

天弘中证 500 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	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	196
8.1 期末基金资产组合情况	196
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	196
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	198
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	216
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	218
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	219
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	219
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	219
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	219
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	219

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	220
8.12 投资组合报告附注.....	220
§9 基金份额持有人信息.....	222
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	222
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	222
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	223
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.....	223
§10 开放式基金份额变动.....	223
§11 重大事件揭示.....	223
11.1 基金份额持有人大会决议.....	224
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.....	224
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	224
11.4 基金投资策略的改变.....	224
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	224
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.....	224
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	224
11.8 其他重大事件.....	227
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	229
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.....	229
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	230
§13 备查文件目录.....	230
13.1 备查文件目录.....	231
13.2 存放地点.....	231
13.3 查阅方式.....	231

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	中证500ETF天弘
场内简称	中证500ETF天弘
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07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	2,476,408,470.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月24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	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。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，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	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	shuaifang@gtjas.com
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	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
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08月07日 (基金合同生效日) - 2020年12月31日
	本期已实现收益	-26,024,855.91	265,476,041.52
本期利润	-439,857,950.03	398,195,984.01	-69,172,130.13
加权平均基金份额 本期利润	-0.1886	0.1790	-0.0312
本期加权平均净值 利润率	-19.04%	16.90%	-3.22%
本期基金份额净值 增长率	-18.38%	18.40%	-2.47%
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	-142,437,349.55	221,084,103.98	-61,038,982.80
期末可供分配基金 份额利润	-0.0575	0.1075	-0.0247
期末基金资产净值	2,333,971,120.45	2,374,667,017.17	2,407,869,487.20

期末基金份额净值	0.9425	1.1548	0.9753
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	-5.75%	15.48%	-2.47%

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	2.81%	1.02%	2.63%	1.03%	0.18%	-0.01%
过去六个月	-8.27%	1.09%	-9.14%	1.10%	0.87%	-0.01%
过去一年	-18.38%	1.37%	-20.31%	1.38%	1.93%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	-5.75%	1.17%	-13.38%	1.19%	7.63%	-0.02%

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

天弘中证500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



注：1、本基金合同于2020年08月07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2020年08月07日生效。基金合同生效当年2020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

本基金于2020年08月07日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	11年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

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

报告期内本基金秉承合规第一、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。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则，报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。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，同时紧密跟踪成分股的股息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。

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0.9425元，本报告期份额净值增长率-18.38%，同期业绩比较基准增长率-20.31%。

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年全年来看，制约经济和股票市场表现的国内因素主要是地产融资困境带来的经济连锁反应以及疫情在经济社会生活形成拖累，当前这两大负面因素都有了好转。

尽管2023年可能面临外需下滑的压力，但地产和消费是国内经济修复的两大看点。地产政策自2022年底密集出台，并且有了较为明显的突破，通过改善房地产企业融资环境，需求端、供给端和保交楼三管齐下，促进房地产市场平稳健康发展。我们认为2023年仍然存在政策继续发力的空间。疫情方面，随着疫情政策的放开，国内经济经历短期阵痛，但经济的恢复动能较强。随着疫情放开，社交场景重启，消费大概率呈现回暖趋势，助力经济修复。

整体上我们认为，当前股票市场的底部区域特征还是较为明确的，一来政策底的信号已经较为明确，经济修复的预期已经开始演绎。另一方面，近几年来，股票市场多轮下探已经对底部进行了多次试探，我们认为当前股票市场整体已经是到了底部区域。当然经济底还尚未确认，宏观经济层面仍然存在一些不确定因素，包括宏观经济增长压力、疫情短期的影响、外需可能回落等等。因此短期我们的态度是不悲观，但谨慎乐观。如果把时间放长一些，我们认为，我们可以对中国经济的修复和股票市场的表现更加乐观一些。

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、不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”）在天弘中证500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26235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	天弘中证500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 我们审计了天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘中证500ETF”)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,公允反映了天弘中证500ETF2022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

	<p>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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天弘中证500ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
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	<p>天弘中证500ETF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中证500ETF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中证500ETF、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中证500ETF的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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</p>

	<p>财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天弘中证500ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证500ETF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。</p>
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：天弘中证500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	30,541,972.80	45,464,854.58
结算备付金		61,232,998.93	116,832,783.44
存出保证金		13,900,231.01	25,430,838.76
交易性金融资产	7.4.7.2	2,233,326,609.28	2,190,227,299.39
其中：股票投资		2,232,596,024.84	2,190,025,003.29
基金投资		-	-
债券投资		730,584.44	202,296.10
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		-	260,190.17
应收股利		4,144.50	539.00
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	140,915.40	284,867.79

资产总计		2,339,146,871.92	2,378,501,373.13
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		3,223,994.11	1,304,905.52
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,008,793.41	1,015,836.23
应付托管费		201,758.69	203,167.27
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,202.43	189,223.40
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	736,002.83	1,121,223.54
负债合计		5,175,751.47	3,834,355.96
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,476,408,470.00	2,056,408,470.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-142,437,349.55	318,258,547.17
净资产合计		2,333,971,120.45	2,374,667,017.17
负债和净资产总计		2,339,146,871.92	2,378,501,373.13

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额净值0.9425元，基金份额总额2,476,408,470.00份。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500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		-424,880,653.35	418,460,460.02
1.利息收入		5,337,389.22	6,631,638.82
其中：存款利息收入	7.4.7.9	763,207.81	2,471,786.60
债券利息收入		-	951.28
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		4,574,181.41	4,158,900.94
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-17,011,353.94	274,831,718.48
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-43,921,655.59	198,982,822.81
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	1,380,831.15	804,262.30
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	-13,437,098.07	47,700,621.36
股利收益	7.4.7.15	38,966,568.57	27,344,012.01
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	-413,833,094.12	132,719,942.49
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	626,405.49	4,277,160.23
减：二、营业总支出		14,977,296.68	20,264,476.01

1. 管理人报酬		11,515,948.09	11,804,269.13
2. 托管费		2,303,189.71	2,360,853.85
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		16,473.06	198,058.93
8. 其他费用	7.4.7.19	1,141,685.82	5,901,294.10
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-439,857,950.03	398,195,984.01
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-439,857,950.03	398,195,984.01
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-439,857,950.03	398,195,984.01

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500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）	2,056,408,470.00	-	318,258,547.17	2,374,667,017.17
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）	2,056,408,470.00	-	318,258,547.17	2,374,667,017.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	420,000,000.00	-	-460,695,896.72	-40,695,896.72
（一）、综合收益总额	-	-	-439,857,950.03	-439,857,950.03
（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）	420,000,000.00	-	-20,837,946.69	399,162,053.31
其中：1.基金申购款	627,500,000.00	-	-10,970,319.49	616,529,680.51
2.基金赎回款	-207,500,000.00	-	-9,867,627.20	-217,367,627.20
（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）	2,476,408,470.00	-	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
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）	2,468,908,470.00	-	-61,038,982.80	2,407,869,487.20
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）	2,468,908,470.00	-	-61,038,982.80	2,407,869,487.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-412,500,000.00	-	379,297,529.97	-33,202,470.03
（一）、综合收益总额	-	-	398,195,984.01	398,195,984.01
（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）	-412,500,000.00	-	-18,898,454.04	-431,398,454.04
其中：1.基金申购款	2,090,000,000.00	-	108,775,300.54	2,198,775,300.54
2.基金赎回款	-2,502,500,000.00	-	-127,673,754.58	-2,630,173,754.58
（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）	2,056,408,470.00	-	318,258,547.17	2,374,667,017.17

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

天弘中证500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[2020]1285号《关于准予天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，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《天弘中证500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333,867,000.00元，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(2020)第0673号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年8月7日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为333,908,470.00份基金份额，其中认购资金利息折合41,470.00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《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证500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[2020]735号文审核同意，本基金333,908,470.00份基金份额于2020年8月24日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500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允许上市的股票)、存托凭证、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)。基金的投资组合比例为: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:中证500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,将原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘中证500ETF联接”)。天弘中证500ETF联接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》、《天弘中证500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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。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的金融工具，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 45,464,854.58 元、116,832,783.44 元、25,430,838.76 元、284,867.79 元、260,190.17 元和 539.00 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 45,498,140.58 元、117,014,409.63 元、25,431,156.33 元、69,613.97 元、260,190.17 元和 539.00 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 2,190,227,299.39 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 2,190,227,323.45 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,304,905.52 元、1,015,836.23 元、203,167.27 元、629,042.63 元和 192,180.91 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 1,304,905.52 元、1,015,836.23 元、203,167.27 元、629,042.63 元和 192,180.91 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	30,541,972.80	45,464,854.58
等于：本金	30,527,958.74	45,464,854.58
加：应计利息	14,014.06	-
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	30,541,972.80	45,464,854.58

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	2,543,623,431.0	-	2,232,596,024.8	-311,027,406.25

		9		4	
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	743,000.00	52.24	730,584.44	-12,467.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	743,000.00	52.24	730,584.44	-12,467.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,544,366,431.09	52.24	2,233,326,609.28	-311,039,874.05
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		2,093,258,799.32	-	2,190,025,003.29	96,766,203.97
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	202,000.00	-	202,296.10	296.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	202,000.00	-	202,296.10	296.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,093,460,799.32	-	2,190,227,299.39	96,766,500.07

注：1、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。

2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	101,617,880.00	-	-	-
--股指期货	101,617,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	101,617,880.00	-	-	-
项目	上年度末 2021年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	175,143,320.00	-	-	-
--股指期货	175,143,320.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	175,143,320.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IC2303	IC2303	83.00	97,515,040.00	-4,102,840.00
合计				-4,102,840.00
减：可抵销 期货暂收 款				-4,102,840.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

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	-	284,867.79
其他应收款	140,915.40	-
待摊费用	-	-
合计	140,915.40	284,867.79

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	258,080.77	629,042.63
其中：交易所市场	258,080.77	629,042.63
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	300,000.00	300,000.00
其他应付	177,922.06	192,180.91

合计	736,002.83	1,121,223.54
----	------------	--------------

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	2,056,408,470.00	2,056,408,470.00
本期申购	627,500,000.00	627,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-207,500,000.00	-207,500,000.00
本期末	2,476,408,470.00	2,476,408,470.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	221,084,103.98	97,174,443.19	318,258,547.17
本期利润	-26,024,855.91	-413,833,094.12	-439,857,950.03
本期基金份额交易产生的变动数	43,826,228.16	-64,664,174.85	-20,837,946.69
其中：基金申购款	65,035,225.44	-76,005,544.93	-10,970,319.49
基金赎回款	-21,208,997.28	11,341,370.08	-9,867,627.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	238,885,476.23	-381,322,825.78	-142,437,349.55

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	460,833.62	2,088,805.15
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	296,799.14	372,523.36
其他	5,575.05	10,458.09
合计	763,207.81	2,471,786.60

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	-36,807,048.10	194,894,934.74
股票投资收益——赎回差价收入	-7,114,607.49	4,087,888.07
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	-43,921,655.59	198,982,822.81

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	949,754,302.24	2,266,181,758.70
减：卖出股票成本总额	984,454,955.94	2,071,286,823.96
减：交易费用	2,106,394.40	-
买卖股票差价收入	-36,807,048.10	194,894,934.74

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年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	217,367,627.20	2,630,173,754.58

减：现金支付赎回款总额	112,119,912.20	1,251,492,536.58
减：赎回股票成本总额	112,362,322.49	1,374,593,329.93
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-7,114,607.49	4,087,888.07

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	1,384.55	-
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	1,379,446.60	804,262.30
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	1,380,831.15	804,262.30

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	7,669,327.38	4,439,511.32
减：卖出债券(债 转股及债券到期兑 付)成本总额	6,288,200.00	3,634,300.00
减：应计利息总额	1,389.77	949.02

减：交易费用	291.01	-
买卖债券差价收入	1,379,446.60	804,262.30

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022年01月01日至2022年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2021年01月01日至2021年 12月31日
期货投资	-13,437,098.07	47,700,621.36

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	38,966,568.57	27,344,012.01
其中：证券出借权益补偿收入	4,359,381.50	3,156,000.90
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	38,966,568.57	27,344,012.01

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期	上年度可比期间
------	----	---------

	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-407,806,374.12	135,991,782.49
——股票投资	-407,793,610.22	135,991,486.39
——债券投资	-12,763.90	296.10
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-6,026,720.00	-3,271,840.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-6,026,720.00	-3,271,840.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-413,833,094.12	132,719,942.49

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 12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年 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	626,405.49	4,277,160.23
延期合约递延费收入	-	-
合计	626,405.49	4,277,160.23

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	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	690,956.95	708,256.16
IOPV计算发布费	100,000.00	100,000.00
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00
存托服务费	728.87	-
交易费用	-	4,743,037.94
合计	1,141,685.82	5,901,294.10

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
天弘中证500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	388,157,548.49	17.93%	-	-

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

关联方名称	本期 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	89,791.68	10.49%	89,791.68	34.79%

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
-	-	-	-	-

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	11,515,948.09	11,804,269.13
其中: 支付销售机构的客户维护费	1,192.62	3,539.03

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	2,303,189.71	2,360,853.85
----------------	--------------	--------------

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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	1,073,079,753.00	685,895.42	52,696,082.00	21,550.61
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	1,096,354,209.00	650,077.36	84,153,389.00	-

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	202201040000	华策影视	2022-01-04	17,496.00	2,400	14	3.40%	22.46	-	-

股份有限公司	0862										
国泰君安证券股份有限公司	202201 050000 1410	万孚生物	2022-0 1-05	39,41 0.00	1,000	14	3.40%	50.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0094	华策影视	2022-0 1-14	155,94 9.00	22,900	14	3.20%	188.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0096	汤臣倍健	2022-0 1-14	444,94 2.00	17,100	14	3.20%	537.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0098	信维通信	2022-0 1-14	455,52 0.00	19,500	14	3.20%	550.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0100	新宙邦	2022-0 1-14	594,62 4.00	5,700	14	3.20%	718.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0102	机器人	2022-0 1-14	280,22 4.00	25,200	14	3.20%	338.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0104	红日药业	2022-0 1-14	301,90 8.00	36,200	14	3.20%	364.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0106	网宿科技	2022-0 1-14	331,47 4.00	49,400	14	3.20%	400.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0108	安科生物	2022-0 1-14	324,78 6.00	23,100	14	3.20%	392.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0110	捷成股份	2022-0 1-14	291,61 6.00	41,600	14	3.20%	352.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0112	寒锐钴业	2022-0 1-14	335,95 9.00	4,300	14	3.20%	405.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0114	普利制药	2022-0 1-14	267,80 0.00	5,200	14	3.20%	323.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0116	万孚生物	2022-0 1-14	371,38 0.00	6,200	14	3.20%	448.70	-	-	
国泰君安	202201	昆仑万	2022-0	432,89	19,300	14	3.20%	523.03	-	-	

安证券股份有限公司	140002 0118	维	1-14	9.00							
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0120	迈克生物	2022-0 1-14	304,20 2.00	8,900	14	3.20%	367.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0122	康泰医学	2022-0 1-14	101,97 6.00	2,400	14	3.20%	123.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0124	光威复材	2022-0 1-14	452,04 2.00	6,200	14	3.20%	546.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0126	迈为股份	2022-0 1-14	543,91 0.00	1,000	14	3.20%	657.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0128	光环新网	2022-0 1-14	367,27 5.00	24,900	14	3.20%	443.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0130	卫宁健康	2022-0 1-14	516,57 8.00	34,600	14	3.20%	624.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 0132	华宇软件	2022-0 1-14	205,74 4.00	16,700	14	3.20%	248.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1950	长信科技	2022-0 1-14	586,57 5.00	49,500	14	3.20%	708.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1952	长盈精密	2022-0 1-14	286,62 4.00	16,900	14	3.20%	346.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1954	海新能科	2022-0 1-14	223,50 8.00	28,400	14	3.20%	270.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1956	东方国信	2022-0 1-14	176,74 2.00	16,200	14	3.20%	213.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1958	蓝色光标	2022-0 1-14	531,11 6.00	50,200	14	3.20%	641.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1960	万达信息	2022-0 1-14	276,28 4.00	23,900	14	3.20%	333.81	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1962	碧水源	2022-0 1-14	319,78 2.00	44,600	14	3.20%	386.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1964	圣湘生物	2022-0 1-14	180,19 2.00	2,400	14	3.20%	217.71	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1966	凯赛生物	2022-0 1-14	388,75 2.00	2,400	14	3.20%	469.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1968	虹软科技	2022-0 1-14	164,68 0.00	4,000	14	3.20%	198.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 1970	南微医学	2022-0 1-14	177,06 0.00	1,000	14	3.20%	213.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2836	易华录	2022-0 1-14	211,18 4.00	6,700	14	3.20%	255.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2838	迪安诊断	2022-0 1-14	337,21 2.00	8,700	14	3.20%	407.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2840	中际旭创	2022-0 1-14	437,58 4.00	11,200	14	3.20%	528.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2842	国瓷材料	2022-0 1-14	673,11 0.00	16,200	14	3.20%	813.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2844	光线传媒	2022-0 1-14	269,04 0.00	23,600	14	3.20%	325.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2846	掌趣科技	2022-0 1-14	261,87 6.00	55,600	14	3.20%	316.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2848	我武生物	2022-0 1-14	331,44 3.00	6,300	14	3.20%	400.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202201 140002 2850	博腾股份	2022-0 1-14	518,05 0.00	6,500	14	3.20%	625.90	-	-
国泰君安股份有	202201 280001 9562	博腾股份	2022-0 1-28	505,63 5.00	6,500	14	3.20%	610.90	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9564	我武生物	2022-0 1-28	290,17 8.00	6,300	14	3.20%	350.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9566	掌趣科技	2022-0 1-28	206,27 6.00	55,600	14	3.20%	249.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9568	光线传媒	2022-0 1-28	248,50 8.00	23,600	14	3.20%	300.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9570	国瓷材料	2022-0 1-28	649,62 0.00	16,200	14	3.20%	784.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9572	中际旭创	2022-0 1-28	400,96 0.00	11,200	14	3.20%	484.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9574	迪安诊断	2022-0 1-28	254,47 5.00	8,700	14	3.20%	307.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9576	易华录	2022-0 1-28	184,25 0.00	6,700	14	3.20%	222.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9578	南微医学	2022-0 1-28	154,81 0.00	1,000	14	3.20%	187.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9580	虹软科技	2022-0 1-28	154,12 0.00	4,000	14	3.20%	186.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9582	凯赛生物	2022-0 1-28	379,20 0.00	2,400	14	3.20%	458.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9584	圣湘生物	2022-0 1-28	125,59 2.00	2,400	14	3.20%	151.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9586	碧水源	2022-0 1-28	293,91 4.00	44,600	14	3.20%	355.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9588	万达信息	2022-0 1-28	281,30 3.00	23,900	14	3.20%	339.87	-	-	
国泰君安证券	202201 280001	蓝色光标	2022-0 1-28	439,75 2.00	50,200	14	3.20%	531.31	-	-	

