

天弘创业板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:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2022年01月01日起至2022年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	183
8.1 期末基金资产组合情况	183
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	184
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	186
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	191
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	193
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	193
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	193
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	193
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	193
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	193

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	193
8.12 投资组合报告附注.....	193
§9 基金份额持有人信息.....	195
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	195
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	196
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	196
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情况.....	197
§10 开放式基金份额变动.....	197
§11 重大事件揭示.....	197
11.1 基金份额持有人大会决议.....	197
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.....	197
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	197
11.4 基金投资策略的改变.....	197
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	198
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.....	198
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	198
11.8 其他重大事件.....	200
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	203
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.....	203
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	204
§13 备查文件目录.....	204
13.1 备查文件目录.....	204
13.2 存放地点.....	205
13.3 查阅方式.....	205

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创业板ETF天弘
场内简称	创业板ETF天弘
基金主代码	159977
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年09月12日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,167,936,410.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019年09月27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的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	<p>本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。</p> <p>主要产品投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通</p>

	证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。
业绩比较基准	创业板指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

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	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	021-38917599-5
传真	022-83865564	021-38677819
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码	300203	200041
法定代表人	韩歆毅	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况**3.1 主要会计数据和财务指标**

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022年	2021年	2020年
本期已实现收益	-402,236,649.24	999,259,914.11	1,107,447,699.79
本期利润	-1,444,938,608.90	574,883,307.08	1,697,865,571.49
加权平均基金份额 本期利润	-0.7892	0.4837	1.1359
本期加权平均净值 利润率	-30.58%	15.10%	47.54%
本期基金份额净值 增长率	-29.15%	12.45%	66.18%
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	1,481,488,188.62	1,806,457,144.07	988,507,439.64
期末可供分配基金 份额利润	0.6834	1.6620	0.7877
期末基金资产净值	5,157,610,163.50	3,649,551,251.36	3,746,994,857.06
期末基金份额净值	2.3790	3.3576	2.9858
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	40.30%	98.01%	76.09%

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（例如，开放式基金的申购赎回费等），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

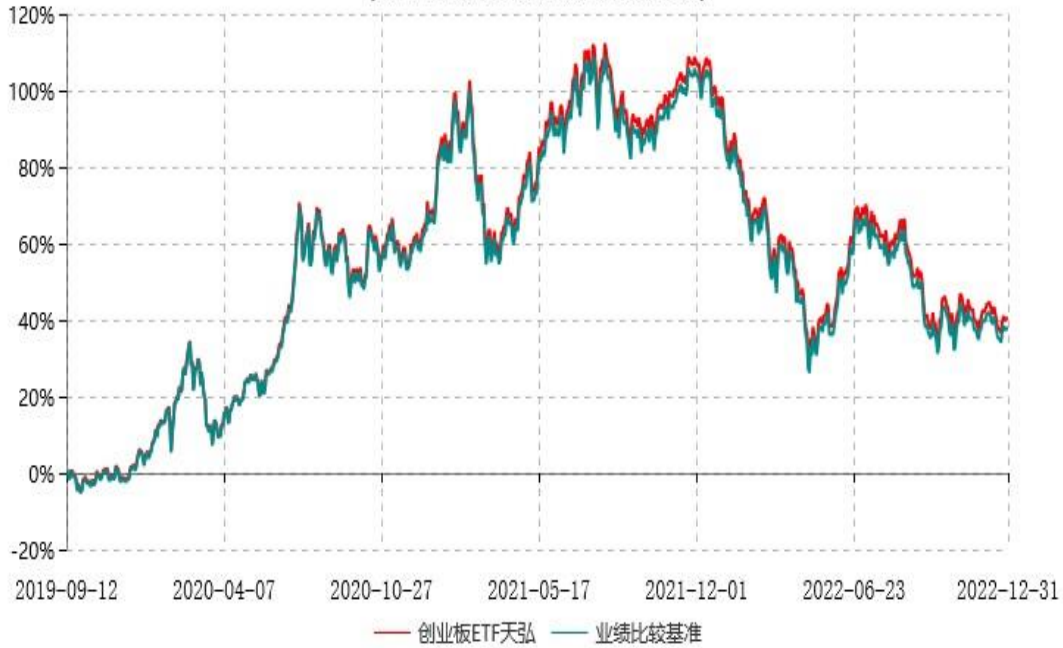
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.53%	1.49%	2.53%	1.49%	0.00%	0.00%
过去六个月	-16.46%	1.47%	-16.50%	1.47%	0.04%	0.00%
过去一年	-29.15%	1.77%	-29.37%	1.77%	0.22%	0.00%
过去三年	32.41%	1.83%	30.51%	1.83%	1.90%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	40.30%	1.77%	37.76%	1.78%	2.54%	-0.01%

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

天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

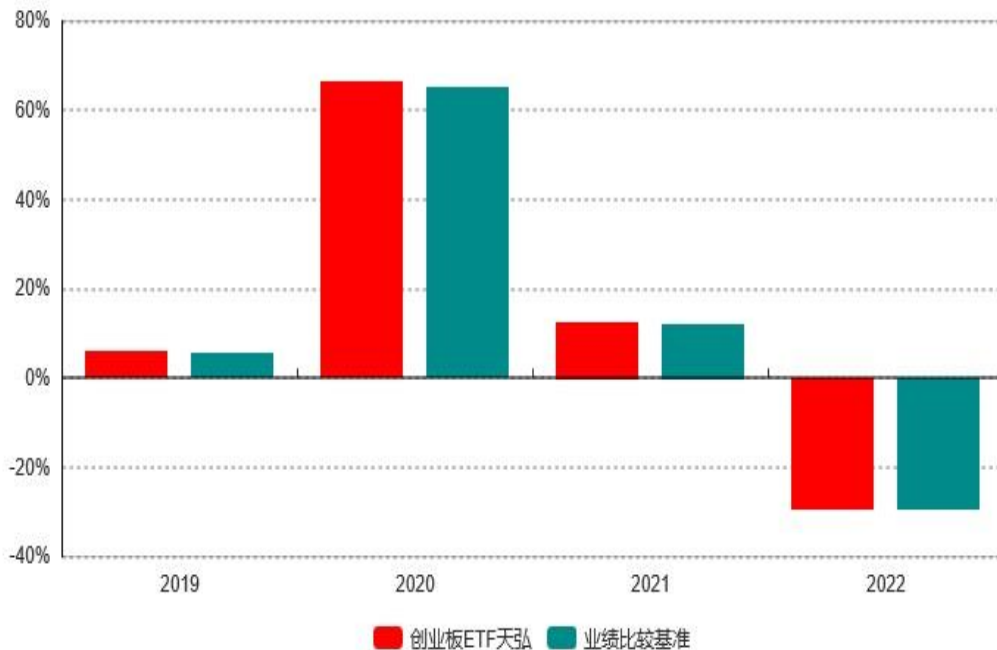
(2019年09月12日-2022年12月31日)



注：1、本基金合同于2019年09月12日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



注：本基金合同于2019年09月12日生效。基金合同生效当年2019年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，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

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2022年12月31日，公司共管理运作170只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年	说明
		任职日期	离任日期		

				限	
林心龙	本基金基金经理	2022年05月	-	7年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理，2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。
杨超	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2019年09月	2022年05月	12年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
张子法	本基金基金经理	2019年09月	2022年12月	15年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品

种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司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%的交易次数为4次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

本基金作为一只被动指数型基金，以最小化跟踪误差为投资目标，紧密跟踪标的指数。报告期内本基金秉承合规与风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

报告期内，本基金跟踪误差和超额收益的来源主要是申购赎回导致的仓位和结构偏离、标的指数样本股调整导致的结构偏离、成分股分红和打新四方面因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，在保证跟踪误差可控的前提下实现了相对基准指数的正向偏离。报告期内，本基金整体运行平稳。

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2.3790元，本报告期份额净值增长率-29.15%，同期业绩比较基准增长率-29.37%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022年受美联储加息周期开启、全球通胀、地缘政治冲突加剧等一系列海外宏观因素扰动，全球资本市场风险偏好下行压力较大，弱势行情延续全年。其中外胀内滞是全年的宏观主基调，货币政策外紧内松与出口回落导致人民币贬值幅度较大，叠加国内疫情反复、地产信贷风险、稳增长不及预期等多重压力，权益资产全年承压。直至四季度下旬，随着疫情政策转向、地产纾困落地、美元流动性见底，市场才逐步企稳回升。展望2023年，在国内经济修复、海外流动性好转的宏观背景下，A股中枢有望逐步抬升。过去一年抑制国内经济内生动能的地产风险问题，在房企纾困落地以及扩内需政策的关注下有望得到一定改善，而随着疫情优化政策的全面落实，2023年在短期的疫后经济脉冲式回落过后，国内经济基本面有望迎来内生性修复，并向着经济常态回归。同时，海外环境也朝着有利于权益资产的方向发展，欧美经济的下行压力在2023年将进一步凸显，在警惕经济衰退风险同时，货币宽松作为应对衰退手段值得期待，特别是在上半年通胀压力明显缓解后，2023年下半年海外货币政策灵活空间有望打开。节奏上，由于国内刚经历完三年疫情，居民和企业资产负债表的修复将需要相对更漫长的时间，经济基本面从企稳到确立复苏趋势，大致要经历“人员货物流动正常化”、“疫情受损行业恢复”、“收入和就业信心改善”、“地产销售及居民消费企稳”到“内需全面回暖”的过程，因此预计上半年经济要先经历爬坑，下半年才有望确立复苏趋势。相应的证券市场在缺乏实际需求配合的情况下，短期可能面临“向下有估值底部支撑、向上有现实基本面制约”的局面。二季度后内外环境更加确定，国内经济复苏趋势明朗化叠加库存周期逐步见底有望推动上市公司业绩重回修复通道，同时美联储加息也将步入尾声，届时A股有望迎来更具确定性的右侧配置机会。

具体行业赛道方面，创业板指聚焦的新能源、生物医药和半导体等科技领域均为最前沿、最具发展潜力的硬科技赛道，2022年受国内外宏观因素扰动影响，赛道股估值均遭受了较强的压制，伴随2023年国内经济修复的开启，市场情绪有望逐步回暖，板块亦有望迎来估值修复窗口期。本基金将持续跟踪各细分赛道的发展趋势和相关企业业绩兑

现情况，并密切关注海外通胀、美联储政策、流动性以及全球经济衰退预期变化对A股的潜在影响。

本基金为被动指数基金，我们将通过严谨的投资管理流程和精细的数量化模型，以及勤勉尽责的工作态度，恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人争取与基准相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

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，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

- 2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及

合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘创业板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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见

审计报告编号	普华永道中天审字(2023)第26362号
--------	-----------------------

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘创业板ETF”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘创业板ETF2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘创业板ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘创业板ETF的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制

	<p>财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估天弘创业板ETF的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算天弘创业板ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘创业板ETF的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天弘创业板ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大</p>

	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天弘创业板ETF不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2023-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	6,979,118.39	9,323,034.71
结算备付金		109,937.24	271,245.89
存出保证金		1,448,480.97	154,256.21
交易性金融资产	7.4.7.2	5,154,348,266.16	3,640,588,868.67
其中：股票投资		5,154,348,266.16	3,640,588,868.67
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	2,211,027.48
应收股利		-	1,155.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	649,800.45	153,033.16
资产总计		5,163,535,603.21	3,652,702,621.12
负债和净资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,071,463.53	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,175,891.98	1,504,819.41
应付托管费		435,178.38	300,963.87
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		21,531.83	13,535.45
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,221,373.99	1,332,051.03
负债合计		5,925,439.71	3,151,369.76
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	3,676,121,974.88	1,843,094,107.29
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	1,481,488,188.62	1,806,457,144.07
净资产合计		5,157,610,163.50	3,649,551,251.36
负债和净资产总计		5,163,535,603.21	3,652,702,621.12

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额净值2.3790元，基金份额总额2,167,936,410.00份。

7.2 利润表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2 021年12月31日
一、营业总收入		-1,414,857,691.83	600,973,307.11
1.利息收入		11,655,597.38	13,640,745.76
其中：存款利息收入	7.4.7.9	111,928.07	211,889.87
债券利息收入		-	3,246.70
资产支持证券利息收 入		-	-
买入返售金融资产收 入		-	-
证券出借利息收入		11,543,669.31	13,425,609.19
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-382,966,903.34	1,012,016,222.84

其中：股票投资收益	7.4.7.10	-407,306,500.08	992,481,263.57
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,133,731.05	6,477,357.47
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	23,205,865.69	13,057,601.80
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,042,701,959.66	-424,376,607.03
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-844,426.21	-307,054.46
减：二、营业总支出		30,080,917.07	26,090,000.03
1. 管理人报酬		23,542,555.66	19,059,251.94
2. 托管费		4,708,511.14	3,811,850.38
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	7.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		47,296.97	54,322.08
8. 其他费用	7.4.7.19	1,782,553.30	3,164,575.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,444,938,608.90	574,883,307.08
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,444,938,608.90	574,883,307.08
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,444,938,608.90	574,883,307.08

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01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）	1,843,094,107.29	-	1,806,457,144.07	3,649,551,251.36
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,843,094,107.29	-	1,806,457,144.07	3,649,551,251.36
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	1,833,027,867.59	-	-324,968,955.45	1,508,058,912.14
（一）、综合收益总额	-	-	-1,444,938,608.90	-1,444,938,608.90
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	1,833,027,867.59	-	1,119,969,653.45	2,952,997,521.04

少以“-”号填列)				
其中：1.基金申购款	3,282,832,517.4 3	-	1,850,788,798.5 9	5,133,621,316.0 2
2.基金赎回款	-1,449,804,649. 84	-	-730,819,145.14	-2,180,623,794. 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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	3,676,121,974.8 8	-	1,481,488,188.6 2	5,157,610,163.5 0
项目	上年度可比期间 2021年01月01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)	2,127,968,003.3 5	-	1,619,026,853.7 1	3,746,994,857.0 6
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,127,968,003.3 5	-	1,619,026,853.7 1	3,746,994,857.0 6
三、本期增减变动额(减少以“-”	-284,873,896.06	-	187,430,290.36	-97,443,605.70

号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	574,883,307.08	574,883,307.08
(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)	-284,873,896.06	-	-387,453,016.72	-672,326,912.78
其中: 1.基金申购款	2,594,387,268.88	-	2,217,326,394.33	4,811,713,663.21
2.基金赎回款	-2,879,261,164.94	-	-2,604,779,411.05	-5,484,040,575.99
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,843,094,107.29	-	1,806,457,144.07	3,649,551,251.36

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:

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1409号《关于准予天弘创业板交易型开

开放式指数证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币640,778,160.00元(含募集股票市值)，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0520号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年09月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为640,858,438.00份基金份额，其中认购资金利息折合80,278.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2019]581号文审核同意，本基金377,936,410.00份基金份额于2019年9月27日在深交所挂牌交易。

根据《天弘创业板交易型开放式证券投资基金基金合同》和《天弘创业板交易型开放式证券投资基金招募说明书》的有关规定，天弘基金管理有限公司决定对本基金进行基金份额折算与变更登记，基金份额折算基准日确定为2019年9月19日。本基金折算前基金份额总额为640,858,438.00份，折算前基金份额净值为1.0059元，折算后基金份额总额为377,936,410.00份，折算后T+1日基金份额净值为1.7056元。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股和备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：创业板指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF，将原天弘创业板指数型发起式证券投资基金转型为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基

金(以下简称“天弘创业板ETF联接基金”)。天弘创业板ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2023年3月28日批准报出。

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于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《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”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

新金融工具准则

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

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业务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。

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

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

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、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其他各类应收款项等。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。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。本基金持有的其他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。

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

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；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。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

本基金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。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段和金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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，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；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，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。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于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。

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生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1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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。

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

新金融工具准则

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。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。

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；于处置时，其处置价格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则按直线法计算。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。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或者发行价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；于处置时，其处置价格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。

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则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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则按直线法计算。

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 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和债券，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》提供的市盈率法和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)》(以下简称“指引”),按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)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(可转换债券和可交换债券除外),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

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号--金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号--金融资产转移》、《企业会计准则第24号一套期会计》及《企业会计准则第37号--金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”),财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》,公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外,财政部于2022年颁布了《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),中国证监会于2022年颁布了修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表,对本基金财务报表的影响列示如下:

(a) 金融工具

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

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

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收股利,金额分别为9,323,034.71元、271,245.89元、154,256.21元、153,033.16元、2,211,027.48元和1,155.00元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清

算款和应收股利，金额分别为9,327,287.12元、271,421.14元、154,332.55元、148,529.16元、2,211,027.48元和1,155.00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3,640,588,868.67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3,640,588,868.67元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、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1,504,819.41元、300,963.87元、250,853.02元和861,198.01元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、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1,504,819.41元、300,963.87元、250,853.02元和861,198.01元。

i)于2021年12月31日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于2022年1月1日，本基金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，无期初留存收益影响。

(b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服

务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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	6,979,118.39	9,323,034.71
等于：本金	6,976,392.28	9,323,034.71
加：应计利息	2,726.11	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以内	-	-
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	6,979,118.39	9,323,034.71

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	5,827,219,606.98	-	5,154,348,266.16	-672,871,340.82
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	5,827,219,606.98	-	5,154,348,266.16	-672,871,340.82

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		3,270,758,249.8 3	-	3,640,588,868.6 7	369,830,618.84
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		3,270,758,249.8 3	-	3,640,588,868.6 7	369,830,618.84

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估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

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	-	153,033.16
其他应收款	649,800.45	-

待摊费用	-	-
合计	649,800.45	153,033.16

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	276,141.15	250,853.02
其中：交易所市场	276,141.15	250,853.02
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	220,000.00
其他应付	725,232.84	861,198.01
合计	1,221,373.99	1,332,051.03

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,086,936,410.00	1,843,094,107.29
本期申购	1,936,000,000.00	3,282,832,517.43
本期赎回（以“-”号填列）	-855,000,000.00	-1,449,804,649.84
本期末	2,167,936,410.00	3,676,121,974.88

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
本期期初	1,807,873,842.41	-1,416,698.34	1,806,457,144.07

本期利润	-402,236,649.24	-1,042,701,959.66	-1,444,938,608.90
本期基金份额交易产生的变动数	1,753,810,733.78	-633,841,080.33	1,119,969,653.45
其中：基金申购款	3,094,867,886.19	-1,244,079,087.60	1,850,788,798.59
基金赎回款	-1,341,057,152.41	610,238,007.27	-730,819,145.14
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,159,447,926.95	-1,677,959,738.33	1,481,488,188.62

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
活期存款利息收入	97,948.64	195,138.85
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	11,017.84	14,137.94
其他	2,961.59	2,613.08
合计	111,928.07	211,889.87

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01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至20 21年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-144,923,115.71	84,684,274.33
股票投资收益——赎回差价收入	-262,383,384.37	907,796,989.24
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	-407,306,500.08	992,481,263.57

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01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
卖出股票成交总额	773,871,551.13	749,588,040.82
减：卖出股票成本总额	917,186,920.64	664,903,766.49
减：交易费用	1,607,746.20	-
买卖股票差价收入	-144,923,115.71	84,684,274.33

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01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
赎回基金份额对价总额	2,180,623,794.98	5,484,040,575.99
减：现金支付赎回款总额	-10,395,004.02	3,876,077.99
减：赎回股票成本总额	2,453,402,183.37	4,572,367,508.76
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-262,383,384.37	907,796,989.24

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01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 12月31日
债券投资收益——利息收入	856.40	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	1,132,874.65	6,477,357.47
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	1,133,731.05	6,477,357.47

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01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	5,319,169.66	38,019,874.91
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,185,200.00	31,539,100.00
减：应计利息总额	882.32	3,417.44
减：交易费用	212.69	-
买卖债券差价收入	1,132,874.65	6,477,357.47

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
股票投资产生的股利收益	23,205,865.69	13,057,601.80
其中：证券出借权益补偿收入	1,593,434.57	1,660,483.63
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	23,205,865.69	13,057,601.80

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1.交易性金融资产	-1,042,701,959.66	-424,376,607.03
——股票投资	-1,042,701,959.66	-424,376,607.03
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——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	-1,042,701,959.66	-424,376,607.03

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年
----	-------------------------	------------------------------

	12月31日	12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	-844,426.21	-307,054.46
延期合约递延费收入	-	-
合计	-844,426.21	-307,054.46

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01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	-	-
指数使用费	1,412,553.30	1,143,555.22
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00
交易费用	-	1,651,020.41
合计	1,782,553.30	3,164,575.63

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的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
天弘基金管理有限公司	基金管理人

国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01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
国泰君安 证券股份 有限公司	63,280,830.96	3.83%	200,425,870.95	11.09%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名	本期
------	----

称	2022年01月01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
国泰君安证券股份有限公司	14,637.68	2.09%	1,992.72	0.72%
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01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
国泰君安证券股份有限公司	46,359.83	6.27%	5,113.34	2.04%

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

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

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01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,542,555.66	19,059,251.94
其中: 支付销售机构的客户维护费	3,240.83	3,922.27

注:1、支付基金管理人的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。其计算公式为: 日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，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01月01日至2022 年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,708,511.14	3,811,850.38

注：支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的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。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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01月01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(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2022010400000812	乐普医疗	2022-01-04	273,992.00	11,600	14	3.40%	351.73	-	-
国泰君	202201	国瓷材	2022-0	40,96	1,000	14	3.40%	52.58	-	-

安证券股份有限公司	050000 1356	料	1-05	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202201 050000 1366	新易盛	2022-0 1-05	189,70 0.00	5,000	14	3.40%	243.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 050000 1372	昆仑万维	2022-0 1-05	62,15 0.00	2,500	14	3.40%	79.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 070000 1059	国瓷材料	2022-0 1-07	915,11 0.00	23,800	14	3.40%	1,174. 74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 070000 1079	易华录	2022-0 1-07	166,92 0.00	5,200	14	3.40%	214.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 070000 1083	宁德时代	2022-0 1-07	3,563, 340.00	6,600	14	3.40%	4,574. 30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 100000 1303	昆仑万维	2022-0 1-10	75,33 0.00	3,100	14	3.40%	96.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 100000 1359	网宿科技	2022-0 1-10	32,16 0.00	4,800	14	3.40%	41.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 100000 1366	机器人	2022-0 1-10	40,21 2.00	3,600	14	3.40%	51.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 100000 1382	同花顺	2022-0 1-10	312,02 4.00	2,400	14	3.40%	400.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 110001 2173	金龙鱼	2022-0 1-11	192,75 0.00	3,000	14	3.40%	247.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 110001 2175	健帆生物	2022-0 1-11	370,04 7.00	6,900	14	3.40%	475.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 120001 5453	景嘉微	2022-0 1-12	582,62 4.00	4,800	14	3.40%	747.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 180002 4656	乐普医疗	2022-0 1-18	270,16 4.00	11,600	14	3.40%	495.45	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202201 190000 0750	安克创新	2022-0 1-19	224,83 2.00	2,400	14	3.40%	391.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 190000 0760	东方财富	2022-0 1-19	56,35 5.00	1,700	14	3.40%	98.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 210000 9186	国瓷材料	2022-0 1-21	978,65 6.00	23,800	14	3.40%	1,525. 52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 070005 5247	国瓷材料	2022-0 2-07	942,24 2.00	23,800	14	3.40%	1,209. 56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 070005 5255	东方财富	2022-0 2-07	54,77 4.00	1,700	14	3.40%	70.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 080000 1912	万孚生物	2022-0 2-08	40,56 8.00	1,100	14	3.40%	52.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 080000 1915	健帆生物	2022-0 2-08	260,40 0.00	5,600	14	3.40%	334.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 080000 1923	金力永磁	2022-0 2-08	492,66 0.00	13,800	14	3.40%	632.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 080000 1933	迈克生物	2022-0 2-08	37,71 6.00	1,400	14	3.40%	48.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 080000 1939	信维通信	2022-0 2-08	1,023, 358.00	46,900	14	3.40%	1,313. 70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 140000 0840	新易盛	2022-0 2-14	37,17 0.00	1,000	14	3.40%	47.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 160000 0855	东方财富	2022-0 2-16	1,085, 065.00	39,500	14	3.40%	1,392. 91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 210004 2361	东方财富	2022-0 2-21	44,45 5.00	1,700	14	3.40%	57.07	-	-
国泰君安股份有	202202 230000 0960	国瓷材料	2022-0 2-23	38,26 0.00	1,000	14	3.20%	46.22	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202203 020000 0625	汤臣倍健	2022-0 3-02	24,98 0.00	1,000	14	3.20%	30.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 020000 3139	东方财富	2022-0 3-02	1,071, 240.00	39,500	14	3.40%	1,375. 16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 030000 1381	汇川技术	2022-0 3-03	62,40 0.00	1,000	14	3.20%	75.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 070003 9472	东方财富	2022-0 3-07	42,29 6.00	1,700	14	3.40%	54.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 140000 1100	英科医疗	2022-0 3-14	791,43 7.00	15,700	14	3.20%	956.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 160000 6260	东方财富	2022-0 3-16	995,79 5.00	39,500	14	3.40%	1,278. 31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 210000 0979	深信服	2022-0 3-21	1,230, 528.00	10,200	14	3.20%	1,699. 11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 210003 3827	东方财富	2022-0 3-21	42,58 5.00	1,700	14	3.40%	62.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 230000 1121	温氏股份	2022-0 3-23	289,40 8.00	13,300	14	3.20%	349.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 240000 0950	温氏股份	2022-0 3-24	627,26 4.00	28,800	14	3.20%	757.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 290000 1027	欣旺达	2022-0 3-29	110,94 6.00	4,100	14	3.20%	134.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 290000 1032	当升科技	2022-0 3-29	159,60 0.00	2,100	14	3.20%	192.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 310000 0855	欣旺达	2022-0 3-31	96,25 0.00	3,500	14	3.20%	116.29	-	-	
国泰君安证券	202204 010000	迪安诊断	2022-0 4-01	455.67 2.00	15,800	14	3.20%	550.54	-	-	

