007522	扬杰科技	2022-06-21	66,250.00	1,000.00	14	3.50	90.17	-	
中信证券	2022062100008938	圣邦股份	2022-06-21	51,316,000.00	200,000.00	14	3.50	69,846.78	-	
中信证券	2022062100008940	景嘉微	2022-06-21	312,300.00	5,000.00	14	3.00	364.35	-	
中信证券	2022062100010096	圣邦股份	2022-06-09	500.00	-	14	1.80	-	-	
中信证券	2022062100010228	圣邦股份	2022-06-16	3,500.00	-	14	3.40	-	-	
中信证	2022062100010300	圣邦股	2022-06-21	100,000.00	-	14	3.50	-	-	

券		份								
中信证券	2022062100010338	圣邦股份	2022-06-09	-	500.00	14	1.80	-	-	
中信证券	2022062100010470	圣邦股份	2022-06-16	-	3,500.00	14	3.40	-	-	
中信证券	2022062100010542	圣邦股份	2022-06-21	-	100,000.00	14	3.50	-	-	
中信证券	2022062200002608	捷捷微电	2022-06-22	108,850.00	5,000.00	14	3.60	152.39	-	
中信证券	2022062200012743	卓胜微	2022-06-22	4,284,053.00	22,300.00	14	2.80	4,664.86	-	
中信证券	2022062300001777	卓胜微	2022-06-23	388,455.00	1,900.00	28	1.80	543.84	-	
中信证券	2022062300001781	北京君正	2022-06-23	831,705.00	8,900.00	28	1.80	1,164.39	-	
中信证券	2022062300001870	捷捷微电	2022-06-23	2,080,616.00	91,900.00	14	3.60	2,912.86	-	
中信证券	2022062300009123	北京君正	2022-06-23	93,450.00	1,000.00	14	1.80	65.42	-	
中信证券	2022062300009145	圣邦股份	2022-06-23	167,980.00	1,000.00	14	1.80	117.59	-	
中信证券	2022062300009553	晶盛机电	2022-06-23	201,870.00	3,000.00	14	1.80	141.31	-	
中信证券	2022062400001496	晶盛机电	2022-06-24	2,021,600.00	30,400.00	28	1.80	2,830.24	-	
中信	2022062800001357	晶盛	2022-06-28	13,684,320.00	198,900.00	14	2.60	13,836.37	-	

证券		机电								
中信证券	2022062800001367	卓胜微	2022-06-28	11,598,400.00	55,000.00	14	2.70	12,178.32	-	
中信证券	2022062800001377	捷捷微电	2022-06-28	287,760.00	12,000.00	14	3.70	414.05	-	
中信证券	2022062900001910	扬杰科技	2022-06-29	2,030,000.00	29,000.00	14	2.70	2,131.50	-	
中信证券	2022062900001924	北京君正	2022-06-29	2,023,700.00	19,600.00	14	3.10	2,439.68	-	
中信证券	2022062900001928	北京君正	2022-06-29	722,750.00	7,000.00	14	3.10	871.32	-	
中信证券	2022062900027474	卓胜微	2022-06-16	700.00	-	14	2.70	-	-	
中信证券	2022062900027628	卓胜微	2022-06-22	15,610.00	-	14	2.80	-	-	
中信证券	2022062900027647	卓胜微	2022-06-23	1,330.00	-	28	1.80	-	-	
中信证券	2022062900027703	卓胜微	2022-06-28	38,500.00	-	14	2.70	-	-	
中信证券	2022062900027826	卓胜微	2022-06-16	-	600.00	14	2.70	-	-	
中信证券	2022062900027980	卓胜微	2022-06-22	-	13,380.00	14	2.80	-	-	
中信证券	2022062900027999	卓胜微	2022-06-23	-	1,140.00	28	1.80	-	-	
中	2022062900028055	卓	2022-	-	33,000.00	14	2.70	-	-	

信 证 券		胜 微	06-28								
中 信 证 券	2022063000001674	卓 胜 微	2022- 06-30	6,750,000.00	50,000.00	14	2.70	7,087.50	-		
中 信 证 券	2022063000001793	沪 硅 产 业	2022- 06-30	34,470,000.00	1,500,000.00	14	0.90	12,064.50	-		
中 信 证 券	20220630000018541	卓 胜 微	2022- 06-30	135,000.00	1,000.00	14	2.70	141.75	-		
中 信 证 券	20220630000018545	捷 捷 微 电	2022- 06-30	967,200.00	39,000.00	14	3.60	1,354.08	-		
中 信 证 券	20220630000018551	圣 邦 股 份	2022- 06-30	1,274,140.00	7,000.00	14	2.20	1,090.10	-		
中 信 证 券	20220630000018553	北 京 君 正	2022- 06-30	2,125,000.00	20,000.00	14	2.70	2,231.25	-		
中 信 证 券	20220630000021535	晶 盛 机 电	2022- 06-30	743,490.00	11,000.00	14	2.80	809.58	-		
中 信 证 券	20220630000021537	扬 杰 科 技	2022- 06-30	2,308,500.00	32,400.00	14	3.20	2,872.80	-		
中 信 证 券	2022070500001087	扬 杰 科 技	2022- 07-05	4,839,600.00	74,000.00	14	3.30	6,210.82	-		
中 信 证 券	2022070500001088	扬 杰 科 技	2022- 07-05	719,400.00	11,000.00	14	3.30	923.23	-		
中 信 证 券	2022070500001100	捷 捷 微 电	2022- 07-05	611,260.00	26,000.00	14	4.30	1,022.16	-		
中 信 证 券	2022070500001118	北 京 君 正	2022- 07-05	9,791,000.00	100,000.00	14	3.40	12,945.88	-		

中信证券	2022070500008038	圣邦股份	2022-07-05	36,074,000.00	200,000.00	14	2.60	36,474.82	-	
中信证券	2022070500008040	扬杰科技	2022-07-05	654,000.00	10,000.00	14	2.70	686.70	-	
中信证券	2022070500008046	扬杰科技	2022-07-05	65,400.00	1,000.00	14	2.70	68.67	-	
中信证券	2022070500008050	景嘉微	2022-07-05	336,600.00	5,000.00	14	3.40	445.06	-	
中信证券	2022070500009372	捷捷微电	2022-07-05	1,951,330.00	83,000.00	14	3.70	2,807.75	-	
中信证券	2022070500009374	捷捷微电	2022-07-05	2,092,390.00	89,000.00	14	3.70	3,010.72	-	
中信证券	2022070600000839	北京君正	2022-07-06	9,715,000.00	100,000.00	14	3.40	12,845.39	-	
中信证券	2022070600001339	捷捷微电	2022-07-06	2,012,615.00	85,100.00	14	4.30	3,365.54	-	
中信证券	2022070600001365	晶盛机电	2022-07-06	18,386,298.00	266,700.00	14	3.40	24,310.77	-	
中信证券	2022070600012147	捷捷微电	2022-07-06	118,250.00	5,000.00	14	3.70	170.15	-	
中信证券	2022070600012149	卓胜微	2022-07-06	2,992,660.00	22,300.00	14	2.70	3,142.29	-	
中信证券	2022070700000890	捷捷微电	2022-07-07	1,978,800.00	85,000.00	14	4.30	3,308.99	-	
中信证	2022070700000995	晶盛机	2022-07-07	280,880.00	4,000.00	28	1.80	393.23	-	

券		电								
中信证券	2022070700000998	卓胜微	2022-07-07	1,958,009.00	14,900.00	14	3.10	2,360.49	-	
中信证券	2022070700001017	捷捷微电	2022-07-07	2,328,000.00	100,000.00	14	4.30	3,892.93	-	
中信证券	2022070700001024	扬杰科技	2022-07-07	261,200.00	4,000.00	14	3.30	335.21	-	
中信证券	2022070700001025	晶盛机电	2022-07-07	7,022,000.00	100,000.00	14	3.40	9,284.64	-	
中信证券	2022070700001027	北京君正	2022-07-07	23,395,000.00	250,000.00	14	3.40	30,933.39	-	
中信证券	2022070700007060	圣邦股份	2022-07-07	185,000.00	1,000.00	14	1.80	129.50	-	
中信证券	2022070700007072	北京君正	2022-07-07	93,580.00	1,000.00	14	1.80	65.51	-	
中信证券	2022070700007960	晶盛机电	2022-07-07	210,660.00	3,000.00	14	1.80	147.46	-	
中信证券	2022070700008438	捷捷微电	2022-07-07	2,139,432.00	91,900.00	14	3.70	3,078.40	-	
中信证券	2022071200000794	卓胜微	2022-07-12	500,598.00	4,200.00	14	3.40	661.90	-	
中信证券	2022071200009467	晶盛机电	2022-07-12	13,391,937.00	198,900.00	14	3.40	17,707.12	-	
中信证券	2022071200011239	捷捷微电	2022-07-12	262,680.00	12,000.00	14	4.30	439.26	-	
中信	2022071200011609	卓胜	2022-07-12	6,555,450.00	55,000.00	14	3.10	7,902.96	-	

证 券		微								
中 信 证 券	2022071300001173	捷 捷 微 电	2022- 07-13	1,994,348.00	91,400.00	14	3.90	3,024.76	-	
中 信 证 券	2022071300001219	中 微 公 司	2022- 07-13	11,263,000.00	100,000.00	14	3.10	13,578.17	-	
中 信 证 券	2022071300026570	北 京 君 正	2022- 07-13	1,705,788.00	19,600.00	14	3.40	2,255.43	-	
中 信 证 券	2022071300026572	扬 杰 科 技	2022- 07-13	1,773,350.00	29,000.00	14	3.30	2,275.80	-	
中 信 证 券	2022071400001280	中 微 公 司	2022- 07-14	453,560.00	4,000.00	14	3.10	546.79	-	
中 信 证 券	2022071400001292	扬 杰 科 技	2022- 07-14	89,474.00	1,400.00	14	3.30	114.82	-	
中 信 证 券	2022071400001293	北 京 君 正	2022- 07-14	176,480.00	2,000.00	14	3.50	240.21	-	
中 信 证 券	2022071400001312	扬 杰 科 技	2022- 07-14	63,910.00	1,000.00	14	3.30	82.02	-	
中 信 证 券	2022071400010748	沪 硅 产 业	2022- 07-14	31,155,000.00	1,500,000.00	14	1.10	13,327.42	-	
中 信 证 券	2022071400010750	北 京 君 正	2022- 07-14	1,764,800.00	20,000.00	14	3.40	2,333.46	-	
中 信 证 券	2022071400010754	扬 杰 科 技	2022- 07-14	2,070,684.00	32,400.00	14	3.30	2,657.38	-	
中 信 证 券	2022071400010756	捷 捷 微 电	2022- 07-14	874,380.00	39,000.00	14	4.30	1,462.16	-	
中	2022071400010762	卓	2022-	105,420.00	1,000.00	14	3.10	127.09	-	

信 证 券		胜 微	07-14								
中 信 证 券	2022071400010764	卓 胜 微	2022- 07-14	5,271,000.00	50,000.00	14	3.10	6,354.48	-		
中 信 证 券	2022071900000846	扬 杰 科 技	2022- 07-19	8,701,000.00	140,000.00	14	3.40	11,504.66	-		
中 信 证 券	2022071900000853	捷 捷 微 电	2022- 07-19	791,700.00	35,000.00	14	3.50	1,077.59	-		
中 信 证 券	2022071900008212	景 嘉 微	2022- 07-19	310,050.00	5,000.00	14	3.40	409.96	-		
中 信 证 券	2022071900008214	捷 捷 微 电	2022- 07-19	588,120.00	26,000.00	14	3.90	891.98	-		
中 信 证 券	2022071900008228	圣 邦 股 份	2022- 07-19	32,932,000.00	200,000.00	14	3.10	39,701.36	-		
中 信 证 券	2022071900008236	捷 捷 微 电	2022- 07-19	2,013,180.00	89,000.00	14	3.90	3,053.32	-		
中 信 证 券	2022071900008240	北 京 君 正	2022- 07-19	8,941,000.00	100,000.00	14	3.50	12,169.69	-		
中 信 证 券	2022071900008242	扬 杰 科 技	2022- 07-19	683,650.00	11,000.00	14	3.30	877.35	-		
中 信 证 券	2022071900008244	捷 捷 微 电	2022- 07-19	1,877,460.00	83,000.00	14	3.90	2,847.48	-		
中 信 证 券	2022072000000995	澜 起 科 技	2022- 07-20	27,025,000.00	500,000.00	14	3.30	34,682.08	-		
中 信 证 券	2022072000012197	卓 胜 微	2022- 07-20	2,332,134.00	22,300.00	14	3.40	3,083.60	-		

中信证券	2022072000012199	捷捷微电	2022-07-20	2,056,867.00	85,100.00	14	3.90	3,119.58	-	
中信证券	2022072000012201	捷捷微电	2022-07-20	120,850.00	5,000.00	14	3.90	183.29	-	
中信证券	2022072000012207	晶盛机电	2022-07-20	18,556,986.00	266,700.00	14	3.90	28,144.76	-	
中信证券	2022072000012209	北京君正	2022-07-20	9,014,000.00	100,000.00	14	3.50	12,269.06	-	
中信证券	2022072100001206	中微公司	2022-07-21	121,200.00	1,000.00	14	3.20	150.83	-	
中信证券	2022072100001230	澜起科技	2022-07-21	28,785,000.00	500,000.00	14	3.30	36,940.75	-	
中信证券	2022072100009246	捷捷微电	2022-07-21	2,015,350.00	85,000.00	14	3.90	3,056.61	-	
中信证券	2022072100009260	卓胜微	2022-07-21	1,594,002.00	14,900.00	14	3.40	2,107.62	-	
中信证券	2022072100009300	卓胜微	2022-07-21	203,262.00	1,900.00	28	1.80	284.57	-	
中信证券	2022072100009302	北京君正	2022-07-21	824,140.00	8,900.00	28	1.80	1,153.80	-	
中信证券	2022072100009318	北京君正	2022-07-21	23,150,000.00	250,000.00	14	3.50	31,509.72	-	
中信证券	2022072100009422	圣邦股份	2022-07-21	172,000.00	1,000.00	14	1.80	120.40	-	
中信证	2022072100009426	北京君	2022-07-21	92,600.00	1,000.00	14	1.80	64.82	-	

券		正								
中信证	2022072100010266	晶	2022-	203,580.00	3,000.00	14	1.80	142.51	-	
券		盛	07-21							
中信证	2022072200007205	盛	2022-	2,103,376.00	30,400.00	28	1.80	2,944.73	-	
券		机	07-22							
中信证	2022072600001153	电	2022-	1,996,720.00	88,000.00	14	3.50	2,717.76	-	
券		捷	07-26							
中信证	2022072600001174	捷	2022-	25,650,000.00	150,000.00	14	3.50	34,912.50	-	
券		微	07-26							
中信证	2022072600001239	电	2022-	1,704,450.00	33,000.00	14	3.30	2,187.38	-	
券		圣	07-26							
中信证	2022072600001241	邦	2022-	2,582,500.00	50,000.00	14	3.30	3,314.21	-	
券		股	07-26							
中信证	2022072600001243	份	2022-	670,440.00	12,000.00	14	2.70	703.96	-	
券		华	07-26							
中信证	2022072600011106	润	2022-	422,058.00	4,200.00	14	3.30	541.64	-	
券		微	07-26							
中信证	2022072700026014	澜	2022-	1,820,040.00	29,000.00	14	3.40	2,406.50	-	
券		起	07-27							
中信证	2022072800011599	科	2022-	492,000.00	4,000.00	14	3.20	612.27	-	
券		技	07-28							
中信证	2022072800011601	中	2022-	31,305,000.00	1,500,000.00	14	3.60	43,827.00	-	
券		微	07-28							
中信证	2022072800011603	公	2022-	171,940.00	2,000.00	14	3.20	213.97	-	
券		司	07-28							
中信	2022072800011611	沪	2022-	2,103,408.00	32,400.00	14	3.40	2,781.17	-	
		硅	07-28							
		产								
		业								
		北								
		京								
		君								
		正								
		扬								
		杰								

证券		科技								
中信证券	2022080200000950	捷捷微电	2022-08-02	90,360.00	4,000.00	14	3.60	126.50	-	
中信证券	2022080200011785	捷捷微电	2022-08-02	790,650.00	35,000.00	14	3.50	1,076.16	-	
中信证券	2022080200011787	扬杰科技	2022-08-02	8,596,000.00	140,000.00	14	3.50	11,700.11	-	
中信证券	2022080200011859	捷捷微电	2022-08-02	2,010,510.00	89,000.00	14	3.50	2,736.53	-	
中信证券	2022080200011861	捷捷微电	2022-08-02	1,874,970.00	83,000.00	14	3.50	2,552.04	-	
中信证券	2022080200011863	圣邦股份	2022-08-02	34,120,000.00	200,000.00	14	3.50	46,441.11	-	
中信证券	2022080200011875	景嘉微	2022-08-02	295,500.00	5,000.00	14	3.40	390.72	-	
中信证券	2022080200011895	扬杰科技	2022-08-02	675,400.00	11,000.00	14	3.50	919.29	-	
中信证券	2022080300001938	圣邦股份	2022-08-03	1,360,000.00	8,000.00	14	3.40	1,798.22	-	
中信证券	2022080300014601	澜起科技	2022-08-03	29,030,000.00	500,000.00	14	2.80	31,610.44	-	
中信证券	2022080300015007	卓胜微	2022-08-03	2,165,776.00	22,300.00	14	3.40	2,863.64	-	
中信证券	2022080300015049	晶盛机电	2022-08-03	18,967,704.00	266,700.00	14	2.70	19,916.09	-	
中	2022080300015053	捷	2022-	1,974,320.00	85,100.00	14	3.50	2,687.27	-	

信 证 券		捷 微 电	08-03								
中 信 证 券	2022080300015057	捷 捷 微 电	2022- 08-03	116,000.00	5,000.00	14	3.50	157.89	-		
中 信 证 券	2022080400002507	卓 胜 微	2022- 08-04	1,205,400.00	12,000.00	14	3.00	1,406.30	-		
中 信 证 券	2022080400002517	景 嘉 微	2022- 08-04	3,392,000.00	50,000.00	14	3.40	4,484.98	-		
中 信 证 券	2022080400012992	澜 起 科 技	2022- 08-04	29,605,000.00	500,000.00	14	2.80	32,236.56	-		
中 信 证 券	2022080400013014	晶 盛 机 电	2022- 08-04	281,800.00	4,000.00	28	1.80	394.52	-		
中 信 证 券	2022080400014810	中 微 公 司	2022- 08-04	136,000.00	1,000.00	14	4.90	259.16	-		
中 信 证 券	2022080400014898	捷 捷 微 电	2022- 08-04	2,034,900.00	85,000.00	14	3.50	2,769.73	-		
中 信 证 券	2022080400014958	圣 邦 股 份	2022- 08-04	174,230.00	1,000.00	14	1.80	121.96	-		
中 信 证 券	2022080400014960	北 京 君 正	2022- 08-04	95,060.00	1,000.00	14	1.80	66.54	-		
中 信 证 券	2022080400015036	晶 盛 机 电	2022- 08-04	211,350.00	3,000.00	14	1.80	147.95	-		
中 信 证 券	2022080400016055	澜 起 科 技	2022- 07-26	3,600.00	-	14	2.70	-	-		
中 信 证 券	2022080400016256	澜 起 科 技	2022- 08-03	150,000.00	-	14	2.80	-	-		

中信证券	2022080400016292	澜起科技	2022-08-04	150,000.00	-	14	2.80	-	-	
中信证券	2022080900001428	捷捷微电	2022-08-09	550,000.00	22,000.00	14	3.40	727.22	-	
中信证券	2022080900001432	扬杰科技	2022-08-09	1,323,000.00	20,000.00	14	3.40	1,749.30	-	
中信证券	2022080900001434	景嘉微	2022-08-09	1,874,880.00	28,000.00	14	3.40	2,479.01	-	
中信证券	2022080900001469	中微公司	2022-08-09	1,153,680.00	8,000.00	14	5.40	2,422.73	-	
中信证券	2022080900013138	捷捷微电	2022-08-09	2,200,000.00	88,000.00	14	3.60	3,080.00	-	
中信证券	2022080900013148	圣邦股份	2022-08-09	27,433,500.00	150,000.00	14	3.40	36,273.18	-	
中信证券	2022080900013156	华润微	2022-08-09	1,892,220.00	33,000.00	14	3.40	2,501.94	-	
中信证券	2022080900013158	华润微	2022-08-09	2,867,000.00	50,000.00	14	3.40	3,790.81	-	
中信证券	2022081000032688	扬杰科技	2022-08-10	1,873,980.00	29,000.00	14	3.30	2,404.94	-	
中信证券	2022081100001703	景嘉微	2022-08-11	2,230,060.00	34,000.00	14	3.40	2,948.63	-	
中信证券	2022081100001721	捷捷微电	2022-08-11	493,400.00	20,000.00	14	3.40	652.38	-	
中信证	2022081100001722	北京君	2022-08-11	18,874,000.00	200,000.00	14	3.30	24,221.63	-	

券		正								
中信证券	2022081100014444	北京君正	2022-08-11	188,740.00	2,000.00	14	3.40	249.56	-	
中信证券	2022081100014540	沪硅产业	2022-08-11	33,930,000.00	1,500,000.00	14	2.70	35,626.50	-	
中信证券	2022081100014598	中微公司	2022-08-11	587,000.00	4,000.00	14	4.30	981.59	-	
中信证券	2022081600000981	澜起科技	2022-08-16	5,645,000.00	100,000.00	14	1.80	3,951.50	-	
中信证券	2022081600008368	圣邦股份	2022-08-16	33,984,000.00	200,000.00	14	3.40	44,934.40	-	
中信证券	2022081600010072	捷捷微电	2022-08-16	96,840.00	4,000.00	14	3.40	128.04	-	
中信证券	2022081600010090	捷捷微电	2022-08-16	2,154,690.00	89,000.00	14	3.40	2,848.98	-	
中信证券	2022081600010092	捷捷微电	2022-08-16	2,009,430.00	83,000.00	14	3.40	2,656.91	-	
中信证券	2022081600010094	捷捷微电	2022-08-16	847,350.00	35,000.00	14	3.40	1,120.39	-	
中信证券	2022081600010096	景嘉微	2022-08-16	310,700.00	5,000.00	14	3.40	410.81	-	
中信证券	2022081600010108	扬杰科技	2022-08-16	8,951,600.00	140,000.00	14	3.40	11,836.00	-	
中信证券	2022081600010110	扬杰科技	2022-08-16	703,340.00	11,000.00	14	3.40	929.97	-	
中信	2022081700002131	景嘉	2022-08-17	747,840.00	12,000.00	14	3.50	1,017.89	-	

证券		微								
中信证券	2022081700018325	捷捷微电	2022-08-17	121,550.00	5,000.00	14	3.40	160.72	-	
中信证券	2022081700018327	捷捷微电	2022-08-17	2,068,781.00	85,100.00	14	3.40	2,735.39	-	
中信证券	2022081700018377	卓胜微	2022-08-17	2,283,520.00	22,300.00	14	3.30	2,930.52	-	
中信证券	2022081700018393	圣邦股份	2022-08-17	1,372,400.00	8,000.00	14	3.40	1,814.62	-	
中信证券	2022081700018679	澜起科技	2022-08-17	28,205,000.00	500,000.00	14	3.20	35,099.56	-	
中信证券	2022081700018803	晶盛机电	2022-08-17	20,295,870.00	266,700.00	14	4.10	32,360.64	-	
中信证券	2022081800001209	景嘉微	2022-08-18	388,710.00	6,300.00	14	3.50	529.08	-	
中信证券	2022081800013391	卓胜微	2022-08-18	1,234,560.00	12,000.00	14	3.30	1,584.35	-	
中信证券	2022081800014927	北京君正	2022-08-18	89,400.00	1,000.00	14	1.80	62.58	-	
中信证券	2022081800014933	晶盛机电	2022-08-18	252,030.00	3,000.00	14	1.80	176.42	-	
中信证券	2022081800015121	圣邦股份	2022-08-18	170,690.00	1,000.00	14	1.80	119.48	-	
中信证券	2022081800015391	澜起科技	2022-08-18	27,975,000.00	500,000.00	14	3.20	34,813.33	-	
中	2022081800015395	中	2022-	139,800.00	1,000.00	14	5.40	293.58	-	

信 证 券		微 公 司	08-18								
中 信 证 券	2022081800015429	捷 捷 微 电	2022- 08-18	2,123,300.00	85,000.00	14	3.40	2,807.47	-		
中 信 证 券	2022082300013458	华 润 微	2022- 08-23	2,763,500.00	50,000.00	14	3.20	3,439.02	-		
中 信 证 券	2022082300013782	圣 邦 股 份	2022- 08-23	24,967,500.00	150,000.00	14	3.30	32,041.63	-		
中 信 证 券	2022082300015592	捷 捷 微 电	2022- 08-23	2,060,080.00	88,000.00	14	3.30	2,643.77	-		
中 信 证 券	2022082300015624	景 嘉 微	2022- 08-23	1,743,000.00	28,000.00	14	3.50	2,372.42	-		
中 信 证 券	2022082300015626	扬 杰 科 技	2022- 08-23	1,257,200.00	20,000.00	14	3.30	1,613.41	-		
中 信 证 券	2022082300015646	捷 捷 微 电	2022- 08-23	515,020.00	22,000.00	14	3.30	660.94	-		
中 信 证 券	2022082300015656	中 微 公 司	2022- 08-23	1,088,960.00	8,000.00	14	4.00	1,693.94	-		
中 信 证 券	2022082300015674	华 润 微	2022- 08-23	1,823,910.00	33,000.00	14	3.20	2,269.75	-		
中 信 证 券	2022082400001530	捷 捷 微 电	2022- 08-24	84,322.00	3,800.00	14	3.30	108.21	-		
中 信 证 券	2022082400027007	扬 杰 科 技	2022- 08-24	1,798,000.00	29,000.00	14	3.30	2,307.43	-		
中 信 证 券	2022082500001387	捷 捷 微 电	2022- 08-25	1,186,254.00	53,100.00	14	3.30	1,522.36	-		

中信证券	2022082500001405	景嘉微	2022-08-25	968,352.00	16,800.00	14	3.50	1,318.03	-	
中信证券	2022082500010494	捷捷微电	2022-08-25	446,800.00	20,000.00	14	3.30	573.39	-	
中信证券	2022082500010498	北京君正	2022-08-25	16,424,000.00	200,000.00	14	3.40	21,716.18	-	
中信证券	2022082500010524	景嘉微	2022-08-25	1,959,760.00	34,000.00	14	3.50	2,667.45	-	
中信证券	2022082500010526	北京君正	2022-08-25	164,240.00	2,000.00	14	3.40	217.16	-	
中信证券	2022082500010616	中微公司	2022-08-25	519,800.00	4,000.00	14	4.00	808.58	-	
中信证券	2022082500010634	沪硅产业	2022-08-25	30,330,000.00	1,500,000.00	14	3.00	35,385.00	-	
中信证券	2022083000012538	扬杰科技	2022-08-30	8,572,200.00	140,000.00	14	3.50	11,667.72	-	
中信证券	2022083000012556	捷捷微电	2022-08-30	1,898,370.00	89,000.00	14	3.30	2,436.24	-	
中信证券	2022083000012560	捷捷微电	2022-08-30	85,320.00	4,000.00	14	3.30	109.49	-	
中信证券	2022083000012566	捷捷微电	2022-08-30	746,550.00	35,000.00	14	3.30	958.07	-	
中信证券	2022083000013230	景嘉微	2022-08-30	284,200.00	5,000.00	14	3.50	386.83	-	
中信证	2022083000013974	圣邦股	2022-08-30	32,560,000.00	200,000.00	14	3.30	41,785.33	-	