股份有限公司	9590										
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9592	东方国信	2022-0 1-28	185,32 8.00	16,200	14	3.20%	223.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9594	海新能科	2022-0 1-28	220,10 0.00	28,400	14	3.20%	265.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9596	长盈精密	2022-0 1-28	236,43 1.00	16,900	14	3.20%	285.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9598	长信科技	2022-0 1-28	505,39 5.00	49,500	14	3.20%	610.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9600	华宇软件	2022-0 1-28	191,71 6.00	16,700	14	3.20%	231.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9602	卫宁健康	2022-0 1-28	398,24 6.00	34,600	14	3.20%	481.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9604	光环新网	2022-0 1-28	331,41 9.00	24,900	14	3.20%	400.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9606	迈为股份	2022-0 1-28	491,71 0.00	1,000	14	3.20%	594.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9608	光威复材	2022-0 1-28	445,90 4.00	6,200	14	3.20%	538.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9610	康泰医学	2022-0 1-28	80,49 6.00	2,400	14	3.20%	97.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9612	迈克生物	2022-0 1-28	221,87 7.00	8,900	14	3.20%	268.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9614	昆仑万维	2022-0 1-28	361,87 5.00	19,300	14	3.20%	437.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9616	万孚生物	2022-0 1-28	226,92 0.00	6,200	14	3.20%	274.16	-	-	
国泰君安	202201	普利制	2022-0	248,04	5,200	14	3.20%	299.68	-	-	

安证券股份有限公司	280001 9618	药	1-28	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9620	寒锐钴业	2022-0 1-28	303,27 9.00	4,300	14	3.20%	366.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9622	捷成股份	2022-0 1-28	263,74 4.00	41,600	14	3.20%	318.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9624	安科生物	2022-0 1-28	242,55 0.00	23,100	14	3.20%	293.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9626	网宿科技	2022-0 1-28	286,52 0.00	49,400	14	3.20%	346.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9628	红日药业	2022-0 1-28	223,35 4.00	36,200	14	3.20%	269.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9630	机器人	2022-0 1-28	254,77 2.00	25,200	14	3.20%	307.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280001 9632	新宙邦	2022-0 1-28	538,82 1.00	5,700	14	3.20%	651.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280002 1662	信维通信	2022-0 1-28	415,15 5.00	19,500	14	3.20%	501.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280002 1664	华策影视	2022-0 1-28	136,94 2.00	22,900	14	3.20%	165.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202201 280002 1666	汤臣倍健	2022-0 1-28	429,21 0.00	17,100	14	3.20%	518.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9222	汤臣倍健	2022-0 2-11	452,97 9.00	17,100	14	3.20%	547.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9224	华策影视	2022-0 2-11	135,33 9.00	22,900	14	3.20%	163.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9226	信维通信	2022-0 2-11	425,68 5.00	19,500	14	3.20%	514.31	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022021100019228	新宙邦	2022-02-11	503,880.00	5,700	14	3.20%	608.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019230	红日药业	2022-02-11	218,286.00	36,200	14	3.20%	263.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019232	网宿科技	2022-02-11	305,786.00	49,400	14	3.20%	369.45	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019234	安科生物	2022-02-11	240,240.00	23,100	14	3.20%	290.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019236	捷成股份	2022-02-11	293,280.00	41,600	14	3.20%	354.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019238	寒锐钴业	2022-02-11	323,102.00	4,300	14	3.20%	390.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019240	普利制药	2022-02-11	227,708.00	5,200	14	3.20%	275.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019242	万孚生物	2022-02-11	215,512.00	6,200	14	3.20%	260.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019244	昆仑万维	2022-02-11	356,857.00	19,300	14	3.20%	431.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019246	迈克生物	2022-02-11	234,426.00	8,900	14	3.20%	283.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019248	康泰医学	2022-02-11	79,992.00	2,400	14	3.20%	96.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019250	光威复材	2022-02-11	412,238.00	6,200	14	3.20%	498.07	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019252	迈为股份	2022-02-11	455,800.00	1,000	14	3.20%	550.70	-	-
国泰君安股份有	2022021100019254	光环新网	2022-02-11	346,608.00	24,900	14	3.20%	418.77	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019256	卫宁健康	2022-02-11	399,284.00	34,600	14	3.20%	482.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019258	华宇软件	2022-02-11	195,891.00	16,700	14	3.20%	236.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019260	长信科技	2022-02-11	465,300.00	49,500	14	3.20%	562.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019262	长盈精密	2022-02-11	202,800.00	16,900	14	3.20%	245.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019264	海新能科	2022-02-11	227,768.00	28,400	14	3.20%	275.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019266	东方国信	2022-02-11	208,980.00	16,200	14	3.20%	252.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019268	蓝色光标	2022-02-11	402,604.00	50,200	14	3.20%	486.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019270	万达信息	2022-02-11	298,750.00	23,900	14	3.20%	360.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019272	碧水源	2022-02-11	314,430.00	44,600	14	3.20%	379.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019274	圣湘生物	2022-02-11	116,616.00	2,400	14	3.20%	140.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019276	凯赛生物	2022-02-11	344,592.00	2,400	14	3.20%	416.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019278	虹软科技	2022-02-11	151,880.00	4,000	14	3.20%	183.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022021100019280	南微医学	2022-02-11	150,920.00	1,000	14	3.20%	182.34	-	-	
国泰君安证券	202202110001	易华录	2022-02-11	175,875.00	6,700	14	3.20%	212.49	-	-	

股份有限公司	9282										
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9284	迪安诊断	2022-0 2-11	246,12 3.00	8,700	14	3.20%	297.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9286	中际旭创	2022-0 2-11	389,08 8.00	11,200	14	3.20%	470.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9288	国瓷材料	2022-0 2-11	669,06 0.00	16,200	14	3.20%	808.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9290	光线传媒	2022-0 2-11	235,52 8.00	23,600	14	3.20%	284.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9292	掌趣科技	2022-0 2-11	218,50 8.00	55,600	14	3.20%	264.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9294	我武生物	2022-0 2-11	269,38 8.00	6,300	14	3.20%	325.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 110001 9296	博腾股份	2022-0 2-11	398,58 0.00	6,500	14	3.20%	481.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6487	华宇软件	2022-0 2-25	191,38 2.00	16,700	14	3.20%	231.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6489	卫宁健康	2022-0 2-25	395,13 2.00	34,600	14	3.20%	477.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6491	光环新网	2022-0 2-25	373,50 0.00	24,900	14	3.20%	451.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6493	迈为股份	2022-0 2-25	536,08 0.00	1,000	14	3.20%	647.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6495	光威复材	2022-0 2-25	450,18 2.00	6,200	14	3.20%	543.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6497	康泰医学	2022-0 2-25	91,27 2.00	2,400	14	3.20%	110.27	-	-	
国泰君安	202202	迈克生	2022-0	241,01	8,900	14	3.20%	291.19	-	-	

安证券股份有限公司	250001 6499	物	2-25	2.00							
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6501	昆仑万维	2022-0 2-25	338,71 5.00	19,300	14	3.20%	409.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6503	万孚生物	2022-0 2-25	267,03 4.00	6,200	14	3.20%	322.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6505	普利制药	2022-0 2-25	253,70 8.00	5,200	14	3.20%	306.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6507	寒锐钴业	2022-0 2-25	335,05 6.00	4,300	14	3.20%	404.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6509	捷成股份	2022-0 2-25	241,69 6.00	41,600	14	3.20%	292.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6511	安科生物	2022-0 2-25	247,86 3.00	23,100	14	3.20%	299.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6513	网宿科技	2022-0 2-25	338,88 4.00	49,400	14	3.20%	409.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6515	红日药业	2022-0 2-25	245,07 4.00	36,200	14	3.20%	296.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6517	新宙邦	2022-0 2-25	540,64 5.00	5,700	14	3.20%	653.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6519	信维通信	2022-0 2-25	416,32 5.00	19,500	14	3.20%	503.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6521	华策影视	2022-0 2-25	128,24 0.00	22,900	14	3.20%	154.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6523	汤臣倍健	2022-0 2-25	422,02 8.00	17,100	14	3.20%	509.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6789	博腾股份	2022-0 2-25	519,02 5.00	6,500	14	3.20%	627.09	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6791	我武生物	2022-0 2-25	282,74 4.00	6,300	14	3.20%	341.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6793	掌趣科技	2022-0 2-25	206,83 2.00	55,600	14	3.20%	249.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6795	光线传媒	2022-0 2-25	223,49 2.00	23,600	14	3.20%	270.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6797	国瓷材料	2022-0 2-25	589,35 6.00	16,200	14	3.20%	712.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6799	中际旭创	2022-0 2-25	415,18 4.00	11,200	14	3.20%	501.62	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6801	迪安诊断	2022-0 2-25	264,48 0.00	8,700	14	3.20%	319.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6803	易华录	2022-0 2-25	187,73 4.00	6,700	14	3.20%	226.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6805	南微医学	2022-0 2-25	154,79 0.00	1,000	14	3.20%	187.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6807	虹软科技	2022-0 2-25	150,36 0.00	4,000	14	3.20%	181.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6809	凯赛生物	2022-0 2-25	349,20 0.00	2,400	14	3.20%	421.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6811	圣湘生物	2022-0 2-25	118,96 8.00	2,400	14	3.20%	143.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6813	碧水源	2022-0 2-25	297,48 2.00	44,600	14	3.20%	359.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6815	万达信息	2022-0 2-25	300,42 3.00	23,900	14	3.20%	362.97	-	-
国泰君安股份有	202202 250001 6817	东方国信	2022-0 2-25	219,67 2.00	16,200	14	3.20%	265.41	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6819	蓝色光标	2022-0 2-25	393,56 8.00	50,200	14	3.20%	475.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6821	海新能科	2022-0 2-25	229,18 8.00	28,400	14	3.20%	276.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6823	长盈精密	2022-0 2-25	205,16 6.00	16,900	14	3.20%	247.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202202 250001 6825	长信科技	2022-0 2-25	480,15 0.00	49,500	14	3.20%	580.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6112	长信科技	2022-0 3-11	428,67 0.00	49,500	14	3.20%	517.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6114	长盈精密	2022-0 3-11	181,67 5.00	16,900	14	3.20%	219.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6116	海新能科	2022-0 3-11	193,68 8.00	28,400	14	3.20%	234.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6118	蓝色光标	2022-0 3-11	389,55 2.00	50,200	14	3.20%	470.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6120	东方国信	2022-0 3-11	211,08 6.00	16,200	14	3.20%	255.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6122	万达信息	2022-0 3-11	271,98 2.00	23,900	14	3.20%	328.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6124	碧水源	2022-0 3-11	272,95 2.00	44,600	14	3.20%	329.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6126	圣湘生物	2022-0 3-11	116,40 0.00	2,400	14	3.20%	140.63	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6128	凯赛生物	2022-0 3-11	269,44 8.00	2,400	14	3.20%	325.54	-	-	
国泰君安证券	202203 110001	虹软科技	2022-0 3-11	124,08 0.00	4,000	14	3.20%	149.91	-	-	

股份有限公司	6130										
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6132	南微医学	2022-0 3-11	137,62 0.00	1,000	14	3.20%	166.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6134	易华录	2022-0 3-11	169,57 7.00	6,700	14	3.20%	204.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6136	迪安诊断	2022-0 3-11	265,87 2.00	8,700	14	3.20%	321.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6138	中际旭创	2022-0 3-11	396,36 8.00	11,200	14	3.20%	478.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6140	国瓷材料	2022-0 3-11	571,21 2.00	16,200	14	3.20%	690.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6434	光线传媒	2022-0 3-11	205,08 4.00	23,600	14	3.20%	247.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6436	掌趣科技	2022-0 3-11	200,16 0.00	55,600	14	3.20%	241.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6438	我武生物	2022-0 3-11	255,33 9.00	6,300	14	3.20%	308.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6440	博腾股份	2022-0 3-11	591,63 0.00	6,500	14	3.20%	714.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6442	汤臣倍健	2022-0 3-11	389,53 8.00	17,100	14	3.20%	470.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6444	华策影视	2022-0 3-11	117,47 7.00	22,900	14	3.20%	141.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6446	信维通信	2022-0 3-11	379,47 0.00	19,500	14	3.20%	458.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6448	新宙邦	2022-0 3-11	485,92 5.00	5,700	14	3.20%	587.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203	红日药	2022-0	241,45	36,200	14	3.20%	291.73	-	-	

安证券股份有限公司	110001 6450	业	3-11	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6452	网宿科技	2022-0 3-11	309,73 8.00	49,400	14	3.20%	374.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6454	安科生物	2022-0 3-11	240,24 0.00	23,100	14	3.20%	290.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6456	捷成股份	2022-0 3-11	232,96 0.00	41,600	14	3.20%	281.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6458	寒锐钴业	2022-0 3-11	293,77 6.00	4,300	14	3.20%	354.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6460	普利制药	2022-0 3-11	244,40 0.00	5,200	14	3.20%	295.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6462	万孚生物	2022-0 3-11	370,51 2.00	6,200	14	3.20%	447.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6464	昆仑万维	2022-0 3-11	328,29 3.00	19,300	14	3.20%	396.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6466	迈克生物	2022-0 3-11	246,70 8.00	8,900	14	3.20%	298.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6468	康泰医学	2022-0 3-11	98,71 2.00	2,400	14	3.20%	119.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6470	光威复材	2022-0 3-11	419,43 0.00	6,200	14	3.20%	506.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6472	迈为股份	2022-0 3-11	546,54 0.00	1,000	14	3.20%	660.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6474	光环新网	2022-0 3-11	358,06 2.00	24,900	14	3.20%	432.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6476	卫宁健康	2022-0 3-11	344,96 2.00	34,600	14	3.20%	416.79	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202203 110001 6478	华宇软件	2022-0 3-11	174,34 8.00	16,700	14	3.20%	210.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4776	华宇软件	2022-0 3-25	162,99 2.00	16,700	14	3.20%	196.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4778	卫宁健康	2022-0 3-25	324,89 4.00	34,600	14	3.20%	392.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4780	光环新网	2022-0 3-25	329,67 6.00	24,900	14	3.20%	398.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4782	迈为股份	2022-0 3-25	489,39 0.00	1,000	14	3.20%	591.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4784	光威复材	2022-0 3-25	380,43 2.00	6,200	14	3.20%	459.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4786	康泰医学	2022-0 3-25	82,56 0.00	2,400	14	3.20%	99.75	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4788	迈克生物	2022-0 3-25	222,32 2.00	8,900	14	3.20%	268.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4790	昆仑万维	2022-0 3-25	321,15 2.00	19,300	14	3.20%	388.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4792	万孚生物	2022-0 3-25	293,94 2.00	6,200	14	3.20%	355.14	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4794	普利制药	2022-0 3-25	232,28 4.00	5,200	14	3.20%	280.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4796	寒锐钴业	2022-0 3-25	277,39 3.00	4,300	14	3.20%	335.15	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4798	捷成股份	2022-0 3-25	242,94 4.00	41,600	14	3.20%	293.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4800	安科生物	2022-0 3-25	228,92 1.00	23,100	14	3.20%	276.58	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4802	网宿科技	2022-0 3-25	292,44 8.00	49,400	14	3.20%	353.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4804	红日药业	2022-0 3-25	282,72 2.00	36,200	14	3.20%	341.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4806	新宙邦	2022-0 3-25	461,58 6.00	5,700	14	3.20%	557.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4808	信维通信	2022-0 3-25	358,80 0.00	19,500	14	3.20%	433.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4990	华策影视	2022-0 3-25	113,81 3.00	22,900	14	3.20%	137.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4992	汤臣倍健	2022-0 3-25	358,41 6.00	17,100	14	3.20%	433.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4994	博腾股份	2022-0 3-25	609,18 0.00	6,500	14	3.20%	736.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4996	掌趣科技	2022-0 3-25	198,49 2.00	55,600	14	3.20%	239.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 4998	我武生物	2022-0 3-25	247,59 0.00	6,300	14	3.20%	299.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5000	光线传媒	2022-0 3-25	188,09 2.00	23,600	14	3.20%	227.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5002	国瓷材料	2022-0 3-25	554,04 0.00	16,200	14	3.20%	669.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5004	中际旭创	2022-0 3-25	360,64 0.00	11,200	14	3.20%	435.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5006	迪安诊断	2022-0 3-25	238,98 9.00	8,700	14	3.20%	288.75	-	-	
国泰君安证券	202203 250001	易华录	2022-0 3-25	149,07 5.00	6,700	14	3.20%	180.12	-	-	

股份有限公司	5008										
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5010	南微医学	2022-0 3-25	127,33 0.00	1,000	14	3.20%	153.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5012	虹软科技	2022-0 3-25	117,04 0.00	4,000	14	3.20%	141.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5014	凯赛生物	2022-0 3-25	264,64 8.00	2,400	14	3.20%	319.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5016	圣湘生物	2022-0 3-25	103,92 0.00	2,400	14	3.20%	125.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5018	碧水源	2022-0 3-25	260,46 4.00	44,600	14	3.20%	314.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5020	万达信息	2022-0 3-25	253,81 8.00	23,900	14	3.20%	306.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5022	东方国信	2022-0 3-25	177,06 6.00	16,200	14	3.20%	213.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5024	蓝色光标	2022-0 3-25	408,62 8.00	50,200	14	3.20%	493.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5026	海新能科	2022-0 3-25	186,02 0.00	28,400	14	3.20%	224.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5028	长信科技	2022-0 3-25	415,80 0.00	49,500	14	3.20%	502.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202203 250001 5030	长盈精密	2022-0 3-25	170,01 4.00	16,900	14	3.20%	205.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 5491	长盈精密	2022-0 4-08	154,63 5.00	16,900	14	3.20%	186.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 5493	长信科技	2022-0 4-08	364,81 5.00	49,500	14	3.20%	440.77	-	-	
国泰君安	202204	海新能	2022-0	174,94	28,400	14	3.20%	211.37	-	-	