股份有限公司	1028										
国泰君安证券股份有限公司	2022040600052945	东方财富	2022-04-06	44,132.00	1,700	14	3.40%	56.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040700000910	宋城演艺	2022-04-07	469,800.00	34,800	14	3.20%	567.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040700012916	温氏股份	2022-04-07	616,032.00	28,800	14	3.20%	744.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041300001211	中际旭创	2022-04-13	38,207.00	1,300	14	3.20%	46.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041300001214	欣旺达	2022-04-13	45,660.00	2,000	14	3.20%	55.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041300001216	深信服	2022-04-13	97,260.00	1,000	14	3.20%	117.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041300001219	温氏股份	2022-04-13	82,290.00	3,900	14	3.20%	99.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041300001229	新宙邦	2022-04-13	81,829.00	1,100	14	3.20%	98.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041500000876	特锐德	2022-04-15	18,095.00	1,100	14	3.20%	21.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041500000894	中伟股份	2022-04-15	90,010.00	1,000	14	3.20%	108.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041500004820	迪安诊断	2022-04-15	436,870.00	15,800	14	3.20%	527.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041800000905	康泰生物	2022-04-18	109,340.00	1,400	14	3.20%	160.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022041900001261	沃森生物	2022-04-19	822,312.00	14,100	14	3.20%	1,135.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204	东方财富	2022-0	35.03	1,700	14	3.40%	48.19	-	-	

安证券股份有限公司	200004 7698	富	4-20	7.00							
国泰君安证券股份有限公司	202204 210000 1307	特锐德	2022-0 4-21	16,94 0.00	1,100	14	3.20%	20.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 210000 1329	中伟股份	2022-0 4-21	83,09 0.00	1,000	14	3.20%	100.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 210001 3091	温氏股份	2022-0 4-21	596,16 0.00	28,800	14	3.20%	720.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 260000 1307	景嘉微	2022-0 4-26	1,573, 467.00	21,700	14	3.20%	1,901. 06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 270000 0661	博雅生物	2022-0 4-27	819,30 0.00	30,000	14	3.20%	989.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 290000 5358	迪安诊断	2022-0 4-29	516,50 2.00	15,800	14	3.20%	624.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 050005 5943	特锐德	2022-0 5-05	15,18 0.00	1,100	14	3.20%	18.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 050005 5961	东方财富	2022-0 5-05	38,08 0.00	1,700	14	3.40%	48.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 100000 0871	新宙邦	2022-0 5-10	70,96 0.00	1,000	14	3.20%	85.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 100000 0883	深信服	2022-0 5-10	86,00 0.00	1,000	14	3.20%	103.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 100000 0889	迪安诊断	2022-0 5-10	44,27 8.00	1,300	14	3.20%	53.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 100000 0891	卫宁健康	2022-0 5-10	21,15 0.00	2,500	14	3.20%	25.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 100000 0925	寒锐钴业	2022-0 5-10	51,70 0.00	1,000	14	3.20%	62.47	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202205 100001 4805	景嘉微	2022-0 5-10	1,887, 900.00	21,700	14	3.20%	2,280. 96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 120000 0750	景嘉微	2022-0 5-12	88,00 0.00	1,000	14	3.20%	106.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 120000 0758	新宙邦	2022-0 5-12	40,02 0.00	1,000	14	3.20%	48.35	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 120000 0768	特锐德	2022-0 5-12	15,56 5.00	1,100	14	3.20%	18.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 130000 4828	迪安诊断	2022-0 5-13	552,05 2.00	15,800	14	3.20%	666.99	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 160000 0690	长信科技	2022-0 5-16	23,23 6.00	3,700	14	3.20%	28.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 160000 0696	药石科技	2022-0 5-16	85,36 0.00	1,000	14	3.20%	103.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 190004 6483	东方财富	2022-0 5-19	37,68 9.00	1,700	14	3.40%	48.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2062	光威复材	2022-0 6-30	494,50 8.00	8,400	14	3.20%	597.47	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2063	宏达电子	2022-0 6-30	244,68 0.00	4,000	14	3.20%	295.62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2065	华大基因	2022-0 6-30	229,44 0.00	3,200	14	3.20%	277.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2068	药石科技	2022-0 6-30	395,96 0.00	4,000	14	3.20%	478.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2076	万孚生物	2022-0 6-30	329,75 1.00	8,100	14	3.20%	398.41	-	-
国泰君安股份有	202206 300000 2080	贝达药业	2022-0 6-30	419,52 0.00	6,900	14	3.20%	506.86	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2096	金力永 磁	2022-0 6-30	426,88 0.00	11,600	14	3.20%	515.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2099	易华录	2022-0 6-30	109,62 0.00	6,300	14	3.20%	132.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2101	汤臣倍 健	2022-0 6-30	155,88 0.00	7,200	14	3.20%	188.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2102	稳健医 疗	2022-0 6-30	239,40 0.00	3,600	14	3.20%	289.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2106	长信科 技	2022-0 6-30	1,079, 610.00	145,50 0	14	3.20%	1,304. 38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2113	美畅股 份	2022-0 6-30	370,76 0.00	4,000	14	3.20%	447.95	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2119	宋城演 艺	2022-0 6-30	675,40 0.00	44,000	14	3.20%	816.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2123	光线传 媒	2022-0 6-30	302,09 3.00	31,900	14	3.20%	364.99	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2144	昆仑万 维	2022-0 6-30	353,60 0.00	22,100	14	3.20%	427.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2149	深信服	2022-0 6-30	228,31 6.00	2,200	14	3.20%	275.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2156	国瓷材 料	2022-0 6-30	811,79 2.00	22,600	14	3.20%	980.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2159	我武生 物	2022-0 6-30	364,21 0.00	7,000	14	3.20%	440.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2161	卫宁健 康	2022-0 6-30	233,54 8.00	26,600	14	3.20%	282.17	-	-
国泰君安证券	202206 300000	中际旭 创	2022-0 6-30	543,37 5.00	17,500	14	3.20%	656.50	-	-

股份有限公司	2168									
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2216	特锐德	2022-0 6-30	296,00 1.00	17,100	14	3.20%	357.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2220	碧水源	2022-0 6-30	289,15 5.00	55,500	14	3.20%	349.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2232	华测检测	2022-0 6-30	958,57 3.00	41,300	14	3.20%	1,158. 15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2238	同花顺	2022-0 6-30	298,06 5.00	3,100	14	3.20%	360.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2239	蓝色光标	2022-0 6-30	425,75 6.00	65,200	14	3.20%	514.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 2240	安科生物	2022-0 6-30	326,55 3.00	32,300	14	3.20%	394.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 040000 0939	长信科技	2022-0 7-04	20,41 2.00	2,800	14	3.20%	24.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 040000 0940	新宙邦	2022-0 7-04	55,55 0.00	1,000	14	3.20%	67.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 040000 0951	寒锐钴业	2022-0 7-04	58,56 0.00	1,000	14	3.20%	70.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 040000 0967	利亚德	2022-0 7-04	26,63 7.00	3,900	14	3.20%	32.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 050000 0884	利亚德	2022-0 7-05	26,79 3.00	3,900	14	3.20%	32.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 050000 0891	长信科技	2022-0 7-05	19,76 8.00	2,800	14	3.20%	23.88	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 050000 0892	新宙邦	2022-0 7-05	54,74 0.00	1,000	14	3.20%	66.14	-	-
国泰君安	202207	寒锐钴	2022-0	64,05	1,000	14	3.20%	77.39	-	-

安证券股份有限公司	050000 0903	业	7-05	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202207 140000 1168	义翘神州	2022-0 7-14	254,32 0.00	2,000	14	3.20%	307.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0604	光威复材	2022-0 7-14	557,50 8.00	8,400	14	3.20%	673.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0608	蓝色光标	2022-0 7-14	384,68 0.00	65,200	14	3.20%	464.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0610	安科生物	2022-0 7-14	313,63 3.00	32,300	14	3.20%	378.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0724	宏达电子	2022-0 7-14	220,56 0.00	4,000	14	3.20%	266.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0726	药石科技	2022-0 7-14	386,72 0.00	4,000	14	3.20%	467.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0728	万孚生物	2022-0 7-14	326,91 6.00	8,100	14	3.20%	394.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0730	金力永磁	2022-0 7-14	502,74 4.00	11,600	14	3.20%	607.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0732	美畅股份	2022-0 7-14	310,64 0.00	4,000	14	3.20%	375.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 1166	碧水源	2022-0 7-14	276,39 0.00	55,500	14	3.20%	333.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 1168	华测检测	2022-0 7-14	903,64 4.00	41,300	14	3.20%	1,091. 78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3448	华大基因	2022-0 7-14	214,62 4.00	3,200	14	3.20%	259.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3450	贝达药业	2022-0 7-14	383,29 5.00	6,900	14	3.20%	463.10	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3820	特锐德	2022-0 7-14	325,07 1.00	17,100	14	3.20%	392.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3822	同花顺	2022-0 7-14	276,67 5.00	3,100	14	3.20%	334.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4820	易华录	2022-0 7-14	103,95 0.00	6,300	14	3.20%	125.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4822	稳健医疗	2022-0 7-14	268,74 0.00	3,600	14	3.20%	324.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4854	汤臣倍健	2022-0 7-14	139,10 4.00	7,200	14	3.20%	168.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4856	长信科技	2022-0 7-14	1,008, 315.00	145,50 0	14	3.20%	1,218. 24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4858	宋城演艺	2022-0 7-14	574,20 0.00	44,000	14	3.20%	693.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4860	光线传媒	2022-0 7-14	266,04 6.00	31,900	14	3.20%	321.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4862	昆仑万维	2022-0 7-14	325,53 3.00	22,100	14	3.20%	393.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4864	深信服	2022-0 7-14	202,26 8.00	2,200	14	3.20%	244.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4866	国瓷材料	2022-0 7-14	722,97 4.00	22,600	14	3.20%	873.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4868	我武生物	2022-0 7-14	369,04 0.00	7,000	14	3.20%	445.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 4870	卫宁健康	2022-0 7-14	215,99 2.00	26,600	14	3.20%	260.96	-	-
国泰君安股份有	202207 140001 4872	中际旭创	2022-0 7-14	516,25 0.00	17,500	14	3.20%	623.73	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202207 150000 0913	光威复材	2022-0 7-15	68,39 0.00	1,000	14	3.20%	82.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 150000 0947	特锐德	2022-0 7-15	48,36 0.00	2,600	14	3.20%	58.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 150000 0955	长盈精密	2022-0 7-15	10,05 0.00	1,000	14	3.20%	12.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1371	光线传媒	2022-0 7-18	293,82 0.00	35,400	14	3.20%	354.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1373	博雅生物	2022-0 7-18	188,32 8.00	5,600	14	3.20%	227.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1377	阳光电源	2022-0 7-18	227,80 8.00	1,800	14	3.20%	275.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1401	义翘神州	2022-0 7-18	124,66 0.00	1,000	14	3.20%	150.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1409	景嘉微	2022-0 7-18	521,48 9.00	8,300	14	3.20%	630.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180001 3657	长信科技	2022-0 7-18	19,85 2.00	2,800	14	3.20%	23.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180001 3659	新宙邦	2022-0 7-18	49,53 0.00	1,000	14	3.20%	59.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180001 3661	寒锐钴业	2022-0 7-18	58,14 0.00	1,000	14	3.20%	70.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180001 3663	利亚德	2022-0 7-18	25,35 0.00	3,900	14	3.20%	30.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 0970	光线传媒	2022-0 7-19	157,62 6.00	18,900	14	3.20%	190.45	-	-	
国泰君安证券	202207 190000	利亚德	2022-0 7-19	25,74 0.00	3,900	14	3.20%	31.10	-	-	

股份有限公司	8444									
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 8446	长信科技	2022-0 7-19	20,13 2.00	2,800	14	3.20%	24.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 8448	新宙邦	2022-0 7-19	49,55 0.00	1,000	14	3.20%	59.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 8450	寒锐钴业	2022-0 7-19	57,87 0.00	1,000	14	3.20%	69.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1038	长信科技	2022-0 7-21	976,03 8.00	136,70 0	14	3.20%	1,179. 25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1041	光威复材	2022-0 7-21	420,08 0.00	5,900	14	3.20%	507.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1046	汤臣倍健	2022-0 7-21	158,09 6.00	8,200	14	3.20%	191.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1048	我武生物	2022-0 7-21	229,50 0.00	4,500	14	3.20%	277.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 220000 0767	光威复材	2022-0 7-22	70,21 0.00	1,000	14	3.20%	84.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 220000 0775	卓胜微	2022-0 7-22	103,48 0.00	1,000	14	3.20%	125.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 260000 0985	蓝色光标	2022-0 7-26	500,26 2.00	83,100	14	3.20%	604.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 260000 0991	金力永磁	2022-0 7-26	160,16 4.00	3,600	14	3.20%	193.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 260000 0992	宏达电子	2022-0 7-26	255,00 0.00	5,000	14	3.20%	308.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 270000 1251	博雅生物	2022-0 7-27	33,56 0.00	1,000	14	3.20%	40.54	-	-
国泰君安	202207	宏达电	2022-0	53,03	1,000	14	3.20%	64.07	-	-

安证券股份有限公司	270000 1267	子	7-27	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202207 280000 1334	蓝思科技	2022-0 7-28	139,26 4.00	12,800	14	3.20%	168.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280000 1337	芒果超媒	2022-0 7-28	202,24 0.00	6,400	14	3.20%	244.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280000 1340	东方财富	2022-0 7-28	1,922, 112.00	84,600	14	3.20%	2,322. 29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1727	华测检测	2022-0 7-28	875,97 3.00	41,300	14	3.20%	1,058. 35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1735	光威复材	2022-0 7-28	588,16 8.00	8,400	14	3.20%	710.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1739	蓝色光标	2022-0 7-28	391,20 0.00	65,200	14	3.20%	472.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1741	宋城演艺	2022-0 7-28	590,04 0.00	44,000	14	3.20%	712.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1749	长信科技	2022-0 7-28	1,060, 695.00	145,50 0	14	3.20%	1,281. 53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1995	金力永磁	2022-0 7-28	531,51 2.00	11,600	14	3.20%	642.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2005	美畅股份	2022-0 7-28	311,92 0.00	4,000	14	3.20%	376.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2007	特锐德	2022-0 7-28	320,96 7.00	17,100	14	3.20%	387.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2009	药石科技	2022-0 7-28	340,40 0.00	4,000	14	3.20%	411.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2011	深信服	2022-0 7-28	219,91 2.00	2,200	14	3.20%	265.70	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2943	光线传媒	2022-0 7-28	271,15 0.00	31,900	14	3.20%	327.60	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2949	汤臣倍健	2022-0 7-28	136,22 4.00	7,200	14	3.20%	164.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2955	中际旭创	2022-0 7-28	585,37 5.00	17,500	14	3.20%	707.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2957	国瓷材料	2022-0 7-28	732,69 2.00	22,600	14	3.20%	885.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2963	我武生物	2022-0 7-28	326,90 0.00	7,000	14	3.20%	394.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 3317	易华录	2022-0 7-28	110,31 3.00	6,300	14	3.20%	133.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 4355	碧水源	2022-0 7-28	305,25 0.00	55,500	14	3.20%	368.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 4359	万孚生物	2022-0 7-28	312,57 9.00	8,100	14	3.20%	377.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 4719	贝达药业	2022-0 7-28	349,20 9.00	6,900	14	3.20%	421.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290000 1626	宏达电子	2022-0 7-29	345,04 8.00	6,600	14	3.20%	416.88	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290000 1628	拉卡拉	2022-0 7-29	184,70 4.00	10,400	14	3.20%	223.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290000 1634	赢合科技	2022-0 7-29	308,98 4.00	10,400	14	3.20%	373.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290000 1636	新易盛	2022-0 7-29	344,28 1.00	13,700	14	3.20%	415.96	-	-
国泰君安股份有	202207 290000 1650	义翘神州	2022-0 7-29	116,82 0.00	1,000	14	3.20%	141.15	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022080100001064	光威复材	2022-08-01	506,450.00	7,000	14	3.20%	611.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100001070	义翘神州	2022-08-01	163,548.00	1,400	14	3.20%	197.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100001086	康泰生物	2022-08-01	55,828.00	1,700	14	3.20%	67.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100001094	光线传媒	2022-08-01	433,159.00	50,900	14	3.20%	523.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100001098	同花顺	2022-08-01	85,150.00	1,000	14	3.20%	102.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100013141	利亚德	2022-08-01	25,896.00	3,900	14	3.20%	31.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100013153	博雅生物	2022-08-01	183,344.00	5,600	14	3.20%	221.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100013163	长信科技	2022-08-01	20,496.00	2,800	14	3.20%	24.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100013233	义翘神州	2022-08-01	116,820.00	1,000	14	3.20%	141.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080100015677	新宙邦	2022-08-01	46,410.00	1,000	14	3.20%	56.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080200001330	新宙邦	2022-08-02	85,785.00	1,900	14	3.20%	103.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080200001343	华利集团	2022-08-02	57,350.00	1,000	14	3.20%	69.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080200009455	长信科技	2022-08-02	19,600.00	2,800	14	3.20%	23.68	-	-	
国泰君安证券	202208020000	利亚德	2022-08-02	24,648.00	3,900	14	3.20%	29.78	-	-	

股份有限公司	9475									
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001529	德方纳米	2022-08-03	1,270,188.00	3,600	14	3.20%	1,534.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001541	华测检测	2022-08-03	892,645.00	44,300	14	3.20%	1,078.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001545	天华超净	2022-08-03	980,100.00	13,200	14	3.20%	1,184.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001549	景嘉微	2022-08-03	665,280.00	9,900	14	3.20%	803.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001559	新宙邦	2022-08-03	407,430.00	9,000	14	3.20%	492.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002232	华利集团	2022-08-04	185,064.00	3,300	14	3.20%	223.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002240	新宙邦	2022-08-04	583,998.00	13,100	14	3.20%	705.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002254	立高食品	2022-08-04	149,530.00	1,900	14	3.20%	180.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002256	圣邦股份	2022-08-04	243,922.00	1,400	14	3.20%	294.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002258	国瓷材料	2022-08-04	950,810.00	28,900	14	3.20%	1,148.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002263	我武生物	2022-08-04	348,794.00	7,300	14	3.20%	421.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400013748	我武生物	2022-08-04	215,010.00	4,500	14	3.20%	259.78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022080400014000	光威复材	2022-08-04	408,221.00	5,900	14	3.20%	493.21	-	-
国泰君安	202208	国瓷材	2022-0	1,405,	41,200	14	3.20%	1,698.	-	-

安证券股份有限公司	050000 1529	料	8-05	744.00				42		
国泰君安证券股份有限公司	202208 050000 1551	万孚生物	2022-0 8-05	201,15 2.00	5,600	14	3.20%	243.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 050000 9265	光威复材	2022-0 8-05	68,29 0.00	1,000	14	3.20%	82.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 080000 1336	北京君正	2022-0 8-08	775,92 0.00	8,000	14	3.20%	937.47	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 080000 1344	汇川技术	2022-0 8-08	336,79 8.00	5,400	14	3.20%	406.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 080000 1348	光环新网	2022-0 8-08	287,32 8.00	29,200	14	3.20%	347.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 080000 1378	宏达电子	2022-0 8-08	55,66 0.00	1,000	14	3.20%	67.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 080000 1398	卓胜微	2022-0 8-08	470,25 0.00	4,500	14	3.20%	568.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 090000 1121	博雅生物	2022-0 8-09	34,55 0.00	1,000	14	3.20%	41.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 090000 1130	德方纳米	2022-0 8-09	1,411, 200.00	3,600	14	3.20%	1,705. 01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 090000 1149	金龙鱼	2022-0 8-09	60,97 0.00	1,300	14	3.20%	73.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 090001 3664	宏达电子	2022-0 8-09	288,45 0.00	5,000	14	3.20%	348.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 090001 3742	金力永磁	2022-0 8-09	154,18 8.00	3,600	14	3.20%	186.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 100000 1414	金力永磁	2022-0 8-10	228,43 6.00	5,200	14	3.20%	276.00	-	-

国泰君安证券股份有限公司	202208 100002 7650	博雅生物	2022-0 8-10	33,90 0.00	1,000	14	3.20%	40.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 100002 8262	宏达电子	2022-0 8-10	56,90 0.00	1,000	14	3.20%	68.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110000 1849	东方财富	2022-0 8-11	39,08 3.00	1,700	14	3.20%	47.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 2910	金力永磁	2022-0 8-11	501,12 0.00	11,600	14	3.20%	605.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 2916	深信服	2022-0 8-11	229,37 2.00	2,200	14	3.20%	277.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 3398	美畅股份	2022-0 8-11	286,60 0.00	4,000	14	3.20%	346.27	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5076	药石科技	2022-0 8-11	343,96 0.00	4,000	14	3.20%	415.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5078	光威复材	2022-0 8-11	631,42 8.00	8,400	14	3.20%	762.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5106	宋城演艺	2022-0 8-11	557,92 0.00	44,000	14	3.20%	674.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5116	光线传媒	2022-0 8-11	290,92 8.00	31,900	14	3.20%	351.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5130	贝达药业	2022-0 8-11	363,14 7.00	6,900	14	3.20%	438.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5150	特锐德	2022-0 8-11	315,66 6.00	17,100	14	3.20%	381.39	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 6294	中际旭创	2022-0 8-11	613,90 0.00	17,500	14	3.20%	741.71	-	-
国泰君安股份有	202208 120000 1203	胜宏科技	2022-0 8-12	300,44 7.00	17,100	14	3.20%	363.00	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202208 120000 1209	易华录	2022-0 8-12	28,72 0.00	1,600	14	3.20%	34.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120000 1211	迪安诊断	2022-0 8-12	572,04 0.00	18,000	14	3.20%	691.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120000 1221	中伟股份	2022-0 8-12	181,33 5.00	1,500	14	3.20%	219.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120001 8879	新易盛	2022-0 8-12	380,86 0.00	13,700	14	3.20%	460.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120001 8881	义翘神州	2022-0 8-12	116,05 0.00	1,000	14	3.20%	140.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120001 8883	赢合科技	2022-0 8-12	303,88 8.00	10,400	14	3.20%	367.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120002 0877	宏达电子	2022-0 8-12	367,35 6.00	6,600	14	3.20%	443.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1502	华测检测	2022-0 8-15	2,286, 519.00	110,30 0	14	3.20%	2,762. 57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1504	蓝色光标	2022-0 8-15	1,155, 950.00	189,50 0	14	3.20%	1,396. 62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1508	安科生物	2022-0 8-15	382,00 0.00	40,000	14	3.20%	461.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1509	易华录	2022-0 8-15	159,04 3.00	8,900	14	3.20%	192.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1514	长信科技	2022-0 8-15	1,222, 400.00	160,00 0	14	3.20%	1,476. 90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1515	中际旭创	2022-0 8-15	266,23 0.00	7,900	14	3.20%	321.66	-	-	
国泰君安证券	202208 150000	扬杰科技	2022-0 8-15	150,23 6.00	2,300	14	3.20%	181.51	-	-	

股份有限公司	1522										
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1532	宏达电子	2022-0 8-15	55,08 0.00	1,000	14	3.20%	66.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150001 7171	博雅生物	2022-0 8-15	189,22 4.00	5,600	14	3.20%	228.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150001 7333	利亚德	2022-0 8-15	26,52 0.00	3,900	14	3.20%	32.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1111	光线传媒	2022-0 8-16	453,25 8.00	50,700	14	3.20%	547.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1112	易华录	2022-0 8-16	158,94 0.00	9,000	14	3.20%	192.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1118	中际旭创	2022-0 8-16	263,07 0.00	7,900	14	3.20%	317.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1131	扬杰科技	2022-0 8-16	147,06 2.00	2,300	14	3.20%	177.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1137	安科生物	2022-0 8-16	376,20 0.00	39,600	14	3.20%	454.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1145	华测检测	2022-0 8-16	2,490, 088.00	119,20 0	14	3.20%	3,008. 52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1154	东方财富	2022-0 8-16	407,44 2.00	17,800	14	3.20%	492.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1158	蓝色光标	2022-0 8-16	1,176, 795.00	189,50 0	14	3.20%	1,421. 81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1185	宏达电子	2022-0 8-16	54,80 0.00	1,000	14	3.20%	66.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160000 1189	先导智能	2022-0 8-16	399,03 6.00	6,600	14	3.20%	482.12	-	-	
国泰君安	202208	利亚德	2022-0	27,14	3,900	14	3.20%	32.80	-	-	