券		份								
中信证券	2022083000014324	澜起科技	2022-08-30	5,442,000.00	100,000.00	14	1.80	3,809.40	-	
中信证券	2022083100001658	景嘉微	2022-08-31	1,476,300.00	26,600.00	14	3.40	1,952.00	-	
中信证券	2022083100001660	捷捷微电	2022-08-31	1,154,812.00	55,600.00	14	3.30	1,482.01	-	
中信证券	2022083100016528	捷捷微电	2022-08-31	103,850.00	5,000.00	14	3.30	133.27	-	
中信证券	2022083100017504	捷捷微电	2022-08-31	1,767,527.00	85,100.00	14	3.30	2,268.33	-	
中信证券	2022083100018034	卓胜微	2022-08-31	2,268,802.00	22,300.00	14	3.20	2,823.40	-	
中信证券	2022083100018054	澜起科技	2022-08-31	27,750,000.00	500,000.00	14	3.00	32,375.00	-	
中信证券	2022083100018122	晶盛机电	2022-08-31	20,269,200.00	266,700.00	14	3.20	25,223.89	-	
中信证券	2022090100001093	景嘉微	2022-09-01	6,235,590.00	104,100.00	14	3.40	8,244.84	-	
中信证券	2022090100013518	圣邦股份	2022-09-01	155,940.00	1,000.00	14	1.80	109.16	-	
中信证券	2022090100015364	景嘉微	2022-09-01	377,370.00	6,300.00	14	3.50	513.64	-	
中信证券	2022090100015380	卓胜微	2022-09-01	1,183,800.00	12,000.00	14	3.00	1,381.10	-	
中信	2022090100015400	捷捷	2022-09-01	1,748,450.00	85,000.00	14	3.30	2,243.84	-	

证券		微电								
中信证券	2022090100015448	澜起科技	2022-09-01	28,240,000.00	500,000.00	14	2.70	29,652.00	-	
中信证券	2022090100015450	中微公司	2022-09-01	121,700.00	1,000.00	14	3.10	146.72	-	
中信证券	2022090100017852	晶盛机电	2022-09-01	223,410.00	3,000.00	14	1.80	156.39	-	
中信证券	2022090100018624	北京君正	2022-09-01	80,530.00	1,000.00	14	1.80	56.37	-	
中信证券	2022090100018708	晶盛机电	2022-09-01	297,880.00	4,000.00	28	1.80	417.03	-	
中信证券	2022090600001258	景嘉微	2022-09-06	1,505,730.00	26,500.00	14	3.70	2,166.58	-	
中信证券	2022090600014103	景嘉微	2022-09-06	1,590,960.00	28,000.00	14	3.40	2,103.60	-	
中信证券	2022090600014107	扬杰科技	2022-09-06	1,159,800.00	20,000.00	14	3.30	1,488.41	-	
中信证券	2022090600014115	华润微	2022-09-06	2,576,500.00	50,000.00	14	3.40	3,406.71	-	
中信证券	2022090600014117	华润微	2022-09-06	1,700,490.00	33,000.00	14	3.40	2,248.43	-	
中信证券	2022090600014177	捷捷微电	2022-09-06	465,960.00	22,000.00	14	3.30	597.98	-	
中信证券	2022090600014179	捷捷微电	2022-09-06	1,863,840.00	88,000.00	14	3.30	2,391.93	-	
中	2022090600014259	中	2022-	985,680.00	8,000.00	14	3.80	1,456.62	-	

信 证 券		微 公 司	09-06								
中 信 证 券	2022090600014335	圣 邦 股 份	2022- 09-06	22,905,000.00	150,000.00	14	3.10	27,613.25	-		
中 信 证 券	2022090700001196	景 嘉 微	2022- 09-07	1,521,960.00	26,400.00	14	3.70	2,189.93	-		
中 信 证 券	2022090700029772	捷 捷 微 电	2022- 09-07	81,548.00	3,800.00	14	3.30	104.65	-		
中 信 证 券	2022090700029822	扬 杰 科 技	2022- 09-07	1,681,130.00	29,000.00	14	3.30	2,157.45	-		
中 信 证 券	2022090800001145	景 嘉 微	2022- 09-08	1,934,178.00	34,700.00	14	3.70	2,783.07	-		
中 信 证 券	2022090800015106	景 嘉 微	2022- 09-08	936,432.00	16,800.00	14	3.40	1,238.17	-		
中 信 证 券	2022090800015358	沪 硅 产 业	2022- 09-08	30,495,000.00	1,500,000.00	14	3.10	36,763.42	-		
中 信 证 券	2022090800015402	捷 捷 微 电	2022- 09-08	420,200.00	20,000.00	14	3.30	539.26	-		
中 信 证 券	2022090800015408	北 京 君 正	2022- 09-08	15,524,000.00	200,000.00	14	3.30	19,922.47	-		
中 信 证 券	2022090800015410	北 京 君 正	2022- 09-08	155,240.00	2,000.00	14	3.30	199.22	-		
中 信 证 券	2022091300001569	景 嘉 微	2022- 09-13	488,505.00	8,700.00	14	3.80	721.90	-		
中 信 证 券	2022091300001593	捷 捷 微 电	2022- 09-13	1,185,520.00	56,000.00	14	3.50	1,613.62	-		

中信证券	2022091300027467	扬杰科技	2022-09-13	7,964,600.00	140,000.00	14	3.30	10,221.24	-	
中信证券	2022091300027487	景嘉微	2022-09-13	280,750.00	5,000.00	14	3.70	403.97	-	
中信证券	2022091300027495	捷捷微电	2022-09-13	1,884,130.00	89,000.00	14	3.40	2,491.24	-	
中信证券	2022091300027497	捷捷微电	2022-09-13	84,680.00	4,000.00	14	3.40	111.97	-	
中信证券	2022091300027499	捷捷微电	2022-09-13	740,950.00	35,000.00	14	3.40	979.70	-	
中信证券	2022091300031611	澜起科技	2022-09-13	5,821,000.00	100,000.00	14	1.80	4,074.70	-	
中信证券	2022091400001727	景嘉微	2022-09-14	1,844,466.00	32,100.00	14	3.80	2,725.71	-	
中信证券	2022091400001737	扬杰科技	2022-09-14	10,332,168.00	184,800.00	14	3.40	13,661.42	-	
中信证券	2022091400001764	中芯国际	2022-09-14	15,268,400.00	380,000.00	28	3.00	35,626.27	-	
中信证券	2022091400018394	卓胜微	2022-09-14	2,244,495.00	22,300.00	14	3.40	2,967.72	-	
中信证券	2022091400018712	景嘉微	2022-09-14	1,528,436.00	26,600.00	14	3.70	2,199.25	-	
中信证券	2022091400018714	捷捷微电	2022-09-14	1,158,148.00	55,600.00	14	3.40	1,531.33	-	
中信证	2022091400018778	澜起科	2022-09-14	29,105,000.00	500,000.00	14	3.20	36,219.56	-	

券		技								
中信证券	2022091400018824	捷捷微电	2022-09-14	1,772,633.00	85,100.00	14	3.40	2,343.81	-	
中信证券	2022091400019342	晶盛机电	2022-09-14	21,488,019.00	266,700.00	14	2.90	24,233.71	-	
中信证券	2022091500016273	卓胜微	2022-09-15	1,247,400.00	12,000.00	14	3.40	1,649.34	-	
中信证券	2022091500016307	景嘉微	2022-09-15	352,044.00	6,300.00	14	3.70	506.55	-	
中信证券	2022091500016327	澜起科技	2022-09-15	28,350,000.00	500,000.00	14	3.20	35,280.00	-	
中信证券	2022091500016329	中微公司	2022-09-15	126,980.00	1,000.00	14	3.60	177.77	-	
中信证券	2022091500016335	捷捷微电	2022-09-15	1,698,300.00	85,000.00	14	3.40	2,245.53	-	
中信证券	2022091500017615	北京君正	2022-09-15	74,990.00	1,000.00	14	1.80	52.49	-	
中信证券	2022091500017665	晶盛机电	2022-09-15	219,000.00	3,000.00	14	1.80	153.30	-	
中信证券	2022091500018193	圣邦股份	2022-09-15	143,450.00	1,000.00	14	1.80	100.42	-	
中信证券	2022092000001384	沪硅产业	2022-09-20	388,600.00	20,000.00	14	3.20	690.84	-	
中信证券	2022092000001403	中微公司	2022-09-20	861,700.00	7,000.00	14	2.80	1,340.43	-	
中信	2022092000001522	景嘉	2022-09-20	3,910,400.00	75,200.00	14	3.60	7,820.80	-	

证券		微								
中信证券	2022092000014575	景嘉微	2022-09-20	1,378,000.00	26,500.00	14	3.80	2,909.11	-	
中信证券	2022092000014645	景嘉微	2022-09-20	1,456,000.00	28,000.00	14	3.80	3,073.77	-	
中信证券	2022092000014659	中微公司	2022-09-20	984,800.00	8,000.00	14	3.50	1,914.89	-	
中信证券	2022092000018721	圣邦股份	2022-09-20	21,558,000.00	150,000.00	14	3.20	38,325.33	-	
中信证券	2022092000018849	捷捷微电	2022-09-20	423,500.00	22,000.00	14	3.50	823.47	-	
中信证券	2022092000018851	捷捷微电	2022-09-20	1,694,000.00	88,000.00	14	3.50	3,293.89	-	
中信证券	2022092000019051	华润微	2022-09-20	2,470,500.00	50,000.00	14	2.00	2,745.00	-	
中信证券	2022092000019053	华润微	2022-09-20	1,630,530.00	33,000.00	14	2.00	1,811.70	-	
中信证券	2022092100026280	捷捷微电	2022-09-21	74,100.00	3,800.00	14	3.50	136.88	-	
中信证券	2022092100026304	扬杰科技	2022-09-21	1,515,250.00	29,000.00	14	3.40	2,719.03	-	
中信证券	2022092100026940	景嘉微	2022-09-21	1,315,512.00	26,400.00	14	3.80	2,638.33	-	
中信证券	2022092200000782	捷捷微电	2022-09-22	346,723.00	17,900.00	28	3.50	943.86	-	
中	2022092200000786	扬	2022-	301,194.00	5,800.00	14	3.40	512.03	-	

信 证 券		杰 科 技	09-22								
中 信 证 券	2022092200011353	捷 捷 微 电	2022- 09-22	387,400.00	20,000.00	14	3.50	677.95	-		
中 信 证 券	2022092200011447	景 嘉 微	2022- 09-22	838,824.00	16,800.00	14	3.80	1,593.77	-		
中 信 证 券	2022092700001120	捷 捷 微 电	2022- 09-27	1,183,005.00	62,100.00	14	3.50	1,610.20	-		
中 信 证 券	2022092700001160	北 京 君 正	2022- 09-27	7,442,260.00	100,300.00	14	2.90	8,393.22	-		
中 信 证 券	2022092700022975	捷 捷 微 电	2022- 09-27	1,695,450.00	89,000.00	14	3.60	2,373.63	-		
中 信 证 券	2022092700022977	捷 捷 微 电	2022- 09-27	666,750.00	35,000.00	14	3.60	933.45	-		
中 信 证 券	2022092700023067	捷 捷 微 电	2022- 09-27	1,066,800.00	56,000.00	14	3.60	1,493.52	-		
中 信 证 券	2022092700028271	澜 起 科 技	2022- 09-27	5,289,000.00	100,000.00	14	1.80	3,702.30	-		
中 信 证 券	2022092800015093	晶 盛 机 电	2022- 09-28	18,375,630.00	266,700.00	14	2.90	20,723.63	-		
中 信 证 券	2022092800015115	卓 胜 微	2022- 09-28	2,112,033.00	22,300.00	14	3.20	2,628.31	-		
中 信 证 券	2022092800015915	景 嘉 微	2022- 09-28	1,518,972.00	32,100.00	14	3.60	2,126.56	-		
中 信 证 券	2022092800015947	澜 起 科 技	2022- 09-28	26,225,000.00	500,000.00	14	3.40	34,675.28	-		

中信证券	2022092900000883	景嘉微	2022-09-29	812,770.00	17,000.00	14	3.30	1,043.05	-	
中信证券	2022092900014441	澜起科技	2022-09-29	26,605,000.00	500,000.00	14	3.40	35,177.72	-	
中信证券	2022092900016411	卓胜微	2022-09-29	1,100,160.00	12,000.00	14	3.20	1,369.09	-	
中信证券	2022092900016421	捷捷微电	2022-09-29	1,547,000.00	85,000.00	14	3.60	2,165.80	-	
中信证券	2022092900016601	晶盛机电	2022-09-29	280,680.00	4,000.00	28	1.80	392.95	-	
中信证券	2022101000080073	圣邦股份	2022-10-10	20,415,000.00	150,000.00	14	3.20	25,405.33	-	
中信证券	2022101000102685	景嘉微	2022-10-10	749,448.00	16,800.00	14	3.30	961.79	-	
中信证券	2022101000102789	景嘉微	2022-10-10	3,354,672.00	75,200.00	14	3.30	4,305.16	-	
中信证券	2022101000103649	捷捷微电	2022-10-10	343,000.00	20,000.00	14	3.50	466.86	-	
中信证券	2022101000103719	捷捷微电	2022-10-10	377,300.00	22,000.00	14	3.50	513.55	-	
中信证券	2022101000103721	捷捷微电	2022-10-10	1,509,200.00	88,000.00	14	3.50	2,054.19	-	
中信证券	2022101000104461	景嘉微	2022-10-10	1,177,704.00	26,400.00	14	3.30	1,511.39	-	
中信证	2022101000104593	景嘉微	2022-10-10	1,182,165.00	26,500.00	14	3.30	1,517.11	-	

券										
中信证券	2022101000105923	捷捷微电	2022-10-10	65,170.00	3,800.00	14	3.50	88.70	-	
中信证券	2022101000107163	扬杰科技	2022-10-10	269,700.00	5,800.00	14	3.50	367.09	-	
中信证券	2022101000107223	沪硅产业	2022-10-10	341,000.00	20,000.00	14	3.30	437.62	-	
中信证券	2022101000107225	中微公司	2022-10-10	608,580.00	7,000.00	14	3.40	804.68	-	
中信证券	2022101000107789	景嘉微	2022-10-10	1,249,080.00	28,000.00	14	3.30	1,602.99	-	
中信证券	2022101000108079	华润微	2022-10-10	2,234,500.00	50,000.00	14	3.30	2,867.61	-	
中信证券	2022101000108081	华润微	2022-10-10	1,474,770.00	33,000.00	14	3.30	1,892.62	-	
中信证券	2022101000108085	中微公司	2022-10-10	695,520.00	8,000.00	14	3.40	919.63	-	
中信证券	2022101100002495	北京君正	2022-10-11	1,036,000.00	16,000.00	14	3.30	1,329.53	-	
中信证券	2022101100002496	北京君正	2022-10-11	259,000.00	4,000.00	28	3.20	644.62	-	
中信证券	2022101100002516	景嘉微	2022-10-11	2,009,280.00	44,800.00	14	3.60	2,812.99	-	
中信证券	2022101100023173	北京君正	2022-10-11	6,494,425.00	100,300.00	14	2.90	7,324.27	-	
中信	2022101100023233	捷捷	2022-10-11	1,537,030.00	89,000.00	14	3.50	2,092.07	-	

证券		微电								
中信证券	2022101100023235	捷捷微电	2022-10-11	604,450.00	35,000.00	14	3.50	822.72	-	
中信证券	2022101100024233	捷捷微电	2022-10-11	1,072,467.00	62,100.00	14	3.50	1,459.75	-	
中信证券	2022101100024291	捷捷微电	2022-10-11	967,120.00	56,000.00	14	3.50	1,316.36	-	
中信证券	2022101100029179	澜起科技	2022-10-11	4,296,000.00	100,000.00	14	1.80	3,007.20	-	
中信证券	2022101200002397	北京君正	2022-10-12	2,129,010.00	30,900.00	14	3.30	2,732.23	-	
中信证券	2022101200016002	卓胜微	2022-10-12	1,873,646.00	22,300.00	14	3.10	2,258.78	-	
中信证券	2022101200016010	中芯国际	2022-10-12	14,238,600.00	380,000.00	28	3.00	33,223.40	-	
中信证券	2022101200016070	晶盛机电	2022-10-12	17,735,550.00	266,700.00	14	3.30	22,760.62	-	
中信证券	2022101200016118	澜起科技	2022-10-12	22,005,000.00	500,000.00	14	3.50	29,951.25	-	
中信证券	2022101200019518	景嘉微	2022-10-12	1,513,515.00	32,100.00	14	3.30	1,942.34	-	
中信证券	2022101300015816	卓胜微	2022-10-13	985,200.00	12,000.00	14	3.10	1,187.71	-	
中信证券	2022101300016432	捷捷微电	2022-10-13	1,538,500.00	85,000.00	14	3.50	2,094.07	-	
中	2022101300016488	澜	2022-	22,460,000.00	500,000.00	14	3.50	30,570.56	-	

信 证 券		起 科 技	10-13								
中 信 证 券	2022101900001165	澜 起 科 技	2022-10-19	4,588,360.00	98,000.00	14	3.30	5,888.40	-		
中 信 证 券	2022102000003849	捷 捷 微 电	2022-10-20	335,625.00	17,900.00	28	3.30	861.44	-		
中 信 证 券	2022102400081979	圣 邦 股 份	2022-10-24	23,085,000.00	150,000.00	14	2.90	26,034.75	-		
中 信 证 券	2022102400084013	捷 捷 微 电	2022-10-24	1,619,200.00	88,000.00	14	3.10	1,952.04	-		
中 信 证 券	2022102400084525	景 嘉 微	2022-10-24	1,382,040.00	26,400.00	14	3.60	1,934.86	-		
中 信 证 券	2022102400084555	捷 捷 微 电	2022-10-24	404,800.00	22,000.00	14	3.40	535.24	-		
中 信 证 券	2022102400084639	景 嘉 微	2022-10-24	879,480.00	16,800.00	14	3.60	1,231.27	-		
中 信 证 券	2022102400084645	景 嘉 微	2022-10-24	1,387,275.00	26,500.00	14	3.60	1,942.19	-		
中 信 证 券	2022102400084711	捷 捷 微 电	2022-10-24	368,000.00	20,000.00	14	3.40	486.58	-		
中 信 证 券	2022102400086675	沪 硅 产 业	2022-10-24	388,000.00	20,000.00	14	2.90	437.58	-		
中 信 证 券	2022102400086677	中 微 公 司	2022-10-24	679,280.00	7,000.00	14	2.70	713.24	-		
中 信 证 券	2022102400086679	捷 捷 微 电	2022-10-24	69,920.00	3,800.00	14	3.40	92.45	-		

中信证券	2022102400087801	扬杰科技	2022-10-24	293,538.00	5,800.00	14	3.40	388.12	-	
中信证券	2022102400088879	景嘉微	2022-10-24	1,465,800.00	28,000.00	14	3.70	2,109.12	-	
中信证券	2022102400090259	华润微	2022-10-24	2,440,000.00	50,000.00	14	3.40	3,226.22	-	
中信证券	2022102400090261	华润微	2022-10-24	1,610,400.00	33,000.00	14	3.40	2,129.31	-	
中信证券	2022102400090323	中微公司	2022-10-24	776,320.00	8,000.00	14	2.70	815.14	-	
中信证券	2022102500022400	北京君正	2022-10-25	1,077,120.00	16,000.00	14	3.10	1,298.53	-	
中信证券	2022102500022488	捷捷微电	2022-10-25	1,131,462.00	62,100.00	14	3.10	1,364.04	-	
中信证券	2022102500024536	景嘉微	2022-10-25	2,318,400.00	44,800.00	14	3.70	3,335.92	-	
中信证券	2022102500024626	捷捷微电	2022-10-25	1,621,580.00	89,000.00	14	3.10	1,954.90	-	
中信证券	2022102500024628	捷捷微电	2022-10-25	637,700.00	35,000.00	14	3.10	768.78	-	
中信证券	2022102500024632	捷捷微电	2022-10-25	1,020,320.00	56,000.00	14	3.10	1,230.05	-	
中信证券	2022102500028572	澜起科技	2022-10-25	4,955,000.00	100,000.00	14	1.80	3,468.50	-	
中信证	2022102600002340	圣邦股	2022-10-26	13,251,600.00	81,800.00	14	3.30	17,006.22	-	

券		份								
中信证券	2022102600018534	澜起科技	2022-10-26	26,165,000.00	500,000.00	14	3.30	33,578.42	-	
中信证券	2022102600018594	景嘉微	2022-10-26	1,887,159.00	32,100.00	14	3.70	2,715.41	-	
中信证券	2022102600022914	晶盛机电	2022-10-26	20,485,227.00	266,700.00	14	3.20	25,492.73	-	
中信证券	2022102600022978	北京君正	2022-10-26	2,172,270.00	30,900.00	14	3.10	2,618.79	-	
中信证券	2022102600023048	卓胜微	2022-10-26	1,940,323.00	22,300.00	14	2.90	2,188.25	-	
中信证券	2022102700001512	北京君正	2022-10-27	3,471,000.00	50,000.00	14	3.00	4,049.50	-	
中信证券	2022102700001514	北京君正	2022-10-27	5,074,602.00	73,100.00	14	3.00	5,920.37	-	
中信证券	2022102700016341	晶盛机电	2022-10-27	305,840.00	4,000.00	28	1.80	428.18	-	
中信证券	2022102700019211	捷捷微电	2022-10-27	1,593,750.00	85,000.00	14	3.10	1,921.35	-	
中信证券	2022102700019315	澜起科技	2022-10-27	27,000,000.00	500,000.00	14	3.30	34,650.00	-	
中信证券	2022102700019363	卓胜微	2022-10-27	1,038,600.00	12,000.00	14	2.90	1,171.31	-	
中信证券	2022110100001309	景嘉微	2022-11-01	2,220,372.00	32,400.00	14	3.80	3,281.22	-	
中信	2022110200001143	圣邦	2022-11-02	16,677,694.00	111,400.00	14	3.40	22,051.62	-	

证券		股份								
中信证券	2022110200010030	澜起科技	2022-11-02	5,838,840.00	98,000.00	14	3.40	7,720.24	-	
中信证券	2022110300001644	卓胜微	2022-11-03	225,764.00	2,200.00	14	3.30	289.73	-	
中信证券	2022110700076473	捷捷微电	2022-11-07	1,722,160.00	88,000.00	14	3.40	2,277.08	-	
中信证券	2022110700090173	圣邦股份	2022-11-07	24,241,500.00	150,000.00	14	3.40	32,052.65	-	
中信证券	2022110700091465	景嘉微	2022-11-07	1,673,210.00	26,500.00	14	3.80	2,472.63	-	
中信证券	2022110700091873	捷捷微电	2022-11-07	391,400.00	20,000.00	14	3.40	517.52	-	
中信证券	2022110700091885	扬杰科技	2022-11-07	318,130.00	5,800.00	14	3.10	383.52	-	
中信证券	2022110700091901	捷捷微电	2022-11-07	430,540.00	22,000.00	14	3.40	569.27	-	
中信证券	2022110700092521	景嘉微	2022-11-07	1,060,752.00	16,800.00	14	3.80	1,567.56	-	
中信证券	2022110700092543	华润微	2022-11-07	2,625,500.00	50,000.00	14	3.20	3,267.29	-	
中信证券	2022110700092545	华润微	2022-11-07	1,732,830.00	33,000.00	14	3.20	2,156.41	-	
中信证券	2022110700094459	捷捷微电	2022-11-07	74,366.00	3,800.00	14	3.40	98.33	-	
中	2022110700094657	景	2022-	1,767,920.00	28,000.00	14	3.80	2,612.59	-	

信 证 券		嘉 微	11-07								
中 信 证 券	2022110700097723	景 嘉 微	2022- 11-07	1,666,896.00	26,400.00	14	3.80	2,463.30	-		
中 信 证 券	2022110800024645	北 京 君 正	2022- 11-08	1,145,440.00	16,000.00	14	3.30	1,469.98	-		
中 信 证 券	2022110800026313	捷 捷 微 电	2022- 11-08	679,700.00	35,000.00	14	3.40	898.71	-		
中 信 证 券	2022110800026331	捷 捷 微 电	2022- 11-08	1,205,982.00	62,100.00	14	3.40	1,594.58	-		
中 信 证 券	2022110800026333	捷 捷 微 电	2022- 11-08	1,087,520.00	56,000.00	14	3.40	1,437.94	-		
中 信 证 券	2022110800027575	景 嘉 微	2022- 11-08	2,912,000.00	44,800.00	14	3.80	4,303.29	-		
中 信 证 券	2022110800027633	北 京 君 正	2022- 11-08	286,360.00	4,000.00	28	3.20	712.72	-		
中 信 证 券	2022110800028799	澜 起 科 技	2022- 11-08	6,320,000.00	100,000.00	14	1.80	4,424.00	-		
中 信 证 券	2022110800029209	捷 捷 微 电	2022- 11-08	1,728,380.00	89,000.00	14	3.40	2,285.30	-		
中 信 证 券	2022110900001524	卓 胜 微	2022- 11-09	15,502,500.00	150,000.00	14	1.80	10,851.75	-		
中 信 证 券	2022110900017829	圣 邦 股 份	2022- 11-09	12,629,920.00	81,800.00	14	3.40	16,699.56	-		
中 信 证 券	2022110900022311	卓 胜 微	2022- 11-09	2,304,705.00	22,300.00	14	3.30	2,957.70	-		

中信证券	2022110900023081	北京君正	2022-11-09	2,193,282.00	30,900.00	14	3.30	2,814.71	-	
中信证券	2022110900023151	澜起科技	2022-11-09	32,000,000.00	500,000.00	14	3.20	39,822.22	-	
中信证券	2022110900023163	景嘉微	2022-11-09	2,071,734.00	32,100.00	14	3.80	3,061.56	-	
中信证券	2022110900023759	晶盛机电	2022-11-09	19,570,446.00	266,700.00	14	3.10	23,593.26	-	
中信证券	2022111000018134	捷捷微电	2022-11-10	1,616,700.00	85,000.00	14	3.40	2,137.64	-	
中信证券	2022111000018146	卓胜微	2022-11-10	1,197,360.00	12,000.00	14	3.30	1,536.61	-	
中信证券	2022111000018210	澜起科技	2022-11-10	31,905,000.00	500,000.00	14	3.20	39,704.00	-	
中信证券	2022111500001360	捷捷微电	2022-11-15	1,051,915.00	50,500.00	14	2.90	1,186.33	-	
中信证券	2022111500001396	捷捷微电	2022-11-15	520,750.00	25,000.00	14	2.90	587.29	-	
中信证券	2022111600001058	北京君正	2022-11-16	1,483,140.00	19,000.00	14	3.40	1,961.04	-	
中信证券	2022111600001059	北京君正	2022-11-16	23,418,000.00	300,000.00	14	3.40	30,963.80	-	
中信证券	2022111600001065	北京君正	2022-11-16	1,178,706.00	15,100.00	14	3.40	1,558.51	-	
中信证	2022111600001082	捷捷微	2022-11-16	522,962.00	24,200.00	14	2.90	589.78	-	

券		电								
中信证券	2022111600001085	圣邦股份	2022-11-16	1,929,960.00	10,800.00	14	3.50	2,626.89	-	
中信证券	2022111600008207	圣邦股份	2022-11-16	19,907,180.00	111,400.00	14	3.40	26,321.72	-	
中信证券	2022111600008575	澜起科技	2022-11-16	6,672,820.00	98,000.00	14	3.10	8,044.46	-	
中信证券	2022111700001262	捷捷微电	2022-11-17	1,117,600.00	50,800.00	14	2.90	1,260.40	-	
中信证券	2022111700001279	圣邦股份	2022-11-17	381,980.00	2,000.00	14	3.50	519.92	-	
中信证券	2022111700006236	捷捷微电	2022-11-17	393,800.00	17,900.00	28	2.80	857.61	-	
中信证券	2022111700007196	卓胜微	2022-11-17	278,300.00	2,200.00	14	3.40	367.97	-	
中信证券	2022112100061972	捷捷微电	2022-11-21	1,918,400.00	88,000.00	14	2.90	2,163.53	-	
中信证券	2022112100062500	捷捷微电	2022-11-21	82,840.00	3,800.00	14	2.90	93.43	-	
中信证券	2022112100062756	捷捷微电	2022-11-21	479,600.00	22,000.00	14	2.90	540.88	-	
中信证券	2022112100070870	捷捷微电	2022-11-21	436,000.00	20,000.00	14	2.90	491.71	-	
中信证券	2022112100070886	扬杰科技	2022-11-21	345,042.00	5,800.00	14	3.20	429.39	-	
中信	2022112100071000	圣邦	2022-11-21	27,504,000.00	150,000.00	14	3.50	37,436.00	-	