安证券股份有限公司	080001 5495	科	4-08	4.00							
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 5497	蓝色光标	2022-0 4-08	419,67 2.00	50,200	14	3.20%	507.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 5499	东方国信	2022-0 4-08	166,86 0.00	16,200	14	3.20%	201.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6451	万达信息	2022-0 4-08	235,89 3.00	23,900	14	3.20%	285.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6453	碧水源	2022-0 4-08	259,57 2.00	44,600	14	3.20%	313.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6455	圣湘生物	2022-0 4-08	102,38 4.00	2,400	14	3.20%	123.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6457	凯赛生物	2022-0 4-08	260,37 6.00	2,400	14	3.20%	314.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6459	虹软科技	2022-0 4-08	108,08 0.00	4,000	14	3.20%	130.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6461	南微医学	2022-0 4-08	115,96 0.00	1,000	14	3.20%	140.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6463	易华录	2022-0 4-08	128,70 7.00	6,700	14	3.20%	155.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6465	迪安诊断	2022-0 4-08	238,81 5.00	8,700	14	3.20%	288.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6467	中际旭创	2022-0 4-08	346,08 0.00	11,200	14	3.20%	418.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6469	国瓷材料	2022-0 4-08	545,29 2.00	16,200	14	3.20%	658.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 080001 6471	光线传媒	2022-0 4-08	180,06 8.00	23,600	14	3.20%	217.55	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	2022040800016473	我武生物	2022-04-08	227,115.00	6,300	14	3.20%	274.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016475	掌趣科技	2022-04-08	200,716.00	55,600	14	3.20%	242.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016477	博腾股份	2022-04-08	566,150.00	6,500	14	3.20%	684.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016479	汤臣倍健	2022-04-08	355,680.00	17,100	14	3.20%	429.73	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016481	华策影视	2022-04-08	112,439.00	22,900	14	3.20%	135.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016483	信维通信	2022-04-08	332,280.00	19,500	14	3.20%	401.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016485	新宙邦	2022-04-08	455,259.00	5,700	14	3.20%	550.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016487	红日药业	2022-04-08	284,532.00	36,200	14	3.20%	343.77	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016489	网宿科技	2022-04-08	274,170.00	49,400	14	3.20%	331.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016491	安科生物	2022-04-08	211,134.00	23,100	14	3.20%	255.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016493	捷成股份	2022-04-08	236,704.00	41,600	14	3.20%	285.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016495	寒锐钴业	2022-04-08	258,688.00	4,300	14	3.20%	312.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016497	普利制药	2022-04-08	218,868.00	5,200	14	3.20%	264.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016499	万孚生物	2022-04-08	279,620.00	6,200	14	3.20%	337.84	-	-

限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016501	昆仑万维	2022-04-08	315,362.00	19,300	14	3.20%	381.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016503	迈克生物	2022-04-08	203,009.00	8,900	14	3.20%	245.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016505	康泰医学	2022-04-08	75,936.00	2,400	14	3.20%	91.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016507	迈为股份	2022-04-08	508,500.00	1,000	14	3.20%	614.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016509	光威复材	2022-04-08	334,800.00	6,200	14	3.20%	404.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016511	光环新网	2022-04-08	314,985.00	24,900	14	3.20%	380.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016513	卫宁健康	2022-04-08	302,750.00	34,600	14	3.20%	365.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022040800016515	华宇软件	2022-04-08	152,972.00	16,700	14	3.20%	184.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013966	卫宁健康	2022-04-22	267,804.00	34,600	14	3.20%	323.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013968	光环新网	2022-04-22	260,454.00	24,900	14	3.20%	314.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013970	光威复材	2022-04-22	289,168.00	6,200	14	3.20%	349.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013972	迈为股份	2022-04-22	324,110.00	1,000	14	3.20%	391.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022042200013974	康泰医学	2022-04-22	68,112.00	2,400	14	3.20%	82.29	-	-	
国泰君安证券	202204220001	迈克生物	2022-04-22	178,356.00	8,900	14	3.20%	215.49	-	-	

股份有限公司	3976										
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3978	昆仑万维	2022-0 4-22	277,14 8.00	19,300	14	3.20%	334.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3980	万孚生物	2022-0 4-22	288,79 6.00	6,200	14	3.20%	348.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3982	普利制药	2022-0 4-22	134,42 0.00	5,200	14	3.20%	162.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3984	寒锐钴业	2022-0 4-22	231,85 6.00	4,300	14	3.20%	280.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3986	捷成股份	2022-0 4-22	197,60 0.00	41,600	14	3.20%	238.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3988	安科生物	2022-0 4-22	188,03 4.00	23,100	14	3.20%	227.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3990	网宿科技	2022-0 4-22	250,45 8.00	49,400	14	3.20%	302.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3992	红日药业	2022-0 4-22	211,40 8.00	36,200	14	3.20%	255.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3994	新宙邦	2022-0 4-22	381,61 5.00	5,700	14	3.20%	461.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3996	信维通信	2022-0 4-22	300,69 0.00	19,500	14	3.20%	363.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 3998	华策影视	2022-0 4-22	102,59 2.00	22,900	14	3.20%	123.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4000	汤臣倍健	2022-0 4-22	344,56 5.00	17,100	14	3.20%	416.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4002	博腾股份	2022-0 4-22	493,35 0.00	6,500	14	3.20%	596.07	-	-	
国泰君安	202204	掌趣科	2022-0	184,03	55,600	14	3.20%	222.35	-	-	

安证券股份有限公司	220001 4004	技	4-22	6.00							
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4006	我武生物	2022-0 4-22	213,88 5.00	6,300	14	3.20%	258.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4008	光线传媒	2022-0 4-22	161,66 0.00	23,600	14	3.20%	195.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4010	国瓷材料	2022-0 4-22	490,69 8.00	16,200	14	3.20%	592.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4012	中际旭创	2022-0 4-22	322,22 4.00	11,200	14	3.20%	389.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4014	迪安诊断	2022-0 4-22	244,47 0.00	8,700	14	3.20%	295.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4016	南微医学	2022-0 4-22	108,14 0.00	1,000	14	3.20%	130.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4018	易华录	2022-0 4-22	110,34 9.00	6,700	14	3.20%	133.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4020	虹软科技	2022-0 4-22	98,60 0.00	4,000	14	3.20%	119.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4022	凯赛生物	2022-0 4-22	213,24 0.00	2,400	14	3.20%	257.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4024	圣湘生物	2022-0 4-22	103,77 6.00	2,400	14	3.20%	125.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4026	碧水源	2022-0 4-22	223,44 6.00	44,600	14	3.20%	269.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4028	万达信息	2022-0 4-22	211,75 4.00	23,900	14	3.20%	255.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4030	东方国信	2022-0 4-22	143,20 8.00	16,200	14	3.20%	173.02	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4032	蓝色光标	2022-0 4-22	310,23 6.00	50,200	14	3.20%	374.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4034	海新能科	2022-0 4-22	134,61 6.00	28,400	14	3.20%	162.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4036	长信科技	2022-0 4-22	321,75 0.00	49,500	14	3.20%	388.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202204 220001 4038	长盈精密	2022-0 4-22	134,52 4.00	16,900	14	3.20%	162.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4207	长盈精密	2022-0 5-06	126,24 3.00	16,900	14	3.20%	152.52	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4209	长信科技	2022-0 5-06	289,57 5.00	49,500	14	3.20%	349.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4211	海新能科	2022-0 5-06	118,42 8.00	28,400	14	3.20%	143.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4213	蓝色光标	2022-0 5-06	276,10 0.00	50,200	14	3.20%	333.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4215	东方国信	2022-0 5-06	137,37 6.00	16,200	14	3.20%	165.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4217	万达信息	2022-0 5-06	196,69 7.00	23,900	14	3.20%	237.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4219	碧水源	2022-0 5-06	200,25 4.00	44,600	14	3.20%	241.94	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4221	圣湘生物	2022-0 5-06	109,20 0.00	2,400	14	3.20%	131.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4223	凯赛生物	2022-0 5-06	209,97 6.00	2,400	14	3.20%	253.69	-	-
国泰君安股份有	202205 060001 4225	虹软科技	2022-0 5-06	89,36 0.00	4,000	14	3.20%	107.96	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4227	易华录	2022-0 5-06	99,16 0.00	6,700	14	3.20%	119.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4229	南微医学	2022-0 5-06	96,08 0.00	1,000	14	3.20%	116.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4231	迪安诊断	2022-0 5-06	322,85 7.00	8,700	14	3.20%	390.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4233	中际旭创	2022-0 5-06	357,84 0.00	11,200	14	3.20%	432.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4235	国瓷材料	2022-0 5-06	513,37 8.00	16,200	14	3.20%	620.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4237	光线传媒	2022-0 5-06	160,24 4.00	23,600	14	3.20%	193.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4239	我武生物	2022-0 5-06	278,96 4.00	6,300	14	3.20%	337.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4241	掌趣科技	2022-0 5-06	161,79 6.00	55,600	14	3.20%	195.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4243	博腾股份	2022-0 5-06	457,92 5.00	6,500	14	3.20%	553.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4245	汤臣倍健	2022-0 5-06	332,76 6.00	17,100	14	3.20%	402.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4247	华策影视	2022-0 5-06	95,49 3.00	22,900	14	3.20%	115.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4249	信维通信	2022-0 5-06	286,65 0.00	19,500	14	3.20%	346.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4251	新宙邦	2022-0 5-06	386,80 2.00	5,700	14	3.20%	467.33	-	-	
国泰君安证券	202205 060001	红日药业	2022-0 5-06	216,11 4.00	36,200	14	3.20%	261.11	-	-	

股份有限公司	4253										
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4255	网宿科技	2022-0 5-06	239,09 6.00	49,400	14	3.20%	288.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4257	安科生物	2022-0 5-06	210,21 0.00	23,100	14	3.20%	253.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4259	捷成股份	2022-0 5-06	201,76 0.00	41,600	14	3.20%	243.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4261	寒锐钴业	2022-0 5-06	216,20 4.00	4,300	14	3.20%	261.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4263	普利制药	2022-0 5-06	142,74 0.00	5,200	14	3.20%	172.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4265	万孚生物	2022-0 5-06	281,23 2.00	6,200	14	3.20%	339.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4267	昆仑万维	2022-0 5-06	274,83 2.00	19,300	14	3.20%	332.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4269	迈克生物	2022-0 5-06	172,12 6.00	8,900	14	3.20%	207.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4271	康泰医学	2022-0 5-06	64,80 0.00	2,400	14	3.20%	78.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4273	迈为股份	2022-0 5-06	321,80 0.00	1,000	14	3.20%	388.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4275	光威复材	2022-0 5-06	308,07 8.00	6,200	14	3.20%	372.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4277	光环新网	2022-0 5-06	239,04 0.00	24,900	14	3.20%	288.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202205 060001 4279	卫宁健康	2022-0 5-06	279,22 2.00	34,600	14	3.20%	337.36	-	-	
国泰君安	202206	宋城演	2022-0	110,52	7,200	14	3.20%	133.53	-	-	

安证券股份有限公司	300000 1833	艺	6-30	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1836	长信科技	2022-0 6-30	200,34 0.00	27,000	14	3.20%	242.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1840	碧水源	2022-0 6-30	52,10 0.00	10,000	14	3.20%	62.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1846	海新能科	2022-0 6-30	102,71 8.00	20,300	14	3.20%	124.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1850	汤臣倍健	2022-0 6-30	28,14 5.00	1,300	14	3.20%	34.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1860	我武生物	2022-0 6-30	62,43 6.00	1,200	14	3.20%	75.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1870	昆仑万维	2022-0 6-30	68,80 0.00	4,300	14	3.20%	83.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1874	中际旭创	2022-0 6-30	68,31 0.00	2,200	14	3.20%	82.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1878	光线传媒	2022-0 6-30	50,19 1.00	5,300	14	3.20%	60.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1882	国瓷材料	2022-0 6-30	132,90 4.00	3,700	14	3.20%	160.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1884	卫宁健康	2022-0 6-30	35,12 0.00	4,000	14	3.20%	42.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1910	蓝色光标	2022-0 6-30	74,44 2.00	11,400	14	3.20%	89.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1912	网宿科技	2022-0 6-30	34,30 4.00	6,400	14	3.20%	41.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1916	特锐德	2022-0 6-30	51,93 0.00	3,000	14	3.20%	62.74	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1918	华测检测	2022-0 6-30	176,39 6.00	7,600	14	3.20%	213.13	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1922	安科生物	2022-0 6-30	53,58 3.00	5,300	14	3.20%	64.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1930	万孚生物	2022-0 6-30	48,85 2.00	1,200	14	3.20%	59.02	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1936	光威复材	2022-0 6-30	82,41 8.00	1,400	14	3.20%	99.57	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1972	杭可科技	2022-0 6-30	140,12 0.00	2,000	14	3.20%	169.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1974	寒武纪	2022-0 6-30	155,28 0.00	2,400	14	3.20%	187.61	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202206 300000 1982	南微医学	2022-0 6-30	95,92 0.00	1,100	14	3.20%	115.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 010000 0897	柏楚电子	2022-0 7-01	296,03 0.00	1,400	14	3.20%	357.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 060000 1571	南微医学	2022-0 7-06	143,98 4.00	1,600	14	3.20%	173.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 070000 1128	芯原股份	2022-0 7-07	435,34 4.00	9,200	14	3.20%	525.98	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 070000 1138	杭可科技	2022-0 7-07	72,62 0.00	1,000	14	3.20%	87.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0596	蓝色光标	2022-0 7-14	67,26 0.00	11,400	14	3.20%	81.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0598	安科生物	2022-0 7-14	51,46 3.00	5,300	14	3.20%	62.17	-	-
国泰君安股份有	202207 140001 0600	光威复材	2022-0 7-14	92,91 8.00	1,400	14	3.20%	112.26	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0714	寒武纪	2022-0 7-14	144,64 8.00	2,400	14	3.20%	174.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 0718	南微医学	2022-0 7-14	90,86 0.00	1,100	14	3.20%	109.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 1790	宋城演艺	2022-0 7-14	93,96 0.00	7,200	14	3.20%	113.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 1792	长信科技	2022-0 7-14	187,11 0.00	27,000	14	3.20%	226.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3424	碧水源	2022-0 7-14	49,80 0.00	10,000	14	3.20%	60.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3426	海新能科	2022-0 7-14	104,13 9.00	20,300	14	3.20%	125.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3428	汤臣倍健	2022-0 7-14	25,11 6.00	1,300	14	3.20%	30.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3430	我武生物	2022-0 7-14	63,26 4.00	1,200	14	3.20%	76.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3432	昆仑万维	2022-0 7-14	63,33 9.00	4,300	14	3.20%	76.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3434	中际旭创	2022-0 7-14	64,90 0.00	2,200	14	3.20%	78.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3436	光线传媒	2022-0 7-14	44,20 2.00	5,300	14	3.20%	53.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3438	国瓷材料	2022-0 7-14	118,36 3.00	3,700	14	3.20%	143.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3440	卫宁健康	2022-0 7-14	32,48 0.00	4,000	14	3.20%	39.24	-	-	
国泰君安证券	202207 140001	华测检测	2022-0 7-14	166,28 8.00	7,600	14	3.20%	200.91	-	-	

股份有限公司	3442										
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3500	网宿科技	2022-0 7-14	33,08 8.00	6,400	14	3.20%	39.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3502	特锐德	2022-0 7-14	57,03 0.00	3,000	14	3.20%	68.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3504	万孚生物	2022-0 7-14	48,43 2.00	1,200	14	3.20%	58.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 140001 3506	杭可科技	2022-0 7-14	142,58 0.00	2,000	14	3.20%	172.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 150000 0949	杭可科技	2022-0 7-15	70,19 0.00	1,000	14	3.20%	84.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 150001 4333	柏楚电子	2022-0 7-15	280,75 6.00	1,400	14	3.20%	339.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 180000 1461	光线传媒	2022-0 7-18	38,18 0.00	4,600	14	3.20%	46.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 0932	光线传媒	2022-0 7-19	18,34 8.00	2,200	14	3.20%	22.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 0938	晶晨股份	2022-0 7-19	81,99 0.00	1,000	14	3.20%	99.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 190000 1002	东方国信	2022-0 7-19	25,39 6.00	2,800	14	3.20%	30.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 200001 3389	南微医学	2022-0 7-20	133,18 4.00	1,600	14	3.20%	160.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1084	长信科技	2022-0 7-21	163,50 6.00	22,900	14	3.20%	197.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 210000 1086	汤臣倍健	2022-0 7-21	25,06 4.00	1,300	14	3.20%	30.28	-	-	
国泰君安	202207	芯原股	2022-0	441,60	9,200	14	3.20%	533.54	-	-	

安证券股份有限公司	210000 8558	份	7-21	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202207 250000 1048	杭可科技	2022-0 7-25	94,75 7.00	1,300	14	3.20%	114.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 260000 1022	中国通号	2022-0 7-26	220,94 1.00	50,100	14	3.20%	266.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280000 1382	万达信息	2022-0 7-28	90,33 6.00	9,600	14	3.20%	109.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1729	海新能科	2022-0 7-28	103,53 0.00	20,300	14	3.20%	125.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1731	我武生物	2022-0 7-28	56,04 0.00	1,200	14	3.20%	67.71	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1737	光线传媒	2022-0 7-28	45,05 0.00	5,300	14	3.20%	54.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1745	光威复材	2022-0 7-28	98,02 8.00	1,400	14	3.20%	118.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1747	汤臣倍健	2022-0 7-28	24,59 6.00	1,300	14	3.20%	29.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 1999	杭可科技	2022-0 7-28	141,92 0.00	2,000	14	3.20%	171.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2941	宋城演艺	2022-0 7-28	96,55 2.00	7,200	14	3.20%	116.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2945	国瓷材料	2022-0 7-28	119,95 4.00	3,700	14	3.20%	144.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2951	长信科技	2022-0 7-28	196,83 0.00	27,000	14	3.20%	237.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2953	中际旭创	2022-0 7-28	73,59 0.00	2,200	14	3.20%	88.91	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2959	华测检测	2022-0 7-28	161,19 6.00	7,600	14	3.20%	194.76	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2961	特锐德	2022-0 7-28	56,31 0.00	3,000	14	3.20%	68.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 2965	寒武纪	2022-0 7-28	150,76 8.00	2,400	14	3.20%	182.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 280001 3413	南微医学	2022-0 7-28	98,34 0.00	1,100	14	3.20%	118.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290000 1618	中国通号	2022-0 7-29	190,08 7.00	43,300	14	3.20%	229.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290001 6308	杭可科技	2022-0 7-29	74,64 0.00	1,000	14	3.20%	90.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202207 290001 6726	柏楚电子	2022-0 7-29	346,20 6.00	1,400	14	3.20%	418.28	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 010000 1036	光线传媒	2022-0 8-01	62,12 3.00	7,300	14	3.20%	75.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 010000 1038	迈克生物	2022-0 8-01	224,05 5.00	11,700	14	3.20%	270.70	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 010000 1040	光威复材	2022-0 8-01	72,35 0.00	1,000	14	3.20%	87.42	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 010000 1054	天能股份	2022-0 8-01	182,99 4.00	4,200	14	3.20%	221.10	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 020000 9441	东方国信	2022-0 8-02	23,82 8.00	2,800	14	3.20%	28.79	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202208 020001 1131	晶晨股份	2022-0 8-02	88,76 0.00	1,000	14	3.20%	107.24	-	-
国泰君安股份有	202208 030000 1535	晶晨股份	2022-0 8-03	91,67 0.00	1,000	14	3.20%	110.76	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001593	新宙邦	2022-08-03	58,851.00	1,300	14	3.20%	71.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001601	天华超净	2022-08-03	89,100.00	1,200	14	3.20%	107.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080300001603	华测检测	2022-08-03	141,050.00	7,000	14	3.20%	170.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002228	我武生物	2022-08-04	66,892.00	1,400	14	3.20%	80.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002270	晶晨股份	2022-08-04	581,374.00	6,200	14	3.20%	702.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002294	新宙邦	2022-08-04	89,160.00	2,000	14	3.20%	107.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002298	网宿科技	2022-08-04	127,239.00	24,900	14	3.20%	153.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080400002300	国瓷材料	2022-08-04	131,600.00	4,000	14	3.20%	159.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080500001579	国瓷材料	2022-08-05	197,896.00	5,800	14	3.20%	239.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080800001380	芯原股份	2022-08-08	536,116.00	8,200	14	3.20%	647.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022080800001430	光环新网	2022-08-08	328,656.00	33,400	14	3.20%	397.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022081100012962	光线传媒	2022-08-11	48,336.00	5,300	14	3.20%	58.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	2022081100013350	寒武纪	2022-08-11	167,496.00	2,400	14	3.20%	202.37	-	-	
国泰君安证券	202208110001	杭可科技	2022-08-11	157,660.00	2,000	14	3.20%	190.49	-	-	