安证券股份有限公司	160001 0476		8-16	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1918	同花顺	2022-0 8-17	88,42 0.00	1,000	14	3.20%	106.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1927	当升科技	2022-0 8-17	1,124, 550.00	12,600	14	3.20%	1,358. 68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1934	博腾股份	2022-0 8-17	1,067, 742.00	16,900	14	3.20%	1,290. 05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1936	天华超净	2022-0 8-17	180,66 5.00	2,300	14	3.20%	218.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1938	康泰生物	2022-0 8-17	91,15 6.00	2,600	14	3.20%	110.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1940	昆仑万维	2022-0 8-17	922,64 0.00	60,700	14	3.20%	1,114. 73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1942	中际旭创	2022-0 8-17	410,16 4.00	12,200	14	3.20%	495.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1946	信维通信	2022-0 8-17	901,96 7.00	49,100	14	3.20%	1,089. 76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 1962	卫宁健康	2022-0 8-17	12,96 0.00	1,600	14	3.20%	15.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 2000	金力永磁	2022-0 8-17	53,31 3.00	1,300	14	3.20%	64.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 2002	寒锐钴业	2022-0 8-17	502,40 5.00	8,900	14	3.20%	607.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170001 5469	德方纳米	2022-0 8-17	1,366, 020.00	3,600	14	3.20%	1,650. 43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170001 5473	景嘉微	2022-0 8-17	616,96 8.00	9,900	14	3.20%	745.42	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202208 170001 8219	华测检测	2022-0 8-17	925,87 0.00	44,300	14	3.20%	1,118. 63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 180000 1376	寒锐钴业	2022-0 8-18	55,95 0.00	1,000	14	3.20%	67.60	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 180001 2859	国瓷材料	2022-0 8-18	1,012, 367.00	28,900	14	3.20%	1,223. 14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 180001 5551	我武生物	2022-0 8-18	332,36 9.00	7,300	14	3.20%	401.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 180001 5731	立高食品	2022-0 8-18	147,38 3.00	1,900	14	3.20%	178.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 190000 0814	东方财富	2022-0 8-19	158,01 0.00	6,900	14	3.20%	190.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 190000 0830	扬杰科技	2022-0 8-19	471,43 4.00	7,300	14	3.20%	569.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 190000 8712	光威复材	2022-0 8-19	72,84 0.00	1,000	14	3.20%	88.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 220000 1580	博雅生物	2022-0 8-22	133,57 0.00	3,800	14	3.20%	161.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 220000 1594	华利集团	2022-0 8-22	241,53 1.00	4,100	14	3.20%	291.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 220001 8159	宏达电子	2022-0 8-22	57,50 0.00	1,000	14	3.20%	69.48	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 230000 1446	华利集团	2022-0 8-23	57,85 0.00	1,000	14	3.20%	69.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 230000 1462	长信科技	2022-0 8-23	10,46 5.00	1,300	14	3.20%	12.64	-	-
国泰君安股份有	202208 230001 5432	德方纳 米	2022-0 8-23	1,385, 640.00	3,600	14	3.20%	1,674. 13	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202208 230001 6028	博雅生物	2022-0 8-23	33,21 0.00	1,000	14	3.20%	40.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 230001 6094	宏达电子	2022-0 8-23	277,95 0.00	5,000	14	3.20%	335.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 230001 6096	金力永磁	2022-0 8-23	146,08 8.00	3,600	14	3.20%	176.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 240000 1122	贝达药业	2022-0 8-24	46,48 0.00	1,000	14	3.20%	56.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 240000 1130	北京君正	2022-0 8-24	166,52 0.00	2,000	14	3.20%	201.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 240002 7791	金力永磁	2022-0 8-24	198,90 0.00	5,200	14	3.20%	240.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 240002 7839	博雅生物	2022-0 8-24	33,68 0.00	1,000	14	3.20%	40.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 240002 8437	宏达电子	2022-0 8-24	52,10 0.00	1,000	14	3.20%	62.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 2026	金力永磁	2022-0 8-25	442,88 8.00	11,600	14	3.20%	535.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 2168	特锐德	2022-0 8-25	329,85 9.00	17,100	14	3.20%	398.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 2926	贝达药业	2022-0 8-25	317,19 3.00	6,900	14	3.20%	383.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 3970	东方财富	2022-0 8-25	38,77 7.00	1,700	14	3.20%	46.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 3978	宋城演艺	2022-0 8-25	554,40 0.00	44,000	14	3.20%	669.83	-	-	
国泰君安证券	202208 250001	中际旭创	2022-0 8-25	530,60 0.00	17,500	14	3.20%	641.07	-	-	

股份有限公司	4004										
国泰君安证券股份有限公司	202208 250001 4012	光威复材	2022-0 8-25	589,59 6.00	8,400	14	3.20%	712.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1169	光线传媒	2022-0 8-26	14,07 0.00	1,500	14	3.20%	17.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1170	长信科技	2022-0 8-26	157,16 5.00	21,500	14	3.20%	189.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1173	汤臣倍健	2022-0 8-26	23,85 5.00	1,300	14	3.20%	28.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1195	利亚德	2022-0 8-26	14,34 4.00	2,200	14	3.20%	17.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1199	光环新网	2022-0 8-26	16,83 0.00	1,800	14	3.20%	20.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1233	普利制药	2022-0 8-26	43,36 0.00	1,600	14	3.20%	52.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1249	英科医疗	2022-0 8-26	21,71 0.00	1,000	14	3.20%	26.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260001 8652	胜宏科技	2022-0 8-26	273,42 9.00	17,100	14	3.20%	330.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260001 8672	宏达电子	2022-0 8-26	318,71 4.00	6,600	14	3.20%	385.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260001 9334	易华录	2022-0 8-26	24,08 0.00	1,600	14	3.20%	29.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260001 9336	中伟股份	2022-0 8-26	148,87 5.00	1,500	14	3.20%	179.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260001 9368	义翘神州	2022-0 8-26	108,80 0.00	1,000	14	3.20%	131.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208	新易盛	2022-0	340,85	13,700	14	3.20%	411.83	-	-	

安证券股份有限公司	260001 9374		8-26	6.00							
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1292	汤臣倍健	2022-0 8-29	197,42 4.00	10,800	14	3.20%	255.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1296	宋城演艺	2022-0 8-29	54,99 7.00	4,300	14	3.20%	71.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1320	博雅生物	2022-0 8-29	71,46 3.00	2,100	14	3.20%	92.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1322	国瓷材料	2022-0 8-29	84,13 6.00	2,600	14	3.20%	108.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1378	美畅股份	2022-0 8-29	228,60 8.00	3,200	14	3.20%	295.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1379	新易盛	2022-0 8-29	70,28 0.00	2,800	14	3.20%	90.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1384	英科医疗	2022-0 8-29	22,33 0.00	1,000	14	3.20%	28.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290000 1388	普利制药	2022-0 8-29	55,12 0.00	2,000	14	3.20%	71.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 4883	易华录	2022-0 8-29	132,96 6.00	8,900	14	3.20%	172.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 4885	中际旭创	2022-0 8-29	236,05 2.00	7,900	14	3.20%	305.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 4891	扬杰科技	2022-0 8-29	138,55 2.00	2,300	14	3.20%	179.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 9405	宏达电子	2022-0 8-29	48,41 0.00	1,000	14	3.20%	62.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 9407	华测检测	2022-0 8-29	2,380, 274.00	110,30 0	14	3.20%	3,081. 26	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 9409	长信科技	2022-0 8-29	1,160, 000.00	160,00 0	14	3.20%	1,501. 62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 9419	安科生物	2022-0 8-29	373,60 0.00	40,000	14	3.20%	483.62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 290001 9517	利亚德	2022-0 8-29	25,23 3.00	3,900	14	3.20%	32.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1594	北京君正	2022-0 8-30	83,19 0.00	1,000	14	3.20%	100.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1598	宋城演艺	2022-0 8-30	749,76 8.00	59,600	14	3.20%	905.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1606	光线传媒	2022-0 8-30	118,01 6.00	12,800	14	3.20%	142.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1630	英科医疗	2022-0 8-30	22,29 0.00	1,000	14	3.20%	26.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1634	利亚德	2022-0 8-30	14,16 8.00	2,200	14	3.20%	17.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 1456	先导智能	2022-0 8-30	386,76 0.00	6,600	14	3.20%	467.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 2112	宏达电子	2022-0 8-30	47,59 0.00	1,000	14	3.20%	57.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 2124	扬杰科技	2022-0 8-30	140,82 9.00	2,300	14	3.20%	170.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 2126	中际旭创	2022-0 8-30	236,60 5.00	7,900	14	3.20%	285.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 2134	华测检测	2022-0 8-30	2,562, 800.00	119,20 0	14	3.20%	3,096. 37	-	-
国泰君安股份有	202208 300001 2200	东方财富	2022-0 8-30	390,88 8.00	17,800	14	3.20%	472.27	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202208 300001 4516	利亚德	2022-0 8-30	25,11 6.00	3,900	14	3.20%	30.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1294	国瓷材料	2022-0 8-31	504,03 0.00	15,900	14	3.20%	608.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1296	光线传媒	2022-0 8-31	154,47 5.00	16,700	14	3.20%	186.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1297	易华录	2022-0 8-31	36,65 0.00	2,500	14	3.20%	44.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1321	信维通信	2022-0 8-31	214,88 4.00	12,700	14	3.20%	259.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1324	昆仑万维	2022-0 8-31	415,16 1.00	28,300	14	3.20%	501.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1326	景嘉微	2022-0 8-31	138,75 0.00	2,500	14	3.20%	167.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1330	万孚生物	2022-0 8-31	39,16 8.00	1,200	14	3.20%	47.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1334	利亚德	2022-0 8-31	194,37 0.00	31,000	14	3.20%	234.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1338	我武生物	2022-0 8-31	87,93 2.00	1,900	14	3.20%	106.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1340	光环新网	2022-0 8-31	85,56 0.00	9,200	14	3.20%	103.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1374	安科生物	2022-0 8-31	67,10 4.00	7,200	14	3.20%	81.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1380	新宙邦	2022-0 8-31	357,42 5.00	8,500	14	3.20%	431.84	-	-	
国泰君安证券	202208 310000	贝达药业	2022-0 8-31	140,70 9.00	3,100	14	3.20%	170.00	-	-	

股份有限公司	1408										
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1410	宏达电子	2022-0 8-31	106,97 3.00	2,300	14	3.20%	129.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1412	普利制药	2022-0 8-31	105,57 3.00	3,900	14	3.20%	127.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310001 7546	天华超净	2022-0 8-31	179,42 3.00	2,300	14	3.20%	216.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 310001 7550	金力永磁	2022-0 8-31	48,32 1.00	1,300	14	3.20%	58.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1298	光线传媒	2022-0 9-01	492,96 6.00	53,700	14	3.20%	595.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1301	卫宁健康	2022-0 9-01	7,040. 00	1,000	14	3.20%	8.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1303	安科生物	2022-0 9-01	27,55 0.00	2,900	14	3.20%	33.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1307	长信科技	2022-0 9-01	20,15 5.00	2,900	14	3.20%	24.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1318	利亚德	2022-0 9-01	242,73 6.00	38,900	14	3.20%	293.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1345	普利制药	2022-0 9-01	41,13 0.00	1,500	14	3.20%	49.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010001 2706	我武生物	2022-0 9-01	340,47 2.00	7,300	14	3.20%	411.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010001 4948	立高食品	2022-0 9-01	152,89 3.00	1,900	14	3.20%	184.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1352	新易盛	2022-0 9-02	39,58 4.00	1,600	14	3.20%	47.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209	赢合科	2022-0	57,94	2,200	14	3.20%	70.01	-	-	

安证券股份有限公司	020000 1366	技	9-02	8.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1368	深信服	2022-0 9-02	207,10 0.00	2,000	14	3.20%	250.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1374	美畅股份	2022-0 9-02	767,59 0.00	11,800	14	3.20%	927.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1384	普利制药	2022-0 9-02	43,26 4.00	1,600	14	3.20%	52.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1386	药石科技	2022-0 9-02	80,40 0.00	1,000	14	3.20%	97.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1412	华测检测	2022-0 9-02	21,40 0.00	1,000	14	3.20%	25.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1416	国瓷材料	2022-0 9-02	137,20 5.00	4,500	14	3.20%	165.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1420	博雅生物	2022-0 9-02	153,47 2.00	4,400	14	3.20%	185.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1426	中际旭创	2022-0 9-02	113,99 7.00	3,900	14	3.20%	137.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 1460	华利集团	2022-0 9-02	59,68 0.00	1,000	14	3.20%	72.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020000 9547	扬杰科技	2022-0 9-02	416,97 6.00	7,300	14	3.20%	503.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 020001 0909	光威复材	2022-0 9-02	78,10 0.00	1,000	14	3.20%	94.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0865	国瓷材料	2022-0 9-05	57,49 4.00	1,900	14	3.20%	69.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0872	中际旭创	2022-0 9-05	742,95 0.00	25,400	14	3.20%	897.63	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0890	新易盛	2022-0 9-05	38,97 6.00	1,600	14	3.20%	47.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0902	光威复材	2022-0 9-05	1,133, 160.00	14,200	14	3.20%	1,369. 08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0908	贝达药业	2022-0 9-05	44,59 0.00	1,000	14	3.20%	53.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050000 0912	康泰生物	2022-0 9-05	68,79 6.00	2,100	14	3.20%	83.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050002 2023	华利集团	2022-0 9-05	243,54 0.00	4,100	14	3.20%	294.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050002 2027	博雅生物	2022-0 9-05	131,32 8.00	3,800	14	3.20%	158.67	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 050002 2057	宏达电子	2022-0 9-05	45,37 0.00	1,000	14	3.20%	54.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1058	金力永磁	2022-0 9-06	206,01 0.00	5,400	14	3.20%	248.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1060	药石科技	2022-0 9-06	161,34 0.00	2,000	14	3.20%	194.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1064	易华录	2022-0 9-06	23,29 6.00	1,600	14	3.20%	28.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1070	博雅生物	2022-0 9-06	113,58 6.00	3,300	14	3.20%	137.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1076	昆仑万维	2022-0 9-06	1,063, 050.00	74,600	14	3.20%	1,284. 38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1102	拉卡拉	2022-0 9-06	32,92 0.00	2,000	14	3.20%	39.78	-	-
国泰君安股份有	202209 060001 7425	华利集团	2022-0 9-06	57,84 0.00	1,000	14	3.20%	69.88	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 060001 7645	长信科技	2022-0 9-06	9,269. 00	1,300	14	3.20%	11.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 060001 7673	宏达电子	2022-0 9-06	231,90 0.00	5,000	14	3.20%	280.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 060001 7675	德方纳米	2022-0 9-06	1,127, 880.00	3,600	14	3.20%	1,362. 70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 060001 7681	金力永磁	2022-0 9-06	137,34 0.00	3,600	14	3.20%	165.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 060001 7715	博雅生物	2022-0 9-06	34,42 0.00	1,000	14	3.20%	41.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070000 1354	华测检测	2022-0 9-07	196,01 4.00	9,100	14	3.20%	236.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070000 1368	新易盛	2022-0 9-07	234,08 0.00	9,500	14	3.20%	282.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070002 8338	北京君正	2022-0 9-07	160,52 0.00	2,000	14	3.20%	193.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070002 8544	贝达药业	2022-0 9-07	43,90 0.00	1,000	14	3.20%	53.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070003 1692	金力永磁	2022-0 9-07	200,77 2.00	5,200	14	3.20%	242.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070003 1734	博雅生物	2022-0 9-07	34,00 0.00	1,000	14	3.20%	41.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 070003 1744	宏达电子	2022-0 9-07	48,32 0.00	1,000	14	3.20%	58.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 080000 0929	贝达药业	2022-0 9-08	44,30 0.00	1,000	14	3.20%	53.52	-	-	
国泰君安证券	202209 080000	美畅股份	2022-0 9-08	120,65 4.00	1,800	14	3.20%	145.78	-	-	

股份有限公司	0937										
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000941	金力永磁	2022-09-08	52,640.00	1,400	14	3.20%	63.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000947	长盈精密	2022-09-08	37,613.00	2,900	14	3.20%	45.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000951	博雅生物	2022-09-08	125,689.00	3,700	14	3.20%	151.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000953	赢合科技	2022-09-08	37,730.00	1,400	14	3.20%	45.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000955	易华录	2022-09-08	21,450.00	1,500	14	3.20%	25.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000957	光线传媒	2022-09-08	13,575.00	1,500	14	3.20%	16.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800000971	义翘神州	2022-09-08	169,840.00	1,600	14	3.20%	205.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014068	东方财富	2022-09-08	37,774.00	1,700	14	3.20%	45.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014076	光威复材	2022-09-08	722,568.00	8,400	14	3.20%	873.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014080	金力永磁	2022-09-08	436,160.00	11,600	14	3.20%	526.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014084	宋城演艺	2022-09-08	554,400.00	44,000	14	3.20%	669.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014134	贝达药业	2022-09-08	305,670.00	6,900	14	3.20%	369.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022090800014144	特锐德	2022-09-08	285,741.00	17,100	14	3.20%	345.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209	中际旭	2022-09-08	512,920.00	17,500	14	3.20%	619.72	-	-	

安证券股份有限公司	080001 4210	创	9-08	5.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 090000 1063	华大基因	2022-0 9-09	159,30 0.00	2,700	14	3.20%	192.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090000 1064	寒锐钴业	2022-0 9-09	314,46 0.00	6,000	14	3.20%	379.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090000 1193	康泰生物	2022-0 9-09	99,60 3.00	3,100	14	3.20%	120.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090000 1195	光线传媒	2022-0 9-09	13,51 5.00	1,500	14	3.20%	16.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090000 1202	信维通信	2022-0 9-09	916,84 4.00	55,600	14	3.20%	1,107. 73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 1709	义翘神州	2022-0 9-09	106,74 0.00	1,000	14	3.20%	128.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 2183	光环新网	2022-0 9-09	16,54 2.00	1,800	14	3.20%	19.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 2357	新易盛	2022-0 9-09	329,34 8.00	13,700	14	3.20%	397.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 2365	中伟股份	2022-0 9-09	143,55 0.00	1,500	14	3.20%	173.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 2521	光线传媒	2022-0 9-09	13,51 5.00	1,500	14	3.20%	16.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3331	胜宏科技	2022-0 9-09	279,58 5.00	17,100	14	3.20%	337.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3361	汤臣倍健	2022-0 9-09	23,62 1.00	1,300	14	3.20%	28.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3363	长信科技	2022-0 9-09	151,79 0.00	21,500	14	3.20%	183.39	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3365	利亚德	2022-0 9-09	13,88 2.00	2,200	14	3.20%	16.78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3371	英科医疗	2022-0 9-09	22,25 0.00	1,000	14	3.20%	26.88	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3451	宏达电子	2022-0 9-09	325,90 8.00	6,600	14	3.20%	393.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3473	易华录	2022-0 9-09	23,07 2.00	1,600	14	3.20%	27.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1243	新易盛	2022-0 9-13	662,03 0.00	27,700	14	3.20%	799.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1249	博雅生物	2022-0 9-13	268,71 0.00	7,800	14	3.20%	324.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1251	天华超净	2022-0 9-13	188,76 0.00	2,400	14	3.20%	228.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1257	华大基因	2022-0 9-13	88,81 5.00	1,500	14	3.20%	107.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1273	信维通信	2022-0 9-13	279,69 5.00	16,900	14	3.20%	337.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1275	光线传媒	2022-0 9-13	13,63 5.00	1,500	14	3.20%	16.48	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1277	国瓷材料	2022-0 9-13	144,99 0.00	4,500	14	3.20%	175.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1285	华测检测	2022-0 9-13	500,02 0.00	23,000	14	3.20%	604.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 130000 1287	新宙邦	2022-0 9-13	50,42 4.00	1,200	14	3.20%	60.92	-	-
国泰君安股份有	202209 130000 1289	蓝色光标	2022-0 9-13	12,39 7.00	2,300	14	3.20%	14.98	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2381	新易盛	2022-0 9-13	66,92 0.00	2,800	14	3.20%	80.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2457	宏达电子	2022-0 9-13	50,04 0.00	1,000	14	3.20%	60.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2467	华测检测	2022-0 9-13	2,591, 408.00	119,20 0	14	3.20%	3,130. 93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2471	扬杰科技	2022-0 9-13	130,84 7.00	2,300	14	3.20%	158.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2475	东方财富	2022-0 9-13	403,52 6.00	17,800	14	3.20%	487.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2495	先导智能	2022-0 9-13	360,55 8.00	6,600	14	3.20%	435.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2515	中际旭创	2022-0 9-13	229,25 8.00	7,900	14	3.20%	276.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2541	宏达电子	2022-0 9-13	50,04 0.00	1,000	14	3.20%	60.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2555	易华录	2022-0 9-13	127,71 5.00	8,900	14	3.20%	154.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2561	中际旭创	2022-0 9-13	229,25 8.00	7,900	14	3.20%	276.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 2563	利亚德	2022-0 9-13	24,45 3.00	3,900	14	3.20%	29.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 5047	北京君正	2022-0 9-13	78,26 0.00	1,000	14	3.20%	94.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 6115	安科生物	2022-0 9-13	379,60 0.00	40,000	14	3.20%	458.63	-	-	
国泰君安证券	202209 130002	华测检测	2022-0 9-13	2,397, 922.00	110,30 0	14	3.20%	2,897. 16	-	-	

股份有限公司	6117										
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 6121	长信科技	2022-0 9-13	1,132, 800.00	160,00 0	14	3.20%	1,368. 65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 6153	扬杰科技	2022-0 9-13	130,84 7.00	2,300	14	3.20%	158.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7083	英科医疗	2022-0 9-13	22,28 0.00	1,000	14	3.20%	26.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7099	利亚德	2022-0 9-13	13,79 4.00	2,200	14	3.20%	16.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7109	英科医疗	2022-0 9-13	22,28 0.00	1,000	14	3.20%	26.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7111	光线传媒	2022-0 9-13	116,35 2.00	12,800	14	3.20%	140.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7135	国瓷材料	2022-0 9-13	83,77 2.00	2,600	14	3.20%	101.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7139	美畅股份	2022-0 9-13	210,81 6.00	3,200	14	3.20%	254.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7141	博雅生物	2022-0 9-13	72,34 5.00	2,100	14	3.20%	87.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7147	宋城演艺	2022-0 9-13	55,38 4.00	4,300	14	3.20%	66.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7189	利亚德	2022-0 9-13	24,45 3.00	3,900	14	3.20%	29.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2089	新宙邦	2022-0 9-14	962,91 0.00	23,400	14	3.20%	1,163. 39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2099	当升科技	2022-0 9-14	447,75 1.00	5,900	14	3.20%	540.97	-	-	
国泰君安	202209	蓝色光标	2022-0	11,10	2,100	14	3.20%	13.42	-	-	

安证券股份有限公司	140000 2101	标	9-14	9.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2107	华测检测	2022-0 9-14	231,98 4.00	10,800	14	3.20%	280.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2109	汤臣倍健	2022-0 9-14	228,00 0.00	12,500	14	3.20%	275.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2165	光线传媒	2022-0 9-14	13,06 5.00	1,500	14	3.20%	15.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2175	国瓷材料	2022-0 9-14	1,184, 980.00	35,800	14	3.20%	1,431. 69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2201	贝达药业	2022-0 9-14	350,92 2.00	7,800	14	3.20%	423.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2205	英科医疗	2022-0 9-14	246,96 0.00	11,200	14	3.20%	298.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7510	国瓷材料	2022-0 9-14	526,29 0.00	15,900	14	3.20%	635.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7512	我武生物	2022-0 9-14	91,10 5.00	1,900	14	3.20%	110.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7514	光环新网	2022-0 9-14	83,81 2.00	9,200	14	3.20%	101.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7518	利亚德	2022-0 9-14	190,96 0.00	31,000	14	3.20%	230.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7520	光线传媒	2022-0 9-14	145,45 7.00	16,700	14	3.20%	175.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7522	景嘉微	2022-0 9-14	143,65 0.00	2,500	14	3.20%	173.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7524	信维通信	2022-0 9-14	206,37 5.00	12,700	14	3.20%	249.34	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7526	昆仑万维	2022-0 9-14	394,50 2.00	28,300	14	3.20%	476.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7528	万孚生物	2022-0 9-14	38,72 4.00	1,200	14	3.20%	46.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7530	易华录	2022-0 9-14	35,67 5.00	2,500	14	3.20%	43.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7536	新宙邦	2022-0 9-14	349,77 5.00	8,500	14	3.20%	422.60	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7774	贝达药业	2022-0 9-14	139,46 9.00	3,100	14	3.20%	168.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7786	宏达电子	2022-0 9-14	115,87 4.00	2,300	14	3.20%	140.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7810	天华超净	2022-0 9-14	180,20 5.00	2,300	14	3.20%	217.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7836	金力永磁	2022-0 9-14	48,17 8.00	1,300	14	3.20%	58.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140002 0230	安科生物	2022-0 9-14	67,39 2.00	7,200	14	3.20%	81.43	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140002 0232	普利制药	2022-0 9-14	103,58 4.00	3,900	14	3.20%	125.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150000 0980	当升科技	2022-0 9-15	864,77 3.00	11,900	14	3.20%	1,044. 82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150000 0982	光线传媒	2022-0 9-15	153,40 3.00	17,900	14	3.20%	185.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150000 0986	新宙邦	2022-0 9-15	665,32 8.00	16,700	14	3.20%	803.84	-	-
国泰君安股份有	202209 150000 0987	蓝色光标	2022-0 9-15	11,91 4.00	2,300	14	3.20%	14.40	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	202209 150000 0992	国瓷材料	2022-0 9-15	1,998, 381.00	63,300	14	3.20%	2,414. 44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150000 1000	贝达药业	2022-0 9-15	542,04 6.00	12,200	14	3.20%	654.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 4107	长信科技	2022-0 9-15	19,19 8.00	2,900	14	3.20%	23.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 4119	立高食品	2022-0 9-15	148,82 7.00	1,900	14	3.20%	179.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 4215	我武生物	2022-0 9-15	343,10 0.00	7,300	14	3.20%	414.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 4687	普利制药	2022-0 9-15	38,31 0.00	1,500	14	3.20%	46.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 6905	卫宁健康	2022-0 9-15	6,750. 00	1,000	14	3.20%	8.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 6909	利亚德	2022-0 9-15	234,56 7.00	38,900	14	3.20%	283.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0704	特锐德	2022-0 9-16	28,50 0.00	1,900	14	3.20%	34.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0720	蓝色光标	2022-0 9-16	11,61 5.00	2,300	14	3.20%	14.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0750	赢合科技	2022-0 9-16	28,41 6.00	1,200	14	3.20%	34.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0754	胜宏科技	2022-0 9-16	25,41 5.00	1,700	14	3.20%	30.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0760	光线传媒	2022-0 9-16	34,85 0.00	4,100	14	3.20%	42.11	-	-
国泰君安证券	202209 160000	易华录	2022-0 9-16	14,89 4.00	1,100	14	3.20%	17.99	-	-

