

---

# 华夏沪深 300 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：中国工商银行股份有限公司

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。

基金托管人中国工商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.....	14
§6 审计报告.....	14
§7 年度财务报表.....	16
7.1 资产负债表.....	16
7.2 利润表.....	18
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
7.4 报表附注.....	20
§8 投资组合报告.....	313
8.1 期末基金资产组合情况.....	313
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.....	314
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	322
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	323
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.....	323
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.....	323
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.....	323
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.....	323
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	323
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	323
8.12 投资组合报告附注.....	324
§9 基金份额持有人信息.....	325
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	325
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	325
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.....	325
§10 开放式基金份额变动.....	326
§11 重大事件揭示.....	326
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	329
§13 备查文件目录.....	330

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏沪深 300ETF
场内简称	华夏 300（扩位证券简称：300ETF 基金）
基金主代码	510330
交易代码	510330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 12 月 25 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,327,249,828 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2013 年 1 月 16 日

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	郭明
	联系电话	400-818-6666	010-66105799
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-818-6666	95588
传真		010-63136700	010-66105798
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		100033	100140
法定代表人		杨明辉	陈四清

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金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
本期已实现收益	-1,539,484,225.40	4,027,975,636.95	6,450,197,326.68
本期利润	-5,279,323,088.26	-769,948,591.22	7,661,526,702.05
加权平均基金份额本期利润	-0.9858	-0.1462	1.1538
本期加权平均净值利润率	-23.58%	-2.84%	26.38%
本期基金份额净值增长率	-20.26%	-3.77%	29.45%
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	9,450,797,099.63	14,838,516,859.82	16,504,667,979.85
期末可供分配基金份额利润	1.4937	2.5764	2.8630
期末基金资产净值	24,908,529,942.84	28,908,846,530.65	30,588,190,074.58
期末基金份额净值	3.9367	5.0195	5.3061
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	92.99%	142.02%	151.50%

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	1.82%	1.29%	1.75%	1.29%	0.07%	0.00%
过去六个月	-12.81%	1.10%	-13.68%	1.11%	0.87%	-0.01%
过去一年	-20.26%	1.28%	-21.63%	1.28%	1.37%	0.00%
过去三年	-0.67%	1.30%	-5.49%	1.30%	4.82%	0.00%

过去五年	4.51%	1.30%	-3.95%	1.30%	8.46%	0.00%
自基金合同生效起至今	92.99%	1.42%	62.59%	1.43%	30.40%	-0.01%

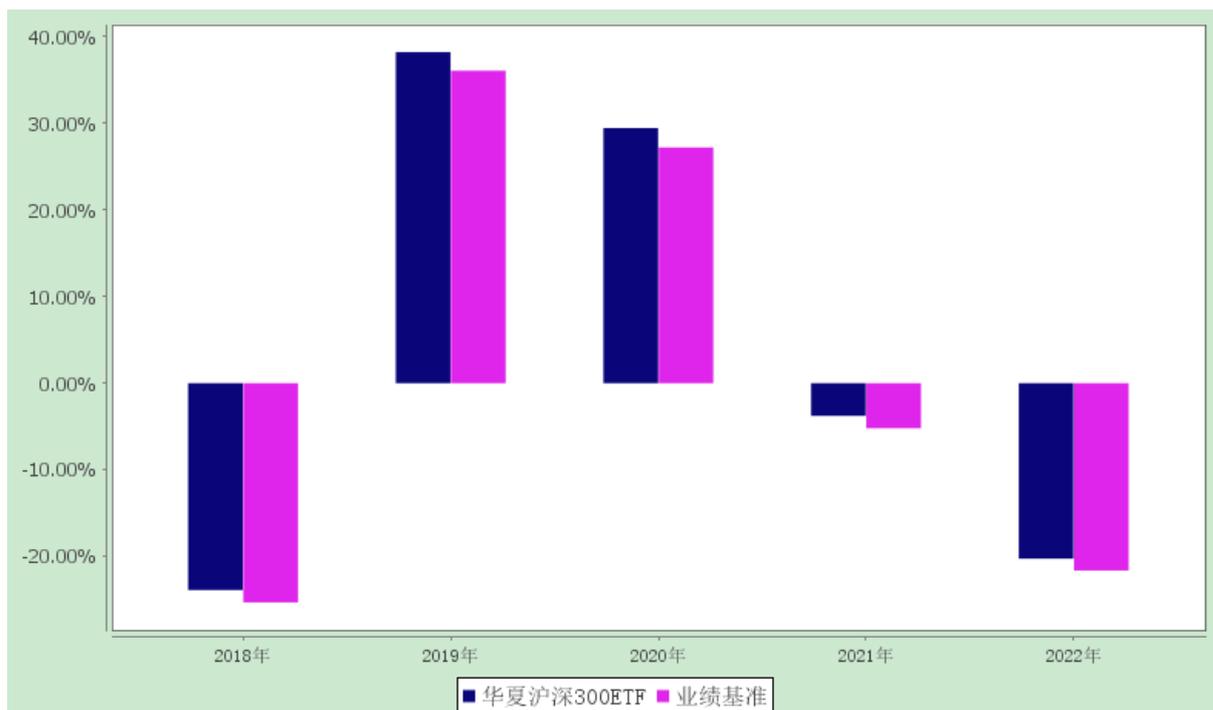
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
 (2012 年 12 月 25 日至 2022 年 12 月 31 日)



3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金  
 过去五年基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每10份基金份额 分红数	现金形式发放总 额	再投资形式发 放总额	年度利润分配合 计	备注
2022年	0.790	422,851,436.44	-	422,851,436.44	-
2021年	0.960	533,975,983.52	-	533,975,983.52	-
2020年	0.710	538,886,437.85	-	538,886,437.85	-
合计	2.460	1,495,713,857.81	-	1,495,713,857.81	-

## §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	2017-04-17	-	14 年	硕士。曾任华夏基金管理有限公司研究发展部产品经理、数量投资部研究员，嘉实基金管理

					有限公司指数投资部基金经理助理，嘉实国际资产管理有限公司基金经理。2016 年 11 月加入华夏基金管理有限公司。
张弘弢	本基金的基金经理、投委会成员	2012-12-25	-	22 年	硕士。2000 年 4 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部总经理、数量投资部副总经理、上证能源交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2013 年 3 月 28 日至 2016 年 3 月 28 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2012 年 8 月 9 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2012 年 8 月 21 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2014 年 12 月 23 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 1 月 13 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2015 年 2 月 12 日至 2017 年 11 月 10 日期间）、华夏睿磐泰利六个月定期开放混合型证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 27 日至 2019 年 2 月 26 日期间）、华夏睿磐泰盛六个月定期开放混合型

					证券投资基金基金经理 (2017 年 3 月 15 日至 2021 年 1 月 5 日期间)、华夏睿磐泰兴混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 7 月 14 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰茂混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰荣混合型证券投资基金基金经理 (2017 年 12 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰利混合型证券投资基金基金经理 (2019 年 2 月 27 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、华夏睿磐泰盛混合型证券投资基金基金经理 (2021 年 1 月 6 日至 2021 年 5 月 26 日期间)、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理 (2013 年 3 月 28 日至 2021 年 5 月 27 日期间)等。
--	--	--	--	--	--

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

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量 (只)	资产净值(元)	任职时间
张弘弢	公募基金	8	152,359,845,390.31	2009-07-10
	私募资产管理计划	1	10,374,003.92	2021-11-18
	其他组合	-	-	-
	合计	9	152,370,219,394.23	-

注：报告期内，张弘弢于 2022 年 3 月 7 日离任 1 只公募基金基金经理，其管理的 1 个私募资产管理计划已于 2022 年 4 月 27 日终止。

#### 4.1.4 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遵规守信情况的说明

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

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2022 年 12 月 31 日，本基金份额净值为 3.9367 元，本报告期份额净值增长率为-20.26%，同期业绩比较基准增长率-21.63%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.37%，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

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

#### 4.9 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

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

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

本报告期内，本基金的管理人——华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对华夏基金管理有限公司编制和披露的本基金 2022 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §6 审计报告

普华永道中天审字(2023)第 25627 号

华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人：

## 6.1 审计意见

### (一) 我们审计的内容

我们审计了华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华夏沪深 300ETF”)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,公允反映了华夏沪深 300ETF 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,我们独立于华夏沪深 300ETF,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

华夏沪深 300ETF 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沪深 300ETF 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沪深 300ETF、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沪深 300ETF 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，就可能对华夏沪深 300ETF 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沪深 300ETF 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：华夏沪深 300 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	上年度末
----	-----	-----	------

		2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	67,382,370.51	27,638,718.23
结算备付金		131,987,362.10	188,358,586.41
存出保证金		20,099,945.07	27,128,180.22
交易性金融资产	7.4.7.2	24,741,873,810.09	28,697,060,869.42
其中：股票投资		24,741,873,810.09	28,697,060,869.42
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		208,577,591.01	111,273,067.79
应收股利		24,853.50	2,024.70
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	458,340.27	1,563,446.91
资产总计		25,170,404,272.55	29,053,024,893.68
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
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		190,143,000.67	105,353,159.01
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,844,943.90	11,676,773.42
应付托管费		1,968,988.77	2,335,354.69
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		54,607.69	141,194.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	59,862,788.68	24,671,881.60
负债合计		261,874,329.71	144,178,363.03
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	15,457,732,843.21	14,070,329,670.83
未分配利润	7.4.7.8	9,450,797,099.63	14,838,516,859.82
净资产合计		24,908,529,942.84	28,908,846,530.65
负债和净资产总计		25,170,404,272.55	29,053,024,893.68

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.9367 元，基金份额总额 6,327,249,828.00 份。

②以下比较数据已根据本年《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》中的资产负债表格式的要求进行列示：2021 年年度报告资产负债表中“应收利息”与“其他资产”

项目的“本期末”余额合并列示在 2022 年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：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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
<b>一、营业总收入</b>		-5,137,506,726.91	-573,799,309.40
1.利息收入		32,330,719.00	53,626,400.98
其中：存款利息收入	7.4.7.9	3,199,415.98	4,476,864.16
债券利息收入		-	8,392.98
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		56,479.45	43,134.24
证券出借利息收入		29,074,823.57	49,098,009.60
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,439,152,216.70	4,149,766,481.18
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,893,740,420.22	3,653,873,604.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	6,024,917.61	12,102,219.73
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	-44,065,147.97	12,762,171.84
股利收益	7.4.7.14	492,628,433.88	471,028,485.43
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	-3,739,838,862.86	-4,797,924,228.17
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	9,153,633.65	20,732,036.61
<b>减：二、营业总支出</b>		141,816,361.35	196,149,281.82
1.管理人报酬		112,275,892.09	135,444,428.50
2.托管费		22,455,178.43	27,088,885.67
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		104,568.73	202,448.83
8.其他费用	7.4.7.18	6,980,722.10	33,413,518.82
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-5,279,323,088.26	-769,948,591.22
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填</b>		-5,279,323,088.26	-769,948,591.22

列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-5,279,323,088.26	-769,948,591.22

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：华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 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）	14,070,329,670.83	-	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65
二、本期期初净资产（基金净值）	14,070,329,670.83	-	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,387,403,172.38	-	-5,387,719,760.19	-4,000,316,587.81
（一）、综合收益总额	-	-	-5,279,323,088.26	-5,279,323,088.26
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,387,403,172.38	-	314,454,764.51	1,701,857,936.89
其中：1. 基金申购款	9,883,323,706.81	-	6,757,281,464.31	16,640,605,171.12
2. 基金赎回款	-8,495,920,534.43	-	-6,442,826,699.80	-14,938,747,234.23
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-422,851,436.44	-422,851,436.44
四、本期期末净资产（基金净值）	15,457,732,843.21	-	9,450,797,099.63	24,908,529,942.84
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）	14,083,522,094.73	-	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58
二、本期期初净资产（基金净值）	14,083,522,094.73	-	16,504,667,979.85	30,588,190,074.58
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-13,192,423.90	-	-1,666,151,120.03	-1,679,343,543.93
（一）、综合收益总额	-	-	-769,948,591.22	-769,948,591.22
（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）	-13,192,423.90	-	-362,226,545.29	-375,418,969.19
其中：1.基金申购款	13,821,262,027.71	-	15,323,357,502.16	29,144,619,529.87
2.基金赎回款	-13,834,454,451.61	-	-15,685,584,047.45	-29,520,038,499.06
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-533,975,983.52	-533,975,983.52
四、本期期末净资产（基金净值）	14,070,329,670.83	-	14,838,516,859.82	28,908,846,530.65

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

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

2012 年 12 月 25 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 602,808,845 份基金份额，其中认购资金利息折合 44,550 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股、债券、股指期货、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

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

#### 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中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、应收证券清算款和应收股利，金额分别为 27,638,718.23 元、188,358,586.41 元、27,128,180.22 元、1,563,446.91 元、111,273,067.79 元和 2,024.70 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收股利，金额分别为 27,643,491.91 元、188,471,426.68 元、27,128,816.90 元、1,445,196.28 元、111,273,067.79 元和 2,024.70 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 28,697,060,869.42 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 28,697,060,869.42 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 105,353,159.01 元、11,676,773.42 元、2,335,354.69 元、2,879,002.64 元和 21,792,878.96 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 105,353,159.01 元、11,676,773.42 元、2,335,354.69 元、2,879,002.64 元和 21,792,878.96 元。

#### 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	67,382,370.51	27,638,718.23
等于：本金	67,377,756.97	27,638,718.23
加：应计利息	4,613.54	-
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	67,382,370.51	27,638,718.23

##### 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	27,676,183,335.95	-	24,741,873,810.09	-2,934,309,525.86
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	27,676,183,335.95	-	24,741,873,810.09	-2,934,309,525.86
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	27,892,274,512.42	-	28,697,060,869.42	804,786,357.00
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	27,892,274,512.42	-	28,697,060,869.42	804,786,357.00

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

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	163,954,800.00	-	-	-
其中：股指期货	163,954,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	163,954,800.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	218,100,300.00	-	-	-
其中：股指期货	218,100,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	218,100,300.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2303	沪深 300 期货 IF2303 合约	137.00	160,462,620.00	-3,492,180.00
合计	-	-	-	-3,492,180.00
减：可抵销期货 暂收款	-	-	-	-3,492,180.00
净额				-

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

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	-	1,563,446.91
其他应收款	458,340.27	-
待摊费用	-	-
合计	458,340.27	1,563,446.91

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	1,961,198.82	2,879,002.64
其中：交易所市场	1,961,198.82	2,879,002.64
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	240,000.00	250,000.00
应付指数使用费	3,213,380.09	1,946,769.61
应退替代款	54,391,184.38	18,864,093.32

可退替代款	57,025.39	732,016.03
合计	59,862,788.68	24,671,881.60

#### 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	5,759,349,828.00	14,070,329,670.83
本期申购	4,045,500,000.00	9,883,323,706.81
本期赎回（以“-”号填列）	-3,477,600,000.00	-8,495,920,534.43
本期末	6,327,249,828.00	15,457,732,843.21

#### 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	23,782,737,048.88	-8,944,220,189.06	14,838,516,859.82
本期利润	-1,539,484,225.40	-3,739,838,862.86	-5,279,323,088.26
本期基金份额交易产生的变动数	2,031,513,398.30	-1,717,058,633.79	314,454,764.51
其中：基金申购款	15,700,404,472.67	-8,943,123,008.36	6,757,281,464.31
基金赎回款	-13,668,891,074.37	7,226,064,374.57	-6,442,826,699.80
本期已分配利润	-422,851,436.44	-	-422,851,436.44
本期末	23,851,914,785.34	-14,401,117,685.71	9,450,797,099.63

#### 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	290,311.44	228,022.32
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	2,882,272.04	4,217,488.22
其他	26,832.50	31,353.62
合计	3,199,415.98	4,476,864.16

#### 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	-1,298,583,982.36	1,971,497,658.08
股票投资收益——赎回差价收入	-595,156,437.86	1,682,375,946.10
股票投资收益——申购差价收入	-	-

入		
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,893,740,420.22	3,653,873,604.18

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	9,770,128,703.05	18,544,715,294.40
减：卖出股票成本总额	11,055,481,633.15	16,573,217,636.32
减：交易费用	13,231,052.26	-
买卖股票差价收入	-1,298,583,982.36	1,971,497,658.08

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	14,938,747,234.23	29,520,038,499.06
减：现金支付赎回款总额	6,167,353,956.23	11,698,776,122.06
减：赎回股票成本总额	9,366,549,715.86	16,138,886,430.90
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-595,156,437.86	1,682,375,946.10

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	3,452.35	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	6,021,465.26	12,102,219.73
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	6,024,917.61	12,102,219.73

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	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	30,050,860.68	82,749,858.89
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	24,025,600.00	70,639,100.00
减：应计利息总额	3,516.96	8,539.16
减：交易费用	278.46	-
买卖债券差价收入	6,021,465.26	12,102,219.73

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额	上年度可比期间收益金额
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-44,065,147.97	12,762,171.84

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	492,628,433.88	471,028,485.43
其中：证券出借权益补偿收入	27,459,011.55	39,439,647.46
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	492,628,433.88	471,028,485.43

7.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-3,739,095,882.86	-4,780,989,408.17
——股票投资	-3,739,095,882.86	-4,780,989,408.17
——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	-742,980.00	-16,934,820.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-742,980.00	-16,934,820.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-3,739,838,862.86	-4,797,924,228.17

7.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	9,153,633.65	15,148,744.03
其他	-	5,583,292.58
合计	9,153,633.65	20,732,036.61

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	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	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	4,168.70	3,929.84
指数使用费	6,736,553.40	8,126,665.64
其他	-	25,032,923.34
合计	6,980,722.10	33,413,518.82

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

根据本基金管理人于 2023 年 1 月 10 日发布的分红公告，本基金向 2023 年 1 月 13 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.650 元。

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
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	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
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (“华夏沪深 300ETF 联接”)	该基金是本基金的联接基金
中信期货有限公司 (“中信期货”)	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	8,010,799,745.12	39.77%	7,190,392,442.09	19.41%

###### 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	30,050,860.68	100.00%	44,309,112.00	53.55%

###### 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	60,000,000.00	60.00%	20,000,000.00	28.57%

###### 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	651,270.71	39.77%	33,081.93	1.69%
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	584,731.07	19.41%	221,893.43	7.71%

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	112,275,892.09	135,444,428.50
其中：支付销售机构的客户维护费	301,670.07	216,027.66

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

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

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

##### 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	22,455,178.43	27,088,885.67

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	5,728,391,900.94	5,872,825.98	168,380,239.00	67,447.38
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	13,321,217,336.28	14,472,782.36	1,543,410,285.12	742,840.46

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	期末应收利息余额
中信证券	2022010400021237	华大基因	2022-01-04	586,278.00	6,600.00	28	2.50	1,384.27	-	-
中信证券	2022010400021239	阳光电源	2022-01-04	1,787,280.00	13,200.00	28	3.00	5,063.96	-	-
中信证券	2022010400021241	英科医疗	2022-01-04	381,810.00	6,600.00	28	3.30	1,189.98	-	-
中信证券	2022010400021243	泰格医药	2022-01-04	782,364.00	6,600.00	28	2.40	1,773.36	-	-
中信证券	2022010400021245	先导智能	2022-01-04	943,800.00	13,200.00	28	2.80	2,495.83	-	-
中信证券	2022010400021247	汇川	2022-01-04	1,382,040.00	19,800.00	28	2.80	3,654.73	-	-

		技术	04							
中信证券	202201040002 1249	温氏股份	202 2- 01- 04	1,364,880.00	66,000.00	28	3.2 0	4,124.97	-	-
中信证券	202201040002 1251	同花顺	202 2- 01- 04	954,360.00	6,600.00	28	2.9 0	2,613.88	-	-
中信证券	202201040002 1271	贝达药业	202 2- 01- 04	529,848.00	6,600.00	28	2.9 0	1,451.19	-	-
中信证券	202201040002 1273	中国通号	202 2- 01- 04	199,188.00	39,600.00	28	2.1 0	395.06	-	-
中信证券	202201040002 1275	蓝思科技	202 2- 01- 04	464,904.00	19,800.00	28	2.5 0	1,097.69	-	-
中信证券	202201040002 1277	沪硅产业	202 2- 01- 04	336,468.00	13,200.00	28	3.3 0	1,048.66	-	-
中信证券	202201040002 1279	东方财富	202 2- 01- 04	4,496,844.00	125,400.00	28	3.2 0	13,590.47	-	-
中信证券	202201040002 1281	宋城演艺	202 2- 01- 04	401,280.00	26,400.00	28	3.3 0	1,250.65	-	-
中信证券	202201040002 1283	宋城演艺	202 2- 01- 04	304,000.00	20,000.00	14	3.4 0	401.96	-	-
中信证券	202201040002 1285	爱尔眼科	202 2- 01- 04	253,260.00	6,000.00	14	3.3 0	325.02	-	-
中信证券	202201040002 1287	爱尔眼科	202 2- 01- 04	1,671,516.00	39,600.00	28	3.2 0	5,051.70	-	-
中信证券	202201040002 1289	亿联网络	202 2- 01- 04	515,988.00	6,600.00	28	2.8 0	1,364.50	-	-
中信证券	202201040002 1291	沃	202 2-	1,454,112.00	26,400.00	28	2.9 0	3,982.65	-	-

		森生物	01-04							
中信证券	2022010600000403	爱尔眼科	2022-01-06	3,585,120.00	92,400.00	14	1.80	2,509.58	-	-
中信证券	2022010600000411	智飞生物	2022-01-06	3,756,490.00	32,300.00	14	1.80	2,629.54	-	-
中信证券	2022010600000421	东方财富	2022-01-06	7,481,388.00	220,300.00	14	1.80	5,236.97	-	-
中信证券	2022010600000422	沃森生物	2022-01-06	4,112,584.00	72,100.00	14	1.80	2,878.81	-	-
中信证券	2022010600001232	迈瑞医疗	2022-01-06	2,602,600.00	7,700.00	14	2.90	2,935.15	-	-
中信证券	2022010600010033	宋城演艺	2022-01-06	260,440.00	17,000.00	14	3.40	344.36	-	-
中信证券	2022010600010035	爱尔眼科	2022-01-06	1,474,400.00	38,000.00	14	3.30	1,892.15	-	-
中信证券	2022010700010579	中国通号	2022-01-07	200,376.00	39,600.00	28	2.10	362.35	-	-
中信证券	2022010700010581	同花顺	2022-01-07	854,634.00	6,600.00	28	2.90	2,134.21	-	-
中信证券	2022010700010583	贝达药业	2022-01-07	513,480.00	6,600.00	28	2.90	1,282.27	-	-
中信证券	2022010700010585	爱尔眼科	2022-01-07	1,533,708.00	39,600.00	28	3.20	4,226.22	-	-
中信证券	2022010700010587	东方财富	2022-01-07	4,232,250.00	125,400.00	28	3.20	11,662.20	-	-

中信证券	2022010700010589	亿纬锂能	2022-01-07	2,086,722.00	19,800.00	28	2.80	5,031.32	-	-
中信证券	2022010700010591	阳光电源	2022-01-07	1,693,560.00	13,200.00	28	3.00	4,375.03	-	-
中信证券	2022010700010593	汇川技术	2022-01-07	1,314,522.00	19,800.00	28	2.80	3,169.46	-	-
中信证券	2022010700010595	沃森生物	2022-01-07	1,548,360.00	26,400.00	28	2.90	3,866.60	-	-
中信证券	2022010700010597	华大基因	2022-01-07	600,402.00	6,600.00	28	2.50	1,292.53	-	-
中信证券	2022010700010599	澜起科技	2022-01-07	996,336.00	13,200.00	28	2.70	2,316.49	-	-
中信证券	2022010700010601	英科医疗	2022-01-07	398,442.00	6,600.00	28	3.30	1,132.24	-	-
中信证券	2022010700010603	乐普医疗	2022-01-07	452,430.00	19,800.00	28	3.10	1,207.74	-	-
中信证券	2022010700010605	亿联网络	2022-01-07	551,100.00	6,600.00	28	2.80	1,328.76	-	-
中信证券	2022010700010607	康泰生物	2022-01-07	594,594.00	6,600.00	28	2.60	1,331.23	-	-
中信证券	2022010700010609	欧普康视	2022-01-07	346,500.00	6,600.00	28	2.70	805.61	-	-
中信证券	2022010700010611	智飞生物	2022-01-07	1,507,836.00	13,200.00	28	2.40	3,116.20	-	-
中信证券	2022010700010613	沪硅产	2022-01-07	335,148.00	13,200.00	28	3.30	952.38	-	-

中信证券	2022010700010615	业 蓝 思 科 技	202 2- 01- 07	429,660.0 0	19,800.00	28	2.5 0	924.96	-	-
中信证券	2022010700010617	温 氏 股 份	202 2- 01- 07	1,328,580. 00	66,000.00	28	3.2 0	3,660.98	-	-
中信证券	2022010700010619	健 帆 生 物	202 2- 01- 07	355,938.0 0	6,600.00	28	3.2 0	980.81	-	-
中信证券	2022010700010621	先 导 智 能	202 2- 01- 07	891,000.0 0	13,200.00	28	2.8 0	2,148.30	-	-
中信证券	2022010700010625	芒 果 超 媒	202 2- 01- 07	724,812.0 0	13,200.00	28	3.4 0	2,122.09	-	-
中信证券	2022010700010627	三 环 集 团	202 2- 01- 07	558,360.0 0	13,200.00	28	2.6 0	1,250.11	-	-
中信证券	2022010700010629	泰 格 医 药	202 2- 01- 07	733,260.0 0	6,600.00	28	2.4 0	1,515.40	-	-
中信证券	2022010700010631	宋 城 演 艺	202 2- 01- 07	399,432.0 0	26,400.00	28	3.3 0	1,135.05	-	-
中信证券	2022011000010795	爱 尔 眼 科	202 2- 01- 10	1,726,527. 00	46,300.00	14	3.0 0	2,014.28	-	-
中信证券	2022011100012139	阳 光 电 源	202 2- 01- 11	362,940.0 0	3,000.00	14	3.2 0	451.66	-	-
中信证券	2022011100014177	健 帆 生 物	202 2- 01- 11	214,520.0 0	4,000.00	14	1.8 0	150.16	-	-
中信证券	2022011100014179	爱 尔 眼 科	202 2- 01- 11	689,320.0 0	19,000.00	14	1.8 0	482.52	-	-
中信证券	2022011100014181	迈 瑞	202 2-	638,000.0 0	2,000.00	14	1.8 0	446.60	-	-

		医疗	01-11							
中信证券	2022011100014185	乐普医疗	2022-01-11	259,930.00	11,000.00	14	1.80	181.95	-	-
中信证券	2022011300009626	宁德时代	2022-01-13	7,288,500.00	12,900.00	28	3.10	17,573.38	-	-
中信证券	2022011300009628	同花顺	2022-01-13	224,766.00	1,800.00	28	2.90	506.97	-	-
中信证券	2022011300009820	中芯国际	2022-01-13	1,436,856.00	27,600.00	28	1.80	2,011.60	-	-
中信证券	2022011300009840	亿纬锂能	2022-01-13	1,075,400.00	10,000.00	28	2.80	2,341.98	-	-
中信证券	2022011300009842	稳健医疗	2022-01-13	702,720.00	8,000.00	28	2.80	1,530.37	-	-
中信证券	2022011300009844	安克创新	2022-01-13	627,321.00	6,700.00	28	3.20	1,561.33	-	-
中信证券	2022011300009846	爱美客	2022-01-13	903,982.00	1,900.00	28	2.90	2,038.98	-	-
中信证券	2022011300009848	卓胜微	2022-01-13	1,083,420.00	3,600.00	28	2.50	2,106.65	-	-
中信证券	2022011300009850	英科医疗	2022-01-13	214,710.00	3,400.00	28	3.20	534.39	-	-
中信证券	2022011300009852	澜起科技	2022-01-13	304,138.00	4,100.00	28	2.30	544.07	-	-
中信证券	2022011300009854	华润微	2022-01-13	144,960.00	2,400.00	28	1.90	214.22	-	-
中信证券	2022011300009856	华大基	2022-01-	206,536.00	2,200.00	28	3.00	481.92	-	-

		因	13							
中信证券	202201130000 9858	华熙生物	202 2- 01- 13	136,980.0 0	1,000.00	28	2.8 0	298.31	-	-
中信证券	202201130000 9860	天合光能	202 2- 01- 13	892,860.0 0	13,800.00	28	4.8 0	3,333.34	-	-
中信证券	202201130000 9862	沪硅产业	202 2- 01- 13	173,316.0 0	6,600.00	28	2.2 0	296.56	-	-
中信证券	202201130000 9864	迈瑞医疗	202 2- 01- 13	1,876,242. 00	5,800.00	28	2.4 0	3,502.32	-	-
中信证券	202201130000 9866	中国通号	202 2- 01- 13	115,645.0 0	22,900.00	28	1.6 0	143.91	-	-
中信证券	202201130000 9868	奇安信	202 2- 01- 13	672,160.0 0	8,000.00	28	2.0 0	1,045.58	-	-
中信证券	202201130000 9870	中微公司	202 2- 01- 13	256,344.0 0	2,200.00	28	2.4 0	478.51	-	-
中信证券	202201130001 1588	蓝思科技	202 2- 01- 13	345,270.0 0	17,000.00	28	2.0 0	537.09	-	-
中信证券	202201130001 1590	乐普医疗	202 2- 01- 13	271,600.0 0	11,200.00	28	2.8 0	591.48	-	-
中信证券	202201130001 1592	金龙鱼	202 2- 01- 13	827,405.0 0	12,700.00	28	3.1 0	1,994.97	-	-
中信证券	202201130001 2154	康龙化成	202 2- 01- 13	771,438.0 0	5,700.00	28	2.4 0	1,440.02	-	-
中信证券	202201130001 2156	宋城演艺	202 2- 01- 13	209,890.0 0	13,900.00	28	2.9 0	473.42	-	-
中信证券	202201130001 2158	金山办	202 2- 01-	431,817.0 0	1,700.00	28	2.9 0	973.99	-	-

		公	13							
中信证券	202201130001 2160	晶 盛 机 电	202 2- 01- 13	802,710.0 0	13,500.00	28	2.4 0	1,498.39	-	-
中信证券	202201130001 2162	泰 格 医 药	202 2- 01- 13	578,758.0 0	4,700.00	28	3.1 0	1,395.45	-	-
中信证券	202201130001 2164	阳 光 电 源	202 2- 01- 13	1,144,365. 00	9,300.00	28	2.8 0	2,492.17	-	-
中信证券	202201130001 2166	传 音 控 股	202 2- 01- 13	317,284.0 0	2,200.00	28	3.1 0	765.01	-	-
中信证券	202201130001 2168	沃 森 生 物	202 2- 01- 13	800,400.0 0	13,800.00	28	2.5 0	1,556.33	-	-
中信证券	202201130001 2170	爱 尔 眼 科	202 2- 01- 13	851,724.0 0	23,600.00	28	3.2 0	2,119.85	-	-
中信证券	202201130001 2172	汇 川 技 术	202 2- 01- 13	1,041,600. 00	16,000.00	28	2.4 0	1,944.32	-	-
中信证券	202201130001 2174	东 方 财 富	202 2- 01- 13	2,290,112. 00	70,400.00	28	3.0 0	5,343.59	-	-
中信证券	202201130001 2176	亿 联 网 络	202 2- 01- 13	261,280.0 0	3,200.00	28	2.0 0	406.44	-	-
中信证券	202201130001 2178	智 飞 生 物	202 2- 01- 13	800,660.0 0	7,000.00	28	2.0 0	1,245.47	-	-
中信证券	202201130001 2180	贝 达 药 业	202 2- 01- 13	168,520.0 0	2,200.00	28	2.5 0	327.68	-	-
中信证券	202201130001 2182	温 氏 股 份	202 2- 01- 13	763,551.0 0	38,700.00	28	3.0 0	1,781.62	-	-
中信证券	202201130001 2184	健 帆	202 2-	232,974.0 0	4,200.00	28	3.1 0	561.73	-	-

		生物	01-13							
中信证券	2022011300012186	欧普康视	2022-01-13	225,324.00	4,400.00	28	1.80	315.45	-	-
中信证券	2022011300012188	先导智能	2022-01-13	688,603.00	9,700.00	28	1.90	1,017.60	-	-
中信证券	2022011300012190	康泰生物	2022-01-13	340,326.00	3,700.00	28	2.40	635.28	-	-
中信证券	2022011300012192	芒果超媒	2022-01-13	285,634.00	6,200.00	28	3.20	710.91	-	-
中信证券	2022011300012194	三环集团	2022-01-13	472,340.00	11,300.00	28	2.00	734.75	-	-
中信证券	2022011400020858	爱尔眼科	2022-01-14	5,317,500.00	150,000.00	14	3.30	6,824.13	-	-
中信证券	2022011400021472	汇川技术	2022-01-14	64,000.00	1,000.00	14	1.80	44.80	-	-
中信证券	2022011400023528	蓝思科技	2022-01-14	34,374.00	1,700.00	14	1.80	24.06	-	-
中信证券	2022011700002799	贝达药业	2022-01-17	409,136.00	5,200.00	28	2.50	795.54	-	-
中信证券	2022011800001393	乐普医疗	2022-01-18	1,117,920.00	48,000.00	14	3.10	1,925.30	-	-
中信证券	2022011800025768	爱尔眼科	2022-01-18	216,360.00	6,000.00	14	3.30	396.66	-	-
中信证券	2022011800025770	宋城演艺	2022-01-18	301,400.00	20,000.00	14	3.00	502.33	-	-
中信证券	202201200000	温	202	463,910.00	23,000.00	14	3.2	742.26	-	-

	1278	氏股份	2-01-20	0			0			
中信证券	2022012000009804	爱尔眼科	2022-01-20	1,331,900.00	38,000.00	14	3.30	2,197.63	-	-
中信证券	2022012000009808	宋城演艺	2022-01-20	265,710.00	17,000.00	14	3.00	398.57	-	-
中信证券	2022012000010874	爱尔眼科	2022-01-20	1,331,900.00	38,000.00	28	3.20	3,314.95	-	-
中信证券	2022012000011178	沃森生物	2022-01-20	3,888,353.00	72,100.00	14	1.80	3,499.52	-	-
中信证券	2022012000011182	爱尔眼科	2022-01-20	3,238,620.00	92,400.00	14	1.80	2,914.75	-	-
中信证券	2022012000011184	智飞生物	2022-01-20	3,456,100.00	32,300.00	14	1.80	3,110.49	-	-
中信证券	2022012000011186	东方财富	2022-01-20	7,430,719.00	220,300.00	14	1.80	6,687.64	-	-
中信证券	2022012400010302	爱尔眼科	2022-01-24	1,595,498.00	46,300.00	14	3.30	2,047.56	-	-
中信证券	2022012500010174	乐普医疗	2022-01-25	242,000.00	11,000.00	14	1.80	169.40	-	-
中信证券	2022012500010176	爱尔眼科	2022-01-25	641,250.00	19,000.00	14	1.80	448.88	-	-
中信证券	2022012500010216	阳光电源	2022-01-25	378,030.00	3,000.00	14	2.60	382.23	-	-
中信证券	2022012500010310	迈瑞医疗	2022-01-25	682,000.00	2,000.00	14	1.80	477.40	-	-

中信证券	2022012500010716	健帆生物	2022-01-25	183,400.00	4,000.00	14	1.80	128.38	-	-
中信证券	2022012600009806	爱尔眼科	2022-01-26	573,104.00	17,200.00	28	3.20	1,426.39	-	-
中信证券	2022012600010238	先导智能	2022-01-26	529,305.00	7,100.00	28	1.90	782.20	-	-
中信证券	2022012600010240	三环集团	2022-01-26	323,368.00	8,300.00	28	2.40	603.62	-	-
中信证券	2022012600010242	温氏股份	2022-01-26	546,756.00	28,300.00	28	3.10	1,318.29	-	-
中信证券	2022012600010244	蓝思科技	2022-01-26	225,184.00	12,400.00	28	2.70	472.89	-	-
中信证券	2022012600010246	澜起科技	2022-01-26	227,700.00	3,000.00	28	2.60	460.46	-	-
中信证券	2022012600010248	中国通号	2022-01-26	81,496.00	16,700.00	28	1.90	120.43	-	-
中信证券	2022012600010250	芒果超媒	2022-01-26	162,810.00	4,500.00	28	3.00	379.89	-	-
中信证券	2022012600010252	华大基因	2022-01-26	135,200.00	1,600.00	28	2.70	283.92	-	-
中信证券	2022012600010254	英科医疗	2022-01-26	139,475.00	2,500.00	28	3.10	336.29	-	-
中信证券	2022012600010256	健帆生物	2022-01-26	146,723.00	3,100.00	28	2.90	330.94	-	-
中信证券	2022012600010260	中微公	2022-01-26	201,200.00	1,600.00	28	2.40	375.57	-	-

中信证券	2022012600010262	司亿联网络	2022-01-26	186,024.00	2,300.00	28	2.10	303.84	-	-
中信证券	2022012600010264	东方财富	2022-01-26	1,679,752.00	51,400.00	28	2.80	3,658.13	-	-
中信证券	2022012600010266	智飞生物	2022-01-26	550,494.00	5,100.00	28	2.20	941.96	-	-
中信证券	2022012600010268	同花顺	2022-01-26	169,156.00	1,300.00	28	2.50	328.91	-	-
中信证券	2022012600010270	汇川技术	2022-01-26	763,659.00	11,700.00	28	2.90	1,722.48	-	-
中信证券	2022012600010272	亿纬锂能	2022-01-26	722,846.00	7,300.00	28	3.10	1,742.86	-	-
中信证券	2022012600010274	乐普医疗	2022-01-26	177,940.00	8,200.00	28	3.00	415.19	-	-
中信证券	2022012600010276	沃森生物	2022-01-26	493,284.00	10,100.00	28	2.60	997.53	-	-
中信证券	2022012600010278	阳光电源	2022-01-26	880,260.00	6,800.00	28	2.50	1,711.62	-	-
中信证券	2022012600010280	宋城演艺	2022-01-26	153,510.00	10,200.00	28	2.30	274.61	-	-
中信证券	2022012600010284	华熙生物	2022-01-26	123,040.00	1,000.00	28	2.80	267.95	-	-
中信证券	2022012600010286	华润微	2022-01-26	103,446.00	1,800.00	28	3.30	265.51	-	-
中信证券	2022012600010288	沪硅产	2022-01-	124,704.00	4,800.00	28	2.60	252.18	-	-

		业	26							
中信证券	2022012600010290	金山办公	2022-01-26	306,924.00	1,200.00	28	3.10	740.03	-	-
中信证券	2022012600010292	传音控股	2022-01-26	217,280.00	1,600.00	28	2.50	422.49	-	-
中信证券	2022012600010336	泰格医药	2022-01-26	370,566.00	3,400.00	28	2.40	691.72	-	-
中信证券	2022012600010342	欧普康视	2022-01-26	127,424.00	3,200.00	28	2.70	267.59	-	-
中信证券	2022012600010344	康泰生物	2022-01-26	220,185.00	2,700.00	28	2.60	445.26	-	-
中信证券	2022012600011490	贝达药业	2022-01-26	106,320.00	1,600.00	28	2.90	239.81	-	-
中信证券	2022012700000935	宋城演艺	2022-01-27	1,390,080.00	96,000.00	14	2.00	1,081.17	-	-
中信证券	2022012800022092	亿联网络	2022-01-28	140,940.00	1,800.00	28	2.10	230.20	-	-
中信证券	2022012800022094	华大基因	2022-01-28	151,200.00	1,800.00	28	2.70	317.52	-	-
中信证券	2022012800022096	爱尔眼科	2022-01-28	4,840,500.00	150,000.00	14	3.30	6,211.98	-	-
中信证券	2022012800022098	澜起科技	2022-01-28	263,625.00	3,700.00	28	2.60	533.11	-	-
中信证券	2022012800022100	中国通号	2022-01-28	53,020.00	11,000.00	28	1.90	78.35	-	-
中信证券	2022012800022102	沪硅	2022-	86,580.00	3,700.00	28	2.60	175.08	-	-

		产业	01-28							
中信证券	202201280002 2112	三环集团	2022-01-28	140,600.00	3,700.00	28	2.40	262.45	-	-
中信证券	202201280002 2114	芒果超媒	2022-01-28	128,612.00	3,700.00	28	3.00	300.09	-	-
中信证券	202201280002 2116	阳光电源	2022-01-28	421,763.00	3,700.00	28	2.50	820.09	-	-
中信证券	202201280002 2118	蓝思科技	2022-01-28	93,005.00	5,500.00	28	2.70	195.31	-	-
中信证券	202201280002 2120	欧普康视	2022-01-28	68,094.00	1,800.00	28	2.70	143.00	-	-
中信证券	202201280002 2122	泰格医药	2022-01-28	185,886.00	1,800.00	28	2.40	346.99	-	-
中信证券	202201280002 2124	贝达药业	2022-01-28	112,140.00	1,800.00	28	2.90	252.94	-	-
中信证券	202201280002 2126	康泰生物	2022-01-28	144,144.00	1,800.00	28	2.60	291.49	-	-
中信证券	202201280002 2128	先导智能	2022-01-28	265,882.00	3,700.00	28	1.90	392.91	-	-
中信证券	202201280002 2130	温氏股份	2022-01-28	368,745.00	18,300.00	28	3.10	889.09	-	-
中信证券	202201280002 2132	乐普医疗	2022-01-28	113,960.00	5,500.00	28	3.00	265.91	-	-
中信证券	202201280002 2134	健帆生物	2022-01-28	84,960.00	1,800.00	28	2.90	191.63	-	-
中信证券	202201280002	亿	202	512,985.0	5,500.00	28	3.1	1,236.86	-	-

	2136	纬 锂 能	2- 01- 28	0			0			
中信证券	202201280002 2138	宋 城 演 艺	202 2- 01- 28	111,617.0 0	7,300.00	28	2.3 0	199.67	-	-
中信证券	202201280002 2140	爱 尔 眼 科	202 2- 01- 28	354,970.0 0	11,000.00	28	3.2 0	883.48	-	-
中信证券	202201280002 2142	东 方 财 富	202 2- 01- 28	784,000.0 0	25,000.00	28	2.8 0	1,707.38	-	-
中信证券	202201280002 2144	汇 川 技 术	202 2- 01- 28	329,945.0 0	5,500.00	28	2.9 0	744.21	-	-
中信证券	202201280002 2146	沃 森 生 物	202 2- 01- 28	351,860.0 0	7,300.00	28	2.6 0	711.54	-	-
中信证券	202201280002 2148	智 飞 生 物	202 2- 01- 28	390,794.0 0	3,700.00	28	2.2 0	668.69	-	-
中信证券	202201280002 2150	同 花 顺	202 2- 01- 28	225,126.0 0	1,800.00	28	2.5 0	437.75	-	-
中信证券	202201280002 2170	蓝 思 科 技	202 2- 01- 28	28,747.00	1,700.00	14	1.8 0	20.12	-	-
中信证券	202201280002 2176	汇 川 技 术	202 2- 01- 28	59,990.00	1,000.00	14	1.8 0	41.99	-	-
中信证券	202202070004 7197	沃 森 生 物	202 2- 02- 07	3,622,304. 00	72,100.00	14	1.8 0	2,535.61	-	-
中信证券	202202070004 7203	爱 尔 眼 科	202 2- 02- 07	2,966,964. 00	92,400.00	14	1.8 0	2,076.87	-	-
中信证券	202202070004 7207	智 飞 生 物	202 2- 02- 07	3,568,181. 00	32,300.00	14	1.8 0	2,497.73	-	-

中信证券	202202070004 7211	东方 财富	202 2- 02- 07	7,098,066. 00	220,300.0 0	14	1.8 0	4,968.65	-	-
中信证券	202202070005 5547	爱尔 眼科	202 2- 02- 07	192,660.0 0	6,000.00	14	3.6 0	269.72	-	-
中信证券	202202070005 5549	宋城 演艺	202 2- 02- 07	256,190.0 0	17,000.00	14	2.0 0	199.26	-	-
中信证券	202202070005 5551	宋城 演艺	202 2- 02- 07	301,400.0 0	20,000.00	14	2.0 0	234.42	-	-
中信证券	202202070005 5553	乐普 医疗	202 2- 02- 07	998,880.0 0	48,000.00	14	3.0 0	1,165.36	-	-
中信证券	202202070005 5555	温氏 股份	202 2- 02- 07	474,950.0 0	23,000.00	14	2.5 0	461.76	-	-
中信证券	202202070005 5557	爱尔 眼科	202 2- 02- 07	1,220,180. 00	38,000.00	14	3.6 0	1,708.25	-	-
中信证券	202202070005 5559	爱尔 眼科	202 2- 02- 07	1,486,693. 00	46,300.00	14	3.6 0	2,081.37	-	-
中信证券	202202080001 3618	乐普 医疗	202 2- 02- 08	231,220.0 0	11,000.00	14	1.8 0	161.85	-	-
中信证券	202202080001 3622	爱尔 眼科	202 2- 02- 08	623,770.0 0	19,000.00	14	1.8 0	436.64	-	-
中信证券	202202080001 3630	健帆 生物	202 2- 02- 08	186,000.0 0	4,000.00	14	1.8 0	130.20	-	-
中信证券	202202080001 3634	迈瑞 医疗	202 2- 02- 08	636,220.0 0	2,000.00	14	1.8 0	445.35	-	-
中信证券	202202080001 3638	阳光 电	202 2- 02- 08	321,360.0 0	3,000.00	14	2.5 0	312.43	-	-

中信证券	2022021000001628	源安克创新	2022-02-10	1,965,744.00	20,400.00	14	3.50	2,675.60	-	-
中信证券	2022021000013426	中微公司	2022-02-10	256,696.00	2,200.00	28	3.30	658.85	-	-
中信证券	2022021000013428	传音控股	2022-02-10	290,312.00	2,200.00	28	1.90	429.02	-	-
中信证券	2022021000013430	中国通号	2022-02-10	114,729.00	22,900.00	28	2.00	178.47	-	-
中信证券	2022021000013432	澜起科技	2022-02-10	305,573.00	4,100.00	28	2.40	570.40	-	-
中信证券	2022021000013434	奇安信	2022-02-10	581,840.00	8,000.00	28	5.60	2,534.24	-	-
中信证券	2022021000013436	天合光能	2022-02-10	788,946.00	13,800.00	28	3.60	2,209.05	-	-
中信证券	2022021000013438	金山办公	2022-02-10	363,596.00	1,700.00	28	2.60	735.27	-	-
中信证券	2022021000013440	中芯国际	2022-02-10	1,413,120.00	27,600.00	28	1.70	1,868.46	-	-
中信证券	2022021000013442	沪硅产业	2022-02-10	152,988.00	6,600.00	28	3.10	368.87	-	-
中信证券	2022021000013444	华润微	2022-02-10	137,040.00	2,400.00	28	2.90	309.10	-	-
中信证券	2022021000013446	华熙生物	2022-02-10	118,500.00	1,000.00	28	2.00	184.33	-	-
中信证券	2022021000013454	爱尔眼	2022-02-	792,724.00	23,600.00	28	3.50	2,157.97	-	-

		科	10							
中信证券	202202100001 3456	亿 纬 锂 能	202 2- 02- 10	858,700.0 0	10,000.00	28	2.8 0	1,870.06	-	-
中信证券	202202100001 3458	同 花 顺	202 2- 02- 10	211,140.0 0	1,800.00	28	2.0 0	328.44	-	-
中信证券	202202100001 3460	乐 普 医 疗	202 2- 02- 10	240,688.0 0	11,200.00	28	2.9 0	542.89	-	-
中信证券	202202100001 3488	宁 德 时 代	202 2- 02- 10	6,683,490. 00	12,900.00	28	3.4 0	17,674.12	-	-
中信证券	202202100001 3490	亿 联 网 络	202 2- 02- 10	240,768.0 0	3,200.00	28	2.0 0	374.53	-	-
中信证券	202202100001 3492	康 龙 化 成	202 2- 02- 10	619,932.0 0	5,700.00	28	2.8 0	1,350.07	-	-
中信证券	202202100001 3494	华 大 基 因	202 2- 02- 10	190,894.0 0	2,200.00	28	3.2 0	475.11	-	-
中信证券	202202100001 3496	贝 达 药 业	202 2- 02- 10	136,400.0 0	2,200.00	28	3.0 0	318.27	-	-
中信证券	202202100001 3498	欧 普 康 视	202 2- 02- 10	174,768.0 0	4,400.00	28	2.2 0	299.05	-	-
中信证券	202202100001 3500	康 泰 生 物	202 2- 02- 10	308,099.0 0	3,700.00	28	2.8 0	670.97	-	-
中信证券	202202100001 3502	爱 美 客	202 2- 02- 10	841,605.0 0	1,900.00	28	3.7 0	2,421.95	-	-
中信证券	202202100001 3504	金 龙 鱼	202 2- 02- 10	737,870.0 0	12,700.00	28	2.8 0	1,606.92	-	-
中信证券	202202100001 3506	迈 瑞 医	202 2- 02- 10	1,792,200. 00	5,800.00	28	2.0 0	2,787.87	-	-

中信证券	2022021000013508	疗安克创新	2022-02-10	645,612.00	6,700.00	28	2.70	1,355.79	-	-
中信证券	2022021000013510	健帆生物	2022-02-10	198,114.00	4,200.00	28	3.20	493.08	-	-
中信证券	2022021000013512	卓胜微	2022-02-10	945,360.00	3,600.00	28	2.80	2,058.78	-	-
中信证券	2022021000013514	宋城演艺	2022-02-10	236,022.00	13,900.00	28	1.90	348.79	-	-
中信证券	2022021000013516	阳光电源	2022-02-10	940,230.00	9,300.00	28	2.40	1,755.10	-	-
中信证券	2022021000013518	宋城演艺	2022-02-10	1,630,080.00	96,000.00	14	2.00	1,267.84	-	-
中信证券	2022021000013520	智飞生物	2022-02-10	872,760.00	7,000.00	28	2.40	1,629.15	-	-
中信证券	2022021000013522	蓝思科技	2022-02-10	258,230.00	17,000.00	28	2.10	421.78	-	-
中信证券	2022021000013590	英科医疗	2022-02-10	183,056.00	3,400.00	28	3.10	441.37	-	-
中信证券	2022021000013592	稳健医疗	2022-02-10	603,680.00	8,000.00	28	3.20	1,502.49	-	-
中信证券	2022021000014152	先导智能	2022-02-10	625,165.00	9,700.00	28	1.90	923.85	-	-
中信证券	2022021000014154	沃森生物	2022-02-10	721,188.00	13,800.00	28	2.10	1,177.94	-	-
中信证券	2022021000014156	泰格	2022-02-	430,520.00	4,700.00	28	1.90	636.21	-	-

		医药	10							
中信证券	202202100001 4158	晶盛机电	202 2- 02- 10	770,850.0 0	13,500.00	28	3.0 0	1,798.65	-	-
中信证券	202202100001 4160	汇川技术	202 2- 02- 10	966,400.0 0	16,000.00	28	2.6 0	1,954.28	-	-
中信证券	202202100001 4162	东方财富	202 2- 02- 10	2,262,656. 00	70,400.00	28	2.8 0	4,927.56	-	-
中信证券	202202100001 4164	温氏股份	202 2- 02- 10	850,626.0 0	38,700.00	28	2.4 0	1,587.84	-	-
中信证券	202202100001 4166	三环集团	202 2- 02- 10	413,693.0 0	11,300.00	28	2.0 0	643.52	-	-
中信证券	202202100001 4168	芒果超媒	202 2- 02- 10	225,866.0 0	6,200.00	28	2.9 0	509.45	-	-
中信证券	202202110002 0210	蓝思科技	202 2- 02- 11	25,194.00	1,700.00	14	1.8 0	17.64	-	-
中信证券	202202110002 0212	汇川技术	202 2- 02- 11	61,110.00	1,000.00	14	1.8 0	42.78	-	-
中信证券	202202110002 0220	爱尔眼科	202 2- 02- 11	4,860,000. 00	150,000.0 0	14	2.9 0	5,481.00	-	-
中信证券	202202140000 3670	贝达药业	202 2- 02- 14	304,200.0 0	5,200.00	28	3.0 0	709.80	-	-
中信证券	202202150000 0933	泰格医药	202 2- 02- 15	591,960.0 0	6,000.00	14	3.2 0	736.66	-	-
中信证券	202202170000 2950	爱尔眼科	202 2- 02- 17	1,330,000. 00	38,000.00	28	2.8 0	2,896.44	-	-
中信证券	202202210004	宋	202	318,000.0	20,000.00	14	3.3	408.10	-	-

	0251	城演艺	2-02-21	0			0			
中信证券	2022022100042839	乐普医疗	2022-02-21	1,038,240.00	48,000.00	14	2.70	1,090.15	-	-
中信证券	2022022100042841	温氏股份	2022-02-21	475,410.00	23,000.00	14	2.90	536.16	-	-
中信证券	2022022100042863	爱尔眼科	2022-02-21	207,060.00	6,000.00	14	2.90	233.52	-	-
中信证券	2022022100042885	爱尔眼科	2022-02-21	1,597,813.00	46,300.00	14	2.90	1,801.98	-	-
中信证券	2022022100042887	宋城演艺	2022-02-21	270,300.00	17,000.00	14	2.80	294.33	-	-
中信证券	2022022100042889	爱尔眼科	2022-02-21	1,311,380.00	38,000.00	14	2.90	1,478.95	-	-
中信证券	2022022100045471	沃森生物	2022-02-21	3,614,373.00	72,100.00	14	1.80	2,530.06	-	-
中信证券	2022022100045475	东方财富	2022-02-21	5,760,845.00	220,300.00	14	1.80	4,032.59	-	-
中信证券	2022022100045477	智飞生物	2022-02-21	4,057,203.00	32,300.00	14	1.80	2,840.04	-	-
中信证券	2022022100045489	爱尔眼科	2022-02-21	3,188,724.00	92,400.00	14	1.80	2,232.11	-	-
中信证券	2022022200001301	华大基因	2022-02-22	684,560.00	8,000.00	14	3.00	798.65	-	-
中信证券	2022022200012001	阳光电源	2022-02-22	322,950.00	3,000.00	14	2.70	339.10	-	-

中信证券	20220220001 3167	爱尔眼科	202 2- 02- 22	647,140.0 0	19,000.00	14	1.8 0	453.00	-	-
中信证券	20220220001 3169	健帆生物	202 2- 02- 22	184,960.0 0	4,000.00	14	1.8 0	129.47	-	-
中信证券	20220220001 3171	迈瑞医疗	202 2- 02- 22	635,400.0 0	2,000.00	14	1.8 0	444.78	-	-
中信证券	20220220001 3173	乐普医疗	202 2- 02- 22	234,080.0 0	11,000.00	14	1.8 0	163.86	-	-
中信证券	202202230001 3358	宋城演艺	202 2- 02- 23	157,488.0 0	10,200.00	28	2.7 0	330.72	-	-
中信证券	202202230001 3360	智飞生物	202 2- 02- 23	617,100.0 0	5,100.00	28	1.9 0	911.94	-	-
中信证券	202202230001 3362	传音控股	202 2- 02- 23	210,528.0 0	1,600.00	28	1.9 0	311.11	-	-
中信证券	202202230001 3364	三环集团	202 2- 02- 23	291,911.0 0	8,300.00	28	1.8 0	408.68	-	-
中信证券	202202230001 3366	欧普康视	202 2- 02- 23	132,256.0 0	3,200.00	28	2.3 0	236.59	-	-
中信证券	202202230001 3368	贝达药业	202 2- 02- 23	96,528.00	1,600.00	28	3.0 0	225.23	-	-
中信证券	202202230001 3370	爱尔眼科	202 2- 02- 23	593,916.0 0	17,200.00	28	2.8 0	1,293.42	-	-
中信证券	202202230001 3372	华熙生物	202 2- 02- 23	119,900.0 0	1,000.00	28	2.8 0	261.12	-	-
中信证券	202202230001 3374	同花顺	202 2- 02- 23	141,557.0 0	1,300.00	28	2.3 0	253.23	-	-

中信证券	202202230001 3376	芒果超媒	2022-02-23	158,580.00	4,500.00	28	2.60	320.68	-	-
中信证券	202202230001 3378	先导智能	2022-02-23	455,749.00	7,100.00	28	2.00	708.94	-	-
中信证券	202202230001 3380	亿联网络	2022-02-23	173,949.00	2,300.00	28	2.00	270.59	-	-
中信证券	202202230001 3382	康泰生物	2022-02-23	223,992.00	2,700.00	28	2.20	383.28	-	-
中信证券	202202230001 3384	澜起科技	2022-02-23	237,210.00	3,000.00	28	1.80	332.09	-	-
中信证券	202202230001 3386	健帆生物	2022-02-23	145,421.00	3,100.00	28	2.80	316.69	-	-
中信证券	202202230001 3388	蓝思科技	2022-02-23	187,364.00	12,400.00	28	2.10	306.03	-	-
中信证券	202202230001 3390	温氏股份	2022-02-23	571,377.00	28,300.00	28	2.80	1,244.33	-	-
中信证券	202202230001 3392	中国通号	2022-02-23	81,997.00	16,700.00	28	2.20	140.31	-	-
中信证券	202202230001 3394	泰格医药	2022-02-23	341,870.00	3,400.00	28	1.90	505.21	-	-
中信证券	202202230001 3396	沪硅产业	2022-02-23	114,384.00	4,800.00	28	3.00	266.90	-	-
中信证券	202202230001 3398	华大基因	2022-02-23	138,416.00	1,600.00	28	2.90	312.20	-	-
中信证券	202202230001 3406	阳光电	2022-02-23	760,512.00	6,800.00	28	2.60	1,537.92	-	-

中信证券	2022022300013408	源沃森生物	2022-02-23	495,910.00	10,100.00	28	2.30	887.13	-	-
中信证券	2022022300013410	华润微	2022-02-23	104,868.00	1,800.00	28	2.10	171.28	-	-
中信证券	2022022300013412	亿纬锂能	2022-02-23	650,284.00	7,300.00	28	1.90	960.98	-	-
中信证券	2022022300013414	乐普医疗	2022-02-23	177,120.00	8,200.00	28	2.60	358.18	-	-
中信证券	2022022300013416	中微公司	2022-02-23	207,680.00	1,600.00	28	1.80	290.75	-	-
中信证券	2022022300013418	英科医疗	2022-02-23	130,475.00	2,500.00	28	3.10	314.59	-	-
中信证券	2022022300013420	金山办公	2022-02-23	263,160.00	1,200.00	28	2.10	429.83	-	-
中信证券	2022022300013422	东方财富	2022-02-23	1,356,960.00	51,400.00	28	3.20	3,377.32	-	-
中信证券	2022022300013424	汇川技术	2022-02-23	755,001.00	11,700.00	28	2.40	1,409.34	-	-
中信证券	2022022400000802	康泰生物	2022-02-24	161,340.00	2,000.00	28	2.70	338.81	-	-
中信证券	2022022400000816	金龙鱼	2022-02-24	876,792.00	16,800.00	14	3.10	1,057.02	-	-
中信证券	2022022400012435	宋城演艺	2022-02-24	1,452,480.00	96,000.00	14	3.30	1,864.02	-	-
中信证券	2022022400012441	安克创	2022-02-	1,958,400.00	20,400.00	14	3.50	2,665.60	-	-

		新	24							
中信证券	202202250001 7909	汇 川 技 术	202 2- 02- 25	63,700.00	1,000.00	14	1.8 0	44.59	-	-
中信证券	202202250001 7911	蓝 思 科 技	202 2- 02- 25	24,973.00	1,700.00	14	1.8 0	17.48	-	-
中信证券	202202250001 7925	爱 尔 眼 科	202 2- 02- 25	5,307,000. 00	150,000.0 0	14	3.1 0	6,397.88	-	-
中信证券	202203010000 1292	英 科 医 疗	202 2- 03- 01	51,020.00	1,000.00	14	2.8 0	55.56	-	-
中信证券	202203010000 1314	宋 城 演 艺	202 2- 03- 01	203,580.0 0	13,000.00	14	1.9 0	150.42	-	-
中信证券	202203030000 1512	宁 德 时 代	202 2- 03- 03	25,649,50 0.00	50,000.00	14	3.5 0	34,911.82	-	-
中信证券	202203070003 8368	爱 尔 眼 科	202 2- 03- 07	3,016,860. 00	92,400.00	14	1.8 0	2,111.80	-	-
中信证券	202203070003 8372	东 方 财 富	202 2- 03- 07	5,481,064. 00	220,300.0 0	14	1.8 0	3,836.74	-	-
中信证券	202203070004 4310	智 飞 生 物	202 2- 03- 07	3,938,339. 00	32,300.00	14	1.8 0	2,756.84	-	-
中信证券	202203070004 4394	宋 城 演 艺	202 2- 03- 07	290,000.0 0	20,000.00	14	1.9 0	214.28	-	-
中信证券	202203070004 4396	宋 城 演 艺	202 2- 03- 07	246,500.0 0	17,000.00	14	1.9 0	182.14	-	-
中信证券	202203070004 4398	爱 尔 眼 科	202 2- 03- 07	195,900.0 0	6,000.00	14	2.4 0	182.84	-	-
中信证券	202203080001 3136	华 大	202 2-	615,360.0 0	8,000.00	14	3.2 0	765.78	-	-

		基因	03-08							
中信证券	2022030800013138	阳光电源	2022-03-08	380,700.00	3,000.00	14	2.90	429.35	-	-
中信证券	2022030800013738	健帆生物	2022-03-08	169,360.00	4,000.00	14	1.80	118.55	-	-
中信证券	2022030800013740	爱尔眼科	2022-03-08	627,190.00	19,000.00	14	1.80	439.03	-	-
中信证券	2022030800013744	迈瑞医疗	2022-03-08	593,040.00	2,000.00	14	1.80	415.13	-	-
中信证券	2022030800015568	乐普医疗	2022-03-08	213,400.00	11,000.00	14	1.80	149.38	-	-
中信证券	2022031000013196	宋城演艺	2022-03-10	186,399.00	13,900.00	28	1.80	260.96	-	-
中信证券	2022031000013198	健帆生物	2022-03-10	181,440.00	4,200.00	28	3.00	423.36	-	-
中信证券	2022031000013200	芒果超媒	2022-03-10	189,596.00	6,200.00	28	1.80	265.43	-	-
中信证券	2022031000013202	卓胜微	2022-03-10	846,000.00	3,600.00	28	3.10	2,039.80	-	-
中信证券	2022031000013204	奇安信	2022-03-10	497,600.00	8,000.00	28	1.80	696.64	-	-
中信证券	2022031000013206	爱尔眼科	2022-03-10	756,144.00	23,600.00	28	2.30	1,352.66	-	-
中信证券	2022031000013208	华熙生物	2022-03-10	112,540.00	1,000.00	28	2.20	192.57	-	-
中信证券	2022031000013210	亿联	2022-	245,952.00	3,200.00	28	1.80	344.33	-	-