股份有限公司	3428										
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5108	宋城演艺	2022-0 8-11	91,29 6.00	7,200	14	3.20%	110.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 110001 5136	中际旭创	2022-0 8-11	77,17 6.00	2,200	14	3.20%	93.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 120000 1237	迪安诊断	2022-0 8-12	79,45 0.00	2,500	14	3.20%	95.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1558	中国通号	2022-0 8-15	214,85 5.00	48,500	14	3.20%	259.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1578	长信科技	2022-0 8-15	25,97 6.00	3,400	14	3.20%	31.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150000 1580	华测检测	2022-0 8-15	184,49 7.00	8,900	14	3.20%	222.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150001 7127	光线传媒	2022-0 8-15	65,77 3.00	7,300	14	3.20%	79.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 150001 7131	天能股份	2022-0 8-15	178,62 6.00	4,200	14	3.20%	215.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 160001 0468	晶晨股份	2022-0 8-16	94,45 0.00	1,000	14	3.20%	114.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 170000 2038	信维通信	2022-0 8-17	18,37 0.00	1,000	14	3.20%	22.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 220000 1660	网宿科技	2022-0 8-22	10,07 0.00	1,900	14	3.20%	12.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 260000 1283	东方国信	2022-0 8-26	18,63 4.00	2,200	14	3.20%	22.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202208 300000 1604	光线传媒	2022-0 8-30	11,98 6.00	1,300	14	3.20%	14.49	-	-	
国泰君安	202208	中国通	2022-0	30,19	6,800	14	3.20%	36.48	-	-	

安证券股份有限公司	300000 1619	号	8-30	2.00							
国泰君安证券股份有限公司	202208 310000 1456	红日药业	2022-0 8-31	26,36 7.00	4,700	14	3.20%	31.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1390	万达信息	2022-0 9-01	9,317. 00	1,100	14	3.20%	11.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1391	光线传媒	2022-0 9-01	15,60 6.00	1,700	14	3.20%	18.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 010000 1394	海新能科	2022-0 9-01	19,88 8.00	4,400	14	3.20%	24.03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 060000 1120	昆仑万维	2022-0 9-06	18,52 5.00	1,300	14	3.20%	22.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 090002 3393	东方国信	2022-0 9-09	18,19 4.00	2,200	14	3.20%	21.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7115	中国通号	2022-0 9-13	30,19 2.00	6,800	14	3.20%	36.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 130002 7123	光线传媒	2022-0 9-13	11,81 7.00	1,300	14	3.20%	14.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2123	寒武纪	2022-0 9-14	98,70 0.00	1,400	14	3.20%	119.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2251	国瓷材料	2022-0 9-14	69,51 0.00	2,100	14	3.20%	83.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2257	海新能科	2022-0 9-14	15,64 0.00	3,400	14	3.20%	18.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2263	捷成股份	2022-0 9-14	47,61 6.00	9,300	14	3.20%	57.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2269	东方国信	2022-0 9-14	35,08 8.00	4,300	14	3.20%	42.40	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2271	华测检测	2022-0 9-14	38,66 4.00	1,800	14	3.20%	46.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2272	新宙邦	2022-0 9-14	53,49 5.00	1,300	14	3.20%	64.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140000 2275	红日药业	2022-0 9-14	45,44 1.00	8,100	14	3.20%	54.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 140001 7792	红日药业	2022-0 9-14	26,36 7.00	4,700	14	3.20%	31.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 3639	海新能科	2022-0 9-15	19,49 2.00	4,400	14	3.20%	23.55	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 150001 3641	万达信息	2022-0 9-15	9,042. 00	1,100	14	3.20%	10.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 190000 1738	特锐德	2022-0 9-19	28,10 1.00	1,900	14	3.20%	50.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 210000 1162	迈克生物	2022-0 9-21	23,22 6.00	1,400	14	3.20%	38.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 260000 1155	宋城演艺	2022-0 9-26	12,34 0.00	1,000	14	3.20%	14.91	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270000 1522	网宿科技	2022-0 9-27	8,968. 00	1,900	14	3.20%	10.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 270002 5845	光线传媒	2022-0 9-27	9,841. 00	1,300	14	3.20%	11.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5821	新宙邦	2022-0 9-28	54,36 6.00	1,300	14	3.20%	65.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202209 280001 5827	国瓷材料	2022-0 9-28	63,02 1.00	2,100	14	3.20%	76.15	-	-
国泰君安股份有	202209 290000 0811	昆仑万维	2022-0 9-29	23,59 8.00	1,900	14	3.20%	28.51	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0815	捷成股份	2022-0 9-29	41,95 2.00	9,200	14	3.20%	50.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0821	红日药业	2022-0 9-29	40,16 0.00	8,000	14	3.20%	48.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202209 290000 0825	机器人	2022-0 9-29	49,00 5.00	5,500	14	3.20%	59.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1447	迈克生物	2022-1 0-10	23,17 0.00	1,400	14	3.20%	27.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 100010 1475	宋城演艺	2022-1 0-10	11,20 0.00	1,000	14	3.20%	13.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 110002 5837	光线传媒	2022-1 0-11	8,840. 00	1,300	14	3.20%	10.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1955	光线传媒	2022-1 0-12	7,733. 00	1,100	14	3.20%	9.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1983	捷成股份	2022-1 0-12	8,702. 00	1,900	14	3.20%	10.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120000 1987	红日药业	2022-1 0-12	8,806. 00	1,700	14	3.20%	10.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 120001 7940	国瓷材料	2022-1 0-12	54,24 3.00	2,100	14	3.20%	65.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130000 1082	网宿科技	2022-1 0-13	17,22 0.00	3,500	14	3.20%	20.81	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 7634	捷成股份	2022-1 0-13	42,13 6.00	9,200	14	3.20%	50.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 130001 7638	机器人	2022-1 0-13	49,44 5.00	5,500	14	3.20%	59.74	-	-	
国泰君安证券	202210 130001	红日药业	2022-1 0-13	42,24 0.00	8,000	14	3.20%	51.04	-	-	

股份有限公司	7644										
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1963	昆仑万维	2022-1 0-18	20,68 8.00	1,600	14	3.20%	25.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 180000 1967	海新能科	2022-1 0-18	24,69 6.00	5,600	14	3.20%	29.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1155	光线传媒	2022-1 0-20	15,44 4.00	2,200	14	3.20%	18.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1158	特锐德	2022-1 0-20	37,15 2.00	2,400	14	3.20%	44.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1160	昆仑万维	2022-1 0-20	30,81 6.00	2,400	14	3.20%	37.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1162	国瓷材料	2022-1 0-20	46,51 2.00	1,900	14	3.20%	56.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 200000 1170	寒锐钴业	2022-1 0-20	44,43 0.00	1,000	14	3.20%	53.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2677	迈克生物	2022-1 0-24	29,09 2.00	1,400	14	3.20%	35.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 240007 2731	宋城演艺	2022-1 0-24	11,11 0.00	1,000	14	3.20%	13.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 250002 6364	光线传媒	2022-1 0-25	8,658. 00	1,300	14	3.20%	10.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9816	国瓷材料	2022-1 0-26	49,81 2.00	2,100	14	3.20%	60.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 260001 9902	光线传媒	2022-1 0-26	7,711. 00	1,100	14	3.20%	9.32	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8505	机器人	2022-1 0-27	50,71 0.00	5,500	14	3.20%	61.27	-	-	
国泰君安	202210	红日药	2022-1	56,72	8,000	14	3.20%	68.52	-	-	

安证券股份有限公司	270001 8507	业	0-27	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202210 270001 8611	捷成股份	2022-1 0-27	42,68 8.00	9,200	14	3.20%	51.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 7446	海新能科	2022-1 1-01	23,24 0.00	5,600	14	3.20%	28.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 010000 8318	昆仑万维	2022-1 1-01	21,34 4.00	1,600	14	3.20%	25.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5971	特锐德	2022-1 1-03	38,18 4.00	2,400	14	3.20%	46.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5973	国瓷材料	2022-1 1-03	48,27 9.00	1,900	14	3.20%	58.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5981	寒锐钴业	2022-1 1-03	42,86 0.00	1,000	14	3.20%	51.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 030000 5983	昆仑万维	2022-1 1-03	32,01 6.00	2,400	14	3.20%	38.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 8937	迈克生物	2022-1 1-07	27,17 4.00	1,400	14	3.20%	32.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 070009 9019	宋城演艺	2022-1 1-07	13,57 0.00	1,000	14	3.20%	16.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 090001 6379	国瓷材料	2022-1 1-09	55,58 7.00	2,100	14	3.20%	67.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 8660	捷成股份	2022-1 1-10	45,17 2.00	9,200	14	3.20%	54.57	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9566	机器人	2022-1 1-10	57,91 5.00	5,500	14	3.20%	69.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202211 100001 9568	红日药业	2022-1 1-10	54,88 0.00	8,000	14	3.20%	66.31	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 8706	海新能科	2022-1 1-15	24,13 6.00	5,600	14	3.20%	29.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202211 150000 9238	昆仑万维	2022-1 1-15	23,48 8.00	1,600	14	3.20%	28.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 1972	易事特	2022-1 2-20	7,953. 00	1,100	14	3.20%	7.58	7,513. 00	7.81
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 1986	捷成股份	2022-1 2-20	556,54 2.00	126,20 0	14	3.20%	528.32	564,11 4.00	544.17
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2004	普利制药	2022-1 2-20	85,17 3.00	3,300	14	3.20%	80.84	81,37 8.00	83.27
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2034	虹软科技	2022-1 2-20	32,20 0.00	1,400	14	3.20%	30.54	31,51 4.00	31.46
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2044	道通科技	2022-1 2-20	358,53 0.00	11,100	14	3.20%	340.36	350,20 5.00	350.57
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2355	红日药业	2022-1 2-20	419,48 2.00	72,200	14	3.20%	398.24	410,09 6.00	410.19
国泰君安证券股份有限公司	202212 200000 2357	蓝色光标	2022-1 2-20	697,65 6.00	141,80 0	14	3.20%	662.24	716,09 0.00	682.11
国泰君安证券股份有限公司	202212 210000 2451	长盈精密	2022-1 2-21	471,29 6.00	44,800	14	3.20%	406.70	462,78 4.00	418.90
国泰君安证券股份有限公司	202212 230000 0573	贝达药业	2022-1 2-23	111,52 7.00	2,300	14	3.20%	76.97	113,32 1.00	79.28
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 1971	安克创新	2022-1 2-27	102,17 0.00	1,700	14	3.20%	35.26	100,75 9.00	36.32
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 1973	新强联	2022-1 2-27	99,55 8.00	1,800	14	3.20%	34.37	95,90 4.00	35.40
国泰君安股份有	202212 270000 1974	蓝色光标	2022-1 2-27	32,53 8.00	6,600	14	3.20%	11.22	33,33 0.00	11.56

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 1977	华测检测	2022-1 2-27	600,32 0.00	26,800	14	3.20%	207.22	597,64 0.00	213.44	
国泰君安证券股份有限公司	202212 270000 1981	海新能科	2022-1 2-27	22,85 2.00	5,800	14	3.20%	7.88	25,28 8.00	8.12	
国泰君安证券股份有限公司	202212 290000 1416	海新能科	2022-1 2-29	252,64 8.00	63,800	14	3.20%	43.61	278,16 8.00	44.92	
国泰君安证券股份有限公司	202212 290000 1422	柏楚电子	2022-1 2-29	443,00 0.00	2,000	14	3.20%	76.47	434,16 0.00	78.76	
国泰君安证券股份有限公司	202212 300000 0854	道通科技	2022-1 2-30	41,01 5.00	1,300	14	3.20%	3.54	41,01 5.00	3.65	
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	202107 020000 0603	寒锐钴业	2021-0 7-02	340,00 1.00	4,300	14	3.20%	410.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0605	普利制药	2021-0 7-02	266,80 2.00	5,300	14	3.20%	322.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0607	光威复材	2021-0 7-02	427,80 0.00	6,200	14	3.20%	516.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0609	虹软科技	2021-0 7-02	290,12 5.00	5,500	14	3.20%	350.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0611	晶晨股份	2021-0 7-02	602,50 4.00	5,600	14	3.20%	727.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0613	道通科技	2021-0 7-02	423,85 0.00	4,900	14	3.20%	512.10	-	-	
国泰君安证券	202107 020000	南微医学	2021-0 7-02	324,51 1.00	1,100	14	3.20%	392.08	-	-	

股份有限公司	0615										
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0617	万孚生物	2021-0 7-02	333,82 8.00	5,400	14	3.20%	403.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0621	神州泰岳	2021-0 7-02	181,56 6.00	39,300	14	3.20%	219.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0623	安科生物	2021-0 7-02	329,98 9.00	22,900	14	3.20%	398.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0625	豆神教育	2021-0 7-02	79,23 0.00	13,900	14	3.20%	95.73	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0627	特锐德	2021-0 7-02	367,62 5.00	12,500	14	3.20%	444.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0629	新宙邦	2021-0 7-02	574,20 0.00	5,800	14	3.20%	693.75	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0631	蓝色光标	2021-0 7-02	235,01 1.00	39,900	14	3.20%	283.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0633	碧水源	2021-0 7-02	318,96 0.00	44,300	14	3.20%	385.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0635	网宿科技	2021-0 7-02	226,90 8.00	39,600	14	3.20%	274.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0637	机器人	2021-0 7-02	253,98 0.00	24,900	14	3.20%	306.85	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0639	红日药业	2021-0 7-02	158,76 0.00	36,000	14	3.20%	191.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0641	国瓷材料	2021-0 7-02	727,72 0.00	16,100	14	3.20%	879.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0643	利亚德	2021-0 7-02	323,51 9.00	40,900	14	3.20%	390.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107	中际旭	2021-0	411,54	11,400	14	3.20%	497.22	-	-	

安证券股份有限公司	020000 0645	创	7-02	0.00							
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0647	光线传媒	2021-0 7-02	247,10 4.00	23,400	14	3.20%	298.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0649	卫宁健康	2021-0 7-02	571,14 0.00	34,200	14	3.20%	690.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0651	华宇软件	2021-0 7-02	324,81 5.00	16,700	14	3.20%	392.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0653	光环新网	2021-0 7-02	304,88 5.00	21,700	14	3.20%	368.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0655	迈克生物	2021-0 7-02	342,26 8.00	8,200	14	3.20%	413.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0657	昆仑万维	2021-0 7-02	290,14 0.00	16,300	14	3.20%	350.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0659	掌趣科技	2021-0 7-02	239,51 0.00	55,700	14	3.20%	289.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0661	晶盛机电	2021-0 7-02	611,58 9.00	12,900	14	3.20%	738.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0663	我武生物	2021-0 7-02	314,08 0.00	5,200	14	3.20%	379.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0665	长盈精密	2021-0 7-02	293,91 5.00	14,500	14	3.20%	355.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0667	华策影视	2021-0 7-02	137,33 5.00	22,700	14	3.20%	165.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0669	汤臣倍健	2021-0 7-02	498,55 0.00	16,900	14	3.20%	602.35	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0671	三聚环保	2021-0 7-02	169,29 0.00	28,500	14	3.20%	204.53	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0673	长信科技	2021-0 7-02	392,80 0.00	49,100	14	3.20%	474.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0675	顺网科技	2021-0 7-02	125,22 7.00	9,700	14	3.20%	151.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0677	易华录	2021-0 7-02	202,21 2.00	8,200	14	3.20%	244.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0679	欣旺达	2021-0 7-02	657,69 6.00	22,100	14	3.20%	794.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0681	迪安诊断	2021-0 7-02	305,63 1.00	8,700	14	3.20%	369.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0683	东方国信	2021-0 7-02	197,31 6.00	16,200	14	3.20%	238.40	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0685	华峰超纤	2021-0 7-02	118,82 5.00	24,500	14	3.20%	143.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 020000 0687	捷成股份	2021-0 7-02	200,97 9.00	41,100	14	3.20%	242.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3834	捷成股份	2021-0 7-16	208,78 8.00	41,100	14	3.20%	252.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3836	欣旺达	2021-0 7-16	720,46 0.00	22,100	14	3.20%	870.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3838	易华录	2021-0 7-16	229,19 0.00	8,200	14	3.20%	276.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3840	迪安诊断	2021-0 7-16	283,44 6.00	8,700	14	3.20%	342.46	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3842	光线传媒	2021-0 7-16	237,74 4.00	23,400	14	3.20%	287.24	-	-
国泰君安股份有	202107 160001 3844	卫宁健康	2021-0 7-16	563,61 6.00	34,200	14	3.20%	680.96	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3846	华宇软件	2021-0 7-16	318,97 0.00	16,700	14	3.20%	385.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3848	国瓷材料	2021-0 7-16	749,61 6.00	16,100	14	3.20%	905.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3850	利亚德	2021-0 7-16	331,69 9.00	40,900	14	3.20%	400.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3852	中际旭创	2021-0 7-16	372,89 4.00	11,400	14	3.20%	450.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3854	掌趣科技	2021-0 7-16	237,83 9.00	55,700	14	3.20%	287.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3856	晶盛机电	2021-0 7-16	664,35 0.00	12,900	14	3.20%	802.67	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3858	我武生物	2021-0 7-16	369,20 0.00	5,200	14	3.20%	446.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3860	光环新网	2021-0 7-16	322,02 8.00	21,700	14	3.20%	389.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3862	昆仑万维	2021-0 7-16	303,66 9.00	16,300	14	3.20%	366.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3864	迈克生物	2021-0 7-16	303,97 4.00	8,200	14	3.20%	367.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3866	万孚生物	2021-0 7-16	307,74 6.00	5,400	14	3.20%	371.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3868	寒锐钴业	2021-0 7-16	382,18 4.00	4,300	14	3.20%	461.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 3870	普利制药	2021-0 7-16	243,85 3.00	5,300	14	3.20%	294.62	-	-	
国泰君安证券	202107 160001	特锐德	2021-0 7-16	398,50 0.00	12,500	14	3.20%	481.47	-	-	