股份有限公司	0762										
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0773	博腾股份	2022-0 9-16	50,42 0.00	1,000	14	3.20%	60.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160000 0794	金力永磁	2022-0 9-16	34,61 0.00	1,000	14	3.20%	41.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0858	赢合科技	2022-0 9-16	52,09 6.00	2,200	14	3.20%	62.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0874	国瓷材料	2022-0 9-16	138,60 0.00	4,500	14	3.20%	167.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0876	中际旭创	2022-0 9-16	102,68 7.00	3,900	14	3.20%	124.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0886	博雅生物	2022-0 9-16	141,94 4.00	4,400	14	3.20%	171.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0888	深信服	2022-0 9-16	238,36 0.00	2,000	14	3.20%	287.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0890	普利制药	2022-0 9-16	40,03 2.00	1,600	14	3.20%	48.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0894	扬杰科技	2022-0 9-16	381,64 4.00	7,300	14	3.20%	461.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 0914	光威复材	2022-0 9-16	85,76 0.00	1,000	14	3.20%	103.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 1362	药石科技	2022-0 9-16	69,15 0.00	1,000	14	3.20%	83.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 1370	新易盛	2022-0 9-16	35,20 0.00	1,600	14	3.20%	42.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 160001 1374	华测检测	2022-0 9-16	20,90 0.00	1,000	14	3.20%	25.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209	美畅股	2022-0	725,11	11,800	14	3.20%	876.08	-	-	

安证券股份有限公司	160001 1376	份	9-16	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1584	博腾股份	2022-0 9-19	49,84 0.00	1,000	14	3.20%	90.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1588	光线传媒	2022-0 9-19	32,55 4.00	4,100	14	3.20%	59.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1589	易华录	2022-0 9-19	22,61 0.00	1,700	14	3.20%	40.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1598	博雅生物	2022-0 9-19	61,37 0.00	1,900	14	3.20%	111.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1610	药石科技	2022-0 9-19	840,70 8.00	12,100	14	3.20%	1,523. 61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1616	赢合科技	2022-0 9-19	37,76 0.00	1,600	14	3.20%	68.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1632	蓝色光标	2022-0 9-19	11,43 1.00	2,300	14	3.20%	20.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1646	特锐德	2022-0 9-19	97,61 4.00	6,600	14	3.20%	176.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1696	金力永磁	2022-0 9-19	34,72 0.00	1,000	14	3.20%	62.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8044	光威复材	2022-0 9-19	1,190, 102.00	14,200	14	3.20%	2,156. 82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8054	贝达药业	2022-0 9-19	42,00 0.00	1,000	14	3.20%	76.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8124	博雅生物	2022-0 9-19	122,74 0.00	3,800	14	3.20%	222.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8640	国瓷材料	2022-0 9-19	59,10 9.00	1,900	14	3.20%	107.13	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8644	新易盛	2022-0 9-19	35,18 4.00	1,600	14	3.20%	63.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 190001 8702	宏达电 子	2022-0 9-19	47,96 0.00	1,000	14	3.20%	86.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 190002 0090	华利集 团	2022-0 9-19	212,21 6.00	4,100	14	3.20%	384.60	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 190002 0982	中际旭 创	2022-0 9-19	681,48 2.00	25,400	14	3.20%	1,235. 05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200000 1087	深信服	2022-0 9-20	256,45 0.00	2,300	14	3.20%	442.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200000 1095	光线传 媒	2022-0 9-20	15,60 0.00	2,000	14	3.20%	26.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200000 1101	华测检 测	2022-0 9-20	159,35 4.00	7,800	14	3.20%	275.05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200000 1119	华利集 团	2022-0 9-20	99,71 2.00	1,900	14	3.20%	172.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 4195	药石科 技	2022-0 9-20	140,16 0.00	2,000	14	3.20%	241.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 4315	博雅生 物	2022-0 9-20	32,11 0.00	1,000	14	3.20%	55.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6205	宏达电 子	2022-0 9-20	239,75 0.00	5,000	14	3.20%	413.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6219	金力永 磁	2022-0 9-20	127,72 8.00	3,600	14	3.20%	220.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6227	博雅生 物	2022-0 9-20	105,96 3.00	3,300	14	3.20%	182.89	-	-
国泰君安股份有	202209 200001 6231	易华录	2022-0 9-20	21,36 0.00	1,600	14	3.20%	36.86	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6233	金力永 磁	2022-0 9-20	191,59 2.00	5,400	14	3.20%	330.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6239	拉卡拉	2022-0 9-20	30,00 0.00	2,000	14	3.20%	51.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6285	德方纳 米	2022-0 9-20	1,115, 496.00	3,600	14	3.20%	1,925. 34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 200001 6331	长信科 技	2022-0 9-20	8,281. 00	1,300	14	3.20%	14.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1080	我武生 物	2022-0 9-21	219,55 5.00	5,100	14	3.20%	360.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1082	博雅生 物	2022-0 9-21	50,96 0.00	1,600	14	3.20%	83.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1086	博腾股 份	2022-0 9-21	208,85 1.00	4,300	14	3.20%	342.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1088	万孚生 物	2022-0 9-21	146,95 1.00	4,900	14	3.20%	240.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1090	赢合科 技	2022-0 9-21	36,18 0.00	1,500	14	3.20%	59.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1094	易华录	2022-0 9-21	32,56 8.00	2,400	14	3.20%	53.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1098	天华超 净	2022-0 9-21	166,24 4.00	2,300	14	3.20%	272.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1126	稳健医 疗	2022-0 9-21	105,18 4.00	1,600	14	3.20%	172.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1132	金力永 磁	2022-0 9-21	377,25 4.00	10,600	14	3.20%	618.58	-	-	
国泰君安证券	202209 210000	华利集 团	2022-0 9-21	78,16 5.00	1,500	14	3.20%	128.16	-	-	

股份有限公司	1136										
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1494	新易盛	2022-0 9-21	208,81 0.00	9,500	14	3.20%	342.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1500	华测检测	2022-0 9-21	182,45 5.00	9,100	14	3.20%	299.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1588	北京君正	2022-0 9-21	146,26 0.00	2,000	14	3.20%	239.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1600	博雅生物	2022-0 9-21	31,85 0.00	1,000	14	3.20%	52.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1718	贝达药业	2022-0 9-21	40,62 0.00	1,000	14	3.20%	66.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1760	宏达电子	2022-0 9-21	46,82 0.00	1,000	14	3.20%	76.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 210003 1764	金力永磁	2022-0 9-21	185,06 8.00	5,200	14	3.20%	303.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0326	特锐德	2022-0 9-22	152,59 2.00	10,200	14	3.20%	237.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0331	北京君正	2022-0 9-22	368,20 0.00	5,000	14	3.20%	571.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0333	我武生物	2022-0 9-22	122,81 5.00	2,900	14	3.20%	190.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0351	药石科技	2022-0 9-22	68,11 0.00	1,000	14	3.20%	105.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0355	景嘉微	2022-0 9-22	64,90 9.00	1,300	14	3.20%	100.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0359	万孚生物	2022-0 9-22	216,44 5.00	7,300	14	3.20%	336.22	-	-	
国泰君安	202209	金力永	2022-0	1,424,	39,600	14	3.20%	2,212.	-	-	

安证券股份有限公司	220000 0365	磁	9-22	412.00				68		
国泰君安证券股份有限公司	202209 220000 0369	安克创新	2022-0 9-22	104,86 1.00	1,900	14	3.20%	162.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0691	美畅股份	2022-0 9-22	106,66 8.00	1,800	14	3.20%	165.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0693	义翘神州	2022-0 9-22	157,44 0.00	1,600	14	3.20%	244.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0695	易华录	2022-0 9-22	20,52 0.00	1,500	14	3.20%	31.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0697	赢合科技	2022-0 9-22	33,76 8.00	1,400	14	3.20%	52.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0705	贝达药业	2022-0 9-22	39,85 0.00	1,000	14	3.20%	61.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0723	金力永磁	2022-0 9-22	417,25 2.00	11,600	14	3.20%	648.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0751	贝达药业	2022-0 9-22	274,96 5.00	6,900	14	3.20%	427.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0769	宋城演艺	2022-0 9-22	533,72 0.00	44,000	14	3.20%	829.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0803	东方财富	2022-0 9-22	31,55 2.00	1,700	14	3.20%	49.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 0807	特锐德	2022-0 9-22	255,81 6.00	17,100	14	3.20%	397.39	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 1089	金力永磁	2022-0 9-22	50,35 8.00	1,400	14	3.20%	78.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 1097	博雅生物	2022-0 9-22	115,18 1.00	3,700	14	3.20%	178.92	-	-

国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 1629	光线传媒	2022-0 9-22	11,26 5.00	1,500	14	3.20%	17.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 1731	中际旭创	2022-0 9-22	469,87 5.00	17,500	14	3.20%	729.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 1799	长盈精密	2022-0 9-22	34,88 7.00	2,900	14	3.20%	54.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 220001 4297	光威复材	2022-0 9-22	716,52 0.00	8,400	14	3.20%	1,113. 04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230000 0420	蓝思科技	2022-0 9-23	128,52 0.00	13,500	14	3.20%	188.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230000 0426	博雅生物	2022-0 9-23	38,43 6.00	1,200	14	3.20%	56.39	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230000 0432	易华录	2022-0 9-23	22,40 6.00	1,700	14	3.20%	32.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230000 0436	光线传媒	2022-0 9-23	18,25 0.00	2,500	14	3.20%	26.78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230000 0454	中伟股份	2022-0 9-23	87,52 0.00	1,000	14	3.20%	128.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 6066	康泰生物	2022-0 9-23	92,69 0.00	3,100	14	3.20%	135.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 6362	寒锐钴业	2022-0 9-23	286,92 0.00	6,000	14	3.20%	420.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 6364	华大基因	2022-0 9-23	144,72 0.00	2,700	14	3.20%	212.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 6380	信维通信	2022-0 9-23	815,65 2.00	55,600	14	3.20%	1,196. 64	-	-
国泰君安股份有	202209 230001 6392	易华录	2022-0 9-23	21,08 8.00	1,600	14	3.20%	30.94	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 6476	宏达电 子	2022-0 9-23	315,34 8.00	6,600	14	3.20%	462.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 8544	光线传 媒	2022-0 9-23	10,95 0.00	1,500	14	3.20%	16.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 8640	义翘神 州	2022-0 9-23	95,62 0.00	1,000	14	3.20%	140.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 8652	新易盛	2022-0 9-23	295,92 0.00	13,700	14	3.20%	434.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230001 8694	中伟股 份	2022-0 9-23	131,28 0.00	1,500	14	3.20%	192.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 0514	光线传 媒	2022-0 9-23	10,95 0.00	1,500	14	3.20%	16.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 0558	利亚德	2022-0 9-23	12,51 8.00	2,200	14	3.20%	18.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 0844	光环新 网	2022-0 9-23	15,19 2.00	1,800	14	3.20%	22.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 0984	英科医 疗	2022-0 9-23	19,24 0.00	1,000	14	3.20%	28.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 1104	胜宏科 技	2022-0 9-23	241,96 5.00	17,100	14	3.20%	354.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 1116	长信科 技	2022-0 9-23	133,73 0.00	21,500	14	3.20%	196.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 230002 1144	汤臣倍 健	2022-0 9-23	21,71 0.00	1,300	14	3.20%	31.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 260000 1090	宋城演 艺	2022-0 9-26	478,79 2.00	38,800	14	3.20%	578.48	-	-	
国泰君安证券	202209 260000	光线传 媒	2022-0 9-26	86,75 1.00	11,900	14	3.20%	104.82	-	-	

股份有限公司	1104										
国泰君安证券股份有限公司	202209 260000 1113	天华超净	2022-0 9-26	765,27 0.00	11,000	14	3.20%	924.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 260000 1142	新宙邦	2022-0 9-26	1,854, 600.00	44,000	14	3.20%	2,240. 73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270000 1434	光线传媒	2022-0 9-27	53,74 7.00	7,100	14	3.20%	64.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270000 1437	博雅生物	2022-0 9-27	44,95 4.00	1,400	14	3.20%	54.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270000 1454	昆仑万维	2022-0 9-27	139,52 0.00	10,900	14	3.20%	168.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270000 1470	蓝色光标	2022-0 9-27	20,64 0.00	4,300	14	3.20%	24.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 1877	天华超净	2022-0 9-27	166,99 2.00	2,400	14	3.20%	201.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 1879	华大基因	2022-0 9-27	81,01 5.00	1,500	14	3.20%	97.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 2659	中际旭创	2022-0 9-27	217,72 4.00	7,900	14	3.20%	263.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4137	博雅生物	2022-0 9-27	67,43 1.00	2,100	14	3.20%	81.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4141	利亚德	2022-0 9-27	22,23 0.00	3,900	14	3.20%	26.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4143	利亚德	2022-0 9-27	22,23 0.00	3,900	14	3.20%	26.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4203	新易盛	2022-0 9-27	608,29 2.00	27,700	14	3.20%	734.94	-	-	
国泰君安	202209	博雅生物	2022-0	250,45	7,800	14	3.20%	302.60	-	-	

安证券股份有限公司	270002 4207	物	9-27	8.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4267	北京君正	2022-0 9-27	74,20 0.00	1,000	14	3.20%	89.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4269	国瓷材料	2022-0 9-27	81,19 8.00	2,600	14	3.20%	98.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4279	安科生物	2022-0 9-27	354,80 0.00	40,000	14	3.20%	428.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4281	华测检测	2022-0 9-27	2,327, 330.00	110,30 0	14	3.20%	2,811. 87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4283	华测检测	2022-0 9-27	2,515, 120.00	119,20 0	14	3.20%	3,038. 77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 4293	先导智能	2022-0 9-27	336,07 2.00	6,600	14	3.20%	406.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5307	宏达电子	2022-0 9-27	47,46 0.00	1,000	14	3.20%	57.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5309	扬杰科技	2022-0 9-27	119,94 5.00	2,300	14	3.20%	144.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5311	宏达电子	2022-0 9-27	47,46 0.00	1,000	14	3.20%	57.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5347	美畅股份	2022-0 9-27	192,00 0.00	3,200	14	3.20%	231.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5357	易华录	2022-0 9-27	118,10 3.00	8,900	14	3.20%	142.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5367	宋城演艺	2022-0 9-27	56,15 8.00	4,300	14	3.20%	67.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5653	利亚德	2022-0 9-27	12,54 0.00	2,200	14	3.20%	15.16	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5697	华测检测	2022-0 9-27	485,30 0.00	23,000	14	3.20%	586.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5699	新宙邦	2022-0 9-27	51,55 2.00	1,200	14	3.20%	62.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5705	信维通信	2022-0 9-27	251,81 0.00	16,900	14	3.20%	304.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5709	光线传媒	2022-0 9-27	11,35 5.00	1,500	14	3.20%	13.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5711	国瓷材料	2022-0 9-27	140,53 5.00	4,500	14	3.20%	169.80	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5713	蓝色光标	2022-0 9-27	11,04 0.00	2,300	14	3.20%	13.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5759	英科医疗	2022-0 9-27	19,96 0.00	1,000	14	3.20%	24.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5761	英科医疗	2022-0 9-27	19,96 0.00	1,000	14	3.20%	24.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5777	新易盛	2022-0 9-27	61,48 8.00	2,800	14	3.20%	74.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5783	长信科技	2022-0 9-27	998,40 0.00	160,00 0	14	3.20%	1,206. 26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5809	扬杰科技	2022-0 9-27	119,94 5.00	2,300	14	3.20%	144.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5839	东方财富	2022-0 9-27	328,41 0.00	17,800	14	3.20%	396.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5843	光线传媒	2022-0 9-27	96,89 6.00	12,800	14	3.20%	117.07	-	-
国泰君安股份有	202209 270002 9675	中际旭创	2022-0 9-27	217,72 4.00	7,900	14	3.20%	263.06	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 280000 1010	锐科激光	2022-0 9-28	109,87 2.00	4,800	14	3.20%	132.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3155	景嘉微	2022-0 9-28	118,30 0.00	2,500	14	3.20%	142.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3163	万孚生物	2022-0 9-28	35,11 2.00	1,200	14	3.20%	42.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3217	蓝色光标	2022-0 9-28	9,744. 00	2,100	14	3.20%	11.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3221	新宙邦	2022-0 9-28	978,58 8.00	23,400	14	3.20%	1,182. 33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3233	汤臣倍健	2022-0 9-28	219,12 5.00	12,500	14	3.20%	264.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3239	新宙邦	2022-0 9-28	355,47 0.00	8,500	14	3.20%	429.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3267	信维通信	2022-0 9-28	184,78 5.00	12,700	14	3.20%	223.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3273	易华录	2022-0 9-28	32,15 0.00	2,500	14	3.20%	38.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3281	我武生物	2022-0 9-28	91,25 7.00	1,900	14	3.20%	110.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3285	华测检测	2022-0 9-28	220,86 0.00	10,800	14	3.20%	266.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3287	国瓷材料	2022-0 9-28	1,074, 358.00	35,800	14	3.20%	1,298. 04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3289	光线传媒	2022-0 9-28	122,24 4.00	16,700	14	3.20%	147.70	-	-	
国泰君安证券	202209 280001	利亚德	2022-0 9-28	172,05 0.00	31,000	14	3.20%	207.87	-	-	

股份有限公司	3293										
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3313	贝达药业	2022-0 9-28	131,31 6.00	3,100	14	3.20%	158.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3321	昆仑万维	2022-0 9-28	351,20 3.00	28,300	14	3.20%	424.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3325	光环新网	2022-0 9-28	75,07 2.00	9,200	14	3.20%	90.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 3991	国瓷材料	2022-0 9-28	477,15 9.00	15,900	14	3.20%	576.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 4187	普利制药	2022-0 9-28	96,36 9.00	3,900	14	3.20%	116.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 4191	宏达电子	2022-0 9-28	102,53 4.00	2,300	14	3.20%	123.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 4193	金力永磁	2022-0 9-28	44,26 5.00	1,300	14	3.20%	53.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 4209	天华超净	2022-0 9-28	151,96 1.00	2,300	14	3.20%	183.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 4229	安科生物	2022-0 9-28	63,50 4.00	7,200	14	3.20%	76.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5705	当升科技	2022-0 9-28	399,90 2.00	5,900	14	3.20%	483.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5707	光线传媒	2022-0 9-28	10,98 0.00	1,500	14	3.20%	13.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5733	贝达药业	2022-0 9-28	330,40 8.00	7,800	14	3.20%	399.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5735	英科医疗	2022-0 9-28	219,85 6.00	11,200	14	3.20%	265.63	-	-	
国泰君安	202209	同花顺	2022-0	168,89	2,200	14	3.20%	204.06	-	-	

安证券股份有限公司	290000 0793		9-29	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0797	昆仑万维	2022-0 9-29	971,24 4.00	78,200	14	3.20%	1,173. 46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0799	康泰生物	2022-0 9-29	109,90 8.00	3,600	14	3.20%	132.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0803	万孚生物	2022-0 9-29	221,10 0.00	7,500	14	3.20%	267.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 4121	国瓷材料	2022-0 9-29	1,900, 266.00	63,300	14	3.20%	2,295. 90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5287	新宙邦	2022-0 9-29	706,91 1.00	16,700	14	3.20%	854.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5289	当升科技	2022-0 9-29	820,38 6.00	11,900	14	3.20%	991.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5297	立高食品	2022-0 9-29	159,14 4.00	1,900	14	3.20%	192.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5841	蓝色光标	2022-0 9-29	10,44 2.00	2,300	14	3.20%	12.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5869	我武生物	2022-0 9-29	356,67 8.00	7,300	14	3.20%	430.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5905	利亚德	2022-0 9-29	215,89 5.00	38,900	14	3.20%	260.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5907	普利制药	2022-0 9-29	37,80 0.00	1,500	14	3.20%	45.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 5935	卫宁健康	2022-0 9-29	6,510. 00	1,000	14	3.20%	7.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 6135	长信科技	2022-0 9-29	17,51 6.00	2,900	14	3.20%	21.16	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 6443	光线传媒	2022-0 9-29	128,52 2.00	17,900	14	3.20%	155.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 290001 6445	贝达药业	2022-0 9-29	547,78 0.00	12,200	14	3.20%	661.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9235	特锐德	2022-0 9-30	27,64 5.00	1,900	14	3.20%	33.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9237	金力永磁	2022-0 9-30	33,05 0.00	1,000	14	3.20%	39.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9239	博腾股份	2022-0 9-30	46,60 0.00	1,000	14	3.20%	56.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9241	易华录	2022-0 9-30	13,78 3.00	1,100	14	3.20%	16.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9243	蓝色光标	2022-0 9-30	10,30 4.00	2,300	14	3.20%	12.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9251	胜宏科技	2022-0 9-30	22,74 6.00	1,700	14	3.20%	27.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9257	赢合科技	2022-0 9-30	28,38 0.00	1,200	14	3.20%	34.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9259	光线传媒	2022-0 9-30	29,11 0.00	4,100	14	3.20%	35.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9277	普利制药	2022-0 9-30	39,60 0.00	1,600	14	3.20%	47.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9279	扬杰科技	2022-0 9-30	360,54 7.00	7,300	14	3.20%	435.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9285	光威复材	2022-0 9-30	82,91 0.00	1,000	14	3.20%	100.17	-	-
国泰君安股份有	202209 300000 9305	药石科技	2022-0 9-30	70,45 0.00	1,000	14	3.20%	85.12	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9307	新易盛	2022-0 9-30	33,82 4.00	1,600	14	3.20%	40.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300000 9913	美畅股份	2022-0 9-30	668,82 4.00	11,800	14	3.20%	808.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 0519	赢合科技	2022-0 9-30	52,03 0.00	2,200	14	3.20%	62.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 0525	中际旭创	2022-0 9-30	101,71 2.00	3,900	14	3.20%	122.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 0527	博雅生物	2022-0 9-30	140,80 0.00	4,400	14	3.20%	170.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 0529	深信服	2022-0 9-30	200,00 0.00	2,000	14	3.20%	241.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 1229	国瓷材料	2022-0 9-30	130,36 5.00	4,500	14	3.20%	157.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 300001 1671	华测检测	2022-0 9-30	20,35 0.00	1,000	14	3.20%	24.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100000 1781	长盈精密	2022-1 0-10	434,14 8.00	42,900	14	3.20%	524.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100000 1898	金龙鱼	2022-1 0-10	93,28 0.00	2,200	14	3.20%	112.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100000 1905	药石科技	2022-1 0-10	234,39 5.00	3,500	14	3.20%	283.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100000 1915	安克创新	2022-1 0-10	133,90 0.00	2,500	14	3.20%	161.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100007 9941	胜宏科技	2022-1 0-10	218,53 8.00	17,100	14	3.20%	264.04	-	-	
国泰君安证券	202210 100007	中际旭创	2022-1 0-10	644,90 6.00	25,400	14	3.20%	779.17	-	-	

股份有限公司	9977										
国泰君安证券股份有限公司	202210 100007 9989	博雅生物	2022-1 0-10	37,80 0.00	1,200	14	3.20%	45.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0003	信维通信	2022-1 0-10	769,50 4.00	55,600	14	3.20%	929.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0011	新易盛	2022-1 0-10	278,11 0.00	13,700	14	3.20%	336.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0017	金力永磁	2022-1 0-10	342,59 2.00	10,600	14	3.20%	413.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0031	天华超净	2022-1 0-10	148,23 5.00	2,300	14	3.20%	179.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0065	宏达电子	2022-1 0-10	41,93 0.00	1,000	14	3.20%	50.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0095	博雅生物	2022-1 0-10	50,40 0.00	1,600	14	3.20%	60.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0097	万孚生物	2022-1 0-10	139,35 6.00	4,900	14	3.20%	168.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0109	药石科技	2022-1 0-10	810,33 7.00	12,100	14	3.20%	979.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0113	博腾股份	2022-1 0-10	190,61 9.00	4,300	14	3.20%	230.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0125	博腾股份	2022-1 0-10	44,33 0.00	1,000	14	3.20%	53.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0949	金力永磁	2022-1 0-10	32,32 0.00	1,000	14	3.20%	39.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 0951	蓝色光标	2022-1 0-10	10,09 7.00	2,300	14	3.20%	12.20	-	-	
国泰君安	202210	博雅生物	2022-1	59,85	1,900	14	3.20%	72.31	-	-	