		网络	03-10							
中信证券	2022031000013212	华润微	2022-03-10	133,296.00	2,400.00	28	3.00	311.02	-	-
中信证券	2022031000013214	沪硅产业	2022-03-10	168,300.00	6,600.00	28	5.00	654.50	-	-
中信证券	2022031000013216	天合光能	2022-03-10	1,015,956.00	13,800.00	28	4.40	3,476.83	-	-
中信证券	2022031000013218	康龙化成	2022-03-10	599,583.00	5,700.00	28	3.10	1,445.66	-	-
中信证券	2022031000013220	亿纬锂能	2022-03-10	751,500.00	10,000.00	28	2.60	1,519.70	-	-
中信证券	2022031000013222	宁德时代	2022-03-10	6,331,449.00	12,900.00	28	3.10	15,265.83	-	-
中信证券	2022031000013224	金山办公	2022-03-10	319,600.00	1,700.00	28	2.90	720.88	-	-
中信证券	2022031000013226	中芯国际	2022-03-10	1,386,348.00	27,600.00	28	1.60	1,725.23	-	-
中信证券	2022031000013228	同花顺	2022-03-10	175,086.00	1,800.00	28	2.80	381.30	-	-
中信证券	2022031000013230	贝达药业	2022-03-10	118,448.00	2,200.00	28	1.90	175.04	-	-
中信证券	2022031000013232	欧普康视	2022-03-10	159,060.00	4,400.00	28	2.00	247.43	-	-
中信证券	2022031000013234	阳光电源	2022-03-10	1,199,793.00	9,300.00	28	2.80	2,612.88	-	-
中信证券	2022031000013236	金龙	2022-	639,699.00	12,700.00	28	3.00	1,492.63	-	-

		鱼	03-10							
中信证券	2022031000013238	华大基因	2022-03-10	177,210.00	2,200.00	28	3.10	427.27	-	-
中信证券	2022031000013240	迈瑞医疗	2022-03-10	1,724,862.00	5,800.00	28	1.90	2,548.96	-	-
中信证券	2022031000013242	爱美客	2022-03-10	898,700.00	1,900.00	28	2.60	1,817.37	-	-
中信证券	2022031000013244	英科医疗	2022-03-10	159,256.00	3,400.00	28	2.70	334.44	-	-
中信证券	2022031000013246	安克创新	2022-03-10	488,899.00	6,700.00	28	3.30	1,254.84	-	-
中信证券	2022031000013248	稳健医疗	2022-03-10	549,680.00	8,000.00	28	3.30	1,410.85	-	-
中信证券	2022031000013250	智飞生物	2022-03-10	835,660.00	7,000.00	28	2.50	1,624.89	-	-
中信证券	2022031000013252	康泰生物	2022-03-10	267,991.00	3,700.00	28	2.10	437.72	-	-
中信证券	2022031000013254	蓝思科技	2022-03-10	218,960.00	17,000.00	28	2.00	340.60	-	-
中信证券	2022031000013256	晶盛机电	2022-03-10	849,555.00	13,500.00	28	2.80	1,850.14	-	-
中信证券	2022031000013258	温氏股份	2022-03-10	761,616.00	38,700.00	28	2.70	1,599.39	-	-
中信证券	2022031000013260	三环集团	2022-03-10	359,566.00	11,300.00	28	1.90	531.36	-	-
中信证券	2022031000013262	先导	2022-	571,136.00	9,700.00	28	2.40	1,066.12	-	-

		智能	03-10							
中信证券	2022031000013264	沃森生物	2022-03-10	584,568.00	13,800.00	28	2.40	1,091.19	-	-
中信证券	2022031000013266	泰格医药	2022-03-10	404,670.00	4,700.00	28	2.20	692.44	-	-
中信证券	2022031000013272	东方财富	2022-03-10	1,728,320.00	70,400.00	28	2.10	2,822.92	-	-
中信证券	2022031000013274	中微公司	2022-03-10	277,420.00	2,200.00	28	3.00	647.31	-	-
中信证券	2022031000013276	中国通号	2022-03-10	106,256.00	22,900.00	28	1.80	148.76	-	-
中信证券	2022031000013278	澜起科技	2022-03-10	302,498.00	4,100.00	28	2.00	470.55	-	-
中信证券	2022031000013280	传音控股	2022-03-10	255,200.00	2,200.00	28	2.70	535.92	-	-
中信证券	2022031000013282	金龙鱼	2022-03-10	846,216.00	16,800.00	14	3.10	1,020.16	-	-
中信证券	2022031000013286	安克创新	2022-03-10	1,488,588.00	20,400.00	14	3.40	1,968.24	-	-
中信证券	2022031000013320	乐普医疗	2022-03-10	212,576.00	11,200.00	28	2.80	462.94	-	-
中信证券	2022031000013322	汇川技术	2022-03-10	924,960.00	16,000.00	28	2.10	1,510.77	-	-
中信证券	2022031100017348	蓝思科技	2022-03-11	22,066.00	1,700.00	14	1.80	15.45	-	-
中信证券	2022031100020392	汇	2022-	58,180.00	1,000.00	14	1.80	40.73	-	-

		川技术	03-11							
中信证券	2022031400006184	贝达药业	2022-03-14	289,172.00	5,200.00	28	2.80	629.75	-	-
中信证券	2022031500011423	宋城演艺	2022-03-15	159,250.00	13,000.00	14	3.30	204.37	-	-
中信证券	2022031500011425	英科医疗	2022-03-15	47,320.00	1,000.00	14	3.30	60.73	-	-
中信证券	2022032100030575	爱尔眼科	2022-03-21	2,632,476.00	92,400.00	14	1.80	2,105.98	-	-
中信证券	2022032100034915	智飞生物	2022-03-21	4,566,897.00	32,300.00	14	1.80	3,653.52	-	-
中信证券	2022032100034927	宋城演艺	2022-03-21	280,800.00	20,000.00	14	3.00	374.40	-	-
中信证券	2022032100034969	爱尔眼科	2022-03-21	170,940.00	6,000.00	14	1.40	106.37	-	-
中信证券	2022032100037157	宋城演艺	2022-03-21	238,680.00	17,000.00	14	3.00	318.24	-	-
中信证券	2022032200000969	宋城演艺	2022-03-22	1,962,225.00	142,500.00	14	3.30	2,698.06	-	-
中信证券	2022032200013435	乐普医疗	2022-03-22	229,900.00	11,000.00	14	1.80	172.43	-	-
中信证券	2022032200013517	迈瑞医疗	2022-03-22	609,160.00	2,000.00	14	1.80	456.87	-	-
中信证券	2022032200013519	健帆生物	2022-03-22	180,000.00	4,000.00	14	1.80	135.00	-	-

中信证券	202203220001 3525	爱尔眼科	202 2- 03- 22	532,570.0 0	19,000.00	14	1.8 0	399.43	-	-
中信证券	202203220001 4135	阳光电源	202 2- 03- 22	340,230.0 0	3,000.00	14	2.2 0	311.88	-	-
中信证券	202203220001 4137	华大基因	202 2- 03- 22	673,680.0 0	8,000.00	14	3.5 0	982.45	-	-
中信证券	202203230001 2325	东方财富	202 2- 03- 23	1,297,850. 00	51,400.00	28	1.7 0	1,716.05	-	-
中信证券	202203230001 2327	英科医疗	202 2- 03- 23	118,250.0 0	2,500.00	28	3.1 0	285.11	-	-
中信证券	202203230001 2329	金山办公	202 2- 03- 23	228,108.0 0	1,200.00	28	2.3 0	408.06	-	-
中信证券	202203230001 2331	亿纬锂能	202 2- 03- 23	605,900.0 0	7,300.00	28	2.1 0	989.64	-	-
中信证券	202203230001 2333	沃森生物	202 2- 03- 23	589,436.0 0	10,100.00	28	1.4 0	641.83	-	-
中信证券	202203230001 2335	贝达药业	202 2- 03- 23	89,184.00	1,600.00	28	2.5 0	173.41	-	-
中信证券	202203230001 2337	华润微	202 2- 03- 23	107,640.0 0	1,800.00	28	2.8 0	234.42	-	-
中信证券	202203230001 2339	阳光电源	202 2- 03- 23	780,164.0 0	6,800.00	28	2.1 0	1,274.27	-	-
中信证券	202203230001 2341	乐普医疗	202 2- 03- 23	174,004.0 0	8,200.00	28	3.1 0	419.54	-	-
中信证券	202203230001 2343	中微公司	202 2- 03- 23	191,152.0 0	1,600.00	28	1.9 0	282.48	-	-

中信证券	202203230001 2345	亿 联 网 络	202 2- 03- 23	175,651.0 0	2,300.00	28	2.9 0	396.19	-	-
中信证券	202203230001 2347	沪 硅 产 业	202 2- 03- 23	118,896.0 0	4,800.00	28	2.5 0	231.19	-	-
中信证券	202203230001 2349	同 花 顺	202 2- 03- 23	126,386.0 0	1,300.00	28	3.1 0	304.73	-	-
中信证券	202203230001 2351	先 导 智 能	202 2- 03- 23	429,834.0 0	7,100.00	28	1.9 0	635.20	-	-
中信证券	202203230001 2353	芒 果 超 媒	202 2- 03- 23	142,920.0 0	4,500.00	28	3.0 0	333.48	-	-
中信证券	202203230001 2355	华 大 基 因	202 2- 03- 23	135,024.0 0	1,600.00	28	3.4 0	357.06	-	-
中信证券	202203230001 2357	汇 川 技 术	202 2- 03- 23	669,825.0 0	11,700.00	28	1.9 0	989.85	-	-
中信证券	202203230001 2359	欧 普 康 视	202 2- 03- 23	119,904.0 0	3,200.00	28	3.2 0	298.43	-	-
中信证券	202203230001 2361	传 音 控 股	202 2- 03- 23	162,400.0 0	1,600.00	28	2.1 0	265.25	-	-
中信证券	202203230001 3633	智 飞 生 物	202 2- 03- 23	686,205.0 0	5,100.00	28	1.0 0	533.72	-	-
中信证券	202203230001 3635	三 环 集 团	202 2- 03- 23	254,146.0 0	8,300.00	28	2.7 0	533.71	-	-
中信证券	202203230001 3637	宋 城 演 艺	202 2- 03- 23	139,638.0 0	10,200.00	28	2.9 0	314.96	-	-
中信证券	202203230001 3639	华 熙 生 物	202 2- 03- 23	116,840.0 0	1,000.00	28	2.8 0	254.45	-	-

中信证券	202203230001 3645	澜起科技	2022-03-23	220,350.00	3,000.00	28	1.90	325.63	-	-
中信证券	202203230001 3647	健帆生物	2022-03-23	140,895.00	3,100.00	28	3.10	339.71	-	-
中信证券	202203230001 3649	康泰生物	2022-03-23	234,549.00	2,700.00	28	2.90	529.04	-	-
中信证券	202203230001 3651	泰格医药	2022-03-23	344,828.00	3,400.00	28	0.90	241.38	-	-
中信证券	202203230001 3653	爱尔眼科	2022-03-23	511,356.00	17,200.00	28	1.30	517.04	-	-
中信证券	202203230001 3655	温氏股份	2022-03-23	615,808.00	28,300.00	28	1.30	622.65	-	-
中信证券	202203230001 3657	蓝思科技	2022-03-23	151,776.00	12,400.00	28	2.20	259.71	-	-
中信证券	202203230001 3659	中国通号	2022-03-23	75,150.00	16,700.00	28	2.60	151.97	-	-
中信证券	202203240000 0822	乐普医疗	2022-03-24	320,850.00	15,000.00	28	3.20	798.56	-	-
中信证券	202203240000 0858	温氏股份	2022-03-24	1,089,000.00	50,000.00	28	1.40	1,185.80	-	-
中信证券	202203240001 0529	康泰生物	2022-03-24	185,320.00	2,000.00	28	2.90	418.00	-	-
中信证券	202203240001 0533	金龙鱼	2022-03-24	823,200.00	16,800.00	14	3.30	1,056.44	-	-
中信证券	202203240001 0535	安克创新	2022-03-24	1,493,484.00	20,400.00	14	3.00	1,742.40	-	-

中信证券	202203250001 5822	蓝 思 科 技	202 2- 03- 25	19,941.00	1,700.00	14	1.8 0	13.96	-	-
中信证券	202203250001 5836	汇 川 技 术	202 2- 03- 25	54,830.00	1,000.00	14	1.8 0	38.38	-	-
中信证券	202203290000 5746	英 科 医 疗	202 2- 03- 29	46,600.00	1,000.00	14	3.4 0	61.62	-	-
中信证券	202203290000 5750	宋 城 演 艺	202 2- 03- 29	171,340.0 0	13,000.00	14	3.3 0	219.89	-	-
中信证券	202203290000 5860	同 花 顺	202 2- 03- 10	3,240.00	-	28	2.8 0	-	-	-
中信证券	202203290000 5942	同 花 顺	202 2- 03- 23	2,340.00	-	28	3.1 0	-	-	-
中信证券	202203310000 0914	蓝 思 科 技	202 2- 03- 31	115,533.0 0	9,900.00	28	1.8 0	161.75	-	-
中信证券	202203310000 0923	乐 普 医 疗	202 2- 03- 31	123,037.0 0	6,100.00	28	1.8 0	172.25	-	-
中信证券	202203310000 0930	先 导 智 能	202 2- 03- 31	946,728.0 0	16,200.00	28	1.8 0	1,325.42	-	-
中信证券	202203310000 0987	沃 森 生 物	202 2- 03- 31	411,525.0 0	7,500.00	28	1.8 0	576.14	-	-
中信证券	202203310000 1121	三 环 集 团	202 2- 03- 31	159,543.0 0	5,700.00	28	1.8 0	223.36	-	-
中信证券	202204060005 0773	宋 城 演 艺	202 2- 04- 06	278,000.0 0	20,000.00	14	3.3 0	356.77	-	-
中信证券	202204060005 0775	宋 城 演 艺	202 2- 04- 06	236,300.0 0	17,000.00	14	3.3 0	303.25	-	-

中信证券	202204060005 0777	爱尔眼科	202 2- 04- 06	190,200.0 0	6,000.00	14	2.8 0	207.11	-	-
中信证券	202204060005 0779	阳光电源	202 2- 04- 06	307,740.0 0	3,000.00	14	3.1 0	371.00	-	-
中信证券	202204060005 0781	宋城演艺	202 2- 04- 06	1,980,750.0 00	142,500.0 0	14	3.3 0	2,541.96	-	-
中信证券	202204060005 0783	华大基因	202 2- 04- 06	654,480.0 0	8,000.00	14	3.4 0	865.37	-	-
中信证券	202204060005 6293	健帆生物	202 2- 04- 06	185,560.0 0	4,000.00	14	1.8 0	129.89	-	-
中信证券	202204060005 6299	迈瑞医疗	202 2- 04- 06	602,920.0 0	2,000.00	14	1.8 0	422.04	-	-
中信证券	202204060005 6301	乐普医疗	202 2- 04- 06	220,000.0 0	11,000.00	14	1.8 0	154.00	-	-
中信证券	202204060005 6307	爱尔眼科	202 2- 04- 06	602,300.0 0	19,000.00	14	1.8 0	421.61	-	-
中信证券	202204060005 6311	智飞生物	202 2- 04- 06	4,406,366.0 00	32,300.00	14	1.8 0	3,084.46	-	-
中信证券	202204060005 9899	爱尔眼科	202 2- 04- 06	2,929,080.0 00	92,400.00	14	1.8 0	2,050.36	-	-
中信证券	202204070001 3972	健帆生物	202 2- 04- 07	192,276.0 0	4,200.00	28	3.2 0	478.55	-	-
中信证券	202204070001 3974	芒果超媒	202 2- 04- 07	194,680.0 0	6,200.00	28	3.2 0	484.54	-	-
中信证券	202204070001 3976	宋城演	202 2- 04- 07	187,650.0 0	13,900.00	28	3.2 0	467.04	-	-

		艺								
中信证券	2022040700013978	卓胜微	2022-04-07	721,764.00	3,600.00	28	3.20	1,796.39	-	-
中信证券	2022040700013980	澜起科技	2022-04-07	240,342.00	4,100.00	28	1.20	224.32	-	-
中信证券	2022040700013982	汇川技术	2022-04-07	886,720.00	16,000.00	28	2.00	1,379.34	-	-
中信证券	2022040700013984	传音控股	2022-04-07	203,280.00	2,200.00	28	2.40	379.46	-	-
中信证券	2022040700013986	英科医疗	2022-04-07	155,652.00	3,400.00	28	3.20	387.40	-	-
中信证券	2022040700013988	爱尔眼科	2022-04-07	749,300.00	23,600.00	28	2.70	1,573.53	-	-
中信证券	2022040700013990	华熙生物	2022-04-07	113,710.00	1,000.00	28	3.10	274.17	-	-
中信证券	2022040700013992	迈瑞医疗	2022-04-07	1,759,720.00	5,800.00	28	3.10	4,242.88	-	-
中信证券	2022040700013994	爱美客	2022-04-07	910,100.00	1,900.00	28	3.10	2,194.35	-	-
中信证券	2022040700013996	亿联网络	2022-04-07	238,976.00	3,200.00	28	3.00	557.61	-	-
中信证券	2022040700013998	宁德时代	2022-04-07	6,388,338.00	12,900.00	28	3.10	15,402.99	-	-
中信证券	2022040700014000	金山办公	2022-04-07	306,476.00	1,700.00	28	2.60	619.76	-	-
中信证券	2022040700014002	奇安信	2022-04-	462,160.00	8,000.00	28	2.90	1,042.43	-	-

			07							
中信证券	202204070001 4004	康 龙 化 成	202 2- 04- 07	649,857.0 0	5,700.00	28	3.1 0	1,566.88	-	-
中信证券	202204070001 4006	亿 纬 锂 能	202 2- 04- 07	746,800.0 0	10,000.00	28	3.0 0	1,742.53	-	-
中信证券	202204070001 4008	华 润 微	202 2- 04- 07	126,816.0 0	2,400.00	28	2.4 0	236.72	-	-
中信证券	202204070001 4010	沪 硅 产 业	202 2- 04- 07	145,134.0 0	6,600.00	28	3.4 0	383.80	-	-
中信证券	202204070001 4012	天 合 光 能	202 2- 04- 07	721,740.0 0	13,800.00	28	4.0 0	2,245.41	-	-
中信证券	202204070001 4014	阳 光 电 源	202 2- 04- 07	942,555.0 0	9,300.00	28	3.0 0	2,199.30	-	-
中信证券	202204070001 4016	华 大 基 因	202 2- 04- 07	174,790.0 0	2,200.00	28	3.3 0	448.63	-	-
中信证券	202204070001 4018	金 龙 鱼	202 2- 04- 07	609,727.0 0	12,700.00	28	3.1 0	1,470.12	-	-
中信证券	202204070001 4020	同 花 顺	202 2- 04- 07	167,490.0 0	1,800.00	28	3.2 0	416.86	-	-
中信证券	202204070001 4022	中 芯 国 际	202 2- 04- 07	1,251,384. 00	27,600.00	28	1.4 0	1,362.62	-	-
中信证券	202204070001 4024	欧 普 康 视	202 2- 04- 07	153,648.0 0	4,400.00	28	3.2 0	382.41	-	-
中信证券	202204070001 4026	贝 达 药 业	202 2- 04- 07	118,668.0 0	2,200.00	28	3.2 0	295.35	-	-
中信证券	202204070001 4028	乐 普 医 疗	202 2- 04- 07	216,048.0 0	11,200.00	28	3.2 0	537.72	-	-

中信证券	202204070001 4030	稳健 医疗	202 2- 04- 07	484,400.0 0	8,000.00	28	3.3 0	1,243.29	-	-
中信证券	202204070001 4032	智飞 生物	202 2- 04- 07	924,840.0 0	7,000.00	28	2.5 0	1,798.30	-	-
中信证券	202204070001 4034	安克 创新	202 2- 04- 07	431,480.0 0	6,700.00	28	3.2 0	1,073.91	-	-
中信证券	202204070001 4036	中国 通号	202 2- 04- 07	103,737.0 0	22,900.00	28	2.6 0	209.78	-	-
中信证券	202204070001 4038	蓝思 科技	202 2- 04- 07	190,230.0 0	17,000.00	28	3.2 0	473.46	-	-
中信证券	202204070001 4040	康泰 生物	202 2- 04- 07	322,270.0 0	3,700.00	28	3.3 0	827.16	-	-
中信证券	202204070001 4042	三环 集团	202 2- 04- 07	311,654.0 0	11,300.00	28	3.1 0	751.43	-	-
中信证券	202204070001 4044	晶盛 机电	202 2- 04- 07	754,380.0 0	13,500.00	28	2.8 0	1,642.87	-	-
中信证券	202204070001 4046	先导 智能	202 2- 04- 07	519,920.0 0	9,700.00	28	2.9 0	1,172.71	-	-
中信证券	202204070001 4048	温氏 股份	202 2- 04- 07	827,793.0 0	38,700.00	28	2.6 0	1,673.98	-	-
中信证券	202204070001 4050	东方 财富	202 2- 04- 07	1,795,200. 00	70,400.00	28	2.4 0	3,351.04	-	-
中信证券	202204070001 4052	中微 公司	202 2- 04- 07	251,460.0 0	2,200.00	28	1.4 0	273.81	-	-
中信证券	202204070001 4054	沃森 生	202 2- 04- 07	787,980.0 0	13,800.00	28	2.4 0	1,470.90	-	-

中信证券	2022040700014056	物泰格医药	2022-04-07	486,356.00	4,700.00	28	2.20	832.21	-	-
中信证券	2022040700014070	安克创新	2022-04-07	1,313,760.00	20,400.00	14	3.30	1,685.99	-	-
中信证券	2022040700014072	金龙鱼	2022-04-07	806,568.00	16,800.00	14	3.20	1,003.73	-	-
中信证券	2022040800015423	汇川技术	2022-04-08	56,040.00	1,000.00	14	1.80	39.23	-	-
中信证券	2022040800015429	蓝思科技	2022-04-08	18,938.00	1,700.00	14	1.80	13.26	-	-
中信证券	2022041500005444	爱美客	2022-04-07	3,990.00	-	28	3.10	-	-	-
中信证券	2022041900003974	东方财富	2022-04-07	5,632.00	-	28	2.40	-	-	-
中信证券	2022041900004196	东方财富	2022-03-23	4,112.00	-	28	1.70	-	-	-
中信证券	2022041900004208	东方财富	2022-03-23	-	10,280.00	28	1.70	-	-	-
中信证券	2022041900004296	东方财富	2022-04-07	-	14,080.00	28	2.40	-	-	-
中信证券	2022042000039098	健帆生物	2022-04-20	174,360.00	4,000.00	14	1.80	130.77	-	-
中信证券	2022042000039158	欧普康视	2022-04-20	111,840.00	3,200.00	28	3.10	269.66	-	-
中信证券	2022042000039160	汇川技	2022-04-	621,855.00	11,700.00	28	3.60	1,741.19	-	-

		术	20							
中信证券	202204200003 9162	传音控股	202 2- 04- 20	143,152.0 0	1,600.00	28	2.3 0	256.08	-	-
中信证券	202204200004 9586	华润微	202 2- 04- 20	87,570.00	1,800.00	28	3.7 0	252.01	-	-
中信证券	202204200004 9588	中国通号	202 2- 04- 20	73,981.00	16,700.00	28	2.9 0	166.87	-	-
中信证券	202204200004 9590	智飞生物	202 2- 04- 20	548,199.0 0	5,100.00	28	2.0 0	852.75	-	-
中信证券	202204200004 9592	蓝思科技	202 2- 04- 20	131,936.0 0	12,400.00	28	2.0 0	205.23	-	-
中信证券	202204200004 9594	爱尔眼科	202 2- 04- 20	579,296.0 0	17,200.00	28	2.9 0	1,306.63	-	-
中信证券	202204200004 9596	泰格医药	202 2- 04- 20	329,426.0 0	3,400.00	28	3.4 0	871.15	-	-
中信证券	202204200004 9598	温氏股份	202 2- 04- 20	615,808.0 0	28,300.00	28	3.4 0	1,628.47	-	-
中信证券	202204200004 9600	康泰生物	202 2- 04- 20	205,740.0 0	2,700.00	28	3.0 0	480.06	-	-
中信证券	202204200004 9602	澜起科技	202 2- 04- 20	179,490.0 0	3,000.00	28	2.6 0	362.97	-	-
中信证券	202204200004 9604	健帆生物	202 2- 04- 20	135,129.0 0	3,100.00	28	3.0 0	315.30	-	-
中信证券	202204200004 9606	三环集团	202 2- 04- 20	233,645.0 0	8,300.00	28	3.6 0	654.21	-	-
中信证券	202204200004 9608	华熙	202 2- 04-	117,430.0 0	1,000.00	28	3.0 0	274.00	-	-

		生物	20							
中信证券	202204200004 9610	宋城 演艺	202 2- 04- 20	146,472.0 0	10,200.00	28	3.5 0	398.73	-	-
中信证券	202204200004 9612	贝达 药业	202 2- 04- 20	74,672.00	1,600.00	28	2.6 0	151.00	-	-
中信证券	202204200004 9614	亿纬 锂能	202 2- 04- 20	493,480.0 0	7,300.00	28	2.9 0	1,113.07	-	-
中信证券	202204200004 9616	沃森 生物	202 2- 04- 20	576,508.0 0	10,100.00	28	2.5 0	1,120.99	-	-
中信证券	202204200004 9618	东方 财富	202 2- 04- 20	1,059,354. 00	51,400.00	28	1.2 0	988.73	-	-
中信证券	202204200004 9620	英科 医疗	202 2- 04- 20	106,325.0 0	2,500.00	28	3.4 0	281.17	-	-
中信证券	202204200004 9622	金山 办公	202 2- 04- 20	218,160.0 0	1,200.00	28	1.9 0	322.39	-	-
中信证券	202204200004 9628	先导 智能	202 2- 04- 20	332,990.0 0	7,100.00	28	0.9 0	233.09	-	-
中信证券	202204200004 9630	宋城 演艺	202 2- 04- 20	287,200.0 0	20,000.00	14	3.6 0	430.80	-	-
中信证券	202204200004 9632	爱尔 眼科	202 2- 04- 20	202,080.0 0	6,000.00	14	3.0 0	252.60	-	-
中信证券	202204200004 9634	宋城 演艺	202 2- 04- 20	2,046,300. 00	142,500.0 0	14	3.6 0	3,069.45	-	-
中信证券	202204200004 9636	华大 基因	202 2- 04- 20	584,560.0 0	8,000.00	14	3.7 0	901.20	-	-
中信证券	202204200004	宋	202	244,120.0	17,000.00	14	3.6	366.18	-	-

	9638	城 演 艺	2- 04- 20	0			0				
中信证券	202204200004 9640	阳 光 电 源	202 2- 04- 20	490,144.0 0	6,800.00	28	3.2 0	1,219.91	-	-	
中信证券	202204200004 9642	乐 普 医 疗	202 2- 04- 20	156,456.0 0	8,200.00	28	3.2 0	389.40	-	-	
中信证券	202204200004 9644	华 大 基 因	202 2- 04- 20	116,912.0 0	1,600.00	28	3.6 0	327.35	-	-	
中信证券	202204200004 9646	沪 硅 产 业	202 2- 04- 20	107,520.0 0	4,800.00	28	3.1 0	259.24	-	-	
中信证券	202204200004 9648	同 花 顺	202 2- 04- 20	117,962.0 0	1,300.00	28	3.4 0	311.94	-	-	
中信证券	202204200004 9650	中 微 公 司	202 2- 04- 20	169,920.0 0	1,600.00	28	2.0 0	264.32	-	-	
中信证券	202204200004 9652	芒 果 超 媒	202 2- 04- 20	133,560.0 0	4,500.00	28	3.4 0	353.19	-	-	
中信证券	202204200004 9654	亿 联 网 络	202 2- 04- 20	178,572.0 0	2,300.00	28	3.3 0	458.33	-	-	
中信证券	202204200004 9662	阳 光 电 源	202 2- 04- 20	216,240.0 0	3,000.00	14	3.3 0	297.33	-	-	
中信证券	202204200004 9870	智 飞 生 物	202 2- 04- 20	3,471,927. 00	32,300.00	14	1.8 0	2,603.95	-	-	
中信证券	202204200004 9872	爱 尔 眼 科	202 2- 04- 20	639,920.0 0	19,000.00	14	1.8 0	479.94	-	-	
中信证券	202204200004 9874	迈 瑞 医 疗	202 2- 04- 20	599,400.0 0	2,000.00	14	1.8 0	449.55	-	-	

中信证券	202204200004 9876	爱尔眼科	2022-04-20	3,112,032.00	92,400.00	14	1.80	2,334.02	-	-
中信证券	202204200004 9878	乐普医疗	2022-04-20	209,880.00	11,000.00	14	1.80	157.41	-	-
中信证券	202204210001 2761	康泰生物	2022-04-21	147,760.00	2,000.00	28	3.00	344.77	-	-
中信证券	202204210001 2763	安克创新	2022-04-21	1,182,588.00	20,400.00	14	3.70	1,701.61	-	-
中信证券	202204210001 2773	温氏股份	2022-04-21	1,035,000.00	50,000.00	28	3.40	2,737.00	-	-
中信证券	202204210001 2775	金龙鱼	2022-04-21	796,320.00	16,800.00	14	3.70	1,145.82	-	-
中信证券	202204220001 5180	蓝思科技	2022-04-22	18,360.00	1,700.00	14	1.80	12.85	-	-
中信证券	202204220001 5192	汇川技术	2022-04-22	50,430.00	1,000.00	14	1.80	35.30	-	-
中信证券	202204250000 6102	沃森生物	2022-03-31	202.50	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	202204250000 6312	沃森生物	2022-04-20	272.70	-	28	2.50	-	-	-
中信证券	202204250000 6686	沃森生物	2022-04-07	372.60	-	28	2.40	-	-	-
中信证券	202204270000 0940	同花顺	2022-04-27	921,147.00	12,300.00	14	3.40	1,217.96	-	-
中信证券	202204280000 1170	宋城演艺	2022-04-28	1,201,200.00	100,100.00	14	3.20	1,494.83	-	-

中信证券	202204280000 8964	沃森生物	202 2- 04- 28	373,725.0 0	7,500.00	28	1.8 0	523.22	-	-
中信证券	202204280000 8970	乐普医疗	202 2- 04- 28	97,966.00	6,100.00	28	1.8 0	137.15	-	-
中信证券	202204280000 8994	先导智能	202 2- 04- 28	684,288.0 0	16,200.00	28	1.8 0	958.00	-	-
中信证券	202204280000 8996	三环集团	202 2- 04- 28	140,505.0 0	5,700.00	28	1.8 0	196.71	-	-
中信证券	202204280000 8998	蓝思科技	202 2- 04- 28	90,981.00	9,900.00	28	1.8 0	127.37	-	-
中信证券	202205050005 7235	迈瑞医疗	202 2- 05- 05	633,940.0 0	2,000.00	14	1.8 0	443.76	-	-
中信证券	202205050005 7241	爱尔眼科	202 2- 05- 05	681,910.0 0	19,000.00	14	1.8 0	477.34	-	-
中信证券	202205050005 7245	乐普医疗	202 2- 05- 05	191,290.0 0	11,000.00	14	1.8 0	133.90	-	-
中信证券	202205050005 7251	健帆生物	202 2- 05- 05	170,160.0 0	4,000.00	14	1.8 0	119.11	-	-
中信证券	202205050005 8583	澜起科技	202 2- 05- 05	250,100.0 0	4,100.00	28	2.6 0	505.76	-	-
中信证券	202205050005 8585	沃森生物	202 2- 05- 05	711,804.0 0	13,800.00	28	3.0 0	1,660.88	-	-
中信证券	202205050005 8587	汇川技术	202 2- 05- 05	933,280.0 0	16,000.00	28	2.0 0	1,451.77	-	-
中信证券	202205050005 8589	智飞生物	202 2- 05- 05	686,000.0 0	7,000.00	28	2.5 0	1,333.89	-	-

中信证券	202205050005 8591	物 晶 盛 机 电	202 2- 05- 05	693,225.0 0	13,500.00	28	2.3 0	1,240.10	-	-
中信证券	202205050005 8593	阳 光 电 源	202 2- 05- 05	591,666.0 0	9,300.00	28	3.0 0	1,380.55	-	-
中信证券	202205050005 8595	宋 城 演 艺	202 2- 05- 05	170,692.0 0	13,900.00	28	3.1 0	411.56	-	-
中信证券	202205050005 8597	乐 普 医 疗	202 2- 05- 05	194,768.0 0	11,200.00	28	2.1 0	318.12	-	-
中信证券	202205050005 8601	东 方 财 富	202 2- 05- 05	1,576,960. 00	70,400.00	28	2.1 0	2,575.70	-	-
中信证券	202205050005 8603	同 花 顺	202 2- 05- 05	145,998.0 0	1,800.00	28	3.3 0	374.73	-	-
中信证券	202205050005 8605	亿 纬 锂 能	202 2- 05- 05	658,800.0 0	10,000.00	28	2.2 0	1,127.28	-	-
中信证券	202205050005 8607	爱 尔 眼 科	202 2- 05- 05	847,004.0 0	23,600.00	28	2.7 0	1,778.71	-	-
中信证券	202205050005 8609	康 泰 生 物	202 2- 05- 05	241,536.0 0	3,700.00	28	2.8 0	526.01	-	-
中信证券	202205050005 8611	宁 德 时 代	202 2- 05- 05	4,850,400. 00	12,900.00	28	3.2 0	12,072.11	-	-
中信证券	202205050005 8613	欧 普 康 视	202 2- 05- 05	163,372.0 0	4,400.00	28	2.9 0	368.49	-	-
中信证券	202205050005 8615	英 科 医 疗	202 2- 05- 05	97,614.00	3,400.00	28	2.9 0	220.17	-	-
中信证券	202205050005 8617	贝 达	202 2- 05-	96,646.00	2,200.00	28	2.3 0	172.89	-	-

		药 业	05							
中信证券	202205050005 8619	华 大 基 因	202 2- 05- 05	141,944.0 0	2,200.00	28	3.0 0	331.20	-	-
中信证券	202205050005 8621	泰 格 医 药	202 2- 05- 05	413,271.0 0	4,700.00	28	2.3 0	739.30	-	-
中信证券	202205050005 8623	亿 联 网 络	202 2- 05- 05	242,304.0 0	3,200.00	28	3.1 0	584.22	-	-
中信证券	202205050005 8625	蓝 思 科 技	202 2- 05- 05	171,190.0 0	17,000.00	28	3.2 0	426.07	-	-
中信证券	202205050005 8627	芒 果 超 媒	202 2- 05- 05	217,620.0 0	6,200.00	28	2.7 0	457.00	-	-
中信证券	202205050005 8629	健 帆 生 物	202 2- 05- 05	178,668.0 0	4,200.00	28	3.2 0	444.68	-	-
中信证券	202205050005 8631	三 环 集 团	202 2- 05- 05	323,293.0 0	11,300.00	28	2.0 0	502.90	-	-
中信证券	202205050005 8633	温 氏 股 份	202 2- 05- 05	720,981.0 0	38,700.00	28	3.3 0	1,850.52	-	-
中信证券	202205050005 8635	先 导 智 能	202 2- 05- 05	433,396.0 0	9,700.00	28	2.0 0	674.17	-	-
中信证券	202205050005 8637	卓 胜 微	202 2- 05- 05	658,152.0 0	3,600.00	28	2.6 0	1,330.93	-	-
中信证券	202205050005 8639	迈 瑞 医 疗	202 2- 05- 05	1,838,426. 00	5,800.00	28	2.2 0	3,145.75	-	-
中信证券	202205050005 8641	金 龙 鱼	202 2- 05- 05	560,959.0 0	12,700.00	28	2.7 0	1,178.01	-	-
中信证券	202205050005 8643	康 龙	202 2-	665,760.0 0	5,700.00	28	3.2 0	1,657.00	-	-

		化成	05-05							
中信证券	2022050500058645	爱美客	2022-05-05	949,981.00	1,900.00	28	2.60	1,921.07	-	-
中信证券	2022050500058647	稳健医疗	2022-05-05	463,120.00	8,000.00	28	3.40	1,224.70	-	-
中信证券	2022050500058649	安克创新	2022-05-05	381,699.00	6,700.00	28	2.10	623.44	-	-
中信证券	2022050500058651	中国通号	2022-05-05	100,989.00	22,900.00	28	2.10	164.95	-	-
中信证券	2022050500058667	中芯国际	2022-05-05	1,113,936.00	27,600.00	28	1.90	1,646.15	-	-
中信证券	2022050500058669	天合光能	2022-05-05	718,704.00	13,800.00	28	4.90	2,739.06	-	-
中信证券	2022050500058671	金山办公	2022-05-05	327,607.00	1,700.00	28	2.20	560.57	-	-
中信证券	2022050500065391	传音控股	2022-05-05	185,900.00	2,200.00	28	2.70	390.39	-	-
中信证券	2022050500065393	中微公司	2022-05-05	229,350.00	2,200.00	28	2.40	428.12	-	-
中信证券	2022050500065395	沪硅产业	2022-05-05	139,590.00	6,600.00	28	5.90	640.56	-	-
中信证券	2022050500065397	华熙生物	2022-05-05	133,000.00	1,000.00	28	3.20	331.02	-	-
中信证券	2022050500065401	奇安信	2022-05-05	394,800.00	8,000.00	28	4.30	1,320.39	-	-
中信证券	2022050500065403	华润	2022-	116,328.00	2,400.00	28	3.10	280.48	-	-

		微	05-05							
中信证券	2022050500068693	智飞生物	2022-05-05	3,165,400.00	32,300.00	14	1.80	2,215.78	-	-
中信证券	2022050500068695	爱尔眼科	2022-05-05	3,316,236.00	92,400.00	14	1.80	2,321.37	-	-
中信证券	2022050500070539	宋城演艺	2022-05-05	208,760.00	17,000.00	14	3.20	259.79	-	-
中信证券	2022050500070541	爱尔眼科	2022-05-05	215,340.00	6,000.00	14	2.80	234.48	-	-
中信证券	2022050500070543	阳光电源	2022-05-05	190,860.00	3,000.00	14	3.10	230.09	-	-
中信证券	2022050500070545	华大基因	2022-05-05	516,160.00	8,000.00	14	3.10	622.26	-	-
中信证券	2022050500070547	安克创新	2022-05-05	1,162,188.00	20,400.00	14	2.20	994.32	-	-
中信证券	2022050500070549	金龙鱼	2022-05-05	742,056.00	16,800.00	14	2.80	808.02	-	-
中信证券	2022050500074773	欧普康视	2022-05-05	642.40	-	28	2.90	-	-	-
中信证券	2022050500074911	欧普康视	2022-04-20	467.20	-	28	3.10	-	-	-
中信证券	2022050600014637	蓝思科技	2022-05-06	16,337.00	1,700.00	14	1.80	11.44	-	-
中信证券	2022050600017627	汇川技术	2022-05-06	55,810.00	1,000.00	14	1.80	39.07	-	-
中信证券	2022051000000562	爱美	2022-	509,993.00	1,100.00	14	3.60	713.99	-	-

		客	05-10							
中信证券	2022051000000564	东方财富	2022-05-10	440,994.00	20,100.00	14	1.90	325.85	-	-
中信证券	2022051000000565	安克创新	2022-05-10	404,680.00	6,700.00	14	3.70	582.29	-	-
中信证券	2022051000000566	智飞生物	2022-05-10	419,078.00	4,300.00	14	2.30	374.84	-	-
中信证券	2022051000000567	卓胜微	2022-05-10	403,128.00	2,200.00	14	3.80	595.73	-	-
中信证券	2022051000000570	沃森生物	2022-05-10	599,165.00	11,900.00	14	3.10	722.33	-	-
中信证券	2022051000000572	汇川技术	2022-05-10	468,300.00	8,400.00	14	3.30	600.99	-	-
中信证券	2022051000000574	晶盛机电	2022-05-10	418,237.00	8,300.00	14	3.50	569.27	-	-
中信证券	2022051000000577	阳光电源	2022-05-10	262,704.00	3,900.00	14	3.30	337.14	-	-
中信证券	2022051000000580	宋城演艺	2022-05-10	409,680.00	36,000.00	14	2.00	318.64	-	-
中信证券	2022051000000582	同花顺	2022-05-10	401,900.00	5,000.00	14	3.50	547.03	-	-
中信证券	2022051000000584	爱尔眼科	2022-05-10	510,682.00	15,100.00	14	3.20	635.52	-	-
中信证券	2022051000000586	乐普医疗	2022-05-10	480,396.00	25,800.00	14	2.80	523.10	-	-
中信证券	2022051000000588	亿纬	2022-05-	494,410.00	7,000.00	14	3.40	653.72	-	-

		锂能	10							
中信证券	202205100000 0590	华大基因	202 2- 05- 10	305,118.0 0	4,600.00	14	3.6 0	427.17	-	-
中信证券	202205100000 0591	泰格医药	202 2- 05- 10	457,710.0 0	5,700.00	14	2.8 0	498.40	-	-
中信证券	202205100000 0594	亿联网络	202 2- 05- 10	455,762.0 0	6,200.00	14	3.0 0	531.72	-	-
中信证券	202205100000 0596	康泰生物	202 2- 05- 10	445,536.0 0	6,800.00	14	3.1 0	537.12	-	-
中信证券	202205100000 0597	康龙化成	202 2- 05- 10	514,603.0 0	4,700.00	14	4.1 0	820.51	-	-
中信证券	202205100000 0598	迈瑞医疗	202 2- 05- 10	515,270.0 0	1,700.00	14	1.3 0	260.50	-	-
中信证券	202205100000 0600	宁德时代	202 2- 05- 10	417,087.0 0	1,100.00	14	3.2 0	519.04	-	-
中信证券	202205100000 0601	英科医疗	202 2- 05- 10	294,424.0 0	10,400.00	14	3.4 0	389.29	-	-
中信证券	202205100000 0606	欧普康视	202 2- 05- 10	510,736.0 0	13,700.00	14	3.6 0	715.03	-	-
中信证券	202205100000 0607	蓝思科技	202 2- 05- 10	367,630.0 0	37,900.00	14	3.1 0	443.20	-	-
中信证券	202205100000 0608	先导智能	202 2- 05- 10	392,400.0 0	9,000.00	14	2.1 0	320.46	-	-
中信证券	202205100000 0609	芒果超媒	202 2- 05- 10	539,010.0 0	15,900.00	14	3.2 0	670.77	-	-
中信证券	202205100000	三	202	448,385.0	16,100.00	14	2.9	505.68	-	-

	0612	环集团	2-05-10	0			0			
中信证券	2022051000000615	温氏股份	2022-05-10	467,232.00	24,800.00	14	3.10	563.27	-	-
中信证券	2022051000000616	健帆生物	2022-05-10	495,600.00	11,800.00	14	3.70	713.11	-	-
中信证券	2022051000000617	贝达药业	2022-05-10	414,129.00	9,300.00	14	2.70	434.84	-	-
中信证券	2022051000000704	沪硅产业	2022-05-10	474,652.00	21,400.00	14	2.60	479.93	-	-
中信证券	2022051000000706	天合光能	2022-05-10	369,240.00	6,800.00	14	3.00	430.78	-	-
中信证券	2022051000000708	中微公司	2022-05-10	426,000.00	4,000.00	14	1.30	215.37	-	-
中信证券	2022051000000709	澜起科技	2022-05-10	417,996.00	6,800.00	14	2.60	422.64	-	-
中信证券	2022051000000712	金山办公	2022-05-10	527,580.00	2,700.00	14	2.70	553.96	-	-
中信证券	2022051000000714	传音控股	2022-05-10	340,300.00	4,100.00	14	2.20	291.15	-	-
中信证券	2022051000000716	石头科技	2022-05-10	550,000.00	1,000.00	14	2.70	577.50	-	-
中信证券	2022051000000718	华润微	2022-05-10	448,448.00	9,100.00	14	2.90	505.75	-	-
中信证券	2022051000000720	中芯国际	2022-05-10	412,888.00	10,100.00	14	2.00	321.14	-	-

中信证券	202205100000 0722	奇安信	202 2- 05- 10	386,370.0 0	8,100.00	14	3.0 0	450.77	-	-
中信证券	202205100000 0724	华熙生物	202 2- 05- 10	567,000.0 0	4,500.00	14	2.7 0	595.35	-	-
中信证券	202205100000 0726	中国通号	202 2- 05- 10	459,194.0 0	104,600.0 0	14	2.0 0	357.15	-	-
中信证券	202205110000 9522	同花顺	202 2- 05- 11	1,003,434. 00	12,300.00	14	3.4 0	1,326.76	-	-
中信证券	202205120000 8972	宋城演艺	202 2- 05- 12	1,196,195. 00	100,100.0 0	14	3.1 0	1,442.08	-	-
中信证券	202205130000 6852	华熙生物	202 2- 04- 20	490.00	-	28	3.0 0	-	-	-
中信证券	202205130000 6946	华熙生物	202 2- 05- 05	490.00	-	28	3.2 0	-	-	-
中信证券	202205130000 7035	华熙生物	202 2- 05- 10	2,205.00	-	14	2.7 0	-	-	-
中信证券	202205180000 3191	金山办公	202 2- 05- 18	249,600.0 0	1,200.00	28	2.6 0	504.75	-	-
中信证券	202205180000 3193	传音控股	202 2- 05- 18	134,624.0 0	1,600.00	28	2.1 0	219.89	-	-
中信证券	202205180000 3195	华润微	202 2- 05- 18	91,530.00	1,800.00	28	2.8 0	199.33	-	-
中信证券	202205180000 3197	华熙生物	202 2- 05- 18	125,600.0 0	1,000.00	28	2.6 0	253.99	-	-
中信证券	202205180000 3199	沪硅产业	202 2- 05- 18	108,816.0 0	4,800.00	28	2.5 0	211.59	-	-

中信证券	202205180000 3203	中 微 公 司	202 2- 05- 18	176,832.0 0	1,600.00	28	1.2 0	165.04	-	-
中信证券	202205180000 3205	澜 起 科 技	202 2- 05- 18	190,830.0 0	3,000.00	28	2.5 0	371.06	-	-
中信证券	202205180000 3349	亿 联 网 络	202 2- 05- 18	166,865.0 0	2,300.00	28	2.9 0	376.37	-	-
中信证券	202205180000 3351	康 泰 生 物	202 2- 05- 18	156,411.0 0	2,700.00	28	3.0 0	364.96	-	-
中信证券	202205180000 3353	东 方 财 富	202 2- 05- 18	1,144,678. 00	51,400.00	28	1.8 0	1,602.55	-	-
中信证券	202205180000 3355	智 飞 生 物	202 2- 05- 18	476,391.0 0	5,100.00	28	2.2 0	815.16	-	-
中信证券	202205180000 3357	沃 森 生 物	202 2- 05- 18	485,305.0 0	10,100.00	28	3.0 0	1,132.38	-	-
中信证券	202205180000 3359	同 花 顺	202 2- 05- 18	106,860.0 0	1,300.00	28	3.4 0	282.59	-	-
中信证券	202205180000 3361	乐 普 医 疗	202 2- 05- 18	143,254.0 0	8,200.00	28	2.7 0	300.83	-	-
中信证券	202205180000 3363	汇 川 技 术	202 2- 05- 18	684,450.0 0	11,700.00	28	3.2 0	1,703.52	-	-
中信证券	202205180000 3365	温 氏 股 份	202 2- 05- 18	511,664.0 0	28,300.00	28	3.0 0	1,193.88	-	-
中信证券	202205180000 3367	爱 尔 眼 科	202 2- 05- 18	590,648.0 0	17,200.00	28	3.1 0	1,424.12	-	-
中信证券	202205180000 3369	先 导 智 能	202 2- 05- 18	340,800.0 0	7,100.00	28	2.0 0	530.13	-	-

中信证券	202205180000 3371	欧普康视	202 2- 05- 18	118,560.0 0	3,200.00	28	3.5 0	322.75	-	-
中信证券	202205180000 3373	亿纬锂能	202 2- 05- 18	573,707.0 0	7,300.00	28	3.3 0	1,472.51	-	-
中信证券	202205180000 3375	健帆生物	202 2- 05- 18	129,766.0 0	3,100.00	28	3.6 0	363.34	-	-
中信证券	202205180000 3377	阳光电源	202 2- 05- 18	523,668.0 0	6,800.00	28	3.2 0	1,303.35	-	-
中信证券	202205180000 3379	芒果超媒	202 2- 05- 18	159,885.0 0	4,500.00	28	3.1 0	385.50	-	-
中信证券	202205180000 3381	蓝思科技	202 2- 05- 18	122,760.0 0	12,400.00	28	3.0 0	286.44	-	-
中信证券	202205180000 3383	三环集团	202 2- 05- 18	249,996.0 0	8,300.00	28	2.8 0	544.44	-	-
中信证券	202205180000 3385	泰格医药	202 2- 05- 18	290,054.0 0	3,400.00	28	2.7 0	609.11	-	-
中信证券	202205180000 4839	迈瑞医疗	202 2- 05- 05	7,000.00	-	14	1.8 0	-	-	-
中信证券	202205180000 4861	迈瑞医疗	202 2- 05- 05	20,300.00	-	28	2.2 0	-	-	-
中信证券	202205180000 5002	迈瑞医疗	202 2- 05- 10	5,950.00	-	14	1.3 0	-	-	-
中信证券	202205180000 5147	安克创新	202 2- 05- 05	5,360.00	-	28	2.1 0	-	-	-
中信证券	202205180000 5201	安克创	202 2- 05- 05	16,320.00	-	14	2.2 0	-	-	-

中信证券	202205180000 5252	新安 克创 新	202 2- 05- 10	5,360.00	-	14	3.7 0	-	-	-
中信证券	202205190004 1523	温 氏 股 份	202 2- 05- 19	880,500.0 0	50,000.00	28	3.0 0	2,054.50	-	-
中信证券	202205190004 3097	乐 普 医 疗	202 2- 05- 19	193,050.0 0	11,000.00	14	1.8 0	135.14	-	-
中信证券	202205190004 3121	爱 尔 眼 科	202 2- 05- 19	651,130.0 0	19,000.00	14	1.8 0	455.79	-	-
中信证券	202205190004 3123	迈 瑞 医 疗	202 2- 05- 19	604,060.0 0	2,000.00	14	1.8 0	422.84	-	-
中信证券	202205190004 3125	健 帆 生 物	202 2- 05- 19	171,440.0 0	4,000.00	14	1.8 0	120.01	-	-
中信证券	202205190005 2265	阳 光 电 源	202 2- 05- 19	246,960.0 0	3,000.00	14	3.3 0	316.93	-	-
中信证券	202205190005 2275	安 克 创 新	202 2- 05- 19	1,248,888. 00	20,400.00	14	3.7 0	1,797.01	-	-
中信证券	202205190005 2285	金 龙 鱼	202 2- 05- 19	727,104.0 0	16,800.00	14	3.5 0	989.67	-	-
中信证券	202205190005 3583	宋 城 演 艺	202 2- 05- 19	197,030.0 0	17,000.00	14	2.0 0	153.25	-	-
中信证券	202205190005 3591	华 大 基 因	202 2- 05- 19	518,960.0 0	8,000.00	14	3.6 0	726.54	-	-
中信证券	202205200001 3630	汇 川 技 术	202 2- 05- 20	60,100.00	1,000.00	14	1.8 0	51.09	-	-
中信证券	202205200001 5870	蓝 思	202 2- 05-	17,459.00	1,700.00	14	1.8 0	14.84	-	-

		科技	20							
中信证券	2022052400000904	宁德时代	2022-05-24	4,020,400.00	10,000.00	14	3.50	5,472.21	-	-
中信证券	2022052400007004	沃森生物	2022-05-24	568,701.00	11,900.00	14	3.20	707.72	-	-
中信证券	2022052400007492	天合光能	2022-05-24	425,000.00	6,800.00	14	4.70	776.81	-	-
中信证券	2022052400007494	华润微	2022-05-24	451,542.00	9,100.00	14	3.20	561.92	-	-
中信证券	2022052400007496	石头科技	2022-05-24	605,160.00	1,000.00	14	2.10	494.21	-	-
中信证券	2022052400007498	沪硅产业	2022-05-24	471,442.00	21,400.00	14	3.60	660.02	-	-
中信证券	2022052400007500	华熙生物	2022-05-24	593,730.00	4,500.00	14	3.00	692.69	-	-
中信证券	2022052400007502	传音控股	2022-05-24	345,015.00	4,100.00	14	2.80	375.68	-	-
中信证券	2022052400007504	金山办公	2022-05-24	534,492.00	2,700.00	14	3.00	623.57	-	-
中信证券	2022052400007506	中国通号	2022-05-24	455,010.00	104,600.00	14	2.10	371.59	-	-
中信证券	2022052400007508	澜起科技	2022-05-24	421,804.00	6,800.00	14	2.30	377.28	-	-
中信证券	2022052400007510	奇安信	2022-05-24	379,809.00	8,100.00	14	3.20	472.65	-	-
中信证券	2022052400007512	中芯	2022-	420,261.00	10,100.00	14	1.70	277.84	-	-

		国际	05-24							
中信证券	2022052400007514	中微公司	2022-05-24	436,000.00	4,000.00	14	1.40	237.38	-	-
中信证券	2022052400007548	东方财富	2022-05-24	443,808.00	20,100.00	14	2.60	448.74	-	-
中信证券	2022052400007550	同花顺	2022-05-24	402,500.00	5,000.00	14	3.50	547.85	-	-
中信证券	2022052400007552	卓胜微	2022-05-24	418,220.00	2,200.00	14	2.30	374.07	-	-
中信证券	2022052400007554	阳光电源	2022-05-24	302,679.00	3,900.00	14	3.40	400.21	-	-
中信证券	2022052400007556	宋城演艺	2022-05-24	410,760.00	36,000.00	14	3.10	495.19	-	-
中信证券	2022052400007558	安克创新	2022-05-24	401,196.00	6,700.00	14	3.90	608.48	-	-
中信证券	2022052400007560	汇川技术	2022-05-24	497,196.00	8,400.00	14	1.70	328.70	-	-
中信证券	2022052400007562	华大基因	2022-05-24	317,400.00	4,600.00	14	3.30	407.33	-	-
中信证券	2022052400007564	宁德时代	2022-05-24	442,244.00	1,100.00	14	2.60	447.16	-	-
中信证券	2022052400007566	康龙化成	2022-05-24	515,590.00	4,700.00	14	4.00	802.03	-	-
中信证券	2022052400007568	三环集团	2022-05-24	466,900.00	16,100.00	14	2.90	526.56	-	-
中信证券	2022052400007570	贝达	2022-	414,873.00	9,300.00	14	2.80	451.75	-	-

		药业	05-24							
中信证券	2022052400007572	欧普康视	2022-05-24	481,829.00	13,700.00	14	3.40	637.09	-	-
中信证券	2022052400007574	迈瑞医疗	2022-05-24	493,850.00	1,700.00	14	2.60	499.34	-	-
中信证券	2022052400007588	英科医疗	2022-05-24	286,416.00	10,400.00	14	3.30	367.57	-	-
中信证券	2022052400007590	温氏股份	2022-05-24	435,240.00	24,800.00	14	3.40	575.48	-	-
中信证券	2022052400007598	健帆生物	2022-05-24	493,594.00	11,800.00	14	3.70	710.23	-	-
中信证券	2022052400007600	芒果超媒	2022-05-24	595,296.00	15,900.00	14	3.60	833.41	-	-
中信证券	2022052400007602	先导智能	2022-05-24	419,400.00	9,000.00	14	2.70	440.37	-	-
中信证券	2022052400007604	蓝思科技	2022-05-24	363,840.00	37,900.00	14	2.20	311.29	-	-
中信证券	2022052400007606	晶盛机电	2022-05-24	456,334.00	8,300.00	14	3.30	585.63	-	-
中信证券	2022052400007608	泰格医药	2022-05-24	465,120.00	5,700.00	14	1.30	235.14	-	-
中信证券	2022052400007610	康泰生物	2022-05-24	414,800.00	6,800.00	14	3.30	532.33	-	-
中信证券	2022052400007612	亿纬锂能	2022-05-24	530,600.00	7,000.00	14	3.10	639.67	-	-
中信证券	202205240000	乐	202	446,340.00	25,800.00	14	3.2	555.45	-	-

	7614	普医疗	2-05-24	0			0			
中信证券	2022052400007616	亿联网络	2022-05-24	450,306.00	6,200.00	14	3.30	577.89	-	-
中信证券	2022052400007618	爱尔眼科	2022-05-24	510,531.00	15,100.00	14	4.00	794.16	-	-
中信证券	2022052400007620	智飞生物	2022-05-24	383,560.00	4,300.00	14	3.20	477.32	-	-
中信证券	2022052400007622	爱美客	2022-05-24	535,700.00	1,100.00	14	5.40	1,124.97	-	-
中信证券	2022052500007177	同花顺	2022-05-25	996,300.00	12,300.00	14	3.50	1,356.08	-	-
中信证券	2022052500011473	金山办公	2022-05-05	1,190.00	-	28	2.20	-	-	-
中信证券	2022052500011527	金山办公	2022-05-18	840.00	-	28	2.60	-	-	-
中信证券	2022052500011729	金山办公	2022-05-24	1,890.00	-	14	3.00	-	-	-
中信证券	2022052600000795	东方财富	2022-05-26	22,450.00	1,000.00	28	2.30	40.16	-	-
中信证券	2022052600000811	东方财富	2022-05-26	22,450.00	1,000.00	14	2.40	20.95	-	-
中信证券	2022052600006918	三环集团	2022-05-26	167,295.00	5,700.00	14	1.80	117.11	-	-
中信证券	2022052600008416	宋城演艺	2022-05-26	1,198,197.00	100,100.00	14	3.10	1,444.49	-	-
中信证券	202205260001	沃	202	358,050.0	7,500.00	14	1.8	250.64	-	-

	0530	森生物	2-05-26	0			0			
中信证券	2022052600010568	先导智能	2022-05-26	739,692.00	16,200.00	14	1.80	517.78	-	-
中信证券	2022052600011522	蓝思科技	2022-05-26	99,198.00	9,900.00	14	1.80	69.44	-	-
中信证券	2022052600011540	乐普医疗	2022-05-26	108,885.00	6,100.00	14	1.80	76.22	-	-
中信证券	2022052600012444	稳健医疗	2022-05-05	7,200.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	2022052700007388	贝达药业	2022-05-05	550.00	-	28	2.30	-	-	-
中信证券	2022052700007498	贝达药业	2022-05-24	2,325.00	-	14	2.80	-	-	-
中信证券	2022053000005580	泰格医药	2022-05-05	2,350.00	-	28	2.30	-	-	-
中信证券	2022053000005602	泰格医药	2022-05-18	1,700.00	-	28	2.70	-	-	-
中信证券	2022053000005694	泰格医药	2022-05-24	2,850.00	-	14	1.30	-	-	-
中信证券	2022053000005824	亿联网络	2022-05-05	2,560.00	-	28	3.10	-	-	-
中信证券	2022053000005844	亿联网络	2022-05-18	1,840.00	-	28	2.90	-	-	-
中信证券	2022053000005924	亿联网络	2022-05-24	4,960.00	-	14	3.30	-	-	-

中信证券	2022053100010221	蓝思科技	2022-05-05	1,700.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2022053100010279	蓝思科技	2022-05-18	1,240.00	-	28	3.00	-	-	-
中信证券	2022053100010411	蓝思科技	2022-05-20	170.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022053100010451	蓝思科技	2022-05-24	3,790.00	-	14	2.20	-	-	-
中信证券	2022053100010589	蓝思科技	2022-05-26	990.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022060100001137	亿纬锂能	2022-06-01	432,650.00	5,000.00	14	2.80	471.11	-	-
中信证券	2022060100001142	东方财富	2022-06-01	5,748,672.00	252,800.00	14	2.70	6,036.11	-	-
中信证券	2022060100001469	先导智能	2022-06-01	1,058,960.00	21,700.00	14	1.80	741.27	-	-
中信证券	2022060100006154	晶盛机电	2022-05-05	3,780.00	-	28	2.30	-	-	-
中信证券	2022060100006296	晶盛机电	2022-05-24	2,324.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	2022060100006470	康泰生物	2022-05-05	3,145.00	-	28	2.80	-	-	-
中信证券	2022060100006490	康泰生物	2022-05-18	2,295.00	-	28	3.00	-	-	-
中信证券	2022060100006612	康泰生	2022-05-24	5,780.00	-	14	3.30	-	-	-

		物								
中信证券	202206010000 6840	康泰生物	202 2- 05- 05	-	2,220.00	28	2.8 0	-	-	-
中信证券	202206010000 6860	康泰生物	202 2- 05- 18	-	1,620.00	28	3.0 0	-	-	-
中信证券	202206010000 6982	康泰生物	202 2- 05- 24	-	4,080.00	14	3.3 0	-	-	-
中信证券	202206010000 8258	宋城演艺	202 2- 05- 05	695.00	-	28	3.1 0	-	-	-
中信证券	202206010000 8304	宋城演艺	202 2- 05- 19	850.00	-	14	2.0 0	-	-	-
中信证券	202206010000 8318	宋城演艺	202 2- 05- 24	1,800.00	-	14	3.1 0	-	-	-
中信证券	202206010000 8342	宋城演艺	202 2- 05- 26	5,005.00	-	14	3.1 0	-	-	-
中信证券	202206020001 6174	金龙鱼	202 2- 06- 02	759,528.0 0	16,800.00	14	3.5 0	1,033.80	-	-
中信证券	202206020001 6176	阳光电源	202 2- 06- 02	255,000.0 0	3,000.00	14	2.0 0	198.33	-	-
中信证券	202206020001 6180	安克创新	202 2- 06- 02	1,311,720. 00	20,400.00	14	4.1 0	2,091.46	-	-
中信证券	202206060001 0314	汇川技术	202 2- 06- 06	65,650.00	1,000.00	14	1.8 0	45.96	-	-
中信证券	202206070000 1424	安克创新	202 2- 06- 07	984,600.0 0	15,000.00	14	3.8 0	1,455.02	-	-
中信证券	202206070000 1430	亿纬	202 2- 06-	89,850.00	1,000.00	14	3.2 0	111.81	-	-

		锂能	07							
中信证券	202206070000 1432	康泰生物	202 2- 06- 07	48,480.00	1,200.00	14	3.7 0	69.76	-	-
中信证券	202206070000 1436	宁德时代	202 2- 06- 07	459,000.0 0	1,000.00	14	2.7 0	481.95	-	-
中信证券	202206070000 1447	康泰生物	202 2- 06- 07	969,600.0 0	24,000.00	14	3.7 0	1,395.15	-	-
中信证券	202206070000 7004	澜起科技	202 2- 06- 07	464,984.0 0	6,800.00	14	2.3 0	415.90	-	-
中信证券	202206070000 7006	中芯国际	202 2- 06- 07	456,722.0 0	10,100.00	14	2.3 0	408.51	-	-
中信证券	202206070000 7008	传音控股	202 2- 06- 07	416,560.0 0	4,100.00	14	2.9 0	469.79	-	-
中信证券	202206070000 7010	华润微	202 2- 06- 07	527,891.0 0	9,100.00	14	2.8 0	574.81	-	-
中信证券	202206070000 7012	奇安信	202 2- 06- 07	427,275.0 0	8,100.00	14	2.8 0	465.26	-	-
中信证券	202206070000 7014	天合光能	202 2- 06- 07	443,700.0 0	6,800.00	14	3.9 0	672.95	-	-
中信证券	202206070000 7016	中微公司	202 2- 06- 07	507,200.0 0	4,000.00	14	2.4 0	473.39	-	-
中信证券	202206070000 7018	金山办公	202 2- 06- 07	589,410.0 0	2,700.00	14	2.4 0	550.12	-	-
中信证券	202206070000 7020	沪硅产业	202 2- 06- 07	523,016.0 0	21,400.00	14	3.3 0	671.20	-	-
中信证券	202206070000 7022	石头	202 2-	682,530.0 0	1,000.00	14	3.3 0	875.91	-	-