证券		股份								
中信证券	2022112100074262	景嘉微	2022-11-21	1,623,655.00	26,500.00	14	3.90	2,462.54	-	
中信证券	2022112200001532	北京君正	2022-11-22	783,861.00	10,100.00	14	3.50	1,066.92	-	
中信证券	2022112200016823	捷捷微电	2022-11-22	1,181,600.00	56,000.00	14	2.90	1,332.58	-	
中信证券	2022112200018631	景嘉微	2022-11-22	2,731,904.00	44,800.00	14	3.90	4,143.39	-	
中信证券	2022112200020117	澜起科技	2022-11-22	6,957,000.00	100,000.00	14	1.80	4,869.90	-	
中信证券	2022112200020401	捷捷微电	2022-11-22	1,877,900.00	89,000.00	14	2.90	2,117.85	-	
中信证券	2022112200020465	北京君正	2022-11-22	1,241,760.00	16,000.00	14	3.40	1,641.88	-	
中信证券	2022112200020867	捷捷微电	2022-11-22	1,310,310.00	62,100.00	14	2.90	1,477.74	-	
中信证券	2022112200020869	捷捷微电	2022-11-22	738,500.00	35,000.00	14	2.90	832.86	-	
中信证券	2022112300001532	圣邦股份	2022-11-23	1,958,880.00	11,200.00	14	3.50	2,666.25	-	
中信证券	2022112300001533	圣邦股份	2022-11-23	3,672,900.00	21,000.00	14	3.50	4,999.23	-	
中信证券	2022112300001601	卓胜微	2022-11-23	1,142,460.00	9,900.00	14	3.50	1,555.02	-	
中	2022112300014732	澜	2022-	35,240,000.00	500,000.00	14	3.10	42,483.78	-	

信 证 券		起 科 技	11-23								
中 信 证 券	2022112300018062	晶 盛 机 电	2022- 11-23	18,407,634.00	266,700.00	14	3.60	25,770.69	-		
中 信 证 券	2022112300020252	卓 胜 微	2022- 11-23	17,310,000.00	150,000.00	14	1.80	12,117.00	-		
中 信 证 券	2022112300020526	北 京 君 正	2022- 11-23	2,364,777.00	30,900.00	14	3.50	3,218.72	-		
中 信 证 券	2022112300020578	圣 邦 股 份	2022- 11-23	14,306,820.00	81,800.00	14	3.50	19,473.17	-		
中 信 证 券	2022112300020606	景 嘉 微	2022- 11-23	1,926,963.00	32,100.00	14	4.20	3,147.37	-		
中 信 证 券	2022112400001354	扬 杰 科 技	2022- 11-24	8,629,500.00	150,000.00	14	3.70	12,416.89	-		
中 信 证 券	2022112400001377	北 京 君 正	2022- 11-24	2,940,210.00	39,000.00	14	3.50	4,001.95	-		
中 信 证 券	2022112400001389	卓 胜 微	2022- 11-24	1,132,614.00	10,100.00	14	3.50	1,541.61	-		
中 信 证 券	2022112400001402	圣 邦 股 份	2022- 11-24	684,520.00	4,000.00	14	3.50	931.71	-		
中 信 证 券	2022112400017446	捷 捷 微 电	2022- 11-24	1,759,500.00	85,000.00	14	2.90	1,984.33	-		
中 信 证 券	2022112400017510	卓 胜 微	2022- 11-24	1,345,680.00	12,000.00	14	3.20	1,674.62	-		
中 信 证 券	2022112400017538	澜 起 科 技	2022- 11-24	34,890,000.00	500,000.00	14	3.10	42,061.83	-		

中信证券	2022113000006187	澜起科技	2022-11-30	6,594,420.00	98,000.00	14	2.10	5,385.44	-	
中信证券	2022113000006495	圣邦股份	2022-11-30	19,717,800.00	111,400.00	14	3.50	26,838.12	-	
中信证券	2022113000006541	北京君正	2022-11-30	1,499,670.00	19,000.00	14	3.50	2,041.22	-	
中信证券	2022113000006543	北京君正	2022-11-30	1,191,843.00	15,100.00	14	3.50	1,622.23	-	
中信证券	2022113000006551	圣邦股份	2022-11-30	1,911,600.00	10,800.00	14	3.50	2,601.90	-	
中信证券	2022120100007156	圣邦股份	2022-12-01	356,860.00	2,000.00	14	3.50	485.73	-	
中信证券	2022120100008714	卓胜微	2022-12-01	261,800.00	2,200.00	14	3.40	346.16	-	
中信证券	2022120500022336	扬杰科技	2022-12-05	330,600.00	5,800.00	14	3.80	488.55	-	
中信证券	2022120500028278	圣邦股份	2022-12-05	27,192,000.00	150,000.00	14	3.50	37,011.33	-	
中信证券	2022120600011848	景嘉微	2022-12-06	2,735,936.00	44,800.00	14	3.60	3,830.31	-	
中信证券	2022120600014010	北京君正	2022-12-06	808,303.00	10,100.00	14	3.70	1,163.06	-	
中信证券	2022120600014028	北京君正	2022-12-06	1,280,480.00	16,000.00	14	3.70	1,842.47	-	
中信证	2022120600014106	北京君	2022-12-06	320,120.00	4,000.00	28	3.60	800.30	281,760.00	80

券		正								
中信证券	2022120600016380	澜起科技	2022-12-06	6,828,000.00	100,000.00	14	1.80	4,779.60	-	
中信证券	2022120700009942	圣邦股份	2022-12-07	3,700,830.00	21,000.00	14	3.50	5,037.24	-	
中信证券	2022120700010064	澜起科技	2022-12-07	34,770,000.00	500,000.00	14	2.10	28,395.50	-	
中信证券	2022120700010156	北京君正	2022-12-07	2,418,543.00	30,900.00	14	3.70	3,480.01	-	
中信证券	2022120700010600	卓胜微	2022-12-07	1,121,076.00	9,900.00	14	3.40	1,482.31	-	
中信证券	2022120700010602	圣邦股份	2022-12-07	1,973,776.00	11,200.00	14	3.50	2,686.53	-	
中信证券	2022120700010690	景嘉微	2022-12-07	1,897,752.00	32,100.00	14	3.60	2,656.85	-	
中信证券	2022120700011882	圣邦股份	2022-12-07	14,415,614.00	81,800.00	14	3.50	19,621.25	-	
中信证券	2022120700011886	晶盛机电	2022-12-07	18,669,000.00	266,700.00	14	3.50	25,410.58	-	
中信证券	2022120700014012	卓胜微	2022-12-07	16,986,000.00	150,000.00	14	1.80	11,890.20	-	
中信证券	2022120800000977	扬杰科技	2022-12-08	362,604.00	6,700.00	14	3.80	535.85	-	
中信证券	2022120800013219	北京君正	2022-12-08	3,005,340.00	39,000.00	14	3.40	3,973.73	-	
中信	2022120800016129	扬杰	2022-12-08	8,118,000.00	150,000.00	14	3.80	11,996.60	-	

证券		科技									
中信证券	2022120800016363	卓胜微	2022-12-08	1,128,170.00	10,100.00	14	3.40	1,491.69	-		
中信证券	2022120800016367	圣邦股份	2022-12-08	679,600.00	4,000.00	14	3.50	925.01	-		
中信证券	2022120800016433	卓胜微	2022-12-08	1,340,400.00	12,000.00	14	3.40	1,772.31	-		
中信证券	2022120800016523	澜起科技	2022-12-08	35,500,000.00	500,000.00	14	2.10	28,991.67	-		
中信证券	2022121400026868	澜起科技	2022-12-14	6,468,980.00	98,000.00	14	2.10	5,283.00	-		
中信证券	2022121400026876	北京君正	2022-12-14	1,175,686.00	15,100.00	14	3.40	1,554.52	-		
中信证券	2022121400026878	圣邦股份	2022-12-14	1,946,592.00	10,800.00	14	3.60	2,725.23	-		
中信证券	2022121400027996	圣邦股份	2022-12-14	20,078,736.00	111,400.00	14	3.60	28,110.23	-		
中信证券	2022121500012535	圣邦股份	2022-12-15	375,000.00	2,000.00	14	3.60	525.00	-		
中信证券	2022121500012573	卓胜微	2022-12-15	259,512.00	2,200.00	14	3.50	353.22	-		
中信证券	2022121900023360	扬杰科技	2022-12-19	329,788.00	5,800.00	14	3.70	406.74	305,080.00	40	
中信证券	2022121900027388	圣邦股份	2022-12-19	25,794,000.00	150,000.00	14	3.50	30,093.00	25,890,000.00	30,	
中	2022122000018648	澜	2022-	6,498,000.00	100,000.00	14	1.80	3,573.90	6,260,000.00	3,5	

信 证 券		起 科 技	12-20								
中 信 证 券	2022122000019508	景 嘉 微	2022- 12-20	2,519,552.00	44,800.00	14	3.20	2,463.56	2,444,736.00	2.4	
中 信 证 券	2022122100004386	澜 起 科 技	2022- 12-21	4,524,800.00	70,000.00	28	1.50	1,885.33	4,382,000.00	1.8	
中 信 证 券	2022122100004415	澜 起 科 技	2022- 12-21	4,524,800.00	70,000.00	28	1.50	1,885.33	4,382,000.00	1.8	
中 信 证 券	2022122100020095	景 嘉 微	2022- 12-21	1,742,709.00	32,100.00	14	3.20	1,549.07	1,751,697.00	1.5	
中 信 证 券	2022122100020195	卓 胜 微	2022- 12-21	1,167,210.00	9,900.00	14	3.50	1,134.79	1,131,570.00	1.1	
中 信 证 券	2022122100020215	澜 起 科 技	2022- 12-21	32,320,000.00	500,000.00	14	1.80	16,160.00	31,300,000.00	16,	
中 信 证 券	2022122100021017	晶 盛 机 电	2022- 12-21	17,474,184.00	266,700.00	14	3.30	16,018.00	16,951,452.00	16,	
中 信 证 券	2022122100021019	圣 邦 股 份	2022- 12-21	1,939,840.00	11,200.00	14	3.50	1,885.96	1,933,120.00	1.8	
中 信 证 券	2022122100021183	圣 邦 股 份	2022- 12-21	14,167,760.00	81,800.00	14	3.50	13,774.21	14,118,680.00	13,	
中 信 证 券	2022122100021253	卓 胜 微	2022- 12-21	17,685,000.00	150,000.00	14	1.80	8,842.50	17,145,000.00	8.8	
中 信 证 券	2022122100021289	圣 邦 股 份	2022- 12-21	3,637,200.00	21,000.00	14	3.50	3,536.16	3,624,600.00	3.5	
中 信 证 券	2022122200014521	澜 起 科 技	2022- 12-22	32,015,000.00	500,000.00	14	1.80	14,406.75	31,300,000.00	14,	

中信证券	2022122200014859	卓胜微	2022-12-22	1,352,520.00	12,000.00	14	3.50	1,183.46	1,371,600.00	1,183.46
中信证券	2022122200015281	扬杰科技	2022-12-22	368,165.00	6,700.00	14	2.60	239.31	352,420.00	239.31
中信证券	2022122200015389	扬杰科技	2022-12-22	8,242,500.00	150,000.00	14	2.60	5,357.62	7,890,000.00	5,357.62
中信证券	2022122200017009	卓胜微	2022-12-22	1,138,371.00	10,100.00	14	3.50	996.08	1,154,430.00	996.08
中信证券	2022122800002346	复旦微电	2022-12-28	7,098,000.00	100,000.00	14	1.80	1,064.70	6,981,000.00	1,064.70
中信证券	2022122800002354	澜起科技	2022-12-28	19,077,000.00	300,000.00	14	1.80	2,861.55	18,780,000.00	2,861.55
中信证券	2022122800031777	圣邦股份	2022-12-28	19,784,640.00	111,400.00	14	3.40	5,605.65	19,227,640.00	5,605.65
中信证券	2022122800031811	澜起科技	2022-12-28	6,231,820.00	98,000.00	14	1.60	830.91	6,134,800.00	830.91
中信证券	2022122800031815	北京君正	2022-12-28	1,083,425.00	15,100.00	14	3.10	279.89	1,063,644.00	279.89
中信证券	2022122800031817	圣邦股份	2022-12-28	1,918,080.00	10,800.00	14	3.40	543.46	1,864,080.00	543.46
中信证券	2022122900001677	扬杰科技	2022-12-29	5,660,928.00	105,300.00	14	2.70	849.14	5,538,780.00	849.14
中信证券	2022122900001711	澜起科技	2022-12-29	2,660,570.00	41,800.00	14	2.40	354.74	2,616,680.00	354.74
中信证	2022122900001731	澜起科	2022-12-29	6,365,000.00	100,000.00	14	2.40	848.67	6,260,000.00	848.67

券		技								
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (单位:)	出借期限 (单位:)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期收
中信证券	2021010400013628	晶盛机电	2021-01-04	4,522,000.00	140,000.00	14	3.50	6,154.94	-	
中信证券	2021010400013630	景嘉微	2021-01-04	2,542,995.00	34,500.00	28	3.40	6,724.81	-	
中信证券	2021010400013632	卓胜微	2021-01-04	6,149,000.00	10,000.00	14	4.20	10,043.37	-	
中信证券	2021010400013634	全志科技	2021-01-04	1,011,975.00	30,900.00	28	3.50	2,754.82	-	
中信证券	2021010400013640	飞凯材料	2021-01-04	256,685.00	14,300.00	14	3.60	359.36	-	
中信证券	2021010400013642	鼎龙股份	2021-01-04	1,650,068.00	86,800.00	14	3.60	2,310.10	-	
中信证券	2021010400013644	上海新阳	2021-01-04	497,100.00	10,000.00	14	3.60	695.94	-	
中信证券	2021010400013646	扬杰科技	2021-01-04	4,180,500.00	92,900.00	14	3.50	5,690.13	-	
中信证券	2021010400013648	扬杰科技	2021-01-04	1,966,500.00	43,700.00	14	3.50	2,676.63	-	
中信证券	2021010400013650	扬杰科技	2021-01-04	2,250,000.00	50,000.00	14	3.50	3,062.50	-	
中信	2021010500000551	鼎龙	2021-01-05	193,000.00	10,000.00	14	3.60	270.20	-	

证券		股份								
中信证券	2021010500000557	北京君正	2021-01-05	2,697,975.00	31,500.00	14	3.40	3,567.32	-	
中信证券	2021010500010236	晶盛机电	2021-01-05	1,969,200.00	60,000.00	14	3.50	2,680.30	-	
中信证券	2021010500010238	扬杰科技	2021-01-05	970,800.00	20,000.00	14	3.50	1,321.37	-	
中信证券	2021010500010240	晶盛机电	2021-01-05	1,969,200.00	60,000.00	14	3.50	2,680.30	-	
中信证券	2021010500010244	扬杰科技	2021-01-05	2,912,400.00	60,000.00	14	3.50	3,964.10	-	
中信证券	2021010500010246	圣邦股份	2021-01-05	2,929,500.00	10,000.00	14	3.40	3,873.45	-	
中信证券	2021010500010248	景嘉微	2021-01-05	2,216,700.00	30,000.00	28	3.30	5,689.53	-	
中信证券	2021010500010252	景嘉微	2021-01-05	738,900.00	10,000.00	14	3.40	976.99	-	
中信证券	2021010500010254	晶盛机电	2021-01-05	498,864.00	15,200.00	14	3.50	679.01	-	
中信证券	2021010700012504	全志科技	2021-01-07	332,964.00	10,800.00	28	3.50	906.40	-	
中信证券	2021010700012506	晶盛机电	2021-01-07	6,932,000.00	200,000.00	14	3.50	9,435.22	-	
中信证券	2021010700012508	全志科技	2021-01-07	462,450.00	15,000.00	14	3.60	647.43	-	
中	2021010700012510	全	2021-	308,300.00	10,000.00	14	3.60	431.62	-	

信 证 券		志 科 技	01-07								
中 信 证 券	2021010700012512	晶 盛 机 电	2021-01-07	346,600.00	10,000.00	14	3.50	471.76	-		
中 信 证 券	2021011200000357	飞 凯 材 料	2021-01-12	240,940.00	14,000.00	28	3.60	674.63	-		
中 信 证 券	2021011200000361	上 海 新 阳	2021-01-12	586,200.00	12,000.00	28	3.50	1,595.77	-		
中 信 证 券	2021011200006595	北 京 君 正	2021-01-12	797,200.00	10,000.00	14	3.40	1,054.08	-		
中 信 证 券	2021011200006597	上 海 新 阳	2021-01-12	488,500.00	10,000.00	14	3.60	683.90	-		
中 信 证 券	2021011200006599	扬 杰 科 技	2021-01-12	992,000.00	20,000.00	14	3.50	1,350.22	-		
中 信 证 券	2021011200006601	景 嘉 微	2021-01-12	1,825,000.00	25,000.00	28	3.40	4,826.11	-		
中 信 证 券	2021011200006603	全 志 科 技	2021-01-12	317,200.00	10,000.00	14	3.30	407.07	-		
中 信 证 券	2021011200006605	南 大 光 电	2021-01-12	1,802,500.00	50,000.00	14	4.20	2,944.08	-		
中 信 证 券	2021011400000925	鼎 龙 股 份	2021-01-14	535,296.00	25,600.00	28	3.50	1,821.49	-		
中 信 证 券	2021011400009385	晶 盛 机 电	2021-01-14	1,165,600.00	31,000.00	28	3.40	3,852.95	-		
中 信 证 券	2021011400009387	扬 杰 科 技	2021-01-14	836,480.00	16,000.00	14	3.50	1,138.54	-		

中信证券	2021011800008534	卓胜微	2021-01-18	6,673,000.00	10,000.00	14	3.50	9,082.69	-	
中信证券	2021011800008536	晶盛机电	2021-01-18	5,390,000.00	140,000.00	14	3.40	7,126.78	-	
中信证券	2021011800008542	飞凯材料	2021-01-18	260,403.00	14,300.00	14	3.70	374.69	-	
中信证券	2021011800008544	扬杰科技	2021-01-18	2,415,500.00	50,000.00	14	3.50	3,287.76	-	
中信证券	2021011800008546	扬杰科技	2021-01-18	4,487,999.00	92,900.00	14	3.50	6,108.67	-	
中信证券	2021011800008548	鼎龙股份	2021-01-18	2,022,440.00	86,800.00	14	3.60	2,831.42	-	
中信证券	2021011900000374	上海新阳	2021-01-19	580,641.00	11,100.00	28	3.50	1,693.53	-	
中信证券	2021011900000380	鼎龙股份	2021-01-19	1,019,040.00	44,000.00	28	3.50	2,972.20	-	
中信证券	2021011900007452	鼎龙股份	2021-01-19	231,600.00	10,000.00	14	3.60	324.24	-	
中信证券	2021011900007454	北京君正	2021-01-19	2,532,285.00	31,500.00	14	3.50	3,446.72	-	
中信证券	2021011900007456	全志科技	2021-01-19	1,250,600.00	37,000.00	28	3.40	3,543.36	-	
中信证券	2021011900007458	晶盛机电	2021-01-19	592,496.00	15,200.00	14	3.40	783.41	-	
中信证	2021011900007460	扬杰科	2021-01-19	952,000.00	20,000.00	14	3.50	1,295.78	-	

券		技								
中信证券	2021011900007474	扬杰科技	2021-01-19	2,856,000.00	60,000.00	14	3.50	3,887.33	-	
中信证券	2021011900007478	景嘉微	2021-01-19	720,000.00	10,000.00	14	3.50	980.00	-	
中信证券	2021011900007558	北京君正	2021-01-19	241,170.00	3,000.00	28	3.40	683.31	-	
中信证券	2021011900007560	晶盛机电	2021-01-19	2,338,800.00	60,000.00	14	3.40	3,092.41	-	
中信证券	2021012100000505	鼎龙股份	2021-01-21	1,172,000.00	50,000.00	14	3.60	1,640.80	-	
中信证券	2021012100000509	鼎龙股份	2021-01-21	1,125,120.00	48,000.00	28	3.50	3,062.83	-	
中信证券	2021012100000523	晶盛机电	2021-01-21	1,277,526.00	29,800.00	28	3.30	3,278.98	-	
中信证券	2021012100013259	晶盛机电	2021-01-21	8,574,000.00	200,000.00	14	3.40	11,336.73	-	
中信证券	2021012100013261	全志科技	2021-01-21	504,000.00	15,000.00	14	3.50	686.00	-	
中信证券	2021012100013265	全志科技	2021-01-21	336,000.00	10,000.00	14	3.50	457.33	-	
中信证券	2021012600000590	景嘉微	2021-01-26	2,054,700.00	27,000.00	14	3.50	2,796.68	-	
中信证券	2021012600000592	晶盛机电	2021-01-26	801,220.00	19,400.00	14	3.50	1,090.55	-	
中信	2021012600006594	上海	2021-01-26	478,100.00	10,000.00	14	3.60	669.34	-	

证 券		新 阳								
中 信 证 券	2021012600006596	景 嘉 微	2021- 01-26	761,000.00	10,000.00	28	3.40	2,012.42	-	
中 信 证 券	2021012600006602	南 大 光 电	2021- 01-26	1,699,000.00	50,000.00	14	4.40	2,907.18	-	
中 信 证 券	2021012600006604	扬 杰 科 技	2021- 01-26	939,400.00	20,000.00	14	3.70	1,351.69	-	
中 信 证 券	2021012600006606	北 京 君 正	2021- 01-26	741,600.00	10,000.00	14	3.40	980.56	-	
中 信 证 券	2021012600006608	全 志 科 技	2021- 01-26	302,100.00	10,000.00	14	3.70	434.69	-	
中 信 证 券	2021012800009604	扬 杰 科 技	2021- 01-28	696,800.00	16,000.00	14	3.70	1,503.93	-	
中 信 证 券	2021020100009052	扬 杰 科 技	2021- 02-01	2,212,000.00	50,000.00	14	3.50	3,655.95	-	
中 信 证 券	2021020100009054	扬 杰 科 技	2021- 02-01	4,109,896.00	92,900.00	14	3.50	6,792.75	-	
中 信 证 券	2021020100009096	晶 盛 机 电	2021- 02-01	5,768,000.00	140,000.00	14	3.50	9,533.22	-	
中 信 证 券	2021020100009116	全 志 科 技	2021- 02-01	912,168.00	30,900.00	28	3.60	2,554.07	-	
中 信 证 券	2021020100009196	景 嘉 微	2021- 02-01	2,505,735.00	34,500.00	28	3.40	6,626.28	-	
中 信 证 券	2021020200000673	景 嘉 微	2021- 02-02	1,025,780.00	14,000.00	28	3.50	2,792.40	-	
中	2021020200000685	全	2021-	210,070.00	7,000.00	28	3.40	555.52	-	

信 证 券		志 科 技	02-02								
中 信 证 券	2021020200000699	鼎 龙 股 份	2021- 02-02	1,234,240.00	56,000.00	28	3.40	3,263.88	-		
中 信 证 券	2021020200000723	上 海 新 阳	2021- 02-02	1,028,060.00	22,000.00	28	3.40	2,718.65	-		
中 信 证 券	2021020200000725	圣 邦 股 份	2021- 02-02	1,756,500.00	6,000.00	28	3.40	4,644.97	-		
中 信 证 券	2021020200008719	北 京 君 正	2021- 02-02	2,122,155.00	31,500.00	14	3.40	3,206.81	-		
中 信 证 券	2021020200008721	扬 杰 科 技	2021- 02-02	2,598,000.00	60,000.00	14	3.50	4,041.34	-		
中 信 证 券	2021020200008723	扬 杰 科 技	2021- 02-02	866,000.00	20,000.00	14	3.50	1,347.11	-		
中 信 证 券	2021020200008837	鼎 龙 股 份	2021- 02-02	220,400.00	10,000.00	14	3.60	352.64	-		
中 信 证 券	2021020200008843	晶 盛 机 电	2021- 02-02	647,520.00	15,200.00	14	3.50	1,007.26	-		
中 信 证 券	2021020200008845	晶 盛 机 电	2021- 02-02	2,556,000.00	60,000.00	14	3.50	3,976.00	-		
中 信 证 券	2021020400000448	上 海 新 阳	2021- 02-04	1,004,160.00	24,000.00	28	3.40	2,655.45	-		
中 信 证 券	2021020400013623	全 志 科 技	2021- 02-04	290,800.00	10,000.00	14	3.70	418.43	-		
中 信 证 券	2021020400013625	鼎 龙 股 份	2021- 02-04	1,057,000.00	50,000.00	14	3.60	1,479.80	-		

中信证券	2021020400013627	全志科技	2021-02-04	436,200.00	15,000.00	14	3.70	627.64	-	
中信证券	2021020400013629	晶盛机电	2021-02-04	8,018,000.00	200,000.00	14	3.50	10,913.39	-	
中信证券	2021020400013631	全志科技	2021-02-04	314,064.00	10,800.00	28	3.60	879.38	-	
中信证券	2021020900006013	景嘉微	2021-02-09	2,040,120.00	27,000.00	14	3.60	2,856.17	-	
中信证券	2021020900006039	北京君正	2021-02-09	650,000.00	10,000.00	14	3.40	859.44	-	
中信证券	2021020900006147	晶盛机电	2021-02-09	809,368.00	19,400.00	14	3.50	1,101.64	-	
中信证券	2021020900006149	飞凯材料	2021-02-09	200,620.00	14,000.00	28	4.20	655.36	-	
中信证券	2021020900006151	南大光电	2021-02-09	1,444,500.00	50,000.00	14	4.50	2,527.88	-	
中信证券	2021020900006153	扬杰科技	2021-02-09	823,400.00	20,000.00	14	4.30	1,376.91	-	
中信证券	2021020900006155	景嘉微	2021-02-09	1,889,000.00	25,000.00	28	3.50	5,142.28	-	
中信证券	2021020900006157	全志科技	2021-02-09	303,800.00	10,000.00	14	3.50	413.51	-	
中信证券	2021020900006325	上海新阳	2021-02-09	405,900.00	10,000.00	14	3.50	552.48	-	
中信证	2021020900006327	上海新	2021-02-09	487,080.00	12,000.00	28	3.40	1,288.06	-	

券		阳								
中信证	2021021800001117	晶	2021-	1,300,500.00	30,000.00	14	3.50	1,770.13	-	
券		盛	02-18							
中信证	2021021800038542	龙	2021-	538,880.00	25,600.00	28	3.40	1,425.04	-	
券		股	02-18							
中信证	2021021800038546	盛	2021-	1,343,850.00	31,000.00	28	3.40	3,553.74	-	
券		机	02-18							
中信证	2021021800038550	电	2021-	2,142,945.00	31,500.00	14	3.40	2,833.45	-	
券		北	02-18							
中信证	2021021800038552	京	2021-	476,523.00	11,100.00	28	3.40	1,260.14	-	
券		君	02-18							
中信证	2021021800038554	正	2021-	926,200.00	44,000.00	28	3.40	2,449.28	-	
券		上	02-18							
中信证	2021021800038556	海	2021-	204,090.00	3,000.00	28	3.30	523.83	-	
券		新	02-18							
中信证	2021021800038558	阳	2021-	658,920.00	15,200.00	14	3.50	896.86	-	
券		鼎	02-18							
中信证	2021021800038560	龙	2021-	2,516,400.00	60,000.00	14	4.30	4,207.98	-	
券		股	02-18							
中信证	2021021800038562	份	2021-	3,896,226.00	92,900.00	14	4.30	6,515.36	-	
券		扬	02-18							
中信证	2021021800038564	杰	2021-	6,069,000.00	140,000.00	14	3.50	8,260.58	-	
券		科	02-18							
中信证	2021021800038566	技	2021-	210,500.00	10,000.00	14	3.50	286.51	-	
券		晶	02-18							
中信	2021021800038568	盛	2021-	1,128,870.00	37,000.00	28	3.40	2,985.23	-	
证		机	02-18							
券		电								