安证券股份有限公司	100008 0955	物	0-10	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1095	华大基因	2022-1 0-10	142,50 6.00	2,700	14	3.20%	172.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1137	天华超净	2022-1 0-10	708,95 0.00	11,000	14	3.20%	856.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1879	易华录	2022-1 0-10	28,99 2.00	2,400	14	3.20%	35.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1943	我武生物	2022-1 0-10	243,27 0.00	5,100	14	3.20%	293.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1969	拉卡拉	2022-1 0-10	27,20 0.00	2,000	14	3.20%	32.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1971	金力永磁	2022-1 0-10	168,06 4.00	5,200	14	3.20%	203.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 1973	北京君正	2022-1 0-10	132,18 0.00	2,000	14	3.20%	159.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2003	博雅生物	2022-1 0-10	31,50 0.00	1,000	14	3.20%	38.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2119	长信科技	2022-1 0-10	7,657. 00	1,300	14	3.20%	9.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2583	赢合科技	2022-1 0-10	33,66 0.00	1,500	14	3.20%	40.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2589	易华录	2022-1 0-10	20,53 6.00	1,700	14	3.20%	24.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2591	赢合科技	2022-1 0-10	35,90 4.00	1,600	14	3.20%	43.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2595	光线传媒	2022-1 0-10	28,00 3.00	4,100	14	3.20%	33.84	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2669	光线传媒	2022-1 0-10	13,66 0.00	2,000	14	3.20%	16.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 2715	药石科技	2022-1 0-10	133,94 0.00	2,000	14	3.20%	161.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 3837	长信科技	2022-1 0-10	126,63 5.00	21,500	14	3.20%	153.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 3947	光环新网	2022-1 0-10	14,14 8.00	1,800	14	3.20%	17.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 6255	新易盛	2022-1 0-10	192,85 0.00	9,500	14	3.20%	233.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100008 6355	宏达电子	2022-1 0-10	41,93 0.00	1,000	14	3.20%	50.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 5669	华测检测	2022-1 0-10	181,90 9.00	9,100	14	3.20%	219.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 6481	安克创新	2022-1 0-10	101,76 4.00	1,900	14	3.20%	122.95	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 6555	赢合科技	2022-1 0-10	31,41 6.00	1,400	14	3.20%	37.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 6587	蓝思科技	2022-1 0-10	123,12 0.00	13,500	14	3.20%	148.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 8061	北京君正	2022-1 0-10	330,45 0.00	5,000	14	3.20%	399.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 8091	金力永磁	2022-1 0-10	1,279, 872.00	39,600	14	3.20%	1,546. 34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 8139	博雅生物	2022-1 0-10	119,70 0.00	3,800	14	3.20%	144.62	-	-
国泰君安股份有	202210 100009 8255	光威复材	2022-1 0-10	1,126, 344.00	14,200	14	3.20%	1,360. 84	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 8999	英科医疗	2022-1 0-10	19,60 0.00	1,000	14	3.20%	23.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9035	宏达电子	2022-1 0-10	276,73 8.00	6,600	14	3.20%	334.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9839	华测检测	2022-1 0-10	155,92 2.00	7,800	14	3.20%	188.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9849	金力永磁	2022-1 0-10	116,35 2.00	3,600	14	3.20%	140.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9855	金力永磁	2022-1 0-10	174,52 8.00	5,400	14	3.20%	210.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9859	东方财富	2022-1 0-10	29,41 0.00	1,700	14	3.20%	35.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9875	宏达电子	2022-1 0-10	209,65 0.00	5,000	14	3.20%	253.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100009 9893	博雅生物	2022-1 0-10	116,55 0.00	3,700	14	3.20%	140.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1443	华利集团	2022-1 0-10	193,02 8.00	4,100	14	3.20%	233.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1465	博雅生物	2022-1 0-10	31,50 0.00	1,000	14	3.20%	38.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1467	博雅生物	2022-1 0-10	103,95 0.00	3,300	14	3.20%	125.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1479	宋城演艺	2022-1 0-10	492,80 0.00	44,000	14	3.20%	595.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1483	宋城演艺	2022-1 0-10	434,56 0.00	38,800	14	3.20%	525.04	-	-	
国泰君安证券	202210 100010	新易盛	2022-1 0-10	32,48 0.00	1,600	14	3.20%	39.24	-	-	

股份有限公司	1513										
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1701	易华录	2022-1 0-10	19,32 8.00	1,600	14	3.20%	23.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 2087	德方纳 米	2022-1 0-10	977,61 6.00	3,600	14	3.20%	1,181. 16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 6993	康泰生 物	2022-1 0-10	89,86 9.00	3,100	14	3.20%	108.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 7125	汤臣倍 健	2022-1 0-10	22,56 8.00	1,300	14	3.20%	27.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110000 2276	光线传 媒	2022-1 0-11	43,52 0.00	6,400	14	3.20%	52.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5811	光线传 媒	2022-1 0-11	48,28 0.00	7,100	14	3.20%	58.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5829	易华录	2022-1 0-11	108,66 9.00	8,900	14	3.20%	131.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5833	光线传 媒	2022-1 0-11	10,20 0.00	1,500	14	3.20%	12.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5835	光线传 媒	2022-1 0-11	87,04 0.00	12,800	14	3.20%	105.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5851	华大基 因	2022-1 0-11	78,51 0.00	1,500	14	3.20%	94.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5863	安科生 物	2022-1 0-11	347,60 0.00	40,000	14	3.20%	419.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5891	天华超 净	2022-1 0-11	156,31 2.00	2,400	14	3.20%	188.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5905	东方财 富	2022-1 0-11	309,54 2.00	17,800	14	3.20%	373.99	-	-	
国泰君	202210	新宙邦	2022-1	51,51	1,200	14	3.20%	62.24	-	-	

安证券股份有限公司	110002 5951		0-11	6.00							
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5973	新易盛	2022-1 0-11	57,00 8.00	2,800	14	3.20%	68.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5985	博雅生物	2022-1 0-11	66,54 9.00	2,100	14	3.20%	80.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5987	新易盛	2022-1 0-11	563,97 2.00	27,700	14	3.20%	681.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 6955	博雅生物	2022-1 0-11	44,36 6.00	1,400	14	3.20%	53.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 6969	昆仑万维	2022-1 0-11	132,54 4.00	10,900	14	3.20%	160.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7043	华测检测	2022-1 0-11	2,423, 336.00	119,20 0	14	3.20%	2,927. 87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7443	利亚德	2022-1 0-11	21,13 8.00	3,900	14	3.20%	25.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7445	利亚德	2022-1 0-11	21,13 8.00	3,900	14	3.20%	25.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7447	利亚德	2022-1 0-11	11,92 4.00	2,200	14	3.20%	14.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7457	宏达电子	2022-1 0-11	41,80 0.00	1,000	14	3.20%	50.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7459	宏达电子	2022-1 0-11	41,80 0.00	1,000	14	3.20%	50.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7467	美畅股份	2022-1 0-11	168,48 0.00	3,200	14	3.20%	203.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7775	国瓷材料	2022-1 0-11	119,02 5.00	4,500	14	3.20%	143.81	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7777	英科医疗	2022-1 0-11	19,47 0.00	1,000	14	3.20%	23.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7779	英科医疗	2022-1 0-11	19,47 0.00	1,000	14	3.20%	23.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 7793	国瓷材料	2022-1 0-11	68,77 0.00	2,600	14	3.20%	83.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8829	华测检测	2022-1 0-11	2,242, 399.00	110,30 0	14	3.20%	2,709. 26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8831	扬杰科技	2022-1 0-11	110,97 5.00	2,300	14	3.20%	134.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8833	扬杰科技	2022-1 0-11	110,97 5.00	2,300	14	3.20%	134.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8841	信维通信	2022-1 0-11	236,60 0.00	16,900	14	3.20%	285.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8863	博雅生物	2022-1 0-11	247,18 2.00	7,800	14	3.20%	298.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 8867	先导智能	2022-1 0-11	315,34 8.00	6,600	14	3.20%	381.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1931	稳健医疗	2022-1 0-12	360,08 2.00	5,300	14	3.20%	435.05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1935	光线传媒	2022-1 0-12	416,17 6.00	59,200	14	3.20%	502.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1937	深信服	2022-1 0-12	108,60 0.00	1,200	14	3.20%	131.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1939	我武生物	2022-1 0-12	219,42 0.00	4,600	14	3.20%	265.11	-	-
国泰君安股份有	202210 120000 1949	华利集团	2022-1 0-12	233,68 1.00	4,900	14	3.20%	282.33	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1951	中伟股份	2022-1 0-12	187,72 6.00	2,300	14	3.20%	226.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 5868	贝达药业	2022-1 0-12	337,27 2.00	7,800	14	3.20%	407.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 5926	普利制药	2022-1 0-12	91,72 8.00	3,900	14	3.20%	110.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 5934	宏达电子	2022-1 0-12	98,87 7.00	2,300	14	3.20%	119.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 5970	当升科技	2022-1 0-12	401,96 7.00	5,900	14	3.20%	485.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 6978	蓝色光标	2022-1 0-12	9,576. 00	2,100	14	3.20%	11.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7050	易华录	2022-1 0-12	32,35 0.00	2,500	14	3.20%	39.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7078	金力永磁	2022-1 0-12	43,12 1.00	1,300	14	3.20%	52.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7096	光环新网	2022-1 0-12	75,99 2.00	9,200	14	3.20%	91.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7110	安科生物	2022-1 0-12	63,86 4.00	7,200	14	3.20%	77.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7138	新宙邦	2022-1 0-12	1,064, 232.00	23,400	14	3.20%	1,285. 81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7146	景嘉微	2022-1 0-12	117,87 5.00	2,500	14	3.20%	142.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7680	万孚生物	2022-1 0-12	34,95 6.00	1,200	14	3.20%	42.23	-	-	
国泰君安证券	202210 120001	锐科激光	2022-1 0-12	108,67 2.00	4,800	14	3.20%	131.30	-	-	

股份有限公司	7686										
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7706	光线传媒	2022-1 0-12	117,40 1.00	16,700	14	3.20%	141.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7708	光线传媒	2022-1 0-12	10,54 5.00	1,500	14	3.20%	12.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7716	国瓷材料	2022-1 0-12	410,69 7.00	15,900	14	3.20%	496.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7724	英科医疗	2022-1 0-12	223,55 2.00	11,200	14	3.20%	270.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7738	天华超净	2022-1 0-12	156,90 6.00	2,300	14	3.20%	189.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7760	我武生物	2022-1 0-12	90,63 0.00	1,900	14	3.20%	109.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7770	汤臣倍健	2022-1 0-12	217,75 0.00	12,500	14	3.20%	263.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 8548	贝达药业	2022-1 0-12	134,04 4.00	3,100	14	3.20%	161.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 8568	国瓷材料	2022-1 0-12	924,71 4.00	35,800	14	3.20%	1,117.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 8572	利亚德	2022-1 0-12	175,15 0.00	31,000	14	3.20%	211.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 8598	昆仑万维	2022-1 0-12	354,03 3.00	28,300	14	3.20%	427.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120002 0410	信维通信	2022-1 0-12	185,16 6.00	12,700	14	3.20%	223.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1042	蓝思科技	2022-1 0-13	265,64 3.00	27,700	14	3.20%	320.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210	迪安诊断	2022-1	596,78	20,700	14	3.20%	721.03	-	-	

安证券股份有限公司	130000 1044	断	0-13	1.00							
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1045	中际旭 创	2022-1 0-13	877,93 5.00	32,100	14	3.20%	1,060. 72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1048	景嘉微	2022-1 0-13	557,99 4.00	11,300	14	3.20%	674.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1049	胜宏科 技	2022-1 0-13	15,85 2.00	1,200	14	3.20%	19.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1052	贝达药 业	2022-1 0-13	43,97 0.00	1,000	14	3.20%	53.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 4780	昆仑万 维	2022-1 0-13	983,75 6.00	78,200	14	3.20%	1,188. 57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 5278	光线传 媒	2022-1 0-13	125,83 7.00	17,900	14	3.20%	152.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 5294	利亚德	2022-1 0-13	221,34 1.00	38,900	14	3.20%	267.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 5602	普利制 药	2022-1 0-13	36,04 5.00	1,500	14	3.20%	43.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 5698	贝达药 业	2022-1 0-13	536,43 4.00	12,200	14	3.20%	648.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6108	万孚生 物	2022-1 0-13	220,50 0.00	7,500	14	3.20%	266.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6112	同花顺	2022-1 0-13	171,60 0.00	2,200	14	3.20%	207.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6120	国瓷材 料	2022-1 0-13	1,605, 921.00	63,300	14	3.20%	1,940. 27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6136	我武生 物	2022-1 0-13	345,80 1.00	7,300	14	3.20%	417.80	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6138	蓝色光标	2022-1 0-13	10,60 3.00	2,300	14	3.20%	12.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6142	长信科技	2022-1 0-13	17,92 2.00	2,900	14	3.20%	21.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 6318	卫宁健康	2022-1 0-13	7,480. 00	1,000	14	3.20%	9.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 7722	当升科技	2022-1 0-13	804,44 0.00	11,900	14	3.20%	971.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 7744	立高食品	2022-1 0-13	157,70 0.00	1,900	14	3.20%	190.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9326	赢合科技	2022-1 0-14	30,62 4.00	1,200	14	3.20%	37.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9332	赢合科技	2022-1 0-14	56,14 4.00	2,200	14	3.20%	67.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9334	深信服	2022-1 0-14	193,20 0.00	2,000	14	3.20%	233.43	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9448	金力永磁	2022-1 0-14	34,61 0.00	1,000	14	3.20%	41.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9510	胜宏科技	2022-1 0-14	23,08 6.00	1,700	14	3.20%	27.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140000 9526	博腾股份	2022-1 0-14	52,35 0.00	1,000	14	3.20%	63.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 0278	国瓷材料	2022-1 0-14	114,61 5.00	4,500	14	3.20%	138.48	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 0314	中际旭创	2022-1 0-14	108,10 8.00	3,900	14	3.20%	130.61	-	-
国泰君安股份有	202210 140001 0316	博雅生物	2022-1 0-14	148,28 0.00	4,400	14	3.20%	179.16	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 0474	普利制药	2022-1 0-14	41,24 8.00	1,600	14	3.20%	49.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 0868	药石科技	2022-1 0-14	81,24 0.00	1,000	14	3.20%	98.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 0870	光威复材	2022-1 0-14	78,80 0.00	1,000	14	3.20%	95.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 1060	美畅股份	2022-1 0-14	653,24 8.00	11,800	14	3.20%	789.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 1294	蓝色光标	2022-1 0-14	10,74 1.00	2,300	14	3.20%	12.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2042	特锐德	2022-1 0-14	29,27 9.00	1,900	14	3.20%	35.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2180	扬杰科技	2022-1 0-14	369,67 2.00	7,300	14	3.20%	446.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2242	易华录	2022-1 0-14	14,89 4.00	1,100	14	3.20%	17.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2260	光线传媒	2022-1 0-14	29,27 4.00	4,100	14	3.20%	35.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2426	新易盛	2022-1 0-14	35,13 6.00	1,600	14	3.20%	42.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 140001 2646	华测检测	2022-1 0-14	21,56 0.00	1,000	14	3.20%	26.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 170000 1153	贝达药业	2022-1 0-17	658,68 8.00	12,800	14	3.20%	795.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1883	国瓷材料	2022-1 0-18	559,00 0.00	21,500	14	3.20%	675.38	-	-	
国泰君安证券	202210 180000	光线传媒	2022-1 0-18	292,63 2.00	41,100	14	3.20%	353.55	-	-	

股份有限公司	1885										
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1886	我武生物	2022-1 0-18	124,12 5.00	2,500	14	3.20%	149.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1887	易华录	2022-1 0-18	42,56 3.00	3,100	14	3.20%	51.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1891	长信科技	2022-1 0-18	21,62 4.00	3,400	14	3.20%	26.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1893	光环新网	2022-1 0-18	150,67 5.00	17,500	14	3.20%	182.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1895	寒锐钴业	2022-1 0-18	175,69 5.00	3,900	14	3.20%	212.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1901	昆仑万维	2022-1 0-18	352,98 9.00	27,300	14	3.20%	426.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1030	昆仑万维	2022-1 0-20	514,88 4.00	40,100	14	3.20%	622.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1042	国瓷材料	2022-1 0-20	1,138, 320.00	46,500	14	3.20%	1,375. 32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1080	寒锐钴业	2022-1 0-20	1,355, 115.00	30,500	14	3.20%	1,637. 25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1082	光线传媒	2022-1 0-20	613,54 8.00	87,400	14	3.20%	741.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1102	同花顺	2022-1 0-20	118,05 0.00	1,500	14	3.20%	142.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1110	特锐德	2022-1 0-20	840,56 4.00	54,300	14	3.20%	1,015. 57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 210000 1584	我武生物	2022-1 0-21	235,10 4.00	4,800	14	3.20%	284.05	-	-	
国泰君	202210	东岳硅	2022-1	1,206,	89,800	14	3.20%	1,457.	-	-	

安证券股份有限公司	240000 1141	材	0-24	014.00				11		
国泰君安证券股份有限公司	202210 240000 1149	康华生物	2022-1 0-24	638,67 7.00	7,300	14	3.20%	771.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240000 1159	华宝股份	2022-1 0-24	245,74 0.00	11,000	14	3.20%	296.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2007	宏达电子	2022-1 0-24	45,77 0.00	1,000	14	3.20%	55.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2009	我武生物	2022-1 0-24	246,58 5.00	5,100	14	3.20%	297.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2021	宋城演艺	2022-1 0-24	431,06 8.00	38,800	14	3.20%	520.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2037	易华录	2022-1 0-24	23,13 7.00	1,700	14	3.20%	27.95	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2039	赢合科技	2022-1 0-24	35,32 8.00	1,600	14	3.20%	42.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2043	安克创新	2022-1 0-24	139,20 0.00	2,500	14	3.20%	168.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2045	药石科技	2022-1 0-24	272,65 0.00	3,500	14	3.20%	329.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2049	长信科技	2022-1 0-24	8,073. 00	1,300	14	3.20%	9.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2053	易华录	2022-1 0-24	32,66 4.00	2,400	14	3.20%	39.47	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2067	药石科技	2022-1 0-24	942,59 0.00	12,100	14	3.20%	1,138. 84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2089	金力永磁	2022-1 0-24	32,39 0.00	1,000	14	3.20%	39.14	-	-

国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2107	天华超净	2022-1 0-24	724,46 0.00	11,000	14	3.20%	875.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2109	博雅生物	2022-1 0-24	61,00 9.00	1,900	14	3.20%	73.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2123	博雅生物	2022-1 0-24	32,11 0.00	1,000	14	3.20%	38.80	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2149	博雅生物	2022-1 0-24	51,37 6.00	1,600	14	3.20%	62.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2153	华大基因	2022-1 0-24	149,87 7.00	2,700	14	3.20%	181.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2161	金力永磁	2022-1 0-24	168,42 8.00	5,200	14	3.20%	203.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2585	光线传媒	2022-1 0-24	27,18 3.00	4,100	14	3.20%	32.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2589	光线传媒	2022-1 0-24	13,26 0.00	2,000	14	3.20%	16.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2617	易华录	2022-1 0-24	21,77 6.00	1,600	14	3.20%	26.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2619	德方纳米	2022-1 0-24	1,024, 812.00	3,600	14	3.20%	1,238. 17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2643	北京君正	2022-1 0-24	139,94 0.00	2,000	14	3.20%	169.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2675	华利集团	2022-1 0-24	177,20 2.00	4,100	14	3.20%	214.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2681	新易盛	2022-1 0-24	34,88 0.00	1,600	14	3.20%	42.15	-	-
国泰君安股份有	202210 240007 2727	博雅生物	2022-1 0-24	105,96 3.00	3,300	14	3.20%	128.03	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2733	宋城演艺	2022-1 0-24	488,84 0.00	44,000	14	3.20%	590.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2861	博腾股份	2022-1 0-24	192,25 3.00	4,300	14	3.20%	232.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2869	博腾股份	2022-1 0-24	44,71 0.00	1,000	14	3.20%	54.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 3977	赢合科技	2022-1 0-24	33,12 0.00	1,500	14	3.20%	40.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 3995	金力永磁	2022-1 0-24	343,33 4.00	10,600	14	3.20%	414.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4005	光环新网	2022-1 0-24	15,17 4.00	1,800	14	3.20%	18.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4023	博雅生物	2022-1 0-24	118,80 7.00	3,700	14	3.20%	143.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4045	天华超净	2022-1 0-24	151,47 8.00	2,300	14	3.20%	183.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4049	蓝思科技	2022-1 0-24	126,63 0.00	13,500	14	3.20%	152.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4059	华测检测	2022-1 0-24	148,35 6.00	7,800	14	3.20%	179.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4081	胜宏科技	2022-1 0-24	229,99 5.00	17,100	14	3.20%	277.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4089	光威复材	2022-1 0-24	1,160, 424.00	14,200	14	3.20%	1,402. 02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4099	赢合科技	2022-1 0-24	30,91 2.00	1,400	14	3.20%	37.35	-	-	
国泰君安证券	202210 240007	博雅生物	2022-1 0-24	38,53 2.00	1,200	14	3.20%	46.55	-	-	

股份有限公司	4121										
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4139	中际旭创	2022-1 0-24	708,91 4.00	25,400	14	3.20%	856.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 4149	万孚生物	2022-1 0-24	150,82 2.00	4,900	14	3.20%	182.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 5609	北京君正	2022-1 0-24	349,85 0.00	5,000	14	3.20%	422.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7339	宏达电子	2022-1 0-24	45,77 0.00	1,000	14	3.20%	55.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7363	华测检测	2022-1 0-24	173,08 2.00	9,100	14	3.20%	209.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7367	长信科技	2022-1 0-24	133,51 5.00	21,500	14	3.20%	161.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7375	新易盛	2022-1 0-24	207,10 0.00	9,500	14	3.20%	250.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7397	信维通信	2022-1 0-24	830,10 8.00	55,600	14	3.20%	1,002. 93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7401	新易盛	2022-1 0-24	298,66 0.00	13,700	14	3.20%	360.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7407	博雅生物	2022-1 0-24	122,01 8.00	3,800	14	3.20%	147.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7411	东方财富	2022-1 0-24	29,05 3.00	1,700	14	3.20%	35.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7413	宏达电子	2022-1 0-24	302,08 2.00	6,600	14	3.20%	364.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7419	药石科技	2022-1 0-24	155,80 0.00	2,000	14	3.20%	188.23	-	-	
国泰君安	202210	宏达电	2022-1	228,85	5,000	14	3.20%	276.49	-	-	

安证券股份有限公司	240007 7423	子	0-24	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7473	汤臣倍健	2022-1 0-24	21,94 4.00	1,300	14	3.20%	26.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7483	英科医疗	2022-1 0-24	21,24 0.00	1,000	14	3.20%	25.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7495	博雅生物	2022-1 0-24	32,11 0.00	1,000	14	3.20%	38.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 7511	康泰生物	2022-1 0-24	95,82 1.00	3,100	14	3.20%	115.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240008 9935	金力永磁	2022-1 0-24	1,282, 644.00	39,600	14	3.20%	1,549. 69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250000 1954	胜宏科技	2022-1 0-25	238,12 8.00	17,600	14	3.20%	287.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2386	光线传媒	2022-1 0-25	42,62 4.00	6,400	14	3.20%	51.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2422	光线传媒	2022-1 0-25	85,24 8.00	12,800	14	3.20%	103.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2450	新宙邦	2022-1 0-25	52,20 0.00	1,200	14	3.20%	63.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2490	国瓷材料	2022-1 0-25	58,60 4.00	2,600	14	3.20%	70.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2494	国瓷材料	2022-1 0-25	101,43 0.00	4,500	14	3.20%	122.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2496	博雅生物	2022-1 0-25	64,15 5.00	2,100	14	3.20%	77.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2498	博雅生物	2022-1 0-25	42,77 0.00	1,400	14	3.20%	51.67	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2500	利亚德	2022-1 0-25	21,91 8.00	3,900	14	3.20%	26.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2502	利亚德	2022-1 0-25	21,91 8.00	3,900	14	3.20%	26.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2504	利亚德	2022-1 0-25	12,36 4.00	2,200	14	3.20%	14.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2510	美畅股份	2022-1 0-25	168,32 0.00	3,200	14	3.20%	203.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2522	昆仑万维	2022-1 0-25	138,21 2.00	10,900	14	3.20%	166.99	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2548	宏达电子	2022-1 0-25	43,79 0.00	1,000	14	3.20%	52.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 2550	宏达电子	2022-1 0-25	43,79 0.00	1,000	14	3.20%	52.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6360	易华录	2022-1 0-25	116,76 8.00	8,900	14	3.20%	141.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6362	光线传媒	2022-1 0-25	9,990. 00	1,500	14	3.20%	12.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6366	光线传媒	2022-1 0-25	47,28 6.00	7,100	14	3.20%	57.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6382	天华超净	2022-1 0-25	159,00 0.00	2,400	14	3.20%	192.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6418	博雅生物	2022-1 0-25	238,29 0.00	7,800	14	3.20%	287.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6712	扬杰科技	2022-1 0-25	115,80 5.00	2,300	14	3.20%	139.91	-	-
国泰君安股份有	202210 250002 6714	扬杰科技	2022-1 0-25	115,80 5.00	2,300	14	3.20%	139.91	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6720	华大基因	2022-1 0-25	80,88 0.00	1,500	14	3.20%	97.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6724	英科医疗	2022-1 0-25	20,53 0.00	1,000	14	3.20%	24.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6736	安科生物	2022-1 0-25	380,80 0.00	40,000	14	3.20%	460.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6738	华测检测	2022-1 0-25	2,065, 919.00	110,30 0	14	3.20%	2,496. 04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6772	信维通信	2022-1 0-25	250,45 8.00	16,900	14	3.20%	302.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 7670	英科医疗	2022-1 0-25	20,53 0.00	1,000	14	3.20%	24.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 7684	华测检测	2022-1 0-25	2,232, 616.00	119,20 0	14	3.20%	2,697. 45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 8384	先导智能	2022-1 0-25	331,45 2.00	6,600	14	3.20%	400.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 8390	东方财富	2022-1 0-25	276,61 2.00	17,800	14	3.20%	334.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260000 1929	安克创新	2022-1 0-26	337,32 8.00	5,800	14	3.20%	407.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260000 1959	万孚生物	2022-1 0-26	145,79 4.00	4,700	14	3.20%	176.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260000 1961	胜宏科技	2022-1 0-26	20,94 0.00	1,500	14	3.20%	25.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260000 1963	健帆生物	2022-1 0-26	116,42 6.00	2,300	14	3.20%	140.67	-	-	
国泰君安证券	202210 260001	国瓷材料	2022-1 0-26	849,17 6.00	35,800	14	3.20%	1,025. 97	-	-	