股份有限公司	4262										
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4264	神州泰岳	2021-0 7-16	189,81 9.00	39,300	14	3.20%	229.34	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4266	安科生物	2021-0 7-16	370,29 3.00	22,900	14	3.20%	447.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4268	豆神教育	2021-0 7-16	69,08 3.00	13,900	14	3.20%	83.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4270	网宿科技	2021-0 7-16	236,80 8.00	39,600	14	3.20%	286.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4272	机器人	2021-0 7-16	251,98 8.00	24,900	14	3.20%	304.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4274	红日药业	2021-0 7-16	155,16 0.00	36,000	14	3.20%	187.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4276	新宙邦	2021-0 7-16	696,11 6.00	5,800	14	3.20%	841.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4278	蓝色光标	2021-0 7-16	235,41 0.00	39,900	14	3.20%	284.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4280	碧水源	2021-0 7-16	318,07 4.00	44,300	14	3.20%	384.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4282	三聚环保	2021-0 7-16	184,39 5.00	28,500	14	3.20%	222.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4284	长信科技	2021-0 7-16	426,67 9.00	49,100	14	3.20%	515.51	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4286	顺网科技	2021-0 7-16	135,80 0.00	9,700	14	3.20%	164.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4288	长盈精密	2021-0 7-16	273,76 0.00	14,500	14	3.20%	330.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107	华策影	2021-0	139,60	22,700	14	3.20%	168.67	-	-	

安证券股份有限公司	160001 4290	视	7-16	5.00							
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4292	汤臣倍健	2021-0 7-16	503,11 3.00	16,900	14	3.20%	607.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4294	东方国信	2021-0 7-16	190,02 6.00	16,200	14	3.20%	229.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4296	华峰超纤	2021-0 7-16	123,23 5.00	24,500	14	3.20%	148.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4298	光威复材	2021-0 7-16	435,67 4.00	6,200	14	3.20%	526.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4300	南微医学	2021-0 7-16	301,95 0.00	1,100	14	3.20%	364.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4302	虹软科技	2021-0 7-16	270,21 5.00	5,500	14	3.20%	326.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4304	晶晨股份	2021-0 7-16	537,60 0.00	5,600	14	3.20%	649.52	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 160001 4306	道通科技	2021-0 7-16	403,07 4.00	4,900	14	3.20%	486.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1850	晶盛机电	2021-0 7-30	823,79 4.00	12,900	14	3.20%	995.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1852	掌趣科技	2021-0 7-30	212,21 7.00	55,700	14	3.20%	256.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1854	中际旭创	2021-0 7-30	486,43 8.00	11,400	14	3.20%	587.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1856	利亚德	2021-0 7-30	388,95 9.00	40,900	14	3.20%	469.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1858	国瓷材料	2021-0 7-30	752,51 4.00	16,100	14	3.20%	909.18	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1860	华宇软件	2021-0 7-30	292,41 7.00	16,700	14	3.20%	353.30	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1862	卫宁健康	2021-0 7-30	491,79 6.00	34,200	14	3.20%	594.18	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1864	光线传媒	2021-0 7-30	208,02 6.00	23,400	14	3.20%	251.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1866	迪安诊断	2021-0 7-30	307,19 7.00	8,700	14	3.20%	371.16	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1868	易华录	2021-0 7-30	216,56 2.00	8,200	14	3.20%	261.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1870	欣旺达	2021-0 7-30	745,21 2.00	22,100	14	3.20%	900.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1872	捷成股份	2021-0 7-30	172,20 9.00	41,100	14	3.20%	208.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1874	道通科技	2021-0 7-30	390,82 4.00	4,900	14	3.20%	472.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1876	晶晨股份	2021-0 7-30	707,28 0.00	5,600	14	3.20%	854.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1878	虹软科技	2021-0 7-30	299,25 5.00	5,500	14	3.20%	361.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1880	南微医学	2021-0 7-30	303,11 6.00	1,100	14	3.20%	366.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1996	光威复材	2021-0 7-30	422,96 4.00	6,200	14	3.20%	511.03	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 1998	华峰超纤	2021-0 7-30	125,44 0.00	24,500	14	3.20%	151.55	-	-
国泰君安股份有	202107 300001 2000	东方国信	2021-0 7-30	173,34 0.00	16,200	14	3.20%	209.43	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2002	华策影视	2021-0 7-30	128,93 6.00	22,700	14	3.20%	155.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2004	汤臣倍健	2021-0 7-30	463,73 6.00	16,900	14	3.20%	560.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2006	长盈精密	2021-0 7-30	257,66 5.00	14,500	14	3.20%	311.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2082	顺网科技	2021-0 7-30	139,29 2.00	9,700	14	3.20%	168.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2084	三聚环保	2021-0 7-30	165,01 5.00	28,500	14	3.20%	199.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2086	长信科技	2021-0 7-30	440,42 7.00	49,100	14	3.20%	532.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2088	碧水源	2021-0 7-30	306,55 6.00	44,300	14	3.20%	370.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2090	蓝色光标	2021-0 7-30	219,05 1.00	39,900	14	3.20%	264.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2092	新宙邦	2021-0 7-30	661,20 0.00	5,800	14	3.20%	798.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2094	红日药业	2021-0 7-30	156,60 0.00	36,000	14	3.20%	189.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2096	机器人	2021-0 7-30	277,38 6.00	24,900	14	3.20%	335.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2098	网宿科技	2021-0 7-30	245,52 0.00	39,600	14	3.20%	296.64	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2100	豆神教育	2021-0 7-30	51,15 2.00	13,900	14	3.20%	61.81	-	-	
国泰君安证券	202107 300001	安科生物	2021-0 7-30	333,42 4.00	22,900	14	3.20%	402.84	-	-	

股份有限公司	2102										
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2104	神州泰岳	2021-0 7-30	178,81 5.00	39,300	14	3.20%	216.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2106	特锐德	2021-0 7-30	374,62 5.00	12,500	14	3.20%	452.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2108	普利制药	2021-0 7-30	232,14 0.00	5,300	14	3.20%	280.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2110	寒锐钴业	2021-0 7-30	380,12 0.00	4,300	14	3.20%	459.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2112	万孚生物	2021-0 7-30	291,54 6.00	5,400	14	3.20%	352.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2114	迈克生物	2021-0 7-30	295,20 0.00	8,200	14	3.20%	356.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2116	昆仑万维	2021-0 7-30	275,95 9.00	16,300	14	3.20%	333.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2118	光环新网	2021-0 7-30	350,45 5.00	21,700	14	3.20%	423.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202107 300001 2120	我武生物	2021-0 7-30	312,05 2.00	5,200	14	3.20%	377.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 2994	三聚环保	2021-0 8-13	166,44 0.00	28,500	14	3.20%	201.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 2996	长信科技	2021-0 8-13	423,24 2.00	49,100	14	3.20%	511.36	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 2998	顺网科技	2021-0 8-13	112,42 3.00	9,700	14	3.20%	135.83	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3000	长盈精密	2021-0 8-13	276,66 0.00	14,500	14	3.20%	334.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108	华策影	2021-0	123,71	22,700	14	3.20%	149.48	-	-	

安证券股份有限公司	130004 3002	视	8-13	5.00							
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3004	汤臣倍健	2021-0 8-13	504,46 5.00	16,900	14	3.20%	609.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3006	东方国信	2021-0 8-13	182,57 4.00	16,200	14	3.20%	220.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3008	华峰超纤	2021-0 8-13	137,20 0.00	24,500	14	3.20%	165.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3010	捷成股份	2021-0 8-13	213,30 9.00	41,100	14	3.20%	257.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3012	欣旺达	2021-0 8-13	939,25 0.00	22,100	14	3.20%	1,134. 80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3014	易华录	2021-0 8-13	283,80 2.00	8,200	14	3.20%	342.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3016	迪安诊断	2021-0 8-13	289,79 7.00	8,700	14	3.20%	350.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3018	光线传媒	2021-0 8-13	205,45 2.00	23,400	14	3.20%	248.22	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3020	卫宁健康	2021-0 8-13	478,80 0.00	34,200	14	3.20%	578.49	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3022	华宇软件	2021-0 8-13	297,26 0.00	16,700	14	3.20%	359.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3024	特锐德	2021-0 8-13	402,50 0.00	12,500	14	3.20%	486.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3026	神州泰岳	2021-0 8-13	219,29 4.00	39,300	14	3.20%	264.95	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3028	安科生物	2021-0 8-13	305,71 5.00	22,900	14	3.20%	369.37	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3030	豆神教育	2021-0 8-13	67,13 7.00	13,900	14	3.20%	81.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3032	网宿科技	2021-0 8-13	241,56 0.00	39,600	14	3.20%	291.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3034	机器人	2021-0 8-13	316,47 9.00	24,900	14	3.20%	382.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3036	红日药业	2021-0 8-13	166,68 0.00	36,000	14	3.20%	201.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3038	新宙邦	2021-0 8-13	670,48 0.00	5,800	14	3.20%	810.08	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3040	蓝色光标	2021-0 8-13	224,63 7.00	39,900	14	3.20%	271.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3042	碧水源	2021-0 8-13	322,06 1.00	44,300	14	3.20%	389.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3814	国瓷材料	2021-0 8-13	776,82 5.00	16,100	14	3.20%	938.56	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3816	利亚德	2021-0 8-13	380,77 9.00	40,900	14	3.20%	460.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3818	中际旭创	2021-0 8-13	461,01 6.00	11,400	14	3.20%	557.00	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3820	掌趣科技	2021-0 8-13	199,96 3.00	55,700	14	3.20%	241.59	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3822	晶盛机电	2021-0 8-13	799,80 0.00	12,900	14	3.20%	966.32	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3824	我武生物	2021-0 8-13	317,04 4.00	5,200	14	3.20%	383.05	-	-
国泰君安股份有	202108 130004 3826	光环新网	2021-0 8-13	340,90 7.00	21,700	14	3.20%	411.88	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3828	昆仑万维	2021-0 8-13	256,88 8.00	16,300	14	3.20%	310.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3830	迈克生物	2021-0 8-13	278,14 4.00	8,200	14	3.20%	336.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3832	万孚生物	2021-0 8-13	292,08 6.00	5,400	14	3.20%	352.89	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3834	寒锐钴业	2021-0 8-13	386,74 2.00	4,300	14	3.20%	467.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3836	普利制药	2021-0 8-13	244,96 6.00	5,300	14	3.20%	295.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3838	光威复材	2021-0 8-13	512,12 0.00	6,200	14	3.20%	618.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3840	南微医学	2021-0 8-13	296,56 0.00	1,100	14	3.20%	358.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3842	虹软科技	2021-0 8-13	249,15 0.00	5,500	14	3.20%	301.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3844	晶晨股份	2021-0 8-13	604,57 6.00	5,600	14	3.20%	730.45	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 130004 3846	道通科技	2021-0 8-13	423,75 2.00	4,900	14	3.20%	511.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3007	道通科技	2021-0 8-27	407,19 0.00	4,900	14	3.20%	491.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3009	晶晨股份	2021-0 8-27	625,80 0.00	5,600	14	3.20%	756.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3011	虹软科技	2021-0 8-27	224,67 5.00	5,500	14	3.20%	271.46	-	-	
国泰君安证券	202108 270001	光威复材	2021-0 8-27	463,63 6.00	6,200	14	3.20%	560.16	-	-	

股份有限公司	3013									
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3015	南微医学	2021-0 8-27	229,14 1.00	1,100	14	3.20%	276.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3017	普利制药	2021-0 8-27	217,30 0.00	5,300	14	3.20%	262.54	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3019	万孚生物	2021-0 8-27	241,75 8.00	5,400	14	3.20%	292.09	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3021	寒锐钴业	2021-0 8-27	420,19 6.00	4,300	14	3.20%	507.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3023	迈克生物	2021-0 8-27	242,72 0.00	8,200	14	3.20%	293.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3025	昆仑万维	2021-0 8-27	264,54 9.00	16,300	14	3.20%	319.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3027	光环新网	2021-0 8-27	315,73 5.00	21,700	14	3.20%	381.47	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3029	我武生物	2021-0 8-27	280,90 4.00	5,200	14	3.20%	339.39	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3031	晶盛机电	2021-0 8-27	925,70 4.00	12,900	14	3.20%	1,118. 44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3033	掌趣科技	2021-0 8-27	199,40 6.00	55,700	14	3.20%	240.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3035	中际旭创	2021-0 8-27	412,79 4.00	11,400	14	3.20%	498.74	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3037	利亚德	2021-0 8-27	410,22 7.00	40,900	14	3.20%	495.63	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3039	国瓷材料	2021-0 8-27	740,43 9.00	16,100	14	3.20%	894.60	-	-
国泰君安	202108	华宇软	2021-0	300,09	16,700	14	3.20%	362.58	-	-

安证券股份有限公司	270001 3041	件	8-27	9.00							
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3043	卫宁健康	2021-0 8-27	467,17 2.00	34,200	14	3.20%	564.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3045	光线传媒	2021-0 8-27	214,57 8.00	23,400	14	3.20%	259.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3047	迪安诊断	2021-0 8-27	272,39 7.00	8,700	14	3.20%	329.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3049	易华录	2021-0 8-27	275,60 2.00	8,200	14	3.20%	332.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3051	欣旺达	2021-0 8-27	903,89 0.00	22,100	14	3.20%	1,092. 08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3053	捷成股份	2021-0 8-27	193,58 1.00	41,100	14	3.20%	233.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3055	华峰超纤	2021-0 8-27	131,81 0.00	24,500	14	3.20%	159.25	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3057	东方国信	2021-0 8-27	162,97 2.00	16,200	14	3.20%	196.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3059	汤臣倍健	2021-0 8-27	456,13 1.00	16,900	14	3.20%	551.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3061	华策影视	2021-0 8-27	126,43 9.00	22,700	14	3.20%	152.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3063	长盈精密	2021-0 8-27	245,05 0.00	14,500	14	3.20%	296.07	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3065	顺网科技	2021-0 8-27	100,88 0.00	9,700	14	3.20%	121.88	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3067	长信科技	2021-0 8-27	349,10 1.00	49,100	14	3.20%	421.79	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3069	三聚环保	2021-0 8-27	176,70 0.00	28,500	14	3.20%	213.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3071	碧水源	2021-0 8-27	320,28 9.00	44,300	14	3.20%	386.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3073	蓝色光标	2021-0 8-27	228,62 7.00	39,900	14	3.20%	276.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3075	新宙邦	2021-0 8-27	586,20 6.00	5,800	14	3.20%	708.25	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3077	红日药业	2021-0 8-27	161,28 0.00	36,000	14	3.20%	194.85	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3079	机器人	2021-0 8-27	269,91 6.00	24,900	14	3.20%	326.12	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3081	网宿科技	2021-0 8-27	242,74 8.00	39,600	14	3.20%	293.29	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3083	安科生物	2021-0 8-27	280,52 5.00	22,900	14	3.20%	338.93	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3085	豆神教育	2021-0 8-27	64,49 6.00	13,900	14	3.20%	77.92	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3087	神州泰岳	2021-0 8-27	198,85 8.00	39,300	14	3.20%	240.26	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202108 270001 3089	特锐德	2021-0 8-27	403,50 0.00	12,500	14	3.20%	487.50	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6867	道通科技	2021-0 9-10	403,27 0.00	4,900	14	3.20%	487.23	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6869	晶晨股份	2021-0 9-10	630,00 0.00	5,600	14	3.20%	761.16	-	-
国泰君安股份有	202109 100001 6871	虹软科技	2021-0 9-10	235,56 5.00	5,500	14	3.20%	284.61	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6873	光威复材	2021-0 9-10	444,91 2.00	6,200	14	3.20%	537.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6875	南微医学	2021-0 9-10	224,10 3.00	1,100	14	3.20%	270.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6877	普利制药	2021-0 9-10	207,23 0.00	5,300	14	3.20%	250.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6879	寒锐钴业	2021-0 9-10	385,92 5.00	4,300	14	3.20%	466.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6881	万孚生物	2021-0 9-10	222,21 0.00	5,400	14	3.20%	268.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6883	迈克生物	2021-0 9-10	230,25 6.00	8,200	14	3.20%	278.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6885	光环新网	2021-0 9-10	312,91 4.00	21,700	14	3.20%	378.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6887	昆仑万维	2021-0 9-10	302,20 2.00	16,300	14	3.20%	365.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6889	我武生物	2021-0 9-10	268,84 0.00	5,200	14	3.20%	324.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6891	晶盛机电	2021-0 9-10	971,24 1.00	12,900	14	3.20%	1,173. 46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6893	掌趣科技	2021-0 9-10	224,47 1.00	55,700	14	3.20%	271.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6895	中际旭创	2021-0 9-10	405,95 4.00	11,400	14	3.20%	490.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6897	利亚德	2021-0 9-10	415,13 5.00	40,900	14	3.20%	501.56	-	-	
国泰君安证券	202109 100001	国瓷材料	2021-0 9-10	703,57 0.00	16,100	14	3.20%	850.05	-	-	

股份有限公司	6899										
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6901	华宇软件	2021-0 9-10	194,38 8.00	16,700	14	3.20%	234.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6903	卫宁健康	2021-0 9-10	497,26 8.00	34,200	14	3.20%	600.80	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6905	光线传媒	2021-0 9-10	231,89 4.00	23,400	14	3.20%	280.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6907	迪安诊断	2021-0 9-10	255,86 7.00	8,700	14	3.20%	309.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6909	易华录	2021-0 9-10	262,48 2.00	8,200	14	3.20%	317.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6911	欣旺达	2021-0 9-10	806,65 0.00	22,100	14	3.20%	974.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6913	捷成股份	2021-0 9-10	202,21 2.00	41,100	14	3.20%	244.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6915	华峰超纤	2021-0 9-10	138,42 5.00	24,500	14	3.20%	167.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6917	东方国信	2021-0 9-10	159,89 4.00	16,200	14	3.20%	193.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6919	汤臣倍健	2021-0 9-10	459,84 9.00	16,900	14	3.20%	555.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6921	华策影视	2021-0 9-10	136,88 1.00	22,700	14	3.20%	165.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6923	长盈精密	2021-0 9-10	247,51 5.00	14,500	14	3.20%	299.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6925	顺网科技	2021-0 9-10	135,70 3.00	9,700	14	3.20%	163.95	-	-	
国泰君安	202109	长信科	2021-0	424,71	49,100	14	3.20%	513.14	-	-	