		科技	06-07							
中信证券	2022060700007028	三环集团	2022-06-07	506,989.00	16,100.00	14	2.50	492.91	-	-
中信证券	2022060700007030	迈瑞医疗	2022-06-07	531,624.00	1,700.00	14	2.40	496.18	-	-
中信证券	2022060700007032	阳光电源	2022-06-07	370,851.00	3,900.00	14	2.90	418.24	-	-
中信证券	2022060700007034	安克创新	2022-06-07	439,788.00	6,700.00	14	3.80	649.91	-	-
中信证券	2022060700007036	东方财富	2022-06-07	479,586.00	20,100.00	14	2.70	503.57	-	-
中信证券	2022060700007038	同花顺	2022-06-07	442,750.00	5,000.00	14	3.70	637.07	-	-
中信证券	2022060700007040	卓胜微	2022-06-07	466,290.00	2,200.00	14	3.10	562.14	-	-
中信证券	2022060700007042	康龙化成	2022-06-07	599,250.00	4,700.00	14	3.50	815.65	-	-
中信证券	2022060700007044	汇川技术	2022-06-07	549,276.00	8,400.00	14	2.10	448.58	-	-
中信证券	2022060700007046	欧普康视	2022-06-07	606,910.00	13,700.00	14	3.40	802.47	-	-
中信证券	2022060700007048	健帆生物	2022-06-07	554,718.00	11,800.00	14	3.30	711.89	-	-
中信证券	2022060700007050	晶盛机电	2022-06-07	498,000.00	8,300.00	14	3.70	716.57	-	-
中信证券	2022060700007052	泰格	2022-	528,390.00	5,700.00	14	3.40	698.65	-	-

		医药	06-07							
中信证券	2022060700007054	亿联网络	2022-06-07	482,422.00	6,200.00	14	3.30	619.11	-	-
中信证券	2022060700007056	康泰生物	2022-06-07	274,720.00	6,800.00	14	3.20	341.87	-	-
中信证券	2022060700007058	芒果超媒	2022-06-07	564,132.00	15,900.00	14	3.50	767.85	-	-
中信证券	2022060700007062	蓝思科技	2022-06-07	391,886.00	37,900.00	14	2.40	365.76	-	-
中信证券	2022060700007064	亿纬锂能	2022-06-07	628,950.00	7,000.00	14	2.80	684.86	-	-
中信证券	2022060700007066	先导智能	2022-06-07	474,300.00	9,000.00	14	2.10	387.35	-	-
中信证券	2022060700007068	智飞生物	2022-06-07	380,636.00	4,300.00	14	1.80	266.45	-	-
中信证券	2022060700007070	爱美客	2022-06-07	580,459.00	1,100.00	14	5.60	1,264.11	-	-
中信证券	2022060700007072	爱尔眼科	2022-06-07	542,694.00	15,100.00	14	3.90	823.09	-	-
中信证券	2022060700007986	华熙生物	2022-06-07	662,940.00	4,500.00	14	3.20	824.99	-	-
中信证券	2022060700007992	宁德时代	2022-06-07	504,900.00	1,100.00	14	3.30	647.96	-	-
中信证券	2022060700007996	温氏股份	2022-06-07	441,688.00	24,800.00	14	3.20	549.66	-	-
中信证券	2022060700007998	乐	2022-	453,306.00	25,800.00	14	3.00	528.86	-	-

		普 医 疗	06- 07								
中信证券	202206070000 8288	宁 德 时 代	202 2- 06- 07	4,590,000. 00	10,000.00	14	3.3 0	5,890.50	-	-	
中信证券	202206070000 8310	沃 森 生 物	202 2- 06- 07	552,398.0 0	11,900.00	14	2.9 0	622.98	-	-	
中信证券	202206080000 5541	同 花 顺	202 2- 06- 08	1,106,877. 00	12,300.00	14	3.7 0	1,592.67	-	-	
中信证券	202206080000 9652	天 合 光 能	202 2- 06- 07	1,564.00	-	14	3.9 0	-	-	-	
中信证券	202206090000 6995	三 环 集 团	202 2- 06- 09	167,466.0 0	5,700.00	14	1.8 0	117.23	-	-	
中信证券	202206090000 7015	先 导 智 能	202 2- 06- 09	876,258.0 0	16,200.00	14	1.8 0	613.38	-	-	
中信证券	202206090000 7035	乐 普 医 疗	202 2- 06- 09	105,042.0 0	6,100.00	14	1.8 0	73.53	-	-	
中信证券	202206090000 7053	沃 森 生 物	202 2- 06- 09	338,250.0 0	7,500.00	14	1.8 0	236.78	-	-	
中信证券	202206090001 1463	三 环 集 团	202 2- 05- 18	2,656.00	-	28	2.8 0	-	-	-	
中信证券	202206090001 1603	三 环 集 团	202 2- 06- 07	5,152.00	-	14	2.5 0	-	-	-	
中信证券	202206090001 1677	三 环 集 团	202 2- 06- 09	1,824.00	-	14	1.8 0	-	-	-	
中信证券	202206090001 1719	健 帆 生 物	202 2- 05- 18	2,790.00	-	28	3.6 0	-	-	-	

中信证券	202206090001 1777	健帆生物	2022-06-07	10,620.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	202206130000 2700	健帆生物	2022-06-13	46,630.00	1,000.00	28	3.20	116.06	-	-
中信证券	202206130000 2702	康泰生物	2022-06-13	86,284.00	2,200.00	28	3.30	221.46	-	-
中信证券	202206130000 2704	迈为股份	2022-06-13	382,100.00	1,000.00	28	3.80	1,129.32	-	-
中信证券	202206130000 2705	温氏股份	2022-06-13	179,352.00	9,400.00	28	3.40	474.29	-	-
中信证券	202206130000 2706	亿联网络	2022-06-13	77,170.00	1,000.00	28	3.30	198.07	-	-
中信证券	202206130000 2710	中科创达	2022-06-13	124,640.00	1,000.00	28	3.30	319.91	-	-
中信证券	202206130000 2711	圣邦股份	2022-06-13	251,500.00	1,000.00	28	3.40	665.08	-	-
中信证券	202206130000 2712	康龙化成	2022-06-13	200,880.00	1,600.00	28	3.30	515.59	-	-
中信证券	202206130000 2714	宁德时代	2022-06-13	1,905,029.00	4,300.00	28	2.50	3,704.22	-	-
中信证券	202206130000 2718	阳光电源	2022-06-13	179,780.00	2,000.00	28	2.80	391.52	-	-
中信证券	202206130000 2720	晶盛机电	2022-06-13	227,392.00	3,800.00	28	3.10	548.27	-	-
中信证券	202206130000 2722	欣旺达	2022-06-13	94,891.00	3,100.00	28	3.00	221.41	-	-

中信证券	202206130000 2724	北京 君正	202 2- 06- 13	90,840.00	1,000.00	28	2.8 0	197.83	-	-
中信证券	202206130000 2726	泰格 医药	202 2- 06- 13	275,190.0 0	3,000.00	28	2.6 0	556.50	-	-
中信证券	202206130000 2728	先导 智能	202 2- 06- 13	188,220.0 0	3,000.00	28	3.1 0	453.82	-	-
中信证券	202206130000 2729	深信 服	202 2- 06- 13	101,700.0 0	1,000.00	28	3.4 0	268.94	-	-
中信证券	202206130000 2732	三环 集团	202 2- 06- 13	218,526.0 0	7,700.00	28	2.8 0	475.90	-	-
中信证券	202206130000 2734	中伟 股份	202 2- 06- 13	128,500.0 0	1,000.00	28	4.5 0	449.75	-	-
中信证券	202206130000 2735	爱美 客	202 2- 06- 13	517,220.0 0	1,000.00	28	5.5 0	2,212.55	-	-
中信证券	202206130000 2737	迈瑞 医疗	202 2- 06- 13	922,064.0 0	3,100.00	28	3.3 0	2,366.63	-	-
中信证券	202206130000 2739	芒果 超媒	202 2- 06- 13	84,456.00	2,400.00	28	3.2 0	210.20	-	-
中信证券	202206130000 2741	卓胜 微	202 2- 06- 13	284,850.0 0	1,500.00	28	2.7 0	598.19	-	-
中信证券	202206130000 2743	安克 创新	202 2- 06- 13	61,750.00	1,000.00	28	3.8 0	182.51	-	-
中信证券	202206130000 2745	贝泰 妮	202 2- 06- 13	197,010.0 0	1,000.00	28	3.8 0	582.27	-	-
中信证券	202206130000 2748	华利 集团	202 2- 06- 13	94,471.00	1,300.00	28	3.3 0	242.48	-	-
中信证券	202206130000	金	202	124,956.0	2,700.00	28	3.3	320.72	-	-

	2749	龙 鱼	2- 06- 13	0			0			
中信证券	202206130000 2750	沃 森 生 物	202 2- 06- 13	479,467.0 0	10,700.00	28	2.3 0	857.71	-	-
中信证券	202206130000 2754	乐 普 医 疗	202 2- 06- 13	17,260.00	1,000.00	28	2.5 0	33.56	-	-
中信证券	202206130000 2756	亿 纬 锂 能	202 2- 06- 13	219,076.0 0	2,200.00	28	3.2 0	545.26	-	-
中信证券	202206130000 2758	智 飞 生 物	202 2- 06- 13	89,050.00	1,000.00	28	2.3 0	159.30	-	-
中信证券	202206130000 2760	爱 尔 眼 科	202 2- 06- 13	213,846.0 0	5,800.00	28	2.7 0	449.08	-	-
中信证券	202206130000 2762	汇 川 技 术	202 2- 06- 13	379,620.0 0	5,700.00	28	1.9 0	560.99	-	-
中信证券	202206130000 2764	同 花 顺	202 2- 06- 13	89,450.00	1,000.00	28	3.4 0	236.55	-	-
中信证券	202206130000 2766	东 方 财 富	202 2- 06- 13	1,532,096. 00	64,700.00	28	2.7 0	3,217.40	-	-
中信证券	202206130000 2852	金 山 办 公	202 2- 06- 13	247,404.0 0	1,200.00	28	2.7 0	519.55	-	-
中信证券	202206130000 2854	传 音 控 股	202 2- 06- 13	146,970.0 0	1,500.00	28	2.5 0	285.78	-	-
中信证券	202206130000 2856	天 合 光 能	202 2- 06- 13	313,040.0 0	5,200.00	28	3.2 0	779.12	-	-
中信证券	202206130000 2858	凯 赛 生 物	202 2- 06- 13	104,170.0 0	1,000.00	28	2.9 0	234.96	-	-
中信证券	202206130000	中	202	182,960.0	4,000.00	28	2.0	284.60	-	-

	2860	芯国际	2-06-13	0			0			
中信证券	202206130000 2862	沪硅产业	2022-06-13	118,727.00	4,900.00	28	3.40	313.97	-	-
中信证券	202206130000 2864	华润微	2022-06-13	88,800.00	1,500.00	28	2.50	172.67	-	-
中信证券	202206130000 2866	石头科技	2022-06-13	670,730.00	1,000.00	28	3.30	1,721.54	-	-
中信证券	202206130000 2868	奇安信	2022-06-13	86,054.00	1,700.00	28	1.90	127.17	-	-
中信证券	202206130000 2870	中微公司	2022-06-13	187,605.00	1,500.00	28	2.70	393.97	-	-
中信证券	202206130000 2872	容百科技	2022-06-13	106,170.00	1,000.00	28	3.30	272.50	-	-
中信证券	202206130000 2874	澜起科技	2022-06-13	62,930.00	1,000.00	28	2.30	112.57	-	-
中信证券	202206130002 2392	深信服	2022-06-13	70.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	202206130002 2809	康龙化成	2022-06-07	2,115.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	202206130002 2952	康龙化成	2022-06-13	720.00	-	28	3.30	-	-	-
中信证券	202206130002 3133	康龙化成	2022-06-07	-	2,350.00	14	3.50	-	-	-
中信证券	202206130002 3276	康龙化成	2022-06-13	-	800.00	28	3.30	-	-	-
中信证券	202206150002 3139	亿	2022-	488,250.00	5,000.00	14	3.20	607.60	-	-

		纬 锂 能	06- 15								
中信证券	202206150002 3775	先 导 智 能	202 2- 06- 15	1,312,633. 00	21,700.00	14	1.8 0	918.84	-	-	
中信证券	202206160000 1346	迈 为 股 份	202 2- 06- 16	393,680.0 0	1,000.00	14	3.9 0	597.08	-	-	
中信证券	202206160000 1348	深 信 服	202 2- 06- 16	104,500.0 0	1,000.00	14	3.5 0	142.24	-	-	
中信证券	202206160000 1371	宁 德 时 代	202 2- 06- 16	11,507,50 0.00	25,000.00	28	1.8 0	16,110.50	-	-	
中信证券	202206160001 6577	安 克 创 新	202 2- 06- 16	1,261,944. 00	20,400.00	14	3.8 0	1,864.87	-	-	
中信证券	202206160001 6581	金 龙 鱼	202 2- 06- 16	801,360.0 0	16,800.00	14	4.1 0	1,277.72	-	-	
中信证券	202206160001 6585	温 氏 股 份	202 2- 06- 16	1,027,500. 00	50,000.00	14	3.4 0	1,358.58	-	-	
中信证券	202206200000 1690	爱 尔 眼 科	202 2- 06- 20	577,536.0 0	14,100.00	14	3.0 0	673.79	-	-	
中信证券	202206200000 1692	亿 纬 锂 能	202 2- 06- 20	5,062,500. 00	50,000.00	14	2.6 0	5,118.75	-	-	
中信证券	202206200001 5625	北 京 君 正	202 2- 06- 13	190.00	-	28	2.8 0	-	-	-	
中信证券	202206210000 1522	康 龙 化 成	202 2- 06- 21	88,880.00	1,000.00	14	2.9 0	100.24	-	-	
中信证券	202206210000 1539	温 氏 股 份	202 2- 06- 21	6,258,000. 00	300,000.0 0	14	2.9 0	7,057.63	-	-	
中信证券	202206210000	宁	202	5,078,500.	10,000.00	14	2.6	5,134.93	-	-	

	7402	德时代	2-06-21	00			0			
中信证券	2022062100007486	安克创新	2022-06-21	938,100.00	15,000.00	14	3.90	1,422.79	-	-
中信证券	2022062100007528	亿纬锂能	2022-06-21	100,300.00	1,000.00	14	3.30	128.72	-	-
中信证券	2022062100007530	宁德时代	2022-06-21	507,850.00	1,000.00	14	2.60	513.49	-	-
中信证券	2022062100008378	智飞生物	2022-06-21	434,472.00	4,300.00	14	2.40	405.51	-	-
中信证券	2022062100008380	蓝思科技	2022-06-21	423,722.00	37,900.00	14	3.20	527.30	-	-
中信证券	2022062100008522	康泰生物	2022-06-21	51,120.00	1,200.00	14	3.40	67.59	-	-
中信证券	2022062100008918	澜起科技	2022-06-21	389,640.00	6,800.00	14	2.40	363.66	-	-
中信证券	2022062100008920	华润微	2022-06-21	519,792.00	9,100.00	14	2.60	525.57	-	-
中信证券	2022062100008922	天合光能	2022-06-21	437,512.00	6,800.00	14	3.30	561.47	-	-
中信证券	2022062100008930	东方财富	2022-06-21	486,219.00	20,100.00	14	2.80	529.44	-	-
中信证券	2022062100008932	金山办公	2022-06-21	540,000.00	2,700.00	14	2.80	588.00	-	-
中信证券	2022062100008934	欧普康视	2022-06-21	729,799.00	13,700.00	14	2.90	823.05	-	-

中信证券	202206210000 8936	汇川技术	2022-06-21	556,500.00	8,400.00	14	2.00	432.83	-	-
中信证券	202206210000 8942	阳光电源	2022-06-21	342,693.00	3,900.00	14	2.90	386.48	-	-
中信证券	202206210000 8944	康龙化成	2022-06-21	417,736.00	4,700.00	14	3.40	552.34	-	-
中信证券	202206210000 8946	迈瑞医疗	2022-06-21	536,095.00	1,700.00	14	3.40	708.84	-	-
中信证券	202206210000 8948	卓胜微	2022-06-21	443,234.00	2,200.00	14	2.80	482.63	-	-
中信证券	202206210000 8950	石头科技	2022-06-21	671,060.00	1,000.00	14	3.40	887.29	-	-
中信证券	202206210000 8952	亿联网络	2022-06-21	455,018.00	6,200.00	14	3.40	601.63	-	-
中信证券	202206210000 8954	泰格医药	2022-06-21	571,026.00	5,700.00	14	2.70	599.58	-	-
中信证券	202206210000 8960	康泰生物	2022-06-21	289,680.00	6,800.00	14	3.40	383.02	-	-
中信证券	202206210000 8962	爱美客	2022-06-21	619,399.00	1,100.00	14	5.60	1,348.91	-	-
中信证券	202206210000 8964	先导智能	2022-06-21	577,800.00	9,000.00	14	3.20	719.04	-	-
中信证券	202206210000 8966	芒果超媒	2022-06-21	578,919.00	15,900.00	14	3.30	742.95	-	-
中信证券	202206210000 8990	乐普医疗	2022-06-21	473,946.00	25,800.00	14	2.60	479.21	-	-

中信证券	202206210000 8992	温氏股份	2022-06-21	517,328.00	24,800.00	14	3.50	704.14	-	-
中信证券	202206210000 9402	沃森生物	2022-06-21	570,129.00	11,900.00	14	2.40	532.12	-	-
中信证券	202206210000 9492	中芯国际	2022-06-21	456,116.00	10,100.00	14	2.10	372.49	-	-
中信证券	202206210000 9494	中微公司	2022-06-21	485,120.00	4,000.00	14	2.80	528.24	-	-
中信证券	202206210000 9496	传音控股	2022-06-21	394,789.00	4,100.00	14	2.60	399.18	-	-
中信证券	202206210000 9498	奇安信	2022-06-21	445,014.00	8,100.00	14	2.00	346.12	-	-
中信证券	202206210000 9500	三环集团	2022-06-21	489,762.00	16,100.00	14	2.90	552.34	-	-
中信证券	202206210000 9502	健帆生物	2022-06-21	579,262.00	11,800.00	14	3.30	743.39	-	-
中信证券	202206210000 9504	沪硅产业	2022-06-21	494,982.00	21,400.00	14	3.50	673.73	-	-
中信证券	202206210000 9506	同花顺	2022-06-21	474,500.00	5,000.00	14	3.50	645.85	-	-
中信证券	202206210000 9508	安克创新	2022-06-21	419,018.00	6,700.00	14	3.90	635.51	-	-
中信证券	202206210000 9510	晶盛机电	2022-06-21	529,540.00	8,300.00	14	3.20	658.98	-	-
中信证券	202206210000 9512	亿纬锂能	2022-06-21	702,100.00	7,000.00	14	3.30	901.03	-	-

中信证券	202206210000 9514	爱尔眼科	2022-06-21	615,627.00	15,100.00	14	2.80	670.35	-	-
中信证券	202206210000 9530	宁德时代	2022-06-21	558,635.00	1,100.00	14	2.60	564.84	-	-
中信证券	202206210000 9532	华熙生物	2022-06-21	663,840.00	4,500.00	14	2.70	697.03	-	-
中信证券	202206210001 0117	圣邦股份	2022-06-13	500.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	202206210001 0359	圣邦股份	2022-06-13	-	500.00	28	3.40	-	-	-
中信证券	202206220000 2592	欣旺达	2022-06-22	162,900.00	5,000.00	14	2.90	183.72	-	-
中信证券	202206220001 6828	传音控股	2022-06-13	2,250.00	-	28	2.50	-	-	-
中信证券	202206220001 7065	传音控股	2022-06-21	6,150.00	-	14	2.60	-	-	-
中信证券	202206230000 1768	爱尔眼科	2022-06-23	168,305.00	4,100.00	28	1.80	235.63	-	-
中信证券	202206230000 1796	阳光电源	2022-06-23	3,610,885.00	39,100.00	14	2.90	4,072.28	-	-
中信证券	202206230000 1841	康泰生物	2022-06-23	41,960.00	1,000.00	14	2.30	37.53	-	-
中信证券	202206230000 1880	欣旺达	2022-06-23	314,910.00	9,000.00	14	2.90	355.15	-	-
中信证券	202206230000 9117	乐普医疗	2022-06-23	110,532.00	6,100.00	14	1.80	77.37	-	-

中信证券	202206230000 9125	先 导 智 能	202 2- 06- 23	1,104,516. 00	16,200.00	14	1.8 0	773.16	-	-
中信证券	202206230000 9143	沃 森 生 物	202 2- 06- 23	353,625.0 0	7,500.00	14	1.8 0	247.54	-	-
中信证券	202206230000 9439	东 方 财 富	202 2- 06- 23	24,880.00	1,000.00	28	2.7 0	52.25	-	-
中信证券	202206230000 9559	三 环 集 团	202 2- 06- 23	167,238.0 0	5,700.00	14	1.8 0	117.07	-	-
中信证券	202206230001 1726	华 润 微	202 2- 06- 13	257.70	-	28	2.5 0	-	-	-
中信证券	202206230001 2027	华 润 微	202 2- 06- 21	1,563.38	-	14	2.6 0	-	-	-
中信证券	202206240000 1491	阳 光 电 源	202 2- 06- 24	2,156,266. 00	22,600.00	28	1.8 0	3,018.77	-	-
中信证券	202206240000 1492	欣 旺 达	202 2- 06- 24	2,348,808. 00	68,200.00	28	1.8 0	3,288.33	-	-
中信证券	202206240000 9647	先 导 智 能	202 2- 06- 13	1,500.00	-	28	3.1 0	-	-	-
中信证券	202206240000 9732	先 导 智 能	202 2- 06- 15	10,850.00	-	14	1.8 0	-	-	-
中信证券	202206240000 9890	先 导 智 能	202 2- 06- 21	4,500.00	-	14	3.2 0	-	-	-
中信证券	202206240000 9954	先 导 智 能	202 2- 06- 23	8,100.00	-	14	1.8 0	-	-	-
中信证券	202206270001 6939	阳 光 电 源	202 2- 06- 13	220.96	-	28	2.8 0	-	-	-

中信证券	2022062700017292	阳光电源	2022-06-21	430.88	-	14	2.90	-	-	-
中信证券	2022062700017371	阳光电源	2022-06-23	4,319.86	-	14	2.90	-	-	-
中信证券	2022062700017399	阳光电源	2022-06-24	2,496.90	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022062800012311	汇川技术	2022-06-13	1,710.00	-	28	1.90	-	-	-
中信证券	2022062800012536	汇川技术	2022-06-21	2,520.00	-	14	2.00	-	-	-
中信证券	2022062900021548	亿纬锂能	2022-06-29	487,900.00	5,000.00	14	2.60	493.32	-	-
中信证券	2022062900023872	先导智能	2022-06-29	1,405,726.00	21,700.00	14	1.80	984.01	-	-
中信证券	2022062900027007	乐普医疗	2022-06-13	275.00	-	28	2.50	-	-	-
中信证券	2022062900027140	乐普医疗	2022-06-21	7,095.00	-	14	2.60	-	-	-
中信证券	2022062900027186	乐普医疗	2022-06-23	1,677.50	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022062900027441	卓胜微	2022-06-13	1,050.00	-	28	2.70	-	-	-
中信证券	2022062900027606	卓胜微	2022-06-21	1,540.00	-	14	2.80	-	-	-
中信证券	2022062900027793	卓胜微	2022-06-13	-	900.00	28	2.70	-	-	-

中信证券	2022062900027958	卓胜微	2022-06-21	-	1,320.00	14	2.80	-	-	-
中信证券	2022063000018531	深信服	2022-06-30	103,780.00	1,000.00	14	3.20	129.15	-	-
中信证券	2022063000018533	迈为股份	2022-06-30	490,900.00	1,000.00	14	3.60	687.26	-	-
中信证券	2022063000018543	温氏股份	2022-06-30	1,064,500.00	50,000.00	14	2.90	1,200.52	-	-
中信证券	2022063000018547	安克创新	2022-06-30	1,352,928.00	20,400.00	14	3.30	1,736.26	-	-
中信证券	2022063000018549	金龙鱼	2022-06-30	907,536.00	16,800.00	14	2.90	1,023.50	-	-
中信证券	2022070400015528	爱尔眼科	2022-07-04	629,706.00	14,100.00	14	3.40	832.61	-	-
中信证券	2022070400015530	亿纬锂能	2022-07-04	4,827,000.00	50,000.00	14	2.90	5,443.78	-	-
中信证券	2022070500001077	蓝思科技	2022-07-05	347,840.00	32,000.00	14	2.50	338.18	-	-
中信证券	2022070500008036	康泰生物	2022-07-05	54,876.00	1,200.00	14	3.40	72.56	-	-
中信证券	2022070500008042	康龙化成	2022-07-05	107,000.00	1,000.00	14	3.10	128.99	-	-
中信证券	2022070500008044	宁德时代	2022-07-05	523,870.00	1,000.00	14	3.40	692.67	-	-
中信证券	2022070500008048	温氏股份	2022-07-05	7,335,000.00	300,000.00	14	3.20	9,128.00	-	-

中信证券	202207050000 8946	东方 财富	202 2- 07- 05	507,123.0 0	20,100.00	14	2.6 0	512.76	-	-
中信证券	202207050000 9368	亿 纬 锂 能	202 2- 07- 05	94,400.00	1,000.00	14	2.9 0	106.46	-	-
中信证券	202207050000 9376	安 克 创 新	202 2- 07- 05	1,176,300. 00	15,000.00	14	2.8 0	1,280.86	-	-
中信证券	202207050001 1745	芒 果 超 媒	202 2- 06- 13	312.00	-	28	3.2 0	-	-	-
中信证券	202207060000 1345	乐 普 医 疗	202 2- 07- 06	1,846,000. 00	100,000.0 0	14	3.2 0	2,297.24	-	-
中信证券	202207060000 1349	蓝 思 科 技	202 2- 07- 06	10,690.00	1,000.00	14	2.5 0	10.39	-	-
中信证券	202207060001 2151	欣 旺 达	202 2- 07- 06	152,950.0 0	5,000.00	14	2.8 0	166.55	-	-
中信证券	202207070000 0982	阳 光 电 源	202 2- 07- 07	710,016.0 0	6,400.00	28	1.8 0	994.02	-	-
中信证券	202207070000 1007	温 氏 股 份	202 2- 07- 07	7,398,000. 00	300,000.0 0	14	3.5 0	10,069.50	-	-
中信证券	202207070000 7004	阳 光 电 源	202 2- 07- 07	4,337,754. 00	39,100.00	14	2.9 0	4,892.02	-	-
中信证券	202207070000 7056	先 导 智 能	202 2- 07- 07	1,023,840. 00	16,200.00	14	1.8 0	716.69	-	-
中信证券	202207070000 7066	沃 森 生 物	202 2- 07- 07	360,750.0 0	7,500.00	14	1.8 0	252.53	-	-
中信证券	202207070000 7078	乐 普 医 疗	202 2- 07- 07	111,447.0 0	6,100.00	14	1.8 0	78.01	-	-

中信证券	202207070000 7976	三环集团	2022-07-07	158,175.00	5,700.00	14	1.80	110.72	-	-
中信证券	202207070000 8398	康泰生物	2022-07-07	43,860.00	1,000.00	14	3.40	57.99	-	-
中信证券	202207070000 8442	欣旺达	2022-07-07	297,630.00	9,000.00	14	2.80	324.09	-	-
中信证券	202207070001 0104	欣旺达	2022-06-13	217.04	-	28	3.00	-	-	-
中信证券	202207070001 0142	欣旺达	2022-06-24	4,774.91	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	202207070001 0447	欣旺达	2022-07-06	350.07	-	14	2.80	-	-	-
中信证券	202207070001 0505	欣旺达	2022-07-07	630.12	-	14	2.80	-	-	-
中信证券	202207070001 1264	亿纬锂能	2022-06-13	352.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	202207070001 1389	亿纬锂能	2022-06-29	800.00	-	14	2.60	-	-	-
中信证券	202207070001 1577	亿纬锂能	2022-07-04	8,000.00	-	14	2.90	-	-	-
中信证券	202207070001 1611	亿纬锂能	2022-07-05	160.00	-	14	2.90	-	-	-
中信证券	202207070001 2138	石头科技	2022-06-13	2,100.00	-	28	3.30	-	-	-
中信证券	202207080000 8743	石头科技	2022-06-13	-	400.00	28	3.30	-	-	-
中信证券	202207080000 9403	爱	2022-	694.06	-	28	2.70	-	-	-

		尔眼科	06-13							
中信证券	2022070800009423	爱尔眼科	2022-06-23	490.63	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022070800009582	爱尔眼科	2022-07-04	1,687.28	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2022070800009695	爱尔眼科	2022-06-13	-	1,735.00	28	2.70	-	-	-
中信证券	2022070800009715	爱尔眼科	2022-06-23	-	1,227.00	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022070800009874	爱尔眼科	2022-07-04	-	4,218.00	14	3.40	-	-	-
中信证券	2022071100017556	中伟股份	2022-07-11	139,050.00	1,000.00	28	5.00	540.75	-	-
中信证券	2022071100017558	温氏股份	2022-07-11	242,614.00	9,400.00	28	3.40	641.58	-	-
中信证券	2022071100017560	阳光电源	2022-07-11	224,300.00	2,000.00	28	2.90	505.92	-	-
中信证券	2022071100017562	中科创达	2022-07-11	129,390.00	1,000.00	28	2.20	221.40	-	-
中信证券	2022071100017564	康龙化成	2022-07-11	168,048.00	1,600.00	28	3.40	444.39	-	-
中信证券	2022071100017566	宁德时代	2022-07-11	2,229,550.00	4,300.00	28	3.20	5,549.10	-	-
中信证券	2022071100017568	康泰生物	2022-07-11	96,448.00	2,200.00	28	2.20	165.03	-	-

中信证券	2022071100017570	迈为股份	2022-07-11	477,780.00	1,000.00	28	2.80	1,040.50	-	-
中信证券	2022071100017572	泰格医药	2022-07-11	353,880.00	3,000.00	28	2.40	660.58	-	-
中信证券	2022071100017574	欣旺达	2022-07-11	92,256.00	3,100.00	28	3.10	222.44	-	-
中信证券	2022071100017576	健帆生物	2022-07-11	48,880.00	1,000.00	28	2.30	87.44	-	-
中信证券	2022071100017578	亿联网络	2022-07-11	71,870.00	1,000.00	28	2.00	111.80	-	-
中信证券	2022071100017580	晶盛机电	2022-07-11	259,730.00	3,800.00	28	3.30	666.64	-	-
中信证券	2022071100017582	容百科技	2022-07-11	133,400.00	1,000.00	28	2.90	300.89	-	-
中信证券	2022071100017584	贝泰妮	2022-07-11	202,000.00	1,000.00	28	3.00	471.33	-	-
中信证券	2022071100017586	沃森生物	2022-07-11	506,110.00	10,700.00	28	1.60	629.83	-	-
中信证券	2022071100017588	芒果超媒	2022-07-11	74,112.00	2,400.00	28	3.30	190.22	-	-
中信证券	2022071100019346	安克创新	2022-07-11	75,420.00	1,000.00	28	2.60	152.52	-	-
中信证券	2022071100020594	爱美客	2022-07-11	561,000.00	1,000.00	28	3.20	1,396.27	-	-
中信证券	2022071100020596	先导智能	2022-07-11	179,790.00	3,000.00	28	2.00	279.67	-	-

中信证券	2022071100020598	圣邦股份	2022-07-11	178,440.00	1,000.00	28	2.80	388.60	-	-
中信证券	2022071100020600	凯赛生物	2022-07-11	110,190.00	1,000.00	28	3.80	325.67	-	-
中信证券	2022071100020602	天合光能	2022-07-11	346,580.00	5,200.00	28	3.20	862.60	-	-
中信证券	2022071100020604	中芯国际	2022-07-11	167,360.00	4,000.00	28	1.90	247.32	-	-
中信证券	2022071100020606	沪硅产业	2022-07-11	105,693.00	4,900.00	28	1.00	82.21	-	-
中信证券	2022071100020608	澜起科技	2022-07-11	54,270.00	1,000.00	28	3.20	135.07	-	-
中信证券	2022071100020610	深信服	2022-07-11	94,100.00	1,000.00	28	2.90	212.25	-	-
中信证券	2022071100020612	传音控股	2022-07-11	121,365.00	1,500.00	28	2.00	188.79	-	-
中信证券	2022071100020614	汇川技术	2022-07-11	358,416.00	5,700.00	28	1.50	418.15	-	-
中信证券	2022071100020616	石头科技	2022-07-11	380,480.00	1,000.00	28	1.90	562.26	-	-
中信证券	2022071100020618	金山办公	2022-07-11	212,160.00	1,200.00	28	2.50	412.53	-	-
中信证券	2022071100020620	同花顺	2022-07-11	89,930.00	1,000.00	28	2.60	181.86	-	-
中信证券	2022071100020622	华润微	2022-07-11	83,040.00	1,500.00	28	2.90	187.30	-	-

中信证券	2022071100020624	中微公司	2022-07-11	182,655.00	1,500.00	28	3.10	440.40	-	-
中信证券	2022071100020626	奇安信	2022-07-11	86,734.00	1,700.00	28	2.10	141.67	-	-
中信证券	2022071100020628	爱尔眼科	2022-07-11	188,384.00	5,800.00	28	2.70	395.61	-	-
中信证券	2022071100020630	智飞生物	2022-07-11	113,560.00	1,000.00	28	1.70	150.15	-	-
中信证券	2022071100020632	东方财富	2022-07-11	1,506,863.00	64,700.00	28	2.90	3,398.81	-	-
中信证券	2022071100020634	北京君正	2022-07-11	90,710.00	1,000.00	28	3.30	232.82	-	-
中信证券	2022071100020636	亿纬锂能	2022-07-11	214,170.00	2,200.00	28	1.60	266.52	-	-
中信证券	2022071100020638	华利集团	2022-07-11	86,385.00	1,300.00	28	3.30	221.72	-	-
中信证券	2022071100020640	迈瑞医疗	2022-07-11	991,008.00	3,100.00	28	1.80	1,387.41	-	-
中信证券	2022071100020642	三环集团	2022-07-11	210,287.00	7,700.00	28	1.90	310.76	-	-
中信证券	2022071100020644	乐普医疗	2022-07-11	18,180.00	1,000.00	28	3.10	43.83	-	-
中信证券	2022071100020646	金龙鱼	2022-07-11	138,672.00	2,700.00	28	3.00	323.57	-	-
中信证券	2022071100020648	卓胜微	2022-07-11	185,925.00	1,500.00	28	3.00	433.83	-	-

中信证券	202207120000 0792	爱尔眼科	202 2- 07- 12	880,306.0 0	27,700.00	14	2.8 0	958.56	-	-
中信证券	202207130002 5890	先导智能	202 2- 07- 13	1,327,606. 00	21,700.00	14	1.8 0	929.32	-	-
中信证券	202207130002 7294	亿纬锂能	202 2- 07- 13	491,900.0 0	5,000.00	14	1.7 0	325.20	-	-
中信证券	202207140000 1297	爱尔眼科	202 2- 07- 14	145,211.0 0	4,300.00	14	2.8 0	158.12	-	-
中信证券	202207140000 1300	阳光电源	202 2- 07- 14	1,348,200. 00	10,700.00	14	3.2 0	1,677.76	-	-
中信证券	202207140001 0752	温氏股份	202 2- 07- 14	1,246,000. 00	50,000.00	14	3.5 0	1,695.94	-	-
中信证券	202207140001 0758	迈为股份	202 2- 07- 14	491,450.0 0	1,000.00	14	2.9 0	554.25	-	-
中信证券	202207140001 0760	金龙鱼	202 2- 07- 14	833,448.0 0	16,800.00	14	3.1 0	1,004.77	-	-
中信证券	202207140001 3188	宁德时代	202 2- 07- 14	13,900,25 0.00	25,000.00	28	1.8 0	19,460.35	-	-
中信证券	202207140001 4072	安克创新	202 2- 07- 14	1,680,552. 00	20,400.00	14	2.7 0	1,764.58	-	-
中信证券	202207140001 8786	智飞生物	202 2- 07- 11	600.00	-	28	1.7 0	-	-	-
中信证券	202207180001 4519	亿纬锂能	202 2- 07- 18	5,366,000. 00	50,000.00	14	2.4 0	5,008.27	-	-
中信证券	202207180001 4521	爱尔眼科	202 2- 07- 18	490,680.0 0	14,100.00	14	2.8 0	534.30	-	-

中信证券	202207190000 0848	锦浪科技	2022-07-19	932,000.00	4,000.00	28	3.60	2,609.60	-	-
中信证券	202207190000 8216	康泰生物	2022-07-19	47,880.00	1,200.00	14	3.00	55.86	-	-
中信证券	202207190000 8218	康龙化成	2022-07-19	82,950.00	1,000.00	14	3.20	103.23	-	-
中信证券	202207190000 8220	宁德时代	2022-07-19	524,610.00	1,000.00	14	3.80	775.26	-	-
中信证券	202207190000 8226	温氏股份	2022-07-19	7,233,000.00	300,000.00	14	3.40	9,563.63	-	-
中信证券	202207190000 8238	蓝思科技	2022-07-19	352,640.00	32,000.00	14	3.10	425.13	-	-
中信证券	202207190000 8246	安克创新	2022-07-19	1,176,150.00	15,000.00	14	3.30	1,509.39	-	-
中信证券	202207190000 8248	东方财富	2022-07-19	468,330.00	20,100.00	14	2.70	491.75	-	-
中信证券	202207190000 8250	亿纬锂能	2022-07-19	102,900.00	1,000.00	14	2.40	96.04	-	-
中信证券	202207190001 1728	凯赛生物	2022-07-11	450.00	-	28	3.80	-	-	-
中信证券	202207200000 0945	爱尔眼科	2022-07-20	44,200.00	1,300.00	14	3.00	51.57	-	-
中信证券	202207200001 2203	欣旺达	2022-07-20	152,750.00	5,000.00	14	3.60	213.85	-	-
中信证券	202207200001 2205	乐普医疗	2022-07-20	1,838,000.00	100,000.00	14	3.30	2,358.77	-	-

中信证券	202207200001 2211	蓝 思 科 技	202 2- 07- 20	10,930.00	1,000.00	14	3.1 0	13.18	-	-
中信证券	202207200001 6971	凯 赛 生 物	202 2- 07- 11	-	400.00	28	3.8 0	-	-	-
中信证券	202207210000 1208	锦 浪 科 技	202 2- 07- 21	2,007,068. 00	8,600.00	14	3.7 0	2,887.95	-	-
中信证券	202207210000 9276	爱 尔 眼 科	202 2- 07- 21	137,514.0 0	4,100.00	28	1.8 0	192.52	-	-
中信证券	202207210000 9306	温 氏 股 份	202 2- 07- 21	7,170,000. 00	300,000.0 0	14	3.4 0	9,480.33	-	-
中信证券	202207210000 9338	东 方 财 富	202 2- 07- 21	22,960.00	1,000.00	28	2.6 0	46.43	-	-
中信证券	202207210000 9408	先 导 智 能	202 2- 07- 21	1,003,590. 00	16,200.00	14	1.8 0	702.51	-	-
中信证券	202207210000 9438	乐 普 医 疗	202 2- 07- 21	113,338.0 0	6,100.00	14	1.8 0	79.34	-	-
中信证券	202207210001 0110	沃 森 生 物	202 2- 07- 21	333,750.0 0	7,500.00	14	1.8 0	233.63	-	-
中信证券	202207210001 0154	阳 光 电 源	202 2- 07- 21	4,557,887. 00	39,100.00	14	3.2 0	5,672.04	-	-
中信证券	202207210001 0260	三 环 集 团	202 2- 07- 21	152,475.0 0	5,700.00	14	1.8 0	106.73	-	-
中信证券	202207210001 0404	康 泰 生 物	202 2- 07- 21	40,120.00	1,000.00	14	3.0 0	46.81	-	-
中信证券	202207220000 7207	欣 旺 达	202 2- 07- 22	2,103,288. 00	68,200.00	28	1.8 0	2,944.60	-	-

中信证券	202207220000 7213	阳光 电源	202 2- 07- 22	2,581,598. 00	22,600.00	28	1.8 0	3,614.24	-	-
中信证券	202207260000 1163	蓝思 科技	202 2- 07- 26	520,000.0 0	50,000.00	14	2.4 0	485.33	-	-
中信证券	202207260001 1104	爱尔 眼科	202 2- 07- 26	910,776.0 0	27,700.00	14	3.0 0	1,062.57	-	-
中信证券	202207270002 4322	先导 智能	202 2- 07- 27	1,370,138. 00	21,700.00	14	1.8 0	959.10	-	-
中信证券	202207270002 6016	亿纬 锂能	202 2- 07- 27	494,000.0 0	5,000.00	14	4.5 0	864.50	-	-
中信证券	202207280001 1605	阳光 电源	202 2- 07- 28	1,334,290. 00	10,700.00	14	3.4 0	1,764.23	-	-
中信证券	202207280001 1607	爱尔 眼科	202 2- 07- 28	132,268.0 0	4,300.00	14	3.0 0	154.31	-	-
中信证券	202207280001 1609	迈为 股份	202 2- 07- 28	476,500.0 0	1,000.00	14	3.3 0	611.51	-	-
中信证券	202207280001 4857	金龙 鱼	202 2- 07- 28	785,400.0 0	16,800.00	14	2.2 0	671.95	-	-
中信证券	202207280001 4859	安克 创新	202 2- 07- 28	1,547,544. 00	20,400.00	14	3.5 0	2,106.38	-	-
中信证券	202207280001 4861	温氏 股份	202 2- 07- 28	1,148,500. 00	50,000.00	14	3.1 0	1,384.58	-	-
中信证券	202208010001 4273	亿纬 锂能	202 2- 08- 01	5,069,500. 00	50,000.00	14	3.1 0	6,111.56	-	-
中信证券	202208010001 4275	爱尔 眼科	202 2- 08- 01	449,508.0 0	14,100.00	14	3.2 0	559.39	-	-

中信证券	202208020000 0854	澜 起 科 技	202 2- 08- 02	58,000.00	1,000.00	14	2.8 0	63.16	-	-
中信证券	202208020000 0942	北 京 君 正	202 2- 08- 02	88,900.00	1,000.00	14	3.4 0	117.55	-	-
中信证券	202208020001 1837	康 龙 化 成	202 2- 08- 02	76,800.00	1,000.00	14	4.0 0	119.47	-	-
中信证券	202208020001 1839	安 克 创 新	202 2- 08- 02	1,075,350. 00	15,000.00	14	4.2 0	1,756.41	-	-
中信证券	202208020001 1855	康 泰 生 物	202 2- 08- 02	38,724.00	1,200.00	14	3.4 0	51.20	-	-
中信证券	202208020001 1877	温 氏 股 份	202 2- 08- 02	7,158,000. 00	300,000.0 0	14	3.5 0	9,742.83	-	-
中信证券	202208020001 1891	亿 纬 锂 能	202 2- 08- 02	99,300.00	1,000.00	14	3.1 0	119.71	-	-
中信证券	202208020001 1897	蓝 思 科 技	202 2- 08- 02	348,480.0 0	32,000.00	14	2.4 0	325.25	-	-
中信证券	202208030001 4961	欣 旺 达	202 2- 08- 03	140,150.0 0	5,000.00	14	3.1 0	168.96	-	-
中信证券	202208030001 5017	蓝 思 科 技	202 2- 08- 03	10,660.00	1,000.00	14	2.4 0	9.95	-	-
中信证券	202208030001 5527	爱 尔 眼 科	202 2- 08- 03	40,391.00	1,300.00	14	3.2 0	50.26	-	-
中信证券	202208030001 6191	乐 普 医 疗	202 2- 08- 03	1,717,000. 00	100,000.0 0	14	3.2 0	2,136.71	-	-
中信证券	202208040001 3088	阳 光 电 源	202 2- 08- 04	755,712.0 0	6,400.00	28	1.8 0	1,058.00	-	-

中信证券	202208040001 4766	锦浪科技	2022-08-04	2,048,520.00	8,600.00	14	3.60	2,867.93	-	-
中信证券	202208040001 4880	康泰生物	2022-08-04	33,200.00	1,000.00	14	3.40	43.90	-	-
中信证券	202208040001 4900	温氏股份	2022-08-04	6,945,000.00	300,000.00	14	3.50	9,452.92	-	-
中信证券	202208040001 4952	先导智能	2022-08-04	944,622.00	16,200.00	14	1.80	661.24	-	-
中信证券	202208040001 4970	乐普医疗	2022-08-04	105,591.00	6,100.00	14	1.80	73.91	-	-
中信证券	202208040001 5000	沃森生物	2022-08-04	310,050.00	7,500.00	14	1.80	217.04	-	-
中信证券	202208040001 5034	三环集团	2022-08-04	154,926.00	5,700.00	14	1.80	108.45	-	-
中信证券	202208040001 5336	金龙鱼	2022-07-11	207.90	-	28	3.00	-	-	-
中信证券	202208040001 5436	金龙鱼	2022-07-28	1,293.60	-	14	2.20	-	-	-
中信证券	202208040001 6000	澜起科技	2022-07-11	300.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	202208040001 6219	澜起科技	2022-08-02	300.00	-	14	2.80	-	-	-
中信证券	202208080001 9555	奇安信	2022-08-08	94,197.00	1,700.00	28	2.90	212.47	-	-
中信证券	202208080001 9593	华润微	2022-08-08	84,825.00	1,500.00	28	3.30	217.72	-	-
中信证券	202208080001	沪	2022	109,858.0	4,900.00	28	2.6	222.16	-	-

	9595	硅产业	2-08-08	0			0			
中信证券	2022080800019597	中芯国际	2022-08-08	172,000.00	4,000.00	28	2.60	347.82	-	-
中信证券	2022080800020367	传音控股	2022-08-08	108,825.00	1,500.00	28	2.20	186.21	-	-
中信证券	2022080800020369	凯赛生物	2022-08-08	86,500.00	1,000.00	28	2.60	174.92	-	-
中信证券	2022080800020371	澜起科技	2022-08-08	61,780.00	1,000.00	28	2.70	129.74	-	-
中信证券	2022080800020373	中微公司	2022-08-08	217,350.00	1,500.00	28	4.20	710.01	-	-
中信证券	2022080800020375	容百科技	2022-08-08	127,990.00	1,000.00	28	2.60	258.82	-	-
中信证券	2022080800020419	健帆生物	2022-08-08	44,730.00	1,000.00	28	3.20	111.33	-	-
中信证券	2022080800020423	金山办公	2022-08-08	238,668.00	1,200.00	28	2.60	482.64	-	-
中信证券	2022080800020425	石头科技	2022-08-08	338,000.00	1,000.00	28	3.00	788.67	-	-
中信证券	2022080800020437	中伟股份	2022-08-08	125,000.00	1,000.00	28	3.70	359.72	-	-
中信证券	2022080800020443	爱美客	2022-08-08	576,000.00	1,000.00	28	3.30	1,478.40	-	-
中信证券	2022080800020447	同花顺	2022-08-08	86,440.00	1,000.00	28	3.10	208.42	-	-
中信证券	202208080002	东	202	1,402,049.	64,700.00	28	3.0	3,271.45	-	-

	0451	方 财 富	2- 08- 08	00			0				
中信证券	202208080002 0455	智 飞 生 物	202 2- 08- 08	96,950.00	1,000.00	28	1.4 0	105.57	-	-	
中信证券	202208080002 0457	沃 森 生 物	202 2- 08- 08	466,520.0 0	10,700.00	28	3.0 0	1,088.55	-	-	
中信证券	202208080002 0463	汇 川 技 术	202 2- 08- 08	355,509.0 0	5,700.00	28	2.6 0	718.92	-	-	
中信证券	202208080002 0465	迈 瑞 医 疗	202 2- 08- 08	935,270.0 0	3,100.00	28	2.7 0	1,964.07	-	-	
中信证券	202208080002 0467	卓 胜 微	202 2- 08- 08	156,750.0 0	1,500.00	28	2.9 0	353.56	-	-	
中信证券	202208080002 0471	迈 为 股 份	202 2- 08- 08	452,500.0 0	1,000.00	28	3.3 0	1,161.42	-	-	
中信证券	202208080002 0473	康 龙 化 成	202 2- 08- 08	120,240.0 0	1,600.00	28	3.6 0	336.67	-	-	
中信证券	202208080002 0475	宁 德 时 代	202 2- 08- 08	2,156,450. 00	4,300.00	28	3.9 0	6,541.23	-	-	
中信证券	202208080002 0477	芒 果 超 媒	202 2- 08- 08	76,080.00	2,400.00	28	2.8 0	165.69	-	-	
中信证券	202208080002 0479	三 环 集 团	202 2- 08- 08	216,139.0 0	7,700.00	28	2.7 0	453.89	-	-	
中信证券	202208080002 0481	深 信 服	202 2- 08- 08	107,030.0 0	1,000.00	28	3.1 0	258.06	-	-	
中信证券	202208080002 0483	先 导 智 能	202 2- 08- 08	173,100.0 0	3,000.00	28	2.4 0	323.12	-	-	
中信证券	202208080002	爱	202	177,016.0	5,800.00	28	3.0	413.04	-	-	

	0485	尔眼科	2-08-08	0			0			
中信证券	2022080800020487	亿纬锂能	2022-08-08	211,618.00	2,200.00	28	2.20	362.10	-	-
中信证券	2022080800020493	泰格医药	2022-08-08	313,080.00	3,000.00	28	2.20	535.71	-	-
中信证券	2022080800020495	中科创达	2022-08-08	144,180.00	1,000.00	28	3.30	370.06	-	-
中信证券	2022080800020497	温氏股份	2022-08-08	214,696.00	9,400.00	28	3.40	567.75	-	-
中信证券	2022080800020499	安克创新	2022-08-08	68,990.00	1,000.00	28	4.00	214.64	-	-
中信证券	2022080800020501	贝泰妮	2022-08-08	187,830.00	1,000.00	28	4.00	584.36	-	-
中信证券	2022080800020503	华利集团	2022-08-08	77,103.00	1,300.00	28	3.40	203.89	-	-
中信证券	2022080800020505	圣邦股份	2022-08-08	183,250.00	1,000.00	28	3.30	470.34	-	-
中信证券	2022080800020513	欣旺达	2022-08-08	89,807.00	3,100.00	28	3.30	230.50	-	-
中信证券	2022080800020515	北京君正	2022-08-08	96,990.00	1,000.00	28	3.30	248.94	-	-
中信证券	2022080800020517	阳光电源	2022-08-08	237,160.00	2,000.00	28	2.80	516.48	-	-
中信证券	2022080800020521	康泰生物	2022-08-08	77,440.00	2,200.00	28	3.00	180.69	-	-
中信证券	202208080002	晶	202	266,190.00	3,800.00	28	3.5	724.63	-	-

	0523	盛机电	2-08-08	0			0			
中信证券	2022080800020525	亿联网络	2022-08-08	75,170.00	1,000.00	28	2.80	163.70	-	-
中信证券	2022080800020537	天合光能	2022-08-08	410,800.00	5,200.00	28	3.30	1,054.39	-	-
中信证券	2022080800020539	金龙鱼	2022-08-08	126,765.00	2,700.00	28	2.90	285.93	-	-
中信证券	2022080800020545	乐普医疗	2022-08-08	18,080.00	1,000.00	28	5.90	82.97	-	-
中信证券	2022080900001373	华润微	2022-08-09	1,146,800.00	20,000.00	14	3.40	1,516.32	-	-
中信证券	2022080900001415	亿纬锂能	2022-08-09	196,760.00	2,000.00	14	4.40	336.68	-	-
中信证券	2022080900013110	蓝思科技	2022-08-09	555,500.00	50,000.00	14	2.80	604.88	-	-
中信证券	2022081000032678	亿纬锂能	2022-08-10	470,100.00	5,000.00	14	2.30	420.48	-	-
中信证券	2022081100012382	宁德时代	2022-08-11	12,750,000.00	25,000.00	28	1.80	17,850.00	-	-
中信证券	2022081100014474	迈为股份	2022-08-11	474,250.00	1,000.00	14	3.40	627.06	-	-
中信证券	2022081100014508	温氏股份	2022-08-11	1,110,000.00	50,000.00	14	3.50	1,510.83	-	-
中信证券	2022081100014554	爱尔眼科	2022-08-11	129,301.00	4,300.00	14	3.10	155.88	-	-
中信证券	202208110001	阳	202	1,350,340.	10,700.00	14	2.9	1,522.88	-	-

	4578	光 电 源	2- 08- 11	00			0			
中信证券	202208110001 4636	金 龙 鱼	202 2- 08- 11	791,280.0 0	16,800.00	14	3.0 0	923.16	-	-
中信证券	202208150001 7067	亿 纬 锂 能	202 2- 08- 15	5,247,500. 00	50,000.00	14	4.4 0	8,979.06	-	-
中信证券	202208150001 7069	爱 尔 眼 科	202 2- 08- 15	416,514.0 0	14,100.00	14	3.1 0	502.13	-	-
中信证券	202208160001 0070	澜 起 科 技	202 2- 08- 16	56,450.00	1,000.00	14	3.2 0	70.25	-	-
中信证券	202208160001 0074	北 京 君 正	202 2- 08- 16	88,020.00	1,000.00	14	3.3 0	112.96	-	-
中信证券	202208160001 0076	锦 浪 科 技	202 2- 08- 16	1,026,400. 00	4,000.00	28	3.4 0	2,714.26	-	-
中信证券	202208160001 0082	康 龙 化 成	202 2- 08- 16	75,120.00	1,000.00	14	3.3 0	96.40	-	-
中信证券	202208160001 0084	安 克 创 新	202 2- 08- 16	1,002,300. 00	15,000.00	14	3.5 0	1,364.24	-	-
中信证券	202208160001 0088	康 泰 生 物	202 2- 08- 16	41,988.00	1,200.00	14	3.4 0	55.52	-	-
中信证券	202208160001 0100	亿 纬 锂 能	202 2- 08- 16	104,340.0 0	1,000.00	14	4.4 0	178.54	-	-
中信证券	202208170000 2136	爱 尔 眼 科	202 2- 08- 17	2,916,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	3,742.20	-	-
中信证券	202208170001 8337	欣 旺 达	202 2- 08- 17	160,750.0 0	5,000.00	14	3.2 0	200.04	-	-
中信证券	202208170001	蓝	202	12,090.00	1,000.00	14	3.2	15.05	-	-

	8397	思科技	2-08-17				0			
中信证券	2022081800001204	乐普医疗	2022-08-18	1,234,100.00	70,000.00	14	3.00	1,439.78	-	-
中信证券	2022081800014269	温氏股份	2022-08-18	6,783,000.00	300,000.00	14	3.10	8,177.28	-	-
中信证券	2022081800014289	康泰生物	2022-08-18	34,310.00	1,000.00	14	3.40	45.37	-	-
中信证券	2022081800014699	三环集团	2022-08-18	164,616.00	5,700.00	14	1.80	115.23	-	-
中信证券	2022081800014909	先导智能	2022-08-18	1,014,120.00	16,200.00	14	1.80	709.88	-	-
中信证券	2022081800014941	乐普医疗	2022-08-18	107,543.00	6,100.00	14	1.80	75.28	-	-
中信证券	2022081800015053	沃森生物	2022-08-18	315,600.00	7,500.00	14	1.80	220.92	-	-
中信证券	2022081800015423	东方财富	2022-08-18	23,090.00	1,000.00	28	1.90	34.12	-	-
中信证券	2022081800015435	锦浪科技	2022-08-18	2,433,628.00	8,600.00	14	3.50	3,312.44	-	-
中信证券	2022082300001862	欣旺达	2022-08-23	191,690.00	5,800.00	14	3.40	253.46	-	-
中信证券	2022082300015628	华润微	2022-08-23	1,105,400.00	20,000.00	14	3.20	1,375.61	-	-
中信证券	2022082300015632	亿纬锂能	2022-08-23	235,760.00	2,000.00	14	2.30	210.87	-	-
中信证券	202208230001	蓝	2022	608,000.00	50,000.00	14	3.0	709.33	-	-

	5704	思科技	2-08-23	0			0			
中信证券	2022082400027113	亿纬锂能	2022-08-24	542,400.00	5,000.00	14	2.30	485.15	-	-
中信证券	2022082500010572	迈为股份	2022-08-25	512,350.00	1,000.00	14	2.70	537.97	-	-
中信证券	2022082500010592	爱尔眼科	2022-08-25	127,753.00	4,300.00	14	3.30	163.95	-	-
中信证券	2022082900017123	亿纬锂能	2022-08-29	5,096,000.00	50,000.00	14	3.10	6,582.33	-	-
中信证券	2022082900017125	爱尔眼科	2022-08-29	400,158.00	14,100.00	14	3.40	566.89	-	-
中信证券	2022083000001988	乐普医疗	2022-08-30	564,000.00	30,000.00	14	3.10	679.93	-	-
中信证券	2022083000012470	安克创新	2022-08-30	940,350.00	15,000.00	14	3.40	1,243.35	-	-
中信证券	2022083000012530	亿纬锂能	2022-08-30	100,550.00	1,000.00	14	3.10	121.22	-	-
中信证券	2022083000013222	康龙化成	2022-08-30	66,450.00	1,000.00	14	3.10	80.11	-	-
中信证券	2022083000013254	康泰生物	2022-08-30	40,272.00	1,200.00	14	3.30	51.68	-	-
中信证券	2022083100016458	爱尔眼科	2022-08-31	2,942,000.00	100,000.00	14	3.40	3,889.98	-	-
中信证券	2022083100016468	欣旺达	2022-08-31	136,500.00	5,000.00	14	3.40	180.48	-	-

中信证券	2022083100016620	蓝思科技	2022-08-31	10,880.00	1,000.00	14	2.50	10.58	-	-
中信证券	2022090100001097	温氏股份	2022-09-01	2,402,000.00	100,000.00	28	3.40	6,351.96	-	-
中信证券	2022090100015360	乐普医疗	2022-09-01	1,363,600.00	70,000.00	14	3.20	1,696.92	-	-
中信证券	2022090100015412	温氏股份	2022-09-01	7,206,000.00	300,000.00	14	3.30	9,247.70	-	-
中信证券	2022090100015508	康泰生物	2022-09-01	33,800.00	1,000.00	14	3.30	43.38	-	-
中信证券	2022090100017806	沃森生物	2022-09-01	324,750.00	7,500.00	14	1.80	227.33	-	-
中信证券	2022090100017824	先导智能	2022-09-01	871,722.00	16,200.00	14	1.80	610.21	-	-
中信证券	2022090100018636	乐普医疗	2022-09-01	118,828.00	6,100.00	14	1.80	83.18	-	-
中信证券	2022090100018654	三环集团	2022-09-01	152,475.00	5,700.00	14	1.80	106.73	-	-
中信证券	2022090100018706	阳光电源	2022-09-01	715,520.00	6,400.00	28	1.80	1,001.73	-	-
中信证券	2022090200001504	中科创达	2022-09-02	2,379,400.00	20,000.00	14	3.40	3,146.10	-	-
中信证券	2022090500023159	中芯国际	2022-09-05	159,760.00	4,000.00	28	2.60	403.84	-	-
中信证券	2022090500023161	乐普医	2022-09-05	20,210.00	1,000.00	28	3.00	58.95	-	-

中信证券	2022090500023195	疗传音控股	2022-09-05	94,125.00	1,500.00	28	2.90	265.38	-	-
中信证券	2022090500023205	北京君正	2022-09-05	78,100.00	1,000.00	28	3.20	242.98	-	-
中信证券	2022090500023211	金山办公	2022-09-05	226,656.00	1,200.00	28	2.90	639.05	-	-
中信证券	2022090500023223	奇安信	2022-09-05	87,278.00	1,700.00	28	3.00	254.56	-	-
中信证券	2022090500023225	中伟股份	2022-09-05	92,010.00	1,000.00	28	4.00	357.81	-	-
中信证券	2022090500023227	爱美客	2022-09-05	535,600.00	1,000.00	28	3.10	1,614.24	-	-
中信证券	2022090500023237	同花顺	2022-09-05	82,780.00	1,000.00	28	3.20	257.54	-	-
中信证券	2022090500023243	智飞生物	2022-09-05	93,020.00	1,000.00	28	2.80	253.22	-	-
中信证券	2022090500023245	沃森生物	2022-09-05	452,610.00	10,700.00	28	3.00	1,320.11	-	-
中信证券	2022090500023247	汇川技术	2022-09-05	336,015.00	5,700.00	28	2.70	882.04	-	-
中信证券	2022090500023249	凯赛生物	2022-09-05	68,300.00	1,000.00	28	3.10	205.85	-	-
中信证券	2022090500023251	东方财富	2022-09-05	1,418,224.00	64,700.00	28	3.00	4,136.49	-	-
中信证券	2022090500023259	容百科	2022-09-05	99,430.00	1,000.00	28	3.10	299.67	-	-

中信证券	202209050002 3261	技 阳 光 电 源	202 2- 09- 05	233,940.0 0	2,000.00	28	3.2 0	727.81	-	-
中信证券	202209050002 3263	澜 起 科 技	202 2- 09- 05	56,430.00	1,000.00	28	2.9 0	159.10	-	-
中信证券	202209050002 3265	中 微 公 司	202 2- 09- 05	183,750.0 0	1,500.00	28	3.7 0	660.99	-	-
中信证券	202209050002 3267	康 泰 生 物	202 2- 09- 05	72,072.00	2,200.00	28	3.3 0	231.23	-	-
中信证券	202209050002 3269	晶 盛 机 电	202 2- 09- 05	281,960.0 0	3,800.00	28	3.0 0	822.39	-	-
中信证券	202209050002 3271	亿 联 网 络	202 2- 09- 05	71,840.00	1,000.00	28	3.1 0	216.51	-	-
中信证券	202209050002 3273	圣 邦 股 份	202 2- 09- 05	154,510.0 0	1,000.00	28	3.0 0	450.65	-	-
中信证券	202209050002 3287	华 润 微	202 2- 09- 05	76,740.00	1,500.00	28	3.3 0	246.21	-	-
中信证券	202209050002 3293	天 合 光 能	202 2- 09- 05	370,500.0 0	5,200.00	28	3.0 0	1,080.63	-	-
中信证券	202209050002 3295	金 龙 鱼	202 2- 09- 05	119,502.0 0	2,700.00	28	2.1 0	243.99	-	-
中信证券	202209050002 3297	沪 硅 产 业	202 2- 09- 05	101,381.0 0	4,900.00	28	3.0 0	295.70	-	-
中信证券	202209050002 3299	石 头 科 技	202 2- 09- 05	304,000.0 0	1,000.00	28	2.9 0	857.11	-	-
中信证券	202209050002 3301	欣 旺 达	202 2- 09-	85,560.00	3,100.00	28	3.3 0	274.50	-	-

