

---

华夏中证新能源汽车交易型开放式指数  
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，安永华明会计师事务所（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.....	13
§6 审计报告.....	13
§7 年度财务报表.....	15
7.1 资产负债表.....	15
7.2 利润表.....	16
7.3 净资产（基金净值）变动表.....	18
7.4 报表附注.....	19
§8 投资组合报告.....	133
8.1 期末基金资产组合情况.....	133
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.....	134
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	136
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	137
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.....	137
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.....	137
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.....	138
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.....	138
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	138
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	138
8.12 投资组合报告附注.....	138
§9 基金份额持有人信息.....	139
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	139
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	140
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.....	140
§10 开放式基金份额变动.....	140
§11 重大事件揭示.....	140
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	144
§13 备查文件目录.....	144

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证新能源汽车 ETF
场内简称	新汽车（扩位证券简称：新能源车 ETF）
基金主代码	515030
交易代码	515030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 20 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,548,384,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 3 月 4 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、衍生品投资策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	中证新能源汽车指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬
	联系电话	400-818-6666
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com
客户服务电话	400-818-6666	95566
传真	010-63136700	010-66594942
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1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1号
邮政编码	100033	100818
法定代表人	杨明辉	刘连舸

### 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
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 2 月 20 日（基金合同生效日）至 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-1,017,712,049.52	4,516,176,836.62	1,995,506,455.35
本期利润	-3,267,790,668.16	2,519,304,384.90	4,127,466,325.46
加权平均基金份额本期利润	-0.6661	0.6360	0.4524
本期加权平均净值利润率	-33.48%	31.02%	44.77%
本期基金份额净值增长率	-29.03%	41.96%	66.23%
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	3,743,889,980.52	5,519,903,616.39	1,950,948,469.30
期末可供分配基金份额利润	0.6748	1.3598	0.3928
期末基金资产净值	9,292,273,980.52	9,579,287,616.39	8,257,324,363.17
期末基金份额净值	1.6748	2.3598	1.6623
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	67.48%	135.98%	66.23%

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

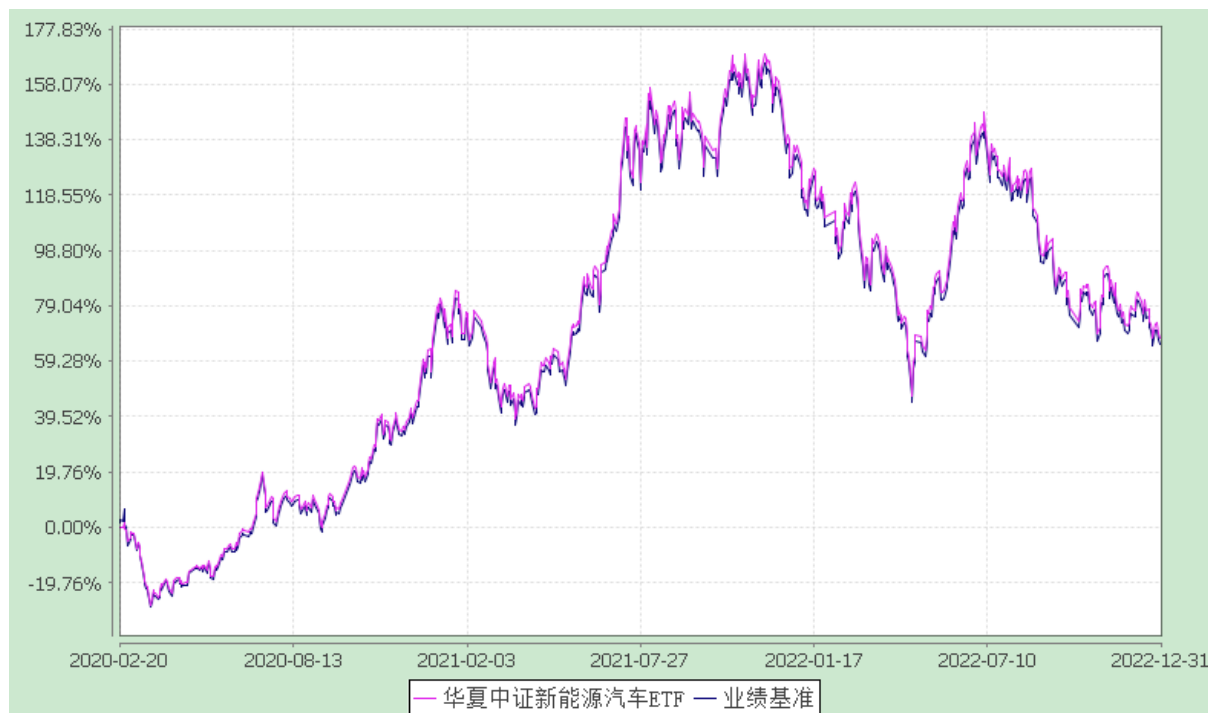
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-6.10%	1.97%	-6.04%	1.98%	-0.06%	-0.01%
过去六个月	-29.00%	1.98%	-29.07%	1.99%	0.07%	-0.01%
过去一年	-29.03%	2.31%	-29.07%	2.33%	0.04%	-0.02%
自基金合同生	67.48%	2.37%	65.17%	2.41%	2.31%	-0.04%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

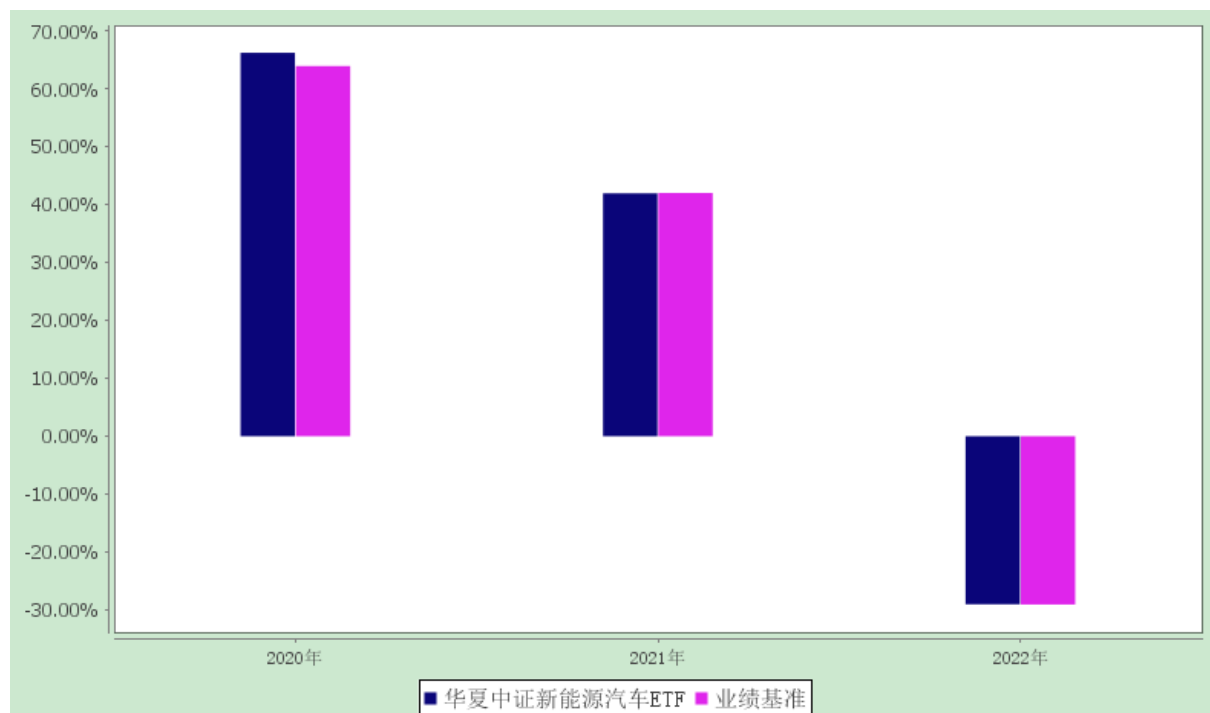
### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金  
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2020年2月20日至2022年12月31日)



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

华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金  
自基金合同生效以来基金净值增长率与业绩比较基准收益率的对比图



注：本基金合同于 2020 年 2 月 20 日生效，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配事项。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州和青岛设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管

理公司之一。

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

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2022 年 12 月 31 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在 TMT 与信息技术行业偏股型基金(A 类)中华夏互联网龙头混合(A 类)排名第 2/22；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；在 TMT 与信息技术行业股票型基金(A 类)中华夏科技成长股票排名第 4/20；在医药医疗健康行业偏股型基金(A 类)中华夏逸享健康混合(A 类)排名第 8/60、华夏乐享健康混合(A 类)排名第 17/60；在消费行业偏股型基金(A 类)中华夏网购精选混合(A 类)排名第 12/61；在标准股票型基金(A 类)中华夏智胜价值成长股票(A 类)排名第 12/307；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中华夏新锦绣混合(A 类)排名第 12/451、华夏新锦升混合(A 类)排名第 18/451、华夏新趋势混合(A 类)排名第 78/451；在偏股型基金(股票上限 80%)(A 类)中华夏经典混合排名第 18/148；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中华夏新兴经济一年持有混合(A 类)排名第 17/211、华夏磐利一年定开混合(A 类)排名第 38/211、华夏蓝筹混合(LOF)(A 类)排名第 44/211、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名第 45/211、华夏兴华混合(A 类)排名第 49/211；在灵活配置型基金(基准股票比例 60%-100%)(A 类)中华夏圆和混合(A 类)排名第 28/461；在偏债型基金(A 类)中华夏睿磐泰盛混合排名第 30/532、华夏磐泰混合(LOF)(A 类)排名第 43/532；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中华夏价值精选混合排名第 60/1177。

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

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



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

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”, 成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十七届中国基金业明星基金奖评选活动上, 在“年度十大明星基金公司奖”评选中, 华夏基金成功获奖。此外, 华夏基金还获得“三年海外投资明星基金公司奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动上, 华夏基金将三大金基金奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“金基金 被动投资基金管理公司奖”; 产品层面, 华夏能源革新股票荣获“金基金 投资回报基金奖”, 华夏沪深 300ETF 荣获“金基金 指数基金三年期奖”。

在客户服务方面, 2022 年, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 华夏基金直销上线北京银行、广发银行快捷等支付方式, 拓展支付渠道的同时交易额度也得到进一步提升, 满足客户支付需求; (2) 华夏基金管家客户端优化资料上传、定投收益展示等功能, 增加客户操作便利性; 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		
李俊	本基金的基金经理	2020-02-20	-	14 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混

					合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020 年 4 月 3 日至 2021 年 12 月 13 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 基金经理薪酬机制

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

#### 4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

本基金管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》要求，针对同经理管理多个组合间的收益率差异进行归因分析，本年度各组合间收益率差异均属正常情况，主要原因为业绩基准不同、投资策略不同，收益率差异可以合理解释。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易共有 113 次，其中 110 次为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易，其余 3 次为投资策略需要所致，不同基金经理管理的组合间因投资策略不同而发生的反向交易，有关基金经理已根据公司管理要求提供决策依据。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证新能源汽车指数，该指数选取以中证全指为样本空间，选取涉及锂电池、充电桩、新能源整车等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源汽车相关上市公司的整体表现，为市场提供多样化的投资标的。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

2022 年，国际方面，俄乌战争爆发，给世界形势带来严重的不确定性；高通胀依然在全球蔓延，美联储、欧央行持续收紧货币政策。国内方面，年初经济恢复整体好于预期，但不久后俄乌战争爆发、疫情多发散发，对经济稳定运行造成了严重冲击。纵观全年，疫情对消费的冲击和持续赢弱的房地产投资成为经济的主要拖累因素，尤其随着出口数据出现下滑，稳内需逐渐成为政策的主要方向。在诸多冲击面前，政府努力调整政策以维持经济的基本稳定，在两大关键领域：房地产方面“三支箭”等政策陆续落地，但目前的政策多是供给侧领域，房地产的稳定还需要需求侧予以配合；

疫情方面，年底疫情防控政策也发生了重大调整，决定对新型冠状病毒感染从“乙类甲管”调整到实施“乙类乙管”。货币政策方面，整体基调“以我为主”，维持宽松。

市场方面，今年无论是国际方面的俄乌战争、美联储激进加息，还是国内疫情冲击、房地产困境，对经济与市场的冲击都是比较的，在这样的环境下，投资者的情绪受到较大冲击，除了个别阶段随着一些因素的边际好转带动市场阶段反弹外，全年市场整体震荡下行。

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

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包括招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东海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 1.6748 元，本报告期份额净值增长率为-29.03%，同期业绩比较基准增长率-29.07%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.04%，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，世界范围内，疫情下的经济恢复、通胀、债务状况，以及相应的政策抉择，是未来仍然需要重点关注的因素。随着美国基本度过通胀高峰，加之目前仍具韧性的经济表现，美联储逐渐进入到一个观察期，表现为打压通胀预期的鹰派发言加之顾及经济增长的加息实质性放缓直至停止加息。

国内方面，在疫情管控放开后，如何推动经济修复成为重中之重，尤其是疫情已三年，对经济造成较大的破坏，稳增长不仅具有必要性，更具有迫切性，这也决定了相应的政策要有力、有效、迅捷，且需要相当的持续性。目前看当前国内经济的问题，症结还是信心的问题，信心的恢复有赖决策者强有力的信号指引与信用重塑。政策方面，中央经济工作会议要求积极的财政政策要加力提效，稳健的货币政策要精准有力，政策基调维持宽松。

就市场而言，如果经济能够如期复苏或政府出台超预期的改革或提振市场的政策，市场或有较好的表现。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为

各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值

低于五千万元的情形。

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

## §6 审计报告

安永华明（2023）审字第 60739337\_A79 号

华夏中证新能源汽车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

我们审计了华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。

### 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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

### 6.3 其他信息

华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

### 6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。

治理层负责监督华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。

### 6.5 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：

（1）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。

(2) 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。

(3) 评价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。

(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。

(5) 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。

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

蒋燕华 王海彦

北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层

2023 年 3 月 28 日

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	36,875,241.53	51,101,316.88
结算备付金		17,704,737.56	23,931,347.28
存出保证金		3,322,728.34	3,381,910.02
交易性金融资产	7.4.7.2	9,252,852,405.37	9,519,224,893.19
其中：股票投资		9,252,852,405.37	9,519,224,893.19
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		28,040,526.45	54,279,584.19
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	307,892.22	375,207.44
资产总计		9,339,103,531.47	9,652,294,259.00
<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		24,521,559.64	40,304,552.76
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,071,828.05	4,119,216.06
应付托管费		814,365.62	823,843.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		47,151.21	38,743.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	17,374,646.43	27,720,286.61
负债合计		46,829,550.95	73,006,642.61
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.7	5,548,384,000.00	4,059,384,000.00
未分配利润	7.4.7.8	3,743,889,980.52	5,519,903,616.39
净资产合计		9,292,273,980.52	9,579,287,616.39
负债和净资产总计		9,339,103,531.47	9,652,294,259.00

注：①报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.6748 元，基金份额总额 5,548,384,000.00 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：华夏中证新能源汽车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>		-3,206,234,473.65	2,615,804,021.79
1.利息收入		17,602,660.49	11,298,399.65
其中：存款利息收入	7.4.7.9	652,009.44	1,103,461.38
债券利息收入		-	5,137.67
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	13,150.68
证券出借利息收入		16,950,651.05	10,176,649.92
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,004,381,287.77	4,553,566,406.88
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-1,044,017,829.01	4,521,726,465.48
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	4,967,830.50	7,674,815.99
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	34,668,710.74	24,165,125.41
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	-2,250,078,618.64	-1,996,872,451.72
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	30,622,772.27	47,811,666.98
<b>减：二、营业总支出</b>		61,556,194.51	96,499,636.89
1.管理人报酬		48,567,034.15	40,568,393.75
2.托管费		9,713,406.82	8,113,678.67
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		61,056.33	33,373.78
8.其他费用	7.4.7.18	3,214,697.21	47,784,190.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-3,267,790,668.16	2,519,304,384.90
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-3,267,790,668.16	2,519,304,384.90
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-3,267,790,668.16	2,519,304,384.90

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：华夏中证新能源汽车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）	4,059,384,000.00	-	5,519,903,616.39	9,579,287,616.39
二、本期期初净资产（基金净值）	4,059,384,000.00	-	5,519,903,616.39	9,579,287,616.39
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,489,000,000.00	-	-1,776,013,635.87	-287,013,635.87
（一）、综合收益总额	-	-	-3,267,790,668.16	-3,267,790,668.16
（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）	1,489,000,000.00	-	1,491,777,032.29	2,980,777,032.29
其中：1.基金申购款	7,919,000,000.00	-	8,070,480,002.27	15,989,480,002.27
2.基金赎回款	-6,430,000,000.00	-	-6,578,702,969.98	-13,008,702,969.98
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	5,548,384,000.00	-	3,743,889,980.52	9,292,273,980.52
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）	4,967,384,000.00	-	3,289,940,363.17	8,257,324,363.17
二、本期期初净资产（基金净值）	4,967,384,000.00	-	3,289,940,363.17	8,257,324,363.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-908,000,000.00	-	2,229,963,253.22	1,321,963,253.22

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	2,519,304,384.90	2,519,304,384.90
(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)	-908,000,000.00	-	-289,341,131.68	-1,197,341,131.68
其中: 1.基金申购款	10,810,500,000.00	-	12,022,603,147.64	22,833,103,147.64
2.基金赎回款	-11,718,500,000.00	-	-12,311,944,279.32	-24,030,444,279.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	4,059,384,000.00	-	5,519,903,616.39	9,579,287,616.39

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

华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019] 1536 号《关于准予华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏中证新能源汽车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 2020 年 2 月 3 日至 2020 年 2 月 14 日共募集 10,762,884,000.00 元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2020）验字第 60739337\_A09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,762,884,000.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，基金还可投资于非成份股（含中小板、创业

板及其他中国证监会注册或核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注 7.4.4 所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

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

###### 1、金融资产分类

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

###### (1) 债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

## (2) 权益工具

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

## 2、金融负债的分类

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

## 3、衍生金融工具

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

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

### 1、金融资产的分类

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

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

列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

## 2、金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债包括交易性金融负债及衍生金融负债等。

本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

#### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益。

本基金对以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础，进行减值处理并确认损失准备。本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

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

率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的金融工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

1、存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进



行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

##### I. 新金融工具准则(自 2022 年 1 月 1 日起适用)

境内基金投资在持有期间应取得的现金红利于除息日确认为投资收益；境外基金投资在持有期间应取得的基金分红收益扣除基金交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为投资收益。境内股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益；境外股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除股票交易所在地适用的预缴所得税后的净额确认为

投资收益。境内债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。境外债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在交易所在地适用的预缴所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

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

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

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

## II. 原金融工具准则(截至 2021 年 12 月 31 日前适用)

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值

变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。期末可供分配利润指期末资产负债表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、应收利息和应收证券清算款，金额分别为 51,101,316.88 元、23,931,347.28 元、3,381,910.02 元、375,207.44 元和 54,279,584.19 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款，金额分别为 51,108,547.55 元、23,943,753.19 元、3,383,584.11 元、353,896.77 元和 54,279,584.19 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 9,519,224,893.19 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 9,519,224,893.19 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 40,304,552.76 元、4,119,216.06 元、823,843.19 元、7,630,647.03 元和 20,089,639.58 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 40,304,552.76 元、4,119,216.06 元、823,843.19 元、7,630,647.03 元和 20,089,639.58 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	36,875,241.53	51,101,316.88
等于：本金	36,871,678.08	51,101,316.88
加：应计利息	3,563.45	-
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	36,875,241.53	51,101,316.88

## 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	11,367,843,605.62	-	9,252,852,405.37	-2,114,991,200.25
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	11,367,843,605.62	-	9,252,852,405.37	-2,114,991,200.25
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	9,384,137,474.80	-	9,519,224,893.19	135,087,418.39
贵金属投资- 金交所黄金 合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-

	场				
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		9,384,137,474.80	-	9,519,224,893.19	135,087,418.39

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

##### 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

#### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	375,207.44
其他应收款	307,892.22	-
待摊费用	-	-
合计	307,892.22	375,207.44

#### 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	3,539,591.91	7,630,647.03
其中：交易所市场	3,539,591.91	7,630,647.03
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
应付指数使用费	1,550,635.99	727,911.09



应退替代款	12,062,334.25	19,051,044.79
可退替代款	2,084.28	90,683.70
合计	17,374,646.43	27,720,286.61

## 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	4,059,384,000.00	4,059,384,000.00
本期申购	7,919,000,000.00	7,919,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-6,430,000,000.00	-6,430,000,000.00
本期末	5,548,384,000.00	5,548,384,000.00

## 7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,260,834,319.01	-740,930,702.62	5,519,903,616.39
本期利润	-1,017,712,049.52	-2,250,078,618.64	-3,267,790,668.16
本期基金份额交易产生的变动数	2,133,571,821.50	-641,794,789.21	1,491,777,032.29
其中：基金申购款	11,249,934,179.85	-3,179,454,177.58	8,070,480,002.27
基金赎回款	-9,116,362,358.35	2,537,659,388.37	-6,578,702,969.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	7,376,694,090.99	-3,632,804,110.47	3,743,889,980.52

## 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	146,079.95	232,374.55
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	448,939.80	825,166.47
其他	56,989.69	45,920.36
合计	652,009.44	1,103,461.38

## 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	-717,514,065.99	3,736,888,204.74
股票投资收益——赎回差价收入	-326,503,763.02	784,838,260.74

股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-1,044,017,829.01	4,521,726,465.48

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	11,969,558,834.55	22,206,867,514.35
减：卖出股票成本总额	12,661,376,795.99	18,469,979,309.61
减：交易费用	25,696,104.55	-
买卖股票差价收入	-717,514,065.99	3,736,888,204.74

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	13,008,702,969.98	24,030,444,279.32
减：现金支付赎回款总额	10,331,756,864.98	18,794,599,916.32
减：赎回股票成本总额	3,003,449,868.02	4,451,006,102.26
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-326,503,763.02	784,838,260.74

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	9,389.97	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,958,440.53	7,674,815.99
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	4,967,830.50	7,674,815.99

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	23,764,740.66	35,129,807.80
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	18,795,800.00	27,449,700.00
减：应计利息总额	9,671.67	5,291.81
减：交易费用	828.46	-
买卖债券差价收入	4,958,440.53	7,674,815.99

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

7.4.7.13 衍生工具收益

7.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期	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	34,668,710.74	24,165,125.41
其中：证券出借权益补偿收入	3,435,788.58	1,714,357.25
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	34,668,710.74	24,165,125.41

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	-2,250,078,618.64	-1,996,872,451.72
——股票投资	-2,250,078,618.64	-1,996,872,451.72
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-

——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,250,078,618.64	-1,996,872,451.72