安证券股份有限公司	100001 6927	技	9-10	5.00							
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6929	三聚环 保	2021-0 9-10	199,78 5.00	28,500	14	3.20%	241.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6931	碧水源	2021-0 9-10	364,14 6.00	44,300	14	3.20%	439.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6933	蓝色光 标	2021-0 9-10	246,98 1.00	39,900	14	3.20%	298.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6935	新宙邦	2021-0 9-10	814,32 0.00	5,800	14	3.20%	983.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6937	机器人	2021-0 9-10	272,65 5.00	24,900	14	3.20%	329.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6939	红日药 业	2021-0 9-10	167,04 0.00	36,000	14	3.20%	201.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6941	网宿科 技	2021-0 9-10	251,46 0.00	39,600	14	3.20%	303.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6943	安科生 物	2021-0 9-10	281,21 2.00	22,900	14	3.20%	339.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6945	豆神教 育	2021-0 9-10	59,77 0.00	13,900	14	3.20%	72.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 6947	神州泰 岳	2021-0 9-10	220,47 3.00	39,300	14	3.20%	266.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 100001 7005	特锐德	2021-0 9-10	368,12 5.00	12,500	14	3.20%	444.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1409	道通科 技	2021-0 9-24	398,37 0.00	4,900	14	3.20%	481.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1411	晶晨股 份	2021-0 9-24	563,69 6.00	5,600	14	3.20%	681.06	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1413	虹软科技	2021-0 9-24	231,71 5.00	5,500	14	3.20%	279.96	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1415	南微医学	2021-0 9-24	239,67 9.00	1,100	14	3.20%	289.58	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1417	光威复材	2021-0 9-24	425,13 4.00	6,200	14	3.20%	513.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1419	普利制药	2021-0 9-24	235,42 6.00	5,300	14	3.20%	284.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1421	寒锐钴业	2021-0 9-24	351,09 5.00	4,300	14	3.20%	424.19	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1423	万孚生物	2021-0 9-24	225,72 0.00	5,400	14	3.20%	272.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1425	迈克生物	2021-0 9-24	233,12 6.00	8,200	14	3.20%	281.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1427	昆仑万维	2021-0 9-24	293,40 0.00	16,300	14	3.20%	354.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1429	光环新网	2021-0 9-24	290,34 6.00	21,700	14	3.20%	350.80	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1431	我武生物	2021-0 9-24	293,54 0.00	5,200	14	3.20%	354.65	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1433	晶盛机电	2021-0 9-24	879,90 9.00	12,900	14	3.20%	1,063. 11	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1435	掌趣科技	2021-0 9-24	223,35 7.00	55,700	14	3.20%	269.86	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1437	中际旭创	2021-0 9-24	395,01 0.00	11,400	14	3.20%	477.25	-	-
国泰君安股份有	202109 240001 1439	国瓷材料	2021-0 9-24	686,98 7.00	16,100	14	3.20%	830.02	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1441	华宇软件	2021-0 9-24	189,71 2.00	16,700	14	3.20%	229.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1443	光线传媒	2021-0 9-24	230,25 6.00	23,400	14	3.20%	278.19	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1445	卫宁健康	2021-0 9-24	494,87 4.00	34,200	14	3.20%	597.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1447	迪安诊断	2021-0 9-24	259,17 3.00	8,700	14	3.20%	313.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1449	易华录	2021-0 9-24	262,23 6.00	8,200	14	3.20%	316.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1451	欣旺达	2021-0 9-24	740,57 1.00	22,100	14	3.20%	894.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1453	捷成股份	2021-0 9-24	188,64 9.00	41,100	14	3.20%	227.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1455	华峰超纤	2021-0 9-24	132,54 5.00	24,500	14	3.20%	160.14	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1457	东方国信	2021-0 9-24	160,38 0.00	16,200	14	3.20%	193.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1459	汤臣倍健	2021-0 9-24	460,18 7.00	16,900	14	3.20%	556.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1461	华策影视	2021-0 9-24	135,97 3.00	22,700	14	3.20%	164.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1463	长盈精密	2021-0 9-24	226,78 0.00	14,500	14	3.20%	274.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1465	顺网科技	2021-0 9-24	127,36 1.00	9,700	14	3.20%	153.87	-	-	
国泰君安证券	202109 240001	长信科技	2021-0 9-24	393,29 1.00	49,100	14	3.20%	475.17	-	-	

股份有限公司	1467										
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1469	三聚环保	2021-0 9-24	199,50 0.00	28,500	14	3.20%	241.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1471	碧水源	2021-0 9-24	370,79 1.00	44,300	14	3.20%	447.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1473	蓝色光标	2021-0 9-24	240,99 6.00	39,900	14	3.20%	291.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1475	新宙邦	2021-0 9-24	856,54 4.00	5,800	14	3.20%	1,034. 87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1477	红日药业	2021-0 9-24	167,04 0.00	36,000	14	3.20%	201.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1479	机器人	2021-0 9-24	263,19 3.00	24,900	14	3.20%	317.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1481	网宿科技	2021-0 9-24	241,95 6.00	39,600	14	3.20%	292.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1483	豆神教育	2021-0 9-24	54,34 9.00	13,900	14	3.20%	65.66	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1485	安科生物	2021-0 9-24	288,54 0.00	22,900	14	3.20%	348.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1487	神州泰岳	2021-0 9-24	211,43 4.00	39,300	14	3.20%	255.46	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202109 240001 1489	特锐德	2021-0 9-24	345,25 0.00	12,500	14	3.20%	417.13	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1499	长盈精密	2021-1 0-08	213,87 5.00	14,500	14	3.20%	258.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1501	顺网科技	2021-1 0-08	124,06 3.00	9,700	14	3.20%	149.89	-	-	
国泰君安	202110	长信科	2021-1	374,63	49,100	14	3.20%	452.63	-	-	

安证券股份有限公司	080006 1503	技	0-08	3.00							
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1505	三聚环 保	2021-1 0-08	196,65 0.00	28,500	14	3.20%	237.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1507	碧水源	2021-1 0-08	340,66 7.00	44,300	14	3.20%	411.59	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1509	蓝色光 标	2021-1 0-08	227,43 0.00	39,900	14	3.20%	274.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1511	新宙邦	2021-1 0-08	806,08 4.00	5,800	14	3.20%	973.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1513	红日药 业	2021-1 0-08	157,32 0.00	36,000	14	3.20%	190.08	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1515	机器人	2021-1 0-08	258,96 0.00	24,900	14	3.20%	312.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1517	网宿科 技	2021-1 0-08	234,82 8.00	39,600	14	3.20%	283.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1519	豆神教 育	2021-1 0-08	53,93 2.00	13,900	14	3.20%	65.16	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1521	安科生 物	2021-1 0-08	285,10 5.00	22,900	14	3.20%	344.47	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1523	神州泰 岳	2021-1 0-08	236,19 3.00	39,300	14	3.20%	285.37	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080006 1525	特锐德	2021-1 0-08	327,62 5.00	12,500	14	3.20%	395.84	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6215	道通科 技	2021-1 0-08	352,55 5.00	4,900	14	3.20%	425.96	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6219	晶晨股 份	2021-1 0-08	573,66 4.00	5,600	14	3.20%	693.10	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6221	虹软科技	2021-1 0-08	227,53 5.00	5,500	14	3.20%	274.90	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6223	南微医学	2021-1 0-08	289,30 0.00	1,100	14	3.20%	349.53	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6225	光威复材	2021-1 0-08	401,76 0.00	6,200	14	3.20%	485.41	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6227	普利制药	2021-1 0-08	248,14 6.00	5,300	14	3.20%	299.81	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6229	寒锐钴业	2021-1 0-08	321,81 2.00	4,300	14	3.20%	388.82	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6231	万孚生物	2021-1 0-08	231,33 6.00	5,400	14	3.20%	279.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6233	迈克生物	2021-1 0-08	239,76 8.00	8,200	14	3.20%	289.69	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6235	昆仑万维	2021-1 0-08	278,07 8.00	16,300	14	3.20%	335.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6237	光环新网	2021-1 0-08	284,48 7.00	21,700	14	3.20%	343.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6239	晶盛机电	2021-1 0-08	808,95 9.00	12,900	14	3.20%	977.38	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6241	我武生物	2021-1 0-08	307,37 2.00	5,200	14	3.20%	371.37	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6243	掌趣科技	2021-1 0-08	215,55 9.00	55,700	14	3.20%	260.44	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6245	中际旭创	2021-1 0-08	399,68 4.00	11,400	14	3.20%	482.89	-	-
国泰君安股份有	202110 080007 6247	国瓷材料	2021-1 0-08	673,46 3.00	16,100	14	3.20%	813.68	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6251	华宇软件	2021-1 0-08	197,56 1.00	16,700	14	3.20%	238.69	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6255	卫宁健康	2021-1 0-08	496,58 4.00	34,200	14	3.20%	599.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6257	光线传媒	2021-1 0-08	223,70 4.00	23,400	14	3.20%	270.28	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6259	迪安诊断	2021-1 0-08	253,25 7.00	8,700	14	3.20%	305.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6261	易华录	2021-1 0-08	248,29 6.00	8,200	14	3.20%	299.99	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6263	欣旺达	2021-1 0-08	826,09 8.00	22,100	14	3.20%	998.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6265	捷成股份	2021-1 0-08	175,49 7.00	41,100	14	3.20%	212.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6267	华峰超纤	2021-1 0-08	122,50 0.00	24,500	14	3.20%	148.00	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6269	东方国信	2021-1 0-08	150,17 4.00	16,200	14	3.20%	181.44	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6271	汤臣倍健	2021-1 0-08	406,61 4.00	16,900	14	3.20%	491.27	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 080007 6273	华策影视	2021-1 0-08	136,88 1.00	22,700	14	3.20%	165.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6110	道通科技	2021-1 0-22	332,80 8.00	4,900	14	3.20%	402.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6112	晶晨股份	2021-1 0-22	609,56 0.00	5,600	14	3.20%	736.47	-	-	
国泰君安证券	202110 220005	虹软科技	2021-1 0-22	210,59 5.00	5,500	14	3.20%	254.44	-	-	

股份有限公司	6114										
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6116	南微医学	2021-1 0-22	283,07 4.00	1,100	14	3.20%	342.01	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6118	光威复材	2021-1 0-22	390,78 6.00	6,200	14	3.20%	472.15	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6120	普利制药	2021-1 0-22	243,58 8.00	5,300	14	3.20%	294.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6122	寒锐钴业	2021-1 0-22	346,62 3.00	4,300	14	3.20%	418.79	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6124	万孚生物	2021-1 0-22	212,86 8.00	5,400	14	3.20%	257.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6126	迈克生物	2021-1 0-22	223,28 6.00	8,200	14	3.20%	269.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6128	昆仑万维	2021-1 0-22	294,70 4.00	16,300	14	3.20%	356.06	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6130	光环新网	2021-1 0-22	284,70 4.00	21,700	14	3.20%	343.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6132	我武生物	2021-1 0-22	287,35 2.00	5,200	14	3.20%	347.17	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6134	晶盛机电	2021-1 0-22	948,15 0.00	12,900	14	3.20%	1,145. 55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6136	掌趣科技	2021-1 0-22	214,44 5.00	55,700	14	3.20%	259.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6138	中际旭创	2021-1 0-22	374,14 8.00	11,400	14	3.20%	452.05	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6140	国瓷材料	2021-1 0-22	735,44 8.00	16,100	14	3.20%	888.56	-	-	
国泰君安	202110	华宇软	2021-1	181,36	16,700	14	3.20%	219.12	-	-	

安证券股份有限公司	220005 6142	件	0-22	2.00							
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6144	卫宁健康	2021-1 0-22	451,09 8.00	34,200	14	3.20%	545.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6146	光线传媒	2021-1 0-22	217,62 0.00	23,400	14	3.20%	262.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6148	迪安诊断	2021-1 0-22	264,30 6.00	8,700	14	3.20%	319.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6150	易华录	2021-1 0-22	247,39 4.00	8,200	14	3.20%	298.90	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6152	欣旺达	2021-1 0-22	997,37 3.00	22,100	14	3.20%	1,205. 03	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6154	捷成股份	2021-1 0-22	167,68 8.00	41,100	14	3.20%	202.60	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6156	华峰超纤	2021-1 0-22	114,66 0.00	24,500	14	3.20%	138.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6158	东方国信	2021-1 0-22	146,77 2.00	16,200	14	3.20%	177.33	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6160	汤臣倍健	2021-1 0-22	421,31 7.00	16,900	14	3.20%	509.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6162	华策影视	2021-1 0-22	125,30 4.00	22,700	14	3.20%	151.39	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6164	长盈精密	2021-1 0-22	219,67 5.00	14,500	14	3.20%	265.41	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6166	顺网科技	2021-1 0-22	128,91 3.00	9,700	14	3.20%	155.76	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6168	长信科技	2021-1 0-22	383,47 1.00	49,100	14	3.20%	463.31	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6170	三聚环保	2021-1 0-22	173,28 0.00	28,500	14	3.20%	209.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6172	碧水源	2021-1 0-22	310,10 0.00	44,300	14	3.20%	374.66	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6174	蓝色光标	2021-1 0-22	199,50 0.00	39,900	14	3.20%	241.04	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6176	新宙邦	2021-1 0-22	768,96 4.00	5,800	14	3.20%	929.06	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6178	红日药业	2021-1 0-22	151,20 0.00	36,000	14	3.20%	182.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6180	机器人	2021-1 0-22	258,21 3.00	24,900	14	3.20%	311.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6182	网宿科技	2021-1 0-22	220,96 8.00	39,600	14	3.20%	266.97	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6184	豆神教育	2021-1 0-22	52,54 2.00	13,900	14	3.20%	63.49	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6186	安科生物	2021-1 0-22	280,75 4.00	22,900	14	3.20%	339.20	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6188	神州泰岳	2021-1 0-22	235,80 0.00	39,300	14	3.20%	284.89	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202110 220005 6190	特锐德	2021-1 0-22	318,12 5.00	12,500	14	3.20%	384.36	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9499	道通科技	2021-1 1-05	322,22 4.00	4,900	14	3.20%	389.31	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9501	晶晨股份	2021-1 1-05	627,14 4.00	5,600	14	3.20%	757.72	-	-
国泰君安股份有	202111 050005 9503	虹软科技	2021-1 1-05	221,43 0.00	5,500	14	3.20%	267.53	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9505	南微医学	2021-1 1-05	271,10 6.00	1,100	14	3.20%	327.55	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9507	光威复材	2021-1 1-05	461,46 6.00	6,200	14	3.20%	557.54	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9509	普利制药	2021-1 1-05	263,14 5.00	5,300	14	3.20%	317.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9511	寒锐钴业	2021-1 1-05	334,45 4.00	4,300	14	3.20%	404.09	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9513	万孚生物	2021-1 1-05	189,48 6.00	5,400	14	3.20%	228.93	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9515	昆仑万维	2021-1 1-05	356,80 7.00	16,300	14	3.20%	431.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9517	光环新网	2021-1 1-05	301,63 0.00	21,700	14	3.20%	364.43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9519	我武生物	2021-1 1-05	276,12 0.00	5,200	14	3.20%	333.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9521	晶盛机电	2021-1 1-05	1,019, 229.00	12,900	14	3.20%	1,231. 43	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9523	掌趣科技	2021-1 1-05	233,94 0.00	55,700	14	3.20%	282.65	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9525	中际旭创	2021-1 1-05	398,20 2.00	11,400	14	3.20%	481.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050005 9527	国瓷材料	2021-1 1-05	719,67 0.00	16,100	14	3.20%	869.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3125	华宇软件	2021-1 1-05	192,71 8.00	16,700	14	3.20%	232.84	-	-	
国泰君安证券	202111 050006	卫宁健康	2021-1 1-05	470,25 0.00	34,200	14	3.20%	568.16	-	-	

股份有限公司	3127										
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3129	光线传媒	2021-1 1-05	229,08 6.00	23,400	14	3.20%	276.78	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3131	迪安诊断	2021-1 1-05	289,53 6.00	8,700	14	3.20%	349.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3133	易华录	2021-1 1-05	248,78 8.00	8,200	14	3.20%	300.58	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3135	欣旺达	2021-1 1-05	1,031, 186.00	22,100	14	3.20%	1,245. 87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3137	捷成股份	2021-1 1-05	190,29 3.00	41,100	14	3.20%	229.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3139	华峰超纤	2021-1 1-05	110,25 0.00	24,500	14	3.20%	133.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3141	东方国信	2021-1 1-05	151,79 4.00	16,200	14	3.20%	183.40	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3143	汤臣倍健	2021-1 1-05	419,12 0.00	16,900	14	3.20%	506.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3145	华策影视	2021-1 1-05	129,84 4.00	22,700	14	3.20%	156.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3147	长盈精密	2021-1 1-05	228,37 5.00	14,500	14	3.20%	275.92	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3149	顺网科技	2021-1 1-05	144,82 1.00	9,700	14	3.20%	174.97	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3151	长信科技	2021-1 1-05	570,05 1.00	49,100	14	3.20%	688.74	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3153	三聚环保	2021-1 1-05	185,25 0.00	28,500	14	3.20%	223.82	-	-	
国泰君安	202111	碧水源	2021-1	311,42	44,300	14	3.20%	376.27	-	-	

安证券股份有限公司	050006 3155		1-05	9.00							
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3157	蓝色光标	2021-1 1-05	242,19 3.00	39,900	14	3.20%	292.62	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3159	新宙邦	2021-1 1-05	766,18 0.00	5,800	14	3.20%	925.70	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3161	红日药业	2021-1 1-05	147,96 0.00	36,000	14	3.20%	178.77	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3163	机器人	2021-1 1-05	241,77 9.00	24,900	14	3.20%	292.12	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3165	网宿科技	2021-1 1-05	225,32 4.00	39,600	14	3.20%	272.23	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3167	豆神教育	2021-1 1-05	51,70 8.00	13,900	14	3.20%	62.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3169	安科生物	2021-1 1-05	295,41 0.00	22,900	14	3.20%	356.91	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3171	神州泰岳	2021-1 1-05	232,65 6.00	39,300	14	3.20%	281.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 3173	特锐德	2021-1 1-05	343,37 5.00	12,500	14	3.20%	414.86	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202111 050006 4133	迈克生物	2021-1 1-05	235,01 2.00	8,200	14	3.20%	283.94	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1870	网宿科技	2021-1 2-14	27,34 7.00	4,100	14	3.40%	35.11	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 140000 1926	华宇软件	2021-1 2-14	65,21 9.00	4,900	14	3.40%	83.72	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2513	长信科技	2021-1 2-17	579,15 0.00	49,500	14	3.20%	699.73	-	-	

国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2515	长盈精密	2021-1 2-17	335,63 4.00	16,900	14	3.20%	405.51	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2517	三聚环保	2021-1 2-17	236,57 2.00	28,400	14	3.20%	285.83	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2519	蓝色光标	2021-1 2-17	557,72 2.00	50,200	14	3.20%	673.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2521	东方国信	2021-1 2-17	173,98 8.00	16,200	14	3.20%	210.21	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2522	碧水源	2021-1 2-17	332,71 6.00	44,600	14	3.20%	401.99	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2525	万达信息	2021-1 2-17	310,93 9.00	23,900	14	3.20%	375.68	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2527	圣湘生物	2021-1 2-17	140,16 0.00	2,400	14	3.20%	169.34	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2529	凯赛生物	2021-1 2-17	441,84 0.00	2,400	14	3.20%	533.84	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2531	虹软科技	2021-1 2-17	172,12 0.00	4,000	14	3.20%	207.95	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2533	南微医学	2021-1 2-17	227,80 0.00	1,000	14	3.20%	275.22	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2534	华策影视	2021-1 2-17	152,05 6.00	22,900	14	3.20%	183.72	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2537	汤臣倍健	2021-1 2-17	430,92 0.00	17,100	14	3.20%	520.64	-	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2539	信维通信	2021-1 2-17	484,77 0.00	19,500	14	3.20%	585.70	-	-
国泰君安股份有	202112 170000 2541	新宙邦	2021-1 2-17	661,48 5.00	5,700	14	3.20%	799.20	-	-