股份有限公司	8060										
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 8068	国瓷材料	2022-1 0-26	377,14 8.00	15,900	14	3.20%	455.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 8966	安科生物	2022-1 0-26	73,00 8.00	7,200	14	3.20%	88.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9014	稳健医疗	2022-1 0-26	365,17 0.00	5,300	14	3.20%	441.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9396	万孚生物	2022-1 0-26	37,22 4.00	1,200	14	3.20%	44.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9782	贝达药业	2022-1 0-26	172,98 0.00	3,100	14	3.20%	208.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9790	贝达药业	2022-1 0-26	435,24 0.00	7,800	14	3.20%	525.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9796	利亚德	2022-1 0-26	177,63 0.00	31,000	14	3.20%	214.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9804	我武生物	2022-1 0-26	95,30 4.00	1,900	14	3.20%	115.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9832	信维通信	2022-1 0-26	194,69 1.00	12,700	14	3.20%	235.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9836	汤臣倍健	2022-1 0-26	226,12 5.00	12,500	14	3.20%	273.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9896	光线传媒	2022-1 0-26	414,99 2.00	59,200	14	3.20%	501.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9904	我武生物	2022-1 0-26	230,73 6.00	4,600	14	3.20%	278.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9922	普利制药	2022-1 0-26	102,33 6.00	3,900	14	3.20%	123.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210	新宙邦	2022-1	1,026,	23,400	14	3.20%	1,240.	-	-	

安证券股份有限公司	260002 0768		0-26	792.00				57		
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 0774	蓝色光标	2022-1 0-26	9,681. 00	2,100	14	3.20%	11.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 1318	金力永磁	2022-1 0-26	42,65 3.00	1,300	14	3.20%	51.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 2142	光环新网	2022-1 0-26	78,38 4.00	9,200	14	3.20%	94.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 2166	当升科技	2022-1 0-26	368,51 4.00	5,900	14	3.20%	445.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 2186	光线传媒	2022-1 0-26	117,06 7.00	16,700	14	3.20%	141.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 2188	光线传媒	2022-1 0-26	10,51 5.00	1,500	14	3.20%	12.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 260002 2196	宏达电子	2022-1 0-26	104,12 1.00	2,300	14	3.20%	125.80	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4739	光线传媒	2022-1 0-27	126,73 2.00	17,900	14	3.20%	153.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4743	我武生物	2022-1 0-27	371,93 5.00	7,300	14	3.20%	449.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4757	普利制药	2022-1 0-27	38,62 5.00	1,500	14	3.20%	46.67	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4801	同花顺	2022-1 0-27	192,94 0.00	2,200	14	3.20%	233.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4803	蓝色光标	2022-1 0-27	10,76 4.00	2,300	14	3.20%	13.01	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4823	国瓷材料	2022-1 0-27	1,458, 432.00	63,300	14	3.20%	1,762. 08	-	-

国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4825	利亚德	2022-1 0-27	223,67 5.00	38,900	14	3.20%	270.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4831	当升科技	2022-1 0-27	727,68 5.00	11,900	14	3.20%	879.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 4843	贝达药业	2022-1 0-27	609,87 8.00	12,200	14	3.20%	736.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 5465	迪安诊断	2022-1 0-27	597,81 6.00	20,700	14	3.20%	722.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 5479	长信科技	2022-1 0-27	18,44 4.00	2,900	14	3.20%	22.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 5485	胜宏科技	2022-1 0-27	16,92 0.00	1,200	14	3.20%	20.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 5509	万孚生物	2022-1 0-27	238,57 5.00	7,500	14	3.20%	288.24	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8271	卫宁健康	2022-1 0-27	9,810. 00	1,000	14	3.20%	11.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8379	贝达药业	2022-1 0-27	49,99 0.00	1,000	14	3.20%	60.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8477	景嘉微	2022-1 0-27	681,72 9.00	11,300	14	3.20%	823.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8553	昆仑万维	2022-1 0-27	1,043, 970.00	78,200	14	3.20%	1,261. 32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8825	立高食品	2022-1 0-27	148,82 7.00	1,900	14	3.20%	179.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1051	赢合科技	2022-1 0-28	23,89 2.00	1,200	14	3.20%	28.86	-	-
国泰君安股份有	202210 280001 1053	赢合科技	2022-1 0-28	43,80 2.00	2,200	14	3.20%	52.92	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1499	胜宏科技	2022-1 0-28	22,28 7.00	1,700	14	3.20%	26.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1615	金力永磁	2022-1 0-28	30,24 0.00	1,000	14	3.20%	36.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1913	特锐德	2022-1 0-28	27,72 1.00	1,900	14	3.20%	33.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1919	华测检测	2022-1 0-28	18,64 0.00	1,000	14	3.20%	22.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1939	扬杰科技	2022-1 0-28	360,03 6.00	7,300	14	3.20%	434.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 1959	新易盛	2022-1 0-28	39,13 6.00	1,600	14	3.20%	47.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 2001	美畅股份	2022-1 0-28	600,85 6.00	11,800	14	3.20%	725.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 2011	易华录	2022-1 0-28	15,04 8.00	1,100	14	3.20%	18.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 3173	蓝色光标	2022-1 0-28	10,18 9.00	2,300	14	3.20%	12.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 3245	药石科技	2022-1 0-28	87,49 0.00	1,000	14	3.20%	105.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 3247	光威复材	2022-1 0-28	76,30 0.00	1,000	14	3.20%	92.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 3269	光线传媒	2022-1 0-28	27,83 9.00	4,100	14	3.20%	33.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 4029	国瓷材料	2022-1 0-28	101,65 5.00	4,500	14	3.20%	122.82	-	-	
国泰君安证券	202210 280001	博雅生物	2022-1 0-28	133,71 6.00	4,400	14	3.20%	161.55	-	-	

股份有限公司	4033										
国泰君安证券股份有限公司	202210 280001 4051	普利制药	2022-1 0-28	39,39 2.00	1,600	14	3.20%	47.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 310000 6017	贝达药业	2022-1 0-31	585,08 8.00	12,800	14	3.20%	706.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7442	我武生物	2022-1 1-01	124,87 5.00	2,500	14	3.20%	150.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7444	长信科技	2022-1 1-01	21,72 6.00	3,400	14	3.20%	26.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7448	易华录	2022-1 1-01	57,31 9.00	3,100	14	3.20%	69.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7450	昆仑万维	2022-1 1-01	364,18 2.00	27,300	14	3.20%	440.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7454	寒锐钴业	2022-1 1-01	164,93 1.00	3,900	14	3.20%	199.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 8312	光线传媒	2022-1 1-01	300,44 1.00	41,100	14	3.20%	362.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 8314	光环新网	2022-1 1-01	154,17 5.00	17,500	14	3.20%	186.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 8316	国瓷材料	2022-1 1-01	520,30 0.00	21,500	14	3.20%	628.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5975	特锐德	2022-1 1-03	863,91 3.00	54,300	14	3.20%	1,043. 78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5979	光线传媒	2022-1 1-03	631,02 8.00	87,400	14	3.20%	762.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5985	国瓷材料	2022-1 1-03	1,181, 565.00	46,500	14	3.20%	1,427. 56	-	-	
国泰君安	202211	同花顺	2022-1	130,33	1,500	14	3.20%	157.47	-	-	

安证券股份有限公司	030000 5989		1-03	5.00							
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5991	昆仑万维	2022-1 1-03	534,93 4.00	40,100	14	3.20%	646.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5993	寒锐钴业	2022-1 1-03	1,307, 230.00	30,500	14	3.20%	1,579. 40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 040000 7237	我武生物	2022-1 1-04	253,44 0.00	4,800	14	3.20%	306.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070007 6423	金力永磁	2022-1 1-07	1,347, 588.00	39,600	14	3.20%	1,628. 16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070007 6513	宋城演艺	2022-1 1-07	526,51 6.00	38,800	14	3.20%	636.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070007 7543	我武生物	2022-1 1-07	264,18 0.00	5,100	14	3.20%	319.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070007 7551	安克创新	2022-1 1-07	148,55 0.00	2,500	14	3.20%	179.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070007 7647	宏达电子	2022-1 1-07	47,35 0.00	1,000	14	3.20%	57.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 2855	华宝股份	2022-1 1-07	266,53 0.00	11,000	14	3.20%	322.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 2933	英科医疗	2022-1 1-07	23,55 0.00	1,000	14	3.20%	28.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 2995	汤臣倍健	2022-1 1-07	23,76 4.00	1,300	14	3.20%	28.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 3123	光线传媒	2022-1 1-07	31,28 3.00	4,100	14	3.20%	37.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 3219	光线传媒	2022-1 1-07	15,26 0.00	2,000	14	3.20%	18.44	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 5011	博雅生物	2022-1 1-07	31,37 0.00	1,000	14	3.20%	37.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 9103	康泰生物	2022-1 1-07	110,48 4.00	3,100	14	3.20%	133.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070008 9161	东岳硅材	2022-1 1-07	1,222, 178.00	89,800	14	3.20%	1,476. 63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0357	蓝思科技	2022-1 1-07	139,05 0.00	13,500	14	3.20%	168.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0363	金力永磁	2022-1 1-07	360,71 8.00	10,600	14	3.20%	435.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0377	光威复材	2022-1 1-07	1,042, 280.00	14,200	14	3.20%	1,259. 28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0437	易华录	2022-1 1-07	27,32 8.00	1,600	14	3.20%	33.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0439	德方纳米	2022-1 1-07	1,134, 720.00	3,600	14	3.20%	1,370. 97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0473	北京君正	2022-1 1-07	144,90 0.00	2,000	14	3.20%	175.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0487	中际旭创	2022-1 1-07	764,28 6.00	25,400	14	3.20%	923.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 0491	赢合科技	2022-1 1-07	29,89 0.00	1,400	14	3.20%	36.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 2945	华测检测	2022-1 1-07	160,91 4.00	7,800	14	3.20%	194.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 2963	天华超净	2022-1 1-07	161,80 5.00	2,300	14	3.20%	195.49	-	-
国泰君安股份有	202211 070009 2965	长信科技	2022-1 1-07	8,606. 00	1,300	14	3.20%	10.40	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022110700092967	易华录	2022-11-07	40,992.00	2,400	14	3.20%	49.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700093005	博雅生物	2022-11-07	116,069.00	3,700	14	3.20%	140.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700093017	宏达电子	2022-11-07	47,350.00	1,000	14	3.20%	57.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700093029	北京君正	2022-11-07	362,250.00	5,000	14	3.20%	437.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700093057	金力永磁	2022-11-07	34,030.00	1,000	14	3.20%	41.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094057	华大基因	2022-11-07	158,058.00	2,700	14	3.20%	190.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094059	博雅生物	2022-11-07	50,192.00	1,600	14	3.20%	60.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094061	胜宏科技	2022-11-07	245,214.00	17,100	14	3.20%	296.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094069	博雅生物	2022-11-07	59,603.00	1,900	14	3.20%	72.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094087	赢合科技	2022-11-07	32,025.00	1,500	14	3.20%	38.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094113	药石科技	2022-11-07	1,123,606.00	12,100	14	3.20%	1,357.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094115	博腾股份	2022-11-07	202,014.00	4,300	14	3.20%	244.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094209	宋城演艺	2022-11-07	597,080.00	44,000	14	3.20%	721.39	-	-	
国泰君安证券	202211070009	药石科技	2022-11-07	325,010.00	3,500	14	3.20%	392.68	-	-	

股份有限公司	4215										
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094229	光环新网	2022-11-07	15,768.00	1,800	14	3.20%	19.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094247	华利集团	2022-11-07	191,101.00	4,100	14	3.20%	230.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700094253	博腾股份	2022-11-07	46,980.00	1,000	14	3.20%	56.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095771	博雅生物	2022-11-07	31,370.00	1,000	14	3.20%	37.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095839	新易盛	2022-11-07	43,680.00	1,600	14	3.20%	52.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095841	金力永磁	2022-11-07	176,956.00	5,200	14	3.20%	213.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095891	华测检测	2022-11-07	187,733.00	9,100	14	3.20%	226.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095899	易华录	2022-11-07	29,036.00	1,700	14	3.20%	35.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095901	赢合科技	2022-11-07	34,160.00	1,600	14	3.20%	41.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095907	博雅生物	2022-11-07	103,521.00	3,300	14	3.20%	125.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700095943	天华超净	2022-11-07	773,850.00	11,000	14	3.20%	934.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700097455	信维通信	2022-11-07	953,540.00	55,600	14	3.20%	1,152.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110700097525	宏达电子	2022-11-07	236,750.00	5,000	14	3.20%	286.04	-	-	
国泰君安	202211	药石科	2022-11	185,72	2,000	14	3.20%	224.39	-	-	

安证券股份有限公司	070009 7543	技	1-07	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 7577	康华生物	2022-1 1-07	776,20 9.00	7,300	14	3.20%	937.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 7825	博雅生物	2022-1 1-07	37,64 4.00	1,200	14	3.20%	45.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 8859	新易盛	2022-1 1-07	259,35 0.00	9,500	14	3.20%	313.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 8863	新易盛	2022-1 1-07	374,01 0.00	13,700	14	3.20%	451.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 8967	博雅生物	2022-1 1-07	119,20 6.00	3,800	14	3.20%	144.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 8969	万孚生物	2022-1 1-07	167,33 5.00	4,900	14	3.20%	202.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 9039	长信科技	2022-1 1-07	142,33 0.00	21,500	14	3.20%	171.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 9057	宏达电子	2022-1 1-07	312,51 0.00	6,600	14	3.20%	377.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 080002 1025	宏达电子	2022-1 1-08	46,93 0.00	1,000	14	3.20%	56.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 080002 1027	宏达电子	2022-1 1-08	46,93 0.00	1,000	14	3.20%	56.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 080002 1073	美畅股份	2022-1 1-08	186,04 8.00	3,200	14	3.20%	224.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 080002 1101	博雅生物	2022-1 1-08	43,49 8.00	1,400	14	3.20%	52.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 080002 1103	利亚德	2022-1 1-08	23,59 5.00	3,900	14	3.20%	28.50	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022110800021105	利亚德	2022-11-08	23,595.00	3,900	14	3.20%	28.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021107	利亚德	2022-11-08	13,310.00	2,200	14	3.20%	16.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021117	华大基因	2022-11-08	86,985.00	1,500	14	3.20%	105.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021133	华测检测	2022-11-08	2,273,283.00	110,300	14	3.20%	2,746.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021165	昆仑万维	2022-11-08	149,003.00	10,900	14	3.20%	180.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021179	新宙邦	2022-11-08	49,440.00	1,200	14	3.20%	59.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800021675	东方财富	2022-11-08	305,804.00	17,800	14	3.20%	369.48	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024543	天华超净	2022-11-08	168,480.00	2,400	14	3.20%	203.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024561	国瓷材料	2022-11-08	70,642.00	2,600	14	3.20%	85.35	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024569	博雅生物	2022-11-08	65,247.00	2,100	14	3.20%	78.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024571	博雅生物	2022-11-08	242,346.00	7,800	14	3.20%	292.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024589	国瓷材料	2022-11-08	122,265.00	4,500	14	3.20%	147.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022110800024611	英科医疗	2022-11-08	23,330.00	1,000	14	3.20%	28.18	-	-
国泰君安股份有	2022110800027669	信维通信	2022-11-08	288,483.00	16,900	14	3.20%	348.54	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022110800027731	安科生物	2022-11-08	412,000.00	40,000	14	3.20%	497.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110800027733	华测检测	2022-11-08	2,456,712.00	119,200	14	3.20%	2,968.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110800027827	先导智能	2022-11-08	349,800.00	6,600	14	3.20%	422.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110800027833	英科医疗	2022-11-08	23,330.00	1,000	14	3.20%	28.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110800029001	胜宏科技	2022-11-08	249,040.00	17,600	14	3.20%	300.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110800030619	易华录	2022-11-08	156,551.00	8,900	14	3.20%	189.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900016445	宏达电子	2022-11-09	107,571.00	2,300	14	3.20%	129.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900018321	当升科技	2022-11-09	378,603.00	5,900	14	3.20%	457.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900018705	我武生物	2022-11-09	97,869.00	1,900	14	3.20%	118.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900019409	安科生物	2022-11-09	77,328.00	7,200	14	3.20%	93.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900019437	我武生物	2022-11-09	236,946.00	4,600	14	3.20%	286.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900019439	贝达药业	2022-11-09	152,861.00	3,100	14	3.20%	184.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022110900019441	贝达药业	2022-11-09	384,618.00	7,800	14	3.20%	464.70	-	-	
国泰君安证券	202211090001	金力永磁	2022-11-09	43,615.00	1,300	14	3.20%	52.70	-	-	

股份有限公司	9455										
国泰君安证券股份有限公司	202211 090001 9493	稳健医疗	2022-1 1-09	360,93 0.00	5,300	14	3.20%	436.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3665	光环新网	2022-1 1-09	80,68 4.00	9,200	14	3.20%	97.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3669	信维通信	2022-1 1-09	213,23 3.00	12,700	14	3.20%	257.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3671	国瓷材料	2022-1 1-09	947,62 6.00	35,800	14	3.20%	1,144. 92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3673	国瓷材料	2022-1 1-09	420,87 3.00	15,900	14	3.20%	508.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3783	万孚生物	2022-1 1-09	162,94 9.00	4,700	14	3.20%	196.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3795	普利制药	2022-1 1-09	116,33 7.00	3,900	14	3.20%	140.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3801	利亚德	2022-1 1-09	185,07 0.00	31,000	14	3.20%	223.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3815	汤臣倍健	2022-1 1-09	224,75 0.00	12,500	14	3.20%	271.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090002 3887	万孚生物	2022-1 1-09	41,60 4.00	1,200	14	3.20%	50.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 5522	我武生物	2022-1 1-10	370,47 5.00	7,300	14	3.20%	447.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 6364	贝达药业	2022-1 1-10	614,63 6.00	12,200	14	3.20%	742.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 6386	迪安诊断	2022-1 1-10	589,95 0.00	20,700	14	3.20%	712.78	-	-	
国泰君安	202211	当升科	2022-1	736,61	11,900	14	3.20%	889.97	-	-	

安证券股份有限公司	100001 6400	技	1-10	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 7180	长信科技	2022-1 1-10	18,93 7.00	2,900	14	3.20%	22.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 7206	贝达药业	2022-1 1-10	50,38 0.00	1,000	14	3.20%	60.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 8654	立高食品	2022-1 1-10	168,34 0.00	1,900	14	3.20%	203.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9066	同花顺	2022-1 1-10	198,22 0.00	2,200	14	3.20%	239.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9854	万孚生物	2022-1 1-10	282,45 0.00	7,500	14	3.20%	341.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9968	卫宁健康	2022-1 1-10	9,530. 00	1,000	14	3.20%	11.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9990	国瓷材料	2022-1 1-10	1,679, 349.00	63,300	14	3.20%	2,028. 99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9992	利亚德	2022-1 1-10	233,78 9.00	38,900	14	3.20%	282.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100002 0184	胜宏科技	2022-1 1-10	16,71 6.00	1,200	14	3.20%	20.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100002 0342	光线传媒	2022-1 1-10	136,21 9.00	17,900	14	3.20%	164.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2031	博雅生物	2022-1 1-11	134,46 4.00	4,400	14	3.20%	162.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2245	金力永磁	2022-1 1-11	32,84 0.00	1,000	14	3.20%	39.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2303	光威复材	2022-1 1-11	72,68 0.00	1,000	14	3.20%	87.82	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2307	易华录	2022-1 1-11	18,27 1.00	1,100	14	3.20%	22.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2321	国瓷材料	2022-1 1-11	126,00 0.00	4,500	14	3.20%	152.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2325	特锐德	2022-1 1-11	30,07 7.00	1,900	14	3.20%	36.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2329	新易盛	2022-1 1-11	42,12 8.00	1,600	14	3.20%	50.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 2629	药石科技	2022-1 1-11	89,39 0.00	1,000	14	3.20%	108.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 5449	光线传媒	2022-1 1-11	31,61 1.00	4,100	14	3.20%	38.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 5611	胜宏科技	2022-1 1-11	24,08 9.00	1,700	14	3.20%	29.11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 5679	美畅股份	2022-1 1-11	650,29 8.00	11,800	14	3.20%	785.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 5693	华测检测	2022-1 1-11	21,27 0.00	1,000	14	3.20%	25.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 110001 5695	扬杰科技	2022-1 1-11	402,74 1.00	7,300	14	3.20%	486.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 140000 9389	贝达药业	2022-1 1-14	644,86 4.00	12,800	14	3.20%	779.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 8708	我武生物	2022-1 1-15	127,47 5.00	2,500	14	3.20%	154.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 8710	国瓷材料	2022-1 1-15	651,45 0.00	21,500	14	3.20%	787.08	-	-
国泰君安股份有	202211 150000 9232	光环新网	2022-1 1-15	161,00 0.00	17,500	14	3.20%	194.52	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 9236	长信科技	2022-1 1-15	22,67 8.00	3,400	14	3.20%	27.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 9240	易华录	2022-1 1-15	53,75 4.00	3,100	14	3.20%	64.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2112	东岳硅材	2022-1 2-20	127,96 7.00	10,100	14	3.20%	121.53	117,96 8.00	125.18	
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2132	锦浪科技	2022-1 2-20	635,36 0.00	3,800	14	3.20%	603.18	684,19 0.00	621.28	
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2178	博雅生物	2022-1 2-20	81,60 0.00	2,400	14	3.20%	77.43	87,74 4.00	79.75	
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2196	蓝思科技	2022-1 2-20	625,95 0.00	58,500	14	3.20%	594.21	616,00 5.00	612.04	
国泰君安证券股份有限公司	202212 210000 2499	宏达电子	2022-1 2-21	161,61 6.00	3,900	14	3.20%	139.51	172,14 6.00	143.70	
国泰君安证券股份有限公司	202212 230000 0547	贝达药业	2022-1 2-23	58,18 8.00	1,200	14	3.20%	40.16	59,12 4.00	41.36	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 1965	华测检测	2022-1 2-27	311,36 0.00	13,900	14	3.20%	107.49	309,97 0.00	110.72	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 2013	天华超净	2022-1 2-27	151,89 2.00	2,600	14	3.20%	52.43	145,28 8.00	54.00	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 2019	安克创新	2022-1 2-27	78,13 0.00	1,300	14	3.20%	26.99	77,05 1.00	27.80	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 2021	新强联	2022-1 2-27	127,21 3.00	2,300	14	3.20%	43.92	122,54 4.00	45.24	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 2023	锐科激光	2022-1 2-27	46,60 7.00	1,900	14	3.20%	16.08	44,93 5.00	16.56	
国泰君安证券	202212 270000	朗新科技	2022-1 2-27	41,22 0.00	1,800	14	3.20%	14.21	39,56 4.00	14.64	

股份有限公司	2025									
上年度可比期间										
2021 年 01 月 01 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(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2021032200000276	国瓷材料	2021-03-22	992,200.00	24,200	14	3.40%	1,364.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040100000252	拉卡拉	2021-04-01	208,040.00	7,000	14	3.40%	267.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040100000264	阳光电源	2021-04-01	217,350.00	3,000	14	3.40%	279.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040100000274	信维通信	2021-04-01	504,064.00	17,900	14	3.40%	647.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040600000313	我武生物	2021-04-06	279,092.00	4,400	14	3.40%	358.27	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040600000315	阳光电源	2021-04-06	1,118,400.00	15,000	14	3.40%	1,435.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040600000329	亿纬锂能	2021-04-06	692,912.00	8,800	14	3.40%	889.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040800000272	汇川技术	2021-04-08	731,916.00	8,100	14	3.40%	939.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021040900000283	爱尔眼科	2021-04-09	968,540.00	15,800	14	3.40%	1,243.33	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021041200000442	光环新网	2021-04-12	16,860.00	1,000	14	3.40%	21.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021042000000669	我武生物	2021-04-20	522,743.00	7,900	14	3.40%	766.91	-	-
国泰君安	202104	金龙鱼	2021-0	1,041,	14,000	14	3.40%	1,528.	-	-