证券		科技								
中信证券	2021021800038570	晶盛机电	2021-02-18	2,601,000.00	60,000.00	14	3.50	3,540.25	-	
中信证券	2021021800039664	鼎龙股份	2021-02-18	1,010,400.00	48,000.00	28	3.40	2,671.95	-	
中信证券	2021021800039666	晶盛机电	2021-02-18	1,291,830.00	29,800.00	28	3.40	3,416.17	-	
中信证券	2021021800040288	扬杰科技	2021-02-18	671,040.00	16,000.00	14	4.50	1,174.32	-	
中信证券	2021021800041642	鼎龙股份	2021-02-18	1,052,500.00	50,000.00	14	3.50	1,432.57	-	
中信证券	2021021800041644	晶盛机电	2021-02-18	8,670,000.00	200,000.00	14	3.50	11,800.83	-	
中信证券	2021021800041646	全志科技	2021-02-18	457,650.00	15,000.00	14	3.50	622.91	-	
中信证券	2021021800041648	全志科技	2021-02-18	305,100.00	10,000.00	14	3.50	415.28	-	
中信证券	2021021800042704	扬杰科技	2021-02-18	2,097,000.00	50,000.00	14	4.30	3,506.65	-	
中信证券	2021022300006560	上海新阳	2021-02-23	428,200.00	10,000.00	14	3.50	582.83	-	
中信证券	2021022300006562	景嘉微	2021-02-23	1,946,160.00	27,000.00	14	3.60	2,724.62	-	
中信证券	2021022300007006	南大光电	2021-02-23	1,520,000.00	50,000.00	14	4.50	2,660.00	-	
中	2021022300007008	扬	2021-	809,600.00	20,000.00	14	4.50	1,416.80	-	

信 证 券		杰 科 技	02-23							
中 信 证 券	2021022300007010	全 志 科 技	2021- 02-23	306,700.00	10,000.00	14	3.50	417.45	-	
中 信 证 券	2021022300007012	北 京 君 正	2021- 02-23	654,500.00	10,000.00	14	3.60	916.30	-	
中 信 证 券	2021022300007014	晶 盛 机 电	2021- 02-23	772,314.00	19,400.00	14	3.50	1,051.21	-	
中 信 证 券	2021022300007204	景 嘉 微	2021- 02-23	720,800.00	10,000.00	28	3.50	1,962.18	-	
中 信 证 券	2021022400000622	景 嘉 微	2021- 02-24	1,518,090.00	21,000.00	28	3.40	4,014.50	-	
中 信 证 券	2021022400000662	上 海 新 阳	2021- 02-24	1,991,800.00	46,000.00	28	3.40	5,267.20	-	
中 信 证 券	2021030200004647	上 海 新 阳	2021- 03-02	929,280.00	22,000.00	28	3.40	2,457.43	-	
中 信 证 券	2021030200005097	鼎 龙 股 份	2021- 03-02	1,066,240.00	56,000.00	28	3.40	2,819.61	-	
中 信 证 券	2021030200005103	全 志 科 技	2021- 03-02	219,800.00	7,000.00	28	3.40	581.25	-	
中 信 证 券	2021030200005107	景 嘉 微	2021- 03-02	1,107,120.00	14,000.00	28	3.40	2,927.72	-	
中 信 证 券	2021030400034633	上 海 新 阳	2021- 03-04	1,056,000.00	24,000.00	28	3.40	2,792.53	-	
中 信 证 券	2021030400034635	扬 杰 科 技	2021- 03-04	2,542,800.00	60,000.00	14	4.60	4,548.79	-	

中信证券	2021030400034639	扬杰科技	2021-03-04	3,937,102.00	92,900.00	14	4.60	7,043.04	-	
中信证券	2021030400034641	北京君正	2021-03-04	2,183,580.00	31,500.00	14	3.50	2,972.10	-	
中信证券	2021030400034643	扬杰科技	2021-03-04	678,080.00	16,000.00	14	4.60	1,213.01	-	
中信证券	2021030400034649	全志科技	2021-03-04	463,200.00	15,000.00	14	3.50	630.47	-	
中信证券	2021030400035021	全志科技	2021-03-04	333,504.00	10,800.00	28	3.40	881.93	-	
中信证券	2021030400035023	全志科技	2021-03-04	308,800.00	10,000.00	14	3.50	420.31	-	
中信证券	2021030400035025	鼎龙股份	2021-03-04	938,000.00	50,000.00	14	3.50	1,276.72	-	
中信证券	2021030400035027	鼎龙股份	2021-03-04	187,600.00	10,000.00	14	3.50	255.34	-	
中信证券	2021030400035029	晶盛机电	2021-03-04	4,914,000.00	140,000.00	14	3.50	6,688.50	-	
中信证券	2021030400035031	晶盛机电	2021-03-04	7,020,000.00	200,000.00	14	3.50	9,555.00	-	
中信证券	2021030900000528	南大光电	2021-03-09	991,569.00	32,100.00	14	3.60	1,388.20	-	
中信证券	2021030900000538	南大光电	2021-03-09	556,020.00	18,000.00	28	3.50	1,513.61	-	
中信证	2021030900007665	扬杰科	2021-03-09	742,000.00	20,000.00	14	4.10	1,183.08	-	

券		技								
中信证券	2021030900007669	全志科技	2021-03-09	283,300.00	10,000.00	14	3.80	418.65	-	
中信证券	2021030900007689	上海新阳	2021-03-09	441,600.00	10,000.00	14	3.50	601.07	-	
中信证券	2021030900007691	晶盛机电	2021-03-09	615,756.00	19,400.00	14	3.50	838.11	-	
中信证券	2021030900007693	景嘉微	2021-03-09	1,898,370.00	27,000.00	14	3.50	2,583.89	-	
中信证券	2021030900007695	上海新阳	2021-03-09	529,920.00	12,000.00	28	3.40	1,401.34	-	
中信证券	2021030900007697	北京君正	2021-03-09	620,000.00	10,000.00	14	3.40	819.78	-	
中信证券	2021030900007699	景嘉微	2021-03-09	1,757,750.00	25,000.00	28	3.40	4,648.27	-	
中信证券	2021030900007701	南大光电	2021-03-09	1,544,500.00	50,000.00	14	4.10	2,462.62	-	
中信证券	2021030900007703	飞凯材料	2021-03-09	212,940.00	14,000.00	28	4.00	662.48	-	
中信证券	2021031100000501	南大光电	2021-03-11	4,626,000.00	150,000.00	14	3.60	6,476.40	-	
中信证券	2021031800038088	全志科技	2021-03-18	267,900.00	10,000.00	14	3.60	375.06	-	
中信证券	2021031800038090	全志科技	2021-03-18	401,850.00	15,000.00	14	3.60	562.59	-	
中信	2021031800038092	全志	2021-03-18	991,230.00	37,000.00	28	3.50	2,698.35	-	

证券		科技								
中信证券	2021031800038096	扬杰科技	2021-03-18	630,400.00	16,000.00	14	3.80	931.59	-	
中信证券	2021031800038098	扬杰科技	2021-03-18	2,364,000.00	60,000.00	14	3.80	3,493.47	-	
中信证券	2021031800038102	鼎龙股份	2021-03-18	855,360.00	48,000.00	28	3.40	2,261.95	-	
中信证券	2021031800038104	鼎龙股份	2021-03-18	456,192.00	25,600.00	28	3.40	1,206.37	-	
中信证券	2021031800038106	鼎龙股份	2021-03-18	891,000.00	50,000.00	14	3.50	1,212.75	-	
中信证券	2021031800038108	鼎龙股份	2021-03-18	784,080.00	44,000.00	28	3.40	2,073.46	-	
中信证券	2021031800038110	鼎龙股份	2021-03-18	178,200.00	10,000.00	14	3.50	242.55	-	
中信证券	2021031800038114	北京君正	2021-03-18	168,570.00	3,000.00	28	3.40	445.77	-	
中信证券	2021031800038116	北京君正	2021-03-18	1,769,985.00	31,500.00	14	3.50	2,409.15	-	
中信证券	2021031800038118	晶盛机电	2021-03-18	6,670,000.00	200,000.00	14	3.60	9,338.00	-	
中信证券	2021031800038338	上海新阳	2021-03-18	464,646.00	11,100.00	28	3.50	1,264.87	-	
中信证券	2021031800038340	晶盛机电	2021-03-18	993,830.00	29,800.00	28	3.50	2,705.43	-	
中	2021032300000475	飞	2021-	163,200.00	10,000.00	14	3.60	228.48	-	

信 证 券		凯 材 料	03-23								
中 信 证 券	2021032300000477	上 海 新 阳	2021- 03-23	1,336,410.00	31,000.00	14	3.60	1,870.97	-		
中 信 证 券	2021032300000479	南 大 光 电	2021- 03-23	4,941,720.00	159,000.00	14	3.60	6,918.41	-		
中 信 证 券	2021032300007723	北 京 君 正	2021- 03-23	544,300.00	10,000.00	14	3.30	698.52	-		
中 信 证 券	2021032300007725	上 海 新 阳	2021- 03-23	431,100.00	10,000.00	14	3.20	536.48	-		
中 信 证 券	2021032300007727	扬 杰 科 技	2021- 03-23	786,600.00	20,000.00	14	3.80	1,162.42	-		
中 信 证 券	2021032300007729	南 大 光 电	2021- 03-23	997,668.00	32,100.00	14	3.60	1,396.74	-		
中 信 证 券	2021032300007731	晶 盛 机 电	2021- 03-23	633,604.00	19,400.00	14	3.30	813.13	-		
中 信 证 券	2021032300007733	南 大 光 电	2021- 03-23	1,554,000.00	50,000.00	14	3.60	2,175.60	-		
中 信 证 券	2021032300007739	景 嘉 微	2021- 03-23	783,000.00	10,000.00	28	3.20	1,948.80	-		
中 信 证 券	2021032300007741	景 嘉 微	2021- 03-23	2,114,100.00	27,000.00	14	3.30	2,713.10	-		
中 信 证 券	2021032300007743	全 志 科 技	2021- 03-23	278,000.00	10,000.00	14	4.30	464.88	-		
中 信 证 券	2021032400006286	上 海 新 阳	2021- 03-24	1,908,080.00	46,000.00	28	3.10	4,600.59	-		

中信证券	2021032400006310	景嘉微	2021-03-24	1,651,020.00	21,000.00	28	3.20	4,109.21	-	
中信证券	2021032500000578	上海新阳	2021-03-25	3,510,500.00	85,000.00	14	3.60	4,914.70	-	
中信证券	2021032500000580	飞凯材料	2021-03-25	611,910.00	39,000.00	14	3.60	856.67	-	
中信证券	2021032500000582	景嘉微	2021-03-25	226,980.00	3,000.00	14	3.50	308.95	-	
中信证券	2021032500000584	南大光电	2021-03-25	628,530.00	21,000.00	14	3.60	879.94	-	
中信证券	2021032500000594	扬杰科技	2021-03-25	543,024.00	14,400.00	14	3.50	739.12	-	
中信证券	2021032500006284	南大光电	2021-03-25	4,489,500.00	150,000.00	14	3.60	6,285.30	-	
中信证券	2021033000000711	景嘉微	2021-03-30	1,629,400.00	20,000.00	14	3.50	2,217.79	-	
中信证券	2021033000000715	卓胜微	2021-03-30	18,105,000.00	30,000.00	28	3.30	46,469.50	-	
中信证券	2021033000007853	鼎龙股份	2021-03-30	917,840.00	56,000.00	28	3.40	2,427.18	-	
中信证券	2021033000007855	全志科技	2021-03-30	200,410.00	7,000.00	28	3.50	545.56	-	
中信证券	2021033000007857	上海新阳	2021-03-30	891,660.00	22,000.00	28	3.50	2,427.30	-	
中信证	2021033000008651	景嘉微	2021-03-30	1,140,580.00	14,000.00	28	3.40	3,016.20	-	

券										
中信证券	2021040100000472	全志科技	2021-04-01	4,194,360.00	109,800.00	14	3.60	5,872.10	-	
中信证券	2021040100000474	景嘉微	2021-04-01	2,740,752.00	33,600.00	14	3.50	3,730.47	-	
中信证券	2021040100032877	全志科技	2021-04-01	573,000.00	15,000.00	14	3.60	802.20	-	
中信证券	2021040100032879	全志科技	2021-04-01	412,560.00	10,800.00	28	3.50	1,123.08	-	
中信证券	2021040100032881	扬杰科技	2021-04-01	647,840.00	16,000.00	14	3.50	881.78	-	
中信证券	2021040100032883	上海新阳	2021-04-01	996,240.00	24,000.00	28	3.50	2,711.99	-	
中信证券	2021040100032885	晶盛机电	2021-04-01	6,714,000.00	200,000.00	14	3.50	9,138.50	-	
中信证券	2021040100032887	鼎龙股份	2021-04-01	168,800.00	10,000.00	14	3.50	229.76	-	
中信证券	2021040100032889	鼎龙股份	2021-04-01	844,000.00	50,000.00	14	3.50	1,148.78	-	
中信证券	2021040600000652	扬杰科技	2021-04-06	1,932,000.00	46,000.00	14	3.60	2,704.80	-	
中信证券	2021040600000738	鼎龙股份	2021-04-06	182,910.00	10,500.00	14	3.50	248.96	-	
中信证券	2021040600000740	江丰电子	2021-04-06	1,002,100.00	22,000.00	28	3.40	2,839.29	-	
中信	2021040600017100	北京	2021-04-06	662,400.00	10,000.00	14	3.40	875.84	-	

证券		君正								
中信证券	2021040600017102	上海新阳	2021-04-06	1,320,290.00	31,000.00	14	3.60	1,848.41	-	
中信证券	2021040600017106	上海新阳	2021-04-06	425,900.00	10,000.00	14	3.60	596.26	-	
中信证券	2021040600017108	上海新阳	2021-04-06	511,080.00	12,000.00	28	3.50	1,490.65	-	
中信证券	2021040600017110	全志科技	2021-04-06	414,000.00	10,000.00	14	3.60	579.60	-	
中信证券	2021040600017112	飞凯材料	2021-04-06	161,600.00	10,000.00	14	4.40	276.52	-	
中信证券	2021040600017114	飞凯材料	2021-04-06	226,240.00	14,000.00	28	4.30	810.70	-	
中信证券	2021040600017116	景嘉微	2021-04-06	2,270,700.00	27,000.00	14	3.50	3,090.68	-	
中信证券	2021040600017118	景嘉微	2021-04-06	2,102,500.00	25,000.00	28	3.40	5,957.08	-	
中信证券	2021040600017120	南大光电	2021-04-06	1,529,500.00	50,000.00	14	3.70	2,200.78	-	
中信证券	2021040600017122	南大光电	2021-04-06	981,939.00	32,100.00	14	3.70	1,412.90	-	
中信证券	2021040600017124	晶盛机电	2021-04-06	669,494.00	19,400.00	14	3.50	911.26	-	
中信证券	2021040600017126	扬杰科技	2021-04-06	840,000.00	20,000.00	14	3.60	1,176.00	-	
中	2021040600017128	南	2021-	550,620.00	18,000.00	28	3.60	1,651.86	-	

信 证 券		大 光 电	04-06								
中 信 证 券	2021040600017130	南 大 光 电	2021- 04-06	4,863,810.00	159,000.00	14	3.70	6,998.48	-		
中 信 证 券	2021040800000542	飞 凯 材 料	2021- 04-08	564,924.00	35,800.00	14	4.10	900.74	-		
中 信 证 券	2021040800000546	鼎 龙 股 份	2021- 04-08	182,336.00	11,200.00	14	3.50	248.18	-		
中 信 证 券	2021040800000556	圣 邦 股 份	2021- 04-08	3,589,040.00	14,000.00	14	3.60	5,024.66	-		
中 信 证 券	2021040800004905	扬 杰 科 技	2021- 04-08	596,736.00	14,400.00	14	3.60	835.43	-		
中 信 证 券	2021040800004907	飞 凯 材 料	2021- 04-08	615,420.00	39,000.00	14	4.40	1,053.05	-		
中 信 证 券	2021040800004909	上 海 新 阳	2021- 04-08	3,472,250.00	85,000.00	14	3.60	4,861.15	-		
中 信 证 券	2021040800004911	南 大 光 电	2021- 04-08	619,290.00	21,000.00	14	3.70	891.09	-		
中 信 证 券	2021040800004913	景 嘉 微	2021- 04-08	247,020.00	3,000.00	14	3.50	336.22	-		
中 信 证 券	2021040800004915	南 大 光 电	2021- 04-08	4,423,500.00	150,000.00	14	3.70	6,364.93	-		
中 信 证 券	2021041300000947	景 嘉 微	2021- 04-13	848,100.00	11,000.00	14	3.50	1,154.36	-		
中 信 证 券	2021041500000531	飞 凯 材 料	2021- 04-15	153,000.00	10,000.00	14	4.40	261.80	-		

中信证券	2021041500000537	全志科技	2021-04-15	735,930.00	17,000.00	14	3.50	1,001.68	-	
中信证券	2021041500032436	扬杰科技	2021-04-15	632,000.00	16,000.00	14	3.60	884.80	-	
中信证券	2021041500032438	晶盛机电	2021-04-15	958,964.00	29,800.00	28	3.40	2,535.93	-	
中信证券	2021041500032440	全志科技	2021-04-15	649,350.00	15,000.00	14	3.50	883.84	-	
中信证券	2021041500032442	全志科技	2021-04-15	1,601,730.00	37,000.00	28	3.40	4,235.69	-	
中信证券	2021041500032444	上海新阳	2021-04-15	446,220.00	11,100.00	28	3.40	1,180.00	-	
中信证券	2021041500032446	全志科技	2021-04-15	4,753,242.00	109,800.00	14	3.50	6,469.69	-	
中信证券	2021041500032448	鼎龙股份	2021-04-15	668,800.00	44,000.00	28	3.40	1,768.60	-	
中信证券	2021041500032450	鼎龙股份	2021-04-15	152,000.00	10,000.00	14	3.50	206.89	-	
中信证券	2021041500032452	鼎龙股份	2021-04-15	760,000.00	50,000.00	14	3.50	1,034.44	-	
中信证券	2021041500032454	鼎龙股份	2021-04-15	389,120.00	25,600.00	28	3.40	1,029.01	-	
中信证券	2021041500032456	北京君正	2021-04-15	206,040.00	3,000.00	28	3.40	544.86	-	
中信证	2021041500032458	鼎龙股	2021-04-15	729,600.00	48,000.00	28	3.40	1,929.39	-	

券		份								
中信证券	2021042000001141	飞凯材料	2021-04-20	404,028.00	26,100.00	14	4.40	790.10	-	
中信证券	2021042000001161	北京君正	2021-04-20	1,957,824.00	28,800.00	14	3.50	3,045.51	-	
中信证券	2021042000015600	景嘉微	2021-04-20	762,200.00	10,000.00	28	3.40	2,015.60	-	
中信证券	2021042000015602	飞凯材料	2021-04-20	154,800.00	10,000.00	14	4.40	302.72	-	
中信证券	2021042000015604	全志科技	2021-04-20	418,000.00	10,000.00	14	3.50	650.22	-	
中信证券	2021042000015608	鼎龙股份	2021-04-20	164,535.00	10,500.00	14	3.60	263.26	-	
中信证券	2021042000015612	北京君正	2021-04-20	679,800.00	10,000.00	14	3.50	1,057.46	-	
中信证券	2021042000015614	南大光电	2021-04-20	935,073.00	32,100.00	14	3.70	1,537.68	-	
中信证券	2021042000015616	南大光电	2021-04-20	1,456,500.00	50,000.00	14	3.70	2,395.13	-	
中信证券	2021042000015618	扬杰科技	2021-04-20	1,858,400.00	46,000.00	14	3.70	3,056.03	-	
中信证券	2021042000015620	扬杰科技	2021-04-20	808,000.00	20,000.00	14	3.70	1,328.71	-	
中信证券	2021042000015622	上海新阳	2021-04-20	1,240,000.00	31,000.00	14	3.50	1,928.89	-	
中信	2021042000015624	上海	2021-04-20	400,000.00	10,000.00	14	3.50	622.22	-	

证 券		新 阳								
中 信 证 券	2021042000015626	南 大 光 电	2021- 04-20	4,631,670.00	159,000.00	14	3.70	7,616.53	-	
中 信 证 券	2021042000015628	晶 盛 机 电	2021- 04-20	686,760.00	19,400.00	14	3.50	1,068.30	-	
中 信 证 券	2021042100007487	景 嘉 微	2021- 04-21	1,591,170.00	21,000.00	28	3.40	4,207.76	-	
中 信 证 券	2021042100007491	上 海 新 阳	2021- 04-21	1,822,520.00	46,000.00	28	3.40	4,819.55	-	
中 信 证 券	2021042200000604	南 大 光 电	2021- 04-22	29,420.00	1,000.00	14	3.70	42.33	-	
中 信 证 券	2021042200000606	北 京 君 正	2021- 04-22	675,500.00	10,000.00	14	3.50	919.43	-	
中 信 证 券	2021042200006928	景 嘉 微	2021- 04-22	225,840.00	3,000.00	14	3.50	307.39	-	
中 信 证 券	2021042200006930	扬 杰 科 技	2021- 04-22	600,912.00	14,400.00	14	3.70	864.65	-	
中 信 证 券	2021042200006932	鼎 龙 股 份	2021- 04-22	178,192.00	11,200.00	14	3.60	249.47	-	
中 信 证 券	2021042200006934	上 海 新 阳	2021- 04-22	3,356,650.00	85,000.00	14	3.50	4,568.77	-	
中 信 证 券	2021042200006946	南 大 光 电	2021- 04-22	617,820.00	21,000.00	14	3.70	888.97	-	
中 信 证 券	2021042200006948	飞 凯 材 料	2021- 04-22	597,090.00	39,000.00	14	4.40	1,021.69	-	
中 信 证 券	2021042200006950	南 大 光 电	2021- 04-22	4,413,000.00	150,000.00	14	3.70	6,349.82	-	

信 证 券		大 光 电	04-22								
中 信 证 券	2021042200007344	飞 凯 材 料	2021- 04-22	548,098.00	35,800.00	14	4.40	937.86	-		
中 信 证 券	2021042700000841	全 志 科 技	2021- 04-27	1,489,200.00	34,000.00	14	3.60	2,084.88	-		
中 信 证 券	2021042700000849	扬 杰 科 技	2021- 04-27	1,468,500.00	33,000.00	14	3.70	2,113.01	-		
中 信 证 券	2021042700011862	卓 胜 微	2021- 04-27	22,526,400.00	30,000.00	28	3.40	59,569.81	-		
中 信 证 券	2021042700011864	景 嘉 微	2021- 04-27	1,046,220.00	14,000.00	28	3.40	2,766.67	-		
中 信 证 券	2021042700011866	鼎 龙 股 份	2021- 04-27	879,200.00	56,000.00	28	3.40	2,325.00	-		
中 信 证 券	2021042700011868	上 海 新 阳	2021- 04-27	812,460.00	22,000.00	28	3.40	2,148.51	-		
中 信 证 券	2021042700011870	景 嘉 微	2021- 04-27	822,030.00	11,000.00	14	3.50	1,118.87	-		
中 信 证 券	2021042700011872	全 志 科 技	2021- 04-27	306,600.00	7,000.00	28	3.40	810.79	-		
中 信 证 券	2021042900000613	北 京 君 正	2021- 04-29	2,911,768.00	39,800.00	14	3.50	3,963.24	-		
中 信 证 券	2021042900000622	全 志 科 技	2021- 04-29	1,413,060.00	33,000.00	14	3.60	1,978.28	-		
中 信 证 券	2021042900024073	全 志 科 技	2021- 04-29	462,456.00	10,800.00	28	3.40	1,222.94	-		

中信证券	2021042900024075	全志科技	2021-04-29	4,701,636.00	109,800.00	14	3.50	6,399.45	-	
中信证券	2021042900024077	飞凯材料	2021-04-29	148,700.00	10,000.00	14	4.40	254.44	-	
中信证券	2021042900024079	扬杰科技	2021-04-29	714,400.00	16,000.00	14	3.70	1,027.94	-	
中信证券	2021042900024081	鼎龙股份	2021-04-29	806,000.00	50,000.00	14	3.50	1,097.06	-	
中信证券	2021042900025459	上海新阳	2021-04-29	882,240.00	24,000.00	28	3.40	2,333.03	-	
中信证券	2021042900025809	鼎龙股份	2021-04-29	161,200.00	10,000.00	14	3.50	219.41	-	
中信证券	2021042900025853	全志科技	2021-04-29	642,300.00	15,000.00	14	3.60	899.22	-	
中信证券	2021042900025855	全志科技	2021-04-29	727,940.00	17,000.00	14	3.60	1,019.12	-	
中信证券	2021042900026513	卓胜微	2021-04-27	30,000.00	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021042900026609	卓胜微	2021-04-27	-	24,000.00	28	3.40	-	-	
中信证券	2021050600026408	江丰电子	2021-05-06	892,320.00	22,000.00	28	3.40	2,359.69	-	
中信证券	2021050600026410	景嘉微	2021-05-06	1,797,500.00	25,000.00	28	3.40	4,753.39	-	
中信证	2021050600026412	南大光	2021-05-06	497,880.00	18,000.00	28	3.60	1,394.06	-	

券		电								
中信证券	2021050600026414	扬杰科技	2021-05-06	886,400.00	20,000.00	14	3.70	1,275.43	-	
中信证券	2021050600026416	南大光电	2021-05-06	887,886.00	32,100.00	14	3.70	1,277.57	-	
中信证券	2021050600026418	南大光电	2021-05-06	4,397,940.00	159,000.00	14	3.70	6,328.15	-	
中信证券	2021050600026420	扬杰科技	2021-05-06	2,038,720.00	46,000.00	14	3.70	2,933.49	-	
中信证券	2021050600026422	南大光电	2021-05-06	1,383,000.00	50,000.00	14	3.70	1,989.98	-	
中信证券	2021050600026424	飞凯材料	2021-05-06	206,500.00	14,000.00	28	4.30	690.63	-	
中信证券	2021050600026426	飞凯材料	2021-05-06	384,975.00	26,100.00	14	4.40	658.74	-	
中信证券	2021050600026428	飞凯材料	2021-05-06	147,500.00	10,000.00	14	4.40	252.39	-	
中信证券	2021050600028240	鼎龙股份	2021-05-06	173,250.00	10,500.00	14	3.50	235.81	-	
中信证券	2021050600028242	上海新阳	2021-05-06	429,600.00	12,000.00	28	3.40	1,136.05	-	
中信证券	2021050600028246	上海新阳	2021-05-06	1,109,800.00	31,000.00	14	3.50	1,510.56	-	
中信证券	2021050600028248	北京君正	2021-05-06	2,024,928.00	28,800.00	14	3.50	2,756.15	-	
中信	2021050600028250	上海	2021-05-06	358,000.00	10,000.00	14	3.50	487.28	-	