			05							
中信证券	202209050002 3303	迈 为 股 份	202 2- 09- 05	521,900.0 0	1,000.00	28	3.0 0	1,522.21	-	-
中信证券	202209050002 3305	康 龙 化 成	202 2- 09- 05	101,760.0 0	1,600.00	28	3.1 0	306.69	-	-
中信证券	202209050002 3307	宁 德 时 代	202 2- 09- 05	2,013,948. 00	4,300.00	28	3.2 0	6,265.61	-	-
中信证券	202209050002 3309	迈 瑞 医 疗	202 2- 09- 05	918,747.0 0	3,100.00	28	2.8 0	2,501.04	-	-
中信证券	202209050002 3311	卓 胜 微	202 2- 09- 05	147,900.0 0	1,500.00	28	3.1 0	445.75	-	-
中信证券	202209050002 3313	安 克 创 新	202 2- 09- 05	59,580.00	1,000.00	28	3.1 0	179.56	-	-
中信证券	202209050002 3315	贝 泰 妮	202 2- 09- 05	182,440.0 0	1,000.00	28	3.3 0	585.33	-	-
中信证券	202209050002 3317	华 利 集 团	202 2- 09- 05	77,220.00	1,300.00	28	3.2 0	240.24	-	-
中信证券	202209050002 3323	爱 尔 眼 科	202 2- 09- 05	158,108.0 0	5,800.00	28	3.3 0	507.26	-	-
中信证券	202209050002 3325	亿 纬 锂 能	202 2- 09- 05	210,298.0 0	2,200.00	28	2.9 0	592.92	-	-
中信证券	202209050002 3327	泰 格 医 药	202 2- 09- 05	305,610.0 0	3,000.00	28	3.0 0	891.36	-	-
中信证券	202209050002 3329	芒 果 超 媒	202 2- 09- 05	66,048.00	2,400.00	28	3.5 0	224.75	-	-
中信证券	202209050002 3331	三 环 集	202 2- 09- 05	204,358.0 0	7,700.00	28	3.2 0	635.78	-	-

		团								
中信证券	202209050002 3333	深信服	202 2- 09- 05	106,030.0 0	1,000.00	28	2.6 0	268.02	-	-
中信证券	202209050002 3335	先导智能	202 2- 09- 05	157,440.0 0	3,000.00	28	3.1 0	474.51	-	-
中信证券	202209050002 3339	中科创达	202 2- 09- 05	120,110.0 0	1,000.00	28	3.3 0	385.35	-	-
中信证券	202209050002 3341	温氏股份	202 2- 09- 05	226,916.0 0	9,400.00	28	3.4 0	750.09	-	-
中信证券	202209050002 3343	健帆生物	202 2- 09- 05	47,700.00	1,000.00	28	2.9 0	134.49	-	-
中信证券	202209060000 1259	欧普康视	202 2- 09- 06	404,900.0 0	10,000.00	14	4.9 0	771.56	-	-
中信证券	202209060001 4153	欣旺达	202 2- 09- 06	163,328.0 0	5,800.00	14	3.4 0	215.96	-	-
中信证券	202209060001 4175	亿纬锂能	202 2- 09- 06	189,600.0 0	2,000.00	14	3.0 0	221.20	-	-
中信证券	202209070002 9824	亿纬锂能	202 2- 09- 07	492,450.0 0	5,000.00	14	3.0 0	574.53	-	-
中信证券	202209080001 5076	爱尔眼科	202 2- 09- 08	121,604.0 0	4,300.00	14	3.4 0	160.79	-	-
中信证券	202209080001 5136	宁德时代	202 2- 09- 08	11,237,50 0.00	25,000.00	28	1.8 0	17,980.00	-	-
中信证券	202209080001 5302	迈为股份	202 2- 09- 08	537,000.0 0	1,000.00	14	3.1 0	647.38	-	-
中信证券	202209130002 7453	乐普医	202 2- 09-	641,700.0 0	30,000.00	14	2.8 0	698.74	-	-

		疗	13							
中信证券	202209130002 7461	康 龙 化 成	202 2- 09- 13	55,760.00	1,000.00	14	3.4 0	73.73	-	-
中信证券	202209130002 7475	锦 浪 科 技	202 2- 09- 13	1,021,200. 00	4,000.00	28	3.9 0	3,097.64	-	-
中信证券	202209130002 7493	康 泰 生 物	202 2- 09- 13	39,084.00	1,200.00	14	2.9 0	44.08	-	-
中信证券	202209130002 7503	安 克 创 新	202 2- 09- 13	907,350.0 0	15,000.00	14	4.1 0	1,446.72	-	-
中信证券	202209130002 7537	亿 纬 锂 能	202 2- 09- 13	4,849,000. 00	50,000.00	14	2.7 0	5,091.45	-	-
中信证券	202209130002 7539	爱 尔 眼 科	202 2- 09- 13	418,065.0 0	14,100.00	14	3.2 0	520.26	-	-
中信证券	202209140000 1741	安 克 创 新	202 2- 09- 14	59,870.00	1,000.00	14	3.0 0	69.85	-	-
中信证券	202209140001 8742	蓝 思 科 技	202 2- 09- 14	10,770.00	1,000.00	14	2.3 0	9.63	-	-
中信证券	202209140001 8828	欣 旺 达	202 2- 09- 14	130,450.0 0	5,000.00	14	3.1 0	157.26	-	-
中信证券	202209140001 9298	爱 尔 眼 科	202 2- 09- 14	2,953,000. 00	100,000.0 0	14	3.2 0	3,674.84	-	-
中信证券	202209150001 6297	康 泰 生 物	202 2- 09- 15	31,800.00	1,000.00	14	2.9 0	35.86	-	-
中信证券	202209150001 6299	东 方 财 富	202 2- 09- 15	22,350.00	1,000.00	28	2.0 0	34.77	-	-
中信证券	202209150001 6323	乐 普	202 2- 09-	1,449,000. 00	70,000.00	14	2.8 0	1,577.80	-	-

		医疗	15							
中信证券	202209150001 6429	沃森生物	202 2- 09- 15	305,625.0 0	7,500.00	14	1.8 0	213.94	-	-
中信证券	202209150001 7621	三环集团	202 2- 09- 15	153,159.0 0	5,700.00	14	1.8 0	107.21	-	-
中信证券	202209150001 7623	先导智能	202 2- 09- 15	826,524.0 0	16,200.00	14	1.8 0	578.57	-	-
中信证券	202209150001 8171	乐普医疗	202 2- 09- 15	126,270.0 0	6,100.00	14	1.8 0	88.39	-	-
中信证券	202209160001 1808	中科创达	202 2- 09- 16	2,240,200. 00	20,000.00	14	3.5 0	3,049.16	-	-
中信证券	202209200001 4567	亿纬锂能	202 2- 09- 20	170,360.0 0	2,000.00	14	2.3 0	217.68	-	-
中信证券	202209200001 8815	欧普康视	202 2- 09- 20	399,400.0 0	10,000.00	14	9.1 0	2,019.19	-	-
中信证券	202209200001 9129	欣旺达	202 2- 09- 20	145,870.0 0	5,800.00	14	3.4 0	275.53	-	-
中信证券	202209210000 1280	锦浪科技	202 2- 09- 21	2,342,700. 00	10,000.00	28	1.8 0	3,279.78	-	-
中信证券	202209210000 1284	深信服	202 2- 09- 21	130,560.0 0	1,200.00	14	3.3 0	227.39	-	-
中信证券	202209210002 6946	亿纬锂能	202 2- 09- 21	432,000.0 0	5,000.00	14	2.3 0	524.40	-	-
中信证券	202209220001 1381	迈为股份	202 2- 09- 22	502,780.0 0	1,000.00	14	3.3 0	829.58	-	-
中信证券	202209220001 2487	爱尔	202 2-	110,209.0 0	4,300.00	14	3.3 0	181.84	-	-

		眼科	09-22							
中信证券	2022092700001150	卓胜微	2022-09-27	425,260.00	4,400.00	14	3.10	512.67	-	-
中信证券	2022092700001176	欣旺达	2022-09-27	259,766.00	10,300.00	14	2.70	272.75	-	-
中信证券	2022092700001183	乐普医疗	2022-09-27	228,712.00	11,300.00	14	4.70	418.03	-	-
中信证券	2022092700022973	康泰生物	2022-09-27	37,092.00	1,200.00	14	2.50	36.06	-	-
中信证券	2022092700022989	爱尔眼科	2022-09-27	406,926.00	14,100.00	14	3.30	522.22	-	-
中信证券	2022092700023087	康龙化成	2022-09-27	54,260.00	1,000.00	14	3.00	63.30	-	-
中信证券	2022092700023097	乐普医疗	2022-09-27	607,200.00	30,000.00	14	4.60	1,086.21	-	-
中信证券	2022092700023099	亿纬锂能	2022-09-27	4,501,500.00	50,000.00	14	2.90	5,076.69	-	-
中信证券	2022092700023139	安克创新	2022-09-27	853,650.00	15,000.00	14	2.80	929.53	-	-
中信证券	2022092700030751	宁德时代	2022-09-05	2,807.04	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2022092700030777	宁德时代	2022-09-08	16,320.00	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022092800015903	爱尔眼科	2022-09-28	2,887,000.00	100,000.00	14	3.30	3,704.98	-	-
中信证券	2022092800015913	安克	2022-	56,120.00	1,000.00	14	2.80	61.11	-	-

		创新	09-28							
中信证券	2022092800015923	欣旺达	2022-09-28	120,000.00	5,000.00	14	3.20	149.33	-	-
中信证券	2022092800015937	蓝思科技	2022-09-28	9,330.00	1,000.00	14	2.30	8.35	-	-
中信证券	2022092900000879	蓝思科技	2022-09-29	12,908.00	1,400.00	28	2.00	20.08	-	-
中信证券	2022092900016185	阳光电源	2022-09-29	522,100.00	6,400.00	28	1.80	1,016.96	-	-
中信证券	2022092900016391	乐普医疗	2022-09-29	1,480,500.00	70,000.00	14	4.60	2,648.45	-	-
中信证券	2022092900016393	康泰生物	2022-09-29	30,530.00	1,000.00	14	2.50	29.68	-	-
中信证券	2022093000010017	中科创达	2022-09-30	2,111,600.00	20,000.00	14	3.20	2,627.77	-	-
中信证券	2022101000083847	欣旺达	2022-10-10	70,432.00	3,100.00	28	2.60	142.43	-	-
中信证券	2022101000083849	乐普医疗	2022-10-10	20,870.00	1,000.00	28	4.60	74.67	-	-
中信证券	2022101000087831	中芯国际	2022-10-10	150,880.00	4,000.00	28	2.30	269.91	-	-
中信证券	2022101000088193	宁德时代	2022-10-10	9,821,500.00	25,000.00	28	1.80	13,750.10	-	-
中信证券	2022101000094281	天合光能	2022-10-10	326,144.00	5,200.00	28	3.40	862.47	-	-
中信证券	2022101000099239	先导	2022-	139,680.00	3,000.00	28	2.70	293.33	-	-

		智能	10-10							
中信证券	2022101000101789	澜起科技	2022-10-10	44,100.00	1,000.00	28	3.40	116.62	-	-
中信证券	2022101000101791	中微公司	2022-10-10	130,410.00	1,500.00	28	3.30	334.72	-	-
中信证券	2022101000103679	迈为股份	2022-10-10	479,900.00	1,000.00	14	2.90	541.22	-	-
中信证券	2022101000104595	欧普康视	2022-10-10	397,700.00	10,000.00	14	5.90	912.50	-	-
中信证券	2022101000107265	欣旺达	2022-10-10	131,776.00	5,800.00	14	2.70	138.36	-	-
中信证券	2022101000107307	深信服	2022-10-10	106,032.00	1,200.00	14	3.30	136.07	-	-
中信证券	2022101000107771	爱尔眼科	2022-10-10	118,680.00	4,300.00	14	3.10	143.08	-	-
中信证券	2022101000107813	亿纬锂能	2022-10-10	410,500.00	5,000.00	14	3.20	510.84	-	-
中信证券	2022101000107857	亿纬锂能	2022-10-10	164,200.00	2,000.00	14	3.20	204.34	-	-
中信证券	2022101100023169	乐普医疗	2022-10-11	232,554.00	11,300.00	14	4.70	425.06	-	-
中信证券	2022101100023267	乐普医疗	2022-10-11	617,400.00	30,000.00	14	4.70	1,128.47	-	-
中信证券	2022101100023275	亿纬锂能	2022-10-11	4,358,000.00	50,000.00	14	3.20	5,423.29	-	-
中信证券	2022101100023285	爱尔	2022-	382,674.00	14,100.00	14	3.10	461.33	-	-

		眼科	10-11							
中信证券	2022101100024249	欣旺达	2022-10-11	239,990.00	10,300.00	14	2.70	251.99	-	-
中信证券	2022101100024251	卓胜微	2022-10-11	349,360.00	4,400.00	14	3.10	421.17	-	-
中信证券	2022101100024275	锦浪科技	2022-10-11	799,600.00	4,000.00	28	3.20	1,990.12	-	-
中信证券	2022101100024299	康龙化成	2022-10-11	49,610.00	1,000.00	14	2.70	52.09	-	-
中信证券	2022101100024321	安克创新	2022-10-11	780,750.00	15,000.00	14	3.20	971.60	-	-
中信证券	2022101100024533	康泰生物	2022-10-11	33,312.00	1,200.00	14	2.90	37.57	-	-
中信证券	2022101200016054	欣旺达	2022-10-12	123,250.00	5,000.00	14	2.70	129.41	-	-
中信证券	2022101200016106	安克创新	2022-10-12	54,160.00	1,000.00	14	3.20	67.40	-	-
中信证券	2022101200016158	蓝思科技	2022-10-12	9,480.00	1,000.00	14	2.10	7.74	-	-
中信证券	2022101300015788	乐普医疗	2022-10-13	1,526,700.00	70,000.00	14	4.70	2,790.47	-	-
中信证券	2022101300016530	康泰生物	2022-10-13	29,760.00	1,000.00	14	2.90	33.56	-	-
中信证券	2022101400011020	中科创达	2022-10-14	2,212,000.00	20,000.00	14	3.50	3,010.78	-	-
中信证券	2022101800001622	欣旺	2022-10-	454,491.00	18,100.00	14	3.10	547.91	-	-

		达	18							
中信证券	202210190000 1171	中 伟 股 份	202 2- 10- 19	592,000.0 0	7,400.00	14	3.9 0	897.87	-	-
中信证券	202210190000 1175	乐 普 医 疗	202 2- 10- 19	445,534.0 0	17,800.00	14	3.7 0	641.07	-	-
中信证券	202210190000 1190	欣 旺 达	202 2- 10- 19	677,026.0 0	25,900.00	14	3.1 0	816.19	-	-
中信证券	202210190000 4730	锦 浪 科 技	202 2- 10- 19	2,064,200. 00	10,000.00	28	1.8 0	206.42	-	-
中信证券	202210200000 1268	阳 光 电 源	202 2- 10- 20	3,136,000. 00	24,500.00	14	3.1 0	3,780.62	-	-
中信证券	202210200000 1298	金 山 办 公	202 2- 10- 20	4,531,200. 00	17,700.00	14	2.7 0	4,757.76	-	-
中信证券	202210200000 3132	锦 浪 科 技	202 2- 10- 19	2,064,200. 00	10,000.00	2	1.8 0	206.42	-	-
中信证券	202210240008 1815	欧 普 康 视	202 2- 10- 24	422,300.0 0	10,000.00	14	3.5 0	574.80	-	-
中信证券	202210240008 1837	亿 纬 锂 能	202 2- 10- 24	446,750.0 0	5,000.00	14	1.2 0	208.48	-	-
中信证券	202210240008 1899	深 信 服	202 2- 10- 24	134,148.0 0	1,200.00	14	3.0 0	156.51	-	-
中信证券	202210240008 6655	迈 为 股 份	202 2- 10- 24	459,000.0 0	1,000.00	14	3.1 0	553.35	-	-
中信证券	202210240008 7693	亿 纬 锂 能	202 2- 10- 24	178,700.0 0	2,000.00	14	1.2 0	83.39	-	-
中信证券	202210240008 7743	爱 尔 眼	202 2- 10-	120,873.0 0	4,300.00	14	3.3 0	155.12	-	-

		科	24							
中信证券	2022102400090289	欣旺达	2022-10-24	140,940.00	5,800.00	14	3.40	186.35	-	-
中信证券	2022102500002095	容百科技	2022-10-25	325,760.00	4,000.00	14	3.10	392.72	-	-
中信证券	2022102500024548	康龙化成	2022-10-25	46,850.00	1,000.00	14	2.70	49.19	-	-
中信证券	2022102500024556	卓胜微	2022-10-25	364,848.00	4,400.00	14	2.90	411.47	-	-
中信证券	2022102500024624	欣旺达	2022-10-25	252,453.00	10,300.00	14	3.10	304.35	-	-
中信证券	2022102500024638	康泰生物	2022-10-25	34,800.00	1,200.00	14	3.00	40.60	-	-
中信证券	2022102500024676	安克创新	2022-10-25	829,200.00	15,000.00	14	3.40	1,096.39	-	-
中信证券	2022102500024678	亿纬锂能	2022-10-25	4,600,000.00	50,000.00	14	2.80	5,008.89	-	-
中信证券	2022102500024686	乐普医疗	2022-10-25	273,912.00	11,300.00	14	3.70	394.13	-	-
中信证券	2022102500024690	乐普医疗	2022-10-25	727,200.00	30,000.00	14	3.70	1,046.36	-	-
中信证券	2022102500024698	爱尔眼科	2022-10-25	392,403.00	14,100.00	14	3.10	473.06	-	-
中信证券	2022102600002334	欣旺达	2022-10-26	412,132.00	16,400.00	14	3.60	576.98	-	-
中信证券	2022102600002338	锦浪科技	2022-10-26	2,026,700.00	10,000.00	14	3.90	3,073.83	-	-

中信证券	202210260001 8532	蓝 思 科 技	202 2- 10- 26	9,530.00	1,000.00	14	2.2 0	8.15	-	-
中信证券	202210260001 8540	欣 旺 达	202 2- 10- 26	125,650.0 0	5,000.00	14	3.1 0	151.48	-	-
中信证券	202210260001 8570	安 克 创 新	202 2- 10- 26	58,160.00	1,000.00	14	3.4 0	76.90	-	-
中信证券	202210270001 6339	阳 光 电 源	202 2- 10- 27	585,288.0 0	4,600.00	28	1.8 0	856.65	-	-
中信证券	202210270001 9227	蓝 思 科 技	202 2- 10- 27	14,266.00	1,400.00	28	2.1 0	23.30	-	-
中信证券	202210270001 9321	乐 普 医 疗	202 2- 10- 27	1,735,300. 00	70,000.00	14	3.7 0	2,496.90	-	-
中信证券	202210280001 2593	中 科 创 达	202 2- 10- 28	1,924,000. 00	20,000.00	14	3.3 0	2,469.13	-	-
中信证券	202211010000 1295	泰 格 医 药	202 2- 11- 01	905,100.0 0	10,000.00	14	3.0 0	1,055.95	-	-
中信证券	202211010000 1313	中 科 创 达	202 2- 11- 01	1,859,902. 00	18,700.00	14	3.4 0	2,459.20	-	-
中信证券	202211010000 1319	贝 泰 妮	202 2- 11- 01	1,545,000. 00	10,000.00	28	3.4 0	4,085.67	-	-
中信证券	202211010000 9104	欣 旺 达	202 2- 11- 01	454,310.0 0	18,100.00	14	3.6 0	636.03	-	-
中信证券	202211020001 0026	中 伟 股 份	202 2- 11- 02	595,330.0 0	7,400.00	14	4.1 0	949.22	-	-
中信证券	202211020001 0028	欣 旺 达	202 2- 11- 02	649,572.0 0	25,900.00	14	3.6 0	909.40	-	-
中信证券	202211020001	乐	202	456,214.0	17,800.00	14	3.6	638.70	-	-

	0032	普医疗	2-11-02	0			0			
中信证券	2022110300001654	中微公司	2022-11-03	115,170.00	1,000.00	14	3.60	161.24	-	-
中信证券	2022110300006205	金山办公	2022-11-03	4,725,900.00	17,700.00	14	3.00	5,513.55	-	-
中信证券	2022110300006209	阳光电源	2022-11-03	3,319,750.00	24,500.00	14	3.30	4,260.35	-	-
中信证券	2022110700077611	亿纬锂能	2022-11-07	194,720.00	2,000.00	14	2.20	166.59	-	-
中信证券	2022110700088877	欣旺达	2022-11-07	153,526.00	5,800.00	14	4.00	238.82	-	-
中信证券	2022110700088905	澜起科技	2022-11-07	64,880.00	1,000.00	28	3.10	156.43	-	-
中信证券	2022110700088907	中微公司	2022-11-07	163,845.00	1,500.00	28	3.50	446.02	-	-
中信证券	2022110700090413	天合光能	2022-11-07	388,440.00	5,200.00	28	5.00	1,510.60	-	-
中信证券	2022110700091725	亿纬锂能	2022-11-07	486,800.00	5,000.00	14	2.20	416.48	-	-
中信证券	2022110700091759	欧普康视	2022-11-07	329,400.00	10,000.00	14	4.90	627.69	-	-
中信证券	2022110700094523	深信服	2022-11-07	151,968.00	1,200.00	14	3.30	195.03	-	-
中信证券	2022110700094901	迈为股份	2022-11-07	509,150.00	1,000.00	14	3.40	673.21	-	-
中信证券	202211070009	欣	202	82,057.00	3,100.00	28	3.9	248.91	-	-

	5017	旺达	2-11-07				0			
中信证券	2022110700095021	乐普医疗	2022-11-07	25,050.00	1,000.00	28	3.60	70.14	-	-
中信证券	2022110700095023	先导智能	2022-11-07	159,600.00	3,000.00	28	2.90	359.99	-	-
中信证券	2022110700095801	中芯国际	2022-11-07	167,520.00	4,000.00	28	3.10	403.91	-	-
中信证券	2022110700096935	爱尔眼科	2022-11-07	115,283.00	4,300.00	14	3.80	170.36	-	-
中信证券	2022110700099779	宁德时代	2022-11-07	10,262,500.00	25,000.00	28	1.80	14,367.50	-	-
中信证券	2022110800001781	华熙生物	2022-11-08	1,472,175.00	13,500.00	14	3.70	2,118.30	-	-
中信证券	2022110800026309	卓胜微	2022-11-08	450,120.00	4,400.00	14	3.30	577.65	-	-
中信证券	2022110800026319	康龙化成	2022-11-08	67,120.00	1,000.00	14	3.20	83.53	-	-
中信证券	2022110800026339	亿纬锂能	2022-11-08	4,831,500.00	50,000.00	14	2.20	4,133.62	-	-
中信证券	2022110800026343	爱尔眼科	2022-11-08	371,535.00	14,100.00	14	3.80	549.05	-	-
中信证券	2022110800026353	康泰生物	2022-11-08	42,060.00	1,200.00	14	3.30	53.98	-	-
中信证券	2022110800026373	安克创新	2022-11-08	876,450.00	15,000.00	14	3.30	1,124.78	-	-
中信证券	202211080002	锦	202	843,520.00	4,000.00	28	3.7	2,427.46	-	-

	7561	浪科技	2-11-08	0			0			
中信证券	2022110800027567	乐普医疗	2022-11-08	720,600.00	30,000.00	14	3.70	1,036.86	-	-
中信证券	2022110800027571	乐普医疗	2022-11-08	271,426.00	11,300.00	14	3.70	390.55	-	-
中信证券	2022110800027623	欣旺达	2022-11-08	266,049.00	10,300.00	14	4.00	413.85	-	-
中信证券	2022110800029239	容百科技	2022-11-08	355,080.00	4,000.00	14	3.30	455.69	-	-
中信证券	2022110900022299	欣旺达	2022-11-09	417,544.00	16,400.00	14	4.00	649.51	-	-
中信证券	2022110900022313	欣旺达	2022-11-09	127,300.00	5,000.00	14	4.00	198.02	-	-
中信证券	2022110900023051	安克创新	2022-11-09	57,880.00	1,000.00	14	3.30	74.28	-	-
中信证券	2022110900023131	蓝思科技	2022-11-09	10,150.00	1,000.00	14	2.70	10.66	-	-
中信证券	2022110900023173	锦浪科技	2022-11-09	2,090,100.00	10,000.00	14	3.80	3,088.70	-	-
中信证券	2022111000018140	乐普医疗	2022-11-10	1,676,500.00	70,000.00	14	3.70	2,412.30	-	-
中信证券	2022111100014059	中科创达	2022-11-11	2,457,600.00	20,000.00	14	3.40	3,249.49	-	-
中信证券	2022111500001356	沃森生物	2022-11-15	72,369.00	1,700.00	14	2.50	70.36	-	-
中信证券	2022111500001369	乐	2022-	235,800.00	10,000.00	14	3.70	339.29	-	-

		普医疗	11-15							
中信证券	2022111500009446	欣旺达	2022-11-15	467,523.00	18,100.00	14	4.20	763.62	-	-
中信证券	2022111500009824	中科创达	2022-11-15	2,237,455.00	18,700.00	14	3.40	2,958.41	-	-
中信证券	2022111600001050	同花顺	2022-11-16	122,486.00	1,300.00	14	3.30	157.19	-	-
中信证券	2022111600008017	中伟股份	2022-11-16	599,844.00	7,400.00	14	3.70	863.11	-	-
中信证券	2022111600008019	乐普医疗	2022-11-16	420,080.00	17,800.00	14	4.00	653.46	-	-
中信证券	2022111600008021	欣旺达	2022-11-16	647,500.00	25,900.00	14	4.20	1,057.58	-	-
中信证券	2022111700007116	金山办公	2022-11-17	5,006,976.00	17,700.00	14	3.40	6,620.33	-	-
中信证券	2022111700007222	阳光电源	2022-11-17	2,818,725.00	24,500.00	14	3.50	3,836.60	-	-
中信证券	2022111800001747	乐普医疗	2022-11-18	142,080.00	6,000.00	14	1.80	99.46	-	-
中信证券	2022111800001752	健帆生物	2022-11-18	134,000.00	4,000.00	14	1.80	93.80	-	-
中信证券	2022112100062004	亿纬锂能	2022-11-21	170,120.00	2,000.00	14	3.10	205.09	-	-
中信证券	2022112100062148	欣旺达	2022-11-21	143,202.00	5,800.00	14	5.10	284.02	-	-
中信证券	2022112100062762	爱尔	2022-	115,584.00	4,300.00	14	3.10	139.34	-	-

		眼科	11-21							
中信证券	2022112100062860	迈为股份	2022-11-21	457,140.00	1,000.00	14	3.50	622.22	-	-
中信证券	2022112100070732	深信服	2022-11-21	141,924.00	1,200.00	14	3.20	176.62	-	-
中信证券	2022112100070806	欧普康视	2022-11-21	324,100.00	10,000.00	14	4.20	529.36	-	-
中信证券	2022112200001565	安克创新	2022-11-22	597,700.00	10,000.00	14	3.20	743.80	-	-
中信证券	2022112200001566	卓胜微	2022-11-22	1,971,480.00	16,800.00	14	3.50	2,683.40	-	-
中信证券	2022112200020403	卓胜微	2022-11-22	516,340.00	4,400.00	14	3.20	642.56	-	-
中信证券	2022112200020461	容百科技	2022-11-22	305,200.00	4,000.00	14	3.20	379.80	-	-
中信证券	2022112200020843	华熙生物	2022-11-22	1,459,350.00	13,500.00	14	3.40	1,929.59	-	-
中信证券	2022112200020895	安克创新	2022-11-22	896,550.00	15,000.00	14	3.50	1,220.30	-	-
中信证券	2022112200020913	乐普医疗	2022-11-22	258,544.00	11,300.00	14	3.70	372.02	-	-
中信证券	2022112200020915	乐普医疗	2022-11-22	686,400.00	30,000.00	14	3.70	987.65	-	-
中信证券	2022112200020921	亿纬锂能	2022-11-22	4,132,500.00	50,000.00	14	3.10	4,981.96	-	-
中信证券	2022112200020951	欣旺	2022-11-	249,672.00	10,300.00	14	5.10	495.18	-	-

		达	22							
中信证券	2022112200020963	爱尔眼科	2022-11-22	375,624.00	14,100.00	14	3.10	452.84	-	-
中信证券	2022112300001606	爱尔眼科	2022-11-23	525,400.00	20,000.00	14	3.40	694.70	-	-
中信证券	2022112300001608	爱尔眼科	2022-11-23	525,400.00	20,000.00	14	3.40	694.70	-	-
中信证券	2022112300001627	宁德时代	2022-11-23	3,795,200.00	10,000.00	14	1.80	2,656.64	-	-
中信证券	2022112300014708	蓝思科技	2022-11-23	10,500.00	1,000.00	14	3.50	14.29	-	-
中信证券	2022112300014760	欣旺达	2022-11-23	398,028.00	16,400.00	14	5.10	789.42	-	-
中信证券	2022112300014762	欣旺达	2022-11-23	121,350.00	5,000.00	14	5.10	240.68	-	-
中信证券	2022112300014768	安克创新	2022-11-23	59,330.00	1,000.00	14	3.50	80.75	-	-
中信证券	2022112300014804	锦浪科技	2022-11-23	2,018,800.00	10,000.00	14	3.50	2,747.81	-	-
中信证券	2022112400001364	深信服	2022-11-24	3,292,300.00	29,200.00	14	3.30	4,225.12	-	-
中信证券	2022112400001391	中科创达	2022-11-24	584,500.00	5,000.00	14	3.50	795.57	-	-
中信证券	2022112400001395	锦浪科技	2022-11-24	493,632.00	2,400.00	14	3.70	710.28	-	-
中信证券	2022112400001406	圣邦股	2022-11-24	3,593,730.00	21,000.00	14	3.50	4,891.47	-	-

中信证券	202211240001 4594	份 蓝 思 科 技	202 2- 11- 24	14,490.00	1,400.00	28	2.1 0	23.67	-	-
中信证券	202211240001 7454	乐 普 医 疗	202 2- 11- 24	1,601,600. 00	70,000.00	14	3.7 0	2,304.52	-	-
中信证券	202211240001 7804	阳 光 电 源	202 2- 11- 24	523,732.0 0	4,400.00	7	1.8 0	183.31	-	-
中信证券	202211250000 7574	中 科 创 达	202 2- 11- 25	2,278,000. 00	20,000.00	14	3.4 0	3,012.02	-	-
中信证券	202211290001 6934	贝 泰 妮	202 2- 11- 29	1,312,400. 00	10,000.00	14	3.6 0	1,837.36	-	-
中信证券	202211290001 7012	欣 旺 达	202 2- 11- 29	435,667.0 0	18,100.00	14	5.0 0	847.13	-	-
中信证券	202211290001 7020	中 科 创 达	202 2- 11- 29	2,083,554. 00	18,700.00	14	3.5 0	2,835.95	-	-
中信证券	202211290001 7032	沃 森 生 物	202 2- 11- 29	76,704.00	1,700.00	14	3.4 0	101.42	-	-
中信证券	202211300000 6193	同 花 顺	202 2- 11- 30	130,728.0 0	1,300.00	14	3.4 0	172.85	-	-
中信证券	202211300000 6531	欣 旺 达	202 2- 11- 30	626,780.0 0	25,900.00	14	5.0 0	1,218.74	-	-
中信证券	202211300000 8853	中 伟 股 份	202 2- 11- 30	560,402.0 0	7,400.00	14	3.7 0	806.36	-	-
中信证券	202212010000 1193	圣 邦 股 份	202 2- 12- 01	178,430.0 0	1,000.00	28	3.4 0	471.85	-	-
中信证券	202212010000 7468	金 山 办 公	202 2- 12- 01	4,707,846. 00	17,700.00	14	2.9 0	5,309.40	-	-

中信证券	202212010000 7508	阳光 电源	202 2- 12- 01	2,839,795. 00	24,500.00	14	3.3 0	3,644.40	-	-
中信证券	202212010000 7930	阳光 电源	202 2- 12- 01	510,004.0 0	4,400.00	7	1.8 0	178.50	-	-
中信证券	202212020000 1148	爱尔 眼科	202 2- 12- 02	393,672.0 0	14,100.00	14	1.8 0	275.57	-	-
中信证券	202212020000 5564	健帆 生物	202 2- 12- 02	128,720.0 0	4,000.00	14	1.8 0	90.10	-	-
中信证券	202212050002 1740	爱尔 眼科	202 2- 12- 05	123,281.0 0	4,300.00	14	3.6 0	172.59	-	-
中信证券	202212050002 2304	亿纬 锂能	202 2- 12- 05	167,960.0 0	2,000.00	14	2.9 0	189.42	-	-
中信证券	202212050002 2318	欣旺 达	202 2- 12- 05	138,736.0 0	5,800.00	14	4.5 0	242.79	-	-
中信证券	202212050002 2472	欧普 康视	202 2- 12- 05	326,800.0 0	10,000.00	14	4.5 0	571.90	-	-
中信证券	202212050002 5568	深信 服	202 2- 12- 05	138,240.0 0	1,200.00	14	3.4 0	182.78	-	-
中信证券	202212060001 3580	卓胜 微	202 2- 12- 06	1,976,352. 00	16,800.00	14	3.4 0	2,613.18	-	-
中信证券	202212060001 3610	卓胜 微	202 2- 12- 06	517,616.0 0	4,400.00	14	3.4 0	684.40	-	-
中信证券	202212060001 3618	容百 科技	202 2- 12- 06	313,480.0 0	4,000.00	14	3.1 0	377.92	-	-
中信证券	202212060001 3640	华熙 生物	202 2- 12- 06	1,656,720. 00	13,500.00	14	2.3 0	1,481.84	-	-
中信证券	202212060001	锦	202	752,120.0	4,000.00	28	3.5	1,828.07	720,2	1,828.0

	4054	浪科技	2-12-06	0			0		00.00	7
中信证券	2022120600014114	欣旺达	2022-12-06	249,363.00	10,300.00	14	4.50	436.39	-	-
中信证券	2022120700009944	爱尔眼科	2022-12-07	582,400.00	20,000.00	14	3.60	815.36	-	-
中信证券	2022120700009980	蓝思科技	2022-12-07	11,170.00	1,000.00	14	2.70	11.73	-	-
中信证券	2022120700010024	欣旺达	2022-12-07	404,588.00	16,400.00	14	4.50	708.03	-	-
中信证券	2022120700010504	爱尔眼科	2022-12-07	582,400.00	20,000.00	14	3.60	815.36	-	-
中信证券	2022120700010570	欣旺达	2022-12-07	123,350.00	5,000.00	14	4.50	215.86	-	-
中信证券	2022120700010576	锦浪科技	2022-12-07	1,923,700.00	10,000.00	14	3.60	2,693.18	-	-
中信证券	2022120700013290	宁德时代	2022-12-07	4,183,100.00	10,000.00	14	1.80	2,928.17	-	-
中信证券	2022120800000983	中伟股份	2022-12-08	802,000.00	10,000.00	14	4.10	1,278.74	-	-
中信证券	2022120800016085	圣邦股份	2022-12-08	3,567,900.00	21,000.00	14	3.50	4,856.31	-	-
中信证券	2022120800016167	深信服	2022-12-08	3,226,600.00	29,200.00	14	3.40	4,266.28	-	-
中信证券	2022120800016365	锦浪科技	2022-12-08	470,136.00	2,400.00	14	3.60	658.19	-	-
中信证券	2022120800016369	中科	2022-	554,650.00	5,000.00	14	3.50	754.94	-	-

		创达	12-08								
中信证券	2022120900006354	中科创达	2022-12-09	2,190,000.00	20,000.00	14	3.50	2,980.83	-	-	
中信证券	2022121300012947	贝泰妮	2022-12-13	1,337,400.00	10,000.00	14	4.30	2,236.43	-	-	
中信证券	2022121300012953	欣旺达	2022-12-13	431,323.00	18,100.00	14	4.30	721.27	-	-	
中信证券	2022121300012957	中科创达	2022-12-13	1,974,907.00	18,700.00	14	3.50	2,688.07	-	-	
中信证券	2022121300012963	沃森生物	2022-12-13	71,553.00	1,700.00	14	3.60	100.17	-	-	
中信证券	2022121400026870	同花顺	2022-12-14	133,679.00	1,300.00	14	3.40	176.75	-	-	
中信证券	2022121400026874	欣旺达	2022-12-14	602,952.00	25,900.00	14	4.30	1,008.27	-	-	
中信证券	2022121400028048	中伟股份	2022-12-14	548,932.00	7,400.00	14	4.10	875.24	-	-	
中信证券	2022121500012545	金山办公	2022-12-15	4,584,300.00	17,700.00	14	2.90	5,170.07	-	-	
中信证券	2022121500012549	阳光电源	2022-12-15	2,458,085.00	24,500.00	14	3.30	3,154.54	-	-	
中信证券	2022121600011243	健帆生物	2022-12-16	127,520.00	4,000.00	14	1.80	89.26	-	-	
中信证券	2022121600011823	爱尔眼科	2022-12-16	414,540.00	14,100.00	14	1.80	290.18	-	-	
中信证券	2022121900023366	深信服	2022-12-	128,424.00	1,200.00	14	2.80	119.86	135,060.00	119.86	

			19							
中信证券	202212190002 3376	亿纬 锂能	202 2- 12- 19	185,800.0 0	2,000.00	14	3.0 0	185.80	175,8 00.00	185.80
中信证券	202212190002 3400	欣旺 达	202 2- 12- 19	135,256.0 0	5,800.00	14	4.0 0	180.34	122,6 70.00	180.34
中信证券	202212190002 3490	欧普 康视	202 2- 12- 19	321,600.0 0	10,000.00	14	4.6 0	493.12	357,0 00.00	493.12
中信证券	202212190002 7338	爱尔 眼科	202 2- 12- 19	123,969.0 0	4,300.00	14	3.0 0	123.97	133,6 01.00	123.97
中信证券	202212200001 6496	卓胜 微	202 2- 12- 20	1,971,648. 00	16,800.00	14	3.5 0	2,108.57	1,920 ,240. 00	2,108.5 7
中信证券	202212200001 6498	卓胜 微	202 2- 12- 20	516,384.0 0	4,400.00	14	3.5 0	552.25	502,9 20.00	552.25
中信证券	202212200001 9322	欣旺 达	202 2- 12- 20	234,531.0 0	10,300.00	14	4.0 0	286.65	217,8 45.00	286.65
中信证券	202212200001 9434	容百 科技	202 2- 12- 20	280,120.0 0	4,000.00	14	2.9 0	248.22	275,0 00.00	248.22
中信证券	202212200001 9462	华熙 生物	202 2- 12- 20	1,657,800. 00	13,500.00	14	3.3 0	1,671.62	1,826 ,280. 00	1,671.6 2
中信证券	202212210000 4295	欣旺 达	202 2- 12- 21	539,660.0 0	24,200.00	14	4.0 0	599.62	511,8 30.00	599.62
中信证券	202212210002 0067	爱尔 眼科	202 2- 12- 21	569,200.0 0	20,000.00	14	3.0 0	474.34	621,4 00.00	474.34
中信证券	202212210002 0155	爱尔 眼科	202 2- 12- 21	569,200.0 0	20,000.00	14	3.0 0	474.34	621,4 00.00	474.34
中信证券	202212210002 1727	锦浪 科技	202 2- 12- 21	1,653,700. 00	10,000.00	14	3.9 0	1,791.51	1,800 ,500. 00	1,791.5 1

中信证券	202212210002 1729	欣旺达	202 2- 12- 21	365,720.0 0	16,400.00	14	4.0 0	406.36	346,8 60.00	406.36
中信证券	202212210002 1945	宁德时代	202 2- 12- 21	4,068,200. 00	10,000.00	14	1.8 0	2,034.10	3,934 ,200. 00	2,034.1 0
中信证券	202212220000 1600	欣旺达	202 2- 12- 22	530,464.0 0	24,200.00	14	4.0 0	530.47	511,8 30.00	530.47
中信证券	202212220001 4533	中伟股份	202 2- 12- 22	681,100.0 0	10,000.00	14	4.1 0	698.13	656,1 00.00	698.13
中信证券	202212220001 4661	深信服	202 2- 12- 22	3,143,088. 00	29,200.00	14	2.8 0	2,200.16	3,286 ,460. 00	2,200.1 6
中信证券	202212220001 7015	圣邦股份	202 2- 12- 22	3,552,780. 00	21,000.00	14	3.5 0	3,108.68	3,624 ,600. 00	3,108.6 8
中信证券	202212220001 7299	锦浪科技	202 2- 12- 22	390,240.0 0	2,400.00	14	3.9 0	380.48	432,1 20.00	380.48
中信证券	202212230000 9036	中科创达	202 2- 12- 23	2,074,600. 00	20,000.00	14	3.6 0	1,659.68	2,006 ,000. 00	1,659.6 8
中信证券	202212270000 1590	澜起科技	202 2- 12- 27	2,677,708. 00	41,800.00	14	2.4 0	714.05	2,616 ,680. 00	714.05
中信证券	202212270000 1685	欣旺达	202 2- 12- 27	529,496.0 0	24,200.00	14	3.8 0	223.57	511,8 30.00	223.57
中信证券	202212270000 1695	迈瑞医疗	202 2- 12- 27	751,680.0 0	2,400.00	14	2.2 0	183.74	758,3 28.00	183.74
中信证券	202212270001 6031	贝泰妮	202 2- 12- 27	1,522,300. 00	10,000.00	14	4.0 0	676.58	1,492 ,400. 00	676.58
中信证券	202212270001 6033	欣旺达	202 2- 12- 27	396,028.0 0	18,100.00	14	4.0 0	176.01	382,8 15.00	176.01
中信证券	202212270001 6035	中科	202 2-	1,943,678. 00	18,700.00	14	3.1 0	669.49	1,875 ,610.	669.49

		创 达	12- 27						00	
中信证券	202212270001 6039	沃 森 生 物	202 2- 12- 27	66,334.00	1,700.00	14	2.6 0	19.16	68,32 3.00	19.16
中信证券	202212280003 1783	中 伟 股 份	202 2- 12- 28	497,650.0 0	7,400.00	14	4.1 0	170.03	485,5 14.00	170.03
中信证券	202212280003 1813	欣 旺 达	202 2- 12- 28	559,958.0 0	25,900.00	14	4.0 0	186.65	547,7 85.00	186.65
中信证券	202212290000 1643	华 利 集 团	202 2- 12- 29	330,600.0 0	5,800.00	14	3.3 0	60.61	331,2 38.00	60.61
中信证券	202212290000 1675	欣 旺 达	202 2- 12- 29	515,702.0 0	24,200.00	14	3.8 0	108.87	511,8 30.00	108.87
中信证券	202212290001 1251	金 山 办 公	202 2- 12- 29	4,725,900. 00	17,700.00	14	2.6 0	682.63	4,681 ,473. 00	682.63
中信证券	202212300001 3033	爱 尔 眼 科	202 2- 12- 30	438,087.0 0	14,100.00	14	1.8 0	21.90	438,0 87.00	21.90
中信证券	202212300001 4181	健 帆 生 物	202 2- 12- 30	123,880.0 0	4,000.00	14	1.8 0	6.19	123,8 80.00	6.19
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 末 应 收 利 息 余 额
中信证券	202101040001 3626	东 方 财 富	202 1- 01- 04	2,630,740. 00	81,700.00	28	3.3 0	6,752.23	-	-
中信证券	202101040001 3636	沃 森 生 物	202 1- 01- 04	1,608,600. 00	42,000.00	28	3.5 0	4,378.97	-	-
中信证券	202101040001 3638	宋 城	202 1- 01-	377,970.0 0	21,500.00	28	3.3 0	970.12	-	-

		演 艺	04							
中信证券	202101050001 0242	蓝 思 科 技	202 1- 01- 05	2,068,200. 00	60,000.00	14	4.2 0	3,378.06	-	-
中信证券	202101050001 0250	蓝 思 科 技	202 1- 01- 05	517,050.0 0	15,000.00	14	4.2 0	844.52	-	-
中信证券	202101070001 2502	蓝 思 科 技	202 1- 01- 07	351,800.0 0	10,000.00	28	4.1 0	1,121.85	-	-
中信证券	202101070001 2514	亿 纬 锂 能	202 1- 01- 07	1,585,600. 00	16,000.00	14	3.5 0	2,158.18	-	-
中信证券	202101120000 0339	泰 格 医 药	202 1- 01- 12	2,779,500. 00	17,000.00	28	3.4 0	7,350.23	-	-
中信证券	202101140000 9381	温 氏 股 份	202 1- 01- 14	8,523,800. 00	460,000.0 0	28	3.3 0	27,347.19	-	-
中信证券	202101140000 9383	东 方 财 富	202 1- 01- 14	5,478,000. 00	150,000.0 0	28	3.4 0	18,107.84	-	-
中信证券	202101190000 0360	温 氏 股 份	202 1- 01- 19	201,190.0 0	11,000.00	14	3.3 0	258.19	-	-
中信证券	202101190000 7462	蓝 思 科 技	202 1- 01- 19	581,100.0 0	15,000.00	14	3.8 0	858.74	-	-
中信证券	202101190000 7464	蓝 思 科 技	202 1- 01- 19	2,324,400. 00	60,000.00	14	3.8 0	3,434.95	-	-
中信证券	202101210001 3263	亿 纬 锂 能	202 1- 01- 21	1,689,760. 00	16,000.00	14	3.5 0	2,299.95	-	-
中信证券	202101260000 6598	亿 联 网 络	202 1- 01- 26	1,320,624. 00	16,200.00	28	3.4 0	3,492.32	-	-
中信证券	202101260000	东	202	7,829,356.	213,800.0	28	3.5	21,313.25	-	-

	6600	方 财 富	1- 01- 26	00	0		0				
中信证券	202102010000 9072	东 方 财 富	202 1- 02- 01	2,931,396. 00	81,700.00	28	3.3 0	7,523.92	-	-	
中信证券	202102010000 9090	宋 城 演 艺	202 1- 02- 01	367,005.0 0	21,500.00	28	3.4 0	970.52	-	-	
中信证券	202102020000 8849	蓝 思 科 技	202 1- 02- 02	1,944,000. 00	60,000.00	14	3.8 0	3,283.20	-	-	
中信证券	202102040000 0436	乐 普 医 疗	202 1- 02- 04	338,010.0 0	11,400.00	28	3.5 0	920.14	-	-	
中信证券	202102040001 3621	蓝 思 科 技	202 1- 02- 04	306,600.0 0	10,000.00	28	3.7 0	882.33	-	-	
中信证券	202102090000 0489	乐 普 医 疗	202 1- 02- 09	322,300.0 0	10,000.00	14	3.6 0	451.22	-	-	
中信证券	202102090000 0493	东 方 财 富	202 1- 02- 09	3,816,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	5,194.00	-	-	
中信证券	202102090000 0497	传 音 控 股	202 1- 02- 09	2,452,000. 00	10,000.00	14	3.2 0	3,051.38	-	-	
中信证券	202102180003 8544	东 方 财 富	202 1- 02- 18	5,643,000. 00	150,000.0 0	28	3.3 0	14,483.70	-	-	
中信证券	202102180003 8548	蓝 思 科 技	202 1- 02- 18	1,931,400. 00	60,000.00	14	4.6 0	3,455.06	-	-	
中信证券	202102230000 6566	乐 普 医 疗	202 1- 02- 23	319,300.0 0	10,000.00	14	3.6 0	447.02	-	-	
中信证券	202102230000 6568	东 方 财 富	202 1- 02- 23	3,355,000. 00	100,000.0 0	14	3.5 0	4,566.53	-	-	

中信证券	202102230000 7000	传 音 控 股	202 1- 02- 23	2,008,300. 00	10,000.00	14	3.2 0	2,499.22	-	-
中信证券	202102230000 7206	亿 联 网 络	202 1- 02- 23	1,343,304. 00	16,200.00	28	3.2 0	3,343.33	-	-
中信证券	202102230000 7208	东 方 财 富	202 1- 02- 23	7,172,990. 00	213,800.0 0	28	3.3 0	18,410.67	-	-
中信证券	202102240000 0630	宋 城 演 艺	202 1- 02- 24	197,500.0 0	10,000.00	28	3.3 0	506.92	-	-
中信证券	202102240000 6560	蓝 思 科 技	202 1- 02- 24	519,255.0 0	16,500.00	28	4.0 0	1,615.46	-	-
中信证券	202102240000 6562	信 维 通 信	202 1- 02- 24	341,800.0 0	10,000.00	28	3.5 0	930.46	-	-
中信证券	202102240000 6564	爱 尔 眼 科	202 1- 02- 24	1,720,170. 00	23,000.00	28	3.4 0	4,548.89	-	-
中信证券	202102240000 6566	宋 城 演 艺	202 1- 02- 24	339,700.0 0	17,200.00	28	3.5 0	924.74	-	-
中信证券	202102240000 6568	汇 川 技 术	202 1- 02- 24	1,087,185. 00	12,100.00	28	3.3 0	2,790.44	-	-
中信证券	202102240000 6570	三 环 集 团	202 1- 02- 24	642,492.0 0	16,200.00	28	3.4 0	1,699.03	-	-
中信证券	202102240000 6614	泰 格 医 药	202 1- 02- 24	1,529,000. 00	10,000.00	28	3.4 0	4,043.36	-	-
中信证券	202102240000 6616	亿 纬 锂 能	202 1- 02- 24	938,100.0 0	10,600.00	28	3.2 0	2,334.83	-	-
中信证券	202102240000 6618	温 氏 股	202 1- 02- 24	951,860.0 0	52,300.00	28	3.2 0	2,369.07	-	-

中信证券	2021022400006620	份智飞生物	2021-02-24	2,176,200.00	13,500.00	28	3.50	5,924.10	-	-
中信证券	2021022400006622	乐普医疗	2021-02-24	471,135.00	14,700.00	28	3.50	1,282.53	-	-
中信证券	2021022400006624	沃森生物	2021-02-24	1,279,161.00	26,100.00	28	4.00	3,979.61	-	-
中信证券	2021022400006626	芒果超媒	2021-02-24	671,200.00	10,000.00	28	3.20	1,670.54	-	-
中信证券	2021030400034637	乐普医疗	2021-03-04	355,338.00	11,400.00	28	3.40	939.67	-	-
中信证券	2021030400034651	蓝思科技	2021-03-04	1,852,800.00	60,000.00	14	3.60	2,593.92	-	-
中信证券	2021030400035033	蓝思科技	2021-03-04	308,800.00	10,000.00	28	3.50	840.62	-	-
中信证券	2021030900007663	传音控股	2021-03-09	1,761,100.00	10,000.00	14	3.20	2,191.59	-	-
中信证券	2021030900007667	乐普医疗	2021-03-09	285,000.00	10,000.00	14	3.60	399.00	-	-
中信证券	2021030900007687	东方财富	2021-03-09	2,753,000.00	100,000.00	14	3.40	3,640.08	-	-
中信证券	2021031100000509	汇川技术	2021-03-11	1,047,600.00	12,000.00	28	3.20	2,607.36	-	-
中信证券	2021031100000529	汇川技术	2021-03-11	1,021,410.00	11,700.00	14	3.30	1,310.81	-	-
中信证券	2021031800038094	蓝思	2021-	1,555,800.00	60,000.00	14	3.50	2,117.62	-	-

		科技	03-18							
中信证券	2021031800038112	东方财富	2021-03-18	4,236,000.00	150,000.00	28	3.40	11,201.87	-	-
中信证券	2021032300007721	传音控股	2021-03-23	2,021,000.00	10,000.00	14	3.20	2,515.02	-	-
中信证券	2021032300007735	东方财富	2021-03-23	2,715,000.00	100,000.00	14	3.40	3,589.83	-	-
中信证券	2021032300007737	东方财富	2021-03-23	5,804,670.00	213,800.00	28	3.30	14,898.65	-	-
中信证券	2021032300007745	亿联网络	2021-03-23	1,072,440.00	16,200.00	28	3.20	2,669.18	-	-
中信证券	2021032400006284	宋城演艺	2021-03-24	203,500.00	10,000.00	28	3.40	538.14	-	-
中信证券	2021032400006288	沃森生物	2021-03-24	1,191,204.00	26,100.00	28	3.40	3,150.07	-	-
中信证券	2021032400006290	宋城演艺	2021-03-24	350,020.00	17,200.00	28	3.40	925.61	-	-
中信证券	2021032400006292	泰格医药	2021-03-24	1,292,700.00	10,000.00	28	3.50	3,519.02	-	-
中信证券	2021032400006294	乐普医疗	2021-03-24	418,803.00	14,700.00	28	3.40	1,107.50	-	-
中信证券	2021032400006296	亿纬锂能	2021-03-24	739,456.00	10,600.00	28	3.40	1,955.45	-	-
中信证券	2021032400006298	汇川技术	2021-03-24	973,566.00	12,100.00	28	3.20	2,423.10	-	-
中信证券	202103240000	爱	202	1,373,560.	23,000.00	28	3.2	3,418.64	-	-

	6300	尔眼科	1-03-24	00			0			
中信证券	2021032400006302	信维通信	2021-03-24	270,200.00	10,000.00	28	4.20	882.65	-	-
中信证券	2021032400006304	智飞生物	2021-03-24	2,387,475.00	13,500.00	28	3.40	6,313.55	-	-
中信证券	2021032400006306	三环集团	2021-03-24	590,976.00	16,200.00	28	3.90	1,792.63	-	-
中信证券	2021032400006308	芒果超媒	2021-03-24	565,500.00	10,000.00	28	3.30	1,451.45	-	-
中信证券	2021032400006312	蓝思科技	2021-03-24	400,950.00	16,500.00	28	3.40	1,060.29	-	-
中信证券	2021032400006314	温氏股份	2021-03-24	895,899.00	52,300.00	28	3.20	2,229.79	-	-
中信证券	2021040100000476	康泰生物	2021-04-01	1,380,200.00	10,000.00	14	3.40	1,824.93	-	-
中信证券	2021040600000654	沃森生物	2021-04-06	442,000.00	10,000.00	14	3.50	601.61	-	-
中信证券	2021040600000750	温氏股份	2021-04-06	167,300.00	10,000.00	14	3.40	221.21	-	-
中信证券	2021040600017104	东方财富	2021-04-06	2,861,000.00	100,000.00	14	3.30	3,671.62	-	-
中信证券	2021040600017132	传音控股	2021-04-06	2,049,800.00	10,000.00	14	3.20	2,550.86	-	-
中信证券	2021040800000526	温氏股份	2021-04-08	164,400.00	10,000.00	14	3.40	217.37	-	-

中信证券	202104190000 4123	乐普医疗	2021-03-24	1,799.66	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	202104200000 1151	东方财富	2021-04-20	297,800.00	10,000.00	14	3.30	436.78	-	-
中信证券	202104200000 1153	宋城演艺	2021-04-20	208,600.00	10,000.00	14	2.70	250.32	-	-
中信证券	202104200000 1155	乐普医疗	2021-04-20	277,600.00	10,000.00	14	3.40	419.49	-	-
中信证券	202104200001 5606	沃森生物	2021-04-20	522,600.00	10,000.00	14	3.50	812.94	-	-
中信证券	202104200001 5610	东方财富	2021-04-20	2,978,000.00	100,000.00	14	3.00	3,970.66	-	-
中信证券	202104200001 5630	传音控股	2021-04-20	1,705,200.00	10,000.00	14	2.30	1,743.10	-	-
中信证券	202104210000 7489	宋城演艺	2021-04-21	218,100.00	10,000.00	28	3.20	542.83	-	-
中信证券	202104210000 8225	温氏股份	2021-03-24	2,504.60	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	202104220000 0612	温氏股份	2021-04-22	151,600.00	10,000.00	14	3.40	200.45	-	-
中信证券	202104220000 0624	爱尔眼科	2021-04-22	9,547,500.00	150,000.00	28	3.30	24,505.25	-	-
中信证券	202104270000 0839	乐普医疗	2021-04-27	315,000.00	10,000.00	14	3.20	392.00	-	-
中信证券	202104290000 0601	东方财富	2021-04-29	319,900.00	10,000.00	14	3.30	410.54	-	-

中信证券	202104290000 0605	富 乐 普 医 疗	202 1- 04- 29	320,300.0 0	10,000.00	14	3.2 0	398.60	-	-
中信证券	202104290000 0621	温 氏 股 份	202 1- 04- 29	296,430.0 0	20,500.00	14	3.3 0	380.42	-	-
中信证券	202105060000 0893	温 氏 股 份	202 1- 05- 06	141,700.0 0	10,000.00	14	3.3 0	181.85	-	-
中信证券	202105060002 8236	东 方 财 富	202 1- 05- 06	3,130,000. 00	100,000.0 0	14	3.3 0	4,016.83	-	-
中信证券	202105060002 8238	东 方 财 富	202 1- 05- 06	313,000.0 0	10,000.00	14	3.3 0	401.68	-	-
中信证券	202105060002 8244	宋 城 演 艺	202 1- 05- 06	205,600.0 0	10,000.00	14	2.7 0	215.88	-	-
中信证券	202105060002 8252	传 音 控 股	202 1- 05- 06	1,636,300. 00	10,000.00	14	2.5 0	1,590.85	-	-
中信证券	202105060002 8810	乐 普 医 疗	202 1- 05- 06	310,000.0 0	10,000.00	14	3.2 0	385.78	-	-
中信证券	202105060002 8816	沃 森 生 物	202 1- 05- 06	557,500.0 0	10,000.00	14	3.6 0	780.50	-	-
中信证券	202105060002 8818	温 氏 股 份	202 1- 05- 06	141,700.0 0	10,000.00	14	3.3 0	181.85	-	-
中信证券	202105110000 0946	智 飞 生 物	202 1- 05- 11	2,098,200. 00	10,000.00	14	3.4 0	2,774.29	-	-
中信证券	202105110000 0948	温 氏 股 份	202 1- 05- 11	284,074.0 0	20,600.00	14	3.2 0	353.51	-	-
中信证券	202105110000 0960	芒 果	202 1-	1,090,320. 00	16,800.00	14	3.3 0	1,399.24	-	-

		超媒	05-11							
中信证券	2021051100000968	沃森生物	2021-05-11	1,456,000.00	26,000.00	14	3.50	1,981.78	-	-
中信证券	2021051300027746	东方财富	2021-05-13	305,000.00	10,000.00	14	3.30	391.42	-	-
中信证券	2021051800002865	沃森生物	2021-05-11	1,300.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	2021051800002924	沃森生物	2021-05-06	500.00	-	14	3.60	-	-	-
中信证券	2021051900002613	宋城演艺	2021-05-19	190,700.00	10,000.00	28	3.20	474.63	-	-
中信证券	2021052000000559	宋城演艺	2021-05-20	549,263.00	29,900.00	14	3.40	726.25	-	-
中信证券	2021052000017891	爱尔眼科	2021-05-20	11,649,000.00	150,000.00	28	3.30	29,899.10	-	-
中信证券	2021052000017893	传音控股	2021-05-20	1,603,800.00	10,000.00	14	2.10	1,309.77	-	-
中信证券	2021052000017895	宋城演艺	2021-05-20	183,700.00	10,000.00	14	3.30	235.75	-	-
中信证券	2021052000017897	沃森生物	2021-05-20	688,400.00	10,000.00	14	3.50	936.99	-	-
中信证券	2021052000017899	东方财富	2021-05-20	3,572,000.00	100,000.00	14	3.40	4,722.98	-	-
中信证券	2021052000017901	东方财富	2021-05-20	357,200.00	10,000.00	14	3.40	472.30	-	-
中信证券	202105200001	温	202	141,000.00	10,000.00	14	3.2	175.47	-	-

	7907	氏股份	1-05-20	0			0			
中信证券	2021052000017909	温氏股份	2021-05-20	141,000.00	10,000.00	14	3.20	175.47	-	-
中信证券	2021052000017941	乐普医疗	2021-05-20	321,900.00	10,000.00	14	3.30	413.11	-	-
中信证券	2021052500001029	温氏股份	2021-05-25	140,100.00	10,000.00	14	3.20	174.35	-	-
中信证券	2021052500001037	亿纬锂能	2021-05-25	3,647,860.00	34,000.00	14	3.50	4,965.14	-	-
中信证券	2021052500010280	温氏股份	2021-05-25	288,606.00	20,600.00	14	3.30	370.38	-	-
中信证券	2021052500010282	沃森生物	2021-05-25	1,765,660.00	26,000.00	14	3.30	2,265.93	-	-
中信证券	2021052500010286	智飞生物	2021-05-25	2,031,900.00	10,000.00	14	3.50	2,765.64	-	-
中信证券	2021052600011360	东方财富	2021-05-20	6,000.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021052600011362	东方财富	2021-05-20	600.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021052600011496	东方财富	2021-05-13	600.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	2021052600011758	东方财富	2021-05-20	-	20,000.00	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021052600011760	东方财富	2021-05-20	-	2,000.00	14	3.40	-	-	-

中信证券	202105260001 1894	东方 财富	202 1- 05- 13	-	2,000.00	14	3.3 0	-	-	-
中信证券	202105270001 8719	东方 财富	202 1- 05- 27	314,200.0 0	10,000.00	14	3.4 0	415.44	-	-
中信证券	202106010000 0692	温 氏 股 份	202 1- 06- 01	1,353,726. 00	95,400.00	14	3.4 0	1,789.93	-	-
中信证券	202106010000 0706	乐 普 医 疗	202 1- 06- 01	1,223,365. 00	37,700.00	14	3.3 0	1,569.99	-	-
中信证券	202106010000 2805	宋 城 演 艺	202 1- 05- 20	500.00	-	14	3.3 0	-	-	-
中信证券	202106010000 2822	宋 城 演 艺	202 1- 05- 20	1,495.00	-	14	3.4 0	-	-	-
中信证券	202106010000 2827	宋 城 演 艺	202 1- 05- 19	500.00	-	28	3.2 0	-	-	-
中信证券	202106030000 0851	亿 纬 锂 能	202 1- 06- 03	15,771,00 0.00	150,000.0 0	14	3.4 0	20,852.77	-	-
中信证券	202106030000 9788	沃 森 生 物	202 1- 06- 03	643,300.0 0	10,000.00	14	3.4 0	850.59	-	-
中信证券	202106030000 9790	乐 普 医 疗	202 1- 06- 03	320,800.0 0	10,000.00	14	3.6 0	449.12	-	-
中信证券	202106030000 9798	温 氏 股 份	202 1- 06- 03	141,200.0 0	10,000.00	14	3.2 0	175.72	-	-
中信证券	202106030000 9800	温 氏 股 份	202 1- 06- 03	141,200.0 0	10,000.00	14	3.2 0	175.72	-	-
中信证券	202106030001 0572	宋 城 演 艺	202 1- 06- 03	540,293.0 0	29,900.00	14	3.5 0	735.40	-	-