## 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	30,622,772.27	47,811,666.98
合计	30,622,772.27	47,811,666.98

## 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	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行费用	80,675.09	88,551.48
指数使用费	2,914,022.12	2,434,103.61
其他	-	45,041,535.60
合计	3,214,697.21	47,784,190.69

## 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

## 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

## 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
POWER CORPORATION OF CANADA	基金管理人的股东
MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION	基金管理人的股东
天津海鹏科技咨询有限公司	基金管理人的股东
华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金	该基金是本基金的联接基金

发起式联接基金（“华夏中证新能源汽车 ETF 发起式联接”）	
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司

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

②下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	3,568,383,320.50	13.52%	2,402,227,324.53	5.50%

##### 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	15,040,350.85	63.29%	25,629,906.20	72.96%

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券	-	-	20,000,000.00	100.00%

##### 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	1,539,042.82	13.52%	4,850.68	0.14%

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	1,036,085.42	5.50%	901,426.05	11.81%

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	48,567,034.15	40,568,393.75
其中：支付销售机构的客户维护费	985,424.18	942,734.42

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	9,713,406.82	8,113,678.67

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	3,036,382,528.93	2,230,457.39	94,508,451.00	29,562.47
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	1,461,841,005.44	1,300,294.77	127,764,165.00	38,338.72

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	2022010600000399	寒锐钴业	2022-01-06	895,735.00	11,500.00	14	1.80	627.01	-	-
中信证券	2022010600000405	新宙邦	2022-01-06	1,130,688.00	10,400.00	14	1.80	791.48	-	-
中信证券	2022010600000408	先导智能	2022-01-06	1,468,656.00	21,700.00	14	1.80	1,028.06	-	-
中信证券	2022010600000413	当升科技	2022-01-06	1,158,234.00	13,800.00	14	1.80	810.76	-	-
中信证券	2022010600010047	中伟股份	2022-01-06	490,910.00	3,500.00	14	3.30	630.00	-	-
中信证券	2022010600011511	新宙邦	2022-01-06	195,696.00	1,800.00	14	3.60	273.97	-	-
中信	2022010600011513	翔丰	2022-01-06	57,000.00	1,000.00	14	3.20	70.93	-	-

证券		华								
中信证券	2022010600011523	特锐德	2022-01-06	89,172.00	3,600.00	14	3.50	121.37	-	-
中信证券	2022011000012721	中伟股份	2022-01-10	1,598,289.00	11,900.00	14	2.90	1,802.51	-	-
中信证券	2022011200018041	天奈科技	2022-01-12	5,915,200.00	40,000.00	28	1.80	8,281.28	-	-
中信证券	2022011300009816	嘉元科技	2022-01-13	6,637,140.00	51,000.00	28	2.90	14,970.44	-	-
中信证券	2022011300009818	当升科技	2022-01-13	2,593,344.00	31,200.00	14	2.70	2,723.01	-	-
中信证券	2022011400020842	当升科技	2022-01-14	3,668,330.00	43,000.00	14	2.70	3,851.75	-	-
中信证券	2022011400021506	中伟股份	2022-01-14	1,381,000.00	10,000.00	14	1.70	912.99	-	-
中信证券	2022011400023522	宁德时代	2022-01-14	750,620.00	1,300.00	14	1.80	525.43	-	-
中信证券	2022012000001264	亿纬锂能	2022-01-20	1,933,140.00	20,200.00	14	3.20	3,093.03	-	-
中信证券	2022012000009796	翔丰华	2022-01-20	49,250.00	1,000.00	14	3.30	81.26	-	-
中信证券	2022012000010890	中伟股份	2022-01-20	475,720.00	3,500.00	14	3.20	761.15	-	-
中信证券	2022012000010894	新宙邦	2022-01-20	171,720.00	1,800.00	14	2.80	240.40	-	-
中	2022012000010896	特	2022-	82,044.00	3,600.00	14	3.00	123.07	-	-



信 证 券		锐 德	01-20								
中 信 证 券	2022012000011194	新 宙 邦	2022- 01-20	992,160.00	10,400.00	14	1.80	892.94	-	-	
中 信 证 券	2022012000011196	当 升 科 技	2022- 01-20	1,137,948.00	13,800.00	14	1.80	1,024.15	-	-	
中 信 证 券	2022012000011198	先 导 智 能	2022- 01-20	1,584,751.00	21,700.00	14	1.80	1,426.28	-	-	
中 信 证 券	2022012000011208	寒 锐 钻 业	2022- 01-20	869,745.00	11,500.00	14	1.80	782.77	-	-	
中 信 证 券	2022012400009788	中 伟 股 份	2022- 01-24	1,621,613.00	11,900.00	14	2.90	1,828.82	-	-	
中 信 证 券	2022012700011465	当 升 科 技	2022- 01-27	2,649,192.00	31,200.00	14	2.50	2,575.60	-	-	
中 信 证 券	2022012800020874	中 伟 股 份	2022- 01-28	1,307,400.00	10,000.00	14	1.70	864.34	-	-	
中 信 证 券	2022012800022184	宁 德 时 代	2022- 01-28	770,380.00	1,300.00	14	1.80	539.27	-	-	
中 信 证 券	2022020700047153	中 伟 股 份	2022- 02-07	1,474,410.00	11,900.00	14	2.90	1,662.81	-	-	
中 信 证 券	2022020700047155	寒 锐 钻 业	2022- 02-07	840,190.00	11,500.00	14	1.80	588.13	-	-	
中 信 证 券	2022020700047163	先 导 智 能	2022- 02-07	1,567,608.00	21,700.00	14	1.80	1,097.33	-	-	
中 信 证 券	2022020700047169	当 升 科 技	2022- 02-07	1,150,920.00	13,800.00	14	1.80	805.64	-	-	

中信证券	2022020700047171	新宙邦	2022-02-07	987,896.00	10,400.00	14	1.80	691.53	-	-
中信证券	2022020700055409	翔丰华	2022-02-07	57,050.00	1,000.00	14	3.20	71.00	-	-
中信证券	2022020700055411	特锐德	2022-02-07	75,456.00	3,600.00	14	3.20	93.90	-	-
中信证券	2022020700055413	新宙邦	2022-02-07	170,982.00	1,800.00	14	2.90	192.83	-	-
中信证券	2022020700055415	中伟股份	2022-02-07	433,650.00	3,500.00	14	3.60	607.11	-	-
中信证券	2022020700055417	亿纬锂能	2022-02-07	1,904,860.00	20,200.00	14	2.90	2,148.26	-	-
中信证券	2022020900017124	天奈科技	2022-02-09	5,368,000.00	40,000.00	28	1.80	7,515.20	-	-
中信证券	2022021000012814	嘉元科技	2022-02-10	5,607,960.00	51,000.00	28	3.20	13,957.59	-	-
中信证券	2022021000012982	当升科技	2022-02-10	2,324,400.00	31,200.00	14	2.80	2,531.01	-	-
中信证券	2022021100020196	宁德时代	2022-02-11	636,987.00	1,300.00	14	1.80	445.89	-	-
中信证券	2022021500000929	寒锐钴业	2022-02-15	309,000.00	4,000.00	14	3.30	396.55	-	-
中信证券	2022021500000934	新宙邦	2022-02-15	2,608,320.00	28,600.00	14	3.10	3,144.47	-	-
中信证	2022021700001189	当升科	2022-02-17	690,312.00	8,400.00	14	3.30	885.90	-	-

券		技								
中信证	2022021700001203	亿纬锂能	2022-02-17	2,060,856.00	23,200.00	14	2.90	2,324.19	-	-
券		新宙邦	2022-02-21	938,600.00	10,400.00	14	1.80	657.02	-	-
中信证	2022022100038029	寒锐钴业	2022-02-21	871,815.00	11,500.00	14	1.80	610.27	-	-
券		中伟股份	2022-02-21	1,467,151.00	11,900.00	14	2.90	1,654.62	-	-
中信证	2022022100043097	新宙邦	2022-02-21	162,450.00	1,800.00	14	2.20	138.99	-	-
券		中伟股份	2022-02-21	431,515.00	3,500.00	14	2.50	419.53	-	-
中信证	2022022100045419	翔丰华	2022-02-21	56,990.00	1,000.00	14	1.90	42.11	-	-
券		特锐德	2022-02-21	76,068.00	3,600.00	14	3.00	88.75	-	-
中信证	2022022100045423	亿纬锂能	2022-02-21	1,734,170.00	20,200.00	14	2.00	1,348.80	-	-
券		当升科技	2022-02-21	1,111,314.00	13,800.00	14	1.80	777.92	-	-
中信证	2022022100045465	先导智能	2022-02-21	1,348,655.00	21,700.00	14	1.80	944.06	-	-
券		亿纬锂能	2022-02-24	85,990.00	1,000.00	28	2.10	140.45	-	-
中信证	2022022400000788	当升	2022-02-24	2,593,968.00	31,200.00	14	3.30	3,328.93	-	-
券										

证券		科技									
中信证券	2022022500017913	宁德时代	2022-02-25	687,440.00	1,300.00	14	1.80	481.21	-	-	
中信证券	2022030100001238	寒锐钴业	2022-03-01	1,576,845.00	20,100.00	14	3.30	2,023.62	-	-	
中信证券	2022030100004472	新宙邦	2022-03-01	2,704,988.00	28,600.00	14	2.80	2,945.43	-	-	
中信证券	2022030100004660	天奈科技	2022-01-12	51,998.84	-	28	1.80	-	-	-	
中信证券	2022030300001576	中伟股份	2022-03-03	494,680.00	4,000.00	14	2.30	442.46	-	-	
中信证券	2022030300001624	亿纬锂能	2022-03-03	238,530.00	3,000.00	14	2.70	250.46	-	-	
中信证券	2022030300004334	亿纬锂能	2022-03-03	1,844,632.00	23,200.00	14	2.20	1,578.19	-	-	
中信证券	2022030300004336	当升科技	2022-03-03	668,640.00	8,400.00	14	2.80	728.07	-	-	
中信证券	2022030700033546	中伟股份	2022-03-07	406,700.00	3,500.00	14	2.30	363.77	-	-	
中信证券	2022030700033550	亿纬锂能	2022-03-07	1,510,758.00	20,200.00	14	2.70	1,586.30	-	-	
中信证券	2022030700033572	特锐德	2022-03-07	71,280.00	3,600.00	14	3.30	91.48	-	-	
中信证券	2022030700033574	新宙邦	2022-03-07	151,722.00	1,800.00	14	3.00	177.01	-	-	
中	2022030700035246	当	2022-	1,020,096.00	13,800.00	14	1.80	714.07	-	-	

信 证 券		升 科 技	03-07								
中 信 证 券	2022030700035248	新 宙 邦	2022- 03-07	876,616.00	10,400.00	14	1.80	613.63	-	-	
中 信 证 券	2022030700035256	先 导 智 能	2022- 03-07	1,238,853.00	21,700.00	14	1.80	867.20	-	-	
中 信 证 券	2022030700035936	翔 丰 华	2022- 03-07	51,990.00	1,000.00	14	3.60	72.79	-	-	
中 信 证 券	2022030800001390	寒 锐 钻 业	2022- 03-08	209,730.00	3,000.00	14	3.50	285.47	-	-	
中 信 证 券	2022030900016541	天 奈 科 技	2022- 03-09	5,303,200.00	40,000.00	28	1.80	7,424.48	-	-	
中 信 证 券	2022031000000753	中 伟 股 份	2022- 03-10	2,146,000.00	18,500.00	28	4.30	7,177.18	-	-	
中 信 证 券	2022031000000757	寒 锐 钻 业	2022- 03-10	481,880.00	7,000.00	28	3.40	1,274.30	-	-	
中 信 证 券	2022031000011794	嘉 元 科 技	2022- 03-10	4,832,760.00	51,000.00	28	2.90	10,900.56	-	-	
中 信 证 券	2022031000011832	当 升 科 技	2022- 03-10	2,427,984.00	31,200.00	14	3.10	2,927.07	-	-	
中 信 证 券	2022031100017352	宁 德 时 代	2022- 03-11	641,615.00	1,300.00	14	1.80	449.13	-	-	
中 信 证 券	2022031500011431	新 宙 邦	2022- 03-15	2,308,878.00	28,600.00	14	3.10	2,783.48	-	-	
中 信 证 券	2022031500011443	寒 锐 钻 业	2022- 03-15	1,296,249.00	20,100.00	14	3.50	1,764.34	-	-	

中信证券	2022031700001098	亿纬锂能	2022-03-17	2,070,862.00	25,400.00	28	2.10	3,382.41	-	-
中信证券	2022031700001099	亿纬锂能	2022-03-17	326,120.00	4,000.00	28	2.10	532.66	-	-
中信证券	2022031700001101	当升科技	2022-03-17	936,770.00	11,300.00	28	3.20	2,331.52	-	-
中信证券	2022031700005212	亿纬锂能	2022-03-17	244,590.00	3,000.00	14	3.10	294.87	-	-
中信证券	2022031700005216	当升科技	2022-03-17	696,360.00	8,400.00	14	3.30	893.66	-	-
中信证券	2022031700005222	中伟股份	2022-03-17	514,400.00	4,000.00	14	4.40	880.20	-	-
中信证券	2022032100030565	先导智能	2022-03-21	1,318,492.00	21,700.00	14	1.80	1,054.79	-	-
中信证券	2022032100030569	新宙邦	2022-03-21	887,952.00	10,400.00	14	1.80	710.37	-	-
中信证券	2022032100034913	当升科技	2022-03-21	1,162,788.00	13,800.00	14	1.80	930.23	-	-
中信证券	2022032100036711	翔丰华	2022-03-21	55,620.00	1,000.00	14	3.50	86.53	-	-
中信证券	2022032100036715	新宙邦	2022-03-21	153,684.00	1,800.00	14	2.50	170.77	-	-
中信证券	2022032100036717	特锐德	2022-03-21	69,804.00	3,600.00	14	3.10	96.17	-	-
中信证	2022032100036719	中伟股	2022-03-21	464,450.00	3,500.00	14	6.40	1,321.10	-	-

券		份								
中信证	2022032100036739	亿纬锂能	2022-03-21	1,725,080.00	20,200.00	14	2.20	1,686.74	-	-
券										
中信证	2022032200000907	当升科技	2022-03-22	667,520.00	8,000.00	14	3.40	945.65	-	-
券										
中信证	2022032200000923	新宙邦	2022-03-22	340,960.00	4,000.00	14	2.10	298.34	-	-
券										
中信证	2022032200013305	寒锐钴业	2022-03-22	199,560.00	3,000.00	14	3.20	266.08	-	-
券										
中信证	2022032400010593	当升科技	2022-03-24	2,542,800.00	31,200.00	14	3.30	3,263.26	-	-
券										
中信证	2022032400010597	亿纬锂能	2022-03-24	81,450.00	1,000.00	28	2.10	133.04	-	-
券										
中信证	2022032500015816	宁德时代	2022-03-25	652,691.00	1,300.00	14	1.80	456.88	-	-
券										
中信证	2022032900005052	新宙邦	2022-03-29	2,361,216.00	28,600.00	14	2.10	1,928.33	-	-
券										
中信证	2022032900005058	寒锐钴业	2022-03-29	1,267,908.00	20,100.00	14	3.40	1,676.46	-	-
券										
中信证	2022033100000903	当升科技	2022-03-31	255,680.00	3,400.00	28	1.80	357.95	-	-
券										
中信证	2022033100000905	新宙邦	2022-03-31	220,185.00	2,700.00	28	1.80	308.26	-	-
券										
中信证	2022033100000908	翔丰华	2022-03-31	49,300.00	1,000.00	28	1.80	69.02	-	-
券										
中信	2022033100000915	亿纬	2022-03-31	451,752.00	5,600.00	28	1.80	632.45	-	-

证券		锂能									
中信证券	2022033100000921	特锐德	2022-03-31	104,608.00	5,600.00	28	1.80	146.45	-	-	
中信证券	2022033100000926	寒锐钴业	2022-03-31	126,680.00	2,000.00	28	1.80	177.35	-	-	
中信证券	2022033100000932	宁德时代	2022-03-31	1,075,830.00	2,100.00	28	1.80	1,506.16	-	-	
中信证券	2022033100000984	汇川技术	2022-03-31	1,476,300.00	25,900.00	28	1.80	2,066.82	-	-	
中信证券	2022033100005870	中伟股份	2022-03-31	471,000.00	4,000.00	14	3.30	604.45	-	-	
中信证券	2022040600050743	中伟股份	2022-04-06	403,655.00	3,500.00	14	3.40	533.72	-	-	
中信证券	2022040600050745	特锐德	2022-04-06	66,600.00	3,600.00	14	3.20	82.88	-	-	
中信证券	2022040600050747	亿纬锂能	2022-04-06	1,601,860.00	20,200.00	14	3.10	1,931.13	-	-	
中信证券	2022040600050749	寒锐钴业	2022-04-06	187,740.00	3,000.00	14	3.10	226.33	-	-	
中信证券	2022040600056319	先导智能	2022-04-06	1,174,404.00	21,700.00	14	1.80	822.08	-	-	
中信证券	2022040600056333	新宙邦	2022-04-06	863,512.00	10,400.00	14	1.80	604.46	-	-	
中信证券	2022040600060935	新宙邦	2022-04-06	149,454.00	1,800.00	14	2.90	168.55	-	-	
中	2022040600060937	翔	2022-	48,170.00	1,000.00	14	3.70	69.31	-	-	



信 证 券		丰 华	04-06								
中 信 证 券	2022040700013966	中 伟 股 份	2022- 04-07	2,081,435.00	18,500.00	28	3.30	5,342.35	-	-	
中 信 证 券	2022040700013968	当 升 科 技	2022- 04-07	2,296,944.00	31,200.00	14	3.10	2,769.09	-	-	
中 信 证 券	2022040700013970	寒 锐 钻 业	2022- 04-07	427,350.00	7,000.00	28	3.00	997.15	-	-	
中 信 证 券	2022040800014877	宁 德 时 代	2022- 04-08	643,500.00	1,300.00	14	1.80	450.45	-	-	
中 信 证 券	2022041200011129	新 宙 邦	2022- 04-12	2,168,452.00	28,600.00	14	2.90	2,445.53	-	-	
中 信 证 券	2022041200011135	寒 锐 钻 业	2022- 04-12	1,175,247.00	20,100.00	14	3.10	1,416.83	-	-	
中 信 证 券	2022041400005529	亿 纬 锂 能	2022- 04-14	290,680.00	4,000.00	28	2.50	565.21	-	-	
中 信 证 券	2022041400005531	当 升 科 技	2022- 04-14	808,063.00	11,300.00	28	3.10	1,948.33	-	-	
中 信 证 券	2022041400005533	亿 纬 锂 能	2022- 04-14	1,845,818.00	25,400.00	28	2.50	3,589.09	-	-	
中 信 证 券	2022041500005799	特 锐 德	2022- 03-31	112.00	-	28	1.80	-	-	-	
中 信 证 券	2022041500005820	特 锐 德	2022- 04-06	72.00	-	14	3.20	-	-	-	
中 信 证 券	2022042000043882	特 锐 德	2022- 04-20	57,744.00	3,600.00	14	3.30	79.39	-	-	

中信证券	2022042000043884	翔丰华	2022-04-20	39,810.00	1,000.00	14	3.70	61.37	-	-
中信证券	2022042000043886	新宙邦	2022-04-20	126,000.00	1,800.00	14	2.60	136.50	-	-
中信证券	2022042000044880	先导智能	2022-04-20	1,017,730.00	21,700.00	14	1.80	763.30	-	-
中信证券	2022042000048134	亿纬锂能	2022-04-20	1,365,520.00	20,200.00	14	3.00	1,706.90	-	-
中信证券	2022042000048164	寒锐钴业	2022-04-20	173,490.00	3,000.00	14	2.10	151.80	-	-
中信证券	2022042000049884	新宙邦	2022-04-20	728,000.00	10,400.00	14	1.80	546.00	-	-
中信证券	2022042100012733	亿纬锂能	2022-04-21	64,510.00	1,000.00	28	2.90	145.51	-	-
中信证券	2022042100012739	当升科技	2022-04-21	2,067,312.00	31,200.00	14	3.40	2,733.45	-	-
中信证券	2022042200015182	宁德时代	2022-04-22	539,942.00	1,300.00	14	1.80	377.96	-	-
中信证券	2022042600007399	寒锐钴业	2022-04-26	935,655.00	20,100.00	14	3.20	1,164.37	-	-
中信证券	2022042600007401	新宙邦	2022-04-26	1,688,830.00	28,600.00	14	3.40	2,233.01	-	-
中信证券	2022042800001142	亿纬锂能	2022-04-28	4,009,830.00	63,800.00	28	1.90	5,925.64	-	-
中信证	2022042800001143	宁德时代	2022-04-28	9,958,750.00	25,700.00	28	1.90	14,716.82	-	-

券		代								
中信证券	2022042800008714	翔丰华	2022-04-28	34,840.00	1,000.00	28	1.80	48.78	-	-
中信证券	2022042800008950	当升科技	2022-04-28	222,054.00	3,400.00	28	1.80	310.88	-	-
中信证券	2022042800008954	新宙邦	2022-04-28	174,960.00	2,700.00	28	1.80	244.94	-	-
中信证券	2022042800008958	汇川技术	2022-04-28	1,448,328.00	25,900.00	28	1.80	2,027.66	-	-
中信证券	2022042800008966	亿纬锂能	2022-04-28	351,960.00	5,600.00	28	1.80	492.74	-	-
中信证券	2022042800008974	特锐德	2022-04-28	74,704.00	5,600.00	28	1.80	104.59	-	-
中信证券	2022042800008980	寒锐钴业	2022-04-28	100,140.00	2,000.00	28	1.80	140.20	-	-
中信证券	2022042800008982	宁德时代	2022-04-28	813,750.00	2,100.00	28	1.80	1,139.25	-	-
中信证券	2022050500001668	当升科技	2022-05-05	1,997,619.00	29,900.00	14	3.40	2,641.30	-	-
中信证券	2022050500059447	新宙邦	2022-05-05	701,480.00	10,400.00	14	1.80	491.04	-	-
中信证券	2022050500059449	先导智能	2022-05-05	969,556.00	21,700.00	14	1.80	678.69	-	-
中信证券	2022050500072233	中伟股份	2022-05-05	1,520,700.00	18,500.00	28	2.70	3,193.47	-	-
中信	2022050500072343	翔丰	2022-05-05	36,600.00	1,000.00	14	4.20	59.78	-	-