安证券股份有限公司	200000 0681		4-20	880.00				54		
国泰君安证券股份有限公司	202104 230000 0414	昆仑万维	2021-0 4-23	119,23 9.00	5,900	14	3.40%	153.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202104 230000 0424	乐普医疗	2021-0 4-23	266,15 6.00	9,200	14	3.40%	341.67	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202104 230000 0426	利亚德	2021-0 4-23	59,90 4.00	7,800	14	3.40%	76.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202104 230000 0428	机器人	2021-0 4-23	43,86 0.00	4,300	14	3.40%	56.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202104 280000 0639	阳光电源	2021-0 4-28	2,532, 000.00	30,000	14	3.40%	3,250. 36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 060002 4884	我武生物	2021-0 5-06	558,60 9.00	7,900	14	3.40%	717.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0381	昆仑万维	2021-0 5-07	82,71 0.00	4,500	14	3.40%	106.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0383	利亚德	2021-0 5-07	54,41 6.00	7,600	14	3.40%	69.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0387	掌趣科技	2021-0 5-07	38,82 4.00	9,200	14	3.40%	49.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0405	拉卡拉	2021-0 5-07	100,74 0.00	3,000	14	3.40%	129.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0419	机器人	2021-0 5-07	271,70 0.00	28,600	14	3.40%	348.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0421	红日药业	2021-0 5-07	340,31 9.00	79,700	14	3.40%	436.87	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0431	特锐德	2021-0 5-07	91,20 0.00	3,800	14	3.40%	117.08	-	-

国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0441	易华录	2021-0 5-07	94,00 0.00	4,000	14	3.40%	120.67	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0453	碧水源	2021-0 5-07	505,48 5.00	71,700	14	3.40%	648.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 070000 0457	长信科技	2021-0 5-07	118,11 0.00	15,500	14	3.40%	151.62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202105 140000 0369	沃森生物	2021-0 5-14	566,06 0.00	8,300	14	3.40%	726.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 170000 1532	万孚生物	2021-0 6-17	865,49 4.00	12,600	14	3.40%	1,111. 05	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 210000 1309	亿联网络	2021-0 6-21	965,00 0.00	12,500	14	3.40%	1,238. 78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 210000 1334	长盈精密	2021-0 6-21	750,04 8.00	41,600	14	3.40%	962.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 210000 1341	汤臣倍健	2021-0 6-21	47,37 2.00	1,300	14	3.40%	60.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 210000 1345	乐普医疗	2021-0 6-21	641,68 0.00	20,800	14	3.40%	823.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 250000 0978	爱尔眼科	2021-0 6-25	675,80 0.00	10,000	14	3.40%	867.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202106 280000 0638	康泰生物	2021-0 6-28	380,75 0.00	2,500	14	3.40%	488.78	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 050000 0977	迈克生物	2021-0 7-05	40,90 0.00	1,000	14	3.40%	52.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 050000 0983	易华录	2021-0 7-05	60,19 2.00	2,400	14	3.40%	77.27	-	-
国泰君安股份有	202107 120000 0796	乐普医疗	2021-0 7-12	475,91 6.00	16,100	14	3.40%	610.94	-	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	202107 150000 0600	亿纬锂能	2021-0 7-15	1,397, 000.00	11,000	14	3.40%	1,793. 34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160000 0604	宋城演艺	2021-0 7-16	431,50 3.00	25,700	14	3.40%	553.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 190001 1171	迈克生物	2021-0 7-19	37,06 0.00	1,000	14	3.40%	47.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300000 0772	温氏股份	2021-0 7-30	686,86 8.00	54,600	14	3.40%	881.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300000 0784	卓胜微	2021-0 7-30	403,15 0.00	1,000	14	3.40%	517.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300000 0794	汇川技术	2021-0 7-30	163,50 6.00	2,100	14	3.40%	209.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300000 0798	乐普医疗	2021-0 7-30	440,83 8.00	17,100	14	3.40%	565.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 060000 0554	宁德时代	2021-0 8-06	543,88 0.00	1,000	14	3.40%	698.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 060000 0558	亿纬锂能	2021-0 8-06	472,56 3.00	3,900	14	3.40%	606.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 060000 0562	迈克生物	2021-0 8-06	450,45 0.00	13,000	14	3.40%	578.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 060000 0570	东方财富	2021-0 8-06	309,54 2.00	9,400	14	3.40%	397.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 090000 0315	迈克生物	2021-0 8-09	288,67 4.00	8,300	14	3.40%	370.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 090000 0318	宁德时代	2021-0 8-09	516,00 0.00	1,000	14	3.40%	662.40	-	-
国泰君安证券	202108 090000	亿纬锂能	2021-0 8-09	604,20 0.00	5,300	14	3.40%	775.62	-	-

股份有限公司	0325										
国泰君安证券股份有限公司	202108 100000 0377	宁德时代	2021-0 8-10	510,50 0.00	1,000	14	3.40%	655.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 120000 0364	康龙化成	2021-0 8-12	207,12 0.00	1,000	14	3.40%	265.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3848	乐普医疗	2021-0 8-13	449,38 8.00	17,100	14	3.40%	576.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3854	汇川技术	2021-0 8-13	155,44 2.00	2,100	14	3.40%	199.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3856	卓胜微	2021-0 8-13	413,09 0.00	1,000	14	3.40%	530.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 160000 0512	信维通信	2021-0 8-16	1,041, 057.00	39,300	14	3.40%	1,336. 42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 180000 1214	先导智能	2021-0 8-18	73,08 0.00	1,000	14	3.40%	93.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 180000 1258	康泰生物	2021-0 8-18	244,71 0.00	1,800	14	3.40%	314.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 180000 1312	汇川技术	2021-0 8-18	352,92 0.00	5,100	14	3.40%	453.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 180000 1318	信维通信	2021-0 8-18	249,60 6.00	9,800	14	3.40%	320.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 180000 1324	宋城演艺	2021-0 8-18	392,16 0.00	28,500	14	3.40%	503.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 200000 0826	康龙化成	2021-0 8-20	177,90 0.00	1,000	14	3.40%	228.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 230000 0808	光威复材	2021-0 8-23	110,89 0.00	1,300	14	3.40%	142.35	-	-	
国泰君安	202108	信维通	2021-0	171,56	6,800	14	3.40%	220.24	-	-	

安证券股份有限公司	230000 0834	信	8-23	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	202108 230000 0850	同花顺	2021-0 8-23	133,27 2.00	1,200	14	3.40%	171.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 230000 0856	先导智能	2021-0 8-23	74,72 0.00	1,000	14	3.40%	95.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 230000 0864	昆仑万维	2021-0 8-23	561,61 0.00	35,500	14	3.40%	720.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 230000 0871	蓝思科技	2021-0 8-23	647,44 6.00	25,400	14	3.40%	831.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 250000 0827	昆仑万维	2021-0 8-25	117,50 4.00	7,200	14	3.40%	150.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 260001 5003	康龙化成	2021-0 8-26	187,28 0.00	1,000	14	3.40%	240.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270000 0997	华测检测	2021-0 8-27	214,48 5.00	7,900	14	3.40%	275.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270000 1015	蓝思科技	2021-0 8-27	176,80 6.00	7,300	14	3.40%	226.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3093	卓胜微	2021-0 8-27	403,53 0.00	1,000	14	3.40%	518.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3095	汇川技术	2021-0 8-27	157,71 0.00	2,100	14	3.40%	202.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3101	乐普医疗	2021-0 8-27	427,84 2.00	17,100	14	3.40%	549.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 010001 7769	康泰生物	2021-0 9-01	213,31 8.00	1,800	14	3.40%	273.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 010001 7771	宋城演艺	2021-0 9-01	447,45 0.00	28,500	14	3.40%	574.40	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2021090100017777	汇川技术	2021-09-01	360,060.00	5,100	14	3.40%	462.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090600000795	药石科技	2021-09-06	1,127,646.00	6,100	14	3.40%	1,654.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090900000495	沃森生物	2021-09-09	423,795.00	5,700	14	3.40%	544.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090900000499	国瓷材料	2021-09-09	1,008,168.00	23,800	14	3.40%	1,294.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090900000501	亿联网络	2021-09-09	138,550.00	1,700	14	3.40%	177.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090900000529	汇川技术	2021-09-09	512,314.00	7,300	14	3.40%	657.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021090900015619	康龙化成	2021-09-09	191,980.00	1,000	14	3.40%	246.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000000640	欧普康视	2021-09-10	561,792.00	8,400	14	3.40%	721.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000013763	华测检测	2021-09-10	194,972.00	7,900	14	3.40%	250.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000016851	卓胜微	2021-09-10	362,810.00	1,000	14	3.40%	465.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000016853	蓝思科技	2021-09-10	181,113.00	7,300	14	3.40%	232.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000016857	汇川技术	2021-09-10	147,168.00	2,100	14	3.40%	188.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2021091000016863	乐普医疗	2021-09-10	450,927.00	17,100	14	3.40%	578.86	-	-
国泰君安股份有	2021091400000788	东方财富	2021-09-14	77,880.00	2,200	14	3.40%	99.97	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202109 150000 0947	碧水源	2021-0 9-15	83,84 2.00	10,300	14	3.40%	107.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 150000 0954	东方财富	2021-0 9-15	77,68 2.00	2,200	14	3.40%	99.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 150001 9558	康泰生物	2021-0 9-15	191,70 0.00	1,800	14	3.40%	246.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 150001 9560	宋城演艺	2021-0 9-15	416,10 0.00	28,500	14	3.40%	534.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 150001 9562	汇川技术	2021-0 9-15	333,48 9.00	5,100	14	3.40%	428.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 160000 0858	东方财富	2021-0 9-16	64,75 2.00	1,900	14	3.40%	83.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 220003 1227	药石科技	2021-0 9-22	1,215, 364.00	6,100	14	3.40%	1,783. 06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 230000 0958	寒锐钴业	2021-0 9-23	83,30 0.00	1,000	14	3.40%	114.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 230001 5147	康龙化成	2021-0 9-23	212,83 0.00	1,000	14	3.40%	292.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 230001 5149	汇川技术	2021-0 9-23	477,42 0.00	7,300	14	3.40%	656.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1491	卓胜微	2021-0 9-24	350,88 0.00	1,000	14	3.40%	450.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1493	汇川技术	2021-0 9-24	136,87 8.00	2,100	14	3.40%	175.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1499	乐普医疗	2021-0 9-24	459,64 8.00	17,100	14	3.40%	590.06	-	-	
国泰君安证券	202109 290001	汇川技术	2021-0 9-29	320,33 1.00	5,100	14	3.40%	411.21	-	-	

股份有限公司	9207										
国泰君安证券股份有限公司	2021092900019213	东方财富	2021-09-29	74,096.00	2,200	14	3.40%	95.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021093000011005	东方财富	2021-09-30	65,303.00	1,900	14	3.40%	83.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021100800000711	红日药业	2021-10-08	576,403.00	131,900	14	3.40%	739.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021100800000717	沃森生物	2021-10-08	435,518.00	7,300	14	3.40%	559.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021100800000731	英科医疗	2021-10-08	212,084.00	3,700	14	3.40%	272.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101100001854	英科医疗	2021-10-11	480,640.00	8,000	14	3.40%	617.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101100001950	沃森生物	2021-10-11	434,475.00	7,500	14	3.40%	557.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101100001965	红日药业	2021-10-11	848,456.00	194,600	14	3.40%	1,089.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101400000885	卓胜微	2021-10-14	335,830.00	1,100	14	3.40%	431.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101400000911	欣旺达	2021-10-14	419,685.00	10,500	14	3.40%	538.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101400000915	汤臣倍健	2021-10-14	158,723.00	6,700	14	3.40%	203.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101400000927	圣邦股份	2021-10-14	488,535.00	1,500	14	3.40%	627.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021101400000932	普利制药	2021-10-14	339,593.00	7,100	14	3.40%	435.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110	三环集	2021-1	204,26	5,300	14	3.40%	262.21	-	-	

安证券股份有限公司	140000 0937	团	0-14	2.00							
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0609	欣旺达	2021-1 0-15	480,24 0.00	11,500	14	3.40%	616.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0611	芒果超媒	2021-1 0-15	364,22 8.00	9,200	14	3.40%	467.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0614	爱尔眼科	2021-1 0-15	202,61 6.00	4,300	14	3.40%	260.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0617	长信科技	2021-1 0-15	179,74 0.00	21,500	14	3.40%	230.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0621	圣邦股份	2021-1 0-15	514,77 0.00	1,500	14	3.40%	660.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0627	健帆生物	2021-1 0-15	191,41 5.00	3,500	14	3.40%	245.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0629	景嘉微	2021-1 0-15	208,71 0.00	1,800	14	3.40%	267.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0630	温氏股份	2021-1 0-15	31,87 8.00	2,200	14	3.40%	40.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0633	华测检测	2021-1 0-15	142,29 0.00	5,100	14	3.40%	182.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0635	亿纬锂能	2021-1 0-15	302,82 0.00	2,800	14	3.40%	388.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 150000 0639	卓胜微	2021-1 0-15	405,92 5.00	1,300	14	3.40%	521.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0784	国瓷材料	2021-1 0-18	43,73 0.00	1,000	14	3.40%	56.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0785	掌趣科技	2021-1 0-18	52,64 0.00	14,000	14	3.40%	67.57	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0788	易华录	2021-1 0-18	29,74 0.00	1,000	14	3.40%	38.17	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0794	沃森生物	2021-1 0-18	57,63 0.00	1,000	14	3.40%	73.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0796	芒果超媒	2021-1 0-18	38,39 0.00	1,000	14	3.40%	49.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0804	康泰生物	2021-1 0-18	105,03 0.00	1,000	14	3.40%	134.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0809	网宿科技	2021-1 0-18	28,51 8.00	4,900	14	3.40%	36.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0811	光威复材	2021-1 0-18	63,15 0.00	1,000	14	3.40%	81.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0814	特锐德	2021-1 0-18	63,69 6.00	2,400	14	3.40%	81.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 180000 0816	爱尔眼科	2021-1 0-18	222,16 9.00	4,700	14	3.40%	285.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 210000 0722	东方财富	2021-1 0-21	36,92 7.00	1,100	14	3.40%	47.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 210000 0731	汇川技术	2021-1 0-21	147,02 4.00	2,400	14	3.40%	188.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 210000 0752	宁德时代	2021-1 0-21	596,00 0.00	1,000	14	3.40%	765.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 210000 0758	迈瑞医疗	2021-1 0-21	364,05 0.00	1,000	14	3.40%	467.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 250000 0838	温氏股份	2021-1 0-25	485,40 8.00	30,800	14	3.40%	623.13	-	-
国泰君安股份有	202110 250000 0864	东方财富	2021-1 0-25	247,76 2.00	7,300	14	3.40%	318.06	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1073	泰格医药	2021-1 0-28	417,30 0.00	2,600	14	3.40%	535.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1077	迈瑞医疗	2021-1 0-28	362,74 0.00	1,000	14	3.40%	465.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1079	英科医疗	2021-1 0-28	51,22 0.00	1,000	14	3.40%	65.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1082	卓胜微	2021-1 0-28	308,31 0.00	1,000	14	3.40%	395.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1093	宁德时代	2021-1 0-28	607,20 0.00	1,000	14	3.40%	779.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1095	金力永磁	2021-1 0-28	232,86 0.00	6,000	14	3.40%	298.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280000 1116	长信科技	2021-1 0-28	63,88 2.00	6,300	14	3.40%	82.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 280001 4361	欣旺达	2021-1 0-28	515,55 0.00	10,500	14	3.40%	661.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 040000 0607	寒锐钴业	2021-1 1-04	76,87 0.00	1,000	14	3.40%	98.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 040000 0610	健帆生物	2021-1 1-04	218,44 2.00	4,200	14	3.40%	280.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 040000 0620	泰格医药	2021-1 1-04	146,51 0.00	1,000	14	3.40%	188.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 040000 0626	宋城演艺	2021-1 1-04	404,12 5.00	30,500	14	3.40%	518.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 040000 3441	迈瑞医疗	2021-1 1-04	388,00 0.00	1,000	14	3.40%	498.08	-	-	
国泰君安证券	202111 040000	宁德时代	2021-1 1-04	646,85 0.00	1,000	14	3.40%	830.37	-	-	

股份有限公司	3445										
国泰君安证券股份有限公司	2021110400003447	汇川技术	2021-11-04	163,512.00	2,400	14	3.40%	209.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021110400003489	东方财富	2021-11-04	35,827.00	1,100	14	3.40%	45.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021110800016202	东方财富	2021-11-08	243,236.00	7,300	14	3.40%	312.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021110800017152	温氏股份	2021-11-08	516,824.00	30,800	14	3.40%	663.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021110900000859	信维通信	2021-11-09	295,834.00	11,900	14	3.40%	379.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111000000994	宋城演艺	2021-11-10	606,320.00	42,400	14	3.40%	778.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111100011032	泰格医药	2021-11-11	375,674.00	2,600	14	3.40%	482.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111100014572	迈瑞医疗	2021-11-11	371,240.00	1,000	14	3.40%	476.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111200000606	中科创达	2021-11-12	444,850.00	3,100	14	3.40%	571.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111200000632	康龙化成	2021-11-12	187,280.00	1,000	14	3.40%	240.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111200000666	东方财富	2021-11-12	81,489.00	2,300	14	3.40%	104.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021111200000668	网宿科技	2021-11-12	31,000.00	5,000	14	3.40%	39.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2021121400001684	网宿科技	2021-12-14	243,455.00	36,500	14	3.40%	312.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112	寒锐钴	2021-1	92,00	1,000	14	3.40%	118.10	-	-	

安证券股份有限公司	140000 1690	业	2-14	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1724	光威复材	2021-1 2-14	84,58 0.00	1,000	14	3.40%	108.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1734	欣旺达	2021-1 2-14	114,37 5.00	2,500	14	3.40%	146.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1746	卫宁健康	2021-1 2-14	43,00 7.00	2,900	14	3.40%	55.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1754	蓝思科技	2021-1 2-14	24,68 0.00	1,000	14	3.40%	31.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1756	景嘉微	2021-1 2-14	163,75 0.00	1,000	14	3.40%	210.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1790	安克创新	2021-1 2-14	165,58 5.00	1,500	14	3.40%	212.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1798	金龙鱼	2021-1 2-14	141,57 0.00	2,200	14	3.40%	181.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 150000 2287	同花顺	2021-1 2-15	395,90 8.00	2,900	14	3.40%	508.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 150000 2293	欣旺达	2021-1 2-15	124,17 3.00	2,700	14	3.40%	159.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 150000 2311	迈瑞医疗	2021-1 2-15	359,00 0.00	1,000	14	3.40%	460.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 150000 2321	寒锐钴业	2021-1 2-15	90,45 0.00	1,000	14	3.40%	116.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 150000 2326	光威复材	2021-1 2-15	85,00 0.00	1,000	14	3.40%	109.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 280000 1348	健帆生物	2021-1 2-28	367,08 0.00	6,900	14	3.40%	100.98	367,77 0.00	104.01	

国泰君安证券股份有限公司	2021122800001406	金龙鱼	2021-12-28	191,400.00	3,000	14	3.40%	52.66	188,790.00	54.24
国泰君安证券股份有限公司	2021122900000908	景嘉微	2021-12-29	745,584.00	4,800	14	3.40%	136.74	730,560.00	140.84

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

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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
天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,059,529,274.00	95.00%	1,007,412,274.00	92.68%
国泰君安证券股份有限公司	7,968.00	0.00%	7,968.00	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年01月01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

国泰君安 证券股份 有限公司	6,979,118.39	97,948.64	9,323,034.71	195,138.85
----------------------	--------------	-----------	--------------	------------

注：本基金由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，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01月01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：张/股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	301217	铜冠铜箔	网下申购	42,831	739,691.37
国泰君安 证券股份 有限公司	301258	富士莱	网下申购	2,942	142,098.60
国泰君安 证券股份 有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813	135,783.09
国泰君安 证券股份 有限公司	301097	天益医疗	网下申购	2,486	130,191.82
国泰君安 证券股份 有限公司	301268	铭利达	网下申购	6,407	182,599.50
国泰君安 证券股份 有限公司	301279	金道科技	网下申购	2,956	92,227.20
国泰君安 证券股份	301283	聚胶股份	网下申购	2,344	123,505.36

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	301309	万得凯	网下申购	2,271	88,569.00
国泰君安 证券股份 有限公司	001238	浙江正特	网下申购	374	6,002.70
国泰君安 证券股份 有限公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920	75,569.60
国泰君安 证券股份 有限公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368	75,207.44
上年度可比期间 2021年01月01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：张 /股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	301009	可靠股份	网下申购	8,007	100,407.78
国泰君安 证券股份 有限公司	301037	保立佳	网下申购	1,923	28,498.86
国泰君安 证券股份 有限公司	301211	亨迪药业	网下申购	9,664	249,331.20

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

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
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	创业板打新限售	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301267	华夏眼科	2022-10-26	6个月	创业板打新限售	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301095	广立微	2022-07-28	6个月	创业板打新限售	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301327	华宝新能	2022-09-08	6个月	创业板打新限售	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	-
301239	普瑞眼科	2022-06-22	6个月	创业板打新限售	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301367	怡和嘉业	2022-10-21	6个月	创业板打新限售	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	-
301175	中科环保	2022-06-30	6个月	创业板打	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-

				新限售						
301165	锐捷网络	2022-11-14	6个月	创业板打新限售	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301301	C川宁	2022-12-20	6个月	创业板打新限售	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22	-
301152	天力锂能	2022-08-19	6个月	创业板打新限售	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-
301391	卡莱特	2022-11-24	6个月	创业板打新限售	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月	创业板打新限售	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	-
301171	易点天下	2022-08-10	6个月	创业板打新限售	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301296	新巨丰	2022-08-26	6个月	创业板打新限售	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月	创业板打新限售	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-

301139	元道通信	2022-06-30	6个月	创业板打新限售	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301339	通行宝	2022-09-02	6个月	创业板打新限售	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月	创业板打新限售	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301230	泓博医药	2022-10-21	6个月	创业板打新限售	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301396	宏景科技	2022-11-04	6个月	创业板打新限售	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40	-
301338	凯格精机	2022-08-08	6个月	创业板打新限售	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301366	一博科技	2022-09-19	6个月	创业板打新限售	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月	创业板打新限售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6个月	创业板打	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-

				新限售						
301132	满坤科技	2022-08-03	6个月	创业板打新限售	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月	创业板打新限售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301282	金禄电子	2022-08-18	6个月	创业板打新限售	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50	-
301361	众智科技	2022-11-08	6个月	创业板打新限售	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301265	华新环保	2022-12-08	6个月	创业板打新限售	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301176	逸豪新材	2022-09-21	6个月	创业板打新限售	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301227	森鹰窗业	2022-09-16	6个月	创业板打新限售	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301326	捷邦科技	2022-09-09	6个月	创业板打新限售	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74	-

301197	工大科雅	2022-07-29	6个月	创业板打新限售	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301161	唯万密封	2022-09-06	6个月	创业板打新限售	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301398	星源卓镁	2022-12-08	6个月	创业板打新限售	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70	-
301313	凡拓数创	2022-09-22	6个月	创业板打新限售	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58	-
301285	鸿日达	2022-09-21	6个月	创业板打新限售	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	创业板打新限售	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-
301359	东南电子	2022-11-02	6个月	创业板打新限售	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	创业板打新限售	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	创业板打	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-

				新限售						
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	创业板打新限售	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	创业板打新限售	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	创业板打新限售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-
301231	荣信文化	2022-08-31	6个月	创业板打新限售	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301309	万得凯	2022-09-08	6个月	创业板打新限售	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88	-
301233	盛帮股份	2022-06-24	6个月	创业板打新限售	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301316	慧博云通	2022-09-29	6个月	创业板打新限售	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	-

注：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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强联	2022-12-30	重大事项	53.28	2023-01-10	56.88	294,630	23,770,459.87	15,697,886.40	-

注:本基金截至2022年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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**

截至本报告期末2022年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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	300001	特锐德	2023年01月04日-2023年01月09日	15.21	188,700	2,870,127.00
2	300003	乐普医疗	2023年01月04日-2023年01月09日	22.97	374,400	8,599,968.00

			23年01月 09日			
3	300009	安科生物	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	9.36	327,000	3,060,720.0 0
4	300012	华测检测	2023年01 月04日-20 23年01月 10日	22.30	442,400	9,865,520.0 0
5	300014	亿纬锂能	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	87.90	377,200	33,155,880. 00
6	300015	爱尔眼科	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	31.07	907,200	28,186,704. 00
7	300033	同花顺	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	98.61	61,200	6,034,932.0 0
8	300034	钢研高纳	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	45.84	79,900	3,662,616.0 0
9	300035	中科电气	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	20.58	185,400	3,815,532.0 0
10	300037	新宙邦	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	43.47	143,700	6,246,639.0 0

11	300054	鼎龙股份	2023年01月04日-2023年01月09日	21.29	208,800	4,445,352.00
12	300059	东方财富	2023年01月04日-2023年01月09日	19.40	3,140,700	60,929,580.00
13	300070	碧水源	2023年01月04日-2023年01月09日	4.73	553,000	2,615,690.00
14	300073	当升科技	2023年01月04日-2023年01月09日	56.40	122,000	6,880,800.00
15	300088	长信科技	2023年01月04日-2023年01月09日	5.97	618,400	3,691,848.00
16	300118	东方日升	2023年01月03日-2023年01月09日	24.82	215,500	5,348,710.00
17	300122	智飞生物	2023年01月04日-2023年01月09日	87.83	229,400	20,148,202.00
18	300124	汇川技术	2023年01月04日-2023年01月09日	69.50	555,800	38,628,100.00
19	300136	信维通信	2023年01月04日-2023年01月09日	16.51	244,100	4,030,091.00