		艺								
中信证券	2021060300010574	东方财富	2021-06-03	3,086,000.00	100,000.00	14	3.50	4,200.39	-	-
中信证券	2021060300010576	东方财富	2021-06-03	308,600.00	10,000.00	14	3.50	420.04	-	-
中信证券	2021060300010590	传音控股	2021-06-03	1,639,600.00	10,000.00	14	1.30	828.91	-	-
中信证券	2021060800006081	温氏股份	2021-06-08	306,116.00	20,600.00	14	3.40	404.75	-	-
中信证券	2021060800006085	温氏股份	2021-06-08	148,600.00	10,000.00	14	3.40	196.48	-	-
中信证券	2021060800006089	沃森生物	2021-06-08	1,721,460.00	26,000.00	14	3.30	2,209.21	-	-
中信证券	2021060800006193	智飞生物	2021-06-08	1,869,800.00	10,000.00	14	3.30	2,399.58	-	-
中信证券	2021060800006195	亿纬锂能	2021-06-08	3,322,820.00	34,000.00	14	3.40	4,393.51	-	-
中信证券	2021060900000677	温氏股份	2021-06-09	147,700.00	10,000.00	14	3.40	195.29	-	-
中信证券	2021060900000687	中微公司	2021-06-09	6,691,500.00	50,000.00	28	3.90	20,297.55	-	-
中信证券	2021061000007776	东方财富	2021-06-10	312,900.00	10,000.00	14	3.30	401.56	-	-
中信证券	2021061000010288	传音控股	2021-06-03	10,800.00	-	14	1.30	-	-	-
中信证券	2021061500001748	乐普	2021-	613,206.00	19,800.00	14	3.40	810.79	-	-

		医疗	06-15							
中信证券	2021061500016030	温氏股份	2021-06-15	1,312,704.00	95,400.00	14	3.40	1,735.69	-	-
中信证券	2021061600007005	宋城演艺	2021-06-16	170,300.00	10,000.00	28	2.50	331.14	-	-
中信证券	2021061700001949	先导智能	2021-06-17	1,423,200.00	24,000.00	14	3.40	1,881.79	-	-
中信证券	2021061700016477	宋城演艺	2021-06-17	504,413.00	29,900.00	14	2.60	510.02	-	-
中信证券	2021061700016479	沃森生物	2021-06-17	593,000.00	10,000.00	14	3.30	761.02	-	-
中信证券	2021061700016481	温氏股份	2021-06-17	137,500.00	10,000.00	14	3.40	181.81	-	-
中信证券	2021061700016483	温氏股份	2021-06-17	137,500.00	10,000.00	14	3.40	181.81	-	-
中信证券	2021061700016491	传音控股	2021-06-17	1,744,300.00	10,000.00	14	1.40	949.67	-	-
中信证券	2021061700016497	亿纬锂能	2021-06-17	15,180,000.00	150,000.00	14	3.40	20,071.33	-	-
中信证券	2021061700016499	爱尔眼科	2021-06-17	12,372,000.00	150,000.00	28	3.20	30,792.53	-	-
中信证券	2021061700016505	乐普医疗	2021-06-17	309,400.00	10,000.00	14	3.40	409.10	-	-
中信证券	2021062200011720	温氏股份	2021-06-22	139,000.00	10,000.00	14	3.50	189.19	-	-
中信证券	202106220001	智	202	1,712,900.	10,000.00	14	3.6	2,398.06	-	-

	1728	飞生物	1-06-22	00			0			
中信证券	2021062200011950	亿纬锂能	2021-06-22	3,451,000.00	34,000.00	14	3.50	4,697.19	-	-
中信证券	2021062300019314	爱尔眼科	2021-06-17	22,243.40	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021062300019628	爱尔眼科	2021-06-17	-	44,487.00	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021062400009959	乐普医疗	2021-06-17	2,280.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021062400009998	乐普医疗	2021-06-15	4,514.40	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021062900001185	爱尔眼科	2021-06-29	1,108,160.00	16,000.00	14	3.20	1,379.04	-	-
中信证券	2021062900017983	温氏股份	2021-06-29	1,370,898.00	95,400.00	14	3.00	1,599.38	-	-
中信证券	2021070100000844	沃森生物	2021-07-01	601,500.00	10,000.00	14	3.50	818.71	-	-
中信证券	2021070100015860	先导智能	2021-07-01	1,392,000.00	24,000.00	14	3.50	1,894.67	-	-
中信证券	2021070100015862	宋城演艺	2021-07-01	510,393.00	29,900.00	14	3.10	615.31	-	-
中信证券	2021070100015864	沃森生物	2021-07-01	601,500.00	10,000.00	14	3.60	842.10	-	-
中信证券	2021070100015866	温氏股份	2021-07-01	141,400.00	10,000.00	14	3.00	164.97	-	-

中信证券	2021070100015868	温氏股份	2021-07-01	141,400.00	10,000.00	14	3.00	164.97	-	-
中信证券	2021070100015870	亿纬锂能	2021-07-01	15,450,000.00	150,000.00	14	3.40	20,428.33	-	-
中信证券	2021070100015880	传音控股	2021-07-01	2,056,000.00	10,000.00	14	3.20	2,558.58	-	-
中信证券	2021070200001132	贝达药业	2021-07-02	673,725.00	15,300.00	7	3.50	1,079.26	-	-
中信证券	2021070200001149	先导智能	2021-07-02	1,543,590.00	63,600.00	7	3.50	2,474.51	-	-
中信证券	2021070200001161	华大基因	2021-07-02	624,305.00	13,000.00	7	3.40	975.56	-	-
中信证券	2021070200001167	中微公司	2021-07-02	1,515,000.00	20,000.00	7	4.40	2,592.33	-	-
中信证券	2021070200001173	亿联网络	2021-07-02	576,100.00	16,500.00	7	3.60	950.57	-	-
中信证券	2021070200001185	同花顺	2021-07-02	598,235.00	13,000.00	7	3.40	934.82	-	-
中信证券	2021070200001193	智飞生物	2021-07-02	3,900,100.00	50,600.00	7	3.60	6,425.19	-	-
中信证券	2021070200001199	乐普医疗	2021-07-02	1,036,825.00	78,900.00	7	3.50	1,661.89	-	-
中信证券	2021070200001203	沃森生物	2021-07-02	2,482,200.00	98,900.00	7	3.60	4,091.49	-	-
中信证券	2021070200001213	康泰生物	2021-07-02	1,594,120.00	25,900.00	7	4.50	3,284.25	-	-

中信证券	202107020000 1216	三环集团	2021-07-02	1,175,660.00	68,300.00	7	3.50	1,884.38	-	-
中信证券	202107020000 1226	泰格医药	2021-07-02	2,687,580.00	33,000.00	7	4.00	4,927.23	-	-
中信证券	202107020000 1243	阳光电源	2021-07-02	2,837,430.00	63,600.00	7	3.60	4,678.61	-	-
中信证券	202107060001 1496	智飞生物	2021-07-06	1,720,100.00	10,000.00	14	3.50	2,341.25	-	-
中信证券	202107060001 1500	温氏股份	2021-07-06	142,700.00	10,000.00	14	3.50	194.23	-	-
中信证券	202107060001 1502	亿纬锂能	2021-07-06	3,452,700.00	34,000.00	14	3.40	4,565.24	-	-
中信证券	202107060001 2815	华大基因	2021-07-02	4,550.00	-	7	3.40	-	-	-
中信证券	202107070001 6917	中微公司	2021-07-07	8,252,000.00	50,000.00	28	4.20	26,956.53	-	-
中信证券	202107070001 7753	温氏股份	2021-07-06	2,000.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	202107070001 7807	温氏股份	2021-07-01	2,000.00	-	14	3.00	-	-	-
中信证券	202107070001 7809	温氏股份	2021-07-01	2,000.00	-	14	3.00	-	-	-
中信证券	202107070001 7859	温氏股份	2021-06-29	19,080.00	-	14	3.00	-	-	-
中信证券	202107090000 6317	华大基	2021-07-09	616,000.00	5,500.00	7	2.70	323.40	-	-

		因								
中信证券	202107090000 6319	中 微 公 司	202 1- 07- 09	1,780,400. 00	10,000.00	7	5.1 0	1,765.56	-	-
中信证券	202107090000 6321	沃 森 生 物	202 1- 07- 09	2,714,460. 00	42,000.00	7	2.7 0	1,425.09	-	-
中信证券	202107090000 6323	阳 光 电 源	202 1- 07- 09	3,186,000. 00	27,000.00	7	2.8 0	1,734.60	-	-
中信证券	202107090000 6325	泰 格 医 药	202 1- 07- 09	2,210,600. 00	14,000.00	7	2.6 0	1,117.58	-	-
中信证券	202107090000 6327	乐 普 医 疗	202 1- 07- 09	958,100.0 0	33,500.00	7	3.2 0	596.15	-	-
中信证券	202107090000 6329	同 花 顺	202 1- 07- 09	572,770.0 0	5,500.00	7	3.4 0	378.66	-	-
中信证券	202107090000 6331	智 飞 生 物	202 1- 07- 09	3,763,145. 00	21,500.00	7	2.8 0	2,048.82	-	-
中信证券	202107090000 6333	亿 联 网 络	202 1- 07- 09	584,710.0 0	7,000.00	7	2.7 0	306.97	-	-
中信证券	202107090000 6337	康 泰 生 物	202 1- 07- 09	1,534,500. 00	11,000.00	7	2.8 0	835.45	-	-
中信证券	202107090000 6339	三 环 集 团	202 1- 07- 09	1,227,570. 00	29,000.00	7	2.7 0	644.47	-	-
中信证券	202107090000 6341	先 导 智 能	202 1- 07- 09	1,771,470. 00	27,000.00	7	2.8 0	964.47	-	-
中信证券	202107090000 6343	贝 达 药 业	202 1- 07- 09	606,385.0 0	6,500.00	7	2.8 0	330.14	-	-
中信证券	202107130002 1389	爱 尔	202 1- 07-	1,060,800. 00	16,000.00	14	2.9 0	1,196.35	-	-

		眼科	13							
中信证券	202107140000 6962	宋城 演艺	202 1- 07- 14	161,700.0 0	10,000.00	28	3.2 0	402.45	-	-
中信证券	202107150001 5714	沃森 生物	202 1- 07- 15	674,000.0 0	10,000.00	14	2.6 0	681.49	-	-
中信证券	202107150001 5716	宋城 演艺	202 1- 07- 15	482,885.0 0	29,900.00	14	3.3 0	619.70	-	-
中信证券	202107150001 5728	亿纬 锂能	202 1- 07- 15	19,050,00 0.00	150,000.0 0	14	3.2 0	23,706.67	-	-
中信证券	202107150001 7568	爱尔 眼科	202 1- 07- 15	10,053,00 0.00	150,000.0 0	28	2.8 0	21,893.20	-	-
中信证券	202107150001 7570	沃森 生物	202 1- 07- 15	674,000.0 0	10,000.00	14	2.6 0	681.49	-	-
中信证券	202107150001 7576	温氏 股份	202 1- 07- 15	135,500.0 0	10,000.00	14	3.4 0	179.16	-	-
中信证券	202107150001 7596	温氏 股份	202 1- 07- 15	135,500.0 0	10,000.00	14	3.4 0	179.16	-	-
中信证券	202107150001 7600	先导 智能	202 1- 07- 15	1,616,160. 00	24,000.00	14	2.7 0	1,696.97	-	-
中信证券	202107200001 2065	温氏 股份	202 1- 07- 20	127,700.0 0	10,000.00	14	1.9 0	94.36	-	-
中信证券	202107200001 3615	亿纬 锂能	202 1- 07- 20	4,028,660. 00	34,000.00	14	2.5 0	3,916.75	-	-
中信证券	202107200001 3617	智飞 生物	202 1- 07- 20	1,941,300. 00	10,000.00	14	2.3 0	1,736.39	-	-
中信证券	202107270001	爱	202	883,520.0	16,000.00	28	3.0	2,061.55	-	-

	8619	尔眼科	1-07-27	0			0			
中信证券	2021072900015735	温氏股份	2021-07-29	123,800.00	10,000.00	28	2.60	250.35	-	-
中信证券	2021072900015739	温氏股份	2021-07-29	123,800.00	10,000.00	28	2.60	250.35	-	-
中信证券	2021072900016257	宋城演艺	2021-07-29	398,567.00	29,900.00	28	2.40	743.99	-	-
中信证券	2021072900016267	沃森生物	2021-07-29	829,200.00	10,000.00	28	2.00	1,289.87	-	-
中信证券	2021072900016269	沃森生物	2021-07-29	829,200.00	10,000.00	28	2.00	1,289.87	-	-
中信证券	2021072900016271	亿纬锂能	2021-07-29	16,561,500.00	150,000.00	28	2.90	37,355.38	-	-
中信证券	2021072900016721	先导智能	2021-07-29	1,686,000.00	24,000.00	28	2.50	3,278.33	-	-
中信证券	2021080300012978	亿纬锂能	2021-08-03	3,745,100.00	34,000.00	14	2.70	3,932.36	-	-
中信证券	2021080300012980	智飞生物	2021-08-03	1,749,100.00	10,000.00	14	2.40	1,632.49	-	-
中信证券	2021080300012982	温氏股份	2021-08-03	133,500.00	10,000.00	14	3.40	176.52	-	-
中信证券	2021080400017536	中微公司	2021-08-04	9,750,000.00	50,000.00	28	5.00	37,916.67	-	-
中信证券	2021080500010555	康泰生物	2021-07-09	10,634.31	-	7	2.80	-	-	-

中信证券	202108100000 0960	沪 硅 产 业	202 1- 08- 10	410,530.0 0	12,200.00	28	2.5 0	798.25	-	-
中信证券	202108100000 0962	澜 起 科 技	202 1- 08- 10	863,148.0 0	13,200.00	28	2.4 0	1,611.21	-	-
中信证券	202108100000 0964	中 国 通 号	202 1- 08- 10	100,782.0 0	19,800.00	28	2.0 0	156.77	-	-
中信证券	202108100000 0972	英 科 医 疗	202 1- 08- 10	592,704.0 0	5,400.00	28	3.0 0	1,382.98	-	-
中信证券	202108100000 0974	华 大 基 因	202 1- 08- 10	597,300.0 0	5,500.00	28	3.2 0	1,486.61	-	-
中信证券	202108100000 0976	亿 联 网 络	202 1- 08- 10	114,842.0 0	1,300.00	28	2.2 0	196.51	-	-
中信证券	202108100000 0978	康 泰 生 物	202 1- 08- 10	266,171.0 0	1,900.00	28	2.8 0	579.66	-	-
中信证券	202108100000 0980	爱 尔 眼 科	202 1- 08- 10	732,917.0 0	12,700.00	28	2.5 0	1,425.12	-	-
中信证券	202108100000 0982	亿 纬 锂 能	202 1- 08- 10	2,185,920. 00	19,800.00	28	2.4 0	4,080.38	-	-
中信证券	202108100000 0984	乐 普 医 疗	202 1- 08- 10	532,422.0 0	19,800.00	28	2.7 0	1,118.09	-	-
中信证券	202108100000 0986	智 飞 生 物	202 1- 08- 10	632,624.0 0	3,800.00	28	2.9 0	1,426.92	-	-
中信证券	202108100000 0988	东 方 财 富	202 1- 08- 10	1,408,660. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,396.44	-	-
中信证券	202108100000 0990	同 花 顺	202 1- 08- 10	99,290.00	1,000.00	28	3.1 0	239.40	-	-

中信证券	202108100000 0992	汇川技术	2021-08-10	622,325.00	7,300.00	28	2.50	1,210.08	-	-
中信证券	202108100000 0994	温氏股份	2021-08-10	287,375.00	20,900.00	28	3.30	737.60	-	-
中信证券	202108100000 0996	先导智能	2021-08-10	341,088.00	4,400.00	28	2.30	610.17	-	-
中信证券	202108100000 0998	蓝思科技	2021-08-10	185,920.00	7,000.00	28	2.50	361.51	-	-
中信证券	202108100000 1000	欧普康视	2021-08-10	224,016.00	2,400.00	28	2.80	487.86	-	-
中信证券	202108100000 1002	健帆生物	2021-08-10	109,060.00	1,900.00	28	3.40	288.40	-	-
中信证券	202108100000 1004	贝达药业	2021-08-10	101,607.00	1,100.00	28	3.00	237.08	-	-
中信证券	202108100000 1006	芒果超媒	2021-08-10	768,900.00	13,200.00	28	2.80	1,674.49	-	-
中信证券	202108100000 1008	宋城演艺	2021-08-10	99,160.00	7,400.00	28	3.40	262.22	-	-
中信证券	202108100000 1010	沃森生物	2021-08-10	646,050.00	7,300.00	28	2.50	1,256.21	-	-
中信证券	202108100000 1012	信维通信	2021-08-10	354,552.00	13,200.00	28	2.90	799.71	-	-
中信证券	202108100000 1014	三环集团	2021-08-10	227,868.00	5,100.00	28	2.70	478.52	-	-
中信证券	202108100000 1016	泰格医	2021-08-10	409,500.00	2,500.00	28	2.30	732.55	-	-

中信证券	2021081000001018	药 阳光电源	2021-08-10	1,065,774.00	6,900.00	28	2.90	2,403.91	-	-
中信证券	2021081000001082	东 方财 富	2021-08-10	67,400.00	2,000.00	14	3.20	83.88	-	-
中信证券	2021081100001410	沪 硅 产 业	2021-08-11	401,502.00	12,200.00	28	2.50	780.70	-	-
中信证券	2021081100001412	中 国 通 号	2021-08-11	101,574.00	19,800.00	28	2.00	158.00	-	-
中信证券	2021081100001414	澜 起 科 技	2021-08-11	849,024.00	13,200.00	28	2.40	1,584.84	-	-
中信证券	2021081100001420	英 科 医 疗	2021-08-11	590,220.00	5,400.00	28	3.00	1,377.18	-	-
中信证券	2021081100001422	华 大 基 因	2021-08-11	592,075.00	5,500.00	28	3.20	1,473.61	-	-
中信证券	2021081100001424	亿 联 网 络	2021-08-11	113,503.00	1,300.00	28	2.20	194.22	-	-
中信证券	2021081100001426	康 泰 生 物	2021-08-11	254,619.00	1,900.00	28	2.80	554.50	-	-
中信证券	2021081100001428	爱 尔 眼 科	2021-08-11	705,358.00	12,700.00	28	2.50	1,371.53	-	-
中信证券	2021081100001430	亿 纬 锂 能	2021-08-11	2,246,112.00	19,800.00	28	2.40	4,192.74	-	-
中信证券	2021081100001432	乐 普 医 疗	2021-08-11	525,096.00	19,800.00	28	2.70	1,102.70	-	-
中信证券	2021081100001434	智 飞	2021-	621,224.00	3,800.00	28	2.90	1,401.21	-	-

		生物	08-11							
中信证券	202108110000 1436	东方 财富	202 1- 08- 11	1,377,728. 00	41,800.00	28	3.1 0	3,321.86	-	-
中信证券	202108110000 1438	同花 顺	202 1- 08- 11	98,490.00	1,000.00	28	3.1 0	237.47	-	-
中信证券	202108110000 1440	汇川 技术	202 1- 08- 11	603,053.0 0	7,300.00	28	2.5 0	1,172.60	-	-
中信证券	202108110000 1442	温氏 股份	202 1- 08- 11	285,076.0 0	20,900.00	28	3.3 0	731.70	-	-
中信证券	202108110000 1444	先导 智能	202 1- 08- 11	335,940.0 0	4,400.00	28	2.3 0	600.96	-	-
中信证券	202108110000 1448	蓝思 科技	202 1- 08- 11	179,340.0 0	7,000.00	28	2.5 0	348.72	-	-
中信证券	202108110000 1450	欧普 康视	202 1- 08- 11	215,976.0 0	2,400.00	28	2.8 0	470.35	-	-
中信证券	202108110000 1452	贝达 药业	202 1- 08- 11	99,110.00	1,100.00	28	3.0 0	231.26	-	-
中信证券	202108110000 1454	健帆 生物	202 1- 08- 11	108,528.0 0	1,900.00	28	3.4 0	287.00	-	-
中信证券	202108110000 1456	芒果 超媒	202 1- 08- 11	762,564.0 0	13,200.00	28	2.8 0	1,660.69	-	-
中信证券	202108110000 1458	宋城 演艺	202 1- 08- 11	98,050.00	7,400.00	28	3.4 0	259.29	-	-
中信证券	202108110000 1460	沃森 生物	202 1- 08- 11	611,594.0 0	7,300.00	28	2.5 0	1,189.21	-	-
中信证券	202108110000 1462	信	202 1-	354,816.0 0	13,200.00	28	2.9 0	800.31	-	-

		维通信	08-11							
中信证券	2021081100001464	三环集团	2021-08-11	228,174.00	5,100.00	28	2.70	479.17	-	-
中信证券	2021081100001466	泰格医药	2021-08-11	404,775.00	2,500.00	28	2.30	724.10	-	-
中信证券	2021081100001474	阳光电源	2021-08-11	1,056,528.00	6,900.00	28	2.90	2,383.06	-	-
中信证券	2021081200000911	中国通号	2021-08-12	100,980.00	19,800.00	28	2.00	157.08	-	-
中信证券	2021081200000913	沪硅产业	2021-08-12	405,284.00	12,200.00	28	2.50	788.05	-	-
中信证券	2021081200000915	澜起科技	2021-08-12	850,080.00	13,200.00	28	2.40	1,586.82	-	-
中信证券	2021081200000957	乐普医疗	2021-08-12	524,700.00	19,800.00	28	2.70	1,101.87	-	-
中信证券	2021081200000959	东方财富	2021-08-12	1,340,108.00	41,800.00	28	3.10	3,231.15	-	-
中信证券	2021081200000961	智飞生物	2021-08-12	617,500.00	3,800.00	28	2.90	1,392.81	-	-
中信证券	2021081200000963	同花顺	2021-08-12	96,880.00	1,000.00	28	3.10	233.59	-	-
中信证券	2021081200000965	亿纬锂能	2021-08-12	2,225,124.00	19,800.00	28	2.40	4,153.56	-	-
中信证券	2021081200000967	爱尔眼科	2021-08-12	695,706.00	12,700.00	28	2.50	1,352.76	-	-

中信证券	202108120000 0969	汇川技术	2021-08-12	540,054.00	7,300.00	28	2.50	1,050.11	-	-
中信证券	202108120000 0971	亿联网络	2021-08-12	113,581.00	1,300.00	28	2.20	194.35	-	-
中信证券	202108120000 0973	华大基因	2021-08-12	586,080.00	5,500.00	28	3.20	1,458.69	-	-
中信证券	202108120000 0975	康泰生物	2021-08-12	256,671.00	1,900.00	28	2.80	558.97	-	-
中信证券	202108120000 0977	贝达药业	2021-08-12	100,540.00	1,100.00	28	3.00	234.59	-	-
中信证券	202108120000 0979	欧普康视	2021-08-12	214,080.00	2,400.00	28	2.80	466.22	-	-
中信证券	202108120000 0981	英科医疗	2021-08-12	582,714.00	5,400.00	28	3.00	1,359.67	-	-
中信证券	202108120000 0983	阳光电源	2021-08-12	1,035,069.00	6,900.00	28	2.90	2,334.66	-	-
中信证券	202108120000 0985	泰格医药	2021-08-12	387,500.00	2,500.00	28	2.30	693.19	-	-
中信证券	202108120000 0987	宋城演艺	2021-08-12	96,126.00	7,400.00	28	3.40	254.20	-	-
中信证券	202108120000 0989	信维通信	2021-08-12	352,044.00	13,200.00	28	2.90	794.05	-	-
中信证券	202108120000 0991	沃森生物	2021-08-12	589,694.00	7,300.00	28	2.50	1,146.63	-	-
中信证券	202108120000 0993	三环集	2021-08-12	241,995.00	5,100.00	28	2.70	508.19	-	-

		团								
中信证券	202108120000 0995	温 氏 股 份	202 1- 08- 12	282,359.0 0	20,900.00	28	3.3 0	724.72	-	-
中信证券	202108120000 0997	健 帆 生 物	202 1- 08- 12	109,231.0 0	1,900.00	28	3.4 0	288.86	-	-
中信证券	202108120000 0999	先 导 智 能	202 1- 08- 12	338,888.0 0	4,400.00	28	2.3 0	606.23	-	-
中信证券	202108120000 1001	芒 果 超 媒	202 1- 08- 12	753,720.0 0	13,200.00	28	2.8 0	1,641.43	-	-
中信证券	202108120000 1003	蓝 思 科 技	202 1- 08- 12	177,520.0 0	7,000.00	28	2.5 0	345.18	-	-
中信证券	202108120001 8385	爱 尔 眼 科	202 1- 08- 12	8,217,000. 00	150,000.0 0	28	2.8 0	17,894.80	-	-
中信证券	202108170000 0797	爱 尔 眼 科	202 1- 08- 17	2,059,200. 00	39,600.00	28	2.5 0	4,004.00	-	-
中信证券	202108170000 0799	中 国 通 号	202 1- 08- 17	201,168.0 0	39,600.00	28	1.8 0	281.64	-	-
中信证券	202108170000 0801	沪 硅 产 业	202 1- 08- 17	399,696.0 0	13,200.00	28	3.0 0	932.62	-	-
中信证券	202108170000 0803	澜 起 科 技	202 1- 08- 17	785,400.0 0	13,200.00	28	2.3 0	1,404.99	-	-
中信证券	202108170000 0841	康 泰 生 物	202 1- 08- 17	892,254.0 0	6,600.00	28	2.8 0	1,943.13	-	-
中信证券	202108170000 0843	亿 联 网 络	202 1- 08- 17	564,960.0 0	6,600.00	28	2.2 0	966.71	-	-
中信证券	202108170000 0847	信 维	202 1-	337,920.0 0	13,200.00	28	2.8 0	735.91	-	-

		通信	08-17							
中信证券	2021081700000849	沃森生物	2021-08-17	1,953,600.00	26,400.00	28	2.60	3,950.61	-	-
中信证券	2021081700000851	汇川技术	2021-08-17	1,405,800.00	19,800.00	28	2.20	2,405.48	-	-
中信证券	2021081700000853	东方财富	2021-08-17	3,884,892.00	125,400.00	28	3.20	9,669.06	-	-
中信证券	2021081700000855	智飞生物	2021-08-17	1,986,600.00	13,200.00	28	2.50	3,862.83	-	-
中信证券	2021081700000857	三环集团	2021-08-17	548,328.00	13,200.00	28	2.30	980.90	-	-
中信证券	2021081700000859	芒果超媒	2021-08-17	703,560.00	13,200.00	28	2.80	1,532.20	-	-
中信证券	2021081700000861	泰格医药	2021-08-17	943,338.00	6,600.00	28	2.50	1,834.27	-	-
中信证券	2021081700000863	宋城演艺	2021-08-17	356,136.00	26,400.00	28	3.40	941.78	-	-
中信证券	2021081700000865	阳光电源	2021-08-17	1,910,040.00	13,200.00	28	2.70	4,011.08	-	-
中信证券	2021081700000867	同花顺	2021-08-17	681,912.00	6,600.00	28	2.80	1,485.05	-	-
中信证券	2021081700000869	乐普医疗	2021-08-17	518,562.00	19,800.00	28	2.80	1,129.31	-	-
中信证券	2021081700000871	健帆生物	2021-08-17	356,400.00	6,600.00	28	3.00	831.60	-	-
中信证券	2021081700000873	贝	2021-	582,780.00	6,600.00	28	2.30	1,042.53	-	-

		达药 业	08- 17								
中信证券	202108170000 0875	温氏 股份	202 1- 08- 17	864,600.0 0	66,000.00	28	3.3 0	2,219.14	-	-	
中信证券	202108170000 0877	蓝思 科技	202 1- 08- 17	479,556.0 0	19,800.00	28	2.2 0	820.57	-	-	
中信证券	202108170000 0879	先导 智能	202 1- 08- 17	962,940.0 0	13,200.00	28	2.3 0	1,722.59	-	-	
中信证券	202108170000 0881	华大 基因	202 1- 08- 17	673,926.0 0	6,600.00	28	2.8 0	1,467.66	-	-	
中信证券	202108170000 0883	英科 医疗	202 1- 08- 17	731,280.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,820.07	-	-	
中信证券	202108170000 0885	欧普 康视	202 1- 08- 17	533,280.0 0	6,600.00	28	2.6 0	1,078.41	-	-	
中信证券	202108170001 2906	温氏 股份	202 1- 08- 17	131,000.0 0	10,000.00	14	3.4 0	173.21	-	-	
中信证券	202108200000 0800	中国 通号	202 1- 08- 20	201,564.0 0	39,600.00	28	1.8 0	282.19	-	-	
中信证券	202108200000 0802	沪硅 产业	202 1- 08- 20	409,596.0 0	13,200.00	28	3.0 0	955.72	-	-	
中信证券	202108200000 0804	澜起 科技	202 1- 08- 20	778,800.0 0	13,200.00	28	2.3 0	1,393.19	-	-	
中信证券	202108200000 0860	英科 医疗	202 1- 08- 20	676,302.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,683.24	-	-	
中信证券	202108200000 0874	亿联 网络	202 1- 08- 20	566,280.0 0	6,600.00	28	2.2 0	968.97	-	-	

中信证券	202108200000 0876	华 大 基 因	202 1- 08- 20	654,192.0 0	6,600.00	28	2.8 0	1,424.68	-	-
中信证券	202108200000 0878	爱 尔 眼 科	202 1- 08- 20	1,851,300. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,599.75	-	-
中信证券	202108200000 0880	同 花 顺	202 1- 08- 20	719,664.0 0	6,600.00	28	2.8 0	1,567.27	-	-
中信证券	202108200000 0882	乐 普 医 疗	202 1- 08- 20	490,050.0 0	19,800.00	28	2.8 0	1,067.22	-	-
中信证券	202108200000 0884	亿 纬 锂 能	202 1- 08- 20	1,950,300. 00	19,800.00	28	2.4 0	3,640.56	-	-
中信证券	202108200000 0886	先 导 智 能	202 1- 08- 20	1,001,484. 00	13,200.00	28	2.3 0	1,791.54	-	-
中信证券	202108200000 0888	温 氏 股 份	202 1- 08- 20	858,000.0 0	66,000.00	28	3.3 0	2,202.20	-	-
中信证券	202108200000 0890	芒 果 超 媒	202 1- 08- 20	703,032.0 0	13,200.00	28	2.8 0	1,531.05	-	-
中信证券	202108200000 0892	蓝 思 科 技	202 1- 08- 20	497,772.0 0	19,800.00	28	2.2 0	851.74	-	-
中信证券	202108200000 0894	欧 普 康 视	202 1- 08- 20	500,280.0 0	6,600.00	28	2.6 0	1,011.68	-	-
中信证券	202108200000 0896	康 泰 生 物	202 1- 08- 20	857,076.0 0	6,600.00	28	2.8 0	1,866.52	-	-
中信证券	202108200000 0898	健 帆 生 物	202 1- 08- 20	341,484.0 0	6,600.00	28	3.0 0	796.80	-	-
中信证券	202108200000 0900	三 环 集 团	202 1- 08- 20	516,120.0 0	13,200.00	28	2.3 0	923.28	-	-

中信证券	202108200000 0902	贝达药业	2021-08-20	538,626.00	6,600.00	28	2.30	963.54	-	-
中信证券	202108200000 0904	汇川技术	2021-08-20	1,373,724.00	19,800.00	28	2.20	2,350.59	-	-
中信证券	202108200000 0906	信维通信	2021-08-20	330,528.00	13,200.00	28	2.80	719.82	-	-
中信证券	202108200000 0908	东方财富	2021-08-20	3,938,814.00	125,400.00	28	3.20	9,803.27	-	-
中信证券	202108200000 0910	智飞生物	2021-08-20	1,914,660.00	13,200.00	28	2.50	3,722.95	-	-
中信证券	202108200000 0912	阳光电源	2021-08-20	1,818,960.00	13,200.00	28	2.70	3,819.82	-	-
中信证券	202108200000 0914	泰格医药	2021-08-20	896,742.00	6,600.00	28	2.50	1,743.67	-	-
中信证券	202108200000 0916	沃森生物	2021-08-20	2,144,472.00	26,400.00	28	2.60	4,336.60	-	-
中信证券	202108200000 0918	宋城演艺	2021-08-20	359,304.00	26,400.00	28	3.40	950.16	-	-
中信证券	202108240001 8359	爱尔眼科	2021-08-24	792,800.00	16,000.00	28	2.50	1,596.62	-	-
中信证券	202108260000 0912	中国通号	2021-08-26	202,752.00	39,600.00	28	2.40	378.47	-	-
中信证券	202108260000 0914	沪硅产业	2021-08-26	382,800.00	13,200.00	28	2.90	863.43	-	-
中信证券	202108260000 0916	澜起科	2021-08-26	764,412.00	13,200.00	28	3.00	1,783.63	-	-

中信证券	202108260000 0942	技 亿 纬 锂 能	202 1- 08- 26	1,908,522. 00	19,800.00	28	2.4 0	3,562.57	-	-
中信证券	202108260000 0944	爱 尔 眼 科	202 1- 08- 26	1,928,916. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,750.67	-	-
中信证券	202108260000 0946	乐 普 医 疗	202 1- 08- 26	497,376.0 0	19,800.00	28	2.9 0	1,121.86	-	-
中信证券	202108260000 0948	汇 川 技 术	202 1- 08- 26	1,470,546. 00	19,800.00	28	2.9 0	3,316.90	-	-
中信证券	202108260000 0950	信 维 通 信	202 1- 08- 26	307,296.0 0	13,200.00	28	2.3 0	549.72	-	-
中信证券	202108260000 0952	智 飞 生 物	202 1- 08- 26	2,082,828. 00	13,200.00	28	2.4 0	3,887.95	-	-
中信证券	202108260000 0954	同 花 顺	202 1- 08- 26	740,190.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,842.25	-	-
中信证券	202108260000 0956	东 方 财 富	202 1- 08- 26	3,884,892. 00	125,400.0 0	28	3.1 0	9,366.91	-	-
中信证券	202108260000 0962	亿 联 网 络	202 1- 08- 26	538,890.0 0	6,600.00	28	2.1 0	880.19	-	-
中信证券	202108260000 0964	华 大 基 因	202 1- 08- 26	650,760.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,569.05	-	-
中信证券	202108260000 0966	康 泰 生 物	202 1- 08- 26	825,858.0 0	6,600.00	28	3.3 0	2,119.70	-	-
中信证券	202108260000 0968	贝 达 药 业	202 1- 08- 26	519,156.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,251.74	-	-
中信证券	202108260000 0970	欧 普	202 1- 08-	496,716.0 0	6,600.00	28	2.9 0	1,120.37	-	-

		康视	26							
中信证券	202108260000 0972	泰格医药	202 1- 08- 26	934,230.0 0	6,600.00	28	2.5 0	1,816.56	-	-
中信证券	202108260000 0974	三环集团	202 1- 08- 26	515,988.0 0	13,200.00	28	2.9 0	1,163.84	-	-
中信证券	202108260000 0976	阳光电源	202 1- 08- 26	1,980,660. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,159.39	-	-
中信证券	202108260000 0978	沃森生物	202 1- 08- 26	2,216,016. 00	26,400.00	28	2.7 0	4,653.63	-	-
中信证券	202108260000 0980	宋城演艺	202 1- 08- 26	388,080.0 0	26,400.00	28	3.4 0	1,026.26	-	-
中信证券	202108260000 0982	温氏股份	202 1- 08- 26	881,100.0 0	66,000.00	28	3.2 0	2,192.96	-	-
中信证券	202108260000 0984	健帆生物	202 1- 08- 26	332,508.0 0	6,600.00	28	3.1 0	801.71	-	-
中信证券	202108260000 0986	先导智能	202 1- 08- 26	943,272.0 0	13,200.00	28	2.9 0	2,127.60	-	-
中信证券	202108260000 0988	芒果超媒	202 1- 08- 26	690,360.0 0	13,200.00	28	3.2 0	1,718.23	-	-
中信证券	202108260000 0990	蓝思科技	202 1- 08- 26	479,160.0 0	19,800.00	28	2.9 0	1,080.77	-	-
中信证券	202108260001 4793	温氏股份	202 1- 08- 26	133,500.0 0	10,000.00	28	3.3 0	342.65	-	-
中信证券	202108260001 4795	温氏股份	202 1- 08- 26	133,500.0 0	10,000.00	28	3.3 0	342.65	-	-
中信证券	202108260001	宋	202	439,530.0	29,900.00	28	3.4	1,162.31	-	-

	4797	城 演 艺	1- 08- 26	0			0			
中信证券	202108260001 4799	亿 纬 锂 能	202 1- 08- 26	14,458,50 0.00	150,000.0 0	28	2.4 0	26,989.20	-	-
中信证券	202108260001 4801	沃 森 生 物	202 1- 08- 26	839,400.0 0	10,000.00	28	2.6 0	1,697.45	-	-
中信证券	202108260001 4803	沃 森 生 物	202 1- 08- 26	839,400.0 0	10,000.00	28	2.6 0	1,697.45	-	-
中信证券	202109010001 9793	中 微 公 司	202 1- 09- 01	7,915,000. 00	50,000.00	28	3.2 0	19,699.56	-	-
中信证券	202109070002 1943	爱 尔 眼 科	202 1- 09- 07	571,627.0 0	12,700.00	28	3.0 0	1,476.71	-	-
中信证券	202109070002 1945	康 泰 生 物	202 1- 09- 07	223,991.0 0	1,900.00	28	3.2 0	617.22	-	-
中信证券	202109070002 1947	沪 硅 产 业	202 1- 09- 07	365,512.0 0	12,200.00	28	3.3 0	1,038.67	-	-
中信证券	202109070002 1949	亿 联 网 络	202 1- 09- 07	108,030.0 0	1,300.00	28	2.9 0	269.78	-	-
中信证券	202109070002 1951	乐 普 医 疗	202 1- 09- 07	527,274.0 0	19,800.00	28	2.9 0	1,316.72	-	-
中信证券	202109070002 1953	亿 纬 锂 能	202 1- 09- 07	1,989,900. 00	19,800.00	28	3.1 0	5,311.93	-	-
中信证券	202109070002 1955	智 飞 生 物	202 1- 09- 07	626,506.0 0	3,800.00	28	2.6 0	1,402.67	-	-
中信证券	202109070002 1957	东 方 财 富	202 1- 09- 07	1,429,560. 00	41,800.00	28	3.2 0	3,939.24	-	-

中信证券	202109070002 1959	中国 通号	202 1- 09- 07	107,118.0 0	19,800.00	28	2.9 0	267.50	-	-
中信证券	202109070002 1961	澜 起 科 技	202 1- 09- 07	774,312.0 0	13,200.00	28	3.0 0	2,000.31	-	-
中信证券	202109070002 1963	华 大 基 因	202 1- 09- 07	531,630.0 0	5,500.00	28	3.1 0	1,419.16	-	-
中信证券	202109070002 1965	英 科 医 疗	202 1- 09- 07	542,106.0 0	5,400.00	28	3.2 0	1,493.80	-	-
中信证券	202109070002 1967	沃 森 生 物	202 1- 09- 07	568,524.0 0	7,300.00	28	2.8 0	1,370.78	-	-
中信证券	202109070002 1969	泰 格 医 药	202 1- 09- 07	361,025.0 0	2,500.00	28	2.5 0	777.20	-	-
中信证券	202109070002 1971	汇 川 技 术	202 1- 09- 07	532,097.0 0	7,300.00	28	2.6 0	1,191.31	-	-
中信证券	202109070002 1973	温 氏 股 份	202 1- 09- 07	284,449.0 0	20,900.00	28	3.3 0	808.31	-	-
中信证券	202109070002 1975	同 花 顺	202 1- 09- 07	134,920.0 0	1,000.00	28	3.2 0	371.78	-	-
中信证券	202109070002 1977	阳 光 电 源	202 1- 09- 07	979,800.0 0	6,900.00	28	2.9 0	2,446.78	-	-
中信证券	202109070002 1979	蓝 思 科 技	202 1- 09- 07	170,870.0 0	7,000.00	28	3.0 0	441.42	-	-
中信证券	202109070002 2131	欧 普 康 视	202 1- 09- 07	160,752.0 0	2,400.00	28	2.6 0	359.91	-	-
中信证券	202109070002 2133	健 帆 生 物	202 1- 09- 07	96,330.00	1,900.00	28	3.2 0	265.44	-	-

中信证券	202109070002 2135	三环集团	2021-09-07	189,924.00	5,100.00	28	2.50	408.87	-	-
中信证券	202109070002 2137	信维通信	2021-09-07	319,044.00	13,200.00	28	2.80	769.25	-	-
中信证券	202109070002 2139	宋城演艺	2021-09-07	118,326.00	7,400.00	28	3.10	315.87	-	-
中信证券	202109070002 2141	芒果超媒	2021-09-07	588,588.00	13,200.00	28	3.00	1,520.52	-	-
中信证券	202109070002 2143	先导智能	2021-09-07	311,124.00	4,400.00	28	3.00	803.74	-	-
中信证券	202109070002 2145	贝达药业	2021-09-07	94,710.00	1,100.00	28	3.20	260.98	-	-
中信证券	202109080000 0857	中国通号	2021-09-08	60,060.00	11,000.00	28	1.90	95.10	-	-
中信证券	202109080000 0859	沪硅产业	2021-09-08	111,000.00	3,700.00	28	3.10	286.75	-	-
中信证券	202109080000 0861	澜起科技	2021-09-08	215,710.00	3,700.00	28	2.30	413.44	-	-
中信证券	202109080000 0873	乐普医疗	2021-09-08	144,870.00	5,500.00	28	2.30	277.67	-	-
中信证券	202109080000 0875	华大基因	2021-09-08	172,584.00	1,800.00	28	2.30	330.78	-	-
中信证券	202109080000 0877	亿纬锂能	2021-09-08	547,745.00	5,500.00	28	2.60	1,186.78	-	-
中信证券	202109080000 0879	东方财	2021-09-08	882,250.00	25,000.00	28	2.90	2,132.10	-	-

中信证券	202109080000 0881	富智 飞 生物	202 1- 09- 08	591,630.0 0	3,700.00	28	2.2 0	1,084.65	-	-
中信证券	202109080000 0883	爱 尔 眼 科	202 1- 09- 08	492,910.0 0	11,000.00	28	2.7 0	1,109.05	-	-
中信证券	202109080000 0885	同 花 顺	202 1- 09- 08	247,158.0 0	1,800.00	28	2.9 0	597.30	-	-
中信证券	202109080000 0887	蓝 思 科 技	202 1- 09- 08	138,270.0 0	5,500.00	28	1.8 0	207.41	-	-
中信证券	202109080000 0889	温 氏 股 份	202 1- 09- 08	249,246.0 0	18,300.00	28	3.2 0	664.66	-	-
中信证券	202109080000 0891	健 帆 生 物	202 1- 09- 08	90,432.00	1,800.00	28	3.2 0	241.16	-	-
中信证券	202109080000 0893	先 导 智 能	202 1- 09- 08	254,375.0 0	3,700.00	28	3.1 0	657.14	-	-
中信证券	202109080000 0895	康 泰 生 物	202 1- 09- 08	209,754.0 0	1,800.00	28	2.9 0	506.90	-	-
中信证券	202109080000 0897	贝 达 药 业	202 1- 09- 08	153,558.0 0	1,800.00	28	2.6 0	332.71	-	-
中信证券	202109080000 0899	亿 联 网 络	202 1- 09- 08	149,724.0 0	1,800.00	28	2.6 0	324.41	-	-
中信证券	202109080000 0901	欧 普 康 视	202 1- 09- 08	119,646.0 0	1,800.00	28	2.7 0	269.21	-	-
中信证券	202109080000 0903	沃 森 生 物	202 1- 09- 08	564,290.0 0	7,300.00	28	2.5 0	1,175.60	-	-
中信证券	202109080000 0905	宋 城	202 1- 09-	117,165.0 0	7,300.00	28	3.7 0	361.25	-	-

		演艺	08							
中信证券	202109080000 0907	汇川技术	202 1- 09- 08	385,000.0 0	5,500.00	28	2.7 0	866.25	-	-
中信证券	202109080000 0909	三环集团	202 1- 09- 08	138,639.0 0	3,700.00	28	2.8 0	323.49	-	-
中信证券	202109080000 0911	信维通信	202 1- 09- 08	90,835.00	3,700.00	28	3.0 0	227.09	-	-
中信证券	202109080000 0913	芒果超媒	202 1- 09- 08	166,426.0 0	3,700.00	28	2.9 0	402.19	-	-
中信证券	202109080000 0915	阳光电源	202 1- 09- 08	505,827.0 0	3,700.00	28	3.1 0	1,306.72	-	-
中信证券	202109080000 0917	泰格医药	202 1- 09- 08	262,800.0 0	1,800.00	28	3.0 0	657.00	-	-
中信证券	202109080001 1449	澜起科技	202 1- 09- 08	769,560.0 0	13,200.00	28	3.0 0	1,923.90	-	-
中信证券	202109080001 1451	华大基因	202 1- 09- 08	527,340.0 0	5,500.00	28	3.1 0	1,362.30	-	-
中信证券	202109080001 1453	沪硅产业	202 1- 09- 08	366,000.0 0	12,200.00	28	3.3 0	1,006.50	-	-
中信证券	202109080001 1455	中国通号	202 1- 09- 08	108,108.0 0	19,800.00	28	2.9 0	261.26	-	-
中信证券	202109080001 1457	英科医疗	202 1- 09- 08	534,006.0 0	5,400.00	28	3.2 0	1,424.01	-	-
中信证券	202109080001 1459	亿联网络	202 1- 09- 08	108,134.0 0	1,300.00	28	2.9 0	261.32	-	-
中信证券	202109080001	爱	202	569,087.0	12,700.00	28	3.0	1,422.72	-	-

	1461	尔眼科	1-09-08	0			0			
中信证券	2021090800011463	阳光电源	2021-09-08	943,299.00	6,900.00	28	2.90	2,279.64	-	-
中信证券	2021090800011465	乐普医疗	2021-09-08	521,532.00	19,800.00	28	2.90	1,260.36	-	-
中信证券	2021090800011467	亿纬锂能	2021-09-08	1,971,882.00	19,800.00	28	3.10	5,094.03	-	-
中信证券	2021090800011469	智飞生物	2021-09-08	607,620.00	3,800.00	28	2.60	1,316.51	-	-
中信证券	2021090800011471	康泰生物	2021-09-08	221,407.00	1,900.00	28	3.20	590.42	-	-
中信证券	2021090800011473	蓝思科技	2021-09-08	175,980.00	7,000.00	28	3.00	439.95	-	-
中信证券	2021090800011475	先导智能	2021-09-08	302,500.00	4,400.00	28	3.00	756.25	-	-
中信证券	2021090800011477	贝达药业	2021-09-08	93,841.00	1,100.00	28	3.20	250.24	-	-
中信证券	2021090800011479	欧普康视	2021-09-08	159,528.00	2,400.00	28	2.60	345.64	-	-
中信证券	2021090800011481	同花顺	2021-09-08	137,310.00	1,000.00	28	3.20	366.16	-	-
中信证券	2021090800011483	东方财富	2021-09-08	1,475,122.00	41,800.00	28	3.20	3,933.65	-	-
中信证券	2021090800011485	温氏股份	2021-09-08	284,658.00	20,900.00	28	3.30	782.81	-	-

中信证券	202109080001 1487	汇川技术	2021-09-08	511,000.00	7,300.00	28	2.60	1,107.17	-	-
中信证券	202109080001 1535	三环集团	2021-09-08	191,097.00	5,100.00	28	2.50	398.12	-	-
中信证券	202109080001 1537	信维通信	2021-09-08	324,060.00	13,200.00	28	2.80	756.14	-	-
中信证券	202109080001 1539	泰格医药	2021-09-08	365,000.00	2,500.00	28	2.50	760.41	-	-
中信证券	202109080001 1541	芒果超媒	2021-09-08	593,736.00	13,200.00	28	3.00	1,484.34	-	-
中信证券	202109080001 1543	健帆生物	2021-09-08	95,456.00	1,900.00	28	3.20	254.55	-	-
中信证券	202109080001 1545	沃森生物	2021-09-08	564,290.00	7,300.00	28	2.80	1,316.68	-	-
中信证券	202109080001 1547	宋城演艺	2021-09-08	118,770.00	7,400.00	28	3.10	306.82	-	-
中信证券	202109090001 4099	亿联网络	2021-09-09	105,950.00	1,300.00	28	2.90	247.51	-	-
中信证券	202109090001 4101	欧普康视	2021-09-09	159,480.00	2,400.00	28	2.60	334.02	-	-
中信证券	202109090001 4103	康泰生物	2021-09-09	239,476.00	1,900.00	28	3.20	617.32	-	-
中信证券	202109090001 4105	三环集团	2021-09-09	188,700.00	5,100.00	28	2.50	380.02	-	-
中信证券	202109090001 4107	东方财	2021-09-09	1,473,868.00	41,800.00	28	3.20	3,799.30	-	-

中信证券	2021090900014109	富智飞生物	2021-09-09	606,290.00	3,800.00	28	2.60	1,269.84	-	-
中信证券	2021090900014111	同花顺	2021-09-09	137,520.00	1,000.00	28	3.20	354.49	-	-
中信证券	2021090900014113	爱尔眼科	2021-09-09	6,777,000.00	150,000.00	28	3.00	16,377.75	-	-
中信证券	2021090900014115	爱尔眼科	2021-09-09	573,786.00	12,700.00	28	3.00	1,386.65	-	-
中信证券	2021090900014117	汇川技术	2021-09-09	512,314.00	7,300.00	28	2.60	1,073.01	-	-
中信证券	2021090900014119	阳光电源	2021-09-09	953,304.00	6,900.00	28	2.90	2,227.02	-	-
中信证券	2021090900014121	泰格医药	2021-09-09	375,000.00	2,500.00	28	2.50	755.21	-	-
中信证券	2021090900014123	宋城演艺	2021-09-09	118,178.00	7,400.00	28	3.10	295.12	-	-
中信证券	2021090900015299	沪硅产业	2021-09-09	356,606.00	12,200.00	28	3.30	947.98	-	-
中信证券	2021090900015301	中国通号	2021-09-09	109,890.00	19,800.00	28	2.90	256.71	-	-
中信证券	2021090900015303	澜起科技	2021-09-09	753,324.00	13,200.00	28	3.00	1,820.54	-	-
中信证券	2021090900015315	乐普医疗	2021-09-09	525,492.00	19,800.00	28	2.90	1,227.61	-	-
中信证券	2021090900015317	亿纬	2021-09-09	2,013,858.00	19,800.00	28	3.10	5,029.06	-	-

		锂能	09							
中信证券	2021090900015319	温氏股份	2021-09-09	285,912.00	20,900.00	28	3.30	760.05	-	-
中信证券	2021090900015321	健帆生物	2021-09-09	94,715.00	1,900.00	28	3.20	244.16	-	-
中信证券	2021090900015323	先导智能	2021-09-09	304,480.00	4,400.00	28	3.00	735.82	-	-
中信证券	2021090900015325	芒果超媒	2021-09-09	569,712.00	13,200.00	28	3.00	1,376.81	-	-
中信证券	2021090900015327	蓝思科技	2021-09-09	172,760.00	7,000.00	28	3.00	417.51	-	-
中信证券	2021090900015329	贝达药业	2021-09-09	94,842.00	1,100.00	28	3.20	244.48	-	-
中信证券	2021090900015331	华大基因	2021-09-09	517,220.00	5,500.00	28	3.10	1,291.61	-	-
中信证券	2021090900015333	英科医疗	2021-09-09	524,286.00	5,400.00	28	3.20	1,351.49	-	-
中信证券	2021090900015335	信维通信	2021-09-09	316,536.00	13,200.00	28	2.80	713.97	-	-
中信证券	2021090900015337	沃森生物	2021-09-09	542,755.00	7,300.00	28	2.80	1,224.21	-	-
中信证券	2021091400014836	同花顺	2021-09-14	899,118.00	6,600.00	28	2.90	2,028.01	-	-
中信证券	2021091400014838	亿联网络	2021-09-14	527,274.00	6,600.00	28	2.60	1,066.27	-	-
中信证券	2021091400014840	康	2021-	745,866.00	6,600.00	28	2.90	1,682.34	-	-

		泰生物	09-14								
中信证券	2021091400014842	英科医疗	2021-09-14	645,612.00	6,600.00	28	3.10	1,556.64	-	-	
中信证券	2021091400014844	华大基因	2021-09-14	634,854.00	6,600.00	28	2.30	1,135.68	-	-	
中信证券	2021091400014846	宋城演艺	2021-09-14	393,096.00	26,400.00	28	3.70	1,131.24	-	-	
中信证券	2021091400014848	沃森生物	2021-09-14	1,882,848.00	26,400.00	28	2.50	3,661.09	-	-	
中信证券	2021091400014850	泰格医药	2021-09-14	1,036,200.00	6,600.00	28	3.00	2,417.80	-	-	
中信证券	2021091400014852	阳光电源	2021-09-14	1,785,828.00	13,200.00	28	3.10	4,305.83	-	-	
中信证券	2021091400014854	东方财富	2021-09-14	4,439,160.00	125,400.00	28	2.90	10,012.77	-	-	
中信证券	2021091400014856	信维通信	2021-09-14	312,576.00	13,200.00	28	3.00	729.34	-	-	
中信证券	2021091400014858	智飞生物	2021-09-14	2,082,960.00	13,200.00	28	2.20	3,564.18	-	-	
中信证券	2021091400014860	汇川技术	2021-09-14	1,349,370.00	19,800.00	28	2.70	2,833.68	-	-	
中信证券	2021091400014862	健帆生物	2021-09-14	327,492.00	6,600.00	28	3.20	815.09	-	-	
中信证券	2021091400014864	欧普康视	2021-09-14	454,080.00	6,600.00	28	2.70	953.57	-	-	

中信证券	202109140001 4866	温氏股份	2021-09-14	870,540.00	66,000.00	28	3.20	2,166.68	-	-
中信证券	202109140001 4868	贝达药业	2021-09-14	574,200.00	6,600.00	28	2.60	1,161.16	-	-
中信证券	202109140001 4870	芒果超媒	2021-09-14	568,524.00	13,200.00	28	2.90	1,282.34	-	-
中信证券	202109140001 4872	三环集团	2021-09-14	484,440.00	13,200.00	28	2.80	1,055.00	-	-
中信证券	202109140001 4874	先导智能	2021-09-14	946,572.00	13,200.00	28	3.10	2,282.29	-	-
中信证券	202109140001 4876	蓝思科技	2021-09-14	474,804.00	19,800.00	28	1.80	664.73	-	-
中信证券	202109140001 5886	澜起科技	2021-09-14	754,116.00	13,200.00	28	2.30	1,349.03	-	-
中信证券	202109140001 5888	中国通号	2021-09-14	209,484.00	39,600.00	28	1.90	309.57	-	-
中信证券	202109140001 5890	沪硅产业	2021-09-14	370,920.00	13,200.00	28	3.10	894.33	-	-
中信证券	202109140001 5892	爱尔眼科	2021-09-14	1,857,240.00	39,600.00	28	2.70	3,900.20	-	-
中信证券	202109140001 5894	乐普医疗	2021-09-14	519,156.00	19,800.00	28	2.30	928.71	-	-
中信证券	202109170000 9209	健帆生物	2021-09-17	369,996.00	6,600.00	28	3.20	920.88	-	-
中信证券	202109170000 9211	贝达药	2021-09-17	620,334.00	6,600.00	28	2.60	1,254.45	-	-

中信证券	202109170000 9213	业 欧 普 康 视	202 1- 09- 17	532,620.0 0	6,600.00	28	2.7 0	1,118.50	-	-
中信证券	202109170000 9215	蓝 思 科 技	202 1- 09- 17	440,154.0 0	19,800.00	28	1.8 0	616.22	-	-
中信证券	202109170000 9217	先 导 智 能	202 1- 09- 17	954,492.0 0	13,200.00	28	3.1 0	2,301.39	-	-
中信证券	202109170000 9219	温 氏 股 份	202 1- 09- 17	902,880.0 0	66,000.00	28	3.2 0	2,247.17	-	-
中信证券	202109170000 9221	英 科 医 疗	202 1- 09- 17	606,936.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,463.39	-	-
中信证券	202109170000 9223	康 泰 生 物	202 1- 09- 17	743,490.0 0	6,600.00	28	2.9 0	1,676.98	-	-
中信证券	202109170000 9225	亿 联 网 络	202 1- 09- 17	522,390.0 0	6,600.00	28	2.6 0	1,056.39	-	-
中信证券	202109170000 9227	华 大 基 因	202 1- 09- 17	606,936.0 0	6,600.00	28	2.3 0	1,085.74	-	-
中信证券	202109170000 9229	智 飞 生 物	202 1- 09- 17	2,097,876. 00	13,200.00	28	2.2 0	3,589.70	-	-
中信证券	202109170000 9231	汇 川 技 术	202 1- 09- 17	1,298,484. 00	19,800.00	28	2.7 0	2,726.82	-	-
中信证券	202109170000 9233	信 维 通 信	202 1- 09- 17	307,560.0 0	13,200.00	28	3.0 0	717.64	-	-
中信证券	202109170000 9235	爱 尔 眼 科	202 1- 09- 17	2,061,576. 00	39,600.00	28	2.7 0	4,329.31	-	-
中信证券	202109170000 9237	同 花	202 1-	882,882.0 0	6,600.00	28	2.9 0	1,991.39	-	-

		顺	09-17							
中信证券	202109170000 9239	泰格医药	2021-09-17	1,145,100.00	6,600.00	28	3.00	2,671.90	-	-
中信证券	202109170000 9241	东方财富	2021-09-17	4,351,380.00	125,400.00	28	2.90	9,814.78	-	-
中信证券	202109170000 9243	三环集团	2021-09-17	471,372.00	13,200.00	28	2.80	1,026.54	-	-
中信证券	202109170000 9245	芒果超媒	2021-09-17	558,096.00	13,200.00	28	2.90	1,258.82	-	-
中信证券	202109170000 9247	沃森生物	2021-09-17	1,908,192.00	26,400.00	28	2.50	3,710.37	-	-
中信证券	202109170000 9249	宋城演艺	2021-09-17	381,480.00	26,400.00	28	3.70	1,097.81	-	-
中信证券	202109170000 9251	阳光电源	2021-09-17	1,636,536.00	13,200.00	28	3.10	3,945.87	-	-
中信证券	202109170000 9655	澜起科技	2021-09-17	742,500.00	13,200.00	28	2.30	1,328.25	-	-
中信证券	202109170000 9657	中国通号	2021-09-17	209,484.00	39,600.00	28	1.90	309.57	-	-
中信证券	202109170000 9659	沪硅产业	2021-09-17	373,560.00	13,200.00	28	3.10	900.69	-	-
中信证券	202109170000 9663	乐普医疗	2021-09-17	502,722.00	19,800.00	28	2.30	899.31	-	-
中信证券	202109170000 9665	亿纬锂能	2021-09-17	1,798,434.00	19,800.00	28	2.60	3,636.83	-	-
中信证券	202109220000	先	202	69,350.00	1,000.00	28	3.2	172.60	-	-

	1038	导智能	1-09-22				0			
中信证券	2021092200001040	温氏股份	2021-09-22	13,290.00	1,000.00	28	3.30	34.11	-	-
中信证券	2021092200001042	泰格医药	2021-09-22	174,780.00	1,000.00	28	2.90	394.23	-	-
中信证券	2021092200001044	健帆生物	2021-09-22	53,000.00	1,000.00	28	3.10	127.79	-	-
中信证券	2021092200001046	三环集团	2021-09-22	35,880.00	1,000.00	28	2.90	80.93	-	-
中信证券	2021092200001048	蓝思科技	2021-09-22	21,740.00	1,000.00	28	3.20	54.11	-	-
中信证券	2021092200001050	华大基因	2021-09-22	92,150.00	1,000.00	28	3.10	222.18	-	-
中信证券	2021092200001052	英科医疗	2021-09-22	89,510.00	1,000.00	28	3.30	229.74	-	-
中信证券	2021092200001054	贝达药业	2021-09-22	94,020.00	1,000.00	28	2.90	212.07	-	-
中信证券	2021092200001056	欧普康视	2021-09-22	79,800.00	1,000.00	28	3.30	204.82	-	-
中信证券	2021092200001058	阳光电源	2021-09-22	124,350.00	1,000.00	28	3.20	309.49	-	-
中信证券	2021092200001060	乐普医疗	2021-09-22	25,240.00	1,000.00	28	3.20	62.82	-	-
中信证券	2021092200001062	康泰生物	2021-09-22	108,110.00	1,000.00	28	3.30	277.48	-	-

中信证券	202109220000 1064	亿纬 锂能	202 1- 09- 22	89,430.00	1,000.00	28	3.0 0	208.67	-	-
中信证券	202109220000 1066	同花 顺	202 1- 09- 22	131,120.0 0	1,000.00	28	2.4 0	244.76	-	-
中信证券	202109220000 1068	信维 通信	202 1- 09- 22	24,310.00	1,000.00	28	2.5 0	47.27	-	-
中信证券	202109220000 1070	沃森 生物	202 1- 09- 22	67,750.00	1,000.00	28	2.8 0	147.54	-	-
中信证券	202109220000 1072	宋城 演艺	202 1- 09- 22	13,960.00	1,000.00	28	3.2 0	34.74	-	-
中信证券	202109220000 1074	东方 财富	202 1- 09- 22	34,350.00	1,000.00	28	2.9 0	77.48	-	-
中信证券	202109220000 1076	智飞 生物	202 1- 09- 22	160,500.0 0	1,000.00	28	3.7 0	461.88	-	-
中信证券	202109220000 1078	汇川 技术	202 1- 09- 22	63,190.00	1,000.00	28	3.0 0	147.44	-	-
中信证券	202109220000 1102	中国 通号	202 1- 09- 22	5,310.00	1,000.00	28	2.0 0	8.26	-	-
中信证券	202109220000 1104	中微 公司	202 1- 09- 22	157,750.0 0	1,000.00	28	4.6 0	564.39	-	-
中信证券	202109220000 1106	沪硅 产业	202 1- 09- 22	28,090.00	1,000.00	28	2.8 0	61.17	-	-
中信证券	202109220000 1108	澜起 科技	202 1- 09- 22	55,080.00	1,000.00	28	3.0 0	128.52	-	-
中信证券	202109220000 1110	石头 科技	202 1- 09- 22	716,060.0 0	1,000.00	28	1.5 0	835.40	-	-

中信证券	202109220000 1112	华 熙 生 物	202 1- 09- 22	172,550.0 0	1,000.00	28	4.0 0	536.82	-	-
中信证券	202109220000 1114	华 润 微	202 1- 09- 22	349,800.0 0	5,000.00	28	1.0 0	272.07	-	-
中信证券	202109220003 6447	爱 尔 眼 科	202 1- 09- 22	856,320.0 0	16,000.00	28	3.2 0	2,131.29	-	-
中信证券	202109230001 3509	亿 纬 锂 能	202 1- 09- 23	13,482,00 0.00	150,000.0 0	28	2.8 0	29,360.80	-	-
中信证券	202109230001 3511	沃 森 生 物	202 1- 09- 23	679,000.0 0	10,000.00	28	3.3 0	1,742.77	-	-
中信证券	202109230001 3515	温 氏 股 份	202 1- 09- 23	136,000.0 0	10,000.00	28	3.3 0	349.07	-	-
中信证券	202109230001 3517	温 氏 股 份	202 1- 09- 23	136,000.0 0	10,000.00	28	3.3 0	349.07	-	-
中信证券	202109230001 3525	沪 硅 产 业	202 1- 09- 23	380,688.0 0	13,200.00	28	2.4 0	710.62	-	-
中信证券	202109230001 3533	爱 尔 眼 科	202 1- 09- 23	2,073,060. 00	39,600.00	28	3.2 0	5,159.62	-	-
中信证券	202109230001 3535	同 花 顺	202 1- 09- 23	874,830.0 0	6,600.00	28	3.4 0	2,313.44	-	-
中信证券	202109230001 3537	东 方 财 富	202 1- 09- 23	4,304,982. 00	125,400.0 0	28	3.0 0	10,044.96	-	-
中信证券	202109230001 3539	乐 普 医 疗	202 1- 09- 23	510,048.0 0	19,800.00	28	2.9 0	1,150.44	-	-
中信证券	202109230001 3541	亿 纬 锂 能	202 1- 09- 23	1,779,624. 00	19,800.00	28	2.8 0	3,875.63	-	-