证券		华									
中信证券	2022050500072349	特锐德	2022-05-05	49,680.00	3,600.00	14	3.20	61.82	-	-	
中信证券	2022050500072351	新宙邦	2022-05-05	121,410.00	1,800.00	14	2.30	108.59	-	-	
中信证券	2022050500072735	当升科技	2022-05-05	2,084,472.00	31,200.00	14	2.30	1,864.44	-	-	
中信证券	2022050500072737	寒锐钴业	2022-05-05	360,570.00	7,000.00	28	2.90	813.29	-	-	
中信证券	2022050500072743	寒锐钴业	2022-05-05	154,530.00	3,000.00	14	3.00	180.29	-	-	
中信证券	2022050600014643	宁德时代	2022-05-06	488,787.00	1,300.00	14	1.80	342.15	-	-	
中信证券	2022051000015021	寒锐钴业	2022-05-10	1,039,170.00	20,100.00	14	3.00	1,212.37	-	-	
中信证券	2022051000015027	新宙邦	2022-05-10	2,029,456.00	28,600.00	14	2.30	1,815.24	-	-	
中信证券	2022051100011740	新宙邦	2022-04-28	1,836.00	-	28	1.80	-	-	-	
中信证券	2022051100011770	新宙邦	2022-05-05	7,072.00	-	14	1.80	-	-	-	
中信证券	2022051100011872	新宙邦	2022-05-05	1,224.00	-	14	2.30	-	-	-	
中信证券	2022051100011946	新宙邦	2022-05-10	19,448.00	-	14	2.30	-	-	-	
中	2022051100011984	新	2022-	-	2,160.00	28	1.80	-	-	-	

信 证 券		宙 邦	04-28							
中 信 证 券	2022051100012014	新 宙 邦	2022- 05-05	-	8,320.00	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	2022051100012116	新 宙 邦	2022- 05-05	-	1,440.00	14	2.30	-	-	-
中 信 证 券	2022051100012190	新 宙 邦	2022- 05-10	-	22,880.00	14	2.30	-	-	-
中 信 证 券	2022051200000921	亿 纬 锂 能	2022- 05-12	2,027,575.00	27,500.00	14	3.40	2,680.90	-	-
中 信 证 券	2022051200009960	亿 纬 锂 能	2022- 05-12	294,920.00	4,000.00	28	1.80	412.89	-	-
中 信 证 券	2022051200009964	亿 纬 锂 能	2022- 05-12	1,872,742.00	25,400.00	28	1.80	2,621.84	-	-
中 信 证 券	2022051200009968	当 升 科 技	2022- 05-12	796,424.00	11,300.00	28	3.30	2,044.15	-	-
中 信 证 券	2022051700000848	先 导 智 能	2022- 05-17	1,042,902.00	21,700.00	14	1.80	730.03	-	-
中 信 证 券	2022051700000856	当 升 科 技	2022- 05-17	970,554.00	13,800.00	14	1.80	679.39	-	-
中 信 证 券	2022051700000867	寒 锐 钴 业	2022- 05-17	625,370.00	11,500.00	14	1.80	437.76	-	-
中 信 证 券	2022051800000832	寒 锐 钴 业	2022- 05-18	1,986,096.00	36,800.00	14	3.10	2,394.35	-	-
中 信 证 券	2022051800000844	当 升 科 技	2022- 05-18	1,970,960.00	28,400.00	14	3.50	2,682.70	-	-

中信证券	2022051900047939	翔丰华	2022-05-19	42,370.00	1,000.00	14	3.70	60.97	-	-
中信证券	2022051900052299	特锐德	2022-05-19	53,748.00	3,600.00	14	3.30	68.98	-	-
中信证券	2022051900052321	亿纬锂能	2022-05-19	79,700.00	1,000.00	28	3.30	204.56	-	-
中信证券	2022051900052361	新宙邦	2022-05-19	76,896.00	1,800.00	14	2.20	65.79	-	-
中信证券	2022051900052383	当升科技	2022-05-19	2,146,820.00	29,900.00	14	3.20	2,671.60	-	-
中信证券	2022052000015874	宁德时代	2022-05-20	554,970.00	1,300.00	14	1.80	471.73	-	-
中信证券	2022052400000899	新宙邦	2022-05-24	1,913,960.00	47,200.00	14	2.90	2,158.52	-	-
中信证券	2022052400007464	寒锐钴业	2022-05-24	1,059,069.00	20,100.00	14	3.10	1,276.77	-	-
中信证券	2022052400007470	新宙邦	2022-05-24	1,159,730.00	28,600.00	14	2.70	1,217.72	-	-
中信证券	2022052500010051	当升科技	2022-04-28	1,441.60	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022052500010079	当升科技	2022-05-12	4,791.20	-	28	3.30	-	-	-
中信证券	2022052500010092	当升科技	2022-05-17	5,851.20	-	14	1.80	-	-	-
中信证	2022052500010102	当升科	2022-05-18	12,041.60	-	14	3.50	-	-	-

券		技								
中信	2022052500010209	当	2022-	12,677.60	-	14	3.20	-	-	-
证		升	05-19							
券		科								
		技								
中	2022052600006906	亿	2022-	428,176.00	5,600.00	14	1.80	299.72	-	-
信		纬	05-26							
证		锂								
券		能								
中	2022052600006914	宁	2022-	10,023,257.00	25,700.00	14	1.90	7,406.07	-	-
信		德	05-26							
证		时								
券		代								
中	2022052600010534	汇	2022-	1,530,431.00	25,900.00	14	1.80	1,071.30	-	-
信		川	05-26							
证		技								
券		术								
中	2022052600010542	当	2022-	225,284.00	3,400.00	14	1.80	157.70	-	-
信		升	05-26							
证		科								
券		技								
中	2022052600010576	宁	2022-	819,021.00	2,100.00	14	1.80	573.31	-	-
信		德	05-26							
证		时								
券		代								
中	2022052600011516	特	2022-	88,648.00	5,600.00	14	1.80	62.05	-	-
信		锐	05-26							
证		德								
券										
中	2022052600011528	新	2022-	106,596.00	2,700.00	14	1.80	74.62	-	-
信		宙	05-26							
证		邦								
券										
中	2022052600011534	亿	2022-	4,878,148.00	63,800.00	14	1.90	3,604.41	-	-
信		纬	05-26							
证		锂								
券		能								
中	2022052600011542	翔	2022-	42,000.00	1,000.00	14	1.80	29.40	-	-
信		丰	05-26							
证		华								
券										
中	2022052600011544	寒	2022-	106,000.00	2,000.00	14	1.80	74.20	-	-
信		锐	05-26							
证		钻								
券		业								
中	2022052600012708	中	2022-	3,087.64	-	28	2.70	-	-	-
信		伟	05-05							
证		股								
券		份								
中	2022053100001359	新	2022-	72,360.00	1,800.00	14	3.30	92.86	-	-
信		宙	05-31							
证										

证券		邦									
中信证券	2022053100001387	先导智能	2022-05-31	276,678.00	5,700.00	14	2.10	225.95	-	-	
中信证券	2022053100001397	亿纬锂能	2022-05-31	554,967.00	6,900.00	14	2.80	604.30	-	-	
中信证券	2022053100001402	特锐德	2022-05-31	58,716.00	3,600.00	14	3.40	77.64	-	-	
中信证券	2022053100008641	先导智能	2022-05-31	1,053,318.00	21,700.00	14	1.80	737.32	-	-	
中信证券	2022053100008643	当升科技	2022-05-31	963,240.00	13,800.00	14	1.80	674.27	-	-	
中信证券	2022053100009653	寒锐钴业	2022-05-31	619,390.00	11,500.00	14	1.80	433.57	-	-	
中信证券	2022060100004526	当升科技	2022-06-01	2,001,916.00	28,400.00	14	3.20	2,491.27	-	-	
中信证券	2022060100004528	寒锐钴业	2022-06-01	1,993,088.00	36,800.00	14	3.10	2,402.78	-	-	
中信证券	2022060200001033	特锐德	2022-06-02	854,782.00	51,400.00	14	3.40	1,130.21	-	-	
中信证券	2022060200013440	当升科技	2022-06-02	2,239,510.00	29,900.00	14	3.20	2,786.95	-	-	
中信证券	2022060200013446	中伟股份	2022-06-02	2,016,500.00	18,500.00	14	3.50	2,744.68	-	-	
中信证券	2022060200013454	寒锐钴业	2022-06-02	386,120.00	7,000.00	14	3.10	465.49	-	-	
中	2022060600010310	宁	2022-	605,787.00	1,300.00	14	1.80	424.05	-	-	



信 证 券		德 时 代	06-06								
中 信 证 券	2022060700007568	寒 锐 钻 业	2022- 06-07	1,134,243.00	20,100.00	14	3.60	1,587.94	-	-	
中 信 证 券	2022060700009068	新 宙 邦	2022- 06-07	2,041,400.00	47,200.00	14	3.30	2,619.80	-	-	
中 信 证 券	2022060800001128	寒 锐 钻 业	2022- 06-08	667,602.00	11,700.00	14	3.40	882.72	-	-	
中 信 证 券	2022060800001131	寒 锐 钻 业	2022- 06-08	656,190.00	11,500.00	14	2.10	535.89	-	-	
中 信 证 券	2022060900006957	宁 德 时 代	2022- 06-09	905,835.00	2,100.00	14	1.80	634.08	-	-	
中 信 证 券	2022060900006961	宁 德 时 代	2022- 06-09	11,085,695.00	25,700.00	14	1.90	8,191.10	-	-	
中 信 证 券	2022060900007021	寒 锐 钻 业	2022- 06-09	111,120.00	2,000.00	14	1.80	77.78	-	-	
中 信 证 券	2022060900007037	亿 纬 锂 能	2022- 06-09	5,831,958.00	63,800.00	14	1.90	4,309.17	-	-	
中 信 证 券	2022060900007041	亿 纬 锂 能	2022- 06-09	511,896.00	5,600.00	14	1.80	358.33	-	-	
中 信 证 券	2022060900007045	新 宙 邦	2022- 06-09	114,858.00	2,700.00	14	1.80	80.40	-	-	
中 信 证 券	2022060900007047	特 锐 德	2022- 06-09	90,328.00	5,600.00	14	1.80	63.23	-	-	
中 信 证 券	2022060900007055	汇 川 技 术	2022- 06-09	1,670,809.00	25,900.00	14	1.80	1,169.57	-	-	

中信证券	2022060900007063	当升科技	2022-06-09	259,080.00	3,400.00	14	1.80	181.36	-	-
中信证券	2022060900007965	当升科技	2022-06-09	861,060.00	11,300.00	14	3.40	1,138.51	-	-
中信证券	2022061400006446	当升科技	2022-06-14	1,149,402.00	13,800.00	14	1.80	804.58	-	-
中信证券	2022061400006448	先导智能	2022-06-14	1,366,449.00	21,700.00	14	1.80	956.51	-	-
中信证券	2022061400006480	寒锐钴业	2022-06-14	671,140.00	11,500.00	14	1.80	469.80	-	-
中信证券	2022061400007708	特锐德	2022-06-14	62,244.00	3,600.00	14	3.40	82.30	-	-
中信证券	2022061400007732	新宙邦	2022-06-14	85,608.00	1,800.00	14	3.40	113.19	-	-
中信证券	2022061400007772	先导智能	2022-06-14	358,929.00	5,700.00	14	1.60	223.33	-	-
中信证券	2022061400007858	亿纬锂能	2022-06-14	695,589.00	6,900.00	14	3.20	865.62	-	-
中信证券	2022061400008242	寒锐钴业	2022-06-01	15,824.00	-	14	3.10	-	-	-
中信证券	2022061400008256	寒锐钴业	2022-06-02	3,010.00	-	14	3.10	-	-	-
中信证券	2022061400008302	寒锐钴业	2022-06-07	8,643.00	-	14	3.60	-	-	-
中信证	2022061400008313	寒锐钴	2022-06-08	5,031.00	-	14	3.40	-	-	-

券		业								
中信证 券	2022061400008315	寒 锐 钻 业	2022- 06-08	4,945.00	-	14	2.10	-	-	-
中信证 券	2022061400008334	寒 锐 钻 业	2022- 06-09	860.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证 券	2022061400008424	寒 锐 钻 业	2022- 06-14	4,945.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证 券	2022061500023151	当 升 科 技	2022- 06-15	2,323,120.00	28,400.00	14	3.40	3,071.68	-	-
中信证 券	2022061500023591	寒 锐 钻 业	2022- 06-15	2,098,704.00	36,800.00	14	3.40	2,774.95	-	-
中信证 券	2022061600014035	特 锐 德	2022- 06-16	873,286.00	51,400.00	14	3.40	1,154.68	-	-
中信证 券	2022061600014043	寒 锐 钻 业	2022- 06-16	399,700.00	7,000.00	14	3.40	528.49	-	-
中信证 券	2022061600016575	亿 纬 锂 能	2022- 06-16	95,500.00	1,000.00	14	3.20	118.84	-	-
中信证 券	2022062200002647	宁 德 时 代	2022- 06-22	25,350,000.00	50,000.00	14	3.20	31,546.67	-	-
中信证 券	2022062200002704	特 锐 德	2022- 06-22	1,993,572.00	117,200.00	14	3.30	2,558.42	-	-
中信证 券	2022062200013335	寒 锐 钻 业	2022- 06-22	650,555.00	11,500.00	14	2.10	531.29	-	-
中信证 券	2022062300001754	震 裕 科 技	2022- 06-23	154,590.00	1,000.00	28	1.80	216.43	-	-
中信	2022062300001756	中 伟	2022- 06-23	138,985.00	1,100.00	28	1.80	194.58	-	-

证券		股份								
中信证券	2022062300001758	亿纬锂能	2022-06-23	235,400.00	2,200.00	28	1.80	329.56	-	-
中信证券	2022062300001759	亿纬锂能	2022-06-23	181,900.00	1,700.00	28	1.80	254.66	-	-
中信证券	2022062300001760	先导智能	2022-06-23	2,290,848.00	33,600.00	28	1.80	3,207.19	-	-
中信证券	2022062300001779	赢合科技	2022-06-23	125,028.00	4,600.00	28	1.80	175.04	-	-
中信证券	2022062300001826	容百科技	2022-06-23	520,495.00	4,100.00	28	1.80	728.69	-	-
中信证券	2022062300001828	嘉元科技	2022-06-23	262,170.00	3,000.00	28	1.80	367.04	-	-
中信证券	2022062300001830	亿华通	2022-06-23	100,530.00	1,000.00	28	1.80	140.74	-	-
中信证券	2022062300001832	联赢激光	2022-06-23	131,364.00	3,600.00	28	1.80	183.91	-	-
中信证券	2022062300001834	天奈科技	2022-06-23	488,768.00	3,200.00	28	1.80	684.28	-	-
中信证券	2022062300007777	亿纬锂能	2022-06-23	6,826,600.00	63,800.00	14	1.90	5,044.10	-	-
中信证券	2022062300007785	亿纬锂能	2022-06-23	599,200.00	5,600.00	14	1.80	419.44	-	-
中信证券	2022062300007813	当升科技	2022-06-23	319,770.00	3,400.00	14	1.80	223.84	-	-
中	2022062300007817	汇	2022-	1,762,495.00	25,900.00	14	1.80	1,233.75	-	-

信 证 券		川 技 术	06-23								
中 信 证 券	2022062300007819	新 宙 邦	2022- 06-23	126,981.00	2,700.00	14	1.80	88.89	-	-	
中 信 证 券	2022062300007889	宁 德 时 代	2022- 06-23	1,127,637.00	2,100.00	14	1.80	789.35	-	-	
中 信 证 券	2022062300007895	寒 锐 钴 业	2022- 06-23	116,180.00	2,000.00	14	1.80	81.33	-	-	
中 信 证 券	2022062300008165	特 锐 德	2022- 06-23	99,848.00	5,600.00	14	1.80	69.89	-	-	
中 信 证 券	2022062300008419	宁 德 时 代	2022- 06-23	13,800,129.00	25,700.00	14	1.90	10,196.76	-	-	
中 信 证 券	2022062300009069	当 升 科 技	2022- 06-23	1,062,765.00	11,300.00	14	3.20	1,322.55	-	-	
中 信 证 券	2022062400009674	先 导 智 能	2022- 06-14	10,850.00	-	14	1.80	-	-	-	
中 信 证 券	2022062400009684	先 导 智 能	2022- 06-14	2,850.00	-	14	1.60	-	-	-	
中 信 证 券	2022062400009935	先 导 智 能	2022- 06-23	16,800.00	-	28	1.80	-	-	-	
中 信 证 券	2022062800001361	震 裕 科 技	2022- 06-28	144,700.00	1,000.00	14	3.40	191.33	-	-	
中 信 证 券	2022062800001362	特 锐 德	2022- 06-28	344,660.00	19,000.00	14	3.30	442.31	-	-	
中 信 证 券	2022062800001375	寒 锐 钴 业	2022- 06-28	241,520.00	4,000.00	14	3.30	309.95	-	-	

中信证券	2022062800008658	先导智能	2022-06-28	386,745.00	5,700.00	14	2.60	391.04	-	-
中信证券	2022062800008660	亿纬锂能	2022-06-28	719,877.00	6,900.00	14	2.60	727.88	-	-
中信证券	2022062800008662	特锐德	2022-06-28	65,304.00	3,600.00	14	3.30	83.81	-	-
中信证券	2022062800008664	新宙邦	2022-06-28	101,052.00	1,800.00	14	3.30	129.68	-	-
中信证券	2022062800010826	当升科技	2022-06-28	1,298,580.00	13,800.00	14	1.80	909.01	-	-
中信证券	2022062800010842	寒锐钴业	2022-06-28	694,370.00	11,500.00	14	1.80	486.06	-	-
中信证券	2022062800010844	先导智能	2022-06-28	1,472,345.00	21,700.00	14	1.80	1,030.64	-	-
中信证券	2022062800012598	汇川技术	2022-06-23	7,770.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022062800013603	联赢激光	2022-06-23	432.00	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022062900023324	当升科技	2022-06-29	2,561,112.00	28,400.00	14	3.20	3,187.16	-	-
中信证券	2022062900023326	寒锐钴业	2022-06-29	2,120,784.00	36,800.00	14	3.30	2,721.67	-	-
中信证券	2022063000021507	寒锐钴业	2022-06-30	405,440.00	7,000.00	14	3.30	520.31	-	-
中信证	2022063000021533	特锐德	2022-06-30	889,734.00	51,400.00	14	3.30	1,141.83	-	-

券										
中信证券	2022070400017601	天奈科技	2022-06-23	220.80	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022070500001021	宁德时代	2022-07-05	2,566,963.00	4,900.00	14	3.30	3,294.27	-	-
中信证券	2022070600010503	特锐德	2022-07-06	2,034,592.00	117,200.00	14	3.30	2,611.06	-	-
中信证券	2022070600011671	宁德时代	2022-07-06	26,100,000.00	50,000.00	14	3.30	33,495.00	-	-
中信证券	2022070700000962	寒锐钴业	2022-07-07	1,985,245.00	30,500.00	14	3.30	2,547.73	-	-
中信证券	2022070700000963	寒锐钴业	2022-07-07	65,090.00	1,000.00	14	3.30	83.53	-	-
中信证券	2022070700000974	中伟股份	2022-07-07	146,520.00	1,100.00	28	1.80	205.13	-	-
中信证券	2022070700000976	新宙邦	2022-07-07	173,088.00	3,200.00	28	1.80	242.32	-	-
中信证券	2022070700000980	当升科技	2022-07-07	238,040.00	2,200.00	28	1.80	333.26	-	-
中信证券	2022070700000983	宁德时代	2022-07-07	3,190,000.00	5,800.00	28	1.80	4,466.00	-	-
中信证券	2022070700000989	亿纬锂能	2022-07-07	728,000.00	7,000.00	28	1.80	1,019.20	-	-
中信证券	2022070700001012	先导智能	2022-07-07	429,760.00	6,800.00	28	1.80	601.66	-	-
中信	2022070700006302	亿纬	2022-07-07	6,635,200.00	63,800.00	14	1.90	4,902.68	-	-

证券		锂能									
中信证券	2022070700006306	宁德时代	2022-07-07	14,135,000.00	25,700.00	14	1.90	10,444.19	-	-	
中信证券	2022070700007050	当升科技	2022-07-07	1,222,660.00	11,300.00	14	3.10	1,473.98	-	-	
中信证券	2022070700007100	宁德时代	2022-07-07	1,155,000.00	2,100.00	14	1.80	808.50	-	-	
中信证券	2022070700007122	寒锐钴业	2022-07-07	130,180.00	2,000.00	14	1.80	91.13	-	-	
中信证券	2022070700007932	特锐德	2022-07-07	104,104.00	5,600.00	14	1.80	72.87	-	-	
中信证券	2022070700008008	亿纬锂能	2022-07-07	582,400.00	5,600.00	14	1.80	407.68	-	-	
中信证券	2022070700008010	汇川技术	2022-07-07	1,666,147.00	25,900.00	14	1.80	1,166.30	-	-	
中信证券	2022070700008012	当升科技	2022-07-07	367,880.00	3,400.00	14	1.80	257.52	-	-	
中信证券	2022070700008016	新宙邦	2022-07-07	146,043.00	2,700.00	14	1.80	102.23	-	-	
中信证券	2022070700011296	亿纬锂能	2022-06-23	352.00	-	28	1.80	-	-	-	
中信证券	2022070700011297	亿纬锂能	2022-06-23	272.00	-	28	1.80	-	-	-	
中信证券	2022070700011355	亿纬锂能	2022-06-28	1,104.00	-	14	2.60	-	-	-	
中	2022070700011668	亿	2022-	1,120.00	-	28	1.80	-	-	-	



信 证 券		纬 锂 能	07-07								
中 信 证 券	2022070700011673	亿 纬 锂 能	2022- 07-07	10,208.00	-	14	1.90	-	-	-	
中 信 证 券	2022070700011691	亿 纬 锂 能	2022- 07-07	896.00	-	14	1.80	-	-	-	
中 信 证 券	2022071200009063	新 宙 邦	2022- 07-12	88,164.00	1,800.00	14	3.20	109.72	-	-	
中 信 证 券	2022071200009065	特 锐 德	2022- 07-12	64,584.00	3,600.00	14	3.40	85.39	-	-	
中 信 证 券	2022071200009621	先 导 智 能	2022- 07-12	340,860.00	5,700.00	14	2.10	278.37	-	-	
中 信 证 券	2022071200009625	亿 纬 锂 能	2022- 07-12	642,183.00	6,900.00	14	1.70	424.55	-	-	
中 信 证 券	2022071200010089	特 锐 德	2022- 07-12	340,860.00	19,000.00	14	3.40	450.69	-	-	
中 信 证 券	2022071200010091	震 裕 科 技	2022- 07-12	137,050.00	1,000.00	14	3.60	191.87	-	-	
中 信 证 券	2022071200010095	寒 锐 钻 业	2022- 07-12	229,640.00	4,000.00	14	3.30	294.70	-	-	
中 信 证 券	2022071300001146	天 华 超 净	2022- 07-13	2,010,091.00	23,300.00	14	3.70	2,892.30	-	-	
中 信 证 券	2022071300001225	联 赢 激 光	2022- 07-13	2,047,995.00	64,100.00	14	2.50	1,991.11	-	-	
中 信 证 券	2022071300001243	容 百 科 技	2022- 07-13	1,993,376.00	15,400.00	14	3.00	2,325.61	-	-	