证 券		新 阳								
中 信 证 券	2021050600028506	扬 杰 科 技	2021- 05-06	638,208.00	14,400.00	14	3.70	918.31	-	
中 信 证 券	2021050600028508	飞 凯 材 料	2021- 05-06	528,050.00	35,800.00	14	4.40	903.55	-	
中 信 证 券	2021050600028510	飞 凯 材 料	2021- 05-06	575,250.00	39,000.00	14	4.40	984.32	-	
中 信 证 券	2021050600028512	北 京 君 正	2021- 05-06	703,100.00	10,000.00	14	3.50	957.00	-	
中 信 证 券	2021050600028514	鼎 龙 股 份	2021- 05-06	184,800.00	11,200.00	14	3.50	251.53	-	
中 信 证 券	2021050600028806	北 京 君 正	2021- 05-06	703,100.00	10,000.00	14	3.50	957.00	-	
中 信 证 券	2021050600028808	晶 盛 机 电	2021- 05-06	738,558.00	19,400.00	14	3.50	1,005.26	-	
中 信 证 券	2021050600029272	南 大 光 电	2021- 05-06	4,149,000.00	150,000.00	14	3.60	5,808.60	-	
中 信 证 券	2021050600029274	南 大 光 电	2021- 05-06	27,660.00	1,000.00	14	3.60	38.72	-	
中 信 证 券	2021050600029276	南 大 光 电	2021- 05-06	580,860.00	21,000.00	14	3.60	813.20	-	
中 信 证 券	2021050600029278	上 海 新 阳	2021- 05-06	3,043,000.00	85,000.00	14	4.30	5,088.57	-	
中 信 证 券	2021050600029280	全 志 科 技	2021- 05-06	414,500.00	10,000.00	14	3.60	580.30	-	
中 信 证 券	2021050600029282	景 嘉 微	2021- 05-06	215,700.00	3,000.00	14	2.90	243.26	-	

信 证 券		嘉 微	05-06								
中 信 证 券	2021051100000956	北 京 君 正	2021- 05-11	1,714,966.00	27,400.00	14	3.60	2,400.95	-		
中 信 证 券	2021051100000958	全 志 科 技	2021- 05-11	1,480,480.00	38,000.00	14	3.50	2,015.10	-		
中 信 证 券	2021051100000964	鼎 龙 股 份	2021- 05-11	923,440.00	59,500.00	14	3.60	1,292.82	-		
中 信 证 券	2021051100000966	江 丰 电 子	2021- 05-11	666,332.00	16,400.00	14	3.50	906.95	-		
中 信 证 券	2021051100000972	南 大 光 电	2021- 05-11	261,300.00	10,000.00	14	3.70	375.98	-		
中 信 证 券	2021051100010743	景 嘉 微	2021- 05-11	816,530.00	11,000.00	14	2.90	920.86	-		
中 信 证 券	2021051100010745	全 志 科 技	2021- 05-11	1,324,640.00	34,000.00	14	3.60	1,854.50	-		
中 信 证 券	2021051100010747	扬 杰 科 技	2021- 05-11	1,313,400.00	33,000.00	14	3.70	1,889.84	-		
中 信 证 券	2021051300000664	江 丰 电 子	2021- 05-13	1,009,736.00	24,700.00	14	3.50	1,374.36	-		
中 信 证 券	2021051300000666	全 志 科 技	2021- 05-13	1,468,160.00	37,000.00	14	3.50	1,998.33	-		
中 信 证 券	2021051300000670	北 京 君 正	2021- 05-13	627,000.00	10,000.00	14	3.60	877.80	-		
中 信 证 券	2021051300000686	鼎 龙 股 份	2021- 05-13	854,192.00	54,200.00	14	3.60	1,195.87	-		

中信证券	2021051300000692	上海新阳	2021-05-13	357,400.00	10,000.00	14	3.60	500.36	-	
中信证券	2021051300027724	鼎龙股份	2021-05-13	756,480.00	48,000.00	28	3.40	1,428.91	-	
中信证券	2021051300027726	鼎龙股份	2021-05-13	788,000.00	50,000.00	14	3.50	1,072.56	-	
中信证券	2021051300027728	飞凯材料	2021-05-13	145,300.00	10,000.00	14	4.40	248.62	-	
中信证券	2021051300027730	上海新阳	2021-05-13	396,714.00	11,100.00	28	4.20	1,295.93	-	
中信证券	2021051300027732	鼎龙股份	2021-05-13	693,440.00	44,000.00	28	3.40	1,309.83	-	
中信证券	2021051300027734	全志科技	2021-05-13	4,356,864.00	109,800.00	14	3.60	6,099.61	-	
中信证券	2021051300027736	全志科技	2021-05-13	1,468,160.00	37,000.00	28	3.50	3,996.66	-	
中信证券	2021051300027738	北京君正	2021-05-13	2,495,460.00	39,800.00	14	3.50	3,396.60	-	
中信证券	2021051300027740	北京君正	2021-05-13	188,100.00	3,000.00	28	3.40	497.42	-	
中信证券	2021051300027742	晶盛机电	2021-05-13	1,072,800.00	29,800.00	28	3.40	2,836.96	-	
中信证券	2021051300027744	扬杰科技	2021-05-13	635,200.00	16,000.00	14	3.70	913.98	-	
中信证	2021051800000528	晶盛机	2021-05-18	398,200.00	10,000.00	14	3.20	495.54	-	

券		电								
中信证	2021051800000530	晶盛机电	2021-05-18	1,951,180.00	49,000.00	14	3.20	2,428.14	-	
券		上海新阳	2021-05-19	1,656,460.00	46,000.00	28	3.50	4,509.25	-	
中信证	2021051900002721	景嘉微	2021-05-19	1,583,400.00	21,000.00	28	3.50	4,310.37	-	
券		圣邦股份	2021-05-20	2,562,000.00	10,000.00	14	3.80	3,786.07	-	
中信证	2021052000000551	扬杰科技	2021-05-20	1,502,280.00	36,000.00	14	3.70	2,161.61	-	
券		扬杰科技	2021-05-20	834,600.00	20,000.00	14	3.60	1,168.44	-	
中信证	2021052000017913	南大光电	2021-05-20	27,590.00	1,000.00	14	3.70	39.70	-	
券		南大光电	2021-05-20	1,379,500.00	50,000.00	14	3.70	1,984.95	-	
中信证	2021052000017919	飞凯材料	2021-05-20	510,508.00	35,800.00	14	3.60	714.71	-	
券		飞凯材料	2021-05-20	556,140.00	39,000.00	14	3.60	778.60	-	
中信证	2021052000017923	南大光电	2021-05-20	4,138,500.00	150,000.00	14	3.70	5,954.84	-	
券		南大光电	2021-05-20	4,386,810.00	159,000.00	14	3.70	6,312.13	-	
中信证	2021052000017925	上海	2021-05-20	3,079,550.00	85,000.00	14	3.60	4,311.37	-	
券										

证 券		新 阳								
中 信 证 券	2021052000017931	上 海 新 阳	2021- 05-20	1,123,130.00	31,000.00	14	3.60	1,572.38	-	
中 信 证 券	2021052000017933	上 海 新 阳	2021- 05-20	362,300.00	10,000.00	14	3.60	507.22	-	
中 信 证 券	2021052000017935	鼎 龙 股 份	2021- 05-20	184,800.00	10,500.00	14	3.60	258.72	-	
中 信 证 券	2021052000017937	鼎 龙 股 份	2021- 05-20	197,120.00	11,200.00	14	3.60	275.97	-	
中 信 证 券	2021052000017939	南 大 光 电	2021- 05-20	885,639.00	32,100.00	14	3.70	1,274.34	-	
中 信 证 券	2021052000017943	飞 凯 材 料	2021- 05-20	372,186.00	26,100.00	14	3.60	521.06	-	
中 信 证 券	2021052000017945	飞 凯 材 料	2021- 05-20	142,600.00	10,000.00	14	3.60	199.64	-	
中 信 证 券	2021052000018351	南 大 光 电	2021- 05-20	579,390.00	21,000.00	14	3.70	833.68	-	
中 信 证 券	2021052000018355	扬 杰 科 技	2021- 05-20	600,912.00	14,400.00	14	3.60	841.28	-	
中 信 证 券	2021052000018357	景 嘉 微	2021- 05-20	228,180.00	3,000.00	14	3.60	319.45	-	
中 信 证 券	2021052000018359	扬 杰 科 技	2021- 05-20	1,919,580.00	46,000.00	14	3.60	2,687.41	-	
中 信 证 券	2021052000018361	北 京 君 正	2021- 05-20	632,500.00	10,000.00	14	3.60	885.50	-	
中	2021052000018363	北	2021-	1,821,600.00	28,800.00	14	3.60	2,550.24	-	

信 证 券		京 君 正	05-20								
中 信 证 券	2021052000018365	晶 盛 机 电	2021-05-20	791,714.00	19,400.00	14	3.60	1,108.40	-		
中 信 证 券	2021052000018367	北 京 君 正	2021-05-20	632,500.00	10,000.00	14	3.60	885.50	-		
中 信 证 券	2021052000018369	全 志 科 技	2021-05-20	424,000.00	10,000.00	14	3.50	577.11	-		
中 信 证 券	2021052000020342	全 志 科 技	2021-05-11	13,600.00	-	14	3.60	-	-		
中 信 证 券	2021052000020357	全 志 科 技	2021-05-13	14,800.00	-	14	3.50	-	-		
中 信 证 券	2021052000020372	全 志 科 技	2021-05-13	43,920.00	-	14	3.60	-	-		
中 信 证 券	2021052000020374	全 志 科 技	2021-05-13	14,800.00	-	28	3.50	-	-		
中 信 证 券	2021052000020381	全 志 科 技	2021-05-20	4,000.00	-	14	3.50	-	-		
中 信 证 券	2021052000020402	全 志 科 技	2021-04-27	2,800.00	-	28	3.40	-	-		
中 信 证 券	2021052000020406	全 志 科 技	2021-04-29	4,320.00	-	28	3.40	-	-		
中 信 证 券	2021052000020421	全 志 科 技	2021-05-11	15,200.00	-	14	3.50	-	-		
中 信 证 券	2021052500001031	北 京 君 正	2021-05-25	709,900.00	10,000.00	14	3.30	911.04	-		

中信证券	2021052500009170	景嘉微	2021-05-25	1,126,300.00	14,000.00	28	3.40	2,978.44	-	
中信证券	2021052500009172	北京君正	2021-05-25	1,945,126.00	27,400.00	14	3.50	2,647.53	-	
中信证券	2021052500009174	上海新阳	2021-05-25	814,000.00	22,000.00	28	3.60	2,279.20	-	
中信证券	2021052500010284	卓胜微	2021-05-25	12,360,300.00	30,000.00	28	3.30	31,724.77	-	
中信证券	2021052500010288	扬杰科技	2021-05-25	1,436,160.00	33,000.00	14	3.70	2,066.47	-	
中信证券	2021052500010290	南大光电	2021-05-25	281,600.00	10,000.00	14	3.80	416.14	-	
中信证券	2021052600012048	南大光电	2021-05-06	720.00	-	28	3.60	-	-	
中信证券	2021052600012096	南大光电	2021-05-20	40.00	-	14	3.70	-	-	
中信证券	2021052600012098	南大光电	2021-05-20	2,000.00	-	14	3.70	-	-	
中信证券	2021052600012100	南大光电	2021-05-20	6,000.00	-	14	3.70	-	-	
中信证券	2021052600012102	南大光电	2021-05-20	6,360.00	-	14	3.70	-	-	
中信证券	2021052600012104	南大光电	2021-05-20	1,284.00	-	14	3.70	-	-	
中信证	2021052600012110	南大光	2021-05-20	840.00	-	14	3.70	-	-	

券		电								
中信证	2021052600012114	南大光电	2021-05-25	400.00	-	14	3.80	-	-	
券		扬杰科技	2021-05-27	1,551,900.00	35,000.00	14	3.60	2,172.66	-	
中信证	2021052700000912	北京君正	2021-05-27	3,250,068.00	39,800.00	14	3.50	4,423.70	-	
券		北京君正	2021-05-27	816,600.00	10,000.00	14	3.50	1,111.48	-	
中信证	2021052700018721	上海新阳	2021-05-27	408,000.00	10,000.00	14	3.70	587.07	-	
券		上海新阳	2021-05-27	979,200.00	24,000.00	28	3.60	2,741.76	-	
中信证	2021052700018723	扬杰科技	2021-05-27	709,440.00	16,000.00	14	3.70	1,020.81	-	
券		扬杰科技	2021-05-27	2,400.00	-	14	3.70	-	-	
中信证	2021052700018725	扬杰科技	2021-05-27	5,250.00	-	14	3.60	-	-	
券		扬杰科技	2021-05-25	4,950.00	-	14	3.70	-	-	
中信证	2021052700018727	扬杰科技	2021-05-20	6,900.00	-	14	3.60	-	-	
券		扬杰科技	2021-05-20	3,000.00	-	14	3.60	-	-	
中信证	2021052700018729	扬杰	2021-05-20	2,160.00	-	14	3.60	-	-	
券										
中信	2021052700021306									
券										
中信	2021052700021311									
券										
中信	2021052700021314									
券										
中信	2021052700021320									
券										
中信	2021052700021328									
券										
中信	2021052700021330									

证券		科技								
中信证券	2021052700021335	扬杰科技	2021-05-20	5,400.00	-	14	3.70	-	-	
中信证券	2021052800004167	江丰电子	2021-05-06	2,990.89	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021052800004217	飞凯材料	2021-05-20	650.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021052800004219	飞凯材料	2021-05-20	2,327.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021052800004221	飞凯材料	2021-05-20	2,535.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021052800004223	飞凯材料	2021-05-20	1,696.50	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021052800004227	飞凯材料	2021-05-06	910.00	-	28	4.30	-	-	
中信证券	2021053100003230	北京君正	2021-05-25	1,300.00	-	14	3.30	-	-	
中信证券	2021053100003244	北京君正	2021-05-13	390.00	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021053100003277	北京君正	2021-05-27	5,174.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2021053100003279	北京君正	2021-05-27	1,300.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2021053100003344	北京君正	2021-05-25	3,562.00	-	14	3.50	-	-	
中	2021053100003395	北	2021-	1,300.00	-	14	3.60	-	-	

信 证 券		京 君 正	05-20							
中 信 证 券	2021053100003397	北 京 君 正	2021- 05-20	3,744.00	-	14	3.60	-	-	
中 信 证 券	2021053100003399	北 京 君 正	2021- 05-20	1,300.00	-	14	3.60	-	-	
中 信 证 券	2021060100000682	全 志 科 技	2021- 06-01	2,557,800.00	49,000.00	14	3.40	3,381.98	-	
中 信 证 券	2021060100000696	景 嘉 微	2021- 06-01	1,493,100.00	18,000.00	14	3.50	2,032.28	-	
中 信 证 券	2021060100000702	江 丰 电 子	2021- 06-01	1,172,931.00	26,700.00	14	3.30	1,505.26	-	
中 信 证 券	2021060100002118	鼎 龙 股 份	2021- 05-13	835,560.00	44,000.00	20	3.40	1,309.83	-	
中 信 证 券	2021060100002120	鼎 龙 股 份	2021- 05-13	911,520.00	48,000.00	20	3.40	1,428.91	-	
中 信 证 券	2021060100002667	晶 盛 机 电	2021- 06-01	2,110,430.00	49,000.00	14	3.40	2,790.46	-	
中 信 证 券	2021060100002669	晶 盛 机 电	2021- 06-01	430,700.00	10,000.00	14	3.40	569.48	-	
中 信 证 券	2021060300000845	卓 胜 微	2021- 06-03	4,071,000.00	10,000.00	14	3.30	5,224.45	-	
中 信 证 券	2021060300009792	扬 杰 科 技	2021- 06-03	1,554,120.00	36,000.00	14	3.60	2,175.77	-	
中 信 证 券	2021060300009802	南 大 光 电	2021- 06-03	5,406,000.00	159,000.00	14	3.90	8,199.10	-	

中信证券	2021060300009804	南大光电	2021-06-03	5,100,000.00	150,000.00	14	3.90	7,735.00	-	
中信证券	2021060300009806	南大光电	2021-06-03	714,000.00	21,000.00	14	3.90	1,082.90	-	
中信证券	2021060300009808	南大光电	2021-06-03	612,000.00	18,000.00	28	3.80	1,808.80	-	
中信证券	2021060300009810	南大光电	2021-06-03	1,091,400.00	32,100.00	14	3.90	1,655.29	-	
中信证券	2021060300009812	南大光电	2021-06-03	1,700,000.00	50,000.00	14	3.90	2,578.33	-	
中信证券	2021060300009814	南大光电	2021-06-03	34,000.00	1,000.00	14	3.90	51.57	-	
中信证券	2021060300010072	江丰电子	2021-06-03	942,040.00	22,000.00	28	3.20	2,344.63	-	
中信证券	2021060300010568	上海新阳	2021-06-03	510,120.00	12,000.00	28	3.50	1,388.66	-	
中信证券	2021060300010570	上海新阳	2021-06-03	3,613,350.00	85,000.00	14	3.60	5,058.69	-	
中信证券	2021060300010578	北京君正	2021-06-03	855,300.00	10,000.00	14	3.30	1,097.64	-	
中信证券	2021060300010580	晶盛机电	2021-06-03	812,472.00	19,400.00	14	3.40	1,074.27	-	
中信证券	2021060300010582	北京君正	2021-06-03	2,463,264.00	28,800.00	14	3.30	3,161.19	-	
中信证	2021060300010584	北京君	2021-06-03	855,300.00	10,000.00	14	3.30	1,097.64	-	

券		正								
中信证券	2021060300010586	上海新阳	2021-06-03	1,317,810.00	31,000.00	14	3.60	1,844.93	-	
中信证券	2021060300010592	扬杰科技	2021-06-03	1,985,820.00	46,000.00	14	3.60	2,780.15	-	
中信证券	2021060300010594	扬杰科技	2021-06-03	621,648.00	14,400.00	14	3.60	870.31	-	
中信证券	2021060300010596	上海新阳	2021-06-03	425,100.00	10,000.00	14	3.60	595.14	-	
中信证券	2021060800006083	北京君正	2021-06-08	871,900.00	10,000.00	14	3.40	1,152.85	-	
中信证券	2021060800006087	南大光电	2021-06-08	357,500.00	10,000.00	14	3.50	486.60	-	
中信证券	2021060800006091	扬杰科技	2021-06-08	1,510,740.00	33,000.00	14	3.70	2,173.79	-	
中信证券	2021060800006093	北京君正	2021-06-08	2,389,006.00	27,400.00	14	3.40	3,158.80	-	
中信证券	2021060900000675	扬杰科技	2021-06-09	733,785.00	15,900.00	14	3.60	1,027.30	-	
中信证券	2021060900000683	卓胜微	2021-06-09	5,436,000.00	12,000.00	28	3.30	13,952.40	-	
中信证券	2021061000000556	卓胜微	2021-06-10	4,630,000.00	10,000.00	14	3.40	6,121.89	-	
中信证券	2021061000007778	上海新阳	2021-06-10	481,185.00	11,100.00	28	3.00	1,122.77	-	
中信	2021061000007780	扬杰	2021-06-10	760,480.00	16,000.00	14	3.70	1,094.25	-	

证券		科技								
中信证券	2021061000007782	上海新阳	2021-06-10	433,500.00	10,000.00	14	3.10	522.61	-	
中信证券	2021061000007784	扬杰科技	2021-06-10	1,663,550.00	35,000.00	14	3.70	2,393.66	-	
中信证券	2021061000007786	北京君正	2021-06-10	3,758,314.00	39,800.00	14	3.40	4,969.33	-	
中信证券	2021061000007788	晶盛机电	2021-06-10	1,318,948.00	29,800.00	28	3.40	3,487.88	-	
中信证券	2021061000007790	北京君正	2021-06-10	944,300.00	10,000.00	14	3.40	1,248.57	-	
中信证券	2021061500001752	扬杰科技	2021-06-15	1,476,800.00	32,000.00	14	3.70	2,124.95	-	
中信证券	2021061500001762	圣邦股份	2021-06-15	2,948,000.00	10,000.00	14	2.90	3,324.69	-	
中信证券	2021061500001766	江丰电子	2021-06-15	1,585,450.00	37,000.00	14	3.40	2,096.32	-	
中信证券	2021061500016018	景嘉微	2021-06-15	1,614,960.00	18,000.00	14	3.60	2,260.94	-	
中信证券	2021061500016020	江丰电子	2021-06-15	1,144,095.00	26,700.00	14	3.40	1,512.75	-	
中信证券	2021061500016022	全志科技	2021-06-15	2,919,420.00	49,000.00	14	3.30	3,746.59	-	
中信证券	2021061500016024	晶盛机电	2021-06-15	439,400.00	10,000.00	14	3.40	580.98	-	
中	2021061500016026	晶	2021-	2,153,060.00	49,000.00	14	3.40	2,846.82	-	

信 证 券		盛 机 电	06-15							
中 信 证 券	2021061500017196	景 嘉 微	2021- 05-19	2,730.00	-	28	3.50	-	-	
中 信 证 券	2021061500017212	景 嘉 微	2021- 06-15	2,340.00	-	14	3.60	-	-	
中 信 证 券	2021061500017290	景 嘉 微	2021- 05-25	1,820.00	-	28	3.40	-	-	
中 信 证 券	2021061600000913	卓 胜 微	2021- 06-16	91,200,000.00	200,000.00	28	3.30	234,080.00	-	
中 信 证 券	2021061600007001	景 嘉 微	2021- 06-16	1,837,290.00	21,000.00	28	3.50	5,001.51	-	
中 信 证 券	2021061600007003	上 海 新 阳	2021- 06-16	1,938,900.00	46,000.00	28	3.00	4,524.10	-	
中 信 证 券	2021061700001943	全 志 科 技	2021- 06-17	1,831,180.00	26,000.00	14	3.40	2,421.23	-	
中 信 证 券	2021061700001945	北 京 君 正	2021- 06-17	505,950.00	5,000.00	14	3.60	708.33	-	
中 信 证 券	2021061700001947	扬 杰 科 技	2021- 06-17	1,233,120.00	24,000.00	14	3.70	1,774.32	-	
中 信 证 券	2021061700001951	北 京 君 正	2021- 06-17	2,226,180.00	22,000.00	14	3.60	3,116.65	-	
中 信 证 券	2021061700001953	江 丰 电 子	2021- 06-17	47,420.00	1,000.00	14	3.40	62.70	-	
中 信 证 券	2021061700001955	上 海 新 阳	2021- 06-17	47,730.00	1,000.00	14	3.20	59.40	-	

中信证券	2021061700016501	扬杰科技	2021-06-17	1,849,680.00	36,000.00	14	3.60	2,589.55	-	
中信证券	2021061700016503	南大光电	2021-06-17	833,700.00	21,000.00	14	3.60	1,167.18	-	
中信证券	2021061700016507	南大光电	2021-06-17	6,312,300.00	159,000.00	14	3.60	8,837.22	-	
中信证券	2021061700016509	扬杰科技	2021-06-17	2,363,480.00	46,000.00	14	3.60	3,308.87	-	
中信证券	2021061700016511	南大光电	2021-06-17	5,955,000.00	150,000.00	14	3.60	8,337.00	-	
中信证券	2021061700016513	卓胜微	2021-06-17	4,908,100.00	10,000.00	14	3.40	6,489.60	-	
中信证券	2021061700016515	晶盛机电	2021-06-17	843,706.00	19,400.00	14	3.40	1,115.57	-	
中信证券	2021061700016517	扬杰科技	2021-06-17	739,872.00	14,400.00	14	3.60	1,035.82	-	
中信证券	2021061700016519	上海新阳	2021-06-17	4,057,050.00	85,000.00	14	3.10	4,891.00	-	
中信证券	2021061700016521	南大光电	2021-06-17	1,274,370.00	32,100.00	14	3.60	1,784.12	-	
中信证券	2021061700016523	南大光电	2021-06-17	39,700.00	1,000.00	14	3.60	55.58	-	
中信证券	2021061700016525	北京君正	2021-06-17	1,011,900.00	10,000.00	14	3.50	1,377.31	-	
中信证	2021061700016527	北京君	2021-06-17	2,914,272.00	28,800.00	14	3.50	3,966.65	-	

券		正								
中信证券	2021061700016529	上海新阳	2021-06-17	1,479,630.00	31,000.00	14	3.10	1,783.78	-	
中信证券	2021061700019720	圣邦股份	2021-06-15	5,000.00	-	14	2.90	-	-	
中信证券	2021061700019762	圣邦股份	2021-06-15	-	5,000.00	14	2.90	-	-	
中信证券	2021062200001478	圣邦股份	2021-06-22	1,913,600.00	10,000.00	14	3.40	2,530.20	-	
中信证券	2021062200011680	景嘉微	2021-06-22	1,319,080.00	14,000.00	28	3.60	3,297.70	-	
中信证券	2021062200011722	扬杰科技	2021-06-22	1,895,190.00	33,000.00	14	3.70	2,726.97	-	
中信证券	2021062200011724	北京君正	2021-06-22	2,640,812.00	27,400.00	14	3.60	3,697.14	-	
中信证券	2021062200011726	北京君正	2021-06-22	963,800.00	10,000.00	14	3.60	1,349.32	-	
中信证券	2021062200011944	南大光电	2021-06-22	380,600.00	10,000.00	14	3.70	547.64	-	
中信证券	2021062200011946	卓胜微	2021-06-22	14,475,000.00	30,000.00	28	3.30	33,171.88	-	
中信证券	2021062200011948	上海新阳	2021-06-22	1,089,000.00	22,000.00	28	3.10	2,344.38	-	
中信证券	2021062300018712	扬杰科技	2021-06-23	929,991.00	15,900.00	14	3.70	1,338.15	-	
中信	2021062400001199	全志	2021-06-24	2,056,860.00	27,000.00	14	3.60	2,879.60	-	

证券		科技								
中信证券	2021062400008981	扬杰科技	2021-06-24	2,043,650.00	35,000.00	14	3.70	2,940.59	-	
中信证券	2021062400009011	北京君正	2021-06-24	963,100.00	10,000.00	14	3.60	1,348.34	-	
中信证券	2021062400009013	北京君正	2021-06-24	3,833,138.00	39,800.00	14	3.60	5,366.39	-	
中信证券	2021062400009433	卓胜微	2021-06-24	4,900,000.00	10,000.00	14	3.40	6,478.89	-	
中信证券	2021062400009435	上海新阳	2021-06-24	1,158,480.00	24,000.00	28	3.10	2,294.43	-	
中信证券	2021062400009437	上海新阳	2021-06-24	482,700.00	10,000.00	14	3.20	600.69	-	
中信证券	2021062900017975	晶盛机电	2021-06-29	2,378,460.00	49,000.00	14	3.50	3,237.35	-	
中信证券	2021062900017977	圣邦股份	2021-06-29	2,309,900.00	10,000.00	14	3.40	3,054.20	-	
中信证券	2021062900017979	江丰电子	2021-06-29	1,752,690.00	37,000.00	14	3.50	2,385.61	-	
中信证券	2021062900017981	扬杰科技	2021-06-29	1,924,800.00	32,000.00	14	3.70	2,769.57	-	
中信证券	2021062900017985	全志科技	2021-06-29	4,011,630.00	49,000.00	14	3.60	5,616.28	-	
中信证券	2021062900017987	江丰电子	2021-06-29	1,264,779.00	26,700.00	14	3.50	1,721.50	-	
中	2021062900017989	景	2021-	1,696,500.00	18,000.00	14	3.60	2,375.10	-	