中信证券	202109230001 3543	欧普 康视	202 1- 09- 23	528,000.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,273.07	-	-
中信证券	202109230001 3545	华大 基因	202 1- 09- 23	606,738.0 0	6,600.00	28	2.9 0	1,368.53	-	-
中信证券	202109230001 5547	康泰 生物	202 1- 09- 23	715,374.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,724.85	-	-
中信证券	202109230001 5549	亿联 网络	202 1- 09- 23	520,740.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,296.06	-	-
中信证券	202109230001 6879	宋城 演艺	202 1- 09- 23	429,962.0 0	29,900.00	28	3.4 0	1,137.01	-	-
中信证券	202109230001 6881	澜起 科技	202 1- 09- 23	738,672.0 0	13,200.00	28	2.8 0	1,608.66	-	-
中信证券	202109230001 6899	中国 通号	202 1- 09- 23	212,256.0 0	39,600.00	28	2.1 0	346.68	-	-
中信证券	202109230001 6901	宋城 演艺	202 1- 09- 23	379,632.0 0	26,400.00	28	3.4 0	1,003.92	-	-
中信证券	202109230001 6903	阳光 电源	202 1- 09- 23	1,709,268. 00	13,200.00	28	2.9 0	3,855.35	-	-
中信证券	202109230001 6905	泰格 医药	202 1- 09- 23	1,121,934. 00	6,600.00	28	3.7 0	3,228.68	-	-
中信证券	202109230001 6907	汇川 技术	202 1- 09- 23	1,294,920. 00	19,800.00	28	3.0 0	3,021.48	-	-
中信证券	202109230001 6909	信维 通信	202 1- 09- 23	322,476.0 0	13,200.00	28	3.2 0	802.61	-	-
中信证券	202109230001 6911	沃森 生	202 1- 09- 23	1,792,560. 00	26,400.00	28	3.3 0	4,600.90	-	-

中信证券	2021092300016913	物三环集团	2021-09-23	478,896.00	13,200.00	28	3.30	1,229.17	-	-
中信证券	2021092300016915	温氏股份	2021-09-23	897,600.00	66,000.00	28	3.30	2,303.84	-	-
中信证券	2021092300016917	健帆生物	2021-09-23	351,120.00	6,600.00	28	3.10	846.59	-	-
中信证券	2021092300016919	贝达药业	2021-09-23	620,334.00	6,600.00	28	3.30	1,592.19	-	-
中信证券	2021092300016921	芒果超媒	2021-09-23	545,292.00	13,200.00	28	3.00	1,272.35	-	-
中信证券	2021092300016923	蓝思科技	2021-09-23	442,134.00	19,800.00	28	3.10	1,066.03	-	-
中信证券	2021092300016925	先导智能	2021-09-23	935,088.00	13,200.00	28	2.30	1,672.77	-	-
中信证券	2021092300016927	智飞生物	2021-09-23	2,113,320.00	13,200.00	28	3.20	5,259.82	-	-
中信证券	2021092800014484	康泰生物	2021-09-23	1,980.00	-	28	3.10	-	-	-
中信证券	2021092800014623	康泰生物	2021-09-22	300.00	-	28	3.30	-	-	-
中信证券	2021092800014642	康泰生物	2021-09-17	1,980.00	-	28	2.90	-	-	-
中信证券	2021092800014776	康泰生物	2021-09-14	1,980.00	-	28	2.90	-	-	-
中信证券	2021092800014798	康泰	2021-	570.00	-	28	3.20	-	-	-

		生物	09-09							
中信证券	2021092800014799	康泰生物	2021-09-08	540.00	-	28	2.90	-	-	-
中信证券	2021092800014804	康泰生物	2021-09-08	570.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021092800014810	康泰生物	2021-09-07	570.00	-	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021092900019181	中微公司	2021-09-29	7,779,500.00	50,000.00	28	3.00	18,152.17	-	-
中信证券	2021092900019490	英科医疗	2021-09-22	-	500.00	28	3.30	-	-	-
中信证券	2021092900019513	英科医疗	2021-09-17	-	3,300.00	28	3.10	-	-	-
中信证券	2021092900019521	英科医疗	2021-09-14	-	3,300.00	28	3.10	-	-	-
中信证券	2021092900019531	英科医疗	2021-09-09	-	2,700.00	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021092900019537	英科医疗	2021-09-08	-	2,700.00	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021092900019539	英科医疗	2021-09-07	-	2,700.00	28	3.20	-	-	-
中信证券	2021100800059363	东方财富	2021-10-08	1,445,862.00	41,800.00	28	2.90	3,261.22	-	-
中信证券	2021100800059365	同花顺	2021-10-08	122,100.00	1,000.00	28	2.40	227.92	-	-
中信证券	2021100800059367	欧	2021-1-	193,824.00	2,400.00	28	3.30	497.48	-	-

		普 康 视	10- 08								
中信证券	202110080005 9369	三 环 集 团	202 1- 10- 08	189,312.0 0	5,100.00	28	2.9 0	427.00	-	-	
中信证券	202110080005 9371	温 氏 股 份	202 1- 10- 08	320,397.0 0	20,900.00	28	3.3 0	822.35	-	-	
中信证券	202110080005 9373	汇 川 技 术	202 1- 10- 08	468,368.0 0	7,300.00	28	3.0 0	1,092.86	-	-	
中信证券	202110080005 9375	贝 达 药 业	202 1- 10- 08	106,722.0 0	1,100.00	28	2.9 0	240.72	-	-	
中信证券	202110080005 9377	智 飞 生 物	202 1- 10- 08	555,332.0 0	3,800.00	28	3.7 0	1,598.12	-	-	
中信证券	202110080005 9379	亿 纬 锂 能	202 1- 10- 08	1,993,068. 00	19,800.00	28	3.0 0	4,650.49	-	-	
中信证券	202110080005 9381	乐 普 医 疗	202 1- 10- 08	541,728.0 0	19,800.00	28	3.2 0	1,348.30	-	-	
中信证券	202110080005 9383	先 导 智 能	202 1- 10- 08	308,440.0 0	4,400.00	28	3.2 0	767.67	-	-	
中信证券	202110080005 9385	蓝 思 科 技	202 1- 10- 08	148,470.0 0	7,000.00	28	3.2 0	369.53	-	-	
中信证券	202110080005 9387	康 泰 生 物	202 1- 10- 08	203,053.0 0	1,900.00	28	3.3 0	521.17	-	-	
中信证券	202110080005 9389	信 维 通 信	202 1- 10- 08	306,900.0 0	13,200.00	28	2.5 0	596.75	-	-	
中信证券	202110080005 9391	泰 格 医 药	202 1- 10- 08	433,300.0 0	2,500.00	28	2.9 0	977.33	-	-	

中信证券	202110080005 9395	阳光 电源	202 1- 10- 08	1,036,380. 00	6,900.00	28	3.2 0	2,579.43	-	-
中信证券	202110080005 9397	华大 基因	202 1- 10- 08	479,105.0 0	5,500.00	28	3.1 0	1,155.18	-	-
中信证券	202110080005 9399	澜起 科技	202 1- 10- 08	790,812.0 0	13,200.00	28	3.0 0	1,845.23	-	-
中信证券	202110080005 9401	英科 医疗	202 1- 10- 08	309,528.0 0	5,400.00	28	3.3 0	794.46	-	-
中信证券	202110080005 9403	亿联 网络	202 1- 10- 08	109,707.0 0	1,300.00	28	2.3 0	196.25	-	-
中信证券	202110080005 9405	爱尔 眼科	202 1- 10- 08	675,386.0 0	12,700.00	28	3.3 0	1,733.49	-	-
中信证券	202110080005 9407	中国 通号	202 1- 10- 08	103,356.0 0	19,800.00	28	2.0 0	160.78	-	-
中信证券	202110080005 9409	健帆 生物	202 1- 10- 08	111,340.0 0	1,900.00	28	3.1 0	268.45	-	-
中信证券	202110080005 9411	宋城 演艺	202 1- 10- 08	110,038.0 0	7,400.00	28	3.2 0	273.87	-	-
中信证券	202110080005 9413	沃森 生物	202 1- 10- 08	435,518.0 0	7,300.00	28	2.8 0	948.46	-	-
中信证券	202110080005 9415	芒果 超媒	202 1- 10- 08	627,792.0 0	13,200.00	28	3.0 0	1,464.85	-	-
中信证券	202110080005 9417	沪硅 产业	202 1- 10- 08	354,044.0 0	12,200.00	28	2.8 0	771.03	-	-
中信证券	202110080005 9419	智飞 生	202 1- 10- 08	555,332.0 0	3,800.00	28	3.7 0	1,598.12	-	-

中信证券	2021100800060033	物泰格医药	2021-10-08	433,300.00	2,500.00	28	2.90	977.33	-	-
中信证券	2021100800060035	汇川技术	2021-10-08	468,368.00	7,300.00	28	3.00	1,092.86	-	-
中信证券	2021100800060037	澜起科技	2021-10-08	790,812.00	13,200.00	28	3.00	1,845.23	-	-
中信证券	2021100800060039	东方财富	2021-10-08	1,445,862.00	41,800.00	28	2.90	3,261.22	-	-
中信证券	2021100800060041	英科医疗	2021-10-08	309,528.00	5,400.00	28	3.30	794.46	-	-
中信证券	2021100800060043	华大基因	2021-10-08	479,105.00	5,500.00	28	3.10	1,155.18	-	-
中信证券	2021100800060045	同花顺	2021-10-08	122,100.00	1,000.00	28	2.40	227.92	-	-
中信证券	2021100800060047	沃森生物	2021-10-08	435,518.00	7,300.00	28	2.80	948.46	-	-
中信证券	2021100800060049	宋城演艺	2021-10-08	110,038.00	7,400.00	28	3.20	273.87	-	-
中信证券	2021100800060051	贝达药业	2021-10-08	106,722.00	1,100.00	28	2.90	240.72	-	-
中信证券	2021100800060053	信维通信	2021-10-08	306,900.00	13,200.00	28	2.50	596.75	-	-
中信证券	2021100800060055	三环集团	2021-10-08	189,312.00	5,100.00	28	2.90	427.00	-	-
中信证券	2021100800060057	健帆	2021-10-	111,340.00	1,900.00	28	3.10	268.45	-	-

		生物	08							
中信证券	2021100800060059	欧普康视	2021-10-08	193,824.00	2,400.00	28	3.30	497.48	-	-
中信证券	2021100800060061	蓝思科技	2021-10-08	148,470.00	7,000.00	28	3.20	369.53	-	-
中信证券	2021100800060063	阳光电源	2021-10-08	1,036,380.00	6,900.00	28	3.20	2,579.43	-	-
中信证券	2021100800060065	亿纬锂能	2021-10-08	1,993,068.00	19,800.00	28	3.00	4,650.49	-	-
中信证券	2021100800060067	沪硅产业	2021-10-08	354,044.00	12,200.00	28	2.80	771.03	-	-
中信证券	2021100800060069	亿联网络	2021-10-08	109,707.00	1,300.00	28	2.30	196.25	-	-
中信证券	2021100800060071	乐普医疗	2021-10-08	541,728.00	19,800.00	28	3.20	1,348.30	-	-
中信证券	2021100800060073	康泰生物	2021-10-08	203,053.00	1,900.00	28	3.30	521.17	-	-
中信证券	2021100800064527	中国通号	2021-10-08	103,356.00	19,800.00	28	2.00	160.78	-	-
中信证券	2021100800064529	温氏股份	2021-10-08	320,397.00	20,900.00	28	3.30	822.35	-	-
中信证券	2021100800064531	先导智能	2021-10-08	308,440.00	4,400.00	28	3.20	767.67	-	-
中信证券	2021100800064533	芒果超媒	2021-10-08	627,792.00	13,200.00	28	3.00	1,464.85	-	-
中信证券	202110080006	爱	202	675,386.0	12,700.00	28	3.3	1,733.49	-	-

	4535	尔眼科	1-10-08	0			0			
中信证券	2021100800064611	东方财富	2021-10-08	1,445,862.00	41,800.00	28	3.00	3,373.68	-	-
中信证券	2021100800064613	阳光电源	2021-10-08	1,036,380.00	6,900.00	28	3.00	2,418.22	-	-
中信证券	2021100800064615	宋城演艺	2021-10-08	110,038.00	7,400.00	28	3.30	282.43	-	-
中信证券	2021100800064617	泰格医药	2021-10-08	433,300.00	2,500.00	28	1.80	606.62	-	-
中信证券	2021100800064619	英科医疗	2021-10-08	309,528.00	5,400.00	28	3.10	746.31	-	-
中信证券	2021100800064621	信维通信	2021-10-08	306,900.00	13,200.00	28	2.90	692.23	-	-
中信证券	2021100800064623	沃森生物	2021-10-08	435,518.00	7,300.00	28	1.90	643.60	-	-
中信证券	2021100800064625	汇川技术	2021-10-08	468,368.00	7,300.00	28	2.90	1,056.43	-	-
中信证券	2021100800064627	亿联网络	2021-10-08	109,707.00	1,300.00	28	2.70	230.38	-	-
中信证券	2021100800064629	欧普康视	2021-10-08	193,824.00	2,400.00	28	2.40	361.80	-	-
中信证券	2021100800064631	中国通号	2021-10-08	103,356.00	19,800.00	28	2.20	176.85	-	-
中信证券	2021100800064633	华大基因	2021-10-08	479,105.00	5,500.00	28	3.20	1,192.44	-	-

中信证券	202110080006 4635	康泰生物	2021-10-08	203,053.00	1,900.00	28	3.10	489.58	-	-
中信证券	202110080006 4637	同花顺	2021-10-08	122,100.00	1,000.00	28	3.00	284.90	-	-
中信证券	202110080006 4639	温氏股份	2021-10-08	320,397.00	20,900.00	28	3.20	797.43	-	-
中信证券	202110080006 4641	健帆生物	2021-10-08	111,340.00	1,900.00	28	3.10	268.45	-	-
中信证券	202110080006 4643	蓝思科技	2021-10-08	148,470.00	7,000.00	28	3.00	346.43	-	-
中信证券	202110080006 4645	澜起科技	2021-10-08	790,812.00	13,200.00	28	2.90	1,783.72	-	-
中信证券	202110080006 4647	沪硅产业	2021-10-08	354,044.00	12,200.00	28	4.40	1,211.62	-	-
中信证券	202110080006 4649	贝达药业	2021-10-08	106,722.00	1,100.00	28	2.50	207.52	-	-
中信证券	202110080006 4651	亿纬锂能	2021-10-08	1,993,068.00	19,800.00	28	3.00	4,650.49	-	-
中信证券	202110080006 4653	乐普医疗	2021-10-08	541,728.00	19,800.00	28	2.90	1,221.90	-	-
中信证券	202110080006 5387	爱尔眼科	2021-10-08	675,386.00	12,700.00	28	2.80	1,470.84	-	-
中信证券	202110080006 5389	三环集团	2021-10-08	189,312.00	5,100.00	28	2.40	353.38	-	-
中信证券	202110080006 5391	智飞生物	2021-10-08	555,332.00	3,800.00	28	2.00	863.85	-	-

中信证券	2021100800065393	先导智能	2021-10-08	308,440.00	4,400.00	28	3.10	743.68	-	-
中信证券	2021100800065395	芒果超媒	2021-10-08	627,792.00	13,200.00	28	2.20	1,074.22	-	-
中信证券	2021100800070057	三环集团	2021-10-08	137,344.00	3,700.00	28	2.90	309.79	-	-
中信证券	2021100800070059	芒果超媒	2021-10-08	175,972.00	3,700.00	28	3.00	410.60	-	-
中信证券	2021100800070061	信维通信	2021-10-08	86,025.00	3,700.00	28	2.50	167.27	-	-
中信证券	2021100800070063	阳光电源	2021-10-08	555,740.00	3,700.00	28	3.20	1,383.18	-	-
中信证券	2021100800070065	泰格医药	2021-10-08	311,976.00	1,800.00	28	2.90	703.68	-	-
中信证券	2021100800070067	沃森生物	2021-10-08	435,518.00	7,300.00	28	2.80	948.46	-	-
中信证券	2021100800070069	澜起科技	2021-10-08	221,667.00	3,700.00	28	3.00	517.22	-	-
中信证券	2021100800070071	宋城演艺	2021-10-08	108,551.00	7,300.00	28	3.20	270.17	-	-
中信证券	2021100800070073	沪硅产业	2021-10-08	107,374.00	3,700.00	28	2.80	233.84	-	-
中信证券	2021100800070075	欧普康视	2021-10-08	145,368.00	1,800.00	28	3.30	373.11	-	-
中信证券	2021100800070077	亿联网络	2021-10-08	151,902.00	1,800.00	28	2.30	271.74	-	-

中信证券	2021100800070079	络中国通号	2021-10-08	57,420.00	11,000.00	28	2.00	89.32	-	-
中信证券	2021100800070081	乐普医疗	2021-10-08	150,480.00	5,500.00	28	3.20	374.53	-	-
中信证券	2021100800070083	汇川技术	2021-10-08	352,880.00	5,500.00	28	3.00	823.39	-	-
中信证券	2021100800070085	亿纬锂能	2021-10-08	553,630.00	5,500.00	28	3.00	1,291.80	-	-
中信证券	2021100800070087	华大基因	2021-10-08	156,798.00	1,800.00	28	3.10	378.06	-	-
中信证券	2021100800070089	东方财富	2021-10-08	864,750.00	25,000.00	28	2.90	1,950.49	-	-
中信证券	2021100800070091	先导智能	2021-10-08	259,370.00	3,700.00	28	3.20	645.54	-	-
中信证券	2021100800070093	健帆生物	2021-10-08	105,480.00	1,800.00	28	3.10	254.32	-	-
中信证券	2021100800070095	贝达药业	2021-10-08	174,636.00	1,800.00	28	2.90	393.90	-	-
中信证券	2021100800070097	康泰生物	2021-10-08	192,366.00	1,800.00	28	3.30	493.74	-	-
中信证券	2021100800070099	温氏股份	2021-10-08	280,539.00	18,300.00	28	3.30	720.05	-	-
中信证券	2021100800070101	爱尔眼科	2021-10-08	584,980.00	11,000.00	28	3.30	1,501.45	-	-
中信证券	2021100800070103	智飞	2021-	540,718.00	3,700.00	28	3.70	1,556.07	-	-

		生物	10-08							
中信证券	2021100800070105	蓝思科技	2021-10-08	116,655.00	5,500.00	28	3.20	290.34	-	-
中信证券	2021100800070107	同花顺	2021-10-08	219,780.00	1,800.00	28	2.40	410.26	-	-
中信证券	2021101200015095	智飞生物	2021-10-12	1,848,000.00	13,200.00	28	2.00	2,874.67	-	-
中信证券	2021101200015099	爱尔眼科	2021-10-12	2,035,440.00	39,600.00	28	2.80	4,432.74	-	-
中信证券	2021101200015101	同花顺	2021-10-12	775,368.00	6,600.00	28	3.00	1,809.19	-	-
中信证券	2021101200015103	东方财富	2021-10-12	4,110,612.00	125,400.00	28	3.00	9,591.43	-	-
中信证券	2021101200015105	乐普医疗	2021-10-12	540,540.00	19,800.00	28	2.90	1,219.22	-	-
中信证券	2021101200017057	澜起科技	2021-10-12	781,572.00	13,200.00	28	2.90	1,762.88	-	-
中信证券	2021101200017059	中国通号	2021-10-12	205,128.00	39,600.00	28	2.20	351.00	-	-
中信证券	2021101200017063	沪硅产业	2021-10-12	360,888.00	13,200.00	28	4.40	1,235.04	-	-
中信证券	2021101200017069	贝达药业	2021-10-12	632,214.00	6,600.00	28	2.50	1,229.31	-	-
中信证券	2021101200017073	欧普康视	2021-10-12	516,186.00	6,600.00	28	2.40	963.55	-	-
中信证券	2021101200017075	康泰	2021-	690,558.00	6,600.00	28	3.10	1,665.01	-	-

		生物	10-12							
中信证券	2021101200017077	温氏股份	2021-10-12	1,005,180.00	66,000.00	28	3.20	2,501.78	-	-
中信证券	2021101200017079	健帆生物	2021-10-12	378,180.00	6,600.00	28	3.10	911.83	-	-
中信证券	2021101200017081	英科医疗	2021-10-12	413,952.00	6,600.00	28	3.10	998.08	-	-
中信证券	2021101200017085	亿联网络	2021-10-12	545,820.00	6,600.00	28	2.70	1,146.22	-	-
中信证券	2021101200017087	华大基因	2021-10-12	576,642.00	6,600.00	28	3.20	1,435.20	-	-
中信证券	2021101200017093	宋城演艺	2021-10-12	380,424.00	26,400.00	28	3.30	976.42	-	-
中信证券	2021101200017095	阳光电源	2021-10-12	1,894,200.00	13,200.00	28	3.00	4,419.80	-	-
中信证券	2021101200017097	汇川技术	2021-10-12	1,178,298.00	19,800.00	28	2.90	2,657.72	-	-
中信证券	2021101200017099	信维通信	2021-10-12	305,052.00	13,200.00	28	2.90	688.06	-	-
中信证券	2021101200017101	沃森生物	2021-10-12	1,494,240.00	26,400.00	28	1.90	2,208.15	-	-
中信证券	2021101200017103	芒果超媒	2021-10-12	517,176.00	13,200.00	28	2.20	884.95	-	-
中信证券	2021101200017107	蓝思科技	2021-10-12	411,048.00	19,800.00	28	3.00	959.11	-	-
中信证券	202110120001	先	202	912,120.00	13,200.00	28	3.1	2,199.22	-	-

	7109	导智能	1-10-12	0			0			
中信证券	2021101200017111	泰格医药	2021-10-12	1,095,270.00	6,600.00	28	1.80	1,533.38	-	-
中信证券	2021101200017113	三环集团	2021-10-12	494,604.00	13,200.00	28	2.40	923.26	-	-
中信证券	2021101500003643	沪硅产业	2021-10-15	377,652.00	13,200.00	28	5.20	1,527.39	-	-
中信证券	2021101500003645	澜起科技	2021-10-15	774,708.00	13,200.00	28	2.70	1,626.89	-	-
中信证券	2021101500003647	中国通号	2021-10-15	202,752.00	39,600.00	28	2.80	441.55	-	-
中信证券	2021101500003649	三环集团	2021-10-15	515,856.00	13,200.00	28	3.00	1,203.66	-	-
中信证券	2021101500003651	芒果超媒	2021-10-15	522,588.00	13,200.00	28	2.50	1,016.14	-	-
中信证券	2021101500003653	信维通信	2021-10-15	295,152.00	13,200.00	28	3.30	757.56	-	-
中信证券	2021101500003655	贝达药业	2021-10-15	597,960.00	6,600.00	28	3.40	1,581.27	-	-
中信证券	2021101500003657	先导智能	2021-10-15	1,008,480.00	13,200.00	28	2.00	1,568.75	-	-
中信证券	2021101500003659	温氏股份	2021-10-15	956,340.00	66,000.00	28	3.30	2,454.61	-	-
中信证券	2021101500003661	健帆生物	2021-10-15	360,954.00	6,600.00	28	3.40	954.52	-	-

中信证券	202110150000 3663	泰 格 医 药	202 1- 10- 15	1,100,220. 00	6,600.00	28	2.8 0	2,396.03	-	-
中信证券	202110150000 3665	阳 光 电 源	202 1- 10- 15	2,080,056. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,368.12	-	-
中信证券	202110150000 3667	欧 普 康 视	202 1- 10- 15	430,518.0 0	6,600.00	28	3.7 0	1,238.94	-	-
中信证券	202110150000 3669	东 方 财 富	202 1- 10- 15	4,247,298. 00	125,400.0 0	28	2.8 0	9,249.67	-	-
中信证券	202110150000 3671	康 泰 生 物	202 1- 10- 15	706,530.0 0	6,600.00	28	3.0 0	1,648.57	-	-
中信证券	202110150000 3673	亿 联 网 络	202 1- 10- 15	540,210.0 0	6,600.00	28	3.0 0	1,260.49	-	-
中信证券	202110150000 3675	智 飞 生 物	202 1- 10- 15	1,935,384. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,064.31	-	-
中信证券	202110150000 3677	乐 普 医 疗	202 1- 10- 15	522,126.0 0	19,800.00	28	3.7 0	1,502.56	-	-
中信证券	202110150000 3679	汇 川 技 术	202 1- 10- 15	1,244,430. 00	19,800.00	28	2.6 0	2,516.51	-	-
中信证券	202110150000 3681	沃 森 生 物	202 1- 10- 15	1,531,992. 00	26,400.00	28	2.5 0	2,978.87	-	-
中信证券	202110150000 3683	同 花 顺	202 1- 10- 15	766,920.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,908.78	-	-
中信证券	202110150000 3685	亿 纬 锂 能	202 1- 10- 15	2,141,370. 00	19,800.00	28	2.7 0	4,496.88	-	-
中信证券	202110150000 3687	宋 城 演 艺	202 1- 10- 15	408,408.0 0	26,400.00	28	3.7 0	1,175.31	-	-

中信证券	202110150000 3689	爱尔眼科	2021-10-15	1,865,952.00	39,600.00	28	3.10	4,499.02	-	-
中信证券	202110150000 3691	蓝思科技	2021-10-15	409,266.00	19,800.00	28	3.40	1,082.28	-	-
中信证券	202110150000 3693	华大基因	2021-10-15	562,452.00	6,600.00	28	5.00	2,187.31	-	-
中信证券	202110150000 3695	英科医疗	2021-10-15	395,802.00	6,600.00	28	3.30	1,015.89	-	-
中信证券	202110190000 0977	温氏股份	2021-10-19	32,760.00	2,000.00	14	3.40	43.32	-	-
中信证券	202110200000 5259	华润微	2021-10-20	342,100.00	5,000.00	28	1.60	425.72	-	-
中信证券	202110200000 5261	欧普康视	2021-10-20	65,750.00	1,000.00	28	3.70	189.21	-	-
中信证券	202110200000 5263	先导智能	2021-10-20	75,000.00	1,000.00	28	2.00	116.67	-	-
中信证券	202110200000 5265	华熙生物	2021-10-20	174,050.00	1,000.00	28	4.40	595.64	-	-
中信证券	202110200000 5267	澜起科技	2021-10-20	55,900.00	1,000.00	28	2.70	117.39	-	-
中信证券	202110200000 5269	石头科技	2021-10-20	844,100.00	1,000.00	28	2.90	1,903.91	-	-
中信证券	202110200000 5271	健帆生物	2021-10-20	52,670.00	1,000.00	28	3.40	139.28	-	-
中信证券	202110200000 5273	温氏股份	2021-10-20	16,340.00	1,000.00	28	3.30	41.94	-	-

中信证券	202110200000 5275	蓝 思 科 技	202 1- 10- 20	20,080.00	1,000.00	28	3.4 0	53.10	-	-
中信证券	202110200000 5277	三 环 集 团	202 1- 10- 20	38,920.00	1,000.00	28	3.0 0	90.81	-	-
中信证券	202110200000 5279	华 大 基 因	202 1- 10- 20	84,690.00	1,000.00	28	5.0 0	329.35	-	-
中信证券	202110200000 5281	泰 格 医 药	202 1- 10- 20	166,700.0 0	1,000.00	28	2.8 0	363.04	-	-
中信证券	202110200000 5283	英 科 医 疗	202 1- 10- 20	53,450.00	1,000.00	28	3.3 0	137.19	-	-
中信证券	202110200000 5285	爱 尔 眼 科	202 1- 10- 20	748,960.0 0	16,000.00	28	3.1 0	1,805.83	-	-
中信证券	202110200000 5295	中 国 通 号	202 1- 10- 20	5,120.00	1,000.00	28	2.8 0	11.15	-	-
中信证券	202110200000 5297	中 微 公 司	202 1- 10- 20	149,850.0 0	1,000.00	28	2.3 0	268.07	-	-
中信证券	202110200000 5299	汇 川 技 术	202 1- 10- 20	62,160.00	1,000.00	28	2.6 0	125.70	-	-
中信证券	202110200000 5301	乐 普 医 疗	202 1- 10- 20	25,900.00	1,000.00	28	3.7 0	74.53	-	-
中信证券	202110200000 5303	阳 光 电 源	202 1- 10- 20	160,400.0 0	1,000.00	28	2.7 0	336.84	-	-
中信证券	202110200000 5305	康 泰 生 物	202 1- 10- 20	107,060.0 0	1,000.00	28	3.0 0	249.81	-	-
中信证券	202110200000 5307	沪 硅 产	202 1- 10- 20	27,420.00	1,000.00	28	5.2 0	110.90	-	-

中信证券	2021102000005309	业亿纬锂能	2021-10-20	114,020.00	1,000.00	28	2.70	239.44	-	-
中信证券	2021102000005311	智飞生物	2021-10-20	145,850.00	1,000.00	28	2.70	306.29	-	-
中信证券	2021102000005313	贝达药业	2021-10-20	85,270.00	1,000.00	28	3.40	225.49	-	-
中信证券	2021102000005315	宋城演艺	2021-10-20	13,860.00	1,000.00	28	3.70	39.89	-	-
中信证券	2021102000005317	信维通信	2021-10-20	21,330.00	1,000.00	28	3.30	54.75	-	-
中信证券	2021102000005319	沃森生物	2021-10-20	59,660.00	1,000.00	28	2.50	116.01	-	-
中信证券	2021102000005321	东方财富	2021-10-20	33,460.00	1,000.00	28	2.80	72.87	-	-
中信证券	2021102000005323	同花顺	2021-10-20	117,120.00	1,000.00	28	3.20	291.50	-	-
中信证券	2021102100004908	温氏股份	2021-10-21	1,044,780.00	66,000.00	28	3.30	2,681.60	-	-
中信证券	2021102100004914	沪硅产业	2021-10-21	357,720.00	13,200.00	28	5.20	1,446.78	-	-
中信证券	2021102100004916	中国通号	2021-10-21	202,752.00	39,600.00	28	2.80	441.55	-	-
中信证券	2021102100004926	泰格医药	2021-10-21	1,097,778.00	6,600.00	28	2.80	2,390.72	-	-
中信证券	2021102100004928	阳光	2021-10-	2,110,416.00	13,200.00	28	2.70	4,431.87	-	-

		电 源	21							
中信证券	202110210000 4930	沃 森 生 物	202 1- 10- 21	596,000.0 0	10,000.00	28	2.5 0	1,158.89	-	-
中信证券	202110210000 4932	芒 果 超 媒	202 1- 10- 21	517,176.0 0	13,200.00	28	2.5 0	1,005.62	-	-
中信证券	202110210000 4934	宋 城 演 艺	202 1- 10- 21	373,560.0 0	26,400.00	28	3.7 0	1,075.02	-	-
中信证券	202110210000 4936	三 环 集 团	202 1- 10- 21	527,868.0 0	13,200.00	28	3.0 0	1,231.69	-	-
中信证券	202110210000 4938	宋 城 演 艺	202 1- 10- 21	423,085.0 0	29,900.00	28	3.7 0	1,217.54	-	-
中信证券	202110210000 4940	康 泰 生 物	202 1- 10- 21	734,910.0 0	6,600.00	28	3.0 0	1,714.79	-	-
中信证券	202110210000 4942	沃 森 生 物	202 1- 10- 21	1,573,440. 00	26,400.00	28	2.5 0	3,059.47	-	-
中信证券	202110210000 4944	蓝 思 科 技	202 1- 10- 21	385,704.0 0	19,800.00	28	3.4 0	1,019.97	-	-
中信证券	202110210000 4946	澜 起 科 技	202 1- 10- 21	731,280.0 0	13,200.00	28	2.7 0	1,535.69	-	-
中信证券	202110210000 4948	健 帆 生 物	202 1- 10- 21	348,744.0 0	6,600.00	28	3.4 0	922.23	-	-
中信证券	202110210000 4950	亿 联 网 络	202 1- 10- 21	513,546.0 0	6,600.00	28	3.0 0	1,198.27	-	-
中信证券	202110210000 4952	华 大 基 因	202 1- 10- 21	554,532.0 0	6,600.00	28	5.0 0	2,156.51	-	-
中信证券	202110210000	先	202	995,280.0	13,200.00	28	2.0	1,548.21	-	-

	4954	导智能	1-10-21	0			0				
中信证券	2021102100004956	欧普康视	2021-10-21	449,394.00	6,600.00	28	3.70	1,293.26	-	-	
中信证券	2021102100004958	贝达药业	2021-10-21	548,064.00	6,600.00	28	3.40	1,449.32	-	-	
中信证券	2021102100004960	信维通信	2021-10-21	279,180.00	13,200.00	28	3.30	716.56	-	-	
中信证券	2021102100004970	东方财富	2021-10-21	4,209,678.00	125,400.00	28	2.80	9,167.74	-	-	
中信证券	2021102100004972	智飞生物	2021-10-21	1,931,028.00	13,200.00	28	2.70	4,055.16	-	-	
中信证券	2021102100004974	汇川技术	2021-10-21	1,212,948.00	19,800.00	28	2.60	2,452.85	-	-	
中信证券	2021102100004976	同花顺	2021-10-21	769,560.00	6,600.00	28	3.20	1,915.35	-	-	
中信证券	2021102100004978	亿纬锂能	2021-10-21	16,932,000.00	150,000.00	28	2.70	35,557.20	-	-	
中信证券	2021102100004980	乐普医疗	2021-10-21	511,236.00	19,800.00	28	3.70	1,471.22	-	-	
中信证券	2021102100004982	爱尔眼科	2021-10-21	1,844,568.00	39,600.00	28	3.10	4,447.46	-	-	
中信证券	2021102100004984	亿纬锂能	2021-10-21	2,235,024.00	19,800.00	28	2.70	4,693.55	-	-	
中信证券	2021102500000688	亿纬锂能	2021-10-25	1,782,450.00	15,300.00	28	3.20	4,436.32	-	-	

中信证券	202110250000 0689	乐普医疗	2021-10-25	397,188.00	15,300.00	28	2.80	864.99	-	-
中信证券	202110250000 0692	信维通信	2021-10-25	221,656.00	10,300.00	28	3.20	551.68	-	-
中信证券	202110250000 0694	沃森生物	2021-10-25	1,219,750.00	20,500.00	28	2.10	1,992.26	-	-
中信证券	202110250000 0695	汇川技术	2021-10-25	948,600.00	15,300.00	28	2.30	1,696.94	-	-
中信证券	202110250000 0698	同花顺	2021-10-25	624,000.00	5,200.00	28	3.20	1,553.07	-	-
中信证券	202110250000 0700	温氏股份	2021-10-25	810,064.00	51,400.00	28	2.90	1,827.14	-	-
中信证券	202110250000 0701	三环集团	2021-10-25	398,301.00	10,300.00	28	2.70	836.43	-	-
中信证券	202110250000 0702	阳光电源	2021-10-25	1,771,600.00	10,300.00	28	2.60	3,582.57	-	-
中信证券	202110250000 0706	健帆生物	2021-10-25	280,540.00	5,200.00	28	2.50	545.49	-	-
中信证券	202110250000 0708	华大基因	2021-10-25	445,692.00	5,200.00	28	3.20	1,109.28	-	-
中信证券	202110250000 0709	英科医疗	2021-10-25	283,504.00	5,200.00	28	3.10	683.56	-	-
中信证券	202110250000 0710	贝达药业	2021-10-25	439,920.00	5,200.00	28	2.30	786.97	-	-
中信证券	202110250000 0816	沪硅产业	2021-10-25	287,267.00	10,300.00	28	3.60	804.35	-	-

中信证券	2021102700017039	中微公司	2021-10-27	7,529,500.00	50,000.00	28	5.30	31,038.27	-	-
中信证券	2021110100001016	乐普医疗	2021-11-01	170,400.00	8,000.00	14	3.00	198.80	-	-
中信证券	2021110100001018	汇川技术	2021-11-01	520,160.00	8,000.00	14	3.10	627.08	-	-
中信证券	2021110100001019	同花顺	2021-11-01	232,000.00	2,000.00	14	3.40	306.76	-	-
中信证券	2021110100001020	亿纬锂能	2021-11-01	873,200.00	8,000.00	14	3.10	1,052.69	-	-
中信证券	2021110100001024	健帆生物	2021-11-01	102,460.00	2,000.00	14	3.30	131.49	-	-
中信证券	2021110100001026	贝达药业	2021-11-01	156,900.00	2,000.00	14	2.50	152.54	-	-
中信证券	2021110100001028	英科医疗	2021-11-01	103,580.00	2,000.00	14	3.40	136.96	-	-
中信证券	2021110100001030	温氏股份	2021-11-01	449,280.00	27,000.00	14	3.40	594.05	-	-
中信证券	2021110100001031	华大基因	2021-11-01	178,900.00	2,000.00	14	3.40	236.55	-	-
中信证券	2021110100001032	沃森生物	2021-11-01	593,450.00	11,000.00	14	2.70	623.12	-	-
中信证券	2021110100001036	信维通信	2021-11-01	123,350.00	5,000.00	14	3.40	163.10	-	-
中信证券	2021110100001037	阳光电源	2021-11-01	824,250.00	5,000.00	14	2.80	897.52	-	-

中信证券	202111010000 1038	三 环 集 团	202 1- 11- 01	203,250.0 0	5,000.00	14	3.2 0	252.93	-	-
中信证券	202111010000 1042	沪 硅 产 业	202 1- 11- 01	139,350.0 0	5,000.00	14	3.5 0	189.67	-	-
中信证券	202111020000 4214	温 氏 股 份	202 1- 11- 02	33,820.00	2,000.00	14	3.0 0	39.46	-	-
中信证券	202111040000 0760	欧 普 康 视	202 1- 11- 04	1,213,150. 00	19,000.00	14	3.1 0	1,462.52	-	-
中信证券	202111050005 5485	智 飞 生 物	202 1- 11- 05	504,716.0 0	3,800.00	28	2.6 0	1,020.65	-	-
中信证券	202111050005 5487	智 飞 生 物	202 1- 11- 05	504,716.0 0	3,800.00	28	2.6 0	1,020.65	-	-
中信证券	202111050005 5489	东 方 财 富	202 1- 11- 05	1,368,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511.49	-	-
中信证券	202111050005 5491	智 飞 生 物	202 1- 11- 05	504,716.0 0	3,800.00	28	2.6 0	1,020.65	-	-
中信证券	202111050005 5493	华 大 基 因	202 1- 11- 05	504,350.0 0	5,500.00	28	3.2 0	1,255.27	-	-
中信证券	202111050005 5495	英 科 医 疗	202 1- 11- 05	300,240.0 0	5,400.00	28	3.1 0	723.91	-	-
中信证券	202111050005 5497	华 大 基 因	202 1- 11- 05	165,060.0 0	1,800.00	28	3.2 0	410.82	-	-
中信证券	202111050005 5499	华 大 基 因	202 1- 11- 05	504,350.0 0	5,500.00	28	3.2 0	1,255.27	-	-
中信证券	202111050005 5501	英 科 医	202 1- 11- 05	300,240.0 0	5,400.00	28	3.1 0	723.91	-	-

中信证券	2021110500055503	疗 华 大 基 因	202 1- 11- 05	504,350.0 0	5,500.00	28	3.2 0	1,255.27	-	-
中信证券	2021110500055505	英 科 医 疗	202 1- 11- 05	300,240.0 0	5,400.00	28	3.1 0	723.91	-	-
中信证券	2021110500055507	康 泰 生 物	202 1- 11- 05	195,930.0 0	1,800.00	28	2.9 0	441.93	-	-
中信证券	2021110500055509	欧 普 康 视	202 1- 11- 05	152,160.0 0	2,400.00	28	3.2 0	378.71	-	-
中信证券	2021110500055511	欧 普 康 视	202 1- 11- 05	152,160.0 0	2,400.00	28	3.2 0	378.71	-	-
中信证券	2021110500055513	亿 联 网 络	202 1- 11- 05	102,245.0 0	1,300.00	28	2.6 0	206.76	-	-
中信证券	2021110500055515	亿 联 网 络	202 1- 11- 05	102,245.0 0	1,300.00	28	2.6 0	206.76	-	-
中信证券	2021110500055517	亿 联 网 络	202 1- 11- 05	102,245.0 0	1,300.00	28	2.6 0	206.76	-	-
中信证券	2021110500055519	亿 联 网 络	202 1- 11- 05	141,570.0 0	1,800.00	28	2.6 0	286.29	-	-
中信证券	2021110500055521	康 泰 生 物	202 1- 11- 05	206,815.0 0	1,900.00	28	2.9 0	466.48	-	-
中信证券	2021110500055523	康 泰 生 物	202 1- 11- 05	206,815.0 0	1,900.00	28	2.9 0	466.48	-	-
中信证券	2021110500055525	康 泰 生 物	202 1- 11- 05	206,815.0 0	1,900.00	28	2.9 0	466.48	-	-
中信证券	2021110500055527	欧 普	202 1-	152,160.0 0	2,400.00	28	3.2 0	378.71	-	-

		康视	11-05							
中信证券	2021110500064819	沪硅产业	2021-11-05	348,188.00	12,200.00	28	3.60	974.93	-	-
中信证券	2021110500064821	澜起科技	2021-11-05	275,021.00	3,700.00	28	2.60	556.15	-	-
中信证券	2021110500064823	澜起科技	2021-11-05	981,156.00	13,200.00	28	2.60	1,984.12	-	-
中信证券	2021110500064825	中国通号	2021-11-05	96,822.00	19,800.00	28	2.90	218.39	-	-
中信证券	2021110500064827	沪硅产业	2021-11-05	105,598.00	3,700.00	28	3.60	295.67	-	-
中信证券	2021110500064829	澜起科技	2021-11-05	981,156.00	13,200.00	28	2.60	1,984.12	-	-
中信证券	2021110500064831	中国通号	2021-11-05	96,822.00	19,800.00	28	2.90	218.39	-	-
中信证券	2021110500064833	中国通号	2021-11-05	53,790.00	11,000.00	28	2.90	121.33	-	-
中信证券	2021110500064835	沪硅产业	2021-11-05	348,188.00	12,200.00	28	3.60	974.93	-	-
中信证券	2021110500064837	中国通号	2021-11-05	96,822.00	19,800.00	28	2.90	218.39	-	-
中信证券	2021110500064839	沪硅产业	2021-11-05	348,188.00	12,200.00	28	3.60	974.93	-	-
中信证券	2021110500064841	澜起科技	2021-11-05	981,156.00	13,200.00	28	2.60	1,984.12	-	-
中信证券	202111050006	泰	202	363,250.00	2,500.00	28	2.6	734.57	-	-

	5625	格医药	1-11-05	0			0			
中信证券	2021110500065627	泰格医药	2021-11-05	363,250.00	2,500.00	28	2.60	734.57	-	-
中信证券	2021110500065629	三环集团	2021-11-05	152,366.00	3,700.00	28	2.70	319.97	-	-
中信证券	2021110500065633	泰格医药	2021-11-05	363,250.00	2,500.00	28	2.60	734.57	-	-
中信证券	2021110500065637	芒果超媒	2021-11-05	604,560.00	13,200.00	28	3.10	1,457.66	-	-
中信证券	2021110500065641	芒果超媒	2021-11-05	169,460.00	3,700.00	28	3.10	408.59	-	-
中信证券	2021110500065643	三环集团	2021-11-05	210,018.00	5,100.00	28	2.70	441.04	-	-
中信证券	2021110500065645	芒果超媒	2021-11-05	604,560.00	13,200.00	28	3.10	1,457.66	-	-
中信证券	2021110500065647	三环集团	2021-11-05	210,018.00	5,100.00	28	2.70	441.04	-	-
中信证券	2021110500065649	宋城演艺	2021-11-05	99,678.00	7,400.00	28	2.00	155.05	-	-
中信证券	2021110500065651	宋城演艺	2021-11-05	98,331.00	7,300.00	28	2.00	152.96	-	-
中信证券	2021110500065653	三环集团	2021-11-05	210,018.00	5,100.00	28	2.70	441.04	-	-
中信证券	2021110500065655	沃森生物	2021-11-05	376,169.00	7,300.00	28	2.10	614.41	-	-

中信证券	202111050006 5657	泰格医药	2021-11-05	261,540.00	1,800.00	28	2.60	528.89	-	-
中信证券	202111050006 5659	沃森生物	2021-11-05	376,169.00	7,300.00	28	2.10	614.41	-	-
中信证券	202111050006 5661	宋城演艺	2021-11-05	99,678.00	7,400.00	28	2.00	155.05	-	-
中信证券	202111050006 5663	阳光电源	2021-11-05	1,074,882.00	6,900.00	28	2.60	2,173.65	-	-
中信证券	202111050006 5665	宋城演艺	2021-11-05	99,678.00	7,400.00	28	2.00	155.05	-	-
中信证券	202111050006 5667	阳光电源	2021-11-05	576,386.00	3,700.00	28	2.60	1,165.58	-	-
中信证券	202111050006 5669	阳光电源	2021-11-05	1,074,882.00	6,900.00	28	2.60	2,173.65	-	-
中信证券	202111050006 5671	芒果超媒	2021-11-05	604,560.00	13,200.00	28	3.10	1,457.66	-	-
中信证券	202111050006 5673	阳光电源	2021-11-05	1,074,882.00	6,900.00	28	2.60	2,173.65	-	-
中信证券	202111050006 5675	健帆生物	2021-11-05	91,692.00	1,800.00	28	2.50	178.29	-	-
中信证券	202111050006 5677	欧普康视	2021-11-05	114,120.00	1,800.00	28	3.20	284.03	-	-
中信证券	202111050006 5679	温氏股份	2021-11-05	350,493.00	20,900.00	28	2.90	790.56	-	-
中信证券	202111050006 5681	健帆生	2021-11-05	96,786.00	1,900.00	28	2.50	188.20	-	-

中信证券	2021110500065683	物 健帆生物	2021-11-05	96,786.00	1,900.00	28	2.50	188.20	-	-
中信证券	2021110500065685	健帆生物	2021-11-05	96,786.00	1,900.00	28	2.50	188.20	-	-
中信证券	2021110500065687	贝达药业	2021-11-05	84,040.00	1,100.00	28	2.30	150.34	-	-
中信证券	2021110500065689	贝达药业	2021-11-05	84,040.00	1,100.00	28	2.30	150.34	-	-
中信证券	2021110500065691	贝达药业	2021-11-05	84,040.00	1,100.00	28	2.30	150.34	-	-
中信证券	2021110500065693	蓝思科技	2021-11-05	153,790.00	7,000.00	28	2.00	239.23	-	-
中信证券	2021110500065695	先导智能	2021-11-05	371,448.00	4,400.00	28	3.30	953.38	-	-
中信证券	2021110500065697	贝达药业	2021-11-05	137,520.00	1,800.00	28	2.30	246.01	-	-
中信证券	2021110500065699	蓝思科技	2021-11-05	120,835.00	5,500.00	28	2.00	187.97	-	-
中信证券	2021110500065701	蓝思科技	2021-11-05	153,790.00	7,000.00	28	2.00	239.23	-	-
中信证券	2021110500065703	温氏股份	2021-11-05	306,891.00	18,300.00	28	2.90	692.21	-	-
中信证券	2021110500065705	温氏股份	2021-11-05	350,493.00	20,900.00	28	2.90	790.56	-	-
中信证券	2021110500065707	蓝思	2021-	153,790.00	7,000.00	28	2.00	239.23	-	-

		科技	11-05							
中信证券	2021110500065709	温氏股份	2021-11-05	350,493.00	20,900.00	28	2.90	790.56	-	-
中信证券	2021110500065711	先导智能	2021-11-05	312,354.00	3,700.00	28	3.30	801.71	-	-
中信证券	2021110500065713	先导智能	2021-11-05	371,448.00	4,400.00	28	3.30	953.38	-	-
中信证券	2021110500065715	亿纬锂能	2021-11-05	624,195.00	5,500.00	28	3.20	1,553.55	-	-
中信证券	2021110500065717	乐普医疗	2021-11-05	425,700.00	19,800.00	28	2.80	927.08	-	-
中信证券	2021110500065719	先导智能	2021-11-05	371,448.00	4,400.00	28	3.30	953.38	-	-
中信证券	2021110500065721	爱尔眼科	2021-11-05	615,823.00	12,700.00	28	2.90	1,389.02	-	-
中信证券	2021110500065723	乐普医疗	2021-11-05	425,700.00	19,800.00	28	2.80	927.08	-	-
中信证券	2021110500065725	亿纬锂能	2021-11-05	2,247,102.00	19,800.00	28	3.20	5,592.79	-	-
中信证券	2021110500065727	爱尔眼科	2021-11-05	533,390.00	11,000.00	28	2.90	1,203.09	-	-
中信证券	2021110500065729	亿纬锂能	2021-11-05	2,247,102.00	19,800.00	28	3.20	5,592.79	-	-
中信证券	2021110500065731	乐普医疗	2021-11-05	425,700.00	19,800.00	28	2.80	927.08	-	-
中信证券	202111050006	爱	202	615,823.00	12,700.00	28	2.9	1,389.02	-	-

	5733	尔眼科	1-11-05	0			0				
中信证券	2021110500065735	亿纬锂能	2021-11-05	2,247,102.00	19,800.00	28	3.20	5,592.79	-	-	
中信证券	2021110500065737	爱尔眼科	2021-11-05	615,823.00	12,700.00	28	2.90	1,389.02	-	-	
中信证券	2021110500065739	同花顺	2021-11-05	112,950.00	1,000.00	28	3.20	281.12	-	-	
中信证券	2021110500065741	汇川技术	2021-11-05	497,276.00	7,300.00	28	2.30	889.57	-	-	
中信证券	2021110500065743	汇川技术	2021-11-05	497,276.00	7,300.00	28	2.30	889.57	-	-	
中信证券	2021110500065745	乐普医疗	2021-11-05	118,250.00	5,500.00	28	2.80	257.52	-	-	
中信证券	2021110500065747	汇川技术	2021-11-05	497,276.00	7,300.00	28	2.30	889.57	-	-	
中信证券	2021110500065749	信维通信	2021-11-05	93,610.00	3,700.00	28	3.20	232.98	-	-	
中信证券	2021110500065751	汇川技术	2021-11-05	374,660.00	5,500.00	28	2.30	670.23	-	-	
中信证券	2021110500065753	信维通信	2021-11-05	333,960.00	13,200.00	28	3.20	831.19	-	-	
中信证券	2021110500065755	信维通信	2021-11-05	333,960.00	13,200.00	28	3.20	831.19	-	-	
中信证券	2021110500065757	沃森生物	2021-11-05	376,169.00	7,300.00	28	2.10	614.41	-	-	

中信证券	202111050006 5759	智 飞 生 物	202 1- 11- 05	491,434.0 0	3,700.00	28	2.6 0	993.79	-	-
中信证券	202111050006 5761	信 维 通 信	202 1- 11- 05	333,960.0 0	13,200.00	28	3.2 0	831.19	-	-
中信证券	202111050006 5763	沃 森 生 物	202 1- 11- 05	376,169.0 0	7,300.00	28	2.1 0	614.41	-	-
中信证券	202111050006 5765	东 方 财 富	202 1- 11- 05	818,250.0 0	25,000.00	28	3.3 0	2,100.18	-	-
中信证券	202111050006 5767	同 花 顺	202 1- 11- 05	112,950.0 0	1,000.00	28	3.2 0	281.12	-	-
中信证券	202111050006 5769	东 方 财 富	202 1- 11- 05	1,368,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511.49	-	-
中信证券	202111050006 5771	同 花 顺	202 1- 11- 05	203,310.0 0	1,800.00	28	3.2 0	506.02	-	-
中信证券	202111050006 5773	同 花 顺	202 1- 11- 05	112,950.0 0	1,000.00	28	3.2 0	281.12	-	-
中信证券	202111050006 5775	东 方 财 富	202 1- 11- 05	1,368,114. 00	41,800.00	28	3.3 0	3,511.49	-	-
中信证券	202111090000 0984	宋 城 演 艺	202 1- 11- 09	289,800.0 0	20,000.00	14	3.4 0	383.18	-	-
中信证券	202111090001 7626	阳 光 电 源	202 1- 11- 09	2,114,772. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,441.02	-	-
中信证券	202111090001 7630	宋 城 演 艺	202 1- 11- 09	382,536.0 0	26,400.00	28	3.1 0	922.34	-	-
中信证券	202111090001 7632	沃 森 生 物	202 1- 11- 09	1,281,984. 00	26,400.00	28	2.6 0	2,592.46	-	-

中信证券	202111090001 7636	爱尔眼科	2021-11-09	1,909,908.00	39,600.00	28	2.50	3,713.71	-	-
中信证券	202111090001 7638	泰格医药	2021-11-09	933,042.00	6,600.00	28	2.90	2,104.53	-	-
中信证券	202111090001 7640	乐普医疗	2021-11-09	425,106.00	19,800.00	28	2.90	958.85	-	-
中信证券	202111090001 7642	同花顺	2021-11-09	755,040.00	6,600.00	28	3.30	1,937.94	-	-
中信证券	202111090001 7644	信维通信	2021-11-09	328,152.00	13,200.00	28	3.30	842.26	-	-
中信证券	202111090001 7646	东方财富	2021-11-09	4,199,646.00	125,400.00	28	3.30	10,779.09	-	-
中信证券	202111090001 7648	汇川技术	2021-11-09	1,408,572.00	19,800.00	28	3.00	3,286.67	-	-
中信证券	202111090001 7650	欧普康视	2021-11-09	415,866.00	6,600.00	28	3.00	970.35	-	-
中信证券	202111090001 7652	智飞生物	2021-11-09	1,696,992.00	13,200.00	28	2.30	3,035.73	-	-
中信证券	202111090001 7654	康泰生物	2021-11-09	709,434.00	6,600.00	28	3.10	1,710.52	-	-
中信证券	202111090001 7656	亿联网络	2021-11-09	496,320.00	6,600.00	28	3.00	1,158.08	-	-
中信证券	202111090001 7658	华大基因	2021-11-09	585,420.00	6,600.00	28	3.30	1,502.58	-	-
中信证券	202111090001 7660	蓝思科技	2021-11-09	427,482.00	19,800.00	28	2.00	664.97	-	-

中信证券	202111090001 7662	英科医疗	2021-11-09	352,638.00	6,600.00	28	3.30	905.10	-	-
中信证券	202111090001 7664	芒果超媒	2021-11-09	580,272.00	13,200.00	28	3.60	1,624.76	-	-
中信证券	202111090001 7666	三环集团	2021-11-09	549,648.00	13,200.00	28	3.10	1,325.26	-	-
中信证券	202111090001 7668	贝达药业	2021-11-09	528,858.00	6,600.00	28	2.40	987.20	-	-
中信证券	202111090001 7670	温氏股份	2021-11-09	1,106,820.00	66,000.00	28	3.30	2,840.84	-	-
中信证券	202111090001 7672	先导智能	2021-11-09	1,149,060.00	13,200.00	28	2.80	2,502.40	-	-
中信证券	202111090001 7674	健帆生物	2021-11-09	323,334.00	6,600.00	28	3.20	804.74	-	-
中信证券	202111090001 7676	澜起科技	2021-11-09	1,003,200.00	13,200.00	28	2.00	1,560.53	-	-
中信证券	202111090001 7678	沪硅产业	2021-11-09	383,328.00	13,200.00	28	3.40	1,013.69	-	-
中信证券	202111090001 7680	中国通号	2021-11-09	194,832.00	39,600.00	28	3.00	454.61	-	-
中信证券	202111110000 0914	温氏股份	2021-11-11	51,180.00	3,000.00	14	3.50	69.66	-	-
中信证券	202111120000 3845	澜起科技	2021-11-12	1,019,040.00	13,200.00	28	2.00	1,585.17	-	-
中信证券	202111120000 3847	中国通	2021-11-12	196,020.00	39,600.00	28	3.00	457.38	-	-

中信证券	20211120000 3849	号 沪 硅 产 业	202 1- 11- 12	394,020.0 0	13,200.00	28	3.4 0	1,041.96	-	-
中信证券	20211120000 3851	蓝 思 科 技	202 1- 11- 12	454,014.0 0	19,800.00	28	2.0 0	706.24	-	-
中信证券	20211120000 3853	先 导 智 能	202 1- 11- 12	1,152,228. 00	13,200.00	28	2.8 0	2,509.30	-	-
中信证券	20211120000 3855	健 帆 生 物	202 1- 11- 12	353,694.0 0	6,600.00	28	3.2 0	880.31	-	-
中信证券	20211120000 3857	欧 普 康 视	202 1- 11- 12	414,348.0 0	6,600.00	28	3.0 0	966.81	-	-
中信证券	20211120000 3859	温 氏 股 份	202 1- 11- 12	1,158,960. 00	66,000.00	28	3.3 0	2,974.66	-	-
中信证券	20211120000 3861	康 泰 生 物	202 1- 11- 12	700,260.0 0	6,600.00	28	3.1 0	1,688.40	-	-
中信证券	20211120000 3863	芒 果 超 媒	202 1- 11- 12	558,096.0 0	13,200.00	28	3.6 0	1,562.67	-	-
中信证券	20211120000 3865	三 环 集 团	202 1- 11- 12	563,904.0 0	13,200.00	28	3.1 0	1,359.64	-	-
中信证券	20211120000 3867	东 方 财 富	202 1- 11- 12	4,442,922. 00	125,400.0 0	28	3.3 0	11,403.50	-	-
中信证券	20211120000 3869	亿 联 网 络	202 1- 11- 12	518,760.0 0	6,600.00	28	3.0 0	1,210.44	-	-
中信证券	20211120000 3871	同 花 顺	202 1- 11- 12	765,138.0 0	6,600.00	28	3.3 0	1,963.85	-	-
中信证券	20211120000 3873	智 飞	202 1- 11-	1,687,488. 00	13,200.00	28	2.3 0	3,018.73	-	-

		生物	12							
中信证券	202111120000 3875	贝达 药业	202 1- 11- 12	580,800.0 0	6,600.00	28	2.4 0	1,084.16	-	-
中信证券	202111120000 3877	汇川 技术	202 1- 11- 12	1,396,098. 00	19,800.00	28	3.0 0	3,257.56	-	-
中信证券	202111120000 3879	爱尔 眼科	202 1- 11- 12	1,884,564. 00	39,600.00	28	2.5 0	3,664.43	-	-
中信证券	202111120000 3881	阳光 电源	202 1- 11- 12	2,121,504. 00	13,200.00	28	2.7 0	4,455.16	-	-
中信证券	202111120000 3883	泰格 医药	202 1- 11- 12	942,480.0 0	6,600.00	28	2.9 0	2,125.82	-	-
中信证券	202111120000 3885	宋城 演艺	202 1- 11- 12	384,120.0 0	26,400.00	28	3.1 0	926.16	-	-
中信证券	202111120000 3887	华大 基因	202 1- 11- 12	585,750.0 0	6,600.00	28	3.3 0	1,503.43	-	-
中信证券	202111120000 4459	沃森 生物	202 1- 11- 12	1,388,640. 00	26,400.00	28	2.6 0	2,808.14	-	-
中信证券	202111120000 4461	英科 医疗	202 1- 11- 12	362,274.0 0	6,600.00	28	3.3 0	929.84	-	-
中信证券	202111120000 4463	亿纬 锂能	202 1- 11- 12	2,605,482. 00	19,800.00	28	3.0 0	6,079.46	-	-
中信证券	202111120000 4465	乐普 医疗	202 1- 11- 12	439,956.0 0	19,800.00	28	2.9 0	992.35	-	-
中信证券	202111150000 6467	沃森 生物	202 1- 11- 15	616,000.0 0	11,000.00	14	3.3 0	790.53	-	-
中信证券	202111150000	贝	202	183,180.0	2,000.00	14	3.5	249.33	-	-

	6469	达药业	1-11-15	0			0			
中信证券	2021111500006471	沪硅产业	2021-11-15	147,100.00	5,000.00	14	3.70	211.66	-	-
中信证券	2021111500006473	信维通信	2021-11-15	133,850.00	5,000.00	14	3.40	176.98	-	-
中信证券	2021111500006475	温氏股份	2021-11-15	479,790.00	27,000.00	14	3.50	653.05	-	-
中信证券	2021111500006477	健帆生物	2021-11-15	111,320.00	2,000.00	14	3.50	151.52	-	-
中信证券	2021111500006479	同花顺	2021-11-15	229,880.00	2,000.00	14	3.50	312.89	-	-
中信证券	2021111500006481	亿纬锂能	2021-11-15	1,017,520.00	8,000.00	14	3.60	1,424.53	-	-
中信证券	2021111500006483	阳光电源	2021-11-15	750,400.00	5,000.00	14	3.40	992.20	-	-
中信证券	2021111500006485	华大基因	2021-11-15	181,840.00	2,000.00	14	2.60	183.86	-	-
中信证券	2021111500006487	汇川技术	2021-11-15	563,920.00	8,000.00	14	3.50	767.56	-	-
中信证券	2021111500006489	乐普医疗	2021-11-15	180,080.00	8,000.00	14	3.40	238.11	-	-
中信证券	2021111500006491	三环集团	2021-11-15	216,400.00	5,000.00	14	3.30	277.71	-	-
中信证券	2021111500006493	英科医疗	2021-11-15	111,000.00	2,000.00	14	2.40	103.60	-	-

中信证券	202111160000 4410	温 氏 股 份	202 1- 11- 16	34,720.00	2,000.00	14	3.5 0	47.26	-	-
中信证券	202111170000 5891	中 国 通 号	202 1- 11- 17	4,970.00	1,000.00	28	3.0 0	11.60	-	-
中信证券	202111170000 5893	贝 达 药 业	202 1- 11- 17	89,660.00	1,000.00	28	3.4 0	237.10	-	-
中信证券	202111170000 5895	沃 森 生 物	202 1- 11- 17	60,180.00	1,000.00	28	3.2 0	149.78	-	-
中信证券	202111170000 5897	中 微 公 司	202 1- 11- 17	164,170.0 0	1,000.00	28	3.7 0	472.44	-	-
中信证券	202111170000 5899	石 头 科 技	202 1- 11- 17	888,000.0 0	1,000.00	28	2.8 0	1,933.87	-	-
中信证券	202111170000 5901	宋 城 演 艺	202 1- 11- 17	14,950.00	1,000.00	28	3.3 0	38.37	-	-
中信证券	202111170000 5903	澜 起 科 技	202 1- 11- 17	74,510.00	1,000.00	28	3.0 0	173.86	-	-
中信证券	202111170000 5905	沪 硅 产 业	202 1- 11- 17	29,050.00	1,000.00	28	3.6 0	81.34	-	-
中信证券	202111170000 5907	阳 光 电 源	202 1- 11- 17	152,150.0 0	1,000.00	28	3.3 0	390.52	-	-
中信证券	202111170000 5909	温 氏 股 份	202 1- 11- 17	17,100.00	1,000.00	28	3.4 0	45.22	-	-
中信证券	202111170000 5911	泰 格 医 药	202 1- 11- 17	150,530.0 0	1,000.00	28	3.3 0	386.36	-	-
中信证券	202111170000 5913	健 帆 生	202 1- 11- 17	55,770.00	1,000.00	28	3.4 0	147.48	-	-