中信证券	2022071300025528	当升科技	2022-07-13	2,913,840.00	28,400.00	14	3.10	3,512.80	-	-
中信证券	2022071300025530	寒锐钴业	2022-07-13	2,111,952.00	36,800.00	14	3.30	2,710.34	-	-
中信证券	2022071400001238	特锐德	2022-07-14	49,426.00	2,600.00	14	3.30	63.43	-	-
中信证券	2022071400001242	新宙邦	2022-07-14	1,243,154.00	24,200.00	14	3.00	1,450.35	-	-
中信证券	2022071400001258	德方纳米	2022-07-14	1,217,990.00	3,100.00	14	3.70	1,752.55	-	-
中信证券	2022071400001278	亿纬锂能	2022-07-14	1,293,345.00	12,300.00	14	2.40	1,207.12	-	-
中信证券	2022071400001287	寒锐钴业	2022-07-14	58,080.00	1,000.00	14	3.50	79.05	-	-
中信证券	2022071400001306	德方纳米	2022-07-14	2,043,080.00	5,200.00	14	3.70	2,939.77	-	-
中信证券	2022071400001316	新宙邦	2022-07-14	821,920.00	16,000.00	14	3.00	958.91	-	-
中信证券	2022071400012164	特锐德	2022-07-14	977,114.00	51,400.00	14	3.40	1,291.96	-	-
中信证券	2022071400013308	寒锐钴业	2022-07-14	406,560.00	7,000.00	14	3.30	521.75	-	-
中信证券	2022071900008200	宁德时代	2022-07-19	2,570,589.00	4,900.00	14	3.80	3,798.76	-	-
中信证	2022072000000947	特锐德	2022-07-20	1,564,800.00	80,000.00	14	3.30	2,008.16	-	-

券										
中信证券	2022072000011851	特锐德	2022-07-20	2,292,432.00	117,200.00	14	3.30	2,941.95	-	-
中信证券	2022072000011857	宁德时代	2022-07-20	26,300,000.00	50,000.00	14	3.80	38,865.56	-	-
中信证券	2022072100001194	震裕科技	2022-07-21	563,600.00	4,000.00	14	3.70	810.96	-	-
中信证券	2022072100001196	特锐德	2022-07-21	2,050,244.00	103,600.00	14	3.30	2,631.15	-	-
中信证券	2022072100001198	天华超净	2022-07-21	1,905,600.00	24,000.00	14	3.90	2,890.16	-	-
中信证券	2022072100001212	德方纳米	2022-07-21	2,042,550.00	5,400.00	14	3.70	2,939.00	-	-
中信证券	2022072100009278	中伟股份	2022-07-21	160,182.00	1,100.00	28	1.80	224.25	-	-
中信证券	2022072100009288	亿纬锂能	2022-07-21	166,600.00	1,700.00	28	1.80	233.24	-	-
中信证券	2022072100009294	亿纬锂能	2022-07-21	215,600.00	2,200.00	28	1.80	301.84	-	-
中信证券	2022072100009296	先导智能	2022-07-21	2,081,520.00	33,600.00	28	1.80	2,914.13	-	-
中信证券	2022072100009308	寒锐钴业	2022-07-21	1,724,470.00	30,500.00	14	3.50	2,347.20	-	-
中信证券	2022072100009352	嘉元科技	2022-07-21	247,800.00	3,000.00	28	1.80	346.92	-	-
中信	2022072100009354	亿华	2022-07-21	107,780.00	1,000.00	28	1.80	150.89	-	-

通										
中信证券	2022072100009356	容百科技	2022-07-21	608,850.00	4,100.00	28	1.80	852.39	-	-
中信证券	2022072100009360	联赢激光	2022-07-21	121,392.00	3,600.00	28	1.80	169.95	-	-
中信证券	2022072100009364	赢合科技	2022-07-21	133,354.00	4,600.00	28	1.80	186.70	-	-
中信证券	2022072100009368	宁德时代	2022-07-21	13,389,700.00	25,700.00	14	1.90	9,893.50	-	-
中信证券	2022072100009370	亿纬锂能	2022-07-21	6,252,400.00	63,800.00	14	1.90	4,619.83	-	-
中信证券	2022072100009396	震裕科技	2022-07-21	140,900.00	1,000.00	28	1.80	197.26	-	-
中信证券	2022072100009398	天奈科技	2022-07-21	502,496.00	3,200.00	28	1.80	703.49	-	-
中信证券	2022072100009424	当升科技	2022-07-21	1,220,400.00	11,300.00	14	3.10	1,471.26	-	-
中信证券	2022072100010124	寒锐钴业	2022-07-21	113,080.00	2,000.00	14	1.80	79.16	-	-
中信证券	2022072100010126	宁德时代	2022-07-21	1,094,100.00	2,100.00	14	1.80	765.87	-	-
中信证券	2022072100010238	特锐德	2022-07-21	110,824.00	5,600.00	14	1.80	77.58	-	-
中信证券	2022072100010280	当升科技	2022-07-21	367,200.00	3,400.00	14	1.80	257.04	-	-
中	2022072100010282	新	2022-	128,250.00	2,700.00	14	1.80	89.78	-	-

信 证 券		宙邦	07-21								
中 信 证 券	2022072100010284	亿纬 锂能	2022- 07-21	548,800.00	5,600.00	14	1.80	384.16	-	-	
中 信 证 券	2022072100010286	汇川 技术	2022- 07-21	1,631,182.00	25,900.00	14	1.80	1,141.83	-	-	
中 信 证 券	2022072600012654	特锐 德	2022- 07-26	352,450.00	19,000.00	14	3.30	452.31	-	-	
中 信 证 券	2022072600012656	寒锐 钴业	2022- 07-26	221,760.00	4,000.00	14	3.30	284.59	-	-	
中 信 证 券	2022072600012662	特锐 德	2022- 07-26	66,780.00	3,600.00	14	3.30	85.70	-	-	
中 信 证 券	2022072600012666	亿纬 锂能	2022- 07-26	671,163.00	6,900.00	14	4.50	1,174.54	-	-	
中 信 证 券	2022072600012668	震裕 科技	2022- 07-26	135,480.00	1,000.00	14	3.70	194.94	-	-	
中 信 证 券	2022072600012670	新宙 邦	2022- 07-26	83,664.00	1,800.00	14	3.20	104.12	-	-	
中 信 证 券	2022072600012672	先导 智能	2022- 07-26	360,126.00	5,700.00	14	2.30	322.11	-	-	
中 信 证 券	2022072700001564	联赢 激光	2022- 07-27	4,096,176.00	116,800.00	14	3.40	5,416.05	-	-	
中 信 证 券	2022072700027730	联赢 激光	2022- 07-27	2,247,987.00	64,100.00	14	3.00	2,622.65	-	-	
中 信 证 券	2022072700027732	容百 科技	2022- 07-27	2,205,742.00	15,400.00	14	3.20	2,744.92	-	-	

中信证券	2022072700027738	天华超净	2022-07-27	1,861,903.00	23,300.00	14	3.90	2,823.89	-	-
中信证券	2022072700027740	寒锐钴业	2022-07-27	2,021,424.00	36,800.00	14	3.30	2,594.16	-	-
中信证券	2022072700027742	当升科技	2022-07-27	2,804,500.00	28,400.00	14	3.20	3,490.04	-	-
中信证券	2022072800001138	特锐德	2022-07-28	1,144,970.00	61,000.00	14	3.30	1,469.38	-	-
中信证券	2022072800001206	亿华通	2022-07-28	1,990,220.00	19,100.00	14	3.80	2,941.10	-	-
中信证券	2022072800014501	特锐德	2022-07-28	48,802.00	2,600.00	14	3.30	62.63	-	-
中信证券	2022072800014503	特锐德	2022-07-28	964,778.00	51,400.00	14	3.30	1,238.13	-	-
中信证券	2022072800014505	亿纬锂能	2022-07-28	1,183,014.00	12,300.00	14	4.50	2,070.27	-	-
中信证券	2022072800014511	新宙邦	2022-07-28	1,101,100.00	24,200.00	14	3.20	1,370.26	-	-
中信证券	2022072800014515	德方纳米	2022-07-28	1,854,996.00	5,200.00	14	3.70	2,669.13	-	-
中信证券	2022072800014517	德方纳米	2022-07-28	1,105,863.00	3,100.00	14	3.70	1,591.21	-	-
中信证券	2022072800015801	寒锐钴业	2022-07-28	385,280.00	7,000.00	14	3.30	494.44	-	-
中信证	2022080300001885	赢合科	2022-08-03	6,518,900.00	235,000.00	14	3.20	8,112.41	-	-

券		技								
中信证 券	2022080300014365	特 锐 德	2022- 08-03	2,052,172.00	117,200.00	14	3.30	2,633.62	-	-
中信证 券	2022080300015143	特 锐 德	2022- 08-03	1,400,800.00	80,000.00	14	3.30	1,797.69	-	-
中信证 券	2022080300015157	宁 德 时 代	2022- 08-03	25,200,000.00	50,000.00	14	3.60	35,280.00	-	-
中信证 券	2022080400002471	当 升 科 技	2022- 08-04	374,120.00	4,000.00	14	3.10	451.02	-	-
中信证 券	2022080400002480	德 方 纳 米	2022- 08-04	1,889,000.00	5,000.00	14	3.60	2,644.60	-	-
中信证 券	2022080400012306	特 锐 德	2022- 08-04	1,854,440.00	103,600.00	14	3.30	2,379.86	-	-
中信证 券	2022080400012388	寒 锐 钴 业	2022- 08-04	1,621,075.00	30,500.00	14	3.40	2,143.42	-	-
中信证 券	2022080400012396	当 升 科 技	2022- 08-04	1,056,889.00	11,300.00	14	3.10	1,274.14	-	-
中信证 券	2022080400013018	先 导 智 能	2022- 08-04	396,508.00	6,800.00	28	1.80	555.11	-	-
中信证 券	2022080400013038	宁 德 时 代	2022- 08-04	2,905,220.00	5,800.00	28	1.80	4,067.31	-	-
中信证 券	2022080400013068	中 伟 股 份	2022- 08-04	132,220.00	1,100.00	28	1.80	185.11	-	-
中信证 券	2022080400013072	当 升 科 技	2022- 08-04	205,766.00	2,200.00	28	1.80	288.07	-	-
中信	2022080400013086	亿 纬	2022- 08-04	670,740.00	7,000.00	28	1.80	939.04	-	-

证 券		锂 能									
中 信 证 券	2022080400013090	新 宙 邦	2022- 08-04	142,656.00	3,200.00	28	1.80	199.72	-	-	
中 信 证 券	2022080400014940	宁 德 时 代	2022- 08-04	12,873,130.00	25,700.00	14	1.90	9,511.81	-	-	
中 信 证 券	2022080400014942	亿 纬 锂 能	2022- 08-04	6,113,316.00	63,800.00	14	1.90	4,517.06	-	-	
中 信 证 券	2022080400015010	寒 锐 钻 业	2022- 08-04	106,300.00	2,000.00	14	1.80	74.41	-	-	
中 信 证 券	2022080400015012	宁 德 时 代	2022- 08-04	1,051,890.00	2,100.00	14	1.80	736.32	-	-	
中 信 证 券	2022080400015030	特 锐 德	2022- 08-04	100,240.00	5,600.00	14	1.80	70.17	-	-	
中 信 证 券	2022080400015066	当 升 科 技	2022- 08-04	318,002.00	3,400.00	14	1.80	222.60	-	-	
中 信 证 券	2022080400015068	新 宙 邦	2022- 08-04	120,366.00	2,700.00	14	1.80	84.26	-	-	
中 信 证 券	2022080400015074	亿 纬 锂 能	2022- 08-04	536,592.00	5,600.00	14	1.80	375.61	-	-	
中 信 证 券	2022080400015076	汇 川 技 术	2022- 08-04	1,687,126.00	25,900.00	14	1.80	1,180.99	-	-	
中 信 证 券	2022080900001419	中 伟 股 份	2022- 08-09	625,250.00	5,000.00	14	4.50	1,094.19	-	-	
中 信 证 券	2022080900001427	特 锐 德	2022- 08-09	310,080.00	17,000.00	14	3.30	397.94	-	-	
中 信 证 券	2022080900001463	杭	2022-	71,470.00	1,000.00	14	3.00	83.38	-	-	



信 证 券		可 科 技	08-09								
中 信 证 券	2022080900014178	新 宙 邦	2022- 08-09	88,506.00	1,800.00	14	3.00	103.26	-	-	
中 信 证 券	2022080900014228	特 锐 德	2022- 08-09	65,664.00	3,600.00	14	3.30	84.27	-	-	
中 信 证 券	2022080900014230	特 锐 德	2022- 08-09	346,560.00	19,000.00	14	3.30	444.75	-	-	
中 信 证 券	2022080900014236	亿 纬 锂 能	2022- 08-09	678,822.00	6,900.00	14	2.30	607.17	-	-	
中 信 证 券	2022081000030020	联 赢 激 光	2022- 08-10	4,694,192.00	116,800.00	14	3.50	6,389.32	-	-	
中 信 证 券	2022081000032474	寒 锐 钻 业	2022- 08-10	2,082,512.00	36,800.00	14	3.40	2,753.54	-	-	
中 信 证 券	2022081000032736	联 赢 激 光	2022- 08-10	2,576,179.00	64,100.00	14	3.50	3,506.47	-	-	
中 信 证 券	2022081000032776	当 升 科 技	2022- 08-10	2,672,724.00	28,400.00	14	3.10	3,222.12	-	-	
中 信 证 券	2022081000032856	天 华 超 净	2022- 08-10	1,841,865.00	23,300.00	14	3.70	2,650.24	-	-	
中 信 证 券	2022081100012244	亿 华 通	2022- 08-11	2,135,762.00	19,100.00	14	3.40	2,823.95	-	-	
中 信 证 券	2022081100012286	亿 纬 锂 能	2022- 08-11	1,212,534.00	12,300.00	14	2.30	1,084.54	-	-	
中 信 证 券	2022081100012316	特 锐 德	2022- 08-11	948,844.00	51,400.00	14	3.30	1,217.68	-	-	

中信证券	2022081100014430	特锐德	2022-08-11	1,126,060.00	61,000.00	14	3.30	1,445.11	-	-
中信证券	2022081100014476	德方纳米	2022-08-11	1,987,908.00	5,200.00	14	3.60	2,783.07	-	-
中信证券	2022081100014478	德方纳米	2022-08-11	1,185,099.00	3,100.00	14	3.60	1,659.14	-	-
中信证券	2022081100014612	寒锐钴业	2022-08-11	397,040.00	7,000.00	14	3.40	524.98	-	-
中信证券	2022081100014616	特锐德	2022-08-11	47,996.00	2,600.00	14	3.30	61.59	-	-
中信证券	2022081100014626	新宙邦	2022-08-11	1,261,304.00	24,200.00	14	3.00	1,471.52	-	-
中信证券	2022081700016449	特锐德	2022-08-17	2,204,532.00	117,200.00	14	3.30	2,829.15	-	-
中信证券	2022081700016451	特锐德	2022-08-17	1,504,800.00	80,000.00	14	3.30	1,931.16	-	-
中信证券	2022081700016471	赢合科技	2022-08-17	7,501,200.00	235,000.00	14	3.40	9,918.25	-	-
中信证券	2022081800013171	寒锐钴业	2022-08-18	1,706,475.00	30,500.00	14	3.20	2,123.61	-	-
中信证券	2022081800014937	寒锐钴业	2022-08-18	111,900.00	2,000.00	14	1.80	78.33	-	-
中信证券	2022081800014939	特锐德	2022-08-18	106,624.00	5,600.00	14	1.80	74.64	-	-
中信证	2022081800014945	亿纬锂	2022-08-18	633,528.00	5,600.00	14	1.80	443.47	-	-

券		能								
中信	2022081800015031	当	2022-	298,724.00	3,400.00	14	1.80	209.11	-	-
证		升	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015045	汇	2022-	1,684,018.00	25,900.00	14	1.80	1,178.81	-	-
证		川	08-18							
券		技								
		术								
中信	2022081800015097	中	2022-	123,816.00	1,100.00	28	1.80	173.34	-	-
证		伟	08-18							
券		股								
		份								
中信	2022081800015099	亿	2022-	248,886.00	2,200.00	28	1.80	348.44	-	-
证		纬	08-18							
券		锂								
		能								
中信	2022081800015101	嘉	2022-	205,650.00	3,000.00	28	1.80	287.91	-	-
证		元	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015103	亿	2022-	106,800.00	1,000.00	28	1.80	149.52	-	-
证		华	08-18							
券		通								
中信	2022081800015105	容	2022-	462,480.00	4,100.00	28	1.80	647.47	-	-
证		百	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015107	联	2022-	150,840.00	3,600.00	28	1.80	211.18	-	-
证		赢	08-18							
券		激								
		光								
中信	2022081800015109	赢	2022-	149,408.00	4,600.00	28	1.80	209.17	-	-
证		合	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015111	震	2022-	136,330.00	1,000.00	28	1.80	190.86	-	-
证		裕	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015113	天	2022-	416,000.00	3,200.00	28	1.80	582.40	-	-
证		奈	08-18							
券		科								
		技								
中信	2022081800015125	宁	2022-	1,144,080.00	2,100.00	14	1.80	800.86	-	-
证		德	08-18							
券		时								
		代								
中信	2022081800015145	新	2022-	134,919.00	2,700.00	14	1.80	94.44	-	-
证		宙	08-18							
券										

证 券		邦									
中 信 证 券	2022081800015169	德 方 纳 米	2022- 08-18	1,813,700.00	5,000.00	14	3.60	2,539.18	-	-	
中 信 证 券	2022081800015233	特 锐 德	2022- 08-18	1,972,544.00	103,600.00	14	3.30	2,531.43	-	-	
中 信 证 券	2022081800015295	当 升 科 技	2022- 08-18	992,818.00	11,300.00	14	3.20	1,235.51	-	-	
中 信 证 券	2022082300001842	寒 锐 钻 业	2022- 08-23	565,300.00	10,000.00	14	3.40	747.45	-	-	
中 信 证 券	2022082300015590	特 锐 德	2022- 08-23	71,316.00	3,600.00	14	3.20	88.75	-	-	
中 信 证 券	2022082300015644	亿 纬 锂 能	2022- 08-23	813,372.00	6,900.00	14	2.30	727.52	-	-	
中 信 证 券	2022082300015648	杭 可 科 技	2022- 08-23	73,810.00	1,000.00	14	2.90	83.24	-	-	
中 信 证 券	2022082300015694	新 宙 邦	2022- 08-23	88,830.00	1,800.00	14	3.10	107.09	-	-	
中 信 证 券	2022082400026847	联 赢 激 光	2022- 08-24	5,256,000.00	116,800.00	14	3.60	7,358.40	-	-	
中 信 证 券	2022082400026963	联 赢 激 光	2022- 08-24	2,884,500.00	64,100.00	14	3.60	4,038.30	-	-	
中 信 证 券	2022082400027019	寒 锐 钻 业	2022- 08-24	1,954,816.00	36,800.00	14	3.30	2,508.68	-	-	
中 信 证 券	2022082500001494	联 赢 激 光	2022- 08-25	245,280.00	6,000.00	14	3.50	333.85	-	-	
中	2022082500010546	寒	2022-	364,210.00	7,000.00	14	3.30	467.40	-	-	

信 证 券		锐 钻 业	08-25								
中 信 证 券	2022082500014550	德 方 纳 米	2022- 08-25	1,126,323.00	3,100.00	14	3.20	1,401.65	-	-	
中 信 证 券	2022082500014572	特 锐 德	2022- 08-25	991,506.00	51,400.00	14	3.20	1,233.87	-	-	
中 信 证 券	2022082500014576	特 锐 德	2022- 08-25	50,154.00	2,600.00	14	3.20	62.41	-	-	
中 信 证 券	2022082500014578	亿 纬 锂 能	2022- 08-25	1,289,655.00	12,300.00	14	2.30	1,153.52	-	-	
中 信 证 券	2022082500014592	新 宙 邦	2022- 08-25	1,094,324.00	24,200.00	14	3.10	1,319.27	-	-	
中 信 证 券	2022082500014616	亿 华 通	2022- 08-25	1,877,339.00	19,100.00	14	3.40	2,482.26	-	-	
中 信 证 券	2022082500016278	赢 合 科 技	2022- 08-17	23,543.69	-	14	3.40	-	-	-	
中 信 证 券	2022082500016302	赢 合 科 技	2022- 08-18	460.86	-	28	1.80	-	-	-	
中 信 证 券	2022083100015962	特 锐 德	2022- 08-31	1,368,000.00	80,000.00	14	3.00	1,596.00	-	-	
中 信 证 券	2022083100019426	赢 合 科 技	2022- 08-31	6,366,150.00	235,000.00	14	3.30	8,169.89	-	-	
中 信 证 券	2022090100001086	宁 德 时 代	2022- 09-01	467,540.00	1,000.00	14	3.30	600.01	-	-	
中 信 证 券	2022090100013562	新 宙 邦	2022- 09-01	111,780.00	2,700.00	14	1.80	78.25	-	-	

中信证券	2022090100013608	当升科技	2022-09-01	263,738.00	3,400.00	14	1.80	184.62	-	-
中信证券	2022090100015234	宁德时代	2022-09-01	2,711,732.00	5,800.00	28	1.80	3,796.42	-	-
中信证券	2022090100015406	德方纳米	2022-09-01	1,598,600.00	5,000.00	14	3.30	2,051.54	-	-
中信证券	2022090100015504	宁德时代	2022-09-01	981,834.00	2,100.00	14	1.80	687.28	-	-
中信证券	2022090100017304	中伟股份	2022-09-01	101,486.00	1,100.00	28	1.80	142.08	-	-
中信证券	2022090100017788	汇川技术	2022-09-01	1,482,257.00	25,900.00	14	1.80	1,037.58	-	-
中信证券	2022090100017844	特锐德	2022-09-01	93,576.00	5,600.00	14	1.80	65.50	-	-
中信证券	2022090100018630	寒锐钴业	2022-09-01	97,180.00	2,000.00	14	1.80	68.03	-	-
中信证券	2022090100018640	亿纬锂能	2022-09-01	529,704.00	5,600.00	14	1.80	370.79	-	-
中信证券	2022090100018704	当升科技	2022-09-01	170,654.00	2,200.00	28	1.80	238.92	-	-
中信证券	2022090100018710	亿纬锂能	2022-09-01	662,130.00	7,000.00	28	1.80	926.98	-	-
中信证券	2022090100018712	新宙邦	2022-09-01	132,480.00	3,200.00	28	1.80	185.47	-	-
中信证	2022090100018714	先导智	2022-09-01	365,908.00	6,800.00	28	1.80	512.27	-	-