信 证 券		嘉 微	06-29								
中 信 证 券	2021070100000856	圣 邦 股 份	2021- 07-01	2,444,800.00	10,000.00	14	3.40	3,232.57	-		
中 信 证 券	2021070100000870	全 志 科 技	2021- 07-01	1,108,784.00	13,100.00	14	3.80	1,638.54	-		
中 信 证 券	2021070100015884	北 京 君 正	2021- 07-01	2,764,512.00	28,800.00	14	3.50	3,762.81	-		
中 信 证 券	2021070100015886	南 大 光 电	2021- 07-01	5,664,000.00	150,000.00	14	3.90	8,590.40	-		
中 信 证 券	2021070100015888	南 大 光 电	2021- 07-01	37,760.00	1,000.00	14	3.90	57.27	-		
中 信 证 券	2021070100015890	晶 盛 机 电	2021- 07-01	927,126.00	19,400.00	14	3.50	1,261.92	-		
中 信 证 券	2021070100015892	南 大 光 电	2021- 07-01	679,680.00	18,000.00	28	3.80	2,008.83	-		
中 信 证 券	2021070100015894	南 大 光 电	2021- 07-01	6,003,840.00	159,000.00	14	3.90	9,105.82	-		
中 信 证 券	2021070100015896	南 大 光 电	2021- 07-01	1,212,096.00	32,100.00	14	3.90	1,838.35	-		
中 信 证 券	2021070100015898	南 大 光 电	2021- 07-01	792,960.00	21,000.00	14	3.90	1,202.66	-		
中 信 证 券	2021070100015900	北 京 君 正	2021- 07-01	2,111,780.00	22,000.00	14	3.50	2,874.37	-		
中 信 证 券	2021070100015902	北 京 君 正	2021- 07-01	479,950.00	5,000.00	14	3.50	653.27	-		

中信证券	2021070100015904	北京君正	2021-07-01	959,900.00	10,000.00	14	3.50	1,306.53	-	
中信证券	2021070100015906	上海新阳	2021-07-01	1,543,800.00	31,000.00	14	3.50	2,101.28	-	
中信证券	2021070100015908	上海新阳	2021-07-01	49,800.00	1,000.00	14	3.50	67.78	-	
中信证券	2021070100015910	上海新阳	2021-07-01	4,233,000.00	85,000.00	14	3.50	5,761.58	-	
中信证券	2021070100015912	扬杰科技	2021-07-01	2,571,400.00	46,000.00	14	3.70	3,699.96	-	
中信证券	2021070100015914	扬杰科技	2021-07-01	1,341,600.00	24,000.00	14	3.70	1,930.41	-	
中信证券	2021070100015916	扬杰科技	2021-07-01	804,960.00	14,400.00	14	3.70	1,158.25	-	
中信证券	2021070100015918	扬杰科技	2021-07-01	2,012,400.00	36,000.00	14	3.70	2,895.62	-	
中信证券	2021070100015920	全志科技	2021-07-01	2,200,640.00	26,000.00	14	3.60	3,080.90	-	
中信证券	2021070100015922	卓胜微	2021-07-01	5,330,000.00	10,000.00	14	3.40	7,047.44	-	
中信证券	2021070100015924	江丰电子	2021-07-01	47,940.00	1,000.00	14	3.50	65.25	-	
中信证券	2021070100015926	江丰电子	2021-07-01	1,054,680.00	22,000.00	28	3.40	2,789.04	-	
中信证	2021070200001183	圣邦股	2021-07-02	700,500.00	7,100.00	7	3.50	1,128.26	-	

券		份								
中信证券	2021070600011498	北京君正	2021-07-06	1,039,000.00	10,000.00	14	3.60	1,454.60	-	
中信证券	2021070600011504	南大光电	2021-07-06	381,500.00	10,000.00	14	3.40	504.43	-	
中信证券	2021070600011506	北京君正	2021-07-06	2,846,860.00	27,400.00	14	3.60	3,985.60	-	
中信证券	2021070600011508	圣邦股份	2021-07-06	2,320,000.00	10,000.00	14	3.40	3,067.56	-	
中信证券	2021070600012462	晶盛机电	2021-06-10	4,023.00	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021070600012528	晶盛机电	2021-07-01	2,619.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2021070600012570	晶盛机电	2021-06-29	6,615.00	-	14	3.50	-	-	
中信证券	2021070700016915	卓胜微	2021-07-07	6,114,000.00	12,000.00	28	3.20	15,217.07	-	
中信证券	2021070800007599	全志科技	2021-07-08	2,394,900.00	27,000.00	14	3.80	3,539.13	-	
中信证券	2021070800007601	北京君正	2021-07-08	4,178,204.00	39,800.00	14	3.60	5,849.49	-	
中信证券	2021070800007603	上海新阳	2021-07-08	492,300.00	10,000.00	14	3.60	689.22	-	
中信证券	2021070800007605	北京君正	2021-07-08	1,049,800.00	10,000.00	14	3.60	1,469.72	-	
中信	2021070800007607	卓胜	2021-07-08	5,165,300.00	10,000.00	14	3.30	6,628.80	-	

证 券		微								
中 信 证 券	2021070900006335	圣 邦 股 份	2021- 07-09	743,640.00	3,000.00	7	3.20	462.71	-	
中 信 证 券	2021071300020441	扬 杰 科 技	2021- 07-13	1,825,600.00	32,000.00	14	3.60	2,555.84	-	
中 信 证 券	2021071300021379	江 丰 电 子	2021- 07-13	1,810,780.00	37,000.00	14	3.50	2,464.67	-	
中 信 证 券	2021071300021381	江 丰 电 子	2021- 07-13	1,306,698.00	26,700.00	14	3.50	1,778.56	-	
中 信 证 券	2021071300021383	景 嘉 微	2021- 07-13	1,621,440.00	18,000.00	14	2.90	1,828.62	-	
中 信 证 券	2021071300021385	全 志 科 技	2021- 07-13	4,248,790.00	49,000.00	14	3.90	6,444.00	-	
中 信 证 券	2021071300021387	圣 邦 股 份	2021- 07-13	2,248,400.00	10,000.00	14	3.10	2,710.57	-	
中 信 证 券	2021071400006960	卓 胜 微	2021- 07-14	86,164,000.00	200,000.00	28	2.50	167,541.11	-	
中 信 证 券	2021071400006966	上 海 新 阳	2021- 07-14	2,178,100.00	46,000.00	28	3.50	5,929.27	-	
中 信 证 券	2021071500015706	北 京 君 正	2021- 07-15	1,165,400.00	10,000.00	14	3.50	1,586.24	-	
中 信 证 券	2021071500015708	北 京 君 正	2021- 07-15	3,356,352.00	28,800.00	14	3.50	4,568.37	-	
中 信 证 券	2021071500015710	北 京 君 正	2021- 07-15	2,563,880.00	22,000.00	14	3.50	3,489.73	-	
中	2021071500015712	北	2021-	582,700.00	5,000.00	14	3.50	793.12	-	

信 证 券		京 君 正	07-15								
中 信 证 券	2021071500015718	南 大 光 电	2021- 07-15	828,660.00	21,000.00	14	6.50	2,094.67	-		
中 信 证 券	2021071500015720	南 大 光 电	2021- 07-15	39,460.00	1,000.00	14	6.50	99.75	-		
中 信 证 券	2021071500015722	上 海 新 阳	2021- 07-15	48,000.00	1,000.00	14	3.60	67.20	-		
中 信 证 券	2021071500015724	上 海 新 阳	2021- 07-15	4,080,000.00	85,000.00	14	3.60	5,712.00	-		
中 信 证 券	2021071500015726	上 海 新 阳	2021- 07-15	1,488,000.00	31,000.00	14	3.60	2,083.20	-		
中 信 证 券	2021071500017572	卓 胜 微	2021- 07-15	4,310,000.00	10,000.00	14	2.60	4,357.89	-		
中 信 证 券	2021071500017574	圣 邦 股 份	2021- 07-15	2,431,600.00	10,000.00	14	3.10	2,931.43	-		
中 信 证 券	2021071500017578	江 丰 电 子	2021- 07-15	47,820.00	1,000.00	14	3.50	65.09	-		
中 信 证 券	2021071500017580	扬 杰 科 技	2021- 07-15	2,567,260.00	46,000.00	14	3.60	3,594.16	-		
中 信 证 券	2021071500017582	扬 杰 科 技	2021- 07-15	2,009,160.00	36,000.00	14	3.60	2,812.82	-		
中 信 证 券	2021071500017584	扬 杰 科 技	2021- 07-15	1,339,440.00	24,000.00	14	3.60	1,875.22	-		
中 信 证 券	2021071500017586	南 大 光 电	2021- 07-15	1,266,666.00	32,100.00	14	6.50	3,201.85	-		

中信证券	2021071500017588	南大光电	2021-07-15	5,919,000.00	150,000.00	14	6.50	14,961.92	-	
中信证券	2021071500017590	南大光电	2021-07-15	6,274,140.00	159,000.00	14	6.50	15,859.63	-	
中信证券	2021071500017592	全志科技	2021-07-15	2,163,200.00	26,000.00	14	3.90	3,280.85	-	
中信证券	2021071500017594	全志科技	2021-07-15	1,089,920.00	13,100.00	14	3.90	1,653.05	-	
中信证券	2021071500017598	扬杰科技	2021-07-15	803,664.00	14,400.00	14	3.60	1,125.13	-	
中信证券	2021071500017874	上海新阳	2021-07-15	17,000.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021071500017876	上海新阳	2021-07-15	6,200.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021071500017882	上海新阳	2021-07-15	200.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021071500017888	上海新阳	2021-07-14	9,200.00	-	28	3.50	-	-	
中信证券	2021071500017900	上海新阳	2021-07-08	2,000.00	-	14	3.60	-	-	
中信证券	2021071500017922	上海新阳	2021-06-22	4,400.00	-	28	3.10	-	-	
中信证券	2021071500017924	上海新阳	2021-06-24	4,800.00	-	28	3.10	-	-	
中信证	2021072000012523	圣邦股	2021-07-20	2,630,400.00	10,000.00	28	2.40	4,910.08	-	

券		份								
中信证券	2021072000012525	卓胜微	2021-07-20	12,819,000.00	30,000.00	28	2.20	21,934.73	-	
中信证券	2021072000012527	北京君正	2021-07-20	1,273,500.00	10,000.00	28	3.40	3,367.70	-	
中信证券	2021072000012529	北京君正	2021-07-20	3,489,390.00	27,400.00	28	3.40	9,227.50	-	
中信证券	2021072000012531	南大光电	2021-07-20	376,200.00	10,000.00	28	3.70	1,082.62	-	
中信证券	2021072200009238	北京君正	2021-07-22	5,763,836.00	39,800.00	28	3.40	15,242.14	-	
中信证券	2021072200009240	上海新阳	2021-07-22	533,000.00	10,000.00	28	3.50	1,450.94	-	
中信证券	2021072200009242	北京君正	2021-07-22	1,448,200.00	10,000.00	28	3.40	3,829.68	-	
中信证券	2021072200009248	全志科技	2021-07-22	2,801,250.00	27,000.00	28	3.40	7,407.75	-	
中信证券	2021072200009250	卓胜微	2021-07-22	4,231,200.00	10,000.00	28	2.20	7,240.05	-	
中信证券	2021072700001478	晶盛机电	2021-07-27	1,799,860.00	31,000.00	14	3.40	2,379.81	-	
中信证券	2021072700018607	江丰电子	2021-07-27	1,411,362.00	26,700.00	28	3.40	3,732.27	-	
中信证券	2021072700018609	圣邦股份	2021-07-27	2,834,100.00	10,000.00	28	2.20	4,849.46	-	
中信	2021072700018611	江丰	2021-07-27	1,955,820.00	37,000.00	28	3.40	5,172.06	-	

证券		电子								
中信证券	2021072700018613	景嘉微	2021-07-27	1,683,180.00	18,000.00	28	2.70	3,534.68	-	
中信证券	2021072700018615	全志科技	2021-07-27	5,017,110.00	49,000.00	28	3.40	13,267.47	-	
中信证券	2021072700018617	扬杰科技	2021-07-27	1,864,640.00	32,000.00	28	3.70	5,366.02	-	
中信证券	2021072900015731	全志科技	2021-07-29	2,730,000.00	26,000.00	28	3.40	7,219.33	-	
中信证券	2021072900015733	全志科技	2021-07-29	1,375,500.00	13,100.00	28	3.40	3,637.43	-	
中信证券	2021072900015737	扬杰科技	2021-07-29	797,616.00	14,400.00	28	3.70	2,295.36	-	
中信证券	2021072900015741	南大光电	2021-07-29	69,960.00	1,000.00	28	5.70	310.16	-	
中信证券	2021072900015743	南大光电	2021-07-29	11,123,640.00	159,000.00	28	5.70	49,314.80	-	
中信证券	2021072900015745	南大光电	2021-07-29	2,245,716.00	32,100.00	28	5.70	9,956.01	-	
中信证券	2021072900015747	南大光电	2021-07-29	1,469,160.00	21,000.00	28	5.70	6,513.28	-	
中信证券	2021072900015749	扬杰科技	2021-07-29	1,994,040.00	36,000.00	28	3.70	5,738.40	-	
中信证券	2021072900015751	南大光电	2021-07-29	1,259,280.00	18,000.00	28	5.70	5,582.81	-	
中	2021072900015753	南	2021-	10,494,000.00	150,000.00	28	5.70	46,523.40	-	

信 证 券		大 光 电	07-29								
中 信 证 券	2021072900015755	圣 邦 股 份	2021- 07-29	3,324,800.00	10,000.00	28	2.20	5,689.10	-		
中 信 证 券	2021072900015757	卓 胜 微	2021- 07-29	4,228,000.00	10,000.00	28	2.80	9,207.64	-		
中 信 证 券	2021072900016247	江 丰 电 子	2021- 07-29	53,830.00	1,000.00	28	3.40	142.35	-		
中 信 证 券	2021072900016249	江 丰 电 子	2021- 07-29	1,184,260.00	22,000.00	28	3.40	3,131.71	-		
中 信 证 券	2021072900016251	上 海 新 阳	2021- 07-29	4,847,550.00	85,000.00	28	3.40	12,819.08	-		
中 信 证 券	2021072900016253	北 京 君 正	2021- 07-29	5,524,992.00	28,800.00	28	2.60	11,172.76	-		
中 信 证 券	2021072900016255	北 京 君 正	2021- 07-29	1,918,400.00	10,000.00	28	2.60	3,879.43	-		
中 信 证 券	2021072900016259	北 京 君 正	2021- 07-29	959,200.00	5,000.00	28	2.60	1,939.72	-		
中 信 证 券	2021072900016261	上 海 新 阳	2021- 07-29	1,767,930.00	31,000.00	28	3.40	4,675.19	-		
中 信 证 券	2021072900016263	上 海 新 阳	2021- 07-29	57,030.00	1,000.00	28	3.40	150.81	-		
中 信 证 券	2021072900016265	北 京 君 正	2021- 07-29	4,220,480.00	22,000.00	28	2.60	8,534.75	-		
中 信 证 券	2021072900016723	扬 杰 科 技	2021- 07-29	1,329,360.00	24,000.00	28	3.70	3,825.60	-		

中信证券	2021072900016725	扬杰科技	2021-07-29	2,547,940.00	46,000.00	28	3.70	7,332.41	-	
中信证券	2021080400017532	卓胜微	2021-08-04	4,866,000.00	12,000.00	28	2.90	10,975.53	-	
中信证券	2021080500001172	晶盛机电	2021-08-05	849,290.00	13,000.00	14	3.50	1,155.98	-	
中信证券	2021080500001182	全志科技	2021-08-05	2,831,500.00	35,000.00	14	3.50	3,853.99	-	
中信证券	2021080500001184	圣邦股份	2021-08-05	1,114,590.00	3,000.00	14	3.00	1,300.36	-	
中信证券	2021081100010976	卓胜微	2021-08-11	85,000,000.00	200,000.00	28	2.70	178,500.00	-	
中信证券	2021081200000937	扬杰科技	2021-08-12	1,607,984.00	29,300.00	14	3.70	2,313.71	-	
中信证券	2021081200000939	北京君正	2021-08-12	5,003,710.00	31,000.00	14	3.60	7,005.19	-	
中信证券	2021081700012910	北京君正	2021-08-17	4,215,490.00	27,400.00	28	3.50	11,475.50	-	
中信证券	2021081700014538	卓胜微	2021-08-17	12,098,400.00	30,000.00	28	3.00	28,229.60	-	
中信证券	2021081700014540	圣邦股份	2021-08-17	3,271,500.00	10,000.00	28	2.60	6,615.70	-	
中信证券	2021081700014542	北京君正	2021-08-17	1,538,500.00	10,000.00	28	3.50	4,188.14	-	
中信证	2021081700014544	南大光	2021-08-17	663,100.00	10,000.00	28	5.90	3,042.89	-	

券		电								
中信证券	2021081900011453	北京君正	2021-08-19	1,538,400.00	10,000.00	28	3.50	4,187.87	-	
中信证券	2021081900011455	圣邦股份	2021-08-19	1,013,850.00	3,000.00	14	2.70	1,064.54	-	
中信证券	2021081900011457	卓胜微	2021-08-19	4,298,400.00	10,000.00	28	3.00	10,029.60	-	
中信证券	2021081900011459	全志科技	2021-08-19	2,566,200.00	35,000.00	14	3.50	3,492.88	-	
中信证券	2021081900011461	上海新阳	2021-08-19	508,800.00	10,000.00	28	3.50	1,385.07	-	
中信证券	2021081900011463	晶盛机电	2021-08-19	786,370.00	13,000.00	14	3.50	1,070.34	-	
中信证券	2021081900011925	北京君正	2021-08-19	6,122,832.00	39,800.00	28	3.50	16,667.71	-	
中信证券	2021082400001303	江丰电子	2021-08-24	152,970.00	3,000.00	14	3.40	202.26	-	
中信证券	2021082400018387	扬杰科技	2021-08-24	1,612,480.00	32,000.00	28	3.70	4,806.09	-	
中信证券	2021082400018389	全志科技	2021-08-24	3,687,740.00	49,000.00	28	3.20	9,506.18	-	
中信证券	2021082400018393	景嘉微	2021-08-24	1,818,180.00	18,000.00	28	3.10	4,540.40	-	
中信证券	2021082400018403	江丰电子	2021-08-24	1,361,433.00	26,700.00	28	3.30	3,619.14	-	
中信	2021082400019099	圣邦	2021-08-24	3,660,000.00	10,000.00	28	3.20	9,434.66	-	

证券		股份								
中信证券	2021082400019101	江丰电子	2021-08-24	1,886,630.00	37,000.00	28	3.30	5,015.29	-	
中信证券	2021082600000926	圣邦股份	2021-08-26	1,251,040.00	4,000.00	14	3.50	1,702.80	-	
中信证券	2021082600014813	圣邦股份	2021-08-26	3,127,600.00	10,000.00	28	3.20	7,784.25	-	
中信证券	2021082600014815	江丰电子	2021-08-26	49,760.00	1,000.00	28	3.30	127.72	-	
中信证券	2021082600014817	全志科技	2021-08-26	967,959.00	13,100.00	28	3.20	2,409.14	-	
中信证券	2021082600014819	卓胜微	2021-08-26	4,107,800.00	10,000.00	28	2.70	8,626.38	-	
中信证券	2021082600014821	江丰电子	2021-08-26	1,094,720.00	22,000.00	28	3.30	2,809.78	-	
中信证券	2021082600014823	北京君正	2021-08-26	1,510,900.00	10,000.00	28	3.40	3,995.49	-	
中信证券	2021082600014825	上海新阳	2021-08-26	49,730.00	1,000.00	28	3.50	135.38	-	
中信证券	2021082600014827	南大光电	2021-08-26	61,810.00	1,000.00	28	3.50	168.26	-	
中信证券	2021082600014829	上海新阳	2021-08-26	4,227,050.00	85,000.00	28	3.50	11,506.97	-	
中信证券	2021082600014831	北京君正	2021-08-26	4,683,790.00	31,000.00	14	3.50	6,375.16	-	
中	2021082600014833	北	2021-	4,351,392.00	28,800.00	28	3.40	11,507.01	-	

信 证 券		京 君 正	08-26								
中 信 证 券	2021082600014835	北 京 君 正	2021- 08-26	3,323,980.00	22,000.00	28	3.40	8,790.08	-		
中 信 证 券	2021082600014837	北 京 君 正	2021- 08-26	755,450.00	5,000.00	28	3.40	1,997.75	-		
中 信 证 券	2021082600014839	扬 杰 科 技	2021- 08-26	704,448.00	14,400.00	28	3.70	2,027.24	-		
中 信 证 券	2021082600014841	扬 杰 科 技	2021- 08-26	1,174,080.00	24,000.00	28	3.70	3,378.74	-		
中 信 证 券	2021082600014843	扬 杰 科 技	2021- 08-26	1,761,120.00	36,000.00	28	3.70	5,068.11	-		
中 信 证 券	2021082600014845	全 志 科 技	2021- 08-26	1,921,140.00	26,000.00	28	3.20	4,781.50	-		
中 信 证 券	2021082600014847	扬 杰 科 技	2021- 08-26	2,250,320.00	46,000.00	28	3.70	6,475.92	-		
中 信 证 券	2021082600014849	扬 杰 科 技	2021- 08-26	1,433,356.00	29,300.00	14	3.80	2,118.18	-		
中 信 证 券	2021082600014851	南 大 光 电	2021- 08-26	1,298,010.00	21,000.00	28	3.50	3,533.47	-		
中 信 证 券	2021083100000836	景 嘉 微	2021- 08-31	594,150.00	5,000.00	14	3.60	831.81	-		
中 信 证 券	2021083100000878	圣 邦 股 份	2021- 08-31	1,920,000.00	6,000.00	14	3.40	2,538.67	-		
中 信 证 券	2021083100000880	扬 杰 科 技	2021- 08-31	2,679,600.00	56,000.00	28	3.70	7,711.29	-		

中信证券	2021090100019803	卓胜微	2021-09-01	4,704,720.00	12,000.00	28	2.80	10,245.83	-	
中信证券	2021090100019813	江丰电子	2021-07-27	18,314.87	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021090100019815	江丰电子	2021-07-27	25,380.15	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021090100019849	江丰电子	2021-07-29	685.95	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021090100019851	江丰电子	2021-07-29	15,090.90	-	28	3.40	-	-	
中信证券	2021090200001190	扬杰科技	2021-09-02	1,959,940.00	43,000.00	14	3.80	2,896.36	-	
中信证券	2021090200012460	全志科技	2021-09-02	2,415,700.00	35,000.00	14	3.30	3,100.15	-	
中信证券	2021090200012462	圣邦股份	2021-09-02	914,220.00	3,000.00	14	3.50	1,244.36	-	
中信证券	2021090200012464	晶盛机电	2021-09-02	1,006,850.00	13,000.00	14	3.40	1,331.28	-	
中信证券	2021090700021363	江丰电子	2021-09-07	146,520.00	3,000.00	14	3.50	213.68	-	
中信证券	2021090800012035	卓胜微	2021-09-08	70,200,000.00	200,000.00	28	3.00	175,500.00	-	
中信证券	2021090900000553	南大光电	2021-09-09	3,000,000.00	50,000.00	14	3.60	4,200.00	-	
中信证	2021090900015307	圣邦股	2021-09-09	1,235,920.00	4,000.00	14	3.40	1,634.16	-	

券		份								
中信证券	2021090900015309	北京君正	2021-09-09	4,399,210.00	31,000.00	14	3.40	5,816.73	-	
中信证券	2021090900015311	扬杰科技	2021-09-09	1,355,418.00	29,300.00	14	3.80	2,003.01	-	
中信证券	2021091400015896	圣邦股份	2021-09-14	1,947,600.00	6,000.00	14	2.70	2,044.98	-	
中信证券	2021091400015898	景嘉微	2021-09-14	633,900.00	5,000.00	14	3.50	862.81	-	
中信证券	2021091400015900	北京君正	2021-09-14	1,365,000.00	10,000.00	28	3.10	3,291.17	-	
中信证券	2021091400015902	北京君正	2021-09-14	3,740,100.00	27,400.00	28	3.10	9,017.80	-	
中信证券	2021091400015904	南大光电	2021-09-14	620,500.00	10,000.00	28	3.50	1,689.14	-	
中信证券	2021091400015906	圣邦股份	2021-09-14	3,246,000.00	10,000.00	28	2.60	6,564.13	-	
中信证券	2021091600012775	卓胜微	2021-09-16	3,335,100.00	10,000.00	28	2.50	6,484.92	-	
中信证券	2021091600012777	晶盛机电	2021-09-16	903,500.00	13,000.00	14	3.50	1,229.76	-	
中信证券	2021091600012779	扬杰科技	2021-09-16	1,888,560.00	43,000.00	14	4.00	2,937.76	-	
中信证券	2021091600012781	圣邦股份	2021-09-16	917,220.00	3,000.00	14	2.70	963.08	-	
中信	2021091600012783	北京	2021-09-16	5,133,802.00	39,800.00	28	3.10	12,378.17	-	

证券		君正								
中信证券	2021091600012785	北京君正	2021-09-16	1,289,900.00	10,000.00	28	3.10	3,110.09	-	
中信证券	2021091600012787	上海新阳	2021-09-16	448,900.00	10,000.00	28	3.40	1,187.09	-	
中信证券	2021092200034719	江丰电子	2021-09-22	1,193,490.00	26,700.00	28	3.60	3,341.77	-	
中信证券	2021092200034721	江丰电子	2021-09-22	134,100.00	3,000.00	14	3.70	220.53	-	
中信证券	2021092200034723	圣邦股份	2021-09-22	3,139,500.00	10,000.00	28	3.20	7,813.87	-	
中信证券	2021092200034725	江丰电子	2021-09-22	1,653,900.00	37,000.00	28	3.60	4,630.92	-	
中信证券	2021092200036445	扬杰科技	2021-09-22	1,395,200.00	32,000.00	28	4.00	4,340.62	-	
中信证券	2021092300001058	景嘉微	2021-09-23	2,194,360.00	17,000.00	14	3.50	3,200.11	-	
中信证券	2021092300001060	南大光电	2021-09-23	3,147,000.00	50,000.00	28	3.50	8,566.83	-	
中信证券	2021092300013513	江丰电子	2021-09-23	44,950.00	1,000.00	28	3.60	125.86	-	
中信证券	2021092300013519	北京君正	2021-09-23	2,871,220.00	22,000.00	28	3.30	7,369.46	-	
中信证券	2021092300013521	北京君正	2021-09-23	4,045,810.00	31,000.00	14	3.40	5,731.56	-	
中	2021092300013523	上	2021-	46,010.00	1,000.00	28	3.10	110.94	-	

信 证 券		海 新 阳	09-23								
中 信 证 券	2021092300016877	卓 胜 微	2021- 09-23	3,414,100.00	10,000.00	28	3.00	7,966.23	-		
中 信 证 券	2021092300016883	北 京 君 正	2021- 09-23	1,305,100.00	10,000.00	28	3.30	3,349.76	-		
中 信 证 券	2021092300016885	南 大 光 电	2021- 09-23	62,940.00	1,000.00	28	3.60	176.23	-		
中 信 证 券	2021092300016887	全 志 科 技	2021- 09-23	931,541.00	13,100.00	28	2.60	1,883.78	-		
中 信 证 券	2021092300016889	圣 邦 股 份	2021- 09-23	3,210,000.00	10,000.00	28	3.20	7,989.33	-		
中 信 证 券	2021092300016891	圣 邦 股 份	2021- 09-23	1,284,000.00	4,000.00	14	3.30	1,765.50	-		
中 信 证 券	2021092300016893	南 大 光 电	2021- 09-23	3,147,000.00	50,000.00	14	3.70	4,851.62	-		
中 信 证 券	2021092300016895	扬 杰 科 技	2021- 09-23	1,626,480.00	36,000.00	28	4.00	5,060.16	-		
中 信 证 券	2021092300016897	扬 杰 科 技	2021- 09-23	1,323,774.00	29,300.00	14	4.10	2,261.44	-		
中 信 证 券	2021092800012940	景 嘉 微	2021- 09-28	620,050.00	5,000.00	14	3.50	843.96	-		
中 信 证 券	2021092800012942	扬 杰 科 技	2021- 09-28	2,492,000.00	56,000.00	28	4.00	7,752.89	-		
中 信 证 券	2021092800012944	圣 邦 股 份	2021- 09-28	1,958,700.00	6,000.00	14	3.30	2,513.67	-		