		物								
中信证券	202111170000 5915	同花顺	2021-11-17	113,900.00	1,000.00	28	3.40	301.20	-	-
中信证券	202111170000 5917	亿纬锂能	2021-11-17	125,900.00	1,000.00	28	3.50	342.73	-	-
中信证券	202111170000 5919	华大基因	2021-11-17	92,550.00	1,000.00	28	2.50	179.96	-	-
中信证券	202111170000 5921	东方财富	2021-11-17	35,150.00	1,000.00	28	2.80	76.55	-	-
中信证券	202111170000 5923	蓝思科技	2021-11-17	22,960.00	1,000.00	28	2.80	50.00	-	-
中信证券	202111170000 5925	华润微	2021-11-17	332,600.00	5,000.00	28	1.00	258.69	-	-
中信证券	202111170000 5927	汇川技术	2021-11-17	67,080.00	1,000.00	28	3.40	177.39	-	-
中信证券	202111170000 5929	先导智能	2021-11-17	80,970.00	1,000.00	28	3.30	207.82	-	-
中信证券	202111170000 5931	乐普医疗	2021-11-17	22,470.00	1,000.00	28	3.30	57.67	-	-
中信证券	202111170000 5933	欧普康视	2021-11-17	66,420.00	1,000.00	28	3.30	170.48	-	-
中信证券	202111170000 5935	智飞生物	2021-11-17	135,800.00	1,000.00	28	2.60	274.62	-	-
中信证券	202111170000 5937	三环集团	2021-11-17	42,100.00	1,000.00	28	3.20	104.78	-	-
中信证券	202111170000 5939	爱尔眼	2021-11-	790,880.00	16,000.00	28	3.10	1,906.90	-	-

		科	17							
中信证券	202111700005941	英科医疗	2021-11-17	57,070.00	1,000.00	28	2.30	102.09	-	-
中信证券	202111700005943	华熙生物	2021-11-17	170,780.00	1,000.00	28	2.60	345.36	-	-
中信证券	202111700005945	康泰生物	2021-11-17	114,330.00	1,000.00	28	2.90	257.88	-	-
中信证券	202111800005701	沃森生物	2021-11-18	1,601,424.00	26,400.00	28	3.20	3,985.77	-	-
中信证券	202111800005703	澜起科技	2021-11-18	984,852.00	13,200.00	28	3.00	2,297.99	-	-
中信证券	202111800005711	沃森生物	2021-11-18	606,600.00	10,000.00	28	3.20	1,509.76	-	-
中信证券	202111800005715	蓝思科技	2021-11-18	441,342.00	19,800.00	28	2.80	961.14	-	-
中信证券	202111800005717	欧普康视	2021-11-18	1,183,700.00	19,000.00	14	3.40	1,565.11	-	-
中信证券	202111800005723	东方财富	2021-11-18	4,350,126.00	125,400.00	28	2.80	9,473.61	-	-
中信证券	202111800005727	泰格医药	2021-11-18	963,600.00	6,600.00	28	3.30	2,473.24	-	-
中信证券	202111800005729	沪硅产业	2021-11-18	378,180.00	13,200.00	28	3.60	1,058.90	-	-
中信证券	202111800005731	康泰生物	2021-11-18	738,606.00	6,600.00	28	2.90	1,665.97	-	-
中信证券	202111800005733	贝达	2021-	586,806.00	6,600.00	28	3.40	1,551.78	-	-

		药 业	11- 18							
中信证券	202111180000 5735	宋 城 演 艺	202 1- 11- 18	382,008.0 0	26,400.00	28	3.3 0	980.49	-	-
中信证券	202111180000 5737	健 帆 生 物	202 1- 11- 18	357,060.0 0	6,600.00	28	3.4 0	944.23	-	-
中信证券	202111180000 5739	智 飞 生 物	202 1- 11- 18	1,754,808. 00	13,200.00	28	2.6 0	3,548.61	-	-
中信证券	202111180000 5741	华 大 基 因	202 1- 11- 18	598,026.0 0	6,600.00	28	2.5 0	1,162.83	-	-
中信证券	202111180000 5743	温 氏 股 份	202 1- 11- 18	1,155,000. 00	66,000.00	28	3.4 0	3,054.33	-	-
中信证券	202111180000 5745	欧 普 康 视	202 1- 11- 18	411,180.0 0	6,600.00	28	3.3 0	1,055.36	-	-
中信证券	202111180000 5747	先 导 智 能	202 1- 11- 18	1,056,000. 00	13,200.00	28	3.3 0	2,710.40	-	-
中信证券	202111180000 5749	亿 纬 锂 能	202 1- 11- 18	2,514,600. 00	19,800.00	28	3.5 0	6,845.30	-	-
中信证券	202111180000 5751	阳 光 电 源	202 1- 11- 18	1,974,852. 00	13,200.00	28	3.3 0	5,068.79	-	-
中信证券	202111180000 5753	汇 川 技 术	202 1- 11- 18	1,306,800. 00	19,800.00	28	3.4 0	3,455.76	-	-
中信证券	202111180000 5755	同 花 顺	202 1- 11- 18	733,392.0 0	6,600.00	28	3.4 0	1,939.41	-	-
中信证券	202111180000 5757	三 环 集 团	202 1- 11- 18	543,576.0 0	13,200.00	28	3.2 0	1,352.90	-	-
中信证券	202111180000 5759	乐	202 1-	438,966.0 0	19,800.00	28	3.3 0	1,126.68	-	-

		普 医 疗	11- 18								
中信证券	202111180000 6245	亿 联 网 络	202 1- 11- 18	527,010.0 0	6,600.00	28	3.3 0	1,352.66	-	-	
中信证券	202111180000 6247	芒 果 超 媒	202 1- 11- 18	611,952.0 0	13,200.00	28	3.1 0	1,475.48	-	-	
中信证券	202111180000 6249	爱 尔 眼 科	202 1- 11- 18	1,888,920. 00	39,600.00	28	3.1 0	4,554.40	-	-	
中信证券	202111180000 6251	中 国 通 号	202 1- 11- 18	195,228.0 0	39,600.00	28	3.0 0	455.53	-	-	
中信证券	202111220001 4510	同 花 顺	202 1- 11- 22	617,084.0 0	5,200.00	28	2.3 0	1,103.89	-	-	
中信证券	202111220001 4512	乐 普 医 疗	202 1- 11- 22	341,802.0 0	15,300.00	28	3.3 0	877.29	-	-	
中信证券	202111220001 6280	健 帆 生 物	202 1- 11- 22	276,900.0 0	5,200.00	28	3.4 0	732.25	-	-	
中信证券	202111220001 6282	华 大 基 因	202 1- 11- 22	468,624.0 0	5,200.00	28	5.4 0	1,968.22	-	-	
中信证券	202111220001 6284	沃 森 生 物	202 1- 11- 22	1,234,100. 00	20,500.00	28	3.3 0	3,167.52	-	-	
中信证券	202111220001 6286	汇 川 技 术	202 1- 11- 22	1,016,226. 00	15,300.00	28	2.9 0	2,292.15	-	-	
中信证券	202111220001 6288	亿 纬 锂 能	202 1- 11- 22	2,135,574. 00	15,300.00	28	3.1 0	5,149.11	-	-	
中信证券	202111220001 6290	英 科 医 疗	202 1- 11- 22	284,128.0 0	5,200.00	28	3.1 0	685.06	-	-	

中信证券	202111220001 6292	贝达药业	2021-11-22	449,696.00	5,200.00	28	3.40	1,189.20	-	-
中信证券	202111220001 6294	沪硅产业	2021-11-22	304,983.00	10,300.00	28	3.40	806.51	-	-
中信证券	202111220001 6296	阳光电源	2021-11-22	1,627,709.00	10,300.00	28	2.80	3,544.79	-	-
中信证券	202111220001 6298	温氏股份	2021-11-22	871,744.00	51,400.00	28	3.40	2,305.28	-	-
中信证券	202111220001 6300	三环集团	2021-11-22	445,578.00	10,300.00	28	3.20	1,108.99	-	-
中信证券	202111230000 0884	爱尔眼科	2021-11-23	281,160.00	6,000.00	14	2.90	317.09	-	-
中信证券	202111230001 2756	宋城演艺	2021-11-23	287,200.00	20,000.00	14	3.40	379.74	-	-
中信证券	202111250000 7934	温氏股份	2021-11-25	48,390.00	3,000.00	14	3.50	65.86	-	-
中信证券	202111290000 4135	英科医疗	2021-11-29	121,300.00	2,000.00	14	3.30	155.67	-	-
中信证券	202111290000 4137	健帆生物	2021-11-29	106,180.00	2,000.00	14	3.50	144.52	-	-
中信证券	202111290000 4139	亿纬锂能	2021-11-29	1,184,000.00	8,000.00	14	2.80	1,289.24	-	-
中信证券	202111290000 4141	沃森生物	2021-11-29	750,750.00	11,000.00	14	3.40	992.66	-	-
中信证券	202111290000 4143	阳光电	2021-11-29	791,100.00	5,000.00	14	3.00	922.95	-	-

中信证券	202111290000 4145	源 汇 川 技 术	202 1- 11- 29	533,040.0 0	8,000.00	14	3.2 0	663.34	-	-
中信证券	202111290000 4147	贝 达 药 业	202 1- 11- 29	167,460.0 0	2,000.00	14	3.3 0	214.91	-	-
中信证券	202111290000 4149	乐 普 医 疗	202 1- 11- 29	178,240.0 0	8,000.00	14	3.4 0	235.67	-	-
中信证券	202111290000 4151	温 氏 股 份	202 1- 11- 29	435,510.0 0	27,000.00	14	3.3 0	558.90	-	-
中信证券	202111290000 4153	三 环 集 团	202 1- 11- 29	208,250.0 0	5,000.00	14	3.5 0	283.45	-	-
中信证券	202111290000 4155	同 花 顺	202 1- 11- 29	232,740.0 0	2,000.00	14	3.2 0	289.63	-	-
中信证券	202111290000 4157	华 大 基 因	202 1- 11- 29	185,280.0 0	2,000.00	14	5.9 0	425.11	-	-
中信证券	202111290000 4159	沪 硅 产 业	202 1- 11- 29	144,800.0 0	5,000.00	14	3.0 0	168.93	-	-
中信证券	202111300000 4743	温 氏 股 份	202 1- 11- 30	31,900.00	2,000.00	14	3.3 0	40.94	-	-
中信证券	202112030000 0962	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 03	6,322,500. 00	150,000.0 0	14	3.5 0	8,605.63	-	-
中信证券	202112030002 1241	沪 硅 产 业	202 1- 12- 03	348,676.0 0	12,200.00	28	2.9 0	786.46	-	-
中信证券	202112030002 1243	沪 硅 产 业	202 1- 12- 03	348,676.0 0	12,200.00	28	2.9 0	786.46	-	-
中信证券	202112030002 1245	中 国	202 1- 12-	55,110.00	11,000.00	28	3.1 0	132.88	-	-

		通 号	03							
中信证券	202112030002 1247	中 国 通 号	202 1- 12- 03	99,198.00	19,800.00	28	3.1 0	239.18	-	-
中信证券	202112030002 1249	澜 起 科 技	202 1- 12- 03	1,018,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456.06	-	-
中信证券	202112030002 1251	沪 硅 产 业	202 1- 12- 03	105,746.0 0	3,700.00	28	2.9 0	238.52	-	-
中信证券	202112030002 1253	澜 起 科 技	202 1- 12- 03	1,018,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456.06	-	-
中信证券	202112030002 1255	中 国 通 号	202 1- 12- 03	99,198.00	19,800.00	28	3.1 0	239.18	-	-
中信证券	202112030002 1257	沪 硅 产 业	202 1- 12- 03	348,676.0 0	12,200.00	28	2.9 0	786.46	-	-
中信证券	202112030002 1259	中 国 通 号	202 1- 12- 03	99,198.00	19,800.00	28	3.1 0	239.18	-	-
中信证券	202112030002 1261	澜 起 科 技	202 1- 12- 03	285,529.0 0	3,700.00	28	3.1 0	688.44	-	-
中信证券	202112030002 1263	澜 起 科 技	202 1- 12- 03	1,018,644. 00	13,200.00	28	3.1 0	2,456.06	-	-
中信证券	202112030002 1269	亿 纬 锂 能	202 1- 12- 03	2,894,760. 00	19,800.00	28	2.7 0	6,079.00	-	-
中信证券	202112030002 1271	亿 纬 锂 能	202 1- 12- 03	2,894,760. 00	19,800.00	28	2.7 0	6,079.00	-	-
中信证券	202112030002 1273	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 03	535,305.0 0	12,700.00	28	2.8 0	1,165.78	-	-
中信证券	202112030002	爱	202	535,305.0	12,700.00	28	2.8	1,165.78	-	-

	1275	尔眼科	1-12-03	0			0			
中信证券	2021120300021277	爱尔眼科	2021-12-03	535,305.00	12,700.00	28	2.80	1,165.78	-	-
中信证券	2021120300021279	亿纬锂能	2021-12-03	804,100.00	5,500.00	28	2.70	1,688.61	-	-
中信证券	2021120300021281	乐普医疗	2021-12-03	433,224.00	19,800.00	28	3.30	1,111.94	-	-
中信证券	2021120300021283	乐普医疗	2021-12-03	433,224.00	19,800.00	28	3.30	1,111.94	-	-
中信证券	2021120300021285	乐普医疗	2021-12-03	120,340.00	5,500.00	28	3.30	308.87	-	-
中信证券	2021120300021287	亿纬锂能	2021-12-03	2,894,760.00	19,800.00	28	2.70	6,079.00	-	-
中信证券	2021120300021289	乐普医疗	2021-12-03	433,224.00	19,800.00	28	3.30	1,111.94	-	-
中信证券	2021120300021291	爱尔眼科	2021-12-03	463,650.00	11,000.00	28	2.80	1,009.73	-	-
中信证券	2021120300021293	智飞生物	2021-12-03	464,512.00	3,800.00	28	2.80	1,011.60	-	-
中信证券	2021120300021295	智飞生物	2021-12-03	452,288.00	3,700.00	28	2.80	984.98	-	-
中信证券	2021120300021297	智飞生物	2021-12-03	464,512.00	3,800.00	28	2.80	1,011.60	-	-
中信证券	2021120300021299	智飞生物	2021-12-03	464,512.00	3,800.00	28	2.80	1,011.60	-	-

中信证券	202112030002 1301	汇川技术	2021-12-03	362,230.00	5,500.00	28	3.10	873.38	-	-
中信证券	202112030002 1303	汇川技术	2021-12-03	480,778.00	7,300.00	28	3.10	1,159.21	-	-
中信证券	202112030002 1305	同花顺	2021-12-03	219,708.00	1,800.00	28	3.10	529.74	-	-
中信证券	202112030002 1307	汇川技术	2021-12-03	480,778.00	7,300.00	28	3.10	1,159.21	-	-
中信证券	202112030002 1309	同花顺	2021-12-03	122,060.00	1,000.00	28	3.10	294.30	-	-
中信证券	202112030002 1311	汇川技术	2021-12-03	480,778.00	7,300.00	28	3.10	1,159.21	-	-
中信证券	202112030002 1313	同花顺	2021-12-03	122,060.00	1,000.00	28	3.10	294.30	-	-
中信证券	202112030002 1315	同花顺	2021-12-03	122,060.00	1,000.00	28	3.10	294.30	-	-
中信证券	202112030002 1317	东方财富	2021-12-03	1,457,566.00	41,800.00	28	3.10	3,514.35	-	-
中信证券	202112030002 1319	东方财富	2021-12-03	871,750.00	25,000.00	28	3.10	2,101.89	-	-
中信证券	202112030002 1321	东方财富	2021-12-03	1,457,566.00	41,800.00	28	3.10	3,514.35	-	-
中信证券	202112030002 1323	东方财富	2021-12-03	1,457,566.00	41,800.00	28	3.10	3,514.35	-	-
中信证券	202112030002 1325	贝达药业	2021-12-03	88,451.00	1,100.00	28	3.20	220.14	-	-
中信证券	202112030002	贝	202	144,738.00	1,800.00	28	3.2	360.24	-	-

	1327	达药业	1-12-03	0			0			
中信证券	2021120300021329	欧普康视	2021-12-03	133,464.00	2,400.00	28	2.40	249.13	-	-
中信证券	2021120300021331	贝达药业	2021-12-03	88,451.00	1,100.00	28	3.20	220.14	-	-
中信证券	2021120300021333	温氏股份	2021-12-03	365,750.00	20,900.00	28	3.20	910.31	-	-
中信证券	2021120300021335	欧普康视	2021-12-03	133,464.00	2,400.00	28	2.40	249.13	-	-
中信证券	2021120300021337	欧普康视	2021-12-03	100,098.00	1,800.00	28	2.40	186.85	-	-
中信证券	2021120300021339	温氏股份	2021-12-03	365,750.00	20,900.00	28	3.20	910.31	-	-
中信证券	2021120300021341	贝达药业	2021-12-03	88,451.00	1,100.00	28	3.20	220.14	-	-
中信证券	2021120300021343	健帆生物	2021-12-03	90,990.00	1,800.00	28	3.40	240.62	-	-
中信证券	2021120300021345	温氏股份	2021-12-03	320,250.00	18,300.00	28	3.20	797.07	-	-
中信证券	2021120300021347	欧普康视	2021-12-03	133,464.00	2,400.00	28	2.40	249.13	-	-
中信证券	2021120300021349	温氏股份	2021-12-03	365,750.00	20,900.00	28	3.20	910.31	-	-
中信证券	2021120300021351	健帆生物	2021-12-03	96,045.00	1,900.00	28	3.40	253.99	-	-

中信证券	202112030002 1353	健帆生物	2021-12-03	96,045.00	1,900.00	28	3.40	253.99	-	-
中信证券	202112030002 1355	华大基因	2021-12-03	165,042.00	1,800.00	28	5.80	744.52	-	-
中信证券	202112030002 1357	健帆生物	2021-12-03	96,045.00	1,900.00	28	3.40	253.99	-	-
中信证券	202112030002 1359	华大基因	2021-12-03	504,295.00	5,500.00	28	5.80	2,274.93	-	-
中信证券	202112030002 1361	华大基因	2021-12-03	504,295.00	5,500.00	28	5.80	2,274.93	-	-
中信证券	202112030002 1363	华大基因	2021-12-03	504,295.00	5,500.00	28	5.80	2,274.93	-	-
中信证券	202112030002 1365	英科医疗	2021-12-03	328,590.00	5,400.00	28	3.20	817.82	-	-
中信证券	202112030002 1367	英科医疗	2021-12-03	328,590.00	5,400.00	28	3.20	817.82	-	-
中信证券	202112030002 1369	英科医疗	2021-12-03	328,590.00	5,400.00	28	3.20	817.82	-	-
中信证券	202112030002 1371	康泰生物	2021-12-03	209,969.00	1,900.00	28	3.00	489.93	-	-
中信证券	202112030002 1373	康泰生物	2021-12-03	209,969.00	1,900.00	28	3.00	489.93	-	-
中信证券	202112030002 1375	康泰生物	2021-12-03	209,969.00	1,900.00	28	3.00	489.93	-	-
中信证券	202112030002 1377	亿联网	2021-12-03	98,020.00	1,300.00	28	3.00	228.71	-	-

中信证券	202112030002 1379	康泰生物	2021-12-03	198,918.00	1,800.00	28	3.00	464.14	-	-
中信证券	202112030002 1381	亿联网络	2021-12-03	135,720.00	1,800.00	28	3.00	316.68	-	-
中信证券	202112030002 1383	亿联网络	2021-12-03	98,020.00	1,300.00	28	3.00	228.71	-	-
中信证券	202112030002 1385	阳光电源	2021-12-03	1,055,631.00	6,900.00	28	2.90	2,381.03	-	-
中信证券	202112030002 1387	亿联网络	2021-12-03	98,020.00	1,300.00	28	3.00	228.71	-	-
中信证券	202112030002 1389	阳光电源	2021-12-03	1,055,631.00	6,900.00	28	2.90	2,381.03	-	-
中信证券	202112030002 1391	阳光电源	2021-12-03	566,063.00	3,700.00	28	2.90	1,276.79	-	-
中信证券	202112030002 1393	阳光电源	2021-12-03	1,055,631.00	6,900.00	28	2.90	2,381.03	-	-
中信证券	202112030002 1395	泰格医药	2021-12-03	340,500.00	2,500.00	28	2.90	768.02	-	-
中信证券	202112030002 3241	泰格医药	2021-12-03	340,500.00	2,500.00	28	2.90	768.02	-	-
中信证券	202112030002 3243	泰格医药	2021-12-03	245,160.00	1,800.00	28	2.90	552.97	-	-
中信证券	202112030002 3245	泰格医药	2021-12-03	340,500.00	2,500.00	28	2.90	768.02	-	-
中信证券	202112030002 3247	沃森	2021-	480,924.00	7,300.00	28	3.30	1,234.37	-	-

		生物	12-03							
中信证券	2021120300023249	沃森生物	2021-12-03	480,924.00	7,300.00	28	3.30	1,234.37	-	-
中信证券	2021120300023251	沃森生物	2021-12-03	480,924.00	7,300.00	28	3.30	1,234.37	-	-
中信证券	2021120300023253	沃森生物	2021-12-03	480,924.00	7,300.00	28	3.30	1,234.37	-	-
中信证券	2021120300023255	宋城演艺	2021-12-03	98,568.00	7,400.00	28	3.20	245.32	-	-
中信证券	2021120300023257	宋城演艺	2021-12-03	97,236.00	7,300.00	28	3.20	242.01	-	-
中信证券	2021120300023259	宋城演艺	2021-12-03	98,568.00	7,400.00	28	3.20	245.32	-	-
中信证券	2021120300023261	宋城演艺	2021-12-03	98,568.00	7,400.00	28	3.20	245.32	-	-
中信证券	2021120300023263	蓝思科技	2021-12-03	145,880.00	7,000.00	28	2.40	272.31	-	-
中信证券	2021120300023265	蓝思科技	2021-12-03	145,880.00	7,000.00	28	2.40	272.31	-	-
中信证券	2021120300023267	蓝思科技	2021-12-03	145,880.00	7,000.00	28	2.40	272.31	-	-
中信证券	2021120300023269	先导智能	2021-12-03	300,662.00	3,700.00	28	3.20	748.31	-	-
中信证券	2021120300023271	先导智能	2021-12-03	357,544.00	4,400.00	28	3.20	889.89	-	-
中信证券	202112030002	先	202	357,544.00	4,400.00	28	3.2	889.89	-	-

	3273	导智能	1-12-03	0			0			
中信证券	2021120300023275	三环集团	2021-12-03	225,063.00	5,100.00	28	3.40	595.17	-	-
中信证券	2021120300023277	先导智能	2021-12-03	357,544.00	4,400.00	28	3.20	889.89	-	-
中信证券	2021120300023279	三环集团	2021-12-03	163,281.00	3,700.00	28	3.40	431.79	-	-
中信证券	2021120300023281	芒果超媒	2021-12-03	579,348.00	13,200.00	28	3.30	1,486.99	-	-
中信证券	2021120300023283	蓝思科技	2021-12-03	114,620.00	5,500.00	28	2.40	213.96	-	-
中信证券	2021120300023285	三环集团	2021-12-03	225,063.00	5,100.00	28	3.40	595.17	-	-
中信证券	2021120300023287	芒果超媒	2021-12-03	162,393.00	3,700.00	28	3.30	416.81	-	-
中信证券	2021120300023289	三环集团	2021-12-03	225,063.00	5,100.00	28	3.40	595.17	-	-
中信证券	2021120300023291	芒果超媒	2021-12-03	579,348.00	13,200.00	28	3.30	1,486.99	-	-
中信证券	2021120300023293	芒果超媒	2021-12-03	579,348.00	13,200.00	28	3.30	1,486.99	-	-
中信证券	2021120700001091	亿联网络	2021-12-07	84,040.00	1,000.00	14	3.40	111.12	-	-
中信证券	2021120700001092	温氏股份	2021-12-07	52,620.00	3,000.00	14	3.40	69.58	-	-

中信证券	202112070000 8669	英科医疗	2021-12-07	389,400.00	6,600.00	28	3.40	882.64	381,744.00	882.64
中信证券	202112070000 8671	华大基因	2021-12-07	593,934.00	6,600.00	28	5.80	2,296.54	579,480.00	2,296.54
中信证券	202112070000 8673	温氏股份	2021-12-07	1,157,640.00	66,000.00	28	3.20	2,469.63	1,271,160.00	2,469.63
中信证券	202112070000 8675	泰格医药	2021-12-07	889,614.00	6,600.00	28	3.20	1,897.84	843,480.00	1,897.84
中信证券	202112070000 8677	汇川技术	2021-12-07	1,297,494.00	19,800.00	28	2.70	2,335.49	1,358,280.00	2,335.49
中信证券	202112070000 8679	先导智能	2021-12-07	1,030,656.00	13,200.00	28	3.40	2,336.15	981,684.00	2,336.15
中信证券	202112070000 8687	阳光电源	2021-12-07	1,962,840.00	13,200.00	28	3.30	4,318.25	1,924,560.00	4,318.25
中信证券	202112070000 8691	沪硅产业	2021-12-07	358,776.00	13,200.00	28	1.90	454.45	340,824.00	454.45
中信证券	202112070000 8693	东方财富	2021-12-07	4,445,430.00	125,400.00	28	3.30	9,779.95	4,653,594.00	9,779.95
中信证券	202112070000 8695	宋城演艺	2021-12-07	272,200.00	20,000.00	14	3.30	349.32	-	-
中信证券	202112070000 8697	宋城演艺	2021-12-07	359,304.00	26,400.00	28	3.20	766.52	378,048.00	766.52
中信证券	202112070000 8699	同花顺	2021-12-07	822,690.00	6,600.00	28	3.30	1,809.92	954,228.00	1,809.92
中信证券	202112070000 8701	爱尔眼科	2021-12-07	257,940.00	6,000.00	14	3.50	351.09	-	-

中信证券	202112070000 8703	爱尔眼科	2021-12-07	1,702,404.00	39,600.00	28	3.40	3,858.78	1,674,288.00	3,858.78
中信证券	202112070000 8705	贝达药业	2021-12-07	537,240.00	6,600.00	28	3.40	1,217.74	526,878.00	1,217.74
中信证券	202112070000 8707	中国通号	2021-12-07	198,000.00	39,600.00	28	3.50	462.00	197,208.00	462.00
中信证券	202112070000 8709	蓝思科技	2021-12-07	424,710.00	19,800.00	28	2.10	594.59	455,004.00	594.59
中信证券	202112070000 8711	沃森生物	2021-12-07	1,658,976.00	26,400.00	28	3.40	3,760.35	1,483,680.00	3,760.35
中信证券	202112070000 8713	亿联网络	2021-12-07	554,664.00	6,600.00	28	3.40	1,257.24	537,570.00	1,257.24
中信证券	202112090000 0738	宋城演艺	2021-12-09	238,000.00	17,000.00	14	3.40	314.69	-	-
中信证券	202112090000 0896	中微公司	2021-12-09	7,600,000.00	50,000.00	14	8.10	23,940.00	-	-
中信证券	202112090000 6891	温氏股份	2021-12-09	52,350.00	3,000.00	14	3.30	67.18	-	-
中信证券	202112100000 4359	同花顺	2021-12-10	845,130.00	6,600.00	28	3.30	1,626.88	954,228.00	1,626.88
中信证券	202112100000 4361	东方财富	2021-12-10	4,627,260.00	125,400.00	28	3.30	8,907.47	4,653,594.00	8,907.47
中信证券	202112100000 4369	汇川技术	2021-12-10	1,402,830.00	19,800.00	28	2.70	2,209.46	1,358,280.00	2,209.46
中信证券	202112100000 4373	沃森生物	2021-12-10	1,623,600.00	26,400.00	28	3.40	3,220.14	1,483,680.00	3,220.14

中信证券	202112100000 4383	阳光 电源	202 1- 12- 10	1,979,868. 00	13,200.00	28	3.3 0	3,811.25	1,924 ,560. 00	3,811.2 5
中信证券	202112100000 4385	芒果 超媒	202 1- 12- 10	608,652.0 0	13,200.00	28	3.3 0	1,171.66	755,3 04.00	1,171.6 6
中信证券	202112100000 4557	沪 硅 产业	202 1- 12- 10	368,808.0 0	13,200.00	28	1.9 0	408.77	340,8 24.00	408.77
中信证券	202112100000 4851	澜 起 科技	202 1- 12- 10	990,000.0 0	13,200.00	28	2.7 0	1,559.25	1,107 ,084. 00	1,559.2 5
中信证券	202112100000 4927	智 飞 生物	202 1- 12- 10	1,679,964. 00	13,200.00	28	3.1 0	3,037.94	1,644 ,720. 00	3,037.9 4
中信证券	202112100000 4929	宋 城 演艺	202 1- 12- 10	366,168.0 0	26,400.00	28	3.2 0	683.51	378,0 48.00	683.51
中信证券	202112100000 4931	泰 格 医药	202 1- 12- 10	940,500.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,755.60	843,4 80.00	1,755.6 0
中信证券	202112100000 4933	三 环 集团	202 1- 12- 10	614,856.0 0	13,200.00	28	3.4 0	1,219.46	588,7 20.00	1,219.4 6
中信证券	202112100000 6075	蓝 思 科技	202 1- 12- 10	449,262.0 0	19,800.00	28	2.1 0	550.34	455,0 04.00	550.34
中信证券	202112100000 6077	先 导 智能	202 1- 12- 10	1,069,068. 00	13,200.00	28	3.4 0	2,120.32	981,6 84.00	2,120.3 2
中信证券	202112100000 6079	温 氏 股份	202 1- 12- 10	1,139,820. 00	66,000.00	28	3.2 0	2,127.67	1,271 ,160. 00	2,127.6 7
中信证券	202112100000 6083	健 帆 生物	202 1- 12- 10	341,286.0 0	6,600.00	28	3.3 0	656.98	351,7 80.00	656.98
中信证券	202112100000 6085	贝 达 药	202 1- 12- 10	541,926.0 0	6,600.00	28	3.4 0	1,074.82	526,8 78.00	1,074.8 2

中信证券	202112100000 6089	业 亿 联 网 络	202 1- 12- 10	557,964.0 0	6,600.00	28	3.4 0	1,106.63	537,5 70.00	1,106.6 3
中信证券	202112100000 6091	华 大 基 因	202 1- 12- 10	608,586.0 0	6,600.00	28	5.8 0	2,059.05	579,4 80.00	2,059.0 5
中信证券	202112100000 6097	英 科 医 疗	202 1- 12- 10	394,878.0 0	6,600.00	28	3.4 0	783.17	381,7 44.00	783.17
中信证券	202112100000 6163	乐 普 医 疗	202 1- 12- 10	435,600.0 0	19,800.00	28	3.3 0	838.53	448,0 74.00	838.53
中信证券	202112100000 6165	亿 纬 锂 能	202 1- 12- 10	2,716,956. 00	19,800.00	28	3.3 0	5,230.14	2,339 ,964. 00	5,230.1 4
中信证券	202112100000 6167	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 10	1,756,260. 00	39,600.00	28	3.4 0	3,483.25	1,674 ,288. 00	3,483.2 5
中信证券	202112100000 6683	欧 普 康 视	202 1- 12- 10	413,292.0 0	6,600.00	28	3.4 0	819.70	378,6 42.00	819.70
中信证券	202112100000 6685	康 泰 生 物	202 1- 12- 10	743,754.0 0	6,600.00	28	3.2 0	1,388.34	650,3 64.00	1,388.3 4
中信证券	202112100000 6689	中 国 通 号	202 1- 12- 10	198,000.0 0	39,600.00	28	3.5 0	404.25	197,2 08.00	404.25
中信证券	202112130000 9331	沪 硅 产 业	202 1- 12- 13	138,400.0 0	5,000.00	14	1.8 0	96.88	-	-
中信证券	202112130000 9333	同 花 顺	202 1- 12- 13	264,180.0 0	2,000.00	14	3.5 0	359.58	-	-
中信证券	202112130000 9335	阳 光 电 源	202 1- 12- 13	740,450.0 0	5,000.00	14	3.4 0	979.04	-	-
中信证券	202112130000 9337	三 环	202 1- 12-	230,900.0 0	5,000.00	14	3.4 0	305.30	-	-

		集团	13							
中信证券	202112130000 9339	汇川技术	2021-12-13	572,400.00	8,000.00	14	3.30	734.58	-	-
中信证券	202112130000 9341	温氏股份	2021-12-13	471,420.00	27,000.00	14	3.40	623.32	-	-
中信证券	202112130000 9343	沃森生物	2021-12-13	673,200.00	11,000.00	14	3.40	890.12	-	-
中信证券	202112130000 9345	健帆生物	2021-12-13	105,680.00	2,000.00	14	2.90	119.18	-	-
中信证券	202112130000 9347	贝达药业	2021-12-13	164,380.00	2,000.00	14	3.50	223.74	-	-
中信证券	202112130000 9349	华大基因	2021-12-13	184,860.00	2,000.00	14	5.90	424.15	-	-
中信证券	202112130000 9351	英科医疗	2021-12-13	118,640.00	2,000.00	14	3.50	161.48	-	-
中信证券	202112130000 9353	亿纬锂能	2021-12-13	1,099,440.00	8,000.00	14	3.00	1,282.68	-	-
中信证券	202112130000 9357	乐普医疗	2021-12-13	174,320.00	8,000.00	14	3.50	237.27	-	-
中信证券	202112140000 1111	迈瑞医疗	2021-12-14	742,600.00	2,000.00	14	1.80	519.82	-	-
中信证券	202112140000 1115	健帆生物	2021-12-14	212,720.00	4,000.00	14	1.80	148.90	-	-
中信证券	202112140000 1117	爱尔眼科	2021-12-14	837,520.00	19,000.00	14	1.80	586.26	-	-
中信证券	202112140000	乐	202	239,690.00	11,000.00	14	1.8	167.78	-	-

	1119	普 医 疗	1- 12- 14	0			0				
中信证券	202112140000 1503	健 帆 生 物	202 1- 12- 14	531,800.0 0	10,000.00	14	3.5 0	723.84	-	-	
中信证券	202112140001 1136	温 氏 股 份	202 1- 12- 14	35,380.00	2,000.00	14	3.4 0	46.78	-	-	
中信证券	202112150001 5773	亿 纬 锂 能	202 1- 12- 15	132,000.0 0	1,000.00	28	2.9 0	170.13	118,1 80.00	170.13	
中信证券	202112150001 5775	同 花 顺	202 1- 12- 15	136,520.0 0	1,000.00	28	3.4 0	206.30	144,5 80.00	206.30	
中信证券	202112150001 5777	东 方 财 富	202 1- 12- 15	38,670.00	1,000.00	28	2.1 0	36.09	37,11 0.00	36.09	
中信证券	202112150001 5779	乐 普 医 疗	202 1- 12- 15	21,600.00	1,000.00	28	3.4 0	32.64	22,63 0.00	32.64	
中信证券	202112150001 5781	宋 城 演 艺	202 1- 12- 15	13,820.00	1,000.00	28	3.3 0	20.27	14,32 0.00	20.27	
中信证券	202112150001 5783	阳 光 电 源	202 1- 12- 15	149,100.0 0	1,000.00	28	3.3 0	218.68	145,8 00.00	218.68	
中信证券	202112150001 5785	汇 川 技 术	202 1- 12- 15	68,850.00	1,000.00	28	3.2 0	97.92	68,60 0.00	97.92	
中信证券	202112150001 5787	泰 格 医 药	202 1- 12- 15	128,600.0 0	1,000.00	28	3.3 0	188.61	127,8 00.00	188.61	
中信证券	202112150001 5789	沃 森 生 物	202 1- 12- 15	62,570.00	1,000.00	28	3.3 0	91.77	56,20 0.00	91.77	
中信证券	202112150001 5791	智 飞 生 物	202 1- 12- 15	129,850.0 0	1,000.00	28	3.3 0	190.45	124,6 00.00	190.45	

中信证券	2021121500015793	健帆生物	2021-12-15	52,320.00	1,000.00	28	2.80	65.11	53,300.00	65.11
中信证券	2021121500015795	贝达药业	2021-12-15	80,860.00	1,000.00	28	3.40	122.19	79,830.00	122.19
中信证券	2021121500015797	温氏股份	2021-12-15	17,590.00	1,000.00	28	3.30	25.80	19,260.00	25.80
中信证券	2021121500015799	三环集团	2021-12-15	45,400.00	1,000.00	28	3.30	66.59	44,600.00	66.59
中信证券	2021121500015801	蓝思科技	2021-12-15	24,350.00	1,000.00	28	2.10	22.73	22,980.00	22.73
中信证券	2021121500015803	先导智能	2021-12-15	85,090.00	1,000.00	28	3.30	124.80	74,370.00	124.80
中信证券	2021121500015805	欧普康视	2021-12-15	60,780.00	1,000.00	28	3.50	94.55	57,370.00	94.55
中信证券	2021121500015807	英科医疗	2021-12-15	58,120.00	1,000.00	28	3.40	87.83	57,840.00	87.83
中信证券	2021121500015809	康泰生物	2021-12-15	111,510.00	1,000.00	28	3.30	163.55	98,540.00	163.55
中信证券	2021121500015811	华大基因	2021-12-15	90,200.00	1,000.00	28	5.80	232.51	87,800.00	232.51
中信证券	2021121500015813	石头科技	2021-12-15	810,000.00	1,000.00	28	3.40	1,224.00	813,000.00	1,224.00
中信证券	2021121500015815	华熙生物	2021-12-15	168,010.00	1,000.00	28	6.00	448.03	155,300.00	448.03
中信证券	2021121500015817	华润微	2021-12-15	338,500.00	5,000.00	28	1.40	210.62	323,000.00	210.62

中信证券	2021121500015819	中国通号	2021-12-15	4,930.00	1,000.00	28	2.80	6.14	4,980.00	6.14
中信证券	2021121500015821	中微公司	2021-12-15	145,150.00	1,000.00	28	8.00	516.09	126,600.00	516.09
中信证券	2021121500015823	澜起科技	2021-12-15	76,550.00	1,000.00	28	4.70	159.90	83,870.00	159.90
中信证券	2021121500015825	沪硅产业	2021-12-15	27,100.00	1,000.00	28	1.70	20.47	25,820.00	20.47
中信证券	2021121600001343	稳健医疗	2021-12-16	638,800.00	8,000.00	28	3.70	984.81	659,600.00	984.81
中信证券	2021121600001345	爱美客	2021-12-16	1,138,100.00	1,900.00	28	5.50	2,608.15	1,018,609.00	2,608.15
中信证券	2021121600001347	金龙鱼	2021-12-16	804,926.00	12,700.00	28	3.10	1,039.70	799,211.00	1,039.70
中信证券	2021121600001349	亿纬锂能	2021-12-16	1,350,000.00	10,000.00	28	3.30	1,856.25	1,181,800.00	1,856.25
中信证券	2021121600001351	乐普医疗	2021-12-16	242,256.00	11,200.00	28	2.80	282.63	253,456.00	282.63
中信证券	2021121600001355	欧普康视	2021-12-16	275,968.00	4,400.00	28	2.20	252.97	252,428.00	252.97
中信证券	2021121600001357	康泰生物	2021-12-16	403,300.00	3,700.00	28	2.80	470.52	364,598.00	470.52
中信证券	2021121600001363	亿联网络	2021-12-16	268,096.00	3,200.00	28	3.30	368.63	260,640.00	368.63
中信证券	2021121600001367	温氏股份	2021-12-16	676,476.00	38,700.00	28	3.10	873.78	745,362.00	873.78

中信证券	202112160000 1373	华 大 基 因	202 1- 12- 16	198,132.0 0	2,200.00	28	2.7 0	222.90	193,1 60.00	222.90
中信证券	202112160000 1374	贝 达 药 业	202 1- 12- 16	174,768.0 0	2,200.00	28	1.8 0	131.08	175,6 26.00	131.08
中信证券	202112160000 1375	健 帆 生 物	202 1- 12- 16	220,206.0 0	4,200.00	28	3.4 0	311.96	223,8 60.00	311.96
中信证券	202112160000 1380	迈 瑞 医 疗	202 1- 12- 16	2,089,450. 00	5,800.00	28	2.3 0	2,002.39	2,208 ,640. 00	2,002.3 9
中信证券	202112160000 1381	卓 胜 微	202 1- 12- 16	1,230,804. 00	3,600.00	28	3.2 0	1,641.07	1,176 ,480. 00	1,641.0 7
中信证券	202112160000 1387	宁 德 时 代	202 1- 12- 16	8,450,274. 00	12,900.00	28	3.1 0	10,914.94	7,585 ,200. 00	10,914. 94
中信证券	202112160000 1388	先 导 智 能	202 1- 12- 16	804,518.0 0	9,700.00	28	3.4 0	1,139.73	721,3 89.00	1,139.7 3
中信证券	202112160000 1389	安 克 创 新	202 1- 12- 16	719,245.0 0	6,700.00	28	3.7 0	1,108.84	686,7 50.00	1,108.8 4
中信证券	202112160000 1390	英 科 医 疗	202 1- 12- 16	198,084.0 0	3,400.00	28	3.4 0	280.62	196,6 56.00	280.62
中信证券	202112160000 1391	康 龙 化 成	202 1- 12- 16	900,600.0 0	5,700.00	28	2.8 0	1,050.70	805,2 39.00	1,050.7 0
中信证券	202112160000 1398	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 16	1,026,600. 00	23,600.00	28	3.2 0	1,368.80	997,8 08.00	1,368.8 0
中信证券	202112160000 1399	同 花 顺	202 1- 12- 16	248,346.0 0	1,800.00	28	2.9 0	300.09	260,2 44.00	300.09
中信证券	202112160000 1401	智 飞 生 物	202 1- 12- 16	916,580.0 0	7,000.00	28	2.1 0	802.01	872,2 00.00	802.01

中信证券	202112160000 1402	沃森生物	2021-12-16	907,074.00	13,800.00	28	3.20	1,209.43	775,560.00	1,209.43
中信证券	202112160000 1403	汇川技术	2021-12-16	1,153,600.00	16,000.00	28	3.00	1,442.00	1,097,600.00	1,442.00
中信证券	202112160000 1409	东方财富	2021-12-16	2,730,112.00	70,400.00	28	2.40	2,730.11	2,612,544.00	2,730.11
中信证券	202112160000 1411	宋城演艺	2021-12-16	203,079.00	13,900.00	28	3.20	270.77	199,048.00	270.77
中信证券	202112160000 1413	三环集团	2021-12-16	514,489.00	11,300.00	28	2.60	557.36	503,980.00	557.36
中信证券	202112160000 1414	阳光电源	2021-12-16	1,419,459.00	9,300.00	28	2.70	1,596.89	1,355,940.00	1,596.89
中信证券	202112160000 1415	芒果超媒	2021-12-16	331,762.00	6,200.00	28	3.20	442.35	354,764.00	442.35
中信证券	202112160000 1418	蓝思科技	2021-12-16	412,760.00	17,000.00	28	2.00	343.97	390,660.00	343.97
中信证券	202112160000 1421	泰格医药	2021-12-16	616,217.00	4,700.00	28	2.90	744.59	600,660.00	744.59
中信证券	202112160000 1423	晶盛机电	2021-12-16	981,855.00	13,500.00	28	2.70	1,104.59	938,250.00	1,104.59
中信证券	202112160000 1581	传音控股	2021-12-16	338,646.00	2,200.00	28	3.00	423.31	345,180.00	423.31
中信证券	202112160000 1583	金山办公	2021-12-16	432,616.00	1,700.00	28	3.00	540.77	450,500.00	540.77
中信证券	202112160000 1585	中微公	2021-12-16	320,760.00	2,200.00	28	3.50	467.78	278,520.00	467.78

中信证券	202112160000 1587	奇安信	2021-12-16	783,200.00	8,000.00	28	3.90	1,272.70	703,360.00	1,272.70
中信证券	202112160000 1588	澜起科技	2021-12-16	332,141.00	4,100.00	28	3.10	429.02	343,867.00	429.02
中信证券	202112160000 1591	中芯国际	2021-12-16	1,474,944.00	27,600.00	28	1.40	860.38	1,462,524.00	860.38
中信证券	202112160000 1593	沪硅产业	2021-12-16	178,860.00	6,600.00	28	5.00	372.63	170,412.00	372.63
中信证券	202112160000 1595	华润微	2021-12-16	161,736.00	2,400.00	28	1.30	87.61	155,040.00	87.61
中信证券	202112160000 1596	中国通号	2021-12-16	113,355.00	22,900.00	28	2.50	118.08	114,042.00	118.08
中信证券	202112160000 1599	华熙生物	2021-12-16	169,170.00	1,000.00	28	4.90	345.39	155,300.00	345.39
中信证券	202112160000 1601	天合光能	2021-12-16	1,152,024.00	13,800.00	28	4.90	2,352.05	1,088,820.00	2,352.05
中信证券	202112170002 7634	爱尔眼科	2021-12-17	6,424,500.00	150,000.00	14	3.20	7,994.93	-	-
中信证券	202112200000 9523	沪硅产业	2021-12-20	258,530.00	10,300.00	28	5.00	394.97	265,946.00	394.97
中信证券	202112200000 9533	健帆生物	2021-12-20	265,148.00	5,200.00	28	3.40	275.46	277,160.00	275.46
中信证券	202112200000 9535	华大基因	2021-12-20	468,104.00	5,200.00	28	2.70	386.19	456,560.00	386.19
中信证券	202112200000 9537	英科医	2021-12-	311,792.00	5,200.00	28	3.40	323.92	300,768.00	323.92

		疗	20							
中信证券	202112200000 9539	亿 纬 锂 能	202 1- 12- 20	1,881,747. 00	15,300.00	28	3.3 0	1,897.43	1,808 ,154. 00	1,897.4 3
中信证券	202112200000 9541	同 花 顺	202 1- 12- 20	719,004.0 0	5,200.00	28	2.9 0	637.12	751,8 16.00	637.12
中信证券	202112200000 9543	乐 普 医 疗	202 1- 12- 20	327,573.0 0	15,300.00	28	2.8 0	280.26	346,2 39.00	280.26
中信证券	202112200000 9545	阳 光 电 源	202 1- 12- 20	1,417,280. 00	10,300.00	28	2.7 0	1,169.26	1,501 ,740. 00	1,169.2 6
中信证券	202112200000 9547	沃 森 生 物	202 1- 12- 20	1,312,410. 00	20,500.00	28	3.2 0	1,283.24	1,152 ,100. 00	1,283.2 4
中信证券	202112200000 9549	汇 川 技 术	202 1- 12- 20	1,075,896. 00	15,300.00	28	3.0 0	986.24	1,049 ,580. 00	986.24
中信证券	202112200000 9551	三 环 集 团	202 1- 12- 20	462,264.0 0	10,300.00	28	2.6 0	367.24	459,3 80.00	367.24
中信证券	202112200000 9553	贝 达 药 业	202 1- 12- 20	404,144.0 0	5,200.00	28	1.8 0	222.28	415,1 16.00	222.28
中信证券	202112200000 9555	温 氏 股 份	202 1- 12- 20	910,808.0 0	51,400.00	28	3.1 0	862.74	989,9 64.00	862.74
中信证券	202112210001 9741	宋 城 演 艺	202 1- 12- 21	274,000.0 0	20,000.00	14	3.3 0	251.16	286,4 00.00	251.16
中信证券	202112210001 9743	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 21	258,720.0 0	6,000.00	14	3.3 0	237.16	253,6 80.00	237.16
中信证券	202112230000 1062	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 23	1,622,600. 00	38,000.00	28	3.1 0	1,117.79	1,606 ,640. 00	1,117.7 9
中信证券	202112230000 1073	爱 尔	202 1- 12-	1,622,600. 00	38,000.00	14	3.2 0	1,153.85	1,606 ,640. 00	1,153.8 5

		眼科	23							
中信证券	2021122300011491	中微公司	2021-12-23	6,422,500.00	50,000.00	14	3.60	5,138.00	6,330,000.00	5,138.00
中信证券	2021122300011503	宋城演艺	2021-12-23	233,410.00	17,000.00	14	3.30	171.17	243,440.00	171.17
中信证券	2021122700001137	爱尔眼科	2021-12-27	2,036,737.00	46,300.00	14	3.30	746.80	1,957,564.00	746.80
中信证券	2021122700009136	乐普医疗	2021-12-27	184,160.00	8,000.00	14	3.00	61.39	181,040.00	61.39
中信证券	2021122700009338	亿纬锂能	2021-12-27	948,000.00	8,000.00	14	3.10	326.53	945,440.00	326.53
中信证券	2021122700009340	汇川技术	2021-12-27	560,000.00	8,000.00	14	2.70	168.00	548,800.00	168.00
中信证券	2021122700009342	同花顺	2021-12-27	273,180.00	2,000.00	14	3.30	100.17	289,160.00	100.17
中信证券	2021122700009344	沃森生物	2021-12-27	647,680.00	11,000.00	14	3.30	237.48	618,200.00	237.48
中信证券	2021122700009346	英科医疗	2021-12-27	115,300.00	2,000.00	14	3.30	42.28	115,680.00	42.28
中信证券	2021122700009348	三环集团	2021-12-27	219,750.00	5,000.00	14	2.70	65.93	223,000.00	65.93
中信证券	2021122700009350	阳光电源	2021-12-27	678,500.00	5,000.00	14	3.20	241.25	729,000.00	241.25
中信证券	2021122700009352	华大基因	2021-12-27	179,740.00	2,000.00	14	2.90	57.92	175,600.00	57.92
中信证券	2021122700009354	温	2021-1-	523,800.00	27,000.00	14	3.30	192.06	520,020.00	192.06

		氏股份	12-27							
中信证券	2021122700009356	贝达药业	2021-12-27	164,520.00	2,000.00	14	3.00	54.84	159,660.00	54.84
中信证券	2021122700009358	健帆生物	2021-12-27	104,360.00	2,000.00	14	3.30	38.27	106,600.00	38.27
中信证券	2021122700009734	沪硅产业	2021-12-27	132,000.00	5,000.00	14	2.80	41.07	129,100.00	41.07
中信证券	2021122800001542	阳光电源	2021-12-28	416,550.00	3,000.00	14	3.10	107.61	437,400.00	107.61
中信证券	2021122800013198	健帆生物	2021-12-28	212,800.00	4,000.00	14	1.80	31.92	213,200.00	31.92
中信证券	2021122800013202	迈瑞医疗	2021-12-28	758,000.00	2,000.00	14	1.80	113.70	761,600.00	113.70
中信证券	2021122800013204	爱尔眼科	2021-12-28	828,400.00	19,000.00	14	1.80	124.26	803,320.00	124.26
中信证券	2021122800013208	乐普医疗	2021-12-28	250,800.00	11,000.00	14	1.80	37.62	248,930.00	37.62
中信证券	2021122900001050	三环集团	2021-12-29	360,552.00	8,300.00	28	2.60	52.08	370,180.00	52.08
中信证券	2021122900001052	东方财富	2021-12-29	36,310,000.00	1,000,000.00	7	3.40	6,858.55	37,110,000.00	6,858.55
中信证券	2021122900001054	华大基因	2021-12-29	141,104.00	1,600.00	28	2.50	19.60	140,480.00	19.60
中信证券	2021122900001055	英科医疗	2021-12-29	143,225.00	2,500.00	28	3.30	26.26	144,600.00	26.26

中信证券	202112290000 1058	温氏股份	2021-12-29	539,115.00	28,300.00	28	3.20	95.84	545,058.00	95.84
中信证券	202112290000 1059	先导智能	2021-12-29	517,235.00	7,100.00	28	2.80	80.46	528,027.00	80.46
中信证券	202112290000 1063	芒果超媒	2021-12-29	227,925.00	4,500.00	28	3.40	43.05	257,490.00	43.05
中信证券	202112290000 1065	健帆生物	2021-12-29	161,882.00	3,100.00	28	3.20	28.78	165,230.00	28.78
中信证券	202112290000 1066	康泰生物	2021-12-29	270,756.00	2,700.00	28	2.60	39.11	266,058.00	39.11
中信证券	202112290000 1070	亿联网络	2021-12-29	186,415.00	2,300.00	28	2.80	29.00	187,335.00	29.00
中信证券	202112290000 1073	蓝思科技	2021-12-29	285,200.00	12,400.00	28	2.50	39.61	284,952.00	39.61
中信证券	202112290000 1076	贝达药业	2021-12-29	127,360.00	1,600.00	28	2.90	20.52	127,728.00	20.52
中信证券	202112290000 1078	欧普康视	2021-12-29	188,416.00	3,200.00	28	2.70	28.26	183,584.00	28.26
中信证券	202112290000 1080	东方财富	2021-12-29	1,866,334.00	51,400.00	28	3.20	331.79	1,907,454.00	331.79
中信证券	202112290000 1082	汇川技术	2021-12-29	811,395.00	11,700.00	28	2.80	126.22	802,620.00	126.22
中信证券	202112290000 1084	亿纬锂能	2021-12-29	878,847.00	7,300.00	28	2.80	136.71	862,714.00	136.71
中信证券	202112290000 1085	沃森生	2021-12-29	577,821.00	10,100.00	28	2.90	93.09	567,620.00	93.09

中信证券	202112290000 1088	物 智 飞 生 物	202 1- 12- 29	639,336.0 0	5,100.00	28	2.4 0	85.25	635,4 60.00	85.25
中信证券	202112290000 1090	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 29	748,028.0 0	17,200.00	28	3.2 0	132.98	727,2 16.00	132.98
中信证券	202112290000 1091	宋 城 演 艺	202 1- 12- 29	145,452.0 0	10,200.00	28	3.3 0	26.67	146,0 64.00	26.67
中信证券	202112290000 1092	泰 格 医 药	202 1- 12- 29	424,286.0 0	3,400.00	28	2.4 0	56.57	434,5 20.00	56.57
中信证券	202112290000 1096	阳 光 电 源	202 1- 12- 29	941,732.0 0	6,800.00	28	3.0 0	156.96	991,4 40.00	156.96
中信证券	202112290000 1098	同 花 顺	202 1- 12- 29	184,106.0 0	1,300.00	28	2.9 0	29.66	187,9 54.00	29.66
中信证券	202112290000 1100	乐 普 医 疗	202 1- 12- 29	186,386.0 0	8,200.00	28	3.1 0	32.10	185,5 66.00	32.10
中信证券	202112290000 1102	中 微 公 司	202 1- 12- 29	198,480.0 0	1,600.00	28	3.0 0	18.90	202,5 60.00	-
中信证券	202112290000 1104	华 润 微	202 1- 12- 29	114,534.0 0	1,800.00	28	1.4 0	5.09	116,2 80.00	-
中信证券	202112290000 1106	中 国 通 号	202 1- 12- 29	83,166.00	16,700.00	28	2.1 0	5.54	83,16 6.00	-
中信证券	202112290000 1108	澜 起 科 技	202 1- 12- 29	235,800.0 0	3,000.00	28	2.7 0	20.21	251,6 10.00	-
中信证券	202112290000 1110	传 音 控 股	202 1- 12- 29	243,040.0 0	1,600.00	28	2.1 0	16.20	251,0 40.00	-
中信证券	202112290000 1112	金 山 办	202 1- 12-	313,248.0 0	1,200.00	28	2.2 0	21.88	318,0 00.00	-

		公	29							
中信证券	202112290000 1114	华 熙 生 物	202 1- 12- 29	156,200.0 0	1,000.00	28	3.2 0	15.87	155,3 00.00	-
中信证券	202112290000 1116	沪 硅 产 业	202 1- 12- 29	122,544.0 0	4,800.00	28	3.3 0	12.84	123,9 36.00	-
中信证券	202112300000 1558	爱 尔 眼 科	202 1- 12- 30	2,007,900. 00	46,000.00	14	3.3 0	184.06	1,944 ,880. 00	184.06
中信证券	202112310000 1151	蓝 思 科 技	202 1- 12- 31	39,066.00	1,700.00	14	1.8 0	-	39,06 6.00	-
中信证券	202112310000 1160	汇 川 技 术	202 1- 12- 31	68,600.00	1,000.00	14	1.8 0	-	68,60 0.00	-
中信证券	202112310002 6608	中 国 通 号	202 1- 12- 31	98,604.00	19,800.00	28	2.1 0	-	98,60 4.00	-
中信证券	202112310002 6610	沪 硅 产 业	202 1- 12- 31	315,004.0 0	12,200.00	28	2.7 0	-	315,0 04.00	-
中信证券	202112310002 6612	澜 起 科 技	202 1- 12- 31	1,107,084. 00	13,200.00	28	2.4 0	-	1,107 ,084. 00	-
中信证券	202112310002 6614	阳 光 电 源	202 1- 12- 31	539,460.0 0	3,700.00	28	3.1 0	-	539,4 60.00	-
中信证券	202112310002 6616	汇 川 技 术	202 1- 12- 31	377,300.0 0	5,500.00	28	2.6 0	-	377,3 00.00	-
中信证券	202112310002 6618	宋 城 演 艺	202 1- 12- 31	104,536.0 0	7,300.00	28	3.3 0	-	104,5 36.00	-
中信证券	202112310002 6620	蓝 思 科 技	202 1- 12- 31	126,390.0 0	5,500.00	28	2.0 0	-	126,3 90.00	-
中信证券	202112310002 6622	沃 森	202 1-	410,260.0 0	7,300.00	28	3.2 0	-	410,2 60.00	-

		生物	12-31							
中信证券	2021123100026624	泰格医药	2021-12-31	230,040.00	1,800.00	28	2.70	-	230,040.00	-
中信证券	2021123100026626	芒果超媒	2021-12-31	211,714.00	3,700.00	28	3.30	-	211,714.00	-
中信证券	2021123100026628	三环集团	2021-12-31	165,020.00	3,700.00	28	2.60	-	165,020.00	-
中信证券	2021123100026630	乐普医疗	2021-12-31	124,465.00	5,500.00	28	2.90	-	124,465.00	-
中信证券	2021123100026632	智飞生物	2021-12-31	461,020.00	3,700.00	28	2.30	-	461,020.00	-
中信证券	2021123100026634	亿纬锂能	2021-12-31	649,990.00	5,500.00	28	3.00	-	649,990.00	-
中信证券	2021123100026636	同花顺	2021-12-31	260,244.00	1,800.00	28	3.20	-	260,244.00	-
中信证券	2021123100026638	爱尔眼科	2021-12-31	465,080.00	11,000.00	28	3.10	-	465,080.00	-
中信证券	2021123100026640	东方财富	2021-12-31	927,750.00	25,000.00	28	2.70	-	927,750.00	-
中信证券	2021123100026642	亿纬锂能	2021-12-31	2,339,964.00	19,800.00	28	3.00	-	2,339,964.00	-
中信证券	2021123100026644	爱尔眼科	2021-12-31	536,956.00	12,700.00	28	3.10	-	536,956.00	-
中信证券	2021123100026646	乐普医疗	2021-12-31	448,074.00	19,800.00	28	2.90	-	448,074.00	-
中信证券	2021123100026648	先	2021-1-	327,228.00	4,400.00	28	3.10	-	327,228.00	-

		导智能	12-31							
中信证券	2021123100026650	芒果超媒	2021-12-31	755,304.00	13,200.00	28	3.30	-	755,304.00	-
中信证券	2021123100026652	蓝思科技	2021-12-31	160,860.00	7,000.00	28	2.00	-	160,860.00	-
中信证券	2021123100026654	温氏股份	2021-12-31	402,534.00	20,900.00	28	3.20	-	402,534.00	-
中信证券	2021123100026656	健帆生物	2021-12-31	101,270.00	1,900.00	28	3.20	-	101,270.00	-
中信证券	2021123100026658	欧普康视	2021-12-31	137,688.00	2,400.00	28	3.00	-	137,688.00	-
中信证券	2021123100026660	贝达药业	2021-12-31	87,813.00	1,100.00	28	2.90	-	87,813.00	-
中信证券	2021123100026662	三环集团	2021-12-31	227,460.00	5,100.00	28	2.60	-	227,460.00	-
中信证券	2021123100026664	康泰生物	2021-12-31	187,226.00	1,900.00	28	2.80	-	187,226.00	-
中信证券	2021123100026666	同花顺	2021-12-31	144,580.00	1,000.00	28	3.20	-	144,580.00	-
中信证券	2021123100026668	智飞生物	2021-12-31	473,480.00	3,800.00	28	2.30	-	473,480.00	-
中信证券	2021123100026670	东方财富	2021-12-31	1,551,198.00	41,800.00	28	2.70	-	1,551,198.00	-
中信证券	2021123100026672	阳光电源	2021-12-31	1,006,020.00	6,900.00	28	3.10	-	1,006,020.00	-

中信证券	202112310002 6674	宋城 演艺	202 1- 12- 31	105,968.0 0	7,400.00	28	3.3 0	-	105,9 68.00	-
中信证券	202112310002 6676	汇川 技术	202 1- 12- 31	500,780.0 0	7,300.00	28	2.6 0	-	500,7 80.00	-
中信证券	202112310002 6678	泰格 医药	202 1- 12- 31	319,500.0 0	2,500.00	28	2.7 0	-	319,5 00.00	-
中信证券	202112310002 6680	沃森 生物	202 1- 12- 31	410,260.0 0	7,300.00	28	3.2 0	-	410,2 60.00	-
中信证券	202112310002 6682	亿联 网络	202 1- 12- 31	105,885.0 0	1,300.00	28	3.1 0	-	105,8 85.00	-
中信证券	202112310002 6684	华大 基因	202 1- 12- 31	482,900.0 0	5,500.00	28	2.8 0	-	482,9 00.00	-
中信证券	202112310002 6686	英科 医疗	202 1- 12- 31	312,336.0 0	5,400.00	28	3.2 0	-	312,3 36.00	-
中信证券	202112310002 6688	爱尔 眼科	202 1- 12- 31	6,342,000. 00	150,000.0 0	14	3.2 0	-	6,342 ,000. 00	-
中信证券	202112310002 6690	澜起 科技	202 1- 12- 31	310,319.0 0	3,700.00	28	2.4 0	-	310,3 19.00	-
中信证券	202112310002 6692	中国 通号	202 1- 12- 31	54,780.00	11,000.00	28	2.1 0	-	54,78 0.00	-
中信证券	202112310002 6694	沪硅 产业	202 1- 12- 31	95,534.00	3,700.00	28	2.7 0	-	95,53 4.00	-
中信证券	202112310002 6696	健帆 生物	202 1- 12- 31	95,940.00	1,800.00	28	3.2 0	-	95,94 0.00	-
中信证券	202112310002 6698	贝达 药	202 1- 12- 31	143,694.0 0	1,800.00	28	2.9 0	-	143,6 94.00	-