券		能								
中信证	2022090600014147	寒	2022-	512,700.00	10,000.00	14	3.10	618.09	-	-
券		锐	09-06							
中信证	2022090600014171	亿	2022-	654,120.00	6,900.00	14	3.00	763.14	-	-
券		纬	09-06							
中信证	2022090600016929	特	2022-	61,740.00	3,600.00	14	3.30	79.23	-	-
券		锐	09-06							
中信证	2022090700029818	联	2022-	2,621,690.00	64,100.00	14	3.50	3,568.41	-	-
券		赢	09-07							
中信证	2022090700034160	联	2022-	4,777,120.00	116,800.00	14	3.50	6,502.19	-	-
券		赢	09-07							
中信证	2022090800001157	容	2022-	100,500.00	1,000.00	14	2.50	97.71	-	-
券		百	09-08							
中信证	2022090800011242	亿	2022-	1,168,500.00	12,300.00	14	3.00	1,363.25	-	-
券		纬	09-08							
中信证	2022090800011282	联	2022-	237,960.00	6,000.00	14	3.50	323.89	-	-
券		赢	09-08							
中信证	2022090800011330	亿	2022-	2,037,970.00	19,100.00	14	3.20	2,536.14	-	-
券		华	09-08							
中信证	2022090800011386	新	2022-	1,014,222.00	24,200.00	14	3.20	1,262.14	-	-
券		宙	09-08							
中信证	2022090800011420	特	2022-	858,894.00	51,400.00	14	3.30	1,102.25	-	-
券		锐	09-08							
中信证	2022090800011422	特	2022-	43,446.00	2,600.00	14	3.30	55.76	-	-
券		锐	09-08							
中信	2022090800015322	德	2022-	976,500.00	3,100.00	14	5.70	2,164.58	-	-
券		方	09-08							

证券		纳									
中信证券	2022091400017936	特锐德	2022-09-14	1,283,200.00	80,000.00	14	3.40	1,696.68	-	-	
中信证券	2022091400017952	赢合科技	2022-09-14	6,081,800.00	235,000.00	14	3.40	8,041.49	-	-	
中信证券	2022091500001370	天华超净	2022-09-15	375,500.00	5,000.00	14	4.20	613.32	-	-	
中信证券	2022091500016081	德方纳米	2022-09-15	1,532,500.00	5,000.00	14	5.50	3,277.85	-	-	
中信证券	2022091500016345	嘉元科技	2022-09-15	176,430.00	3,000.00	28	1.80	247.00	-	-	
中信证券	2022091500016353	天奈科技	2022-09-15	375,680.00	3,200.00	28	1.80	525.95	-	-	
中信证券	2022091500016379	联赢激光	2022-09-15	135,360.00	3,600.00	28	1.80	189.50	-	-	
中信证券	2022091500016381	赢合科技	2022-09-15	113,160.00	4,600.00	28	1.80	158.42	-	-	
中信证券	2022091500016407	中伟股份	2022-09-15	97,900.00	1,100.00	28	1.80	137.06	-	-	
中信证券	2022091500016415	亿华通	2022-09-15	97,910.00	1,000.00	28	1.80	137.07	-	-	
中信证券	2022091500017519	亿纬锂能	2022-09-15	474,376.00	5,600.00	14	1.80	332.06	-	-	
中信证券	2022091500017537	容百科技	2022-09-15	379,045.00	4,100.00	28	1.80	530.66	-	-	
中	2022091500017539	震	2022-	97,580.00	1,000.00	28	1.80	136.61	-	-	



信 证 券		裕 科 技	09-15								
中 信 证 券	2022091500017553	亿 纬 锂 能	2022- 09-15	186,362.00	2,200.00	28	1.80	260.91	-	-	
中 信 证 券	2022091500017565	当 升 科 技	2022- 09-15	247,078.00	3,400.00	14	1.80	172.95	-	-	
中 信 证 券	2022091500017569	汇 川 技 术	2022- 09-15	1,488,214.00	25,900.00	14	1.80	1,041.75	-	-	
中 信 证 券	2022091500017643	特 锐 德	2022- 09-15	86,352.00	5,600.00	14	1.80	60.45	-	-	
中 信 证 券	2022091500018095	寒 锐 钻 业	2022- 09-15	98,860.00	2,000.00	14	1.80	69.20	-	-	
中 信 证 券	2022091500018197	宁 德 时 代	2022- 09-15	870,135.00	2,100.00	14	1.80	609.09	-	-	
中 信 证 券	2022091500018223	新 宙 邦	2022- 09-15	107,568.00	2,700.00	14	1.80	75.30	-	-	
中 信 证 券	2022092000001390	嘉 元 科 技	2022- 09-20	56,300.00	1,000.00	14	3.80	118.86	-	-	
中 信 证 券	2022092000001439	嘉 元 科 技	2022- 09-20	2,021,170.00	35,900.00	14	3.80	4,266.91	-	-	
中 信 证 券	2022092000017099	亿 纬 锂 能	2022- 09-20	587,742.00	6,900.00	14	2.30	751.00	-	-	
中 信 证 券	2022092000017133	寒 锐 钻 业	2022- 09-20	499,700.00	10,000.00	14	3.20	888.36	-	-	
中 信 证 券	2022092000017223	特 锐 德	2022- 09-20	54,000.00	3,600.00	14	3.20	96.00	-	-	

中信证券	2022092100029730	联赢激光	2022-09-21	4,697,696.00	116,800.00	14	3.30	8,181.82	-	-
中信证券	2022092100029732	联赢激光	2022-09-21	2,578,102.00	64,100.00	14	3.30	4,490.19	-	-
中信证券	2022092200013227	亿华通	2022-09-22	1,723,202.00	19,100.00	14	3.50	3,015.60	-	-
中信证券	2022092200013267	亿纬锂能	2022-09-22	1,089,780.00	12,300.00	14	2.30	1,253.25	-	-
中信证券	2022092200013335	新宙邦	2022-09-22	1,017,852.00	24,200.00	14	3.00	1,526.77	-	-
中信证券	2022092200013783	特锐德	2022-09-22	768,944.00	51,400.00	14	3.20	1,230.31	-	-
中信证券	2022092200013809	德方纳米	2022-09-22	941,346.00	3,100.00	14	3.00	1,412.02	-	-
中信证券	2022092700001114	新宙邦	2022-09-27	115,992.00	2,700.00	14	1.80	81.19	-	-
中信证券	2022092700001115	寒锐钴业	2022-09-27	95,080.00	2,000.00	14	1.80	66.56	-	-
中信证券	2022092700001122	赢合科技	2022-09-27	2,075,826.00	83,400.00	14	3.10	2,502.52	-	-
中信证券	2022092700001123	当升科技	2022-09-27	241,400.00	3,400.00	14	1.80	168.98	-	-
中信证券	2022092700001148	特锐德	2022-09-27	85,960.00	5,600.00	14	1.80	60.17	-	-
中信证	2022092700001210	亿华通	2022-09-27	168,188.00	1,900.00	14	3.40	222.38	-	-

券										
中信证券	2022092700030729	宁德时代	2022-09-01	3,786.24	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022092700030842	宁德时代	2022-09-15	1,370.88	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022092800001108	嘉元科技	2022-09-28	2,169,200.00	40,000.00	14	3.70	3,121.24	-	-
中信证券	2022092800015889	赢合科技	2022-09-28	5,623,550.00	235,000.00	14	3.00	6,560.81	-	-
中信证券	2022092800015951	特锐德	2022-09-28	1,208,000.00	80,000.00	14	3.00	1,409.33	-	-
中信证券	2022092900016175	新宙邦	2022-09-29	135,456.00	3,200.00	28	1.80	189.64	-	-
中信证券	2022092900016179	当升科技	2022-09-29	34,470.00	2,200.00	28	1.80	212.34	-	-
中信证券	2022092900016187	亿纬锂能	2022-09-29	610,260.00	7,000.00	28	1.80	854.36	-	-
中信证券	2022092900016591	中伟股份	2022-09-29	93,852.00	1,100.00	28	1.80	131.39	-	-
中信证券	2022092900016603	宁德时代	2022-09-29	2,430,200.00	5,800.00	28	1.80	3,402.28	-	-
中信证券	2022092900016607	先导智能	2022-09-29	341,224.00	6,800.00	28	1.80	477.71	-	-
中信证券	2022101000079971	新宙邦	2022-10-10	1,002,848.00	24,200.00	14	2.60	1,013.99	-	-
中信	2022101000080971	嘉元	2022-10-10	1,770,947.00	35,900.00	14	3.70	2,548.20	-	-

证券		科技									
中信证券	2022101000080977	嘉元科技	2022-10-10	49,330.00	1,000.00	14	3.70	70.98	-	-	
中信证券	2022101000081053	亿纬锂能	2022-10-10	1,009,830.00	12,300.00	14	3.20	1,256.68	-	-	
中信证券	2022101000081097	亿华通	2022-10-10	1,583,008.00	19,100.00	14	3.40	2,093.09	-	-	
中信证券	2022101000082025	联赢激光	2022-10-10	2,381,315.00	64,100.00	14	3.50	3,241.23	-	-	
中信证券	2022101000082031	联赢激光	2022-10-10	4,339,120.00	116,800.00	14	3.50	5,906.02	-	-	
中信证券	2022101000095177	亿纬锂能	2022-10-10	566,490.00	6,900.00	14	3.20	704.97	-	-	
中信证券	2022101000102775	特锐德	2022-10-10	50,940.00	3,600.00	14	3.00	59.43	-	-	
中信证券	2022101000103685	德方纳米	2022-10-10	841,836.00	3,100.00	14	2.80	916.67	-	-	
中信证券	2022101000103701	特锐德	2022-10-10	727,310.00	51,400.00	14	3.00	848.53	-	-	
中信证券	2022101000107283	寒锐钴业	2022-10-10	427,700.00	10,000.00	14	3.20	532.25	-	-	
中信证券	2022101100002634	亿华通	2022-10-11	586,800.00	7,200.00	28	3.10	1,414.84	-	-	
中信证券	2022101100024245	赢合科技	2022-10-11	1,954,896.00	83,400.00	14	3.10	2,356.74	-	-	
中	2022101100024265	亿	2022-	154,850.00	1,900.00	14	3.40	204.75	-	-	

信 证 券		华 通	10-11								
中 信 证 券	2022101100027993	特 锐 德	2022- 10-11	80,416.00	5,600.00	14	1.80	56.29	-	-	
中 信 证 券	2022101100028005	新 宙 邦	2022- 10-11	115,911.00	2,700.00	14	1.80	81.14	-	-	
中 信 证 券	2022101100028007	寒 锐 钴 业	2022- 10-11	86,580.00	2,000.00	14	1.80	60.61	-	-	
中 信 证 券	2022101100028221	当 升 科 技	2022- 10-11	222,088.00	3,400.00	14	1.80	155.46	-	-	
中 信 证 券	2022101200002466	联 赢 激 光	2022- 10-12	289,340.00	7,400.00	28	3.40	765.14	-	-	
中 信 证 券	2022101200019016	特 锐 德	2022- 10-12	1,194,400.00	80,000.00	14	3.00	1,393.47	-	-	
中 信 证 券	2022101200019216	嘉 元 科 技	2022- 10-12	2,156,000.00	40,000.00	14	3.70	3,102.24	-	-	
中 信 证 券	2022101200019514	赢 合 科 技	2022- 10-12	5,886,750.00	235,000.00	14	3.10	7,096.80	-	-	
中 信 证 券	2022101300001174	联 赢 激 光	2022- 10-13	307,280.00	8,000.00	14	3.50	418.24	-	-	
中 信 证 券	2022101300013786	亿 华 通	2022- 10-13	87,160.00	1,000.00	28	1.80	122.02	-	-	
中 信 证 券	2022101300013788	嘉 元 科 技	2022- 10-13	159,510.00	3,000.00	28	1.80	223.31	-	-	
中 信 证 券	2022101300013822	震 裕 科 技	2022- 10-13	92,150.00	1,000.00	28	1.80	129.01	-	-	

中信证券	2022101300013824	亿纬锂能	2022-10-13	200,860.00	2,200.00	28	1.80	281.20	-	-
中信证券	2022101300013826	赢合科技	2022-10-13	114,448.00	4,600.00	28	1.80	160.23	-	-
中信证券	2022101300013832	联赢激光	2022-10-13	138,276.00	3,600.00	28	1.80	193.59	-	-
中信证券	2022101300013834	中伟股份	2022-10-13	88,990.00	1,100.00	28	1.80	124.59	-	-
中信证券	2022101300013838	容百科技	2022-10-13	240,874.00	4,100.00	28	1.80	476.76	-	-
中信证券	2022101300013840	天奈科技	2022-10-13	345,984.00	3,200.00	28	1.80	484.38	-	-
中信证券	2022101800001649	联赢激光	2022-10-18	35,550.00	1,000.00	14	3.40	47.01	-	-
中信证券	2022102100006055	新宙邦	2022-09-01	2,547.17	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	2022102100006225	新宙邦	2022-09-15	2,149.17	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	2022102100006403	新宙邦	2022-09-22	19,262.96	-	14	3.00	-	-	-
中信证券	2022102400073771	亿华通	2022-10-24	1,638,207.00	19,100.00	14	3.20	2,038.66	-	-
中信证券	2022102400073779	德方纳米	2022-10-24	882,477.00	3,100.00	14	2.70	926.60	-	-
中信证	2022102400073805	嘉元科	2022-10-24	1,931,420.00	35,900.00	14	3.40	2,553.77	-	-

券		技								
中信证	2022102400073877	寒	2022-	432,900.00	10,000.00	14	3.10	521.89	-	-
券		锐	10-24							
中信证	2022102400073963	联	2022-	2,222,347.00	64,100.00	14	3.50	3,024.86	-	-
券		赢	10-24							
中信证	2022102400073965	联	2022-	4,049,456.00	116,800.00	14	3.50	5,511.76	-	-
券		赢	10-24							
中信证	2022102400074693	特	2022-	787,962.00	51,400.00	14	2.80	858.00	-	-
券		锐	10-24							
中信证	2022102400074745	嘉	2022-	53,800.00	1,000.00	14	3.40	71.14	-	-
券		元	10-24							
中信证	2022102400074783	新	2022-	1,055,846.00	24,200.00	14	3.10	1,272.88	-	-
券		宙	10-24							
中信证	2022102400078043	特	2022-	55,188.00	3,600.00	14	2.80	60.09	-	-
券		锐	10-24							
中信证	2022102500002200	星	2022-	8,655,599.00	434,300.00	14	3.60	12,117.84	-	-
券		源	10-25							
中信证	2022102500002201	震	2022-	464,880.00	5,200.00	14	3.30	596.60	-	-
券		裕	10-25							
中信证	2022102500002215	天	2022-	1,987,500.00	30,000.00	28	3.70	5,719.58	-	-
券		华	10-25							
中信证	2022102500022556	赢	2022-	1,768,914.00	83,400.00	14	3.10	2,132.52	-	-
券		合	10-25							
中信证	2022102500024038	新	2022-	117,450.00	2,700.00	14	1.80	82.22	-	-
券		宙	10-25							
中信	2022102500024348	亿	2022-	162,982.00	1,900.00	14	3.20	202.82	-	-
信		华	10-25							

通										
中信证券	2022102500028022	寒锐钴业	2022-10-25	86,420.00	2,000.00	14	1.80	60.49	-	-
中信证券	2022102500028040	特锐德	2022-10-25	87,472.00	5,600.00	14	1.80	61.23	-	-
中信证券	2022102600002153	星源材质	2022-10-26	7,302,764.00	362,600.00	14	3.60	10,223.87	-	-
中信证券	2022102600002159	道氏技术	2022-10-26	2,039,048.00	136,300.00	14	3.60	2,854.67	-	-
中信证券	2022102600019462	赢合科技	2022-10-26	4,850,400.00	235,000.00	14	3.10	5,847.43	-	-
中信证券	2022102600024090	嘉元科技	2022-10-26	2,172,400.00	40,000.00	14	3.00	2,534.47	-	-
中信证券	2022102700001533	星源材质	2022-10-27	1,996,000.00	100,000.00	14	3.60	2,794.40	-	-
中信证券	2022102700015129	中伟股份	2022-10-27	83,633.00	1,100.00	28	1.80	117.09	-	-
中信证券	2022102700016329	先导智能	2022-10-27	348,364.00	6,800.00	28	1.80	487.71	-	-
中信证券	2022102700016331	当升科技	2022-10-27	30,575.00	500.00	28	1.80	42.81	-	-
中信证券	2022102700016343	宁德时代	2022-10-27	2,263,740.00	5,800.00	28	1.80	3,169.24	-	-
中信证券	2022102700019839	联赢激光	2022-10-27	292,240.00	8,000.00	14	3.40	386.41	-	-
中	2022102800000916	宁	2022-	36,550,000.00	100,000.00	14	1.80	25,585.00	-	-



信 证 券		德 时 代	10-28								
中 信 证 券	2022110100001273	震 裕 科 技	2022- 11-01	902,000.00	10,000.00	14	3.50	1,227.72	-	-	
中 信 证 券	2022110100007456	联 赢 激 光	2022- 11-01	36,340.00	1,000.00	14	3.50	49.46	-	-	
中 信 证 券	2022110700083807	新 宙 邦	2022- 11-07	991,958.00	24,200.00	14	3.00	1,157.28	-	-	
中 信 证 券	2022110700085027	亿 华 通	2022- 11-07	1,771,334.00	19,100.00	14	3.20	2,204.33	-	-	
中 信 证 券	2022110700088645	寒 锐 钻 业	2022- 11-07	449,500.00	10,000.00	14	3.30	576.86	-	-	
中 信 证 券	2022110700088699	嘉 元 科 技	2022- 11-07	56,180.00	1,000.00	14	2.70	58.99	-	-	
中 信 证 券	2022110700088759	嘉 元 科 技	2022- 11-07	2,016,862.00	35,900.00	14	2.70	2,117.71	-	-	
中 信 证 券	2022110700092017	特 锐 德	2022- 11-07	829,596.00	51,400.00	14	3.20	1,032.39	-	-	
中 信 证 券	2022110700092051	特 锐 德	2022- 11-07	58,104.00	3,600.00	14	3.20	72.31	-	-	
中 信 证 券	2022110700092427	联 赢 激 光	2022- 11-07	2,466,568.00	64,100.00	14	3.60	3,453.20	-	-	
中 信 证 券	2022110700092429	联 赢 激 光	2022- 11-07	4,494,464.00	116,800.00	14	3.60	6,292.25	-	-	
中 信 证 券	2022110700094771	德 方 纳 米	2022- 11-07	977,120.00	3,100.00	14	2.00	759.98	-	-	

中信证券	2022110800001794	天华超净	2022-11-08	702,000.00	10,000.00	14	3.30	900.90	-	-
中信证券	2022110800026345	新宙邦	2022-11-08	111,240.00	2,700.00	14	1.80	77.87	-	-
中信证券	2022110800026355	寒锐钴业	2022-11-08	89,840.00	2,000.00	14	1.80	62.89	-	-
中信证券	2022110800026367	特锐德	2022-11-08	89,432.00	5,600.00	14	1.80	62.60	-	-
中信证券	2022110800027565	亿华通	2022-11-08	658,800.00	7,200.00	28	3.10	1,588.44	-	-
中信证券	2022110800027587	亿华通	2022-11-08	173,850.00	1,900.00	14	3.20	216.35	-	-
中信证券	2022110800027629	星源材质	2022-11-08	9,936,784.00	434,300.00	14	3.50	13,525.07	-	-
中信证券	2022110800027631	震裕科技	2022-11-08	495,976.00	5,200.00	14	3.50	675.08	-	-
中信证券	2022110800027653	赢合科技	2022-11-08	1,750,566.00	83,400.00	14	3.60	2,450.79	-	-
中信证券	2022110900017459	联赢激光	2022-11-09	283,124.00	7,400.00	28	3.50	770.73	-	-
中信证券	2022110900017535	星源材质	2022-11-09	7,995,330.00	362,600.00	14	3.50	10,882.53	-	-
中信证券	2022110900017587	赢合科技	2022-11-09	4,925,600.00	235,000.00	14	3.60	6,895.84	-	-
中信证	2022110900020917	嘉元科	2022-11-09	2,213,200.00	40,000.00	14	2.70	2,323.86	-	-

券		技								
中信	2022110900023959	道氏	2022-	2,225,779.00	136,300.00	14	3.40	2,942.97	-	-
证券		技术	11-09							
中信	2022111000018632	联	2022-	293,360.00	8,000.00	14	3.60	410.70	-	-
证券		赢	11-10							
中信	2022111000019624	星	2022-	2,141,000.00	100,000.00	14	3.50	2,914.14	-	-
证券		源	11-10							
中信	2022111000019744	震	2022-	91,600.00	1,000.00	28	1.80	128.24	-	-
证券		裕	11-10							
中信	2022111000019762	容	2022-	247,051.00	2,900.00	28	1.80	345.87	-	-
证券		百	11-10							
中信	2022111000019764	天	2022-	326,336.00	3,200.00	28	1.80	456.87	-	-
证券		奈	11-10							
中信	2022111000019776	联	2022-	132,012.00	3,600.00	28	1.80	184.82	-	-
证券		赢	11-10							
中信	2022111000019778	中	2022-	87,329.00	1,100.00	28	1.80	122.26	-	-
证券		伟	11-10							
中信	2022111000019782	亿	2022-	87,730.00	1,000.00	28	1.80	122.82	-	-
证券		华	11-10							
中信	2022111000019784	嘉	2022-	161,400.00	3,000.00	28	1.80	225.96	-	-
证券		元	11-10							
中信	2022111000019798	赢	2022-	93,656.00	4,600.00	28	1.80	131.12	-	-
证券		合	11-10							
中信	2022111500001406	亿	2022-	868,800.00	10,000.00	14	3.30	1,114.96	-	-
证券		华	11-15							
中信	2022111500007838	震	2022-	915,000.00	10,000.00	14	3.50	1,245.42	-	-
信		裕	11-15							

证券		科技								
中信证券	2022111600001156	亿华通	2022-11-16	876,700.00	10,000.00	14	3.30	1,125.10	-	-
中信证券	2022111700001245	亿纬锂能	2022-11-17	167,840.00	2,000.00	14	3.10	202.34	-	-
中信证券	2022112100063198	嘉元科技	2022-11-21	53,300.00	1,000.00	14	5.00	103.64	-	-
中信证券	2022112100063202	亿华通	2022-11-21	1,630,949.00	19,100.00	14	3.30	2,093.05	-	-
中信证券	2022112100064746	联赢激光	2022-11-21	3,694,384.00	116,800.00	14	3.50	5,028.47	-	-
中信证券	2022112100072778	寒锐钴业	2022-11-21	456,000.00	10,000.00	14	3.30	585.20	-	-
中信证券	2022112100072792	嘉元科技	2022-11-21	1,913,470.00	35,900.00	14	5.00	3,720.64	-	-
中信证券	2022112100072870	新宙邦	2022-11-21	997,524.00	24,200.00	14	3.30	1,280.16	-	-
中信证券	2022112100073966	德方纳米	2022-11-21	798,002.00	3,100.00	14	3.10	962.04	-	-
中信证券	2022112100075646	联赢激光	2022-11-21	2,027,483.00	64,100.00	14	3.50	2,759.63	-	-
中信证券	2022112200016921	天华超净	2022-11-22	1,866,600.00	30,000.00	28	3.40	4,936.12	-	-
中信证券	2022112200019263	寒锐钴业	2022-11-22	89,000.00	2,000.00	14	1.80	62.30	-	-
中	2022112200020195	特	2022-	90,776.00	5,600.00	14	1.80	63.54	-	-