中信证券	2021092900019179	卓胜微	2021-09-29	4,278,120.00	12,000.00	28	3.00	9,982.28	-	
中信证券	2021093000000290	晶盛机电	2021-09-30	2,014,155.00	31,300.00	14	3.30	2,584.83	-	
中信证券	2021093000012893	扬杰科技	2021-09-30	1,916,080.00	43,000.00	14	3.30	2,458.97	-	
中信证券	2021093000012895	圣邦股份	2021-09-30	998,190.00	3,000.00	14	3.00	1,164.56	-	
中信证券	2021093000012897	晶盛机电	2021-09-30	836,550.00	13,000.00	14	3.40	1,106.11	-	
中信证券	2021100800060235	卓胜微	2021-10-08	71,756,000.00	200,000.00	28	3.10	173,011.69	-	
中信证券	2021100800064547	江丰电子	2021-10-08	129,060.00	3,000.00	14	3.30	165.63	-	
中信证券	2021100800064655	北京君正	2021-10-08	3,983,500.00	31,000.00	14	3.40	5,267.07	-	
中信证券	2021100800064657	圣邦股份	2021-10-08	1,286,720.00	4,000.00	14	1.90	950.74	-	
中信证券	2021100800064659	南大光电	2021-10-08	2,566,500.00	50,000.00	14	3.60	3,593.10	-	
中信证券	2021100800064661	景嘉微	2021-10-08	2,015,860.00	17,000.00	14	3.60	2,822.20	-	
中信证券	2021100800064663	扬杰科技	2021-10-08	1,419,585.00	29,300.00	14	3.60	1,987.42	-	
中信证	2021101200001225	扬杰科	2021-10-12	820,250.00	17,000.00	14	5.10	1,626.83	-	

券		技								
中信证券	2021101200017071	景嘉微	2021-10-12	542,900.00	5,000.00	14	3.60	760.06	-	
中信证券	2021101200017083	圣邦股份	2021-10-12	3,100,600.00	10,000.00	28	1.80	4,340.84	-	
中信证券	2021101200017091	北京君正	2021-10-12	3,391,572.00	27,400.00	28	3.30	8,705.03	-	
中信证券	2021101200017105	南大光电	2021-10-12	495,000.00	10,000.00	28	3.50	1,347.50	-	
中信证券	2021101400000841	扬杰科技	2021-10-14	1,996,000.00	40,000.00	14	5.10	3,958.73	-	
中信证券	2021101400014360	扬杰科技	2021-10-14	2,145,700.00	43,000.00	14	5.10	4,255.64	-	
中信证券	2021101400014362	卓胜微	2021-10-14	3,053,000.00	10,000.00	28	2.60	6,173.84	-	
中信证券	2021101400014364	晶盛机电	2021-10-14	2,229,499.00	31,300.00	14	3.30	2,861.19	-	
中信证券	2021101400014366	北京君正	2021-10-14	1,222,700.00	10,000.00	28	3.00	2,852.97	-	
中信证券	2021101400014368	圣邦股份	2021-10-14	977,070.00	3,000.00	14	3.50	1,329.90	-	
中信证券	2021101400014370	上海新阳	2021-10-14	410,500.00	10,000.00	28	3.40	1,085.54	-	
中信证券	2021101400014372	晶盛机电	2021-10-14	925,990.00	13,000.00	14	3.30	1,188.35	-	
中信	2021101900000978	全志	2021-10-19	1,780,650.00	27,000.00	14	2.70	1,869.68	-	

证券		科技								
中信证券	2021101900000979	扬杰科技	2021-10-19	1,990,950.00	39,000.00	14	5.20	4,026.14	-	
中信证券	2021102000005287	江丰电子	2021-10-20	1,598,030.00	37,000.00	28	3.40	4,225.90	-	
中信证券	2021102000005289	圣邦股份	2021-10-20	3,202,100.00	10,000.00	28	3.40	8,467.78	-	
中信证券	2021102000005291	江丰电子	2021-10-20	1,153,173.00	26,700.00	28	3.40	3,049.50	-	
中信证券	2021102000005293	扬杰科技	2021-10-20	1,633,280.00	32,000.00	28	5.00	6,351.64	-	
中信证券	2021102100000820	卓胜微	2021-10-21	1,223,160.00	4,000.00	14	3.40	1,617.29	-	
中信证券	2021102100000822	全志科技	2021-10-21	6,489,000.00	100,000.00	14	2.70	6,813.45	-	
中信证券	2021102100004918	上海新阳	2021-10-21	39,780.00	1,000.00	28	3.40	105.20	-	
中信证券	2021102100004920	北京君正	2021-10-21	2,599,300.00	22,000.00	28	3.00	6,065.03	-	
中信证券	2021102100004922	扬杰科技	2021-10-21	1,831,680.00	36,000.00	28	5.00	7,123.20	-	
中信证券	2021102100004924	南大光电	2021-10-21	2,574,000.00	50,000.00	28	3.70	7,407.40	-	
中信证券	2021102100004962	圣邦股份	2021-10-21	3,184,100.00	10,000.00	28	3.40	8,420.18	-	
中	2021102100004964	江	2021-	42,460.00	1,000.00	28	3.40	112.28	-	

信 证 券		丰 电 子	10-21								
中 信 证 券	2021102100004966	全 志 科 技	2021- 10-21	850,059.00	13,100.00	28	2.20	1,454.55	-		
中 信 证 券	2021102100004968	卓 胜 微	2021- 10-21	3,057,900.00	10,000.00	28	2.60	6,183.75	-		
中 信 证 券	2021102200056670	景 嘉 微	2021- 10-22	2,177,360.00	17,000.00	14	2.10	1,778.18	-		
中 信 证 券	2021102200056672	扬 杰 科 技	2021- 10-22	1,529,460.00	29,300.00	14	5.10	3,033.43	-		
中 信 证 券	2021102200056674	南 大 光 电	2021- 10-22	2,793,000.00	50,000.00	14	3.80	4,127.43	-		
中 信 证 券	2021102200056676	江 丰 电 子	2021- 10-22	130,290.00	3,000.00	14	3.50	177.34	-		
中 信 证 券	2021102200056928	圣 邦 股 份	2021- 10-22	1,284,000.00	4,000.00	14	3.50	1,747.67	-		
中 信 证 券	2021102600001341	北 京 君 正	2021- 10-26	6,286,820.00	46,000.00	14	3.40	8,312.57	-		
中 信 证 券	2021102600001358	扬 杰 科 技	2021- 10-26	2,111,500.00	41,000.00	14	5.00	4,105.69	-		
中 信 证 券	2021102600014298	景 嘉 微	2021- 10-26	666,000.00	5,000.00	14	3.50	906.50	-		
中 信 证 券	2021102600014300	扬 杰 科 技	2021- 10-26	875,500.00	17,000.00	14	5.20	1,770.46	-		
中 信 证 券	2021102600014302	扬 杰 科 技	2021- 10-26	2,884,000.00	56,000.00	28	5.10	11,439.87	-		

中信证券	2021102700017041	卓胜微	2021-10-27	3,826,560.00	12,000.00	28	3.30	9,821.50	-	
中信证券	2021102800001199	上海新阳	2021-10-28	113,550.00	3,000.00	14	3.60	158.97	-	
中信证券	2021102800001204	北京君正	2021-10-28	1,291,900.00	10,000.00	14	3.40	1,708.18	-	
中信证券	2021102800001207	南大光电	2021-10-28	4,089,600.00	80,000.00	14	3.90	6,202.56	-	
中信证券	2021102800012813	扬杰科技	2021-10-28	1,941,600.00	40,000.00	14	5.20	3,926.35	-	
中信证券	2021102800012815	扬杰科技	2021-10-28	2,087,220.00	43,000.00	14	5.20	4,220.82	-	
中信证券	2021102800012817	圣邦股份	2021-10-28	943,800.00	3,000.00	14	3.50	1,284.62	-	
中信证券	2021102800012819	晶盛机电	2021-10-28	975,130.00	13,000.00	14	3.50	1,327.26	-	
中信证券	2021110200000617	上海新阳	2021-11-02	121,950.00	3,000.00	14	3.50	165.99	-	
中信证券	2021110200000623	江丰电子	2021-11-02	42,200.00	1,000.00	14	4.60	75.49	-	
中信证券	2021110200000624	江丰电子	2021-11-02	42,200.00	1,000.00	14	4.60	75.49	-	
中信证券	2021110200004216	全志科技	2021-11-02	1,739,610.00	27,000.00	14	3.50	2,367.80	-	
中信证	2021110200004218	扬杰科	2021-11-02	2,019,810.00	39,000.00	14	5.00	3,927.41	-	

券		技								
中信证券	2021110400000736	北京君正	2021-11-04	1,040,200.00	7,000.00	14	3.50	1,415.83	-	
中信证券	2021110400000741	上海新阳	2021-11-04	2,028,110.00	49,000.00	14	3.50	2,760.48	-	
中信证券	2021110400000745	扬杰科技	2021-11-04	2,152,000.00	40,000.00	14	4.90	4,100.76	-	
中信证券	2021110400000762	江丰电子	2021-11-04	2,040,000.00	48,000.00	14	4.60	3,649.33	-	
中信证券	2021110400003339	全志科技	2021-11-04	6,451,000.00	100,000.00	14	3.50	8,780.53	-	
中信证券	2021110400003341	卓胜微	2021-11-04	1,249,400.00	4,000.00	14	3.40	1,651.98	-	
中信证券	2021110500055533	扬杰科技	2021-11-05	1,542,938.00	29,300.00	14	5.00	3,000.16	-	
中信证券	2021110500055535	南大光电	2021-11-05	2,709,000.00	50,000.00	14	3.90	4,108.65	-	
中信证券	2021110500055539	圣邦股份	2021-11-05	1,387,440.00	4,000.00	14	3.30	1,780.55	-	
中信证券	2021110500055541	卓胜微	2021-11-05	62,782,000.00	200,000.00	28	3.30	161,140.47	-	
中信证券	2021110500055543	景嘉微	2021-11-05	2,621,060.00	17,000.00	14	3.50	3,567.55	-	
中信证券	2021110500055545	江丰电子	2021-11-05	127,830.00	3,000.00	14	3.80	188.90	-	
中信	2021110900000977	扬杰	2021-11-09	1,943,240.00	37,000.00	14	5.00	3,778.52	-	

证券		科技								
中信证券	2021110900001057	上海新阳	2021-11-09	126,870.00	3,000.00	14	3.30	162.82	-	
中信证券	2021110900017624	北京君正	2021-11-09	6,887,580.00	46,000.00	14	3.50	9,374.76	-	
中信证券	2021110900017628	扬杰科技	2021-11-09	892,840.00	17,000.00	14	4.90	1,701.36	-	
中信证券	2021110900017634	扬杰科技	2021-11-09	2,153,320.00	41,000.00	14	4.90	4,103.27	-	
中信证券	2021111100000907	景嘉微	2021-11-11	880,000.00	5,000.00	14	3.30	1,129.33	-	
中信证券	2021111100000916	北京君正	2021-11-11	7,906,540.00	53,000.00	14	3.50	10,761.68	-	
中信证券	2021111100010556	卓胜微	2021-11-11	3,030,300.00	10,000.00	28	3.60	8,484.84	-	
中信证券	2021111100010558	晶盛机电	2021-11-11	1,054,430.00	13,000.00	14	3.00	1,230.17	-	
中信证券	2021111100010560	扬杰科技	2021-11-11	2,158,000.00	40,000.00	14	4.90	4,112.19	-	
中信证券	2021111100010562	北京君正	2021-11-11	1,491,800.00	10,000.00	14	3.50	2,030.51	-	
中信证券	2021111100010564	上海新阳	2021-11-11	131,040.00	3,000.00	14	3.50	178.36	-	
中信证券	2021111100010566	南大光电	2021-11-11	4,681,600.00	80,000.00	14	3.90	7,100.43	-	
中	2021111100010568	扬	2021-	2,319,850.00	43,000.00	14	4.90	4,420.60	-	

信 证 券		杰 科 技	11-11								
中 信 证 券	2021111600001140	景 嘉 微	2021- 11-16	2,199,820.00	14,000.00	14	3.40	2,908.65	-		
中 信 证 券	2021111600004706	上 海 新 阳	2021- 11-16	127,500.00	3,000.00	14	3.30	163.63	-		
中 信 证 券	2021111600004708	扬 杰 科 技	2021- 11-16	2,102,100.00	39,000.00	14	5.00	4,087.42	-		
中 信 证 券	2021111600004710	江 丰 电 子	2021- 11-16	44,020.00	1,000.00	14	4.00	68.48	-		
中 信 证 券	2021111600004712	江 丰 电 子	2021- 11-16	44,020.00	1,000.00	14	4.00	68.48	-		
中 信 证 券	2021111800005705	扬 杰 科 技	2021- 11-18	2,092,400.00	40,000.00	14	5.00	4,068.56	-		
中 信 证 券	2021111800005707	圣 邦 股 份	2021- 11-18	3,328,600.00	10,000.00	28	2.70	6,990.06	-		
中 信 证 券	2021111800005709	全 志 科 技	2021- 11-18	6,570,000.00	100,000.00	14	1.90	4,854.50	-		
中 信 证 券	2021111800005713	江 丰 电 子	2021- 11-18	2,149,440.00	48,000.00	14	4.00	3,343.57	-		
中 信 证 券	2021111800005719	北 京 君 正	2021- 11-18	907,130.00	7,000.00	14	3.50	1,234.70	-		
中 信 证 券	2021111800005721	北 京 君 正	2021- 11-18	2,850,980.00	22,000.00	28	3.40	7,539.26	-		
中 信 证 券	2021111800005725	上 海 新 阳	2021- 11-18	2,069,760.00	49,000.00	14	3.30	2,656.19	-		

中信证券	2021111900046125	南大光电	2021-11-19	2,804,000.00	50,000.00	14	4.00	4,361.78	-	
中信证券	2021111900046127	扬杰科技	2021-11-19	1,668,635.00	29,300.00	14	5.00	3,244.57	-	
中信证券	2021111900046129	江丰电子	2021-11-19	133,740.00	3,000.00	14	4.00	208.04	-	
中信证券	2021111900046131	景嘉微	2021-11-19	3,313,470.00	17,000.00	14	3.30	4,252.29	-	
中信证券	2021112300000677	景嘉微	2021-11-23	5,100,000.00	25,000.00	14	3.50	6,941.67	-	
中信证券	2021112300000679	景嘉微	2021-11-23	22,134,000.00	108,500.00	14	3.50	30,126.83	-	
中信证券	2021112300000894	晶盛机电	2021-11-23	284,960.00	4,000.00	14	3.50	387.86	-	
中信证券	2021112300000896	北京君正	2021-11-23	3,625,755.00	24,500.00	14	3.60	5,076.06	-	
中信证券	2021112300000906	卓胜微	2021-11-23	2,013,000.00	6,100.00	14	3.20	2,505.07	-	
中信证券	2021112300012748	扬杰科技	2021-11-23	2,886,400.00	41,000.00	14	4.70	5,275.70	-	
中信证券	2021112300012750	北京君正	2021-11-23	6,807,540.00	46,000.00	14	3.50	9,265.82	-	
中信证券	2021112300012752	扬杰科技	2021-11-23	3,942,400.00	56,000.00	28	4.60	14,105.03	-	
中信证	2021112300012754	扬杰科	2021-11-23	1,196,800.00	17,000.00	14	4.70	2,187.48	-	

券		技								
中信证券	2021112300012758	扬杰科技	2021-11-23	2,604,800.00	37,000.00	14	4.70	4,761.00	-	
中信证券	2021112500007928	北京君正	2021-11-25	7,833,930.00	53,000.00	14	3.50	10,662.85	-	
中信证券	2021112500007930	扬杰科技	2021-11-25	2,909,200.00	40,000.00	14	4.70	5,317.37	-	
中信证券	2021112500007932	北京君正	2021-11-25	1,478,100.00	10,000.00	14	3.50	2,011.86	-	
中信证券	2021112500007936	景嘉微	2021-11-25	963,100.00	5,000.00	14	3.40	1,273.43	-	
中信证券	2021112500007940	扬杰科技	2021-11-25	3,127,390.00	43,000.00	14	4.70	5,716.17	-	
中信证券	2021112900000678	卓胜微	2021-11-29	30,011,200.00	80,000.00	14	3.50	40,848.58	-	
中信证券	2021113000004143	上海新阳	2021-11-30	135,420.00	3,000.00	14	3.30	173.79	-	
中信证券	2021113000004739	扬杰科技	2021-11-30	2,937,090.00	39,000.00	14	3.50	3,997.71	-	
中信证券	2021113000004741	景嘉微	2021-11-30	2,608,200.00	14,000.00	14	3.50	3,550.05	-	
中信证券	2021120200000765	南大光电	2021-12-02	5,371,000.00	100,000.00	14	3.50	7,310.53	-	
中信证券	2021120200000769	上海新阳	2021-12-02	2,013,440.00	44,000.00	14	3.30	2,583.91	-	
中信	2021120200000779	扬杰	2021-12-02	7,530,000.00	100,000.00	14	3.30	9,663.50	-	

证 券		科 技								
中 信 证 券	2021120200004317	上 海 新 阳	2021- 12-02	2,242,240.00	49,000.00	14	3.30	2,877.54	-	
中 信 证 券	2021120200004319	全 志 科 技	2021- 12-02	7,559,000.00	100,000.00	14	3.50	10,288.64	-	
中 信 证 券	2021120200004341	扬 杰 科 技	2021- 12-02	3,012,000.00	40,000.00	14	3.50	4,099.67	-	
中 信 证 券	2021120200004343	北 京 君 正	2021- 12-02	1,002,470.00	7,000.00	14	3.60	1,403.46	-	
中 信 证 券	2021120300017251	南 大 光 电	2021- 12-03	2,755,000.00	50,000.00	14	3.50	3,749.86	-	
中 信 证 券	2021120300021265	扬 杰 科 技	2021- 12-03	2,269,871.00	29,300.00	14	3.50	3,089.55	-	
中 信 证 券	2021120300021267	景 嘉 微	2021- 12-03	2,941,000.00	17,000.00	14	3.50	4,003.03	-	
中 信 证 券	2021120700001037	卓 胜 微	2021- 12-07	8,230,090.00	23,000.00	14	3.50	11,202.07	-	
中 信 证 券	2021120700008659	扬 杰 科 技	2021- 12-07	2,947,080.00	41,000.00	14	3.30	3,782.09	-	
中 信 证 券	2021120700008661	扬 杰 科 技	2021- 12-07	2,659,560.00	37,000.00	14	3.30	3,413.10	-	
中 信 证 券	2021120700008663	北 京 君 正	2021- 12-07	6,600,540.00	46,000.00	14	3.70	9,497.44	-	
中 信 证 券	2021120700008665	扬 杰 科 技	2021- 12-07	1,221,960.00	17,000.00	14	3.30	1,568.18	-	
中 信 证 券	2021120700008667	北 京 君 正	2021- 12-07	3,515,505.00	24,500.00	14	3.70	5,058.42	-	

信 证 券		京 君 正	12-07								
中 信 证 券	2021120700008681	景 嘉 微	2021- 12-07	17,794,000.00	108,500.00	14	3.50	24,219.61	-		
中 信 证 券	2021120700008683	景 嘉 微	2021- 12-07	4,100,000.00	25,000.00	14	3.50	5,580.56	-		
中 信 证 券	2021120700008685	卓 胜 微	2021- 12-07	2,182,763.00	6,100.00	14	3.50	2,970.98	-		
中 信 证 券	2021120700008689	晶 盛 机 电	2021- 12-07	272,120.00	4,000.00	14	3.40	359.80	-		
中 信 证 券	2021120900000730	南 大 光 电	2021- 12-09	2,884,560.00	56,000.00	14	3.60	4,038.38	-		
中 信 证 券	2021120900000732	全 志 科 技	2021- 12-09	1,934,820.00	27,000.00	14	3.50	2,633.51	-		
中 信 证 券	2021120900000733	全 志 科 技	2021- 12-09	1,504,860.00	21,000.00	14	3.50	2,048.28	-		
中 信 证 券	2021120900000740	景 嘉 微	2021- 12-09	513,000.00	3,000.00	14	3.50	698.25	-		
中 信 证 券	2021120900000750	卓 胜 微	2021- 12-09	4,720,300.00	13,000.00	14	3.50	6,424.85	-		
中 信 证 券	2021120900000751	卓 胜 微	2021- 12-09	7,262,000.00	20,000.00	14	1.90	5,365.81	-		
中 信 证 券	2021120900006885	景 嘉 微	2021- 12-09	855,000.00	5,000.00	14	3.50	1,163.75	-		
中 信 证 券	2021120900006953	扬 杰 科 技	2021- 12-09	2,866,000.00	40,000.00	14	3.30	3,678.03	-		

中信证券	2021120900007145	北京君正	2021-12-09	1,415,000.00	10,000.00	14	3.70	2,036.03	-	
中信证券	2021120900007147	北京君正	2021-12-09	7,499,500.00	53,000.00	14	3.70	10,790.95	-	
中信证券	2021120900007151	扬杰科技	2021-12-09	3,080,950.00	43,000.00	14	3.30	3,953.89	-	
中信证券	2021121300009355	卓胜微	2021-12-13	29,120,000.00	80,000.00	14	3.50	39,635.56	-	
中信证券	2021121400001454	南大光电	2021-12-14	2,736,390.00	53,000.00	14	3.70	3,937.36	-	
中信证券	2021121400001515	捷捷微电	2021-12-14	1,965,888.00	57,600.00	14	3.60	2,752.24	-	
中信证券	2021121400001537	上海新阳	2021-12-14	1,893,720.00	43,000.00	14	3.20	2,356.63	-	
中信证券	2021121400011130	上海新阳	2021-12-14	132,120.00	3,000.00	14	3.40	174.69	-	
中信证券	2021121400011132	景嘉微	2021-12-14	2,292,500.00	14,000.00	14	3.50	3,120.35	-	
中信证券	2021121400011134	扬杰科技	2021-12-14	2,769,390.00	39,000.00	14	3.40	3,661.75	-	
中信证券	2021121600001459	捷捷微电	2021-12-16	4,836,960.00	144,000.00	14	3.60	6,771.74	-	
中信证券	2021121600001506	上海新阳	2021-12-16	2,451,867.00	57,300.00	14	3.20	3,051.21	-	
中信证	2021121600001530	全志科	2021-12-16	2,211,300.00	32,500.00	14	3.10	2,665.85	-	

券		技									
中信证券	2021121600001543	南大光电	2021-12-16	2,672,280.00	52,000.00	14	3.70	3,845.11	-		
中信证券	2021121600001564	卓胜微	2021-12-16	683,780.00	2,000.00	14	3.30	877.52	-		
中信证券	2021121600008641	扬杰科技	2021-12-16	6,889,000.00	100,000.00	14	3.40	9,108.79	-		
中信证券	2021121600008643	南大光电	2021-12-16	5,139,000.00	100,000.00	14	3.60	7,194.60	-		
中信证券	2021121600008645	上海新阳	2021-12-16	1,882,760.00	44,000.00	14	3.40	2,489.43	-		
中信证券	2021121600008647	全志科技	2021-12-16	6,804,000.00	100,000.00	14	3.50	9,261.00	-		
中信证券	2021121600008649	北京君正	2021-12-16	949,900.00	7,000.00	14	3.30	1,219.04	-		
中信证券	2021121600008651	上海新阳	2021-12-16	2,096,710.00	49,000.00	14	3.40	2,772.32	-		
中信证券	2021121600008653	扬杰科技	2021-12-16	2,755,600.00	40,000.00	14	3.40	3,643.52	-		
中信证券	2021121700027626	南大光电	2021-12-17	2,459,500.00	50,000.00	14	3.60	3,443.30	-		
中信证券	2021121700027628	景嘉微	2021-12-17	2,635,000.00	17,000.00	14	3.50	3,586.53	-		
中信证券	2021121700027632	扬杰科技	2021-12-17	1,903,914.00	29,300.00	14	3.40	2,517.40	-		
中信	2021122100001596	上海	2021-12-21	2,385,399.00	57,300.00	14	3.30	2,186.61	2,340,705.00	2,1	

证 券		新 阳									
中 信 证 券	2021122100001597	捷 捷 微 电	2021- 12-21	4,692,440.00	146,000.00	14	3.60	4,692.44	4,593,160.00	4,6	
中 信 证 券	2021122100019721	北 京 君 正	2021- 12-21	3,103,170.00	24,500.00	14	3.30	2,844.57	3,283,000.00	2,8	
中 信 证 券	2021122100019723	扬 杰 科 技	2021- 12-21	2,726,500.00	41,000.00	14	3.50	2,650.76	2,754,380.00	2,6	
中 信 证 券	2021122100019725	扬 杰 科 技	2021- 12-21	1,130,500.00	17,000.00	14	3.50	1,099.10	1,142,060.00	1,0	
中 信 证 券	2021122100019727	扬 杰 科 技	2021- 12-21	2,460,500.00	37,000.00	14	3.50	2,392.15	2,485,660.00	2,3	
中 信 证 券	2021122100019729	扬 杰 科 技	2021- 12-21	3,724,000.00	56,000.00	28	3.40	3,517.11	3,762,080.00	3,5	
中 信 证 券	2021122100019731	景 嘉 微	2021- 12-21	3,795,000.00	25,000.00	14	3.60	3,795.00	3,805,000.00	3,7	
中 信 证 券	2021122100019733	景 嘉 微	2021- 12-21	16,470,300.00	108,500.00	14	3.60	16,470.30	16,513,700.00	16,4	
中 信 证 券	2021122100019735	北 京 君 正	2021- 12-21	5,826,360.00	46,000.00	14	3.30	5,340.83	6,164,000.00	5,3	
中 信 证 券	2021122100019737	卓 胜 微	2021- 12-21	2,089,250.00	6,100.00	14	3.30	1,915.14	1,993,480.00	1,9	
中 信 证 券	2021122100019739	卓 胜 微	2021- 12-21	7,877,500.00	23,000.00	14	3.30	7,221.04	7,516,400.00	7,2	
中 信 证 券	2021122300010893	卓 胜 微	2021- 12-23	6,753,600.00	20,000.00	14	1.90	2,851.52	6,536,000.00	2,8	
中 信 证 券	2021122300011493	南	2021-	2,665,600.00	56,000.00	14	3.70	2,191.71	2,600,640.00	2,1	

信 证 券		大 光 电	12-23								
中 信 证 券	2021122300011501	扬 杰 科 技	2021- 12-23	2,789,600.00	40,000.00	14	3.50	2,169.69	2,687,200.00	2.1	
中 信 证 券	2021122300011505	全 志 科 技	2021- 12-23	1,346,940.00	21,000.00	14	3.10	927.89	1,328,880.00	92	
中 信 证 券	2021122300011507	卓 胜 微	2021- 12-23	4,389,840.00	13,000.00	14	3.30	3,219.22	4,248,400.00	3,2	
中 信 证 券	2021122300011509	全 志 科 技	2021- 12-23	1,731,780.00	27,000.00	14	3.10	1,193.01	1,708,560.00	1,1	
中 信 证 券	2021122300011511	北 京 君 正	2021- 12-23	1,310,000.00	10,000.00	14	3.30	960.67	1,340,000.00	96	
中 信 证 券	2021122300011513	北 京 君 正	2021- 12-23	6,943,000.00	53,000.00	14	3.30	5,091.53	7,102,000.00	5,0	
中 信 证 券	2021122400001155	南 大 光 电	2021- 12-24	6,900,000.00	150,000.00	14	3.70	4,964.17	6,966,000.00	4,9	
中 信 证 券	2021122700001136	北 京 君 正	2021- 12-27	15,192,723.00	113,100.00	14	3.60	6,077.09	15,155,400.00	6,0	
中 信 证 券	2021122700009130	卓 胜 微	2021- 12-27	27,720,000.00	80,000.00	14	3.10	9,548.00	26,144,000.00	9,5	
中 信 证 券	2021122800001616	全 志 科 技	2021- 12-28	385,154.00	6,100.00	28	3.30	105.92	386,008.00	10	
中 信 证 券	2021122800001630	全 志 科 技	2021- 12-28	631,400.00	10,000.00	14	3.40	178.90	632,800.00	17	
中 信 证 券	2021122800012772	景 嘉 微	2021- 12-28	2,226,140.00	14,000.00	14	3.60	667.84	2,130,800.00	66	