中信证券	2021123100026700	业亿联网络	2021-12-31	146,610.00	1,800.00	28	3.10	-	146,610.00	-
中信证券	2021123100026702	先导智能	2021-12-31	275,169.00	3,700.00	28	3.10	-	275,169.00	-
中信证券	2021123100026704	温氏股份	2021-12-31	352,458.00	18,300.00	28	3.20	-	352,458.00	-
中信证券	2021123100028078	华大基因	2021-12-31	158,040.00	1,800.00	28	2.80	-	158,040.00	-
中信证券	2021123100028080	欧普康视	2021-12-31	103,266.00	1,800.00	28	3.00	-	103,266.00	-
中信证券	2021123100028082	康泰生物	2021-12-31	177,372.00	1,800.00	28	2.80	-	177,372.00	-
中信证券	2021123100028084	亿纬锂能	2021-12-31	2,339,964.00	19,800.00	28	3.00	-	2,339,964.00	-
中信证券	2021123100028086	乐普医疗	2021-12-31	448,074.00	19,800.00	28	2.90	-	448,074.00	-
中信证券	2021123100028088	爱尔眼科	2021-12-31	536,956.00	12,700.00	28	3.10	-	536,956.00	-
中信证券	2021123100028090	同花顺	2021-12-31	144,580.00	1,000.00	28	3.20	-	144,580.00	-
中信证券	2021123100028092	蓝思科技	2021-12-31	160,860.00	7,000.00	28	2.00	-	160,860.00	-
中信证券	2021123100028094	温氏股份	2021-12-31	402,534.00	20,900.00	28	3.20	-	402,534.00	-
中信证券	2021123100028096	先导	2021-12-	327,228.00	4,400.00	28	3.10	-	327,228.00	-

		智能	31							
中信证券	2021123100028098	健帆生物	2021-12-31	101,270.00	1,900.00	28	3.20	-	101,270.00	-
中信证券	2021123100028100	康泰生物	2021-12-31	187,226.00	1,900.00	28	2.80	-	187,226.00	-
中信证券	2021123100028102	贝达药业	2021-12-31	87,813.00	1,100.00	28	2.90	-	87,813.00	-
中信证券	2021123100028104	欧普康视	2021-12-31	137,688.00	2,400.00	28	3.00	-	137,688.00	-
中信证券	2021123100028106	亿联网络	2021-12-31	105,885.00	1,300.00	28	3.10	-	105,885.00	-
中信证券	2021123100028108	汇川技术	2021-12-31	500,780.00	7,300.00	28	2.60	-	500,780.00	-
中信证券	2021123100028110	智飞生物	2021-12-31	473,480.00	3,800.00	28	2.30	-	473,480.00	-
中信证券	2021123100028112	芒果超媒	2021-12-31	755,304.00	13,200.00	28	3.30	-	755,304.00	-
中信证券	2021123100028114	沃森生物	2021-12-31	410,260.00	7,300.00	28	3.20	-	410,260.00	-
中信证券	2021123100028116	东方财富	2021-12-31	1,551,198.00	41,800.00	28	2.70	-	1,551,198.00	-
中信证券	2021123100028118	泰格医药	2021-12-31	319,500.00	2,500.00	28	2.70	-	319,500.00	-
中信证券	2021123100028120	宋城演艺	2021-12-31	105,968.00	7,400.00	28	3.30	-	105,968.00	-
中信证券	202112310002	三	202	227,460.00	5,100.00	28	2.6	-	227,4	-

	8122	环集团	1-12-31	0			0		60.00	
中信证券	2021123100028124	阳光电源	2021-12-31	1,006,020.00	6,900.00	28	3.10	-	1,006,020.00	-
中信证券	2021123100028126	华大基因	2021-12-31	482,900.00	5,500.00	28	2.80	-	482,900.00	-
中信证券	2021123100028128	英科医疗	2021-12-31	312,336.00	5,400.00	28	3.20	-	312,336.00	-
中信证券	2021123100029190	华大基因	2021-12-31	482,900.00	5,500.00	28	2.80	-	482,900.00	-
中信证券	2021123100029192	英科医疗	2021-12-31	312,336.00	5,400.00	28	3.20	-	312,336.00	-
中信证券	2021123100029194	欧普康视	2021-12-31	137,688.00	2,400.00	28	3.00	-	137,688.00	-
中信证券	2021123100029196	康泰生物	2021-12-31	187,226.00	1,900.00	28	2.80	-	187,226.00	-
中信证券	2021123100029198	芒果超媒	2021-12-31	755,304.00	13,200.00	28	3.30	-	755,304.00	-
中信证券	2021123100029200	蓝思科技	2021-12-31	160,860.00	7,000.00	28	2.00	-	160,860.00	-
中信证券	2021123100029202	亿联网络	2021-12-31	105,885.00	1,300.00	28	3.10	-	105,885.00	-
中信证券	2021123100029204	贝达药业	2021-12-31	87,813.00	1,100.00	28	2.90	-	87,813.00	-
中信证券	2021123100029206	泰格医药	2021-12-31	319,500.00	2,500.00	28	2.70	-	319,500.00	-

中信证券	202112310002 9208	先导智能	2021-12-31	327,228.00	4,400.00	28	3.10	-	327,228.00	-
中信证券	202112310002 9210	健帆生物	2021-12-31	101,270.00	1,900.00	28	3.20	-	101,270.00	-
中信证券	202112310002 9212	温氏股份	2021-12-31	402,534.00	20,900.00	28	3.20	-	402,534.00	-
中信证券	202112310002 9214	三环集团	2021-12-31	227,460.00	5,100.00	28	2.60	-	227,460.00	-
中信证券	202112310002 9216	澜起科技	2021-12-31	1,107,084.00	13,200.00	28	2.40	-	1,107,084.00	-
中信证券	202112310002 9218	中国通号	2021-12-31	98,604.00	19,800.00	28	2.10	-	98,604.00	-
中信证券	202112310002 9220	沪硅产业	2021-12-31	315,004.00	12,200.00	28	2.70	-	315,004.00	-
中信证券	202112310002 9222	东方财富	2021-12-31	1,551,198.00	41,800.00	28	2.70	-	1,551,198.00	-
中信证券	202112310002 9224	智飞生物	2021-12-31	473,480.00	3,800.00	28	2.30	-	473,480.00	-
中信证券	202112310002 9226	同花顺	2021-12-31	144,580.00	1,000.00	28	3.20	-	144,580.00	-
中信证券	202112310002 9228	爱尔眼科	2021-12-31	536,956.00	12,700.00	28	3.10	-	536,956.00	-
中信证券	202112310002 9230	宋城演艺	2021-12-31	105,968.00	7,400.00	28	3.30	-	105,968.00	-
中信证券	202112310002 9232	阳光电源	2021-12-31	1,006,020.00	6,900.00	28	3.10	-	1,006,020.00	-

中信证券	202112310002 9234	汇川技术	2021-12-31	500,780.00	7,300.00	28	2.60	-	500,780.00	-
中信证券	202112310002 9236	沃森生物	2021-12-31	410,260.00	7,300.00	28	3.20	-	410,260.00	-
中信证券	202112310002 9238	亿纬锂能	2021-12-31	2,339,964.00	19,800.00	28	3.00	-	2,339,964.00	-
中信证券	202112310002 9240	乐普医疗	2021-12-31	448,074.00	19,800.00	28	2.90	-	448,074.00	-
中信证券	202112310002 9242	沪硅产业	2021-12-31	315,004.00	12,200.00	28	2.70	-	315,004.00	-
中信证券	202112310002 9244	中国通号	2021-12-31	98,604.00	19,800.00	28	2.10	-	98,604.00	-
中信证券	202112310002 9246	澜起科技	2021-12-31	1,107,084.00	13,200.00	28	2.40	-	1,107,084.00	-

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
华夏沪深 300ETF 联接	2,158,653,391.00	34.12%	2,141,945,591.00	37.19%
中信证券	1,998,175.00	0.03%	60,540,609.00	1.05%

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

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
中国工商银行活期存款	67,382,370.51	290,311.44	27,638,718.23	228,022.32

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

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	601377	兴业证券	配股发行	1,443,658	7,507,021.60
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	002142	宁波银行	配股发行	376,101	7,510,736.97
中信证券	600905	三峡能源	新股发行	1,296,803	3,436,527.95
中信证券	601728	中国电信	新股发行	562,873	2,549,814.69
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	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

本基金本报告期通过中信期货买卖股指期货成交额为 1,889,120,220.00 元（上年度可比期间：2,618,556,300.00 元），支付给中信期货的佣金为 62,340.97 元（上年度可比期间为：86,412.34 元）。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 257,787,213.75 元，占基金资产净值的比例为 1.03%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括中信证券而被动）持有的中信证券股票估值总额为人民币 290,985,142.31 元，占基金资产净值的比例为 1.01%）。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括工商银行而被动）持有的工商银行股票估值总额为人民币 201,804,527.26 元，占基金资产净值的比例为 0.81%（2021 年 12 月 31 日，本基金（因指数成份股包括工商银行而被动）持有的工商银行股票估值总额为人民币 209,823,909.57 元，占基金资产净值的比例为 0.73%）。

本基金本报告期通过中信证券渠道参与中信证券配售，配股数量为 1,508,729，配股金额为 21,770,959.47 元。

#### 7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记	除息日	每 10 份基金份额 分红数	现金形式发放 总额	再投资形式发 放总额	利润分配合 计	备注

	日	场内	场外					
1	2022-01-14	2022-01-17	-	0.790	422,851,436.44	-	422,851,436.44	-
合计				0.790	422,851,436.44	-	422,851,436.44	-

注：根据本基金管理人于 2023 年 1 月 10 日发布的分红公告，本基金向 2023 年 1 月 13 日在本基金登记结算机构登记在册的基金份额持有人按每 10 份基金份额派发红利 0.650 元。

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
688041	海光信息	2022-08-05	6 个月	新发流通受限	36.00	39.15	70,208	2,527,488.00	2,748,643.20	-
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	-
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	-
688382	益方生物	2022-07-18	6 个月	新发流通受限	18.12	12.89	36,208	656,088.96	466,721.12	-
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	-
688392	骄成超声	2022-09-19	6 个月	新发流通受限	71.18	134.27	2,745	195,389.10	368,571.15	-
688231	隆达股份	2022-07-13	6 个月	新发流通受限	39.08	35.14	7,835	306,191.80	275,321.90	-
688489	三未信安	2022-11-25	6 个月	新发流通受限	78.89	90.62	1,995	157,385.55	180,786.90	-
688084	晶品特装	2022-12-01	6 个月	新发流通受限	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-

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	-
688291	金橙子	2022-10-17	6 个月	新发流通受限	26.77	24.11	3,961	106,035.97	95,499.71	-
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	新发流通受限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04	-
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	新发流通受限	26.28	18.13	815	21,418.20	14,775.95	-
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	新发流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
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	新发流通受限	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
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	新发流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
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，锁定期限为自发行人股票上市之日起 6 个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于 6 个月的限售期。

⑤基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 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	300750	宁德时代	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 6 日	393.42	135,600.00	53,347,752.00
2	000002	万科 A	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 30 日	18.20	1,340,000.00	24,388,000.00
3	300274	阳光电源	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	111.80	175,400.00	19,609,720.00
4	600438	通威股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	38.58	451,800.00	17,430,444.00
5	000625	长安汽车	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	12.31	1,316,300.00	16,203,653.00
6	002459	晶澳科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年	60.09	261,600.00	15,719,544.00

			1月5日			
7	601669	中国电建	2023年1月3日-2023年1月12日	7.08	2,214,100.00	15,675,828.00
8	000100	TCL 科技	2023年1月3日-2023年1月18日	3.72	4,213,300.00	15,673,476.00
9	300059	东方财富	2023年1月3日-2023年1月12日	19.40	805,700.00	15,630,580.00
10	000725	京东方A	2023年1月3日-2023年1月12日	3.38	4,328,400.00	14,629,992.00
11	600809	山西汾酒	2023年1月4日-2023年1月4日	284.99	47,000.00	13,394,530.00
12	002271	东方雨虹	2023年1月3日-2023年1月12日	33.57	395,500.00	13,276,935.00
13	600196	复星医药	2023年1月3日-2023年1月12日	35.24	366,100.00	12,901,364.00
14	688599	天合光能	2023年1月3日-2023年1月17日	63.76	199,400.00	12,713,744.00
15	601988	中国银行	2023年1月3日-2023年1月3日	3.16	4,000,000.00	12,640,000.00
16	600050	中国联通	2023年1月3日-2023年1月30日	4.48	2,819,500.00	12,631,360.00
17	300122	智飞生物	2023年1月3日-2023年1月30日	87.83	140,400.00	12,331,332.00
18	002049	紫光国微	2023年1月3日-2023年1月12日	131.82	87,200.00	11,494,704.00
19	600029	南方航空	2023年1月3日-2023年1月12日	7.60	1,480,100.00	11,248,760.00
20	601888	中国中免	2023年1月3日-2023年1月10日	216.03	50,000.00	10,801,500.00
21	300450	先导智能	2023年1月3日-2023年1月12日	40.25	265,500.00	10,686,375.00
22	300347	泰格医药	2023年1月3日-2023年1月12日	104.80	99,900.00	10,469,520.00
23	002129	TCL 中环	2023年1月3日-2023年	37.66	275,400.00	10,371,564.00

			1月12日			
24	002410	广联达	2023年1月3日-2023年1月12日	59.95	167,400.00	10,035,630.00
25	000792	盐湖股份	2023年1月3日-2023年1月12日	22.69	436,000.00	9,892,840.00
26	000858	五粮液	2023年1月3日-2023年1月5日	180.69	54,600.00	9,865,674.00
27	300015	爱尔眼科	2023年1月3日-2023年1月13日	31.07	296,200.00	9,202,934.00
28	600010	包钢股份	2023年1月3日-2023年1月5日	1.92	4,737,100.00	9,095,232.00
29	600115	中国东航	2023年1月3日-2023年1月11日	5.53	1,612,300.00	8,916,019.00
30	601111	中国国航	2023年1月3日-2023年1月5日	10.60	833,700.00	8,837,220.00
31	688008	澜起科技	2023年1月3日-2023年1月11日	62.60	134,700.00	8,432,220.00
32	002466	天齐锂业	2023年1月3日-2023年1月5日	78.99	105,900.00	8,365,041.00
33	300207	欣旺达	2023年1月3日-2023年1月12日	21.15	391,500.00	8,280,225.00
34	300496	中科创达	2023年1月3日-2023年1月10日	100.30	80,900.00	8,114,270.00
35	300661	圣邦股份	2023年1月5日-2023年1月12日	172.60	46,800.00	8,077,680.00
36	002812	恩捷股份	2023年1月3日-2023年1月10日	131.29	60,000.00	7,877,400.00
37	601633	长城汽车	2023年1月3日-2023年1月12日	29.62	258,800.00	7,665,656.00
38	300760	迈瑞医疗	2023年1月3日-2023年1月30日	315.97	24,100.00	7,614,877.00
39	300763	锦浪科技	2023年1月3日-2023年1月5日	180.05	41,100.00	7,400,055.00
40	000301	东方盛虹	2023年1月3日-2023年	13.04	553,100.00	7,212,424.00

			1月12日			
41	600031	三一重工	2023年1月3日-2023年1月4日	15.80	444,700.00	7,026,260.00
42	601021	春秋航空	2023年1月3日-2023年1月30日	64.25	107,800.00	6,926,150.00
43	300759	康龙化成	2023年1月3日-2023年1月12日	68.00	101,200.00	6,881,600.00
44	603019	中科曙光	2023年1月3日-2023年1月12日	22.14	310,100.00	6,865,614.00
45	000568	泸州老窖	2023年1月3日-2023年1月12日	224.28	30,000.00	6,728,400.00
46	002460	赣锋锂业	2023年1月3日-2023年1月12日	69.51	91,700.00	6,374,067.00
47	600132	重庆啤酒	2023年1月4日-2023年1月12日	127.38	50,000.00	6,369,000.00
48	600763	通策医疗	2023年1月3日-2023年1月17日	152.99	41,000.00	6,272,590.00
49	002841	视源股份	2023年1月3日-2023年1月12日	59.04	105,000.00	6,199,200.00
50	601100	恒立液压	2023年1月3日-2023年1月11日	63.15	97,000.00	6,125,550.00
51	002821	凯莱英	2023年1月4日-2023年1月4日	148.00	40,000.00	5,920,000.00
52	600085	同仁堂	2023年1月4日-2023年1月18日	44.68	131,000.00	5,853,080.00
53	600436	片仔癀	2023年1月5日-2023年1月12日	288.46	20,000.00	5,769,200.00
54	300014	亿纬锂能	2023年1月3日-2023年1月5日	87.90	63,900.00	5,616,810.00
55	603899	晨光股份	2023年1月3日-2023年1月12日	54.98	102,000.00	5,607,960.00
56	601012	隆基绿能	2023年1月5日-2023年1月19日	42.26	131,800.00	5,569,868.00
57	300782	卓胜微	2023年1月3日-2023年	114.30	48,100.00	5,497,830.00

			1月4日			
58	603659	璞泰来	2023年1月3日-2023年1月11日	51.89	105,600.00	5,479,584.00
59	002352	顺丰控股	2023年1月3日-2023年1月10日	57.76	92,000.00	5,313,920.00
60	300142	沃森生物	2023年1月3日-2023年1月12日	40.19	129,800.00	5,216,662.00
61	002594	比亚迪	2023年1月3日-2023年1月12日	256.97	20,000.00	5,139,400.00
62	603806	福斯特	2023年1月3日-2023年1月11日	66.44	77,100.00	5,122,524.00
63	300124	汇川技术	2023年1月3日-2023年1月19日	69.50	72,500.00	5,038,750.00
64	600188	兖矿能源	2023年1月3日-2023年1月12日	33.58	144,200.00	4,842,236.00
65	688111	金山办公	2023年1月12日-2023年1月12日	264.49	17,700.00	4,681,473.00
66	601155	新城控股	2023年1月3日-2023年1月12日	20.50	228,200.00	4,678,100.00
67	002415	海康威视	2023年1月3日-2023年1月12日	34.68	134,500.00	4,664,460.00
68	002371	北方华创	2023年1月3日-2023年1月12日	225.30	20,000.00	4,506,000.00
69	300595	欧普康视	2023年1月3日-2023年1月5日	35.70	124,700.00	4,451,790.00
70	600276	恒瑞医药	2023年1月4日-2023年1月12日	38.53	115,000.00	4,430,950.00
71	603185	上机数控	2023年1月3日-2023年1月5日	105.85	41,600.00	4,403,360.00
72	300628	亿联网络	2023年1月3日-2023年1月5日	60.59	72,400.00	4,386,716.00
73	600795	国电电力	2023年1月3日-2023年1月4日	4.27	1,025,500.00	4,378,885.00
74	002120	韵达股份	2023年1月	14.38	304,000.00	4,371,520.00

			3 日-2023 年 1 月 12 日			
75	601865	福莱特	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 11 日	33.31	129,900.00	4,326,969.00
76	600346	恒力石化	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	15.53	275,100.00	4,272,303.00
77	603993	洛阳钼业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	4.55	935,000.00	4,254,250.00
78	002714	牧原股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	48.75	87,200.00	4,251,000.00
79	002007	华兰生物	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	22.63	183,100.00	4,143,553.00
80	300454	深信服	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	112.55	36,700.00	4,130,585.00
81	601899	紫金矿业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 17 日	10.00	406,700.00	4,067,000.00
82	002709	天赐材料	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	43.86	91,500.00	4,013,190.00
83	603260	合盛硅业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 10 日	82.94	48,300.00	4,006,002.00
84	300957	贝泰妮	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 10 日	149.24	26,800.00	3,999,632.00
85	600111	北方稀土	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	25.05	158,200.00	3,962,910.00
86	601225	陕西煤业	2023 年 1 月 10 日-2023 年 1 月 19 日	18.58	210,000.00	3,901,800.00
87	603833	欧派家居	2023 年 1 月 11 日-2023 年 1 月 19 日	121.53	30,000.00	3,645,900.00
88	600919	江苏银行	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 5 日	7.29	500,000.00	3,645,000.00
89	600570	恒生电子	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	40.46	88,200.00	3,568,572.00
90	002241	歌尔股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年	16.83	210,900.00	3,549,447.00

			1月12日			
91	600009	上海机场	2023年1月3日-2023年1月11日	57.71	60,400.00	3,485,684.00
92	000876	新希望	2023年1月3日-2023年1月12日	12.91	265,900.00	3,432,769.00
93	601800	中国交建	2023年1月4日-2023年1月5日	8.05	423,000.00	3,405,150.00
94	000977	浪潮信息	2023年1月3日-2023年1月11日	21.52	154,500.00	3,324,840.00
95	601868	中国能建	2023年1月3日-2023年1月12日	2.29	1,449,400.00	3,319,126.00
96	002600	领益智造	2023年1月3日-2023年1月12日	4.54	717,000.00	3,255,180.00
97	002008	大族激光	2023年1月3日-2023年1月10日	25.65	125,200.00	3,211,380.00
98	603288	海天味业	2023年1月3日-2023年1月19日	79.60	40,300.00	3,207,880.00
99	600383	金地集团	2023年1月3日-2023年1月11日	10.23	289,400.00	2,960,562.00
100	601628	中国人寿	2023年1月3日-2023年1月30日	37.12	75,000.00	2,784,000.00
101	600362	江西铜业	2023年1月3日-2023年1月12日	17.43	157,000.00	2,736,510.00
102	000596	古井贡酒	2023年1月5日-2023年1月5日	266.90	10,000.00	2,669,000.00
103	600760	中航沈飞	2023年1月10日-2023年1月10日	58.63	45,500.00	2,667,665.00
104	601788	光大证券	2023年1月3日-2023年1月10日	14.87	176,000.00	2,617,120.00
105	600089	特变电工	2023年1月3日-2023年1月10日	20.08	128,600.00	2,582,288.00
106	000338	潍柴动力	2023年1月3日-2023年1月10日	10.18	249,100.00	2,535,838.00
107	600606	绿地控股	2023年1月	2.98	848,100.00	2,527,338.00

			3 日-2023 年 1 月 19 日			
108	000069	华侨城 A	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	5.33	463,600.00	2,470,988.00
109	000408	藏格矿业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	25.97	93,000.00	2,415,210.00
110	603799	华友钴业	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	55.63	43,400.00	2,414,342.00
111	300033	同花顺	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 12 日	98.61	24,100.00	2,376,501.00
112	601898	中煤能源	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	8.62	274,000.00	2,361,880.00
113	600332	白云山	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	29.79	75,700.00	2,255,103.00
114	002074	国轩高科	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 10 日	28.83	77,000.00	2,219,910.00
115	002202	金风科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	11.00	201,300.00	2,214,300.00
116	600030	中信证券	2023 年 1 月 12 日-2023 年 1 月 12 日	19.91	111,000.00	2,210,010.00
117	601728	中国电信	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	4.19	524,100.00	2,195,979.00
118	600588	用友网络	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	24.17	89,300.00	2,158,381.00
119	002414	高德红外	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	11.00	194,200.00	2,136,200.00
120	601600	中国铝业	2023 年 1 月 10 日-2023 年 1 月 11 日	4.47	471,800.00	2,108,946.00
121	000963	华东医药	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	46.80	41,300.00	1,932,840.00
122	300979	华利集团	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	57.11	33,500.00	1,913,185.00
123	600900	长江电力	2023 年 1 月 5 日-2023 年	21.00	89,700.00	1,883,700.00

			1月5日			
124	688363	华熙生物	2023年1月3日-2023年1月3日	135.28	13,500.00	1,826,280.00
125	601238	广汽集团	2023年1月5日-2023年1月5日	11.03	164,700.00	1,816,641.00
126	300919	中伟股份	2023年1月3日-2023年1月11日	65.61	27,400.00	1,797,714.00
127	002756	永兴材料	2023年1月4日-2023年1月4日	92.17	19,400.00	1,788,098.00
128	605499	东鹏饮料	2023年1月5日-2023年1月5日	177.90	10,000.00	1,779,000.00
129	002142	宁波银行	2023年1月3日-2023年1月4日	32.45	54,600.00	1,771,770.00
130	601336	新华保险	2023年1月4日-2023年1月11日	30.08	58,800.00	1,768,704.00
131	600989	宝丰能源	2023年1月3日-2023年1月10日	12.07	145,000.00	1,750,150.00
132	002027	分众传媒	2023年1月5日-2023年1月12日	6.68	260,800.00	1,742,144.00
133	000661	长春高新	2023年1月3日-2023年1月3日	166.45	10,200.00	1,697,790.00
134	600150	中国船舶	2023年1月3日-2023年1月17日	22.28	75,000.00	1,671,000.00
135	600219	南山铝业	2023年1月4日-2023年1月11日	3.27	510,000.00	1,667,700.00
136	600547	山东黄金	2023年1月3日-2023年1月11日	19.16	85,000.00	1,628,600.00
137	601006	大秦铁路	2023年1月3日-2023年1月5日	6.68	235,000.00	1,569,800.00
138	601236	红塔证券	2023年1月3日-2023年1月11日	7.40	209,900.00	1,553,260.00
139	300999	金龙鱼	2023年1月4日-2023年1月10日	43.56	35,200.00	1,533,312.00
140	603486	科沃斯	2023年1月3日-2023年	72.94	21,000.00	1,531,740.00

			1月12日			
141	002475	立讯精密	2023年1月3日-2023年1月12日	31.75	48,200.00	1,530,350.00
142	300408	三环集团	2023年1月3日-2023年1月5日	30.71	49,800.00	1,529,358.00
143	300751	迈为股份	2023年1月3日-2023年1月5日	411.84	3,700.00	1,523,808.00
144	601658	邮储银行	2023年1月3日-2023年1月3日	4.62	329,000.00	1,519,980.00
145	600660	福耀玻璃	2023年1月3日-2023年1月3日	35.07	42,600.00	1,493,982.00
146	002032	苏泊尔	2023年1月3日-2023年1月11日	49.46	30,100.00	1,488,746.00
147	000776	广发证券	2023年1月4日-2023年1月17日	15.49	93,900.00	1,454,511.00
148	688012	中微公司	2023年1月5日-2023年1月12日	98.01	14,800.00	1,450,548.00
149	000895	双汇发展	2023年1月4日-2023年1月12日	25.93	55,900.00	1,449,487.00
150	000723	美锦能源	2023年1月3日-2023年1月12日	9.02	160,600.00	1,448,612.00
151	603195	公牛集团	2023年1月4日-2023年1月4日	143.26	10,000.00	1,432,600.00
152	600018	上港集团	2023年1月3日-2023年1月5日	5.34	261,000.00	1,393,740.00
153	600585	海螺水泥	2023年1月3日-2023年1月11日	27.38	50,600.00	1,385,428.00
154	600958	东方证券	2023年1月4日-2023年1月12日	8.94	153,200.00	1,369,608.00
155	600941	中国移动	2023年1月4日-2023年1月4日	67.67	20,000.00	1,353,400.00
156	601117	中国化学	2023年1月3日-2023年1月12日	7.94	169,000.00	1,341,860.00
157	300316	晶盛机电	2023年1月3日-2023年	63.56	20,500.00	1,302,980.00

			1月5日			
158	000768	中航西飞	2023年1月3日-2023年1月4日	25.45	50,900.00	1,295,405.00
159	002050	三花智控	2023年1月3日-2023年1月17日	21.22	60,600.00	1,285,932.00
160	601799	星宇股份	2023年1月10日-2023年1月10日	127.37	10,000.00	1,273,700.00
161	603392	万泰生物	2023年1月5日-2023年1月5日	126.70	10,000.00	1,267,000.00
162	002311	海大集团	2023年1月4日-2023年1月5日	61.73	20,000.00	1,234,600.00
163	000800	一汽解放	2023年1月3日-2023年1月12日	7.73	153,500.00	1,186,555.00
164	601618	中国中冶	2023年1月3日-2023年1月5日	3.18	368,100.00	1,170,558.00
165	600011	华能国际	2023年1月4日-2023年1月10日	7.61	151,000.00	1,149,110.00
166	002648	卫星化学	2023年1月3日-2023年1月10日	15.50	73,500.00	1,139,250.00
167	001979	招商蛇口	2023年1月3日-2023年1月18日	12.63	88,600.00	1,119,018.00
168	600048	保利发展	2023年1月3日-2023年1月11日	15.13	73,400.00	1,110,542.00
169	300529	健帆生物	2023年1月3日-2023年1月13日	30.97	35,600.00	1,102,532.00
170	600674	川投能源	2023年1月4日-2023年1月4日	12.23	90,000.00	1,100,700.00
171	600600	青岛啤酒	2023年1月3日-2023年1月3日	107.50	10,000.00	1,075,000.00
172	601985	中国核电	2023年1月4日-2023年1月4日	6.00	177,900.00	1,067,400.00
173	600016	民生银行	2023年1月3日-2023年1月12日	3.45	308,700.00	1,065,015.00
174	600460	士兰微	2023年1月	32.79	32,000.00	1,049,280.00

			4日-2023年 1月5日			
175	600104	上汽集团	2023年1月 3日-2023年 1月19日	14.41	72,300.00	1,041,843.00
176	601881	中国银河	2023年1月 3日-2023年 1月3日	9.29	112,000.00	1,040,480.00
177	000333	美的集团	2023年1月 4日-2023年 1月17日	51.80	20,000.00	1,036,000.00
178	600690	海尔智家	2023年1月 5日-2023年 1月12日	24.46	42,000.00	1,027,320.00
179	002001	新和成	2023年1月 4日-2023年 1月12日	18.75	51,800.00	971,250.00
180	000001	平安银行	2023年1月 3日-2023年 1月19日	13.16	73,700.00	969,892.00
181	601816	京沪高铁	2023年1月 3日-2023年 1月5日	4.92	185,700.00	913,644.00
182	000708	中信特钢	2023年1月 3日-2023年 1月10日	17.16	51,000.00	875,160.00
183	600426	华鲁恒升	2023年1月 10日-2023 年1月10 日	33.15	26,000.00	861,900.00
184	000166	申万宏源	2023年1月 4日-2023年 1月5日	3.98	205,700.00	818,686.00
185	300601	康泰生物	2023年1月 3日-2023年 1月12日	31.53	25,300.00	797,709.00
186	000425	徐工机械	2023年1月 3日-2023年 1月3日	5.07	157,000.00	795,990.00
187	000063	中兴通讯	2023年1月 3日-2023年 1月3日	25.86	28,000.00	724,080.00
188	002601	龙佰集团	2023年1月 4日-2023年 1月10日	18.92	37,700.00	713,284.00
189	000651	格力电器	2023年1月 4日-2023年 1月4日	32.32	22,000.00	711,040.00
190	601319	中国人保	2023年1月 3日-2023年 1月3日	5.22	134,000.00	699,480.00

191	600584	长电科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	23.05	28,000.00	645,400.00
192	002493	荣盛石化	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	12.30	51,100.00	628,530.00
193	601698	中国卫通	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 4 日	11.42	54,000.00	616,680.00
194	601766	中国中车	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 12 日	5.11	117,200.00	598,892.00
195	601088	中国神华	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	27.62	20,000.00	552,400.00
196	300413	芒果超媒	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	30.02	18,200.00	546,364.00
197	601808	中海油服	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 5 日	16.58	31,000.00	513,980.00
198	603369	今世缘	2023 年 1 月 11 日-2023 年 1 月 11 日	50.90	10,000.00	509,000.00
199	601318	中国平安	2023 年 1 月 11 日-2023 年 1 月 11 日	47.00	10,000.00	470,000.00
200	300769	德方纳米	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	229.59	2,000.00	459,180.00
201	601066	中信建投	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	23.75	19,000.00	451,250.00
202	600905	三峡能源	2023 年 1 月 12 日-2023 年 1 月 12 日	5.65	78,500.00	443,525.00
203	002252	上海莱士	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 11 日	6.34	65,700.00	416,538.00
204	600837	海通证券	2023 年 1 月 12 日-2023 年 1 月 12 日	8.69	47,400.00	411,906.00
205	601966	玲珑轮胎	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	20.48	20,000.00	409,600.00
206	601995	中金公司	2023 年 1 月 3 日-2023 年	38.13	10,000.00	381,300.00

			1月3日			
207	601138	工业富联	2023年1月3日-2023年1月3日	9.18	40,000.00	367,200.00
208	001289	龙源电力	2023年1月4日-2023年1月4日	18.27	20,000.00	365,400.00
209	600887	伊利股份	2023年1月4日-2023年1月4日	31.00	10,000.00	310,000.00
210	002938	鹏鼎控股	2023年1月12日-2023年1月12日	27.44	11,000.00	301,840.00
211	601877	正泰电器	2023年1月4日-2023年1月4日	27.70	10,000.00	277,000.00
212	688005	容百科技	2023年1月3日-2023年1月3日	68.75	4,000.00	275,000.00
213	000938	紫光股份	2023年1月11日-2023年1月11日	19.51	14,000.00	273,140.00
214	601901	方正证券	2023年1月11日-2023年1月11日	6.38	42,200.00	269,236.00
215	601216	君正集团	2023年1月3日-2023年1月3日	3.99	66,400.00	264,936.00
216	601615	明阳智能	2023年1月3日-2023年1月3日	25.26	10,000.00	252,600.00
217	002736	国信证券	2023年1月5日-2023年1月5日	8.88	28,300.00	251,304.00
218	601878	浙商证券	2023年1月3日-2023年1月5日	9.93	21,800.00	216,474.00
219	002602	世纪华通	2023年1月3日-2023年1月12日	3.81	55,400.00	211,074.00
220	000157	中联重科	2023年1月4日-2023年1月4日	5.44	34,100.00	185,504.00
221	600884	杉杉股份	2023年1月3日-2023年1月3日	18.20	10,000.00	182,000.00
222	002555	三七互娱	2023年1月12日-2023	18.10	10,000.00	181,000.00

			年 1 月 12 日			
223	601186	中国铁建	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	7.73	20,000.00	154,600.00
224	000877	天山股份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	8.52	17,500.00	149,100.00
225	601390	中国中铁	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	5.56	24,300.00	135,108.00
226	003816	中国广核	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 4 日	2.69	39,000.00	104,910.00
227	601919	中远海控	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	10.29	10,000.00	102,900.00
228	300433	蓝思科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	10.53	9,000.00	94,770.00
229	601360	三六零	2023 年 1 月 10 日-2023 年 1 月 10 日	6.54	11,900.00	77,826.00
230	300223	北京君正	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 3 日	70.44	1,000.00	70,440.00
231	688396	华润微	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 5 日	52.65	1,000.00	52,650.00
232	600015	华夏银行	2023 年 1 月 10 日-2023 年 1 月 10 日	5.19	10,000.00	51,900.00
233	601398	工商银行	2023 年 1 月 10 日-2023 年 1 月 10 日	4.34	10,000.00	43,400.00
合计					58,910,900.00	944,921,414.00

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內。

#### 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	24,741,873,810.09	99.33	28,697,060,869.42	99.27
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	24,741,873,810.09	99.33	28,697,060,869.42	99.27

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

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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%	-1,227,795,000.28	-1,421,312,479.96
	+5%	1,227,795,000.28	1,421,312,479.96

#### 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	24,734,863,833.63	28,638,531,609.39
第二层次	385,863.40	58,529,260.03
第三层次	6,624,113.06	-
合计	24,741,873,810.09	28,697,060,869.42

###### 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	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	6,194,048.38	6,194,048.38
转出第三层次	-	-	-

当期利得或损失总额	-	430,064.68	430,064.68
其中：计入损益的利得或损失	-	430,064.68	430,064.68
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,624,113.06	6,624,113.06
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	-	430,064.68	430,064.68

## 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	6,624,113.06	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	24,741,873,810.09	98.30
	其中：股票	24,741,873,810.09	98.30
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	199,369,732.61	0.79
8	其他各项资产	229,160,729.85	0.91
9	合计	25,170,404,272.55	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 944,921,414.00 元, 占本基金期末资产净值的 3.79%。

## 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	308,499,026.81	1.24
B	采矿业	712,406,220.86	2.86
C	制造业	14,103,730,626.37	56.62
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	690,253,978.29	2.77
E	建筑业	535,219,548.84	2.15
F	批发和零售业	54,637,034.40	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	829,068,675.98	3.33
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	954,981,584.63	3.83
J	金融业	5,136,477,514.14	20.62
K	房地产业	456,881,982.59	1.83
L	租赁和商务服务业	369,708,795.68	1.48
M	科学研究和技术服务业	338,181,592.95	1.36
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	222,205,709.21	0.89
R	文化、体育和娱乐业	29,621,244.34	0.12
S	综合	-	-
	合计	24,741,873,535.09	99.33

### 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	600519	贵州茅台	830,350	1,434,014,450.00	5.76
2	300750	宁德时代	1,946,355	765,734,984.10	3.07
3	601318	中国平安	14,368,916	675,339,052.00	2.71
4	600036	招商银行	16,420,347	611,822,129.22	2.46
5	000858	五粮液	2,577,921	465,804,545.49	1.87
6	601012	隆基绿能	8,049,668	340,178,969.68	1.37
7	601166	兴业银行	19,289,370	339,300,018.30	1.36
8	000333	美的集团	6,503,303	336,871,095.40	1.35

9	600900	长江电力	15,084,463	316,773,723.00	1.27
10	002594	比亚迪	1,205,892	309,878,067.24	1.24
11	601888	中国中免	1,296,500	280,082,895.00	1.12
12	300059	东方财富	14,030,993	272,201,264.20	1.09
13	600887	伊利股份	8,484,196	263,010,076.00	1.06
14	600030	中信证券	12,947,625	257,787,213.75	1.03
15	600309	万华化学	2,503,846	231,981,331.90	0.93
16	600276	恒瑞医药	5,928,372	228,420,173.16	0.92
17	603259	药明康德	2,722,745	220,542,345.00	0.89
18	000568	泸州老窖	970,629	217,692,672.12	0.87
19	002415	海康威视	6,255,300	216,933,804.00	0.87
20	002475	立讯精密	6,597,001	209,454,781.75	0.84
21	300760	迈瑞医疗	644,145	203,530,495.65	0.82
22	601398	工商银行	46,498,739	201,804,527.26	0.81
23	000651	格力电器	5,980,181	193,279,449.92	0.78
24	601899	紫金矿业	19,123,742	191,237,420.00	0.77
25	002352	顺丰控股	3,250,427	187,744,663.52	0.75
26	600809	山西汾酒	648,143	184,714,273.57	0.74
27	601328	交通银行	36,446,567	172,756,727.58	0.69
28	002714	牧原股份	3,528,137	171,996,678.75	0.69
29	300124	汇川技术	2,473,973	171,941,123.50	0.69
30	002142	宁波银行	5,260,545	170,704,685.25	0.69
31	000001	平安银行	12,874,777	169,432,065.32	0.68
32	000725	京东方 A	49,757,400	168,180,012.00	0.68
33	000002	万科 A	9,027,690	164,303,958.00	0.66
34	000792	盐湖股份	7,213,682	163,678,444.58	0.66
35	601816	京沪高铁	32,573,729	160,262,746.68	0.64
36	300274	阳光电源	1,378,994	154,171,529.20	0.62
37	601668	中国建筑	27,820,522	151,065,434.46	0.61
38	300015	爱尔眼科	4,760,901	147,921,194.07	0.59
39	603288	海天味业	1,848,282	147,123,247.20	0.59
40	600048	保利发展	9,529,293	144,178,203.09	0.58
41	300014	亿纬锂能	1,620,228	142,418,041.20	0.57
42	600438	通威股份	3,580,117	138,120,913.86	0.55
43	300498	温氏股份	6,953,762	136,502,348.06	0.55
44	002129	TCL 中环	3,429,713	129,162,991.58	0.52
45	002304	洋河股份	797,452	127,991,046.00	0.51
46	600031	三一重工	7,880,268	124,508,234.40	0.50
47	601288	农业银行	42,366,825	123,287,460.75	0.49
48	600690	海尔智家	5,017,033	122,716,627.18	0.49
49	601088	中国神华	4,370,268	120,706,802.16	0.48
50	002049	紫光国微	897,455	118,302,518.10	0.47
51	600436	片仔癀	405,716	117,032,837.36	0.47
52	600919	江苏银行	15,676,445	114,281,284.05	0.46
53	600016	民生银行	32,930,053	113,608,682.85	0.46
54	600000	浦发银行	15,579,001	113,415,127.28	0.46
55	600050	中国联通	25,315,800	113,414,784.00	0.46
56	601601	中国太保	4,544,624	111,434,180.48	0.45
57	600837	海通证券	12,810,069	111,319,499.61	0.45
58	000063	中兴通讯	4,222,382	109,190,798.52	0.44

59	002466	天齐锂业	1,371,673	108,348,450.27	0.43
60	600406	国电南瑞	4,433,917	108,187,574.80	0.43
61	688981	中芯国际	2,599,491	106,943,059.74	0.43
62	002460	赣锋锂业	1,494,667	103,894,303.17	0.42
63	600089	特变电工	5,143,213	103,275,717.04	0.41
64	601225	陕西煤业	5,137,829	95,460,862.82	0.38
65	603799	华友钴业	1,702,887	94,731,603.81	0.38
66	300122	智飞生物	1,067,324	93,743,066.92	0.38
67	002812	恩捷股份	709,876	93,199,620.04	0.37
68	688599	天合光能	1,437,585	91,660,419.60	0.37
69	603986	兆易创新	881,042	90,280,373.74	0.36
70	002271	东方雨虹	2,674,120	89,770,208.40	0.36
71	002027	分众传媒	13,417,051	89,625,900.68	0.36
72	600104	上汽集团	6,199,036	89,328,108.76	0.36
73	601988	中国银行	27,938,152	88,284,560.32	0.35
74	600585	海螺水泥	3,188,333	87,296,557.54	0.35
75	601919	中远海控	8,459,252	87,045,703.08	0.35
76	601688	华泰证券	6,830,866	87,025,232.84	0.35
77	601728	中国电信	20,595,921	86,296,908.99	0.35
78	300142	沃森生物	2,123,260	85,333,819.40	0.34
79	601169	北京银行	19,638,397	84,641,491.07	0.34
80	601766	中国中车	16,142,601	82,488,691.11	0.33
81	601628	中国人寿	2,206,665	81,911,404.80	0.33
82	600570	恒生电子	2,017,152	81,613,969.92	0.33
83	601211	国泰君安	5,984,262	81,326,120.58	0.33
84	000625	长安汽车	6,595,802	81,194,322.62	0.33
85	002230	科大讯飞	2,471,441	81,137,408.03	0.33
86	002371	北方华创	357,094	80,453,278.20	0.32
87	300896	爱美客	140,681	79,674,684.35	0.32
88	601229	上海银行	13,189,200	77,948,172.00	0.31
89	600028	中国石化	17,748,737	77,384,493.32	0.31
90	600009	上海机场	1,321,426	76,259,494.46	0.31
91	002410	广联达	1,266,411	75,921,339.45	0.30
92	601390	中国中铁	13,629,809	75,781,738.04	0.30
93	002459	晶澳科技	1,252,180	75,243,496.20	0.30
94	601985	中国核电	12,500,207	75,001,242.00	0.30
95	600893	航发动力	1,773,682	74,991,274.96	0.30
96	600660	福耀玻璃	2,124,416	74,503,269.12	0.30
97	000338	潍柴动力	7,192,433	73,218,967.94	0.29
98	300347	泰格医药	695,577	72,896,469.60	0.29
99	600111	北方稀土	2,888,851	72,365,717.55	0.29
100	000661	长春高新	434,463	72,316,366.35	0.29
101	603501	韦尔股份	937,678	72,285,597.02	0.29
102	601009	南京银行	6,836,108	71,232,245.36	0.29
103	601669	中国电建	10,050,880	71,160,230.40	0.29
104	002311	海大集团	1,107,027	68,336,776.71	0.27
105	000100	TCL 科技	18,125,466	67,426,733.52	0.27
106	601818	光大银行	21,956,682	67,407,013.74	0.27
107	002709	天赐材料	1,530,400	67,123,344.00	0.27
108	601658	邮储银行	14,431,479	66,673,432.98	0.27

109	688008	澜起科技	1,058,904	66,287,390.40	0.27
110	600588	用友网络	2,733,207	66,061,613.19	0.27
111	600019	宝钢股份	11,813,097	66,035,212.23	0.27
112	600999	招商证券	4,919,828	65,433,712.40	0.26
113	600426	华鲁恒升	1,973,388	65,417,812.20	0.26
114	600905	三峡能源	11,395,063	64,382,105.95	0.26
115	601857	中国石油	12,890,902	64,067,782.94	0.26
116	688111	金山办公	239,992	63,475,484.08	0.25
117	600958	东方证券	6,933,731	61,987,555.14	0.25
118	600760	中航沈飞	1,046,761	61,371,597.43	0.25
119	002179	中航光电	1,060,569	61,258,465.44	0.25
120	000776	广发证券	3,929,814	60,872,818.86	0.24
121	002050	三花智控	2,855,924	60,602,707.28	0.24
122	600196	复星医药	1,679,477	59,184,769.48	0.24
123	002180	纳思达	1,131,800	58,729,102.00	0.24
124	300450	先导智能	1,452,792	58,474,878.00	0.23
125	300661	圣邦股份	337,600	58,269,760.00	0.23
126	600010	包钢股份	30,234,925	58,051,056.00	0.23
127	000596	古井贡酒	212,609	56,745,342.10	0.23
128	000733	振华科技	485,079	55,410,574.17	0.22
129	688012	中微公司	561,150	54,998,311.50	0.22
130	300316	晶盛机电	864,100	54,922,196.00	0.22
131	300408	三环集团	1,785,094	54,820,236.74	0.22
132	000963	华东医药	1,167,458	54,637,034.40	0.22
133	600029	南方航空	7,145,544	54,306,134.40	0.22
134	002241	歌尔股份	3,177,387	53,475,423.21	0.21
135	601615	明阳智能	2,108,900	53,270,814.00	0.21
136	601989	中国重工	15,123,664	52,781,587.36	0.21
137	601006	大秦铁路	7,895,500	52,741,940.00	0.21
138	600150	中国船舶	2,367,091	52,738,787.48	0.21
139	601377	兴业证券	9,172,153	52,648,158.22	0.21
140	001979	招商蛇口	4,106,759	51,868,366.17	0.21
141	000938	紫光股份	2,657,554	51,848,878.54	0.21
142	600745	闻泰科技	986,081	51,848,138.98	0.21
143	000538	云南白药	947,954	51,530,779.44	0.21
144	600926	杭州银行	3,937,040	51,496,483.20	0.21
145	600600	青岛啤酒	474,536	51,012,620.00	0.20
146	600795	国电电力	11,826,885	50,500,798.95	0.20
147	601939	建设银行	8,908,885	50,157,022.55	0.20
148	002493	荣盛石化	4,031,356	49,585,678.80	0.20
149	300782	卓胜微	429,857	49,132,655.10	0.20
150	600941	中国移动	717,916	48,581,375.72	0.20
151	601138	工业富联	5,273,664	48,412,235.52	0.19
152	601633	长城汽车	1,631,351	48,320,616.62	0.19
153	603659	璞泰来	917,910	47,630,349.90	0.19
154	000166	申万宏源	11,965,812	47,623,931.76	0.19
155	601186	中国铁建	6,105,324	47,194,154.52	0.19
156	603806	福斯特	706,153	46,916,805.32	0.19
157	601600	中国铝业	10,492,246	46,900,339.62	0.19
158	000768	中航西飞	1,840,707	46,845,993.15	0.19

159	300751	迈为股份	112,499	46,331,588.16	0.19
160	002001	新和成	2,465,661	46,231,143.75	0.19
161	600547	山东黄金	2,404,081	46,062,191.96	0.18
162	600233	圆通速递	2,277,800	45,761,002.00	0.18
163	601838	成都银行	2,928,959	44,813,072.70	0.18
164	300759	康龙化成	657,209	44,690,212.00	0.18
165	600763	通策医疗	291,926	44,661,758.74	0.18
166	601995	中金公司	1,167,338	44,510,597.94	0.18
167	600011	华能国际	5,842,269	44,459,667.09	0.18
168	300763	锦浪科技	245,348	44,174,907.40	0.18
169	600015	华夏银行	8,440,762	43,807,554.78	0.18
170	600176	中国巨石	3,190,961	43,748,075.31	0.18
171	601100	恒立液压	692,555	43,734,848.25	0.18
172	600584	长电科技	1,891,895	43,608,179.75	0.18
173	600346	恒力石化	2,800,226	43,487,509.78	0.17
174	300496	中科创达	429,800	43,108,940.00	0.17
175	600383	金地集团	4,190,754	42,871,413.42	0.17
176	600886	国投电力	3,958,500	42,870,555.00	0.17
177	603993	洛阳钼业	9,376,980	42,665,259.00	0.17
178	603369	今世缘	829,268	42,209,741.20	0.17
179	601111	中国国航	3,967,571	42,056,252.60	0.17
180	600132	重庆啤酒	328,100	41,793,378.00	0.17
181	605117	德业股份	124,300	41,168,160.00	0.17
182	601066	中信建投	1,728,099	41,042,351.25	0.16
183	600188	兖矿能源	1,216,409	40,847,014.22	0.16
184	002074	国轩高科	1,415,068	40,796,410.44	0.16
185	600085	同仁堂	905,376	40,452,199.68	0.16
186	002202	金风科技	3,658,439	40,242,829.00	0.16
187	600115	中国东航	7,260,428	40,150,166.84	0.16
188	000425	徐工机械	7,831,812	39,707,286.84	0.16
189	002252	上海莱士	6,257,802	39,674,464.68	0.16
190	002821	凯莱英	267,321	39,563,508.00	0.16
191	601877	正泰电器	1,424,970	39,471,669.00	0.16
192	002920	德赛西威	374,455	39,445,089.70	0.16
193	601868	中国能建	17,206,500	39,402,885.00	0.16
194	000876	新希望	3,005,311	38,798,565.01	0.16
195	601117	中国化学	4,861,618	38,601,246.92	0.15
196	601788	光大证券	2,593,864	38,570,757.68	0.15
197	300454	深信服	337,714	38,009,710.70	0.15
198	601800	中国交建	4,677,564	37,654,390.20	0.15
199	688396	华润微	713,497	37,565,617.05	0.15
200	600460	士兰微	1,131,888	37,114,607.52	0.15
201	300207	欣旺达	1,722,500	36,430,875.00	0.15
202	300769	德方纳米	158,240	36,330,321.60	0.15
203	600741	华域汽车	2,090,517	36,228,659.61	0.15
204	002601	龙佰集团	1,905,399	36,050,149.08	0.14
205	000157	中联重科	6,594,608	35,874,667.52	0.14
206	000895	双汇发展	1,378,740	35,750,728.20	0.14
207	600989	宝丰能源	2,915,052	35,184,677.64	0.14
208	600845	宝信软件	779,835	34,936,608.00	0.14

209	601901	方正证券	5,460,000	34,834,800.00	0.14
210	000786	北新建材	1,345,260	34,815,328.80	0.14
211	002648	卫星化学	2,231,133	34,582,561.50	0.14
212	300999	金龙鱼	789,100	34,373,196.00	0.14
213	601689	拓普集团	586,700	34,368,886.00	0.14
214	603019	中科曙光	1,550,194	34,321,295.16	0.14
215	002736	国信证券	3,831,148	34,020,594.24	0.14
216	601021	春秋航空	522,456	33,567,798.00	0.13
217	601336	新华保险	1,111,569	33,435,995.52	0.13
218	688036	传音控股	418,328	33,265,442.56	0.13
219	002007	华兰生物	1,450,540	32,825,720.20	0.13
220	000301	东方盛虹	2,477,986	32,312,937.44	0.13
221	601238	广汽集团	2,927,560	32,290,986.80	0.13
222	002555	三七互娱	1,770,932	32,053,869.20	0.13
223	000723	美锦能源	3,443,333	31,058,863.66	0.12
224	600219	南山铝业	9,322,050	30,483,103.50	0.12
225	601618	中国中冶	9,462,300	30,090,114.00	0.12
226	603392	万泰生物	235,697	29,862,809.90	0.12
227	300413	芒果超媒	986,717	29,621,244.34	0.12
228	603882	金域医学	377,956	29,556,159.20	0.12
229	000977	浪潮信息	1,359,445	29,255,256.40	0.12
230	603290	斯达半导	88,800	29,241,840.00	0.12
231	300628	亿联网络	482,456	29,232,009.04	0.12
232	000069	华侨城 A	5,441,027	29,000,673.91	0.12
233	600674	川投能源	2,367,500	28,954,525.00	0.12
234	603833	欧派家居	237,713	28,889,260.89	0.12
235	002008	大族激光	1,121,448	28,765,141.20	0.12
236	603185	上机数控	267,194	28,282,484.90	0.11
237	003816	中国广核	10,446,600	28,101,354.00	0.11
238	300601	康泰生物	887,814	27,992,775.42	0.11
239	300433	蓝思科技	2,641,115	27,810,940.95	0.11
240	002120	韵达股份	1,927,653	27,719,650.14	0.11
241	600332	白云山	927,720	27,636,778.80	0.11
242	600039	四川路桥	2,482,700	27,607,624.00	0.11
243	300033	同花顺	279,744	27,585,555.84	0.11
244	002841	视源股份	466,044	27,515,237.76	0.11
245	603899	晨光股份	495,621	27,249,242.58	0.11
246	002236	大华股份	2,407,358	27,227,218.98	0.11
247	600884	杉杉股份	1,490,300	27,123,460.00	0.11
248	002602	世纪华通	6,919,263	26,362,392.03	0.11
249	601878	浙商证券	2,575,300	25,572,729.00	0.10
250	688126	沪硅产业	1,447,993	25,499,156.73	0.10
251	002938	鹏鼎控股	919,100	25,220,104.00	0.10
252	002756	永兴材料	269,700	24,858,249.00	0.10
253	601360	三六零	3,784,474	24,750,459.96	0.10
254	300957	贝泰妮	165,288	24,667,581.12	0.10
255	601155	新城控股	1,202,896	24,659,368.00	0.10
256	688005	容百科技	351,883	24,191,956.25	0.10
257	600362	江西铜业	1,376,369	23,990,111.67	0.10
258	600918	中泰证券	3,705,230	23,750,524.30	0.10

259	601799	星宇股份	185,801	23,665,473.37	0.10
260	688561	奇安信	354,919	23,343,022.63	0.09
261	603260	合盛硅业	279,500	23,181,730.00	0.09
262	300223	北京君正	326,544	23,001,759.36	0.09
263	000708	中信特钢	1,339,762	22,990,315.92	0.09
264	601865	福莱特	675,506	22,501,104.86	0.09
265	600183	生益科技	1,539,894	22,189,872.54	0.09
266	601319	中国人保	4,235,200	22,107,744.00	0.09
267	600061	国投资本	3,409,327	21,785,599.53	0.09
268	603486	科沃斯	298,400	21,765,296.00	0.09
269	000408	藏格矿业	835,700	21,703,129.00	0.09
270	600018	上港集团	4,017,439	21,453,124.26	0.09
271	300595	欧普康视	595,318	21,252,852.60	0.09
272	601898	中煤能源	2,434,300	20,983,666.00	0.08
273	601998	中信银行	4,066,578	20,251,558.44	0.08
274	300529	健帆生物	643,742	19,936,689.74	0.08
275	600803	新奥股份	1,235,825	19,896,782.50	0.08
276	002916	深南电路	266,913	19,257,772.95	0.08
277	002414	高德红外	1,749,326	19,242,586.00	0.08
278	688303	大全能源	389,258	18,559,821.44	0.07
279	688187	时代电气	339,096	18,504,468.72	0.07
280	688169	石头科技	73,124	18,116,471.00	0.07
281	002064	华峰化学	2,635,400	17,920,720.00	0.07
282	601216	君正集团	4,470,466	17,837,159.34	0.07
283	300919	中伟股份	261,716	17,171,186.76	0.07
284	688363	华熙生物	125,164	16,932,185.92	0.07
285	002600	领益智造	3,729,018	16,929,741.72	0.07
286	600606	绿地控股	5,591,185	16,661,731.30	0.07
287	601966	玲珑轮胎	781,710	16,009,420.80	0.06
288	601881	中国银河	1,716,700	15,948,143.00	0.06
289	600025	华能水电	2,381,468	15,717,688.80	0.06
290	603195	公牛集团	101,685	14,567,393.10	0.06
291	688065	凯赛生物	227,628	13,951,320.12	0.06
292	601808	中海油服	783,518	12,990,728.44	0.05
293	300979	华利集团	197,342	11,270,201.62	0.05
294	000877	天山股份	1,266,294	10,788,824.88	0.04
295	002032	苏泊尔	210,381	10,405,444.26	0.04
296	605499	东鹏饮料	57,200	10,175,880.00	0.04
297	000800	一汽解放	1,237,300	9,564,329.00	0.04
298	601236	红塔证券	1,253,603	9,276,662.20	0.04
299	601698	中国卫通	562,854	6,427,792.68	0.03
300	001289	龙源电力	196,800	3,595,536.00	0.01
301	688041	海光信息	70,208	2,748,643.20	0.01
302	688031	星环科技	12,047	949,303.60	0.00
303	688387	信科移动	106,186	518,187.68	0.00
304	688382	益方生物	36,208	466,721.12	0.00
305	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.00
306	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.00
307	688231	隆达股份	7,835	275,321.90	0.00
308	688489	三未信安	1,995	180,786.90	0.00

309	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.00
310	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
311	688291	金橙子	3,961	95,499.71	0.00
312	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
313	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
314	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
315	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
316	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
317	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
318	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
319	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
320	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
321	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
322	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
323	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
324	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
325	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
326	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
327	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
328	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
329	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
330	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
331	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
332	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
333	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
334	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
335	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
336	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
337	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
338	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
339	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
340	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
341	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
342	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
343	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
344	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
345	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
346	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
347	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
348	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
349	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
350	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
351	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
352	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
353	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
354	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
355	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
356	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
357	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
358	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	300750	宁德时代	646,410,123.42	2.24
2	000858	五粮液	318,843,511.91	1.10
3	002594	比亚迪	252,154,441.13	0.87
4	000333	美的集团	249,755,187.64	0.86
5	000792	盐湖股份	242,941,285.11	0.84
6	300059	东方财富	215,966,599.42	0.75
7	002415	海康威视	152,720,709.65	0.53
8	002475	立讯精密	152,522,797.50	0.53
9	000725	京东方 A	144,914,868.77	0.50
10	300760	迈瑞医疗	144,268,473.28	0.50
11	002371	北方华创	142,657,038.24	0.49
12	000651	格力电器	138,624,785.04	0.48
13	002352	顺丰控股	131,684,882.54	0.46
14	002714	牧原股份	124,072,067.87	0.43
15	002142	宁波银行	123,590,478.50	0.43
16	000001	平安银行	122,154,475.10	0.42
17	000568	泸州老窖	116,769,246.59	0.40
18	300124	汇川技术	115,201,633.47	0.40
19	000002	万科 A	112,972,446.69	0.39
20	600089	特变电工	108,310,293.48	0.37

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	300750	宁德时代	620,161,517.14	2.15
2	000858	五粮液	321,584,065.21	1.11
3	000333	美的集团	254,608,320.97	0.88
4	002594	比亚迪	252,384,334.45	0.87
5	300059	东方财富	208,222,310.37	0.72
6	600519	贵州茅台	193,154,049.24	0.67
7	002475	立讯精密	156,142,600.51	0.54
8	002415	海康威视	154,852,517.29	0.54
9	000651	格力电器	146,474,550.98	0.51
10	300760	迈瑞医疗	140,430,097.26	0.49
11	002371	北方华创	140,198,231.39	0.48
12	000001	平安银行	123,423,872.20	0.43
13	002142	宁波银行	122,929,112.07	0.43
14	002714	牧原股份	119,803,210.22	0.41

15	000568	泸州老窖	116,318,346.99	0.40
16	000725	京东方 A	110,994,945.00	0.38
17	000002	万科 A	110,499,427.15	0.38
18	300124	汇川技术	109,806,613.73	0.38
19	002460	赣锋锂业	105,220,672.10	0.36
20	300782	卓胜微	104,853,508.93	0.36

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	10,471,253,720.62
卖出股票收入（成交）总额	9,770,128,703.05

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

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

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

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	20,099,945.07
2	应收清算款	208,577,591.01
3	应收股利	24,853.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	458,340.27
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	229,160,729.85

### 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	300750	宁德时代	53,347,752.00	0.21	转融通出借证券受限
2	000858	五粮液	9,865,674.00	0.04	转融通出借证券受限
3	601012	隆基绿能	5,569,868.00	0.02	转融通出借证券受限
4	002594	比亚迪	5,139,400.00	0.02	转融通出借证券受限
5	600900	长江电力	1,883,700.00	0.01	转融通出借证券受限
6	000333	美的集团	1,036,000.00	0.00	转融通出借证券受限
7	601318	中国平安	470,000.00	0.00	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		华夏沪深 300ETF 联接	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
26,807	236,029.76	3,797,349,278.00	60.02%	371,247,159.00	5.87%	2,158,653,391.00	34.12%

### 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中央汇金投资有限责任公司	1,790,942,652.00	28.31%
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	524,180,600.00	8.28%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	156,542,700.00	2.47%
4	香港上海汇丰银行有限公司	151,238,700.00	2.39%
5	中国太平洋人寿保险股份有限公司—传统—普通保险产品	107,522,400.00	1.70%
6	中国平安人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	99,915,900.00	1.58%
7	中国银河证券股份有限公司融券专用证券账户	76,276,800.00	1.21%
8	中信证券—工行—中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	61,824,600.00	0.98%
9	中国人寿保险股份有限公司	58,220,268.00	0.92%
10	泰康养老保险股份有限公司—自有资金	41,918,100.00	0.66%
11	中国工商银行股份有限公司—华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,158,653,391.00	34.12%

### 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	-	-

### 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

### 9.5 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产
		品份额总量

		的数量区间（万份）
张弘弢	公募基金	0~10
	私募资产管理计划	0
	合计	0~10

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2012 年 12 月 25 日）基金份额总额	602,808,845
本报告期期初基金份额总额	5,759,349,828
本报告期基金总申购份额	4,045,500,000
减：本报告期基金总赎回份额	3,477,600,000
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期末基金份额总额	6,327,249,828

## §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 10 年的审计服务。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 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	
国泰君安证券	2	9,086,279,016.39	45.11%	738,747.52	45.11%	-
中信证券	7	8,010,799,745.12	39.77%	651,270.71	39.77%	-
招商证券	4	2,950,458,877.71	14.65%	239,888.95	14.65%	-
中金公司	4	95,237,021.69	0.47%	7,742.51	0.47%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

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

④在上述租用的券商交易单元中，广发证券、华安证券、招商证券、浙商证券的部分交易单元、世纪证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，中泰证券的部分交易单元、国盛证券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	成交金额	占当期	成交金	占当	成交金	占当

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	额	期权证成交总额的比例	额	期基金成交总额的比例
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	30,050,860.68	100.00%	60,000,000.00	60.00%	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	40,000,000.00	40.00%	-	-	-	-

## 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	华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金利润分配公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-11
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
12	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
13	华夏基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-16
14	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-18
15	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
16	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-25
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	2022-07-07
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	2022-07-20
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联	中国证监会指定报刊及	2022-07-23

	方承销证券的公告	网站	
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	2022-07-30
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	2022-08-06
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	2022-08-10
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	2022-08-12
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	2022-08-13
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	2022-08-19
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	2022-09-01
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	2022-09-03
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	2022-09-22
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	2022-10-14
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	2022-10-20
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	2022-10-22
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	2022-11-05
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	2022-11-12
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	2022-11-16
35	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
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	2022-11-30
37	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
38	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
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	2022-12-20
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	2022-12-23
41	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

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2022-01-01 至 2022-12-31	1,790,942,652.00	-	-	1,790,942,652.00	28.31%
华夏沪深 300ETF 联接	1	2022-01-01 至 2022-12-31	2,141,945,591.00	429,034,900.00	412,327,100.00	2,158,653,391.00	34.12%
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、中国证监会核准基金募集的文件；
- 2、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 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