信 证 券		锐 德	11-22								
中 信 证 券	2022112200020257	新 宙 邦	2022- 11-22	107,730.00	2,700.00	14	1.80	75.41	-	-	
中 信 证 券	2022112200020877	赢 合 科 技	2022- 11-22	1,656,324.00	83,400.00	14	3.20	2,061.20	-	-	
中 信 证 券	2022112200020897	亿 华 通	2022- 11-22	158,194.00	1,900.00	14	3.30	203.02	-	-	
中 信 证 券	2022112200020981	震 裕 科 技	2022- 11-22	437,372.00	5,200.00	14	3.50	595.31	-	-	
中 信 证 券	2022112200021127	星 源 材 质	2022- 11-22	9,511,170.00	434,300.00	14	3.60	13,315.64	-	-	
中 信 证 券	2022112200021227	天 华 超 净	2022- 11-22	622,200.00	10,000.00	14	3.50	846.88	-	-	
中 信 证 券	2022112300015250	嘉 元 科 技	2022- 11-23	2,114,400.00	40,000.00	14	5.00	4,111.33	-	-	
中 信 证 券	2022112300015666	道 氏 技 术	2022- 11-23	2,093,568.00	136,300.00	14	3.30	2,686.75	-	-	
中 信 证 券	2022112300018946	星 源 材 质	2022- 11-23	8,227,394.00	362,600.00	14	3.60	11,518.35	-	-	
中 信 证 券	2022112300020604	赢 合 科 技	2022- 11-23	4,695,300.00	235,000.00	14	3.20	5,843.04	-	-	
中 信 证 券	2022112400001431	中 伟 股 份	2022- 11-24	4,596,600.00	60,000.00	14	3.70	6,614.00	-	-	
中 信 证 券	2022112400001433	星 源 材 质	2022- 11-24	45,520.00	2,000.00	14	3.80	67.27	-	-	

中信证券	2022112400017470	星源材质	2022-11-24	2,276,000.00	100,000.00	14	3.60	3,186.40	-	-
中信证券	2022112400017778	先导智能	2022-11-24	304,300.00	6,800.00	7	1.80	106.51	-	-
中信证券	2022112400017800	当升科技	2022-11-24	31,150.00	500.00	7	1.80	10.90	-	-
中信证券	2022112400018138	宁德时代	2022-11-24	2,184,396.00	5,800.00	7	1.80	764.54	-	-
中信证券	2022112900015476	震裕科技	2022-11-29	846,600.00	10,000.00	14	3.50	1,152.32	-	-
中信证券	2022112900015570	亿华通	2022-11-29	825,000.00	10,000.00	14	3.40	1,090.83	-	-
中信证券	2022113000006061	亿华通	2022-11-30	821,100.00	10,000.00	14	3.40	1,085.68	-	-
中信证券	2022120100001296	新宙邦	2022-12-01	81,000.00	2,000.00	14	3.40	107.10	-	-
中信证券	2022120100007928	当升科技	2022-12-01	31,400.00	500.00	7	1.80	10.99	-	-
中信证券	2022120100007932	先导智能	2022-12-01	297,568.00	6,800.00	7	1.80	104.15	-	-
中信证券	2022120100007934	宁德时代	2022-12-01	2,292,450.00	5,800.00	7	1.80	802.36	-	-
中信证券	2022120200001152	亿纬锂能	2022-12-02	4,216,500.00	50,000.00	14	1.80	2,951.55	-	-
中信证	2022120200001154	天奈科	2022-12-02	327,936.00	3,200.00	14	1.80	229.56	-	-

券		技								
中信证券	2022120200001156	嘉元科技	2022-12-02	157,860.00	3,000.00	14	1.80	110.50	-	-
中信证券	2022120500021272	嘉元科技	2022-12-05	52,270.00	1,000.00	14	3.30	67.08	-	-
中信证券	2022120500021276	新宙邦	2022-12-05	968,000.00	24,200.00	14	3.40	1,279.91	-	-
中信证券	2022120500021360	德方纳米	2022-12-05	706,025.00	3,100.00	14	3.30	906.07	-	-
中信证券	2022120500021866	寒锐钴业	2022-12-05	447,300.00	10,000.00	14	3.80	661.01	-	-
中信证券	2022120500021870	嘉元科技	2022-12-05	1,876,493.00	35,900.00	14	3.30	2,408.17	-	-
中信证券	2022120600011788	星源材质	2022-12-06	10,245,137.00	434,300.00	14	3.40	13,546.35	-	-
中信证券	2022120600011806	天华超净	2022-12-06	621,000.00	10,000.00	14	2.90	700.35	-	-
中信证券	2022120600012714	寒锐钴业	2022-12-06	89,200.00	2,000.00	14	1.80	62.44	-	-
中信证券	2022120600012944	新宙邦	2022-12-06	110,376.00	2,700.00	14	1.80	77.26	-	-
中信证券	2022120600012962	特锐德	2022-12-06	92,288.00	5,600.00	14	1.80	64.60	-	-
中信证券	2022120700010678	星源材质	2022-12-07	8,912,708.00	362,600.00	14	3.40	11,784.58	-	-
中信	2022120700014234	嘉元	2022-12-07	2,098,400.00	40,000.00	14	3.30	2,692.95	-	-

证券		科技									
中信证券	2022120800013109	中伟股份	2022-12-08	4,812,000.00	60,000.00	14	4.10	7,672.47	-	-	
中信证券	2022120800013145	星源材质	2022-12-08	2,464,000.00	100,000.00	14	3.40	3,257.96	-	-	
中信证券	2022121500012613	新宙邦	2022-12-15	83,980.00	2,000.00	14	2.00	65.32	-	-	
中信证券	2022122100004375	富临精工	2022-12-21	1,288,980.00	83,700.00	14	3.20	1,145.76	1,207,791.00	1,145.76	
中信证券	2022122100004376	富临精工	2022-12-21	979,440.00	63,600.00	28	3.10	843.41	917,748.00	843.41	
中信证券	2022122100004377	天华超净	2022-12-21	1,755,600.00	30,000.00	28	2.80	1,365.47	1,676,400.00	1,365.47	
中信证券	2022122100004388	先导智能	2022-12-21	8,194,000.00	200,000.00	14	3.10	7,055.94	8,050,000.00	7,055.94	
中信证券	2022122100019617	嘉元科技	2022-12-21	1,855,600.00	40,000.00	14	3.30	1,700.96	1,794,000.00	1,700.96	
中信证券	2022122100019633	星源材质	2022-12-21	8,129,492.00	362,600.00	14	2.50	5,645.48	7,708,876.00	5,645.48	
中信证券	2022122200001562	富临精工	2022-12-22	1,908,231.00	129,900.00	14	3.20	1,526.59	1,874,457.00	1,526.59	
中信证券	2022122200016437	中伟股份	2022-12-22	4,086,600.00	60,000.00	14	4.10	4,188.77	3,936,600.00	4,188.77	
中信证券	2022122200016439	星源材质	2022-12-22	2,118,000.00	100,000.00	14	2.50	1,323.75	2,126,000.00	1,323.75	
中	2022122700001509	星	2022-	1,659,064.00	74,800.00	14	3.00	553.02	1,590,248.00	553.02	



华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金 2022 年年度报告

信 证 券		源 材 质	12-27								
中 信 证 券	2022122800002268	星 源 材 质	2022- 12-28	2,175,000.00	100,000.00	14	3.00	543.75	2,126,000.00	543.75	
中 信 证 券	2022122900012407	新 宙 邦	2022- 12-29	85,980.00	2,000.00	14	2.30	10.99	86,940.00	10.99	
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	2021020200000717	特 锐 德	2021- 02-02	1,213,800.00	34,000.00	28	3.40	3,209.83	-	-	
中 信 证 券	2021020200000741	寒 锐 钻 业	2021- 02-02	2,856,000.00	28,000.00	28	3.40	7,552.53	-	-	
中 信 证 券	2021020200000745	当 升 科 技	2021- 02-02	3,169,400.00	52,000.00	28	3.40	8,381.30	-	-	
中 信 证 券	2021020200000755	新 宙 邦	2021- 02-02	3,090,600.00	36,000.00	28	3.40	8,172.92	-	-	
中 信 证 券	2021020400000400	容 百 科 技	2021- 02-04	1,896,750.00	27,000.00	28	3.20	4,720.80	-	-	
中 信 证 券	2021020400000402	天 奈 科 技	2021- 02-04	1,964,750.00	25,000.00	28	5.50	8,404.76	-	-	
中 信 证 券	2021020400000426	亿 纬 锂 能	2021- 02-04	3,266,400.00	30,000.00	28	3.30	8,383.76	-	-	
中 信 证 券	2021021800001205	亿 纬 锂 能	2021- 02-18	2,590,000.00	25,000.00	28	3.20	6,446.22	-	-	

中信证券	2021022500000606	宁德时代	2021-02-25	6,742,000.00	20,000.00	28	3.50	18,353.22	-	-
中信证券	2021030200004641	当升科技	2021-03-02	2,514,200.00	52,000.00	28	3.30	6,453.11	-	-
中信证券	2021030200005093	特锐德	2021-03-02	1,023,740.00	34,000.00	28	3.40	2,707.22	-	-
中信证券	2021030200005095	新宙邦	2021-03-02	3,017,160.00	36,000.00	28	3.30	7,744.04	-	-
中信证券	2021030200005115	寒锐钴业	2021-03-02	2,443,840.00	28,000.00	28	3.70	7,032.83	-	-
中信证券	2021030400034631	亿纬锂能	2021-03-04	2,417,400.00	30,000.00	28	3.30	6,204.66	-	-
中信证券	2021030400035005	容百科技	2021-03-04	1,592,730.00	27,000.00	28	3.10	3,840.25	-	-
中信证券	2021030400035007	天奈科技	2021-03-04	1,377,250.00	25,000.00	28	4.00	4,284.78	-	-
中信证券	2021030900000518	天奈科技	2021-03-09	5,810,000.00	100,000.00	14	5.30	11,975.06	-	-
中信证券	2021031100000453	宁德时代	2021-03-11	6,625,600.00	20,000.00	14	3.50	9,018.18	-	-
中信证券	2021031100000473	天奈科技	2021-03-11	1,006,242.00	17,400.00	14	5.30	2,073.98	-	-
中信证券	2021031800037614	亿纬锂能	2021-03-18	2,122,500.00	25,000.00	28	3.30	5,447.75	-	-
中信证	2021032300000489	寒锐钴	2021-03-23	66,220.00	1,000.00	14	3.50	90.13	-	-

券		业								
中信证	2021032300000501	亿纬锂能	2021-03-23	5,069,064.00	72,800.00	14	3.40	6,702.43	-	-
券		嘉元科技	2021-03-23	939,900.00	13,000.00	14	5.20	1,900.69	-	-
中信证	2021032300000519	亿纬锂能	2021-03-23	5,848,920.00	84,000.00	28	3.30	15,012.23	-	-
券		天奈科技	2021-03-23	5,628,000.00	100,000.00	14	4.80	10,505.60	-	-
中信证	2021032300007755	亿纬锂能	2021-03-25	4,149,000.00	60,000.00	14	3.40	5,485.90	-	-
券		嘉元科技	2021-03-25	354,400.00	5,000.00	14	5.20	716.68	-	-
中信证	2021032500000560	宁德时代	2021-03-25	5,831,000.00	20,000.00	28	3.70	16,780.32	-	-
券		宁德时代	2021-03-25	5,831,000.00	20,000.00	14	3.80	8,616.92	-	-
中信证	2021032500006290	天奈科技	2021-03-25	920,112.00	17,400.00	14	4.80	1,717.54	-	-
券		寒锐钴业	2021-03-30	739,090.00	11,000.00	14	3.40	977.24	-	-
中信证	2021033000000669	寒锐钴业	2021-03-30	1,881,320.00	28,000.00	28	3.40	4,975.05	-	-
券		新宙邦	2021-03-30	2,794,680.00	36,000.00	28	3.10	6,738.28	-	-
中信证	2021033000007873	特锐	2021-03-30	881,960.00	34,000.00	28	3.20	2,195.10	-	-
券										
中信	2021033000007883									
券										
中信	2021033000007885									

德										
中信证券	2021040100000466	特锐德	2021-04-01	2,639,000.00	100,000.00	28	3.30	6,773.43	-	-
中信证券	2021040100032955	容百科技	2021-04-01	1,562,220.00	27,000.00	28	3.20	3,888.19	-	-
中信证券	2021040100032957	天奈科技	2021-04-01	1,312,500.00	25,000.00	28	7.40	7,554.17	-	-
中信证券	2021040600006660	寒锐钴业	2021-04-06	3,033,900.00	45,000.00	14	3.60	4,247.46	-	-
中信证券	2021040600017318	天奈科技	2021-04-06	5,335,000.00	100,000.00	14	7.60	15,767.89	-	-
中信证券	2021040600017320	嘉元科技	2021-04-06	1,029,080.00	13,000.00	14	5.80	2,321.15	-	-
中信证券	2021040600017328	亿纬锂能	2021-04-06	5,732,272.00	72,800.00	14	3.60	8,025.18	-	-
中信证券	2021040600017344	寒锐钴业	2021-04-06	67,420.00	1,000.00	14	3.40	89.14	-	-
中信证券	2021040800000520	宁德时代	2021-04-08	319,850.00	1,000.00	14	3.50	435.35	-	-
中信证券	2021040800004733	亿纬锂能	2021-04-08	4,397,400.00	60,000.00	14	3.60	6,156.36	-	-
中信证券	2021041300000933	寒锐钴业	2021-04-13	646,700.00	10,000.00	14	3.50	880.23	-	-
中信证券	2021041300008027	寒锐钴业	2021-04-13	711,370.00	11,000.00	14	3.60	995.92	-	-
中	2021042000001121	新	2021-	813,000.00	10,000.00	14	3.50	1,264.66	-	-

信 证 券		宙 邦	04-20								
中 信 证 券	202104200001175	亿 纬 锂 能	2021- 04-20	2,963,700.00	37,000.00	28	3.50	8,067.85	-	-	
中 信 证 券	2021042000015632	天 奈 科 技	2021- 04-20	5,870,000.00	100,000.00	14	2.00	5,217.78	-	-	
中 信 证 券	2021042000015636	寒 锐 钴 业	2021- 04-20	66,720.00	1,000.00	14	3.50	103.78	-	-	
中 信 证 券	2021042000015640	嘉 元 科 技	2021- 04-20	1,002,690.00	13,000.00	14	4.50	2,005.38	-	-	
中 信 证 券	2021042000015642	亿 纬 锂 能	2021- 04-20	6,728,400.00	84,000.00	28	3.30	17,269.56	-	-	
中 信 证 券	2021042000015654	寒 锐 钴 业	2021- 04-20	3,002,400.00	45,000.00	14	3.50	4,670.40	-	-	
中 信 证 券	2021042200000708	新 宙 邦	2021- 04-22	81,890.00	1,000.00	14	3.50	111.46	-	-	
中 信 证 券	2021042200006954	宁 德 时 代	2021- 04-22	7,247,200.00	20,000.00	28	3.40	19,164.82	-	-	
中 信 证 券	2021042700000757	亿 纬 锂 能	2021- 04-27	1,811,480.00	22,000.00	14	3.50	2,465.63	-	-	
中 信 证 券	2021042700011832	寒 锐 钴 业	2021- 04-27	1,966,440.00	28,000.00	28	3.40	5,200.14	-	-	
中 信 证 券	2021042700011834	寒 锐 钴 业	2021- 04-27	772,530.00	11,000.00	14	3.50	1,051.50	-	-	
中 信 证 券	2021042700011836	寒 锐 钴 业	2021- 04-27	702,300.00	10,000.00	14	3.50	955.91	-	-	

中信证券	2021042700011846	新宙邦	2021-04-27	2,763,360.00	36,000.00	28	3.40	7,307.55	-	-
中信证券	2021042900000629	特锐德	2021-04-29	462,208.00	18,400.00	14	3.50	629.12	-	-
中信证券	2021042900024181	特锐德	2021-04-29	2,512,000.00	100,000.00	28	3.40	6,642.84	-	-
中信证券	2021042900024633	容百科技	2021-04-29	1,728,000.00	27,000.00	28	1.60	2,150.40	-	-
中信证券	2021042900024635	天奈科技	2021-04-29	1,577,500.00	25,000.00	28	3.40	4,171.61	-	-
中信证券	2021043000007184	嘉元科技	2021-04-20	3,250.00	-	14	4.50	-	-	-
中信证券	2021050600026930	新宙邦	2021-05-06	729,100.00	10,000.00	14	3.50	992.39	-	-
中信证券	2021050600026942	天奈科技	2021-05-06	6,830,000.00	100,000.00	14	3.50	9,296.39	-	-
中信证券	2021050600026944	嘉元科技	2021-05-06	1,061,580.00	13,000.00	14	6.00	2,477.02	-	-
中信证券	2021050600026946	寒锐钴业	2021-05-06	73,890.00	1,000.00	14	3.50	100.57	-	-
中信证券	2021050600026948	寒锐钴业	2021-05-06	3,325,050.00	45,000.00	14	3.50	4,525.76	-	-
中信证券	2021050600028310	新宙邦	2021-05-06	72,910.00	1,000.00	14	3.50	99.24	-	-
中信证	2021051100000906	亿纬锂	2021-05-11	2,352,256.00	27,200.00	14	3.30	3,018.73	-	-

券		能								
中信证	2021051100010777	寒	2021-	705,700.00	10,000.00	14	3.50	960.54	-	-
券		锐	05-11							
中信证	2021051100010779	锐	2021-	776,270.00	11,000.00	14	3.50	1,056.59	-	-
券		钻	05-11							
中信证	2021051300025292	特	2021-	431,480.00	18,400.00	14	3.50	587.29	-	-
券		锐	05-13							
中信证	2021051700004019	新	2021-	14,400.00	-	28	3.40	-	-	-
券		宙	04-27							
中信证	2021051700004061	新	2021-	400.00	-	14	3.50	-	-	-
券		宙	05-06							
中信证	2021051700004071	新	2021-	4,000.00	-	14	3.50	-	-	-
券		宙	05-06							
中信证	2021051800000506	新	2021-	757,000.00	10,000.00	14	3.50	1,030.36	-	-
券		宙	05-18							
中信证	2021052000000499	当	2021-	612,250.00	12,500.00	14	3.40	809.53	-	-
券		升	05-20							
中信证	2021052000018411	嘉	2021-	885,430.00	13,000.00	14	5.40	1,859.40	-	-
券		元	05-20							
中信证	2021052000018413	寒	2021-	74,080.00	1,000.00	14	3.50	100.83	-	-
券		锐	05-20							
中信证	2021052000018417	寒	2021-	3,333,600.00	45,000.00	14	3.50	4,537.40	-	-
券		锐	05-20							
中信证	2021052000018419	天	2021-	7,619,000.00	100,000.00	14	6.50	19,259.14	-	-
券		奈	05-20							
中信	2021052000018421	新	2021-	802,800.00	10,000.00	14	3.30	1,030.26	-	-
信		宙	05-20							

证 券		邦									
中 信 证 券	2021052000018423	新 宙 邦	2021- 05-20	80,280.00	1,000.00	14	3.30	103.03	-	-	
中 信 证 券	2021052400006955	亿 纬 锂 能	2021- 05-11	680.14	-	14	3.30	-	-	-	
中 信 证 券	2021052500010274	亿 纬 锂 能	2021- 05-25	2,918,288.00	27,200.00	14	3.40	3,858.63	-	-	
中 信 证 券	2021052500010276	寒 锐 钴 业	2021- 05-25	826,210.00	11,000.00	14	3.50	1,124.56	-	-	
中 信 证 券	2021052500010278	寒 锐 钴 业	2021- 05-25	751,100.00	10,000.00	14	3.50	1,022.33	-	-	
中 信 证 券	2021052700018763	特 锐 德	2021- 05-27	487,784.00	18,400.00	14	3.10	588.05	-	-	
中 信 证 券	2021052700020750	当 升 科 技	2021- 05-20	2,062.50	-	14	3.40	-	-	-	
中 信 证 券	2021060100000664	亿 纬 锂 能	2021- 06-01	1,072,000.00	10,000.00	14	3.40	1,417.42	-	-	
中 信 证 券	2021060100000676	特 锐 德	2021- 06-01	1,035,996.00	37,700.00	14	3.40	1,369.82	-	-	
中 信 证 券	2021060100000680	先 导 智 能	2021- 06-01	943,000.00	10,000.00	14	3.30	1,210.18	-	-	
中 信 证 券	2021060100002539	新 宙 邦	2021- 06-01	865,500.00	10,000.00	14	3.50	1,178.04	-	-	
中 信 证 券	2021060200002732	先 导 智 能	2021- 06-01	3,000.00	-	14	3.30	-	-	-	
中	2021060200002826	先	2021-	-	6,000.00	14	3.30	-	-	-	



信 证 券		导 智 能	06-01								
中 信 证 券	2021060300009842	嘉 元 科 技	2021- 06-03	1,114,100.00	13,000.00	14	3.20	1,386.44	-	-	
中 信 证 券	2021060300009848	寒 锐 钻 业	2021- 06-03	79,500.00	1,000.00	14	3.50	108.21	-	-	
中 信 证 券	2021060300009862	天 奈 科 技	2021- 06-03	8,929,000.00	100,000.00	14	5.00	17,361.94	-	-	
中 信 证 券	2021060300009864	寒 锐 钻 业	2021- 06-03	3,577,500.00	45,000.00	14	3.50	4,869.38	-	-	
中 信 证 券	2021060300010626	新 宙 邦	2021- 06-03	920,000.00	10,000.00	14	3.50	1,252.22	-	-	
中 信 证 券	2021060300010636	当 升 科 技	2021- 06-03	724,750.00	12,500.00	14	3.50	986.47	-	-	
中 信 证 券	2021060800005871	寒 锐 钻 业	2021- 06-08	888,800.00	11,000.00	14	3.50	1,209.76	-	-	
中 信 证 券	2021060800005873	寒 锐 钻 业	2021- 06-08	808,000.00	10,000.00	14	3.50	1,099.78	-	-	
中 信 证 券	2021060800005885	亿 纬 锂 能	2021- 06-08	2,658,256.00	27,200.00	14	3.40	3,514.81	-	-	
中 信 证 券	2021060900000671	亿 纬 锂 能	2021- 06-09	1,485,150.00	15,000.00	14	3.40	1,963.70	-	-	
中 信 证 券	2021061000000500	特 锐 德	2021- 06-10	923,775.00	32,700.00	14	3.30	1,185.51	-	-	
中 信 证 券	2021061000008584	特 锐 德	2021- 06-10	519,800.00	18,400.00	14	3.40	687.29	-	-	