中信证券	2021122800012774	上海新阳	2021-12-28	1,745,800.00	43,000.00	14	3.30	480.09	1,756,550.00	48
中信证券	2021122800012776	捷捷微电	2021-12-28	1,820,160.00	57,600.00	14	3.60	546.05	1,812,096.00	54
中信证券	2021122800012778	南大光电	2021-12-28	2,464,500.00	53,000.00	14	3.70	759.89	2,461,320.00	75
中信证券	2021122800013792	扬杰科技	2021-12-28	2,691,000.00	39,000.00	14	3.40	762.45	2,620,020.00	76
中信证券	2021122800013794	上海新阳	2021-12-28	121,800.00	3,000.00	14	3.30	33.50	122,550.00	3
中信证券	2021122900001048	全志科技	2021-12-29	230,584.00	3,700.00	28	3.30	42.27	234,136.00	4
中信证券	2021122900001062	北京君正	2021-12-29	5,138,913.00	39,100.00	14	3.60	1,027.78	5,239,400.00	1,0
中信证券	2021122900001068	捷捷微电	2021-12-29	1,966,731.00	63,300.00	14	3.70	404.27	1,991,418.00	40
中信证券	2021123000001561	捷捷微电	2021-12-30	2,035,040.00	64,400.00	14	3.70	209.16	2,026,024.00	20
中信证券	2021123000008358	上海新阳	2021-12-30	2,326,953.00	57,300.00	14	3.30	213.30	2,340,705.00	21
中信证券	2021123000008360	南大光电	2021-12-30	2,407,600.00	52,000.00	14	3.70	247.45	2,414,880.00	24
中信证券	2021123000008362	捷捷微电	2021-12-30	4,550,400.00	144,000.00	14	3.60	455.04	4,530,240.00	45
中信证	2021123000008364	全志科	2021-12-30	2,079,350.00	32,500.00	14	3.30	190.61	2,056,600.00	19

券		技								
中信证券	2021123000008366	扬杰科技	2021-12-30	2,829,600.00	40,000.00	14	3.40	267.24	2,687,200.00	26
中信证券	2021123000008368	上海新阳	2021-12-30	1,786,840.00	44,000.00	14	3.30	163.79	1,797,400.00	16
中信证券	2021123000009508	上海新阳	2021-12-30	1,989,890.00	49,000.00	14	3.30	182.41	2,001,650.00	18
中信证券	2021123000009510	南大光电	2021-12-30	4,630,000.00	100,000.00	14	3.70	475.86	4,644,000.00	47
中信证券	2021123000009512	全志科技	2021-12-30	6,398,000.00	100,000.00	14	3.30	586.48	6,328,000.00	58
中信证券	2021123000009514	北京君正	2021-12-30	939,400.00	7,000.00	14	3.40	88.72	938,000.00	8
中信证券	2021123100001161	北京君正	2021-12-31	5,239,400.00	39,100.00	14	3.60	-	5,239,400.00	
中信证券	2021123100001162	南大光电	2021-12-31	2,373,084.00	51,100.00	14	3.70	-	2,373,084.00	
中信证券	2021123100001165	全志科技	2021-12-31	1,006,152.00	15,900.00	14	3.40	-	1,006,152.00	
中信证券	2021123100001168	晶盛机电	2021-12-31	173,750.00	2,500.00	14	1.80	-	173,750.00	
中信证券	2021123100001170	扬杰科技	2021-12-31	1,901,194.00	28,300.00	14	3.40	-	1,901,194.00	
中信证券	2021123100028130	扬杰科技	2021-12-31	1,968,374.00	29,300.00	14	3.40	-	1,968,374.00	
中信	2021123100028132	南大	2021-12-31	2,322,000.00	50,000.00	14	3.70	-	2,322,000.00	

证券		光电							
中信证券	2021123100028792	景嘉微	2021-12-31	2,587,400.00	17,000.00	14	3.60	-	2,587,400.00

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 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
华夏国证半导体芯片 ETF 联接	8,638,632,134.00	42.27%	4,529,925,073.00	42.06%
中信证券	16,497,404.00	0.08%	3,691,141.00	0.03%
中信中证资本	54,500.00	0.00%	-	-

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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国建设银行活期存款	41,247,714.61	169,634.59	49,471,379.67	257,694.85

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	688041	海光信息	新股发行	70,208	2,527,488.00
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	688271	联影医疗	新股发行	7,365	809,266.20
中信证券	688382	益方生物	新股发行	36,208	656,088.96
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	688114	华大智造	新股发行	5,336	465,192.48
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	3,972	447,604.68
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	688380	中微半导	新股发行	12,677	391,212.22
中信证券	301269	华大九天	新股发行	11,677	381,721.13
中信证券	688141	杰华特	新股发行	9,946	380,533.96
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	10,769	348,700.22
中信证券	301349	信德新材	新股发行	1,798	249,706.24
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	4,192	209,516.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	20,044	198,636.04
中信证券	688370	从麟科技	新股发行	3,254	194,459.04
中信证券	688426	康为世纪	新股发行	3,776	184,948.48
中信证券	301171	易点天下	新股发行	9,845	178,982.10
中信证券	301377	鼎泰高科	新股发行	7,695	176,061.60
中信证券	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688252	天德钰	新股发行	5,201	112,757.68
中信证券	301230	泓博医药	新股发行	2,687	107,480.00
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	688525	佰维存储	新股发行	4,614	64,549.86
中信证券	603235	天新药业	新股发行	572	21,095.36
中信证券	001322	箭牌家居	新股发行	1,595	20,224.60
中信证券	001330	博纳影业	新股发行	3,564	17,926.92
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60
中信证券	001339	智微智能	新股发行	812	13,690.32
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	603151	邦基科技	新股发行	535	9,603.25
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 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	688235	百济神州	新股发行	12,010	2,313,126.00
中信证券	688819	天能股份	新股发行	28,382	1,186,083.78
中信证券	688739	成大生物	新股发行	9,882	1,087,020.00
中信证券	688187	时代电气	新股发行	33,865	1,062,683.70
中信证券	688176	亚虹医药	新股发行	37,990	873,010.20
中信证券	688192	迪哲医药	新股发行	8,926	469,329.08
中信证券	688211	中科微至	新股发行	4,501	405,990.20

中信证券	688660	电气风电	新股发行	51,238	278,734.72
中信证券	688798	艾为电子	新股发行	3,592	275,075.36
中信证券	688779	长远锂科	新股发行	43,086	243,435.90
中信证券	601728	中国电信	新股发行	31,000	140,430.00
中信证券	601825	沪农商行	新股发行	15,480	137,772.00
中信证券	688670	金迪克	新股发行	2,310	127,465.80
中信证券	688276	百克生物	新股发行	3,486	126,716.10
中信证券	688212	澳华内镜	新股发行	3,496	78,660.00
中信证券	688776	国光电气	新股发行	1,447	74,433.68
中信证券	688575	亚辉龙	新股发行	3,435	50,838.00
中信证券	300982	苏文电能	新股发行	3,170	50,181.10
中信证券	600955	维远股份	新股发行	1,694	50,074.64
中信证券	300993	玉马遮阳	新股发行	4,097	49,573.70
中信证券	688315	诺禾致源	新股发行	3,711	47,352.36
中信证券	300997	欢乐家	新股发行	9,279	45,838.26
中信证券	688607	康众医疗	新股发行	1,890	43,866.90
中信证券	300930	屹通新材	新股发行	3,220	42,214.20
中信证券	301028	东亚机械	新股发行	7,329	38,916.99
中信证券	301049	超越科技	新股发行	1,954	37,790.36
中信证券	688509	正元地信	新股发行	15,433	30,403.01
中信证券	603529	爱玛科技	新股发行	1,019	28,389.34
中信证券	688690	纳微科技	新股发行	3,477	28,059.39
中信证券	603071	物产环能	新股发行	1,627	25,088.34
中信证券	301055	张小泉	新股发行	3,541	24,432.90
中信证券	300966	共同药业	新股发行	2,858	23,549.92
中信证券	688565	力源科技	新股发行	2,464	23,136.96
中信证券	605555	德昌股份	新股发行	655	21,189.25
中信证券	301059	金三江	新股发行	2,581	20,880.29
中信证券	600935	华塑股份	新股发行	4,811	18,955.34
中信证券	301053	远信工业	新股发行	1,544	18,327.28
中信证券	301062	上海艾录	新股发行	5,225	17,294.75
中信证券	688226	威腾电气	新股发行	2,693	17,289.06
中信证券	600916	中国黄金	新股发行	3,371	16,821.29
中信证券	688305	科德数控	新股发行	1,496	16,500.88
中信证券	688071	华依科技	新股发行	1,101	15,116.73
中信证券	605566	福莱蒾特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688008	澜起科技	2022-12-08	6 个月	大宗转让流通受限	63.28	57.87	800,000	50,624,000.00	46,296,000.00	-
688385	复旦微电	2022-12-09	6 个月	大宗转让流通受限	69.28	63.79	500,000	34,640,000.00	31,895,000.00	-
688008	澜起科技	2022-12-07	6 个月	大宗转让流通受限	62.13	57.88	500,000	31,065,000.00	28,940,000.00	-
688099	晶晨股份	2022-12-09	6 个月	大宗转让流通受限	73.00	65.13	400,000	29,200,000.00	26,052,000.00	-
688008	澜起科技	2022-12-06	6 个月	大宗转让	61.00	57.88	300,000	18,300,000.00	17,364,000.00	-

				流通受限						
688031	星环科技	2022-10-11	6 个月	新发流通受限	47.34	78.80	12,047	570,304.98	949,303.60	-
688172	燕东微	2022-12-09	6 个月	新发流通受限	21.98	17.96	40,177	883,090.46	721,578.92	-
688387	信科移动	2022-09-19	6 个月	新发流通受限	6.05	4.88	106,186	642,425.30	518,187.68	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1 个月内(含)	新发流通受限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	-
688353	华盛锂电	2022-07-06	6 个月	新发流通受限	98.35	63.86	4,358	428,609.30	278,301.88	-
688432	有研硅	2022-11-03	6 个月	新发流通受限	9.91	11.24	20,044	198,636.04	225,294.56	-
301269	华大九天	2022-07-21	6 个月	新发流通受限	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
688525	佰维存储	2022-12-23	6 个月	新发流通受	13.99	15.27	4,614	64,549.86	70,455.78	-

				限						
688455	科捷智能	2022-09-07	6 个月	新发流通受限	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301095	广立微	2022-07-28	6 个月	新发流通受限	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301308	江波龙	2022-07-27	6 个月	新发流通受限	55.67	56.72	819	45,593.73	46,453.68	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6 个月	新发流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301165	锐捷网络	2022-11-14	6 个月	新发流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301356	天振股份	2022-11-03	6 个月	新发流通受限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	-
301195	北路智控	2022-07-25	6 个月	新发流通受限	71.17	73.04	330	23,486.10	24,103.20	-
301389	隆扬电子	2022-10-18	6 个月	新发	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-

				流通受限						
301330	熵基科技	2022-08-10	6 个月	新发流通受限	43.32	31.31	694	30,064.08	21,729.14	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6 个月	新发流通受限	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6 个月	新发流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301349	信德新材	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点天下	2022-08-10	6 个月	新发流通受限	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301363	美好医疗	2022-09-28	6 个月	新发流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	-
301115	建科股份	2022-08-23	6 个月	新发流通受限	42.05	24.04	685	28,804.25	16,467.40	-
301223	中荣股份	2022-10-13	6 个月	新发流通受	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-

				限						
301328	维峰电子	2022-08-30	6 个月	新发流通受限	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6 个月	新发流通受限	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301139	元道通信	2022-06-30	6 个月	新发流通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6 个月	新发流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6 个月	新发流通受限	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6 个月	新发流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6 个月	新发流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6 个月	新发	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-

				流通受限						
301365	矩阵股份	2022-11-14	6 个月	新发流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	-
301366	一博科技	2022-09-19	6 个月	新发流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6 个月	新发流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301132	满坤科技	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	6 个月	新发流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301379	天山电子	2022-10-19	6 个月	新发流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87	-
301306	西测测试	2022-07-19	6 个月	新发流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6 个月	新发流通受	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-

				限						
301265	华新环保	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6 个月	新发流通受限	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301318	维海德	2022-08-03	6 个月	新发流通受限	64.68	41.74	206	13,324.08	8,598.44	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6 个月	新发流通受限	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6 个月	新发流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6 个月	新发流通受限	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6 个月	新发流通受限	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6 个月	新发流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6 个月	新发	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-

				流 通 受 限						
301319	唯特 偶	2022- 09-22	6 个月	新发 流通 受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪 股份	2022- 08-19	6 个月	新发 流通 受限	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301309	万得 凯	2022- 09-08	6 个月	新发 流通 受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301316	慧博 云通	2022- 09-29	6 个月	新发 流通 受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	688008	澜起科技	2023年1月3日-2023年1月30日	62.60	3,623,400.00	226,824,840.00
2	600703	三安光电	2023年1月3日-2023年1月30日	17.16	12,209,500.00	209,515,020.00
3	300782	卓胜微	2023年1月3日-2023年1月11日	114.30	1,407,800.00	160,911,540.00
4	688012	中微公司	2023年1月3日-2023年1月12日	98.01	1,413,000.00	138,488,130.00
5	300661	圣邦股份	2023年1月3日-2023年1月18日	172.60	757,700.00	130,779,020.00
6	688385	复旦微电	2023年1月3日-2023年1月12日	69.81	1,330,100.00	92,854,281.00
7	603290	斯达半导	2023年1月3日-2023年1月12日	329.30	258,300.00	85,058,190.00
8	300316	晶盛机电	2023年1	63.56	1,184,700.00	75,299,532.00

			月 3 日- 2023 年 1 月 30 日			
9	002156	通富微电	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 19 日	16.48	4,459,100.00	73,485,968.00
10	600460	士兰微	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	32.79	2,102,800.00	68,950,812.00
11	300373	扬杰科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 17 日	52.60	1,176,100.00	61,862,860.00
12	600745	闻泰科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	52.58	1,054,100.00	55,424,578.00
13	688981	中芯国际	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	41.14	1,266,600.00	52,107,924.00
14	603501	韦尔股份	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 12 日	77.09	615,700.00	47,464,313.00
15	300223	北京君正	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 17 日	70.44	339,900.00	23,942,556.00
16	002185	华天科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	8.29	2,786,800.00	23,102,572.00
17	002371	北方华创	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 19 日	225.30	92,600.00	20,862,780.00
18	002409	雅克科技	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	50.37	293,200.00	14,768,484.00
19	300474	景嘉微	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 30 日	54.57	267,300.00	14,586,561.00
20	603986	兆易创新	2023 年 1 月 3 日- 2023 年 1 月 11 日	102.47	124,500.00	12,757,515.00

21	688126	沪硅产业	2023年1月3日-2023年1月11日	17.61	683,300.00	12,032,913.00
22	603893	瑞芯微	2023年1月3日-2023年1月11日	68.81	161,300.00	11,099,053.00
23	603160	汇顶科技	2023年1月3日-2023年1月12日	50.20	194,400.00	9,758,880.00
24	002049	紫光国微	2023年1月3日-2023年1月11日	131.82	61,100.00	8,054,202.00
25	688536	思瑞浦	2023年1月3日-2023年1月11日	275.41	21,700.00	5,976,397.00
26	605358	立昂微	2023年1月3日-2023年1月11日	42.60	128,100.00	5,457,060.00
27	688396	华润微	2023年1月3日-2023年1月11日	52.65	96,300.00	5,070,195.00
28	600584	长电科技	2023年1月3日-2023年1月11日	23.05	174,100.00	4,013,005.00
29	688099	晶晨股份	2023年1月4日-2023年1月11日	70.51	35,100.00	2,474,901.00
30	688728	格科微	2023年1月11日-2023年1月11日	17.54	4,800.00	84,192.00
合计					38,323,400.00	1,653,068,274.00

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

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金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之内。

7.4.13.2 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。

7.4.13.3 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“7.4.12 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。

7.4.13.3.1 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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 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	20,378,542,062.75	99.89	17,539,294,913.97	99.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	20,378,542,062.75	99.89	17,539,294,913.97	99.92

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除国证半导体芯片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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	-5%		-1,048,457,210.30
+5%		1,048,457,210.30	863,489,051.58

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	20,223,895,883.64	17,498,701,050.99
第二层次	385,863.40	40,593,862.98
第三层次	154,260,315.71	-
合计	20,378,542,062.75	17,539,294,913.97

7.4.14.2.2 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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	163,829,000.00	163,829,000.00
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,821,477.92	3,821,477.92

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-13,390,162.21	-13,390,162.21
其中：计入损益的利得或损失	-	-13,390,162.21	-13,390,162.21
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	154,260,315.71	154,260,315.71
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-13,390,162.21	-13,390,162.21

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	154,260,315.71	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891-2.4756	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2022 年 12 月 31 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	20,378,542,062.75	98.09
	其中：股票	20,378,542,062.75	98.09
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	49,204,915.37	0.24
8	其他各项资产	347,714,182.69	1.67
9	合计	20,775,461,160.81	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 1,653,068,274.00 元, 占本基金期末资产净值的 8.10%。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	19,538,889,520.75	95.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	839,533,378.45	4.12
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	52,566.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	20,378,542,062.75	99.89

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	002049	紫光国微	14,049,096	1,851,951,834.72	9.08
2	688981	中芯国际	40,935,762	1,684,097,248.68	8.25
3	603986	兆易创新	13,260,365	1,358,789,601.55	6.66
4	002371	北方华创	5,675,372	1,278,661,311.60	6.27
5	603501	韦尔股份	15,924,699	1,227,635,045.91	6.02
6	688008	澜起科技	14,900,968	925,240,596.80	4.54
7	600703	三安光电	52,150,187	894,897,208.92	4.39

8	688012	中微公司	8,810,507	863,517,791.07	4.23
9	600745	闻泰科技	16,363,814	860,409,340.12	4.22
10	300661	圣邦股份	4,914,961	848,322,268.60	4.16
11	300316	晶盛机电	12,712,994	808,037,898.64	3.96
12	300782	卓胜微	6,541,723	747,718,938.90	3.67
13	600584	长电科技	29,406,151	677,811,780.55	3.32
14	600460	士兰微	17,836,583	584,861,556.57	2.87
15	688396	华润微	9,867,843	519,541,933.95	2.55
16	603290	斯达半导	1,508,867	496,869,903.10	2.44
17	688126	沪硅产业	27,447,841	483,356,480.01	2.37
18	605358	立昂微	11,266,215	479,940,759.00	2.35
19	002185	华天科技	56,064,969	464,778,593.01	2.28
20	688099	晶晨股份	6,127,235	429,879,339.85	2.11
21	688536	思瑞浦	1,483,066	408,451,207.06	2.00
22	300223	北京君正	5,204,126	366,578,635.44	1.80
23	688385	复旦微电	5,197,991	359,861,751.71	1.76
24	002156	通富微电	18,318,313	301,885,798.24	1.48
25	300373	扬杰科技	5,527,936	290,769,433.60	1.43
26	603160	汇顶科技	5,642,977	283,277,445.40	1.39
27	002409	雅克科技	5,435,400	273,781,098.00	1.34
28	300474	景嘉微	4,712,892	257,182,516.44	1.26
29	603893	瑞芯微	3,560,906	245,025,941.86	1.20
30	688728	格科微	5,769,587	101,198,555.98	0.50
31	688031	星环科技	12,047	949,303.60	0.00
32	688172	燕东微	40,177	721,578.92	0.00
33	688387	信科移动	106,186	518,187.68	0.00
34	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.00
35	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.00
36	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.00
37	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
38	688525	佰维存储	4,614	70,455.78	0.00
39	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.00
40	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
41	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
42	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
43	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
44	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
45	688511	天微电子	1,490	42,345.80	0.00
46	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
47	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
48	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
49	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
50	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
51	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
52	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
53	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
54	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
55	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
56	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
57	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00

58	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
59	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
60	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
61	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
62	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
63	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
64	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
65	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
66	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
67	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
68	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
69	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
70	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
71	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
72	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
73	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
74	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
75	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
76	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
77	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
78	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
79	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
80	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
81	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
82	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
83	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
84	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
85	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
86	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
87	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688981	中芯国际	2,445,907,997.71	13.93
2	603501	韦尔股份	2,164,020,222.98	12.33
3	603986	兆易创新	2,036,661,528.58	11.60
4	600745	闻泰科技	1,490,674,218.67	8.49
5	600703	三安光电	1,478,779,120.39	8.42
6	688012	中微公司	1,401,979,156.31	7.99
7	688008	澜起科技	1,228,756,863.15	7.00
8	600460	士兰微	979,313,927.82	5.58
9	600584	长电科技	936,512,747.05	5.33
10	688126	沪硅产业	792,419,374.26	4.51
11	688396	华润微	779,702,456.82	4.44
12	605358	立昂微	747,159,713.88	4.26

13	603290	斯达半导	625,851,442.76	3.57
14	688536	思瑞浦	586,329,849.28	3.34
15	688099	晶晨股份	492,367,900.70	2.80
16	603160	汇顶科技	431,885,956.37	2.46
17	688385	复旦微电	398,289,702.88	2.27
18	603893	瑞芯微	390,981,161.83	2.23
19	002049	紫光国微	191,417,902.45	1.09
20	603005	晶方科技	137,674,035.04	0.78

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002129	TCL 中环	2,184,983,540.15	12.45
2	603986	兆易创新	1,394,431,742.54	7.94
3	603501	韦尔股份	1,254,068,143.13	7.14
4	600703	三安光电	1,031,229,044.44	5.87
5	600745	闻泰科技	993,960,460.82	5.66
6	600460	士兰微	695,082,514.14	3.96
7	600584	长电科技	693,162,737.47	3.95
8	688981	中芯国际	666,905,417.53	3.80
9	605358	立昂微	427,224,247.66	2.43
10	603290	斯达半导	380,456,024.18	2.17
11	688012	中微公司	376,046,696.75	2.14
12	002049	紫光国微	308,157,135.86	1.76
13	603005	晶方科技	278,642,435.63	1.59
14	603160	汇顶科技	273,395,405.75	1.56
15	600667	太极实业	265,433,170.36	1.51
16	000021	深科技	261,565,760.39	1.49
17	603893	瑞芯微	256,526,631.32	1.46
18	688008	澜起科技	255,092,714.56	1.45
19	300346	南大光电	226,796,615.79	1.29
20	688396	华润微	223,839,777.89	1.28

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	20,334,843,459.18
卖出股票收入（成交）总额	14,192,946,578.06

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,943,603.33
2	应收清算款	344,804,270.13
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	966,309.23
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	347,714,182.69

8.12.4 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。

8.12.5 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	688008	澜起科技	226,824,840.00	1.11	转融通出借证券受限
2	600703	三安光电	209,515,020.00	1.03	转融通出借证券受限
3	688012	中微公司	138,488,130.00	0.68	转融通出借证券受限
4	300661	圣邦股份	130,779,020.00	0.64	转融通出借证券受限
5	688008	澜起科技	92,600,000.00	0.45	大宗转让流通受限
6	600745	闻泰科技	55,424,578.00	0.27	转融通出借证券受限
7	688981	中芯国际	52,107,924.00	0.26	转融通出借证券受限
8	603501	韦尔股份	47,464,313.00	0.23	转融通出借证券受限
9	002371	北方华创	20,862,780.00	0.10	转融通出借证券受限
10	603986	兆易创新	12,757,515.00	0.06	转融通出借证券受限
11	002049	紫光国微	8,054,202.00	0.04	转融通出借证券受限

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

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		华夏国证半导体芯片 ETF 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
268,711	76,050.34	3,748,048,667.00	18.34%	8,048,882,205.00	39.39%	8,638,632,134.00	42.27%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例
1	中国人寿保险股份有限公司	1,082,337,356.00	5.30%
2	招商财富资管—青银理财璀璨人生成就系列开放式净值型人民币（一年开放芯片主题）—招商财富瑞丰 5 号单一资产管理计划	245,135,100.00	1.20%

3	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	237,660,225.00	1.16%
4	百年人寿保险股份有限公司—分红保险产品	183,662,400.00	0.90%
5	中国人寿保险（集团）公司	135,000,000.00	0.66%
6	宋新华	70,575,338.00	0.35%
7	中信银行股份有限公司—中欧睿智精选一年持有期混合型基金中基金（FOF）	70,224,300.00	0.34%
8	广东粤财信托有限公司—粤财信托·粤银3号单一资金信托计划	63,265,477.00	0.31%
9	中国电信集团有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	58,115,200.00	0.28%
10	光大理财有限责任公司—阳光金15M丰利增强7期	57,045,900.00	0.28%
11	中国建设银行股份有限公司—华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	8,638,632,134.00	42.27%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	275,500.00	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年1月20日）基金份额总额	5,388,463,006.00
本报告期期初基金份额总额	10,771,363,006.00
本报告期基金总申购份额	23,485,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	13,820,800,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	20,435,563,006.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 120,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	18	14,355,992,373.82	41.64%	6,194,308.24	44.32%	-
国盛证券	1	6,543,916,060.31	18.98%	2,822,489.90	20.19%	-
国泰君安证券	2	4,384,043,063.95	12.72%	1,890,915.71	13.53%	-
中信建投证券	5	3,678,869,138.80	10.67%	691,650.90	4.95%	-
浙商证券	1	2,996,758,987.75	8.69%	1,292,541.48	9.25%	-
中金公司	5	883,600,657.24	2.56%	381,110.27	2.73%	-
方正证券	1	847,382,117.01	2.46%	365,489.68	2.61%	-
华西证券	1	574,589,375.09	1.67%	247,839.14	1.77%	-
中泰证券	2	68,766,086.48	0.20%	29,659.20	0.21%	-
安信证券	1	49,233,186.41	0.14%	21,234.79	0.15%	-
华泰证券	2	48,758,756.44	0.14%	21,029.83	0.15%	-
招商证券	2	34,790,011.07	0.10%	15,005.45	0.11%	-
申万宏源证券	2	7,808,270.05	0.02%	3,367.63	0.02%	-
光大证券	5	868,133.70	0.00%	374.43	0.00%	-

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，本基金还选择了东北证券、东方证券、东兴证券、海通证券、万联证券、银河证券、粤开证券、中国银河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，中信证券的部分交易单元为本基金本期新增的交易单元，中信建投的交易单元为本期剔除的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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
中信证券	14,375,202.73	100.00%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	10,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
浙商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-

招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华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
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	2022-02-12
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	2022-02-17
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	2022-02-19
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	2022-02-23
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	2022-03-12
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	2022-03-19
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	2022-04-02
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	2022-04-08
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	2022-04-13
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	2022-04-16
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	2022-06-18
13	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
14	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
15	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	2022-07-07
16	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	2022-07-20
17	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	2022-07-23
18	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	2022-07-30
19	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	2022-08-06
20	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	2022-08-10
21	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	2022-08-12
22	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	2022-08-13

23	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	2022-08-19
24	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	2022-09-01
25	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	2022-09-03
26	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	2022-09-22
27	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	2022-10-14
28	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	2022-10-20
29	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	2022-10-22
30	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	2022-11-05
31	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	2022-11-12
32	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	2022-11-16
33	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	2022-11-26
34	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	2022-11-30
35	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-08
36	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	2022-12-16
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-17
38	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	2022-12-20
39	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	2022-12-23
40	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	2022-12-24
41	华夏基金管理有限公司关于华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		比例达到或者超过20%的时间区间					
华夏国证半导体芯片ETF联接	1	2022-01-01至2022-12-31	4,529,925,073.00	7,444,487,570.00	3,335,780,509.00	8,638,632,134.00	42.27%
产品特有风险							
<p>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。</p> <p>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。</p>							

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏国证半导体芯片交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏国证半导体芯片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。

13.2 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。

13.3 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

二〇二三年三月三十日