			23年01月 09日			
20	300142	沃森生物	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	40.19	490,200	19,701,138. 00
21	300144	宋城演艺	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	14.60	457,300	6,676,580.0 0
22	300146	汤臣倍健	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	22.82	299,400	6,832,308.0 0
23	300171	东富龙	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	23.73	85,300	2,024,169.0 0
24	300207	欣旺达	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	21.15	453,800	9,597,870.0 0
25	300223	北京君正	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	70.44	73,200	5,156,208.0 0
26	300244	迪安诊断	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	25.13	142,000	3,568,460.0 0
27	300251	光线传媒	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	8.66	325,500	2,818,830.0 0

28	300253	卫宁健康	2023年01月04日-2023年01月09日	10.28	531,500	5,463,820.00
29	300274	阳光电源	2023年01月04日-2023年01月12日	111.80	307,100	34,333,780.00
30	300285	国瓷材料	2023年01月04日-2023年01月09日	27.57	235,900	6,503,763.00
31	300294	博雅生物	2023年01月03日-2023年01月09日	36.56	88,500	3,235,560.00
32	300296	利亚德	2023年01月04日-2023年01月09日	5.66	603,000	3,412,980.00
33	300308	中际旭创	2023年01月03日-2023年01月10日	27.03	195,400	5,281,662.00
34	300316	晶盛机电	2023年01月04日-2023年01月09日	63.56	180,400	11,466,224.00
35	300347	泰格医药	2023年01月04日-2023年01月09日	104.80	158,700	16,631,760.00
36	300357	我武生物	2023年01月04日-20	55.10	82,600	4,551,260.00

			23年01月 09日			
37	300363	博腾股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	40.85	101,000	4,125,850.0 0
38	300373	扬杰科技	2023年01 月04日-20 23年01月 12日	52.60	87,100	4,581,460.0 0
39	300376	易事特	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	6.83	334,400	2,283,952.0 0
40	300383	光环新网	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	8.16	414,800	3,384,768.0 0
41	300390	天华超净	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	55.88	132,800	7,420,864.0 0
42	300395	菲利华	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	55.00	123,800	6,809,000.0 0
43	300408	三环集团	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	30.71	375,900	11,543,889. 00
44	300413	芒果超媒	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	30.02	188,800	5,667,776.0 0

45	300418	昆仑万维	2023年01月04日-2023年01月09日	14.41	225,100	3,243,691.00
46	300432	富临精工	2023年01月04日-2023年01月09日	14.43	232,200	3,350,646.00
47	300433	蓝思科技	2023年01月03日-2023年01月09日	10.53	646,100	6,803,433.00
48	300438	鹏辉能源	2023年01月03日-2023年01月10日	77.99	104,300	8,134,357.00
49	300450	先导智能	2023年01月03日-2023年01月10日	40.25	337,600	13,588,400.00
50	300454	深信服	2023年01月04日-2023年01月09日	112.55	70,000	7,878,500.00
51	300474	景嘉微	2023年01月03日-2023年01月09日	54.57	67,900	3,705,303.00
52	300482	万孚生物	2023年01月03日-2023年01月09日	31.87	85,200	2,715,324.00
53	300487	蓝晓科技	2023年01月04日-2023年01月09日	69.59	48,200	3,354,238.00

			23年01月 09日			
54	300496	中科创达	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	100.30	106,700	10,702,010. 00
55	300498	温氏股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	19.63	1,608,000	31,565,040. 00
56	300529	健帆生物	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	30.97	131,100	4,060,167.0 0
57	300558	贝达药业	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	49.27	75,800	3,734,666.0 0
58	300568	星源材质	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	21.26	331,100	7,039,186.0 0
59	300595	欧普康视	2023年01 月04日-20 23年01月 12日	35.70	154,800	5,526,360.0 0
60	300601	康泰生物	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	31.53	175,600	5,536,668.0 0
61	300604	长川科技	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	44.58	112,800	5,028,624.0 0

62	300618	寒锐钴业	2023年01月04日-2023年01月09日	40.05	67,900	2,719,395.00
63	300628	亿联网络	2023年01月04日-2023年01月09日	60.59	97,800	5,925,702.00
64	300661	圣邦股份	2023年01月03日-2023年01月09日	172.60	71,100	12,271,860.00
65	300676	华大基因	2023年01月03日-2023年01月09日	51.69	71,500	3,695,835.00
66	300677	英科医疗	2023年01月03日-2023年01月10日	21.03	147,200	3,095,616.00
67	300682	朗新科技	2023年01月04日-2023年01月10日	21.98	161,700	3,554,166.00
68	300699	光威复材	2023年01月04日-2023年01月09日	72.25	89,900	6,495,275.00
69	300724	捷佳伟创	2023年01月04日-2023年01月11日	114.02	74,300	8,471,686.00
70	300725	药石科技	2023年01月03日-2023年01月09日	80.50	51,700	4,161,850.00

			23年01月 09日			
71	300726	宏达电子	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	44.14	43,800	1,933,332.0 0
72	300741	华宝股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	23.53	40,100	943,553.00
73	300747	锐科激光	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	23.65	97,800	2,312,970.0 0
74	300748	金力永磁	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	29.26	120,400	3,522,904.0 0
75	300750	宁德时代	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	393.42	385,900	151,820,77 8.00
76	300751	迈为股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	411.84	26,300	10,831,392. 00
77	300759	康龙化成	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	68.00	156,300	10,628,400. 00
78	300760	迈瑞医疗	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	315.97	139,800	44,172,606. 00

79	300763	锦浪科技	2023年01月03日-2023年01月10日	180.05	57,700	10,388,885.00
80	300769	德方纳米	2023年01月03日-2023年01月09日	229.59	38,400	8,816,256.00
81	300775	三角防务	2023年01月03日-2023年01月09日	38.00	90,100	3,423,800.00
82	300776	帝尔激光	2023年01月04日-2023年01月09日	126.00	23,600	2,973,600.00
83	300777	中简科技	2023年01月04日-2023年01月09日	49.15	103,100	5,067,365.00
84	300782	卓胜微	2023年01月04日-2023年01月09日	114.30	94,600	10,812,780.00
85	300821	东岳硅材	2023年01月03日-2023年01月09日	11.68	112,000	1,308,160.00
86	300832	新产业	2023年01月04日-2023年01月09日	50.14	87,400	4,382,236.00
87	300850	新强联	2023年01月10日-20	53.28	59,700	3,180,816.00

			23年01月 10日			
88	300861	美畅股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	49.16	45,900	2,256,444.0 0
89	300866	安克创新	2023年01 月04日-20 23年01月 12日	59.27	52,500	3,111,675.0 0
90	300888	稳健医疗	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	71.50	37,300	2,666,950.0 0
91	300896	爱美客	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	566.35	26,600	15,064,910. 00
92	300919	中伟股份	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	65.61	58,700	3,851,307.0 0
93	300957	贝泰妮	2023年01 月03日-20 23年01月 09日	149.24	42,000	6,268,080.0 0
94	300979	华利集团	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	57.11	50,700	2,895,477.0 0
95	300999	金龙鱼	2023年01 月04日-20 23年01月 09日	43.56	170,400	7,422,624.0 0

96	301029	怡合达	2023年01月03日-2023年01月09日	65.74	24,600	1,617,204.00
97	301035	润丰股份	2023年01月04日-2023年01月09日	87.10	22,600	1,968,460.00
98	301047	义翘神州	2023年01月04日-2023年01月09日	99.66	16,500	1,644,390.00
99	301219	腾远钴业	2023年01月04日-2023年01月09日	68.93	14,200	978,806.00
合计					23,027,800	947,915,100.00

注：出借证券中存在因认购新发/增发或暂时停牌等其他流通受限的情形，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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员

会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性

很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

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

于2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

银行存款	6,979,118.39	-	-	-	6,979,118.39
结算备付金	109,937.24	-	-	-	109,937.24
存出保证金	1,448,480.97	-	-	-	1,448,480.97
交易性金融资产	-	-	-	5,154,348,266.16	5,154,348,266.16
其他资产	-	-	-	649,800.45	649,800.45
资产总计	8,537,536.60	-	-	5,154,998,066.61	5,163,535,603.21
负债					
应付清算款	-	-	-	2,071,463.53	2,071,463.53
应付管理人报酬	-	-	-	2,175,891.98	2,175,891.98
应付托管费	-	-	-	435,178.38	435,178.38
应交税费	-	-	-	21,531.83	21,531.83
其他负债	-	-	-	1,221,373.99	1,221,373.99
负债总计	-	-	-	5,925,439.71	5,925,439.71
利率敏感度缺口	8,537,536.60	-	-	5,149,072,626.90	5,157,610,163.50
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,323,034.71	-	-	-	9,323,034.71
结算备付金	271,245.89	-	-	-	271,245.89
存出保证金	154,256.21	-	-	-	154,256.21
交易性金融资产	-	-	-	3,640,588,868.67	3,640,588,868.67
应收证券清算款	-	-	-	2,211,027.48	2,211,027.48
应收利息	-	-	-	153,033.16	153,033.16
应收股利	-	-	-	1,155.00	1,155.00
资产总计	9,748,536.81	-	-	3,642,954,084.31	3,652,702,621.12
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,504,819.41	1,504,819.41
应付托管费	-	-	-	300,963.87	300,963.87
应付交易费用	-	-	-	250,853.02	250,853.02
应交税费	-	-	-	13,535.45	13,535.45
其他负债	-	-	-	1,081,198.01	1,081,198.01
负债总计	-	-	-	3,151,369.76	3,151,369.76
利率敏感度缺口	9,748,536.81	-	-	3,639,802,714.55	3,649,551,251.36

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2021年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2021年12月31日：同)。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪创业板指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，创业板指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%，每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	5,154,348,266.16	99.94	3,640,588,868.67	99.75
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	5,154,348,266.16	99.94	3,640,588,868.67	99.75

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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
	业绩比较基准上升5%	254,244,393.01	182,958,435.71
	业绩比较基准下降5%	-254,244,393.01	-182,958,435.71

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末	上年度末
---------------	-----	------

	2022年12月31日	2021年12月31日
第一层次	5,137,790,917.12	3,639,490,323.00
第二层次	15,697,886.40	80,953.93
第三层次	859,462.64	1,017,591.74
合计	5,154,348,266.16	3,640,588,868.67

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

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01月01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	-	1,017,591.74	1,017,591.74
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,182,655.82	2,182,655.82
转出第三层次	-	2,835,042.56	2,835,042.56
当期利得或损失总额	-	494,257.64	494,257.64
其中：计入损益的利得或损失	-	494,257.64	494,257.64
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-

期末余额	-	859,462.64	859,462.64
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	-	-180,647.77	-180,647.77
项目	上年度可比同期 2021年01月01日至2021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	-	646,130.72	646,130.72
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	371,461.02	371,461.02
其中：计入损益的利得或损失	-	371,461.02	371,461.02
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,017,591.74	1,017,591.74
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	-	371,461.02	371,461.02

于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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
股票投资	859,462.64	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1891~2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	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
股票投资	1,017,591.74	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.3138~2.7417	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

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

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	5,154,348,266.16	99.82
	其中：股票	5,154,348,266.16	99.82
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	7,089,055.63	0.14
8	其他各项资产	2,098,281.42	0.04
9	合计	5,163,535,603.21	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 947,915,100.00 元，占基金资产净值的比例为 18.38%。

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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	174,504,300.62	3.38
B	采矿业	-	-
C	制造业	3,922,542,531.34	76.05
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	180,716,596.27	3.50
J	金融业	370,306,887.88	7.18
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	232,860,533.15	4.51
N	水利、环境和公共设施管	14,460,650.60	0.28

	理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	175,554,119.28	3.40
R	文化、体育和娱乐业	82,474,461.82	1.60
S	综合	-	-
	合计	5,153,420,080.96	99.92

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	513,346.91	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,288.81	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	12,998.08	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	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	106,663.20	0.00

R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	928,185.20	0.02

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

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,134,168	839,624,374.56	16.28
2	300059	东方财富	17,365,928	336,899,003.20	6.53
3	300760	迈瑞医疗	772,836	244,192,990.92	4.73
4	300124	汇川技术	3,073,923	213,637,648.50	4.14
5	300274	阳光电源	1,671,428	186,865,650.40	3.62
6	300014	亿纬锂能	2,084,220	183,202,938.00	3.55
7	300498	温氏股份	8,889,674	174,504,300.62	3.38
8	300015	爱尔眼科	5,015,019	155,816,640.33	3.02
9	300122	智飞生物	1,268,238	111,389,343.54	2.16
10	300142	沃森生物	2,709,129	108,879,894.51	2.11
11	300347	泰格医药	877,524	91,964,515.20	1.78
12	300896	爱美客	148,760	84,250,226.00	1.63
13	300450	先导智能	1,663,501	66,955,915.25	1.30
14	300661	圣邦股份	382,703	66,054,537.80	1.28
15	300408	三环集团	2,070,272	63,578,053.12	1.23
16	300316	晶盛机电	988,043	62,800,013.08	1.22
17	300751	迈为股份	146,928	60,510,827.52	1.17
18	300759	康龙化成	864,519	58,787,292.00	1.14
19	300782	卓胜微	506,975	57,947,242.50	1.12
20	300012	华测检测	2,368,889	52,826,224.70	1.02
21	300496	中科创达	525,972	52,754,991.60	1.02

22	300763	锦浪科技	284,951	51,305,427.55	0.99
23	300207	欣旺达	2,281,288	48,249,241.20	0.94
24	300003	乐普医疗	2,047,705	47,035,783.85	0.91
25	300724	捷佳伟创	403,178	45,970,355.56	0.89
26	300769	德方纳米	193,780	44,489,950.20	0.86
27	300454	深信服	387,367	43,598,155.85	0.85
28	300999	金龙鱼	941,614	41,016,705.84	0.80
29	300438	鹏辉能源	515,400	40,196,046.00	0.78
30	300073	当升科技	674,248	38,027,587.20	0.74
31	300146	汤臣倍健	1,655,401	37,776,250.82	0.73
32	300395	菲利华	684,700	37,658,500.00	0.73
33	300390	天华超净	655,000	36,601,400.00	0.71
34	300285	国瓷材料	1,304,246	35,958,062.22	0.70
35	300699	光威复材	496,695	35,886,213.75	0.70
36	300144	宋城演艺	2,449,049	35,756,115.40	0.69
37	300568	星源材质	1,664,313	35,383,294.38	0.69
38	300037	新宙邦	794,992	34,558,302.24	0.67
39	300433	蓝思科技	3,249,023	34,212,212.19	0.66
40	300033	同花顺	338,788	33,407,884.68	0.65
41	300628	亿联网络	541,392	32,802,941.28	0.64
42	300957	贝泰妮	211,500	31,564,260.00	0.61
43	300413	芒果超媒	1,037,312	31,140,106.24	0.60
44	300601	康泰生物	969,436	30,566,317.08	0.59
45	300253	卫宁健康	2,937,460	30,197,088.80	0.59
46	300223	北京君正	405,200	28,542,288.00	0.55
47	300777	中简科技	570,200	28,025,330.00	0.54
48	300595	欧普康视	761,414	27,182,479.80	0.53
49	300118	东方日升	1,084,970	26,928,955.40	0.52
50	300308	中际旭创	962,600	26,019,078.00	0.50
51	300604	长川科技	566,300	25,245,654.00	0.49
52	300357	我武生物	456,719	25,165,216.90	0.49

53	300054	鼎龙股份	1,153,800	24,564,402.00	0.48
54	300832	新产业	482,911	24,213,157.54	0.47
55	300363	博腾股份	559,500	22,855,575.00	0.44
56	300373	扬杰科技	428,730	22,551,198.00	0.44
57	300529	健帆生物	724,264	22,430,456.08	0.43
58	300136	信维通信	1,349,258	22,276,249.58	0.43
59	300919	中伟股份	324,900	21,316,689.00	0.41
60	300035	中科电气	1,025,300	21,100,674.00	0.41
61	300725	药石科技	260,090	20,937,245.00	0.41
62	300088	长信科技	3,417,473	20,402,313.81	0.40
63	300558	贝达药业	412,700	20,333,729.00	0.39
64	300034	钢研高纳	442,100	20,265,864.00	0.39
65	300676	华大基因	388,005	20,055,978.45	0.39
66	300474	景嘉微	367,294	20,043,233.58	0.39
67	300244	迪安诊断	785,415	19,737,478.95	0.38
68	300296	利亚德	3,335,700	18,880,062.00	0.37
69	300383	光环新网	2,293,084	18,711,565.44	0.36
70	300487	蓝晓科技	267,200	18,594,448.00	0.36
71	300418	昆仑万维	1,244,100	17,927,481.00	0.35
72	300682	朗新科技	797,421	17,527,313.58	0.34
73	300294	博雅生物	475,971	17,401,499.76	0.34
74	300748	金力永磁	594,259	17,388,018.34	0.34
75	300432	富临精工	1,197,659	17,282,219.37	0.34
76	300775	三角防务	453,400	17,229,200.00	0.33
77	300009	安科生物	1,797,560	16,825,161.60	0.33
78	300776	帝尔激光	133,100	16,770,600.00	0.33
79	300001	特锐德	1,043,500	15,871,635.00	0.31
80	300850	新强联	294,630	15,697,886.40	0.30
81	300251	光线传媒	1,798,873	15,578,240.18	0.30
82	300866	安克创新	258,500	15,321,295.00	0.30
83	300677	英科医疗	725,270	15,252,428.10	0.30

84	300618	寒锐钴业	375,672	15,045,663.60	0.29
85	300070	碧水源	3,057,220	14,460,650.60	0.28
86	300979	华利集团	252,900	14,443,119.00	0.28
87	300888	稳健医疗	188,600	13,484,900.00	0.26
88	300482	万孚生物	420,875	13,413,286.25	0.26
89	301035	润丰股份	152,800	13,308,880.00	0.26
90	300861	美畅股份	253,640	12,468,942.40	0.24
91	300376	易事特	1,730,432	11,818,850.56	0.23
92	300747	锐科激光	481,826	11,395,184.90	0.22
93	300457	赢合科技	581,300	10,271,571.00	0.20
94	300171	东富龙	420,900	9,987,957.00	0.19
95	300726	宏达电子	220,900	9,750,526.00	0.19
96	301047	义翘神州	92,580	9,226,522.80	0.18
97	301029	怡合达	125,231	8,232,685.94	0.16
98	300821	东岳硅材	563,600	6,582,848.00	0.13
99	301219	腾远钴业	79,900	5,507,507.00	0.11
100	300741	华宝股份	202,629	4,767,860.37	0.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
2	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
3	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
4	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
5	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
6	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
7	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
8	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
9	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00

10	301301	C川宁	3,574	26,912.22	0.00
11	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
12	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
13	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
14	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
15	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
16	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
17	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
18	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
19	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
20	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
21	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
22	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
23	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
24	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
25	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
26	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
27	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
28	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
29	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
30	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
31	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
32	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
33	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
34	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
35	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
36	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
37	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
38	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
39	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
40	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00

41	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
42	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
43	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
44	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
45	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
46	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
47	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
48	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
49	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	300438	鹏辉能源	41,121,379.00	1.13
2	300363	博腾股份	37,097,506.00	1.02
3	300395	菲利华	36,036,410.63	0.99
4	300751	迈为股份	35,979,993.69	0.99
5	300769	德方纳米	33,247,627.00	0.91
6	300919	中伟股份	33,105,161.00	0.91
7	300059	东方财富	32,106,837.05	0.88
8	300118	东方日升	28,305,998.35	0.78
9	300054	鼎龙股份	26,557,303.52	0.73
10	300777	中简科技	23,472,403.00	0.64
11	300776	帝尔激光	23,213,778.73	0.64
12	300035	中科电气	23,075,826.11	0.63
13	300750	宁德时代	22,761,490.00	0.62
14	300604	长川科技	22,283,687.54	0.61
15	300850	新强联	21,977,478.40	0.60
16	300487	蓝晓科技	20,389,434.00	0.56

17	300034	钢研高纳	20,047,219.80	0.55
18	300432	富临精工	17,941,871.99	0.49
19	300759	康龙化成	16,305,657.36	0.45
20	300498	温氏股份	15,964,662.82	0.44

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（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	300059	东方财富	38,919,651.47	1.07
2	300896	爱美客	25,153,652.68	0.69
3	300014	亿纬锂能	21,771,159.16	0.60
4	300058	蓝色光标	21,470,250.63	0.59
5	300760	迈瑞医疗	20,609,854.86	0.56
6	300502	新易盛	20,566,371.15	0.56
7	300750	宁德时代	19,151,713.83	0.52
8	300782	卓胜微	17,931,591.74	0.49
9	300212	易华录	17,508,486.12	0.48
10	300017	网宿科技	16,581,645.90	0.45
11	300115	长盈精密	16,136,266.20	0.44
12	300751	迈为股份	15,727,577.34	0.43
13	300672	国科微	15,513,611.00	0.43
14	300024	机器人	15,150,807.41	0.42
15	300124	汇川技术	14,996,565.30	0.41
16	300476	胜宏科技	14,598,054.52	0.40
17	300015	爱尔眼科	14,462,953.68	0.40
18	300567	精测电子	13,642,832.91	0.37
19	300274	阳光电源	13,554,436.84	0.37
20	300773	拉卡拉	13,387,943.89	0.37

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（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	896,963,435.10
卖出股票收入（成交）总额	773,871,551.13

注：本项“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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,448,480.97
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	649,800.45
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,098,281.42

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**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	151,820,778.00	2.94	转融通证券出借
2	300059	东方财富	60,929,580.00	1.18	转融通证券出借
3	300760	迈瑞医疗	44,172,606.00	0.86	转融通证券出借
4	300124	汇川技术	38,628,100.00	0.75	转融通证券出借
5	300274	阳光电源	34,333,780.00	0.67	转融通证券出借

6	300014	亿纬锂能	33,155,880.00	0.64	转融通证券出借
7	300498	温氏股份	31,565,040.00	0.61	转融通证券出借
8	300015	爱尔眼科	28,186,704.00	0.55	转融通证券出借
9	300122	智飞生物	20,148,202.00	0.39	转融通证券出借
10	300142	沃森生物	19,701,138.00	0.38	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301269	华大九天	102,713.92	0.00	创业板打新限售
2	301267	华夏眼科	66,597.20	0.00	创业板打新限售
3	301095	广立微	64,002.60	0.00	创业板打新限售
4	301327	华宝新能	42,826.74	0.00	创业板打新限售

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	户均持有的基金份额	持有人结构		
		机构投资者	个人投资者	联接基金

数 (户)		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
13,276	163,297.41	10,577,815.00	0.49%	97,829,321.00	4.51%	2,059,529,274.00	95.00%

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	国泰君安证券股份有限公司一天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,059,529,274.00	95.00%
2	方正证券股份有限公司	3,518,710.00	0.16%
3	申万宏源证券有限公司	1,756,190.00	0.08%
4	金挺	1,379,100.00	0.06%
5	熊大军	1,297,300.00	0.06%
6	广发证券股份有限公司	1,069,171.00	0.05%
7	张科达	946,000.00	0.04%
8	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	845,500.00	0.04%
9	光大理财有限责任公司—阳光金18M增利稳健5号	829,500.00	0.04%
10	蔡光辉	797,900.00	0.04%

注：持有人为场内持有人。

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	600.00	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情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年09月12日)基金份额总额	640,858,438.00
本报告期期初基金份额总额	1,086,936,410.00
本报告期基金总申购份额	1,936,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	855,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,167,936,410.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

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，常勇先生任职公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的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

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费 100,000.00 元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 3 年 4 个月。

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**

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

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	
安信证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	240,802,012.67	14.57%	103,858.62	14.83%	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	84,002,362.66	5.08%	36,230.38	5.17%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	63,280,830.96	3.83%	14,637.68	2.09%	-

海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	89,427,378.82	5.41%	38,570.56	5.51%	-
华鑫证券	1	80,074,265.65	4.84%	34,536.34	4.93%	-
江海证券	2	64,164,321.00	3.88%	27,673.46	3.95%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	1,031,421,079.09	62.39%	444,855.31	63.52%	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：恒泰证券上海交易单元、恒泰证券深圳交易单元、华鑫证券深圳交易单元、江海证券上海交易单元、江海证券深圳交易单元、首创证券深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	3,695,098.37	38.88%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	4,185,200.00	44.03%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	1,624,071.29	17.09%	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-04
2	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
3	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2021年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2022-01-24
4	天弘基金管理有限公司运用固有资金投资旗下公募基金的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-17
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-23

6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
7	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-28
8	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2021年年度报告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-04-08
11	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-14
12	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
13	天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
14	天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告	中国证监会规定媒介	2022-04-26
15	天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
16	天弘基金管理有限公司关于调整天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-25
17	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2022-05-27
18	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2022-05-27
19	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回	中国证监会规定媒介	2022-06-01

	代办证券公司的公告		
20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-02
21	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中信银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-04
22	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2022年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-21
23	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2022-07-29
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2022-08-08
25	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-08-29
26	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-31
27	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2022-09-01
28	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-10
29	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-13
30	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2022-10-21
31	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金2022年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-26
32	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-10-28

33	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-09
34	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2022-11-19
35	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-12-09
36	天弘基金管理有限公司关于调整天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-14
37	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2022-12-15
38	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2022-12-15
39	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2022-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联	1	20220101-	1,007,412,	1,655,117,	603,000,00	2,059,529,	95.0

接基金		20221231	274.00	000.00	0.00	274.00	0%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会(2017)7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会(2017)8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会(2017)9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会(2017)14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自 2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同

- 3、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二三年三月三十一日