中信证券	2021061500001756	先导智能	2021-06-15	1,461,650.00	23,000.00	14	3.40	1,932.63	-	-
中信证券	2021061500016002	特锐德	2021-06-15	1,002,443.00	37,700.00	14	3.30	1,286.47	-	-
中信证券	2021061500016004	新宙邦	2021-06-15	928,300.00	10,000.00	14	3.40	1,227.42	-	-
中信证券	2021061500016012	先导智能	2021-06-15	635,500.00	10,000.00	14	3.30	815.56	-	-
中信证券	2021061500017080	特锐德	2021-06-15	1,885.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	2021061500017104	特锐德	2021-06-10	920.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	2021061500017119	特锐德	2021-06-10	1,635.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	2021061700017951	嘉元科技	2021-06-17	1,056,120.00	13,000.00	14	5.80	2,382.14	-	-
中信证券	2021061700017953	天奈科技	2021-06-17	9,310,000.00	100,000.00	14	6.30	22,809.50	-	-
中信证券	2021061700017955	寒锐钴业	2021-06-17	69,010.00	1,000.00	14	4.00	107.35	-	-
中信证券	2021061700017957	寒锐钴业	2021-06-17	3,105,450.00	45,000.00	14	4.00	4,830.70	-	-
中信证券	2021061700017959	新宙邦	2021-06-17	893,500.00	10,000.00	14	3.40	1,181.41	-	-
中信证	2021061700017961	当升科	2021-06-17	654,750.00	12,500.00	14	3.40	865.73	-	-

券		技								
中信证	2021061700021496	天奈科技	2021-06-17	7,000.00	-	14	6.30	-	-	-
券		容								
中信证	2021072300000612	百科技	2021-07-23	197,955.00	1,500.00	28	2.50	384.91	-	-
券		先								
中信证	2021072300000828	导智能	2021-07-23	374,205.00	5,700.00	28	2.50	727.62	-	-
券		翔								
中信证	2021072300000928	丰华	2021-07-23	64,400.00	1,000.00	28	3.50	175.31	-	-
券		寒								
中信证	2021072300000930	锐钴业	2021-07-23	115,836.00	1,200.00	28	3.20	288.30	-	-
券		宁								
中信证	2021072300000932	德时代	2021-07-23	1,148,721.00	2,100.00	28	3.30	2,948.38	-	-
券		当								
中信证	2021072300000936	升科技	2021-07-23	151,851.00	2,100.00	28	2.70	318.89	-	-
券		汇								
中信证	2021072300000938	川技术	2021-07-23	751,161.00	9,300.00	28	2.60	1,519.01	-	-
券		新								
中信证	2021072300000942	宙邦	2021-07-23	205,578.00	1,800.00	28	3.30	527.65	-	-
券		杭								
中信证	2021072300000943	可科技	2021-07-23	108,000.00	1,000.00	28	2.90	243.60	-	-
券		亿								
中信证	2021072300000946	纬锂能	2021-07-23	864,087.00	6,900.00	28	2.90	1,949.00	-	-
券		特								
中信证	2021072300000948	锐德	2021-07-23	122,436.00	3,600.00	28	3.30	314.25	-	-
券		嘉								
中信	2021072300000950	元	2021-07-23	92,800.00	1,000.00	28	3.80	274.28	-	-

证券		科技								
中信证券	2021072300000952	天奈科技	2021-07-23	167,940.00	1,200.00	28	5.80	757.60	-	-
中信证券	2021072900001354	特锐德	2021-07-29	683,100.00	23,000.00	14	3.50	929.78	-	-
中信证券	2021072900001426	寒锐钴业	2021-07-29	901,200.00	10,000.00	14	3.50	1,226.63	-	-
中信证券	2021080300000859	特锐德	2021-08-03	986,700.00	33,000.00	14	3.40	1,304.64	-	-
中信证券	2021080500001028	特锐德	2021-08-05	181,260.00	6,000.00	14	3.40	239.67	-	-
中信证券	2021081000001024	特锐德	2021-08-10	59,680.00	2,000.00	14	3.50	81.23	-	-
中信证券	2021081200000891	当升科技	2021-08-12	3,220,700.00	43,000.00	14	3.30	4,133.23	-	-
中信证券	2021081200018365	特锐德	2021-08-12	748,650.00	23,000.00	14	3.40	989.88	-	-
中信证券	2021081200018369	寒锐钴业	2021-08-12	879,700.00	10,000.00	14	3.40	1,163.16	-	-
中信证券	2021081700000905	亿纬锂能	2021-08-17	2,066,526.00	19,800.00	28	2.40	3,857.52	-	-
中信证券	2021081700012922	特锐德	2021-08-17	952,050.00	33,000.00	14	3.50	1,295.85	-	-
中信证券	2021081900009591	特锐德	2021-08-19	178,020.00	6,000.00	14	3.50	242.31	-	-
中	2021082000008566	翔	2021-	51,130.00	1,000.00	28	3.50	139.19	-	-

信 证 券		丰 华	08-20								
中 信 证 券	2021082000008568	杭 可 科 技	2021- 08-20	118,060.00	1,000.00	28	2.80	257.11	-	-	
中 信 证 券	2021082000008570	天 奈 科 技	2021- 08-20	202,824.00	1,200.00	28	7.00	1,104.26	-	-	
中 信 证 券	2021082000008572	嘉 元 科 技	2021- 08-20	112,000.00	1,000.00	28	2.70	235.20	-	-	
中 信 证 券	2021082000008574	容 百 科 技	2021- 08-20	182,850.00	1,500.00	28	3.00	426.65	-	-	
中 信 证 券	2021082000008576	宁 德 时 代	2021- 08-20	1,037,631.00	2,100.00	28	3.20	2,582.55	-	-	
中 信 证 券	2021082000008578	汇 川 技 术	2021- 08-20	645,234.00	9,300.00	28	2.50	1,254.62	-	-	
中 信 证 券	2021082000008580	先 导 智 能	2021- 08-20	432,459.00	5,700.00	28	2.30	773.62	-	-	
中 信 证 券	2021082000008582	寒 锐 钻 业	2021- 08-20	107,196.00	1,200.00	28	3.20	266.80	-	-	
中 信 证 券	2021082000008584	当 升 科 技	2021- 08-20	148,512.00	2,100.00	28	3.20	369.63	-	-	
中 信 证 券	2021082000008586	特 锐 德	2021- 08-20	105,840.00	3,600.00	28	3.40	279.89	-	-	
中 信 证 券	2021082000008588	亿 纬 锂 能	2021- 08-20	679,650.00	6,900.00	28	2.40	1,268.68	-	-	
中 信 证 券	2021082000008590	新 宙 邦	2021- 08-20	197,190.00	1,800.00	28	3.40	521.46	-	-	

中信证券	2021082400018827	特锐德	2021-08-24	59,120.00	2,000.00	14	3.40	78.17	-	-
中信证券	2021082400023120	容百科技	2021-08-20	135.00	-	28	3.00	-	-	-
中信证券	2021082600015447	寒锐钴业	2021-08-26	936,700.00	10,000.00	14	3.50	1,274.95	-	-
中信证券	2021082600015453	当升科技	2021-08-26	3,139,000.00	43,000.00	14	3.40	4,150.46	-	-
中信证券	2021082600015457	特锐德	2021-08-26	701,500.00	23,000.00	14	3.40	927.54	-	-
中信证券	2021090900014165	寒锐钴业	2021-09-09	862,000.00	10,000.00	14	3.70	1,240.32	-	-
中信证券	2021090900014169	特锐德	2021-09-09	674,590.00	23,000.00	14	3.30	865.72	-	-
中信证券	2021090900014171	当升科技	2021-09-09	3,592,220.00	43,000.00	14	3.20	4,470.32	-	-
中信证券	2021091400015792	亿纬锂能	2021-09-14	1,912,878.00	19,800.00	28	2.60	3,868.26	-	-
中信证券	2021091700009667	杭可科技	2021-09-17	91,950.00	1,000.00	28	3.10	221.70	-	-
中信证券	2021091700009669	容百科技	2021-09-17	165,465.00	1,500.00	28	3.20	411.82	-	-
中信证券	2021091700009671	嘉元科技	2021-09-17	116,100.00	1,000.00	28	3.30	297.99	-	-
中信证	2021091700009673	天奈科	2021-09-17	206,868.00	1,200.00	28	6.00	965.38	-	-

券		技								
中信证	2021091700009675	亿纬锂能	2021-09-17	626,727.00	6,900.00	28	2.60	1,267.38	-	-
券		特锐德	2021-09-17	96,408.00	3,600.00	28	3.20	239.95	-	-
中信证	2021091700009677	当升科技	2021-09-17	191,016.00	2,100.00	28	3.20	475.42	-	-
券		新宙邦	2021-09-17	259,380.00	1,800.00	28	3.10	625.39	-	-
中信证	2021091700009681	翔丰华	2021-09-17	55,880.00	1,000.00	28	3.50	152.12	-	-
券		先导智能	2021-09-17	412,167.00	5,700.00	28	3.10	993.78	-	-
中信证	2021091700009685	汇川技术	2021-09-17	609,894.00	9,300.00	28	2.70	1,280.78	-	-
券		宁德时代	2021-09-17	1,056,300.00	2,100.00	28	3.30	2,711.17	-	-
中信证	2021091700009689	寒锐钴业	2021-09-17	100,440.00	1,200.00	28	3.30	257.80	-	-
券		中伟股份	2021-09-23	1,896,120.00	11,500.00	14	3.70	2,923.19	-	-
中信证	2021092300001070	新宙邦	2021-09-23	1,973,661.00	13,900.00	14	3.50	2,878.25	-	-
券		先导智能	2021-09-23	70,840.00	1,000.00	28	3.20	176.31	-	-
中信证	2021092300001078	先导	2021-09-23	495,880.00	7,000.00	28	3.20	1,234.19	-	-
券										

证券		智能									
中信证券	2021092300013549	寒锐钴业	2021-09-23	833,000.00	10,000.00	14	3.40	1,180.08	-	-	
中信证券	2021092300013551	特锐德	2021-09-23	627,440.00	23,000.00	14	3.40	888.88	-	-	
中信证券	2021092300013553	当升科技	2021-09-23	3,741,000.00	43,000.00	14	3.40	5,299.75	-	-	
中信证券	2021100800071387	中伟股份	2021-10-08	1,725,000.00	11,500.00	14	3.40	2,280.83	-	-	
中信证券	2021100800071391	寒锐钴业	2021-10-08	748,400.00	10,000.00	14	3.50	1,018.66	-	-	
中信证券	2021100800071393	新宙邦	2021-10-08	1,931,822.00	13,900.00	14	3.50	2,629.42	-	-	
中信证券	2021100800071395	当升科技	2021-10-08	3,457,200.00	43,000.00	14	3.50	4,705.63	-	-	
中信证券	2021100800071399	特锐德	2021-10-08	602,830.00	23,000.00	14	3.40	797.08	-	-	
中信证券	2021101200017045	亿纬锂能	2021-10-12	1,990,098.00	19,800.00	28	3.00	4,643.56	-	-	
中信证券	2021101500003697	杭可科技	2021-10-15	89,270.00	1,000.00	28	2.40	166.64	-	-	
中信证券	2021101500003699	天奈科技	2021-10-15	177,360.00	1,200.00	28	5.90	813.89	-	-	
中信证券	2021101500003701	容百科技	2021-10-15	167,850.00	1,500.00	28	2.70	352.49	-	-	
中	2021101500003703	嘉	2021-	139,210.00	1,000.00	28	3.50	378.96	-	-	



信 证 券		元 科 技	10-15								
中 信 证 券	2021101500003793	翔 丰 华	2021- 10-15	47,990.00	1,000.00	28	3.40	126.91	-	-	
中 信 证 券	2021101500003795	新 宙 邦	2021- 10-15	268,380.00	1,800.00	28	3.40	709.72	-	-	
中 信 证 券	2021101500003797	亿 纬 锂 能	2021- 10-15	746,235.00	6,900.00	28	2.70	1,567.09	-	-	
中 信 证 券	2021101500003799	特 锐 德	2021- 10-15	94,536.00	3,600.00	28	3.30	242.64	-	-	
中 信 证 券	2021101500004163	先 导 智 能	2021- 10-15	435,480.00	5,700.00	28	2.00	677.41	-	-	
中 信 证 券	2021101500004165	汇 川 技 术	2021- 10-15	584,505.00	9,300.00	28	2.60	1,182.00	-	-	
中 信 证 券	2021101500004167	当 升 科 技	2021- 10-15	173,901.00	2,100.00	28	3.40	459.87	-	-	
中 信 证 券	2021101500004169	寒 锐 钻 业	2021- 10-15	97,608.00	1,200.00	28	3.40	258.12	-	-	
中 信 证 券	2021101500004171	宁 德 时 代	2021- 10-15	1,194,900.00	2,100.00	28	3.30	3,066.91	-	-	
中 信 证 券	2021101900001004	新 宙 邦	2021- 10-19	1,923,992.00	13,600.00	14	3.30	2,469.12	-	-	
中 信 证 券	2021102000000917	天 奈 科 技	2021- 10-20	6,277,200.00	40,000.00	28	1.80	8,788.08	-	-	
中 信 证 券	2021102100000814	嘉 元 科 技	2021- 10-21	8,067,180.00	51,000.00	28	3.40	21,333.21	-	-	

中信证券	2021102100004774	先导智能	2021-10-21	75,400.00	1,000.00	28	2.00	117.29	-	-
中信证券	2021102100004778	先导智能	2021-10-21	527,800.00	7,000.00	28	2.00	821.02	-	-
中信证券	2021102200043888	中伟股份	2021-10-22	1,661,635.00	11,500.00	14	3.40	2,197.05	-	-
中信证券	2021102200043890	当升科技	2021-10-22	3,415,490.00	43,000.00	14	3.50	4,648.86	-	-
中信证券	2021102200043892	寒锐钴业	2021-10-22	806,100.00	10,000.00	14	3.50	1,097.19	-	-
中信证券	2021102600001314	当升科技	2021-10-26	244,020.00	3,000.00	28	3.30	626.32	-	-
中信证券	2021102600001316	宁德时代	2021-10-26	597,990.00	1,000.00	14	3.40	790.68	-	-
中信证券	2021102600001320	当升科技	2021-10-26	406,700.00	5,000.00	14	3.40	537.75	-	-
中信证券	2021110200000602	特锐德	2021-11-02	8,535,000.00	300,000.00	7	3.50	5,808.54	-	-
中信证券	2021110200000673	天奈科技	2021-11-02	15,879,000.00	100,000.00	14	7.10	43,843.68	-	-
中信证券	2021110200004500	新宙邦	2021-11-02	1,917,600.00	13,600.00	14	3.70	2,759.21	-	-
中信证券	2021110400000812	嘉元科技	2021-11-04	915,300.00	6,000.00	14	3.60	1,281.42	-	-
中信证	2021110500065619	寒锐钴	2021-11-05	777,800.00	10,000.00	14	3.20	967.93	-	-

券		业								
中信证	2021110500065621	当升科技	2021-11-05	3,904,400.00	43,000.00	14	3.40	5,162.48	-	-
券		中伟股份	2021-11-05	1,910,725.00	11,500.00	14	4.50	3,343.77	-	-
中信证	2021110900017610	当升科技	2021-11-09	488,000.00	5,000.00	14	3.40	645.24	-	-
券		特锐德	2021-11-12	109,044.00	3,600.00	28	3.30	279.88	-	-
中信证	2021111200003889	容百科技	2021-11-12	187,320.00	1,500.00	28	3.00	437.08	-	-
券		天奈科技	2021-11-12	190,572.00	1,200.00	28	7.00	1,037.56	-	-
中信证	2021111200003893	嘉元科技	2021-11-12	145,860.00	1,000.00	28	3.50	397.06	-	-
券		杭可科技	2021-11-12	112,900.00	1,000.00	28	1.80	158.06	-	-
中信证	2021111200004737	寒锐钴业	2021-11-12	93,132.00	1,200.00	28	3.40	246.28	-	-
券		翔丰华	2021-11-12	60,660.00	1,000.00	28	3.40	160.41	-	-
中信证	2021111200004741	先导智能	2021-11-12	497,553.00	5,700.00	28	2.80	1,083.56	-	-
券		新宙邦	2021-11-12	237,618.00	1,800.00	28	3.30	609.89	-	-
中信证	2021111200004743	宁德	2021-11-12	1,346,100.00	2,100.00	28	2.60	2,722.11	-	-
券										

证券		时代								
中信证券	2021111200004749	亿纬锂能	2021-11-12	907,971.00	6,900.00	28	3.00	2,118.60	-	-
中信证券	2021111200004751	当升科技	2021-11-12	199,668.00	2,100.00	28	3.30	512.48	-	-
中信证券	2021111200004753	汇川技术	2021-11-12	655,743.00	9,300.00	28	3.00	1,530.07	-	-
中信证券	2021111600001104	特锐德	2021-11-16	2,229,158.00	73,400.00	14	3.40	2,947.44	-	-
中信证券	2021111600001108	亿纬锂能	2021-11-16	2,870,536.00	23,200.00	14	3.20	3,572.22	-	-
中信证券	2021111600004774	天奈科技	2021-11-16	15,070,000.00	100,000.00	14	7.40	43,368.11	-	-
中信证券	2021111600004778	新宙邦	2021-11-16	1,683,680.00	13,600.00	14	2.60	1,702.39	-	-
中信证券	2021111700005343	天奈科技	2021-11-17	6,202,800.00	40,000.00	28	1.80	8,683.92	-	-
中信证券	2021111800005577	先导智能	2021-11-18	560,000.00	7,000.00	28	3.30	1,437.33	-	-
中信证券	2021111800005585	嘉元科技	2021-11-18	7,088,490.00	51,000.00	28	3.20	17,642.46	-	-
中信证券	2021111900038909	寒锐钴业	2021-11-19	793,700.00	10,000.00	14	3.40	1,049.45	-	-
中信证券	2021111900038921	当升科技	2021-11-19	4,038,990.00	43,000.00	14	3.30	5,183.37	-	-
中	2021111900038923	中	2021-	2,093,230.00	11,500.00	14	4.60	3,744.56	-	-

信 证 券		伟 股 份	11-19								
中 信 证 券	2021112300000885	当 升 科 技	2021- 11-23	106,400.00	1,000.00	14	3.60	148.96	-	-	
中 信 证 券	2021112300012018	当 升 科 技	2021- 11-23	532,000.00	5,000.00	14	3.40	703.42	-	-	
中 信 证 券	2021113000004131	新 宙 邦	2021- 11-30	1,648,320.00	13,600.00	14	3.90	2,499.95	-	-	
中 信 证 券	2021113000004133	亿 纬 锂 能	2021- 11-30	3,392,768.00	23,200.00	14	3.40	4,485.99	-	-	
中 信 证 券	2021113000004135	特 锐 德	2021- 11-30	2,213,744.00	73,400.00	14	3.50	3,013.15	-	-	
中 信 证 券	2021120200000803	当 升 科 技	2021- 12-02	3,419,208.00	31,200.00	14	3.60	4,786.89	-	-	
中 信 证 券	2021120300017245	当 升 科 技	2021- 12-03	4,601,000.00	43,000.00	14	3.60	6,441.40	-	-	
中 信 证 券	2021120700001079	亿 纬 锂 能	2021- 12-07	539,840.00	4,000.00	14	3.00	629.81	-	-	
中 信 证 券	2021120700001083	汇 川 技 术	2021- 12-07	2,424,610.00	37,000.00	14	3.30	3,111.58	-	-	
中 信 证 券	2021120700008653	当 升 科 技	2021- 12-07	491,500.00	5,000.00	14	3.60	688.10	-	-	
中 信 证 券	2021120900000720	特 锐 德	2021- 12-09	102,240.00	3,600.00	14	3.30	131.21	-	-	
中 信 证 券	2021120900000724	新 宙 邦	2021- 12-09	2,012,418.00	16,600.00	14	4.00	3,130.43	-	-	

中信证券	2021120900000726	新宙邦	2021-12-09	218,214.00	1,800.00	14	4.00	339.44	-	-
中信证券	2021120900000753	翔丰华	2021-12-09	74,520.00	1,000.00	14	3.70	107.23	-	-
中信证券	2021121400011878	亿纬锂能	2021-12-14	3,106,480.00	23,200.00	14	3.40	4,107.46	-	-
中信证券	2021121400011880	新宙邦	2021-12-14	1,573,792.00	13,600.00	14	4.10	2,509.32	-	-
中信证券	2021121400011882	特锐德	2021-12-14	2,108,048.00	73,400.00	14	3.20	2,623.35	-	-
中信证券	2021121500015765	天奈科技	2021-12-15	5,708,800.00	40,000.00	28	1.80	4,567.04	5,971,600.00	4,567.04
中信证券	2021121600008301	先导智能	2021-12-16	580,580.00	7,000.00	28	3.40	822.49	520,590.00	822.49
中信证券	2021121600008303	当升科技	2021-12-16	2,964,000.00	31,200.00	14	3.00	3,458.00	-	-
中信证券	2021121600008305	嘉元科技	2021-12-16	7,075,740.00	51,000.00	28	3.30	9,729.14	6,403,050.00	9,729.14
中信证券	2021121700002509	中伟股份	2021-12-17	1,591,500.00	10,000.00	14	1.70	1,052.16	-	-
中信证券	2021121700027066	当升科技	2021-12-17	4,028,670.00	43,000.00	14	3.00	4,700.12	-	-
中信证券	2021122100001544	宁德时代	2021-12-21	785,291.00	1,300.00	14	3.20	698.04	764,400.00	698.04
中信证	2021122100001570	汇川技	2021-12-21	72,280.00	1,000.00	14	2.70	54.21	68,600.00	54.21

券		术								
中信	2021122100019751	亿纬	2021-	493,200.00	4,000.00	14	3.40	465.80	472,720.00	465.80
证券		锂能	12-21							
中信	2021122100019753	当升	2021-	448,050.00	5,000.00	14	3.00	373.38	434,350.00	373.38
证券		科技	12-21							
中信	2021122300000955	中伟	2021-	563,920.00	3,500.00	14	3.30	413.54	530,285.00	413.54
证券		股份	12-23							
中信	2021122300010297	特锐	2021-	90,972.00	3,600.00	14	3.50	70.75	89,532.00	70.75
证券		德	12-23							
中信	2021122300010299	新宙	2021-	201,348.00	1,800.00	14	3.50	156.61	203,400.00	156.61
证券		邦	12-23							
中信	2021122300011495	翔丰	2021-	62,850.00	1,000.00	14	3.70	51.67	61,830.00	51.67
证券		华	12-23							
中信	2021122300011497	新宙	2021-	1,856,876.00	16,600.00	14	4.10	1,691.82	1,875,800.00	1,691.82
证券		邦	12-23							
中信	2021122700001104	中伟	2021-	1,813,203.00	11,900.00	14	2.90	584.25	1,802,969.00	584.25
证券		股份	12-27							
中信	2021122800014006	新宙	2021-	1,543,600.00	13,600.00	14	3.50	450.22	1,536,800.00	450.22
证券		邦	12-28							
中信	2021122800014012	亿纬	2021-	2,816,248.00	23,200.00	14	3.10	727.53	2,741,776.00	727.53
证券		锂能	12-28							
中信	2021122800014014	特锐	2021-	1,846,010.00	73,400.00	14	3.50	538.42	1,825,458.00	538.42
证券		德	12-28							
中信	2021123000009296	当升	2021-	2,666,040.00	31,200.00	14	3.10	229.58	2,710,344.00	229.58
证券		科技	12-30							
中信	2021123100001176	宁德	2021-	764,400.00	1,300.00	14	1.80	-	764,400.00	-
信		德	12-31							