有限公司											
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2543	机器人	2021-1 2-17	261,57 6.00	25,200	14	3.20%	316.04	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2545	红日药业	2021-1 2-17	156,74 6.00	36,200	14	3.20%	189.38	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2547	网宿科技	2021-1 2-17	329,00 4.00	49,400	14	3.20%	397.50	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2549	特锐德	2021-1 2-17	353,31 2.00	12,200	14	3.20%	426.87	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2551	安科生物	2021-1 2-17	288,28 8.00	23,100	14	3.20%	348.31	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2553	捷成股份	2021-1 2-17	244,60 8.00	41,600	14	3.20%	295.53	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2555	寒锐钴业	2021-1 2-17	378,40 0.00	4,300	14	3.20%	457.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2557	普利制药	2021-1 2-17	255,73 6.00	5,200	14	3.20%	308.98	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2559	万孚生物	2021-1 2-17	230,26 8.00	6,200	14	3.20%	278.21	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2561	昆仑万维	2021-1 2-17	438,68 9.00	19,300	14	3.20%	530.02	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2563	迈克生物	2021-1 2-17	253,11 6.00	8,900	14	3.20%	305.82	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2565	康泰医学	2021-1 2-17	94,56 0.00	2,400	14	3.20%	114.24	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2567	光威复材	2021-1 2-17	514,35 2.00	6,200	14	3.20%	621.44	-	-	
国泰君安证券	202112 170000	迈为股份	2021-1 2-17	704,76 0.00	1,000	14	3.20%	851.49	-	-	

股份有限公司	2569										
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2571	光环新网	2021-1 2-17	352,83 3.00	24,900	14	3.20%	426.29	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2573	卫宁健康	2021-1 2-17	510,00 4.00	34,600	14	3.20%	616.18	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2575	华宇软件	2021-1 2-17	213,76 0.00	16,700	14	3.20%	258.26	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2577	易华录	2021-1 2-17	226,46 0.00	6,700	14	3.20%	273.61	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2579	迪安诊断	2021-1 2-17	280,83 6.00	8,700	14	3.20%	339.30	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2581	中际旭创	2021-1 2-17	452,25 6.00	11,200	14	3.20%	546.42	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2582	国瓷材料	2021-1 2-17	678,78 0.00	16,200	14	3.20%	820.10	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2584	光线传媒	2021-1 2-17	265,02 8.00	23,600	14	3.20%	320.20	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2586	掌趣科技	2021-1 2-17	256,31 6.00	55,600	14	3.20%	309.68	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2587	我武生物	2021-1 2-17	364,64 4.00	6,300	14	3.20%	440.56	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 170000 2589	博腾股份	2021-1 2-17	581,42 5.00	6,500	14	3.20%	702.48	-	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4024	博腾股份	2021-1 2-31	581,42 5.00	6,500	14	3.20%	-	581,42 5.00	-	
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4026	我武生物	2021-1 2-31	360,99 0.00	6,300	14	3.20%	-	360,99 0.00	-	
国泰君	202112	掌趣科	2021-1	270,21	55,600	14	3.20%	-	270,21	-	

安证券股份有限公司	310002 4028	技	2-31	6.00					6.00	
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4030	光线传媒	2021-1 2-31	303,26 0.00	23,600	14	3.20%	-	303,26 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4032	国瓷材料	2021-1 2-31	689,63 4.00	16,200	14	3.20%	-	689,63 4.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4034	中际旭创	2021-1 2-31	476,00 0.00	11,200	14	3.20%	-	476,00 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4036	迪安诊断	2021-1 2-31	292,05 9.00	8,700	14	3.20%	-	292,05 9.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4038	易华录	2021-1 2-31	236,84 5.00	6,700	14	3.20%	-	236,84 5.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4040	华宇软件	2021-1 2-31	212,09 0.00	16,700	14	3.20%	-	212,09 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4042	卫宁健康	2021-1 2-31	579,89 6.00	34,600	14	3.20%	-	579,89 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4044	光环新网	2021-1 2-31	369,51 6.00	24,900	14	3.20%	-	369,51 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4046	迈为股份	2021-1 2-31	642,30 0.00	1,000	14	3.20%	-	642,30 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4048	光威复材	2021-1 2-31	523,77 6.00	6,200	14	3.20%	-	523,77 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4050	康泰医学	2021-1 2-31	97,32 0.00	2,400	14	3.20%	-	97,32 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 4052	迈克生物	2021-1 2-31	259,79 1.00	8,900	14	3.20%	-	259,79 1.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5074	昆仑万维	2021-1 2-31	446,79 5.00	19,300	14	3.20%	-	446,79 5.00	-

国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5076	万孚生物	2021-1 2-31	244,15 6.00	6,200	14	3.20%	-	244,15 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5078	普利制药	2021-1 2-31	286,20 8.00	5,200	14	3.20%	-	286,20 8.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5080	寒锐钴业	2021-1 2-31	344,77 4.00	4,300	14	3.20%	-	344,77 4.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5082	捷成股份	2021-1 2-31	263,32 8.00	41,600	14	3.20%	-	263,32 8.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5084	安科生物	2021-1 2-31	302,37 9.00	23,100	14	3.20%	-	302,37 9.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5086	网宿科技	2021-1 2-31	330,48 6.00	49,400	14	3.20%	-	330,48 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5088	红日药业	2021-1 2-31	283,44 6.00	36,200	14	3.20%	-	283,44 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5090	机器人	2021-1 2-31	281,48 4.00	25,200	14	3.20%	-	281,48 4.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5092	新宙邦	2021-1 2-31	644,10 0.00	5,700	14	3.20%	-	644,10 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5094	信维通信	2021-1 2-31	493,74 0.00	19,500	14	3.20%	-	493,74 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5096	汤臣倍健	2021-1 2-31	461,01 6.00	17,100	14	3.20%	-	461,01 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5098	华策影视	2021-1 2-31	155,03 3.00	22,900	14	3.20%	-	155,03 3.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5100	南微医学	2021-1 2-31	212,67 0.00	1,000	14	3.20%	-	212,67 0.00	-
国泰君安股份有	202112 310002 5102	虹软科技	2021-1 2-31	176,24 0.00	4,000	14	3.20%	-	176,24 0.00	-

有限公司										
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5104	凯赛生物	2021-1 2-31	442,27 2.00	2,400	14	3.20%	-	442,27 2.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5106	圣湘生物	2021-1 2-31	141,60 0.00	2,400	14	3.20%	-	141,60 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5108	万达信息	2021-1 2-31	311,17 8.00	23,900	14	3.20%	-	311,17 8.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5110	碧水源	2021-1 2-31	320,67 4.00	44,600	14	3.20%	-	320,67 4.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5112	蓝色光标	2021-1 2-31	538,64 6.00	50,200	14	3.20%	-	538,64 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5114	东方国信	2021-1 2-31	174,96 0.00	16,200	14	3.20%	-	174,96 0.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5116	三聚环保	2021-1 2-31	225,21 2.00	28,400	14	3.20%	-	225,21 2.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5118	长盈精密	2021-1 2-31	335,29 6.00	16,900	14	3.20%	-	335,29 6.00	-
国泰君安证券股份有限公司	202112 310002 5120	长信科技	2021-1 2-31	657,36 0.00	49,500	14	3.20%	-	657,36 0.00	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份

		额的比例		额的比例
天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,375,424,569.00	95.92%	1,933,324,319.00	94.01%

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	30,541,972.80	460,833.62	45,464,854.58	2,088,805.15

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	688234	天岳先进	网下申购	6,759	559,577.61
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

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安 证券股份 有限公司	688238	和元生物	网下申购	12,836	169,820.28
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 有限公司	688120	华海清科	网下申购	4,822	658,974.52
国泰君安 证券股份 有限公司	603170	宝立食品	网下申购	542	5,447.10
国泰君安 证券股份 有限公司	301283	聚胶股份	网下申购	2,344	123,505.36
国泰君安 证券股份	603182	嘉华股份	网下申购	546	5,760.30

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	688455	科捷智能	网下申购	5,277	115,460.76
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	688489	三未信安	网下申购	1,995	157,385.55
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
国泰君安 证券股份 有限公司	688498	源杰科技	网下申购	1,582	159,244.12
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	605005	合兴股份	网下申购	634	4,044.92
国泰君安 证券股份 有限公司	688070	纵横股份	网下申购	2,407	55,746.12

国泰君安证券股份有限公司	688677	海泰新光	网下申购	1,768	63,223.68
国泰君安证券股份有限公司	605089	味知香	网下申购	370	10,556.10
国泰君安证券股份有限公司	605180	华生科技	网下申购	384	8,593.92
国泰君安证券股份有限公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627	25,950.65
国泰君安证券股份有限公司	605319	无锡振华	网下申购	764	8,572.08
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	688276	百克生物	网下申购	3,486	126,716.10
国泰君安证券股份有限公司	688087	英科再生	网下申购	2,469	54,219.24
国泰君安证券股份有限公司	688718	唯赛勃	网下申购	3,145	18,398.25
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	605507	国邦医药	网下申购	1,202	39,149.14

国泰君安证券股份有限公司	605589	圣泉集团	网下申购	1,750	42,017.50
国泰君安证券股份有限公司	601825	沪农商行	网下申购	15,480	137,772.00
国泰君安证券股份有限公司	688187	时代电气	网下申购	33,865	1,062,683.70
国泰君安证券股份有限公司	688767	博拓生物	网下申购	2,220	76,701.00
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
国泰君安证券股份有限公司	688262	国芯科技	网下申购	7,129	299,275.42

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
688392	骄成超声	2022-09-1	6个月	科创板打	71.18	134.27	2,745	195,389.10	368,571.15	-

		9		新限售							
688035	德邦科技	2022-09-09	6个月	科创板打新限售	46.12	48.82	4,981	229,723.72	243,172.42	-	
688084	晶品特装	2022-12-01	6个月	科创板打新限售	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75	-	
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	-	
688143	长盈通	2022-12-01	6个月	科创板打新限售	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08	-	
688455	科捷智能	2022-09-07	6个月	科创板打新限售	21.88	13.12	5,277	115,460.76	69,234.24	-	
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	创业板打新限售	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
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	2022-08-1	6个月	创业板打	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-

		0		新限售						
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	-

3013 66	一博 科技	2022 -09-1 9	6个月	创业 板打 新限 售	65.35	45.09	268	17,51 3.80	12,08 4.12	-
3012 83	聚胶 股份	2022 -08-2 6	6个月	创业 板打 新限 售	52.69	51.41	235	12,38 2.15	12,08 1.35	-
3012 90	东星 医疗	2022 -11-2 3	6个月	创业 板打 新限 售	44.09	35.13	330	14,54 9.70	11,59 2.90	-
3011 32	满坤 科技	2022 -08-0 3	6个月	创业 板打 新限 售	26.80	24.48	468	12,54 2.40	11,45 6.64	-
3012 77	新天 地	2022 -11-0 9	6个月	创业 板打 新限 售	27.00	25.78	439	11,85 3.00	11,31 7.42	-
3012 82	金禄 电子	2022 -08-1 8	6个月	创业 板打 新限 售	30.38	25.25	434	13,18 4.92	10,95 8.50	-
3013 61	众智 科技	2022 -11-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	26.44	20.96	517	13,66 9.48	10,83 6.32	-
3012 65	华新 环保	2022 -12-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	13.28	11.40	819	10,87 6.32	9,33 6.60	-
3011 76	逸豪 新材	2022 -09-2	6个月	创业 板打	23.88	16.89	544	12,99 0.72	9,18 8.16	-

		1		新限售							
3012 27	森鹰 窗业	2022 -09-1 6	6个月	创业 板打 新限 售	38.25	29.49	284	10,86 3.00	8,37 5.16	-	
3013 26	捷邦 科技	2022 -09-0 9	6个月	创业 板打 新限 售	51.72	36.62	227	11,74 0.44	8,31 2.74	-	
3011 97	工大 科雅	2022 -07-2 9	6个月	创业 板打 新限 售	25.50	20.08	380	9,69 0.00	7,63 0.40	-	
3011 61	唯万 密封	2022 -09-0 6	6个月	创业 板打 新限 售	18.66	21.73	346	6,45 6.36	7,51 8.58	-	
3013 98	星源 卓镁	2022 -12-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	34.40	28.94	255	8,77 2.00	7,37 9.70	-	
3013 13	凡拓 数创	2022 -09-2 2	6个月	创业 板打 新限 售	25.25	29.14	247	6,23 6.75	7,19 7.58	-	
3012 85	鸿日 达	2022 -09-2 1	6个月	创业 板打 新限 售	14.60	12.60	565	8,24 9.00	7,11 9.00	-	
3012 76	嘉曼 服饰	2022 -09-0 1	6个月	创业 板打 新限 售	40.66	22.61	303	12,31 9.98	6,85 0.83	-	

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	创业板打新限售	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-
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	2022-06-2	6个月	创业板打	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-

		4		新限售						
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	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118030	睿创转债	2022-12-30	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	4,200	420,000.00	420,005.52	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、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
600038	中直股份	2022-1-26	拟筹划重	46.41	2023-01-10	51.05	102,600	5,512,883.02	4,761,666.00	-

			大 资 产 重 组							
300 850	新 强 联	202 2-1 2-3 0	重 大 事 项	53. 28	202 3-0 1-1 0	56. 88	69,600	4,206,216.1 4	3,708,288.0 0	-

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	000009	中国宝安	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.09	42,800	517,452.00
2	000012	南玻A	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	6.71	28,400	190,564.00
3	000021	深科技	2023年01	10.69	19,400	207,386.00

			月03日-2023年01月03日			
4	000027	深圳能源	2023年01月03日-2023年01月03日	6.36	156,000	992,160.00
5	000031	大悦城	2023年01月03日-2023年01月03日	3.76	110,000	413,600.00
6	000039	中集集团	2023年01月03日-2023年01月03日	7.04	151,000	1,063,040.00
7	000050	深天马 A	2023年01月03日-2023年01月12日	8.66	90,500	783,730.00
8	000060	中金岭南	2023年01月03日-2023年01月03日	4.10	214,500	879,450.00
9	000062	深圳华强	2023年01月03日-2023年01月03日	12.21	19,200	234,432.00
10	000089	深圳机场	2023年01月13日-2023年01月13日	7.86	61,100	480,246.00
11	000400	许继电气	2023年01月03日-2023年01月	19.97	56,700	1,132,299.00

			10日			
12	000401	冀东水泥	2023年01月03日-2023年01月10日	8.23	60,100	494,623.00
13	000402	金融街	2023年01月03日-2023年01月03日	5.25	24,700	129,675.00
14	000519	中兵红箭	2023年01月03日-2023年01月04日	19.64	67,000	1,315,880.00
15	000537	广宇发展	2023年01月03日-2023年01月03日	13.23	45,200	597,996.00
16	000547	航天发展	2023年01月03日-2023年01月04日	9.39	103,800	974,682.00
17	000553	安道麦A	2023年01月03日-2023年01月03日	9.05	23,300	210,865.00
18	000559	万向钱潮	2023年01月03日-2023年01月03日	4.87	108,100	526,447.00
19	000563	陕国投A	2023年01月03日-2023年01月03日	3.03	162,400	492,072.00
20	000581	威孚高科	2023年01	17.73	10,400	184,392.00

			月03日-20 23年01月 03日			
21	000591	太阳能	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.33	192,200	1,408,826.0 0
22	000598	兴蓉环境	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	4.89	85,700	419,073.00
23	000623	吉林敖东	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.99	19,300	289,307.00
24	000629	钒钛股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.73	338,800	1,602,524.0 0
25	000636	风华高科	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.83	56,400	836,412.00
26	000656	金科股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	1.91	346,100	661,051.00
27	000683	远兴能源	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	7.84	204,800	1,605,632.0 0
28	000703	恒逸石化	2023年01 月03日-20 23年01月	7.03	45,500	319,865.00

			03日			
29	000709	河钢股份	2023年01月03日-2023年01月03日	2.26	338,600	765,236.00
30	000728	国元证券	2023年01月03日-2023年01月03日	6.33	54,200	343,086.00
31	000729	燕京啤酒	2023年01月03日-2023年01月03日	10.62	29,200	310,104.00
32	000738	航发控制	2023年01月03日-2023年01月10日	25.64	40,100	1,028,164.00
33	000739	普洛药业	2023年01月03日-2023年01月03日	21.54	12,200	262,788.00
34	000778	新兴铸管	2023年01月03日-2023年01月03日	3.65	59,600	217,540.00
35	000783	长江证券	2023年01月03日-2023年01月03日	5.33	80,200	427,466.00
36	000807	云铝股份	2023年01月03日-2023年01月06日	11.12	58,000	644,960.00
37	000825	太钢不锈	2023年01	4.32	47,500	205,200.00

			月03日-20 23年01月 03日			
38	000830	鲁西化工	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	12.39	57,500	712,425.00
39	000831	中国稀土	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	32.88	48,300	1,588,104.0 0
40	000878	云南铜业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	11.75	98,500	1,157,375.0 0
41	000883	湖北能源	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.20	161,500	678,300.00
42	000887	中鼎股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.47	64,700	936,209.00
43	000898	鞍钢股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	2.67	59,600	159,132.00
44	000930	中粮科技	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	8.36	55,600	464,816.00
45	000932	华菱钢铁	2023年01 月03日-20 23年01月	4.70	85,900	403,730.00

			03日			
46	000937	冀中能源	2023年01月03日-2023年01月03日	6.36	32,200	204,792.00
47	000959	首钢股份	2023年01月03日-2023年01月03日	3.77	32,400	122,148.00
48	000960	锡业股份	2023年01月03日-2023年01月03日	14.10	20,700	291,870.00
49	000967	盈峰环境	2023年01月03日-2023年01月03日	4.54	104,200	473,068.00
50	000970	中科三环	2023年01月03日-2023年01月11日	13.64	78,100	1,065,284.00
51	000975	银泰黄金	2023年01月03日-2023年01月05日	11.04	142,600	1,574,304.00
52	000987	越秀资本	2023年01月03日-2023年01月03日	5.99	123,400	739,166.00
53	000988	华工科技	2023年01月03日-2023年01月04日	16.41	79,800	1,309,518.00
54	000990	诚志股份	2023年01	8.80	49,800	438,240.00

			月03日-20 23年01月 03日			
55	000997	新大陆	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	13.01	29,000	377,290.00
56	000998	隆平高科	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	16.07	35,400	568,878.00
57	000999	华润三九	2023年01 月10日-20 23年01月 13日	46.81	23,500	1,100,035.0 0
58	001872	招商港口	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.36	14,200	203,912.00
59	001914	招商积余	2023年01 月05日-20 23年01月 05日	15.38	19,000	292,220.00
60	002002	鸿达兴业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	3.24	51,700	167,508.00
61	002010	传化智联	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	5.34	112,000	598,080.00
62	002019	亿帆医药	2023年01 月03日-20 23年01月	12.25	53,100	650,475.00