证券		时代								
中信证券	2021123100024392	当升科技	2021-12-31	3,735,410.00	43,000.00	14	3.10	-	3,735,410.00	-
中信证券	2021123100024450	中伟股份	2021-12-31	1,515,100.00	10,000.00	14	1.70	-	1,515,100.00	-

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
华夏中证新能源汽车 ETF 发起式联接	104,850,100.00	1.89%	73,590,100.00	1.81%
中信中证资本	7,514,900.00	0.14%	255,400.00	0.01%
中信证券	4,104,610.00	0.07%	2,784,432.00	0.07%

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
中国银行活期存款	36,875,241.53	146,079.95	51,101,316.88	232,374.55

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入



				数量（单 位：股/张）	总金额
中信证券	688041	海光信息	新股发行	70,208	2,527,488.00
中信证券	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	688271	联影医疗	新股发行	7,365	809,266.20
中信证券	688382	益方生物	新股发行	36,208	656,088.96
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
中信证券	688114	华大智造	新股发行	5,336	465,192.48
中信证券	688061	灿瑞科技	新股发行	3,972	447,604.68
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	688380	中微半导	新股发行	12,677	391,212.22
中信证券	301269	华大九天	新股发行	11,677	381,721.13
中信证券	688141	杰华特	新股发行	9,946	380,533.96
中信证券	301165	锐捷网络	新股发行	10,769	348,700.22
中信证券	301349	信德新材	新股发行	1,798	249,706.24
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	301335	天元宠物	新股发行	4,192	209,516.16
中信证券	688432	有研硅	新股发行	20,044	198,636.04
中信证券	688370	丛麟科技	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	600941	中国移动	新股发行	124,803	7,186,156.74
中信证券	688235	百济神州	新股发行	19,217	3,701,194.20
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	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	福莱茵特	新股发行	435	14,011.35
中信证券	605060	联德股份	新股发行	883	13,765.97
中信证券	605599	菜百股份	新股发行	980	9,800.00
中信证券	605488	福莱新材	新股发行	416	8,498.88
中信证券	605138	盛泰集团	新股发行	723	7,208.31
中信证券	001208	华菱线缆	新股发行	1,754	6,437.18
中信证券	605020	永和股份	新股发行	850	5,890.50
中信证券	003040	楚天龙	新股发行	1,101	5,086.62
中信证券	001219	青岛食品	新股发行	272	4,678.40
中信证券	601279	英利汽车	新股发行	2,004	4,148.28

## 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

## 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

## 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

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

## 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量(单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688503	聚和材料	2022-12-02	6 个月	新发流通受限	110.00	136.39	3,277	360,470.00	446,950.03	-
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	-
688370	丛麟科技	2022-08-17	6 个月	新发流通受限	59.76	34.87	3,254	194,459.04	113,466.98	-
688132	邦彦技术	2022-09-16	6 个月	新发流通受限	28.88	22.80	4,844	139,894.72	110,443.20	-
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	-
688244	永信至诚	2022-10-12	6 个月	新发流通受限	49.19	50.14	1,506	74,080.14	75,510.84	-
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	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-

				受限						
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	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-

				受限						
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	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-

				受限						
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5日-2023年1月30日	393.42	308,500.00	121,370,070.00
2	002466	天齐锂业	2023年1月4日-2023年1月12日	78.99	711,500.00	56,201,385.00
3	300450	先导智能	2023年1月3日-2023年1月12日	40.25	1,319,400.00	53,105,850.00
4	603799	华友钴业	2023年1月5日-2023年1月13日	55.63	682,800.00	37,984,164.00
5	300124	汇川技术	2023年1月5日-2023年1月17日	69.50	478,800.00	33,276,600.00
6	300014	亿纬锂能	2023年1月5日-2023年1月17日	87.90	333,400.00	29,305,860.00
7	300390	天华超净	2023年1月4日-2023年1月18日	55.88	517,600.00	28,923,488.00
8	300769	德方纳米	2023年1月3日-2023年1月19日	229.59	124,100.00	28,492,119.00
9	002460	赣锋锂业	2023年1月3日-2023年1月12日	69.51	366,600.00	25,482,366.00
10	002812	恩捷股份	2023年1月4日-2023年1月18日	131.29	174,800.00	22,949,492.00
11	603659	璞泰来	2023年1月5日-2023年1月12日	51.89	383,600.00	19,905,004.00
12	300568	星源材质	2023年1月3日-2023年1月12日	21.26	903,700.00	19,212,662.00
13	688005	容百科技	2023年1月	68.75	264,300.00	18,170,625.00

			3日-2023年 1月12日			
14	002240	盛新锂能	2023年1月 3日-2023年 1月12日	37.49	418,700.00	15,697,063.00
15	000009	中国宝安	2023年1月 4日-2023年 1月12日	12.09	1,149,900.00	13,902,291.00
16	002074	国轩高科	2023年1月 4日-2023年 1月18日	28.83	458,100.00	13,207,023.00
17	002594	比亚迪	2023年1月 5日-2023年 1月12日	256.97	49,300.00	12,668,621.00
18	300919	中伟股份	2023年1月 3日-2023年 1月18日	65.61	174,500.00	11,448,945.00
19	002340	格林美	2023年1月 3日-2023年 1月12日	7.43	1,376,500.00	10,227,395.00
20	002709	天赐材料	2023年1月 3日-2023年 1月12日	43.86	191,800.00	8,412,348.00
21	300432	富临精工	2023年1月 3日-2023年 1月18日	14.43	562,800.00	8,121,204.00
22	600563	法拉电子	2023年1月 5日-2023年 1月18日	159.88	50,000.00	7,994,000.00
23	300037	新宙邦	2023年1月 4日-2023年 1月30日	43.47	176,600.00	7,676,802.00
24	000762	西藏矿业	2023年1月 4日-2023年 1月18日	38.61	190,200.00	7,343,622.00
25	688388	嘉元科技	2023年1月 4日-2023年 1月12日	44.85	147,700.00	6,624,345.00
26	600110	诺德股份	2023年1月 5日-2023年 1月12日	7.95	754,800.00	6,000,660.00
27	002407	多氟多	2023年1月 3日-2023年 1月12日	33.32	164,300.00	5,474,476.00
28	600699	均胜电子	2023年1月 3日-2023年 1月12日	14.05	356,200.00	5,004,610.00
29	002850	科达利	2023年1月 4日-2023年 1月12日	118.81	40,000.00	4,752,400.00
30	300618	寒锐钴业	2023年1月	40.05	107,400.00	4,301,370.00



			3日-2023年 1月12日			
31	688006	杭可科技	2023年1月 4日-2023年 1月12日	43.77	93,700.00	4,101,249.00
32	002050	三花智控	2023年1月 3日-2023年 1月12日	21.22	167,700.00	3,558,594.00
33	300001	特锐德	2023年1月 3日-2023年 1月30日	15.21	213,200.00	3,242,772.00
34	300073	当升科技	2023年1月 4日-2023年 1月12日	56.40	52,400.00	2,955,360.00
35	300035	中科电气	2023年1月 3日-2023年 1月12日	20.58	140,800.00	2,897,664.00
36	002497	雅化集团	2023年1月 5日-2023年 1月12日	23.25	92,300.00	2,145,975.00
37	603906	龙蟠科技	2023年1月 3日-2023年 1月10日	23.15	88,100.00	2,039,515.00
38	603026	胜华新材	2023年1月 5日-2023年 1月10日	92.30	20,000.00	1,846,000.00
39	600885	宏发股份	2023年1月 3日-2023年 1月12日	33.41	52,700.00	1,760,707.00
40	688116	天奈科技	2023年1月 5日-2023年 1月12日	77.14	21,000.00	1,619,940.00
41	600884	杉杉股份	2023年1月 5日-2023年 1月12日	18.20	71,700.00	1,304,940.00
42	688567	孚能科技	2023年1月 5日-2023年 1月12日	27.03	39,700.00	1,073,091.00
43	301238	瑞泰新材	2023年1月 3日-2023年 1月12日	22.49	45,000.00	1,012,050.00
44	002192	融捷股份	2023年1月 5日-2023年 1月5日	97.90	10,000.00	979,000.00
45	600549	厦门钨业	2023年1月 5日-2023年 1月12日	19.55	43,400.00	848,470.00
46	688707	振华新材	2023年1月 5日-2023年 1月12日	44.95	10,800.00	485,460.00
47	600066	宇通客车	2023年1月	7.51	63,500.00	476,885.00

			5日-2023年 1月12日			
48	688499	利元亨	2023年1月 4日-2023年 1月10日	157.38	3,000.00	472,140.00
49	301219	腾远钴业	2023年1月 3日-2023年 1月10日	68.93	4,400.00	303,292.00
50	688779	长远锂科	2023年1月 10日-2023 年1月12 日	14.59	15,900.00	231,981.00
合计					14,187,200.00	676,591,945.00

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内。

##### 7.4.13.2 信用风险

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

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

##### 7.4.13.3 流动性风险

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

除在“7.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，

本基金所投资的证券均能及时变现。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

##### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	9,252,852,405.37	99.58	9,519,224,893.19	99.37
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	9,252,852,405.37	99.58	9,519,224,893.19	99.37

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	除中证新能源汽车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%	-455,560,357.50	-482,276,426.90
+5%	455,560,357.50	482,276,426.90	

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	9,250,839,211.87	9,515,608,150.94
第二层次	385,863.40	3,616,742.25
第三层次	1,627,330.10	-
合计	9,252,852,405.37	9,519,224,893.19

## 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	-	1,687,305.12	1,687,305.12
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-59,975.02	-59,975.02
其中：计入损益的利得或损失	-	-59,975.02	-59,975.02
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,627,330.10	1,627,330.10
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	-	-59,975.02	-59,975.02

## 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	1,627,330.10	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1444-2.4756	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	9,252,852,405.37	99.08
	其中：股票	9,252,852,405.37	99.08
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	54,579,979.09	0.58
8	其他各项资产	31,671,147.01	0.34
9	合计	9,339,103,531.47	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 676,591,945.00 元，占本基金期末资产净值的 7.28%。

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	196,637,881.11	2.12
C	制造业	8,921,012,086.35	96.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	329,038.78	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	52,566.35	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	113,466.98	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	134,640,768.60	1.45
	合计	9,252,852,405.37	99.58

## 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	300750	宁德时代	2,497,934	982,737,194.28	10.58
2	002594	比亚迪	3,720,006	955,929,941.82	10.29
3	300124	汇川技术	10,040,325	697,802,587.50	7.51
4	300014	亿纬锂能	6,612,220	581,214,138.00	6.25
5	002466	天齐锂业	5,580,514	440,804,800.86	4.74
6	002460	赣锋锂业	6,088,982	423,245,138.82	4.55
7	603799	华友钴业	6,898,781	383,779,187.03	4.13
8	002812	恩捷股份	2,889,580	379,372,958.20	4.08
9	002709	天赐材料	6,238,816	273,634,469.76	2.94
10	002050	三花智控	11,628,713	246,761,289.86	2.66
11	300450	先导智能	5,917,819	238,192,214.75	2.56
12	002340	格林美	27,718,567	205,948,952.81	2.22
13	603659	璞泰来	3,753,878	194,788,729.42	2.10
14	002074	国轩高科	5,757,894	166,000,084.02	1.79
15	300769	德方纳米	656,093	150,632,391.87	1.62
16	600885	宏发股份	4,501,888	150,408,078.08	1.62
17	002497	雅化集团	6,220,300	144,621,975.00	1.56
18	002407	多氟多	4,133,589	137,731,185.48	1.48
19	000009	中国宝安	11,136,540	134,640,768.60	1.45
20	002240	盛新锂能	3,444,800	129,145,552.00	1.39
21	300073	当升科技	2,187,104	123,352,665.60	1.33
22	300037	新宙邦	2,804,993	121,933,045.71	1.31
23	300568	星源材质	5,530,429	117,576,920.54	1.27
24	600563	法拉电子	728,049	116,400,474.12	1.25
25	300390	天华超净	2,074,450	115,920,266.00	1.25
26	600884	杉杉股份	6,073,244	110,533,040.80	1.19
27	002192	融捷股份	1,121,100	109,755,690.00	1.18
28	688567	孚能科技	3,920,498	105,971,060.94	1.14
29	688005	容百科技	1,460,876	100,435,225.00	1.08
30	600549	厦门钨业	4,592,999	89,793,130.45	0.97
31	002850	科达利	753,597	89,534,859.57	0.96
32	000762	西藏矿业	2,250,251	86,882,191.11	0.93

33	300035	中科电气	3,903,896	80,342,179.68	0.86
34	688116	天奈科技	1,003,121	77,380,753.94	0.83
35	600699	均胜电子	5,168,212	72,613,378.60	0.78
36	300919	中伟股份	1,085,608	71,226,740.88	0.77
37	603026	胜华新材	765,001	70,609,592.30	0.76
38	688779	长远锂科	4,166,012	60,782,115.08	0.65
39	600110	诺德股份	7,536,711	59,916,852.45	0.64
40	300001	特锐德	3,931,748	59,801,887.08	0.64
41	300432	富临精工	3,946,671	56,950,462.53	0.61
42	600066	宇通客车	7,169,724	53,844,627.24	0.58
43	688707	振华新材	1,195,024	53,716,328.80	0.58
44	300618	寒锐钴业	1,169,603	46,842,600.15	0.50
45	688388	嘉元科技	986,394	44,239,770.90	0.48
46	603906	龙蟠科技	1,525,481	35,314,885.15	0.38
47	688499	利元亨	189,301	29,792,191.38	0.32
48	688006	杭可科技	657,539	28,780,482.03	0.31
49	301219	腾远钴业	367,770	25,350,386.10	0.27
50	301238	瑞泰新材	790,798	17,785,047.02	0.19
51	688503	聚和材料	3,277	446,950.03	0.00
52	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.00
53	688370	丛麟科技	3,254	113,466.98	0.00
54	688132	邦彦技术	4,844	110,443.20	0.00
55	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
56	688244	永信至诚	1,506	75,510.84	0.00
57	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
58	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
59	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
60	301308	江波龙	819	46,453.68	0.00
61	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
62	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
63	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
64	301195	北路智控	330	24,103.20	0.00
65	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
66	301330	熵基科技	694	21,729.14	0.00
67	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
68	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
69	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
70	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
71	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
72	301115	建科股份	685	16,467.40	0.00
73	301223	中荣股份	815	14,775.95	0.00
74	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
75	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
76	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
77	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
78	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
79	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
80	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
81	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
82	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00



83	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
84	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
85	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
86	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
87	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
88	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
89	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
90	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
91	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
92	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
93	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
94	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
95	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
96	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
97	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
98	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
99	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
100	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
101	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
102	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
103	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	002594	比亚迪	1,711,492,364.27	17.87
2	300750	宁德时代	1,665,185,807.47	17.38
3	002812	恩捷股份	952,186,882.86	9.94
4	300124	汇川技术	941,098,099.83	9.82
5	300014	亿纬锂能	872,469,882.69	9.11
6	002466	天齐锂业	862,572,587.01	9.00
7	002460	赣锋锂业	822,482,791.40	8.59
8	002709	天赐材料	537,338,523.09	5.61
9	300450	先导智能	501,142,862.96	5.23
10	300769	德方纳米	358,619,723.23	3.74
11	002050	三花智控	355,186,696.73	3.71
12	002340	格林美	351,240,024.35	3.67
13	002074	国轩高科	322,409,968.60	3.37
14	000009	中国宝安	269,705,201.88	2.82
15	300390	天华超净	268,931,287.03	2.81
16	300073	当升科技	264,809,230.30	2.76
17	002240	盛新锂能	256,561,975.24	2.68
18	002407	多氟多	252,754,015.32	2.64
19	300568	星源材质	226,105,355.34	2.36
20	300919	中伟股份	219,581,507.27	2.29
21	002192	融捷股份	200,464,730.47	2.09

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	002594	比亚迪	1,702,959,335.82	17.78
2	300750	宁德时代	1,239,475,299.77	12.94
3	002812	恩捷股份	811,815,583.23	8.47
4	300124	汇川技术	800,911,772.41	8.36
5	002466	天齐锂业	756,234,375.23	7.89
6	300014	亿纬锂能	708,273,580.99	7.39
7	002460	赣锋锂业	705,909,430.25	7.37
8	002709	天赐材料	481,095,657.73	5.02
9	300450	先导智能	422,822,065.76	4.41
10	300769	德方纳米	307,927,483.31	3.21
11	002340	格林美	284,499,448.14	2.97
12	002050	三花智控	269,349,960.91	2.81
13	000009	中国宝安	264,384,223.52	2.76
14	002074	国轩高科	263,277,287.24	2.75
15	300073	当升科技	215,327,449.72	2.25
16	300568	星源材质	213,812,155.59	2.23
17	002240	盛新锂能	213,387,133.69	2.23
18	002407	多氟多	191,579,940.75	2.00
19	002192	融捷股份	172,859,056.75	1.80
20	300037	新宙邦	162,028,812.93	1.69

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	14,473,235,603.46
卖出股票收入（成交）总额	11,969,558,834.55

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，江西赣锋锂业集团股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门立案调查。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，赣锋锂业系标的指数成份股，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	3,322,728.34
2	应收清算款	28,040,526.45
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	307,892.22
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,671,147.01

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	121,370,070.00	1.31	转融通出借证券受

					限
2	002466	天齐锂业	56,201,385.00	0.60	转融通出借证券受限
3	603799	华友钴业	37,984,164.00	0.41	转融通出借证券受限
4	300124	汇川技术	33,276,600.00	0.36	转融通出借证券受限
5	300014	亿纬锂能	29,305,860.00	0.32	转融通出借证券受限
6	002460	赣锋锂业	25,482,366.00	0.27	转融通出借证券受限
7	002812	恩捷股份	22,949,492.00	0.25	转融通出借证券受限
8	002594	比亚迪	12,668,621.00	0.14	转融通出借证券受限
9	002709	天赐材料	8,412,348.00	0.09	转融通出借证券受限
10	002050	三花智控	3,558,594.00	0.04	转融通出借证券受限

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏中证新能源汽车ETF发起式联接	
		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
139,903	39,658.79	2,901,071,566.00	52.29%	2,542,462,334.00	45.82%	104,850,100.00	1.89%

### 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	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—汇添富基金国寿股份成长股票型组合	443,406,600.00	7.99%
2	中国人寿保险股份有限公司	399,457,140.00	7.20%
3	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	349,403,889.00	6.30%
4	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—传统险—汇添富国寿股份成长	239,753,194.00	4.32%

	股票传统可供出		
5	招商财富资管—青银理财璀璨人生奋斗系列开放式净值型人民币个人理财计划—招商财富	163,888,657.00	2.95%
6	北京诚通金控投资有限公司	70,622,638.00	1.27%
7	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—万能 B—汇添富国寿股份成长股票型组合万	62,622,500.00	1.13%
8	中信银行股份有限公司—中欧睿智精选一年持有期混合型基金中基金 (FOF)	61,698,200.00	1.11%
9	华夏人寿保险股份有限公司—分红—一个险分红	47,890,400.00	0.86%
10	中国民生银行股份有限公司—中欧甄选 3 个月持有期混合型基金中基金 (FOF)	46,640,100.00	0.84%
11	中国银行股份有限公司—华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	104,850,100.00	1.89%

### 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	53,100.00	0.00%

### 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

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

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日 (2020 年 2 月 20 日) 基金份额总额	10,762,884,000.00
本报告期期初基金份额总额	4,059,384,000.00
本报告期基金总申购份额	7,919,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,430,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,548,384,000.00

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

## 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

## 11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）的报酬为 100,000 元人民币。截至本报告期末，该事务所已向本基金提供 3 年的审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
海通证券	5	4,740,045,514.94	17.96%	2,044,389.74	17.96%	-
中信证券	23	3,568,383,320.50	13.52%	1,539,042.82	13.52%	-
中信建投证券	5	2,998,578,074.33	11.36%	1,293,292.74	11.36%	-
申万宏源证券	4	2,987,029,525.69	11.32%	1,288,312.06	11.32%	-
中金公司	4	2,973,012,117.64	11.27%	1,282,267.71	11.27%	-
广发证券	3	2,591,913,891.17	9.82%	1,117,898.29	9.82%	-
长江证券	4	2,063,675,504.42	7.82%	890,066.90	7.82%	-
国盛证券	2	1,576,970,076.14	5.98%	680,149.39	5.98%	-
方正证券	4	1,195,480,673.72	4.53%	515,613.52	4.53%	-
国信证券	3	962,379,935.90	3.65%	415,076.43	3.65%	-
华泰证券	3	698,942,401.96	2.65%	301,456.44	2.65%	-
招商证券	4	30,656,323.88	0.12%	13,222.43	0.12%	-
中国银河证券	7	287,031.30	0.00%	123.80	0.00%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③ 除本表列示外，本基金还选择了东北证券、东方财富证券、东方证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、高华证券、国金证券、国泰君安证券、华安证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、太平洋证券、天风证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、浙商证券、中国银河证券、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，长江证券、东海证券、中信建投证券的部分交易单元、五矿证券、西南证券、浙商证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元，华泰证券的部分交易单元、粤开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	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
海通证券	1,358,533.80	5.72%	-	-	-	-	-	-
中信证券	15,040,350.85	63.29%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	5,609,022.11	23.60%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,756,833.90	7.39%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-01-21
2	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-12
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-17
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-19
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-02-23
6	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-12
7	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-03-19
8	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-02
9	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-08
10	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-13
11	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-04-16
12	华夏基金管理有限公司关于旗下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
13	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
14	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-06-24
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	2022-06-25
16	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-07
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	2022-07-20
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	2022-07-23
19	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-07-30
20	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-08-06



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	2022-08-10
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	2022-08-12
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	2022-08-13
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	2022-08-19
25	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-09-01
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	2022-09-03
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	2022-09-22
28	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-10-14
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	2022-10-20
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	2022-10-22
31	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-11-05
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	2022-11-12
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	2022-11-16
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	2022-11-26
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	2022-11-30
36	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-16
37	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-17
38	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-20
39	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-23
40	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2022-12-24

## §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

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证新能源汽车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