			03日			
63	002028	思源电气	2023年01月03日-2023年01月04日	38.22	49,500	1,891,890.00
64	002030	达安基因	2023年01月03日-2023年01月03日	15.56	80,500	1,252,580.00
65	002048	宁波华翔	2023年01月03日-2023年01月04日	13.90	39,400	547,660.00
66	002056	横店东磁	2023年01月03日-2023年01月03日	18.74	16,800	314,832.00
67	002065	东华软件	2023年01月03日-2023年01月03日	5.66	46,500	263,190.00
68	002078	太阳纸业	2023年01月03日-2023年01月03日	11.52	132,200	1,522,944.00
69	002080	中材科技	2023年01月03日-2023年01月03日	21.43	36,900	790,767.00
70	002092	中泰化学	2023年01月03日-2023年01月04日	7.46	168,200	1,254,772.00
71	002110	三钢闽光	2023年01	4.70	70,300	330,410.00

			月03日-20 23年01月 12日			
72	002127	南极电商	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.81	152,500	733,525.00
73	002128	电投能源	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.34	15,900	196,206.00
74	002138	顺络电子	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	26.18	48,500	1,269,730.0 0
75	002152	广电运通	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	9.94	72,100	716,674.00
76	002155	湖南黄金	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.95	68,900	892,255.00
77	002156	通富微电	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	16.48	63,000	1,038,240.0 0
78	002183	怡亚通	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	6.43	149,100	958,713.00
79	002185	华天科技	2023年01 月03日-20 23年01月	8.29	52,500	435,225.00

			03日			
80	002191	劲嘉股份	2023年01月03日-2023年01月03日	7.23	76,600	553,818.00
81	002195	二三四五	2023年01月03日-2023年01月03日	2.01	469,400	943,494.00
82	002203	海亮股份	2023年01月03日-2023年01月03日	11.30	96,600	1,091,580.00
83	002221	东华能源	2023年01月03日-2023年01月03日	7.63	77,600	592,088.00
84	002223	鱼跃医疗	2023年01月03日-2023年01月10日	31.86	44,700	1,424,142.00
85	002242	九阳股份	2023年01月04日-2023年01月04日	16.48	18,400	303,232.00
86	002244	滨江集团	2023年01月03日-2023年01月04日	8.83	95,900	846,797.00
87	002249	大洋电机	2023年01月03日-2023年01月03日	5.12	34,500	176,640.00
88	002250	联化科技	2023年01	15.50	59,700	925,350.00

			月03日-20 23年01月 04日			
89	002266	浙富控股	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	3.91	44,500	173,995.00
90	002273	水晶光电	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	11.79	28,800	339,552.00
91	002281	光迅科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	15.72	18,000	282,960.00
92	002294	信立泰	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	32.85	11,500	377,775.00
93	002299	圣农发展	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	23.69	15,400	364,826.00
94	002326	永太科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	21.83	50,300	1,098,049.0 0
95	002340	格林美	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.43	106,400	790,552.00
96	002353	杰瑞股份	2023年01 月03日-20 23年01月	27.91	37,700	1,052,207.0 0

			03日			
97	002368	太极股份	2023年01月03日-2023年01月03日	28.13	13,700	385,381.00
98	002372	伟星新材	2023年01月03日-2023年01月04日	21.34	51,300	1,094,742.00
99	002373	千方科技	2023年01月03日-2023年01月03日	8.92	22,900	204,268.00
100	002384	东山精密	2023年01月03日-2023年01月03日	24.73	28,300	699,859.00
101	002396	星网锐捷	2023年01月12日-2023年01月12日	19.16	10,000	191,600.00
102	002407	多氟多	2023年01月03日-2023年01月04日	33.32	30,700	1,022,924.00
103	002408	齐翔腾达	2023年01月03日-2023年01月05日	7.04	137,800	970,112.00
104	002416	爱施德	2023年01月03日-2023年01月10日	9.48	29,300	277,764.00
105	002422	科伦药业	2023年01	26.61	91,800	2,442,798.0

			月03日-20 23年01月 03日			0
106	002429	兆驰股份	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	3.49	182,900	638,321.00
107	002430	杭氧股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	39.36	20,000	787,200.00
108	002434	万里扬	2023年01 月13日-20 23年01月 13日	8.05	46,000	370,300.00
109	002439	启明星辰	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	26.08	13,800	359,904.00
110	002444	巨星科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	18.98	59,100	1,121,718.0 0
111	002465	海格通信	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	8.12	38,200	310,184.00
112	002468	申通快递	2023年01 月13日-20 23年01月 13日	10.33	45,600	471,048.00
113	002497	雅化集团	2023年01 月03日-20 23年01月	23.25	50,100	1,164,825.0 0

			12日			
114	002500	山西证券	2023年01月03日-2023年01月03日	5.30	44,600	236,380.00
115	002505	鹏都农牧	2023年01月03日-2023年01月03日	2.58	257,900	665,382.00
116	002507	涪陵榨菜	2023年01月03日-2023年01月03日	25.77	12,800	329,856.00
117	002508	老板电器	2023年01月03日-2023年01月03日	27.76	29,100	807,816.00
118	002511	中顺洁柔	2023年01月03日-2023年01月13日	13.74	55,800	766,692.00
119	002531	天顺风能	2023年01月03日-2023年01月03日	15.13	73,700	1,115,081.00
120	002532	天山铝业	2023年01月03日-2023年01月03日	7.72	48,200	372,104.00
121	002563	森马服饰	2023年01月03日-2023年01月06日	5.24	65,200	341,648.00
122	002568	百润股份	2023年01	37.36	10,800	403,488.00

			月03日-20 23年01月 03日			
123	002572	索菲亚	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	18.16	51,500	935,240.00
124	002595	豪迈科技	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	23.15	24,000	555,600.00
125	002603	以岭药业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	29.96	17,300	518,308.00
126	002624	完美世界	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.72	110,900	1,410,648.0 0
127	002625	光启技术	2023年01 月03日-20 23年01月 13日	17.02	94,500	1,608,390.0 0
128	002653	海思科	2023年01 月04日-20 23年01月 04日	22.25	10,500	233,625.00
129	002670	国盛金控	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.41	24,000	177,840.00
130	002673	西部证券	2023年01 月03日-20 23年01月	6.09	55,500	337,995.00

			03日			
131	002683	广东宏大	2023年01月03日-2023年01月03日	26.96	20,800	560,768.00
132	002701	奥瑞金	2023年01月03日-2023年01月12日	5.05	144,700	730,735.00
133	002705	新宝股份	2023年01月03日-2023年01月03日	16.65	15,700	261,405.00
134	002738	中矿资源	2023年01月03日-2023年01月03日	66.66	20,000	1,333,200.00
135	002739	万达电影	2023年01月03日-2023年01月03日	14.00	89,300	1,250,200.00
136	002745	木林森	2023年01月03日-2023年01月05日	8.11	71,900	583,109.00
137	002797	第一创业	2023年01月03日-2023年01月03日	5.63	69,600	391,848.00
138	002831	裕同科技	2023年01月03日-2023年01月03日	33.07	22,800	753,996.00
139	002867	周大生	2023年01	14.03	23,800	333,914.00

			月04日-20 23年01月 04日			
140	002926	华西证券	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.53	32,600	245,478.00
141	002936	郑州银行	2023年01 月03日-20 23年01月 06日	2.35	179,000	420,650.00
142	002939	长城证券	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	8.28	99,100	820,548.00
143	002948	青岛银行	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	3.36	142,700	479,472.00
144	002958	青农商行	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	2.89	107,500	310,675.00
145	002966	苏州银行	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.78	173,200	1,347,496.0 0
146	003035	南网能源	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	5.67	33,500	189,945.00
147	300001	特锐德	2023年01 月03日-20 23年01月	15.21	15,100	229,671.00

			03日			
148	300003	乐普医疗	2023年01月03日-2023年01月06日	22.97	34,800	799,356.00
149	300009	安科生物	2023年01月03日-2023年01月05日	9.36	29,500	276,120.00
150	300012	华测检测	2023年01月03日-2023年01月10日	22.30	61,600	1,373,680.00
151	300017	网宿科技	2023年01月03日-2023年01月03日	5.58	50,500	281,790.00
152	300024	机器人	2023年01月03日-2023年01月03日	8.98	101,700	913,266.00
153	300026	红日药业	2023年01月03日-2023年01月03日	5.68	169,800	964,464.00
154	300037	新宙邦	2023年01月03日-2023年01月03日	43.47	10,700	465,129.00
155	300058	蓝色光标	2023年01月03日-2023年01月10日	5.05	200,000	1,010,000.00
156	300070	碧水源	2023年01	4.73	51,700	244,541.00

			月03日-20 23年01月 03日			
157	300072	海新能科	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	4.36	103,700	452,132.00
158	300073	当升科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	56.40	8,300	468,120.00
159	300088	长信科技	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	5.97	52,300	312,231.00
160	300115	长盈精密	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	10.33	62,200	642,526.00
161	300136	信维通信	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	16.51	20,000	330,200.00
162	300144	宋城演艺	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.60	63,900	932,940.00
163	300146	汤臣倍健	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	22.82	21,100	481,502.00
164	300168	万达信息	2023年01 月03日-20 23年01月	8.43	97,300	820,239.00

			03日			
165	300182	捷成股份	2023年01月03日-2023年01月03日	4.47	168,900	754,983.00
166	300212	易华录	2023年01月03日-2023年01月11日	20.41	31,900	651,079.00
167	300244	迪安诊断	2023年01月03日-2023年01月03日	25.13	10,400	261,352.00
168	300251	光线传媒	2023年01月03日-2023年01月05日	8.66	27,900	241,614.00
169	300253	卫宁健康	2023年01月03日-2023年01月03日	10.28	35,600	365,968.00
170	300257	开山股份	2023年01月03日-2023年01月03日	15.00	8,200	123,000.00
171	300285	国瓷材料	2023年01月03日-2023年01月03日	27.57	16,600	457,662.00
172	300296	利亚德	2023年01月03日-2023年01月03日	5.66	41,900	237,154.00
173	300308	中际旭创	2023年01	27.03	45,100	1,219,053.0

			月03日-20 23年01月 03日			0
174	300357	我武生物	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	55.10	7,400	407,740.00
175	300363	博腾股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	40.85	7,700	314,545.00
176	300373	扬杰科技	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	52.60	20,400	1,073,040.0 0
177	300376	易事特	2023年01 月03日-20 23年01月 06日	6.83	83,600	570,988.00
178	300383	光环新网	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	8.16	29,400	239,904.00
179	300390	天华超净	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	55.88	33,100	1,849,628.0 0
180	300418	昆仑万维	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.41	19,600	282,436.00
181	300463	迈克生物	2023年01 月03日-20 23年01月	17.30	30,800	532,840.00

			03日			
182	300474	景嘉微	2023年01月03日-2023年01月03日	54.57	7,900	431,103.00
183	300482	万孚生物	2023年01月03日-2023年01月03日	31.87	21,800	694,766.00
184	300558	贝达药业	2023年01月03日-2023年01月06日	49.27	7,400	364,598.00
185	300568	星源材质	2023年01月03日-2023年01月03日	21.26	83,900	1,783,714.00
186	300604	长川科技	2023年01月03日-2023年01月06日	44.58	28,100	1,252,698.00
187	300618	寒锐钴业	2023年01月03日-2023年01月03日	40.05	4,500	180,225.00
188	300630	普利制药	2023年01月03日-2023年01月03日	24.66	20,600	507,996.00
189	300676	华大基因	2023年01月03日-2023年01月03日	51.69	8,000	413,520.00
190	300677	英科医疗	2023年01	21.03	37,200	782,316.00

			月03日-20 23年01月 05日			
191	300682	朗新科技	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	21.98	42,700	938,546.00
192	300699	光威复材	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	72.25	6,400	462,400.00
193	300724	捷佳伟创	2023年01 月03日-20 23年01月 11日	114.02	8,600	980,572.00
194	300776	帝尔激光	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	126.00	1,700	214,200.00
195	300832	新产业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	50.14	6,500	325,910.00
196	300850	新强联	2023年01 月10日-20 23年01月 10日	53.28	9,500	506,160.00
197	300861	美畅股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	49.16	3,900	191,724.00
198	300866	安克创新	2023年01 月03日-20 23年01月	59.27	10,800	640,116.00

			12日			
199	301029	怡合达	2023年01月03日-2023年01月03日	65.74	7,700	506,198.00
200	600006	东风汽车	2023年01月03日-2023年01月03日	5.58	65,600	366,048.00
201	600008	首创环保	2023年01月03日-2023年01月03日	2.83	361,000	1,021,630.00
202	600021	上海电力	2023年01月13日-2023年01月13日	10.01	67,100	671,671.00
203	600022	山东钢铁	2023年01月03日-2023年01月03日	1.48	113,400	167,832.00
204	600027	华电国际	2023年01月13日-2023年01月13日	5.88	194,300	1,142,484.00
205	600056	中国医药	2023年01月04日-2023年01月05日	17.23	45,000	775,350.00
206	600060	海信视像	2023年01月03日-2023年01月06日	13.54	63,400	858,436.00
207	600062	华润双鹤	2023年01	17.89	18,000	322,020.00

			月04日-20 23年01月 04日			
208	600064	南京高科	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	6.61	25,100	165,911.00
209	600066	宇通客车	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.51	27,500	206,525.00
210	600095	湘财股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.56	17,700	133,812.00
211	600096	云天化	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	21.04	26,600	559,664.00
212	600109	国金证券	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	8.70	46,300	402,810.00
213	600118	中国卫星	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	21.55	48,400	1,043,020.0 0
214	600126	杭钢股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.13	34,100	140,833.00
215	600141	兴发集团	2023年01 月03日-20 23年01月	29.00	16,100	466,900.00

			03日			
216	600143	金发科技	2023年01月03日-2023年01月03日	9.69	131,800	1,277,142.00
217	600153	建发股份	2023年01月03日-2023年01月03日	13.65	31,100	424,515.00
218	600155	华创阳安	2023年01月03日-2023年01月11日	6.50	90,700	589,550.00
219	600157	永泰能源	2023年01月03日-2023年01月10日	1.53	1,030,800	1,577,124.00
220	600160	巨化股份	2023年01月03日-2023年01月10日	15.51	108,300	1,679,733.00
221	600161	天坛生物	2023年01月03日-2023年01月03日	23.73	17,000	403,410.00
222	600167	联美控股	2023年01月03日-2023年01月03日	6.32	18,900	119,448.00
223	600170	上海建工	2023年01月03日-2023年01月05日	2.60	368,200	957,320.00
224	600171	上海贝岭	2023年01	17.43	40,000	697,200.00

			月03日-20 23年01月 05日			
225	600177	雅戈尔	2023年01 月03日-20 23年01月 06日	6.33	215,200	1,362,216.0 0
226	600195	中牧股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	11.62	10,500	122,010.00
227	600201	生物股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	9.01	23,200	209,032.00
228	600208	新潮中宝	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	2.54	89,100	226,314.00
229	600216	浙江医药	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	11.69	14,000	163,660.00
230	600258	首旅酒店	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	24.80	53,900	1,336,720.0 0
231	600271	航天信息	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	10.41	23,000	239,430.00
232	600282	南钢股份	2023年01 月03日-20 23年01月	3.15	63,800	200,970.00

			03日			
233	600298	安琪酵母	2023年01月03日-2023年01月03日	45.22	10,800	488,376.00
234	600299	安迪苏	2023年01月03日-2023年01月03日	8.26	24,600	203,196.00
235	600307	酒钢宏兴	2023年01月03日-2023年01月05日	1.65	253,200	417,780.00
236	600315	上海家化	2023年01月06日-2023年01月06日	31.85	20,400	649,740.00
237	600316	洪都航空	2023年01月03日-2023年01月03日	25.19	10,000	251,900.00
238	600325	华发股份	2023年01月03日-2023年01月10日	9.06	72,500	656,850.00
239	600329	达仁堂	2023年01月03日-2023年01月03日	29.10	15,000	436,500.00
240	600339	中油工程	2023年01月03日-2023年01月10日	2.98	134,500	400,810.00
241	600348	华阳股份	2023年01	14.25	24,900	354,825.00

			月03日-2023年01月03日			
242	600350	山东高速	2023年01月03日-2023年01月05日	5.69	54,000	307,260.00
243	600352	浙江龙盛	2023年01月03日-2023年01月11日	9.90	163,900	1,622,610.00
244	600369	西南证券	2023年01月03日-2023年01月03日	3.75	68,800	258,000.00
245	600372	中航电子	2023年01月05日-2023年01月13日	15.97	46,000	734,620.00
246	600373	中文传媒	2023年01月03日-2023年01月10日	9.57	54,500	521,565.00
247	600376	首开股份	2023年01月03日-2023年01月12日	5.69	64,400	366,436.00
248	600377	宁沪高速	2023年01月03日-2023年01月03日	8.22	10,300	84,666.00
249	600378	昊华科技	2023年01月13日-2023年01月	42.91	10,000	429,100.00

			13日			
250	600380	健康元	2023年01月03日-2023年01月03日	11.29	94,800	1,070,292.00
251	600390	五矿资本	2023年01月03日-2023年01月04日	5.08	181,800	923,544.00
252	600392	盛和资源	2023年01月03日-2023年01月12日	14.00	99,000	1,386,000.00
253	600398	海澜之家	2023年01月03日-2023年01月03日	5.30	35,800	189,740.00
254	600399	抚顺特钢	2023年01月03日-2023年01月03日	14.31	32,700	467,937.00
255	600409	三友化工	2023年01月03日-2023年01月03日	6.61	101,500	670,915.00
256	600415	小商品城	2023年01月03日-2023年01月04日	5.24	221,600	1,161,184.00
257	600418	江淮汽车	2023年01月03日-2023年01月03日	13.13	136,700	1,794,871.00
258	600435	北方导航	2023年01	11.60	82,400	955,840.00

			月03日-20 23年01月 12日			
259	600482	中国动力	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	15.29	22,300	340,967.00
260	600487	亨通光电	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	15.06	159,400	2,400,564.0 0
261	600489	中金黄金	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	8.19	60,200	493,038.00
262	600497	驰宏锌锗	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	5.06	73,800	373,428.00
263	600498	烽火通信	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	13.14	14,700	193,158.00
264	600499	科达制造	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	14.21	78,200	1,111,222.0 0
265	600500	中化国际	2023年01 月03日-20 23年01月 13日	6.61	114,300	755,523.00
266	600507	方大特钢	2023年01 月03日-20 23年01月	6.02	38,400	231,168.00

			12日			
267	600511	国药股份	2023年01月04日-2023年01月04日	27.90	19,200	535,680.00
268	600516	方大炭素	2023年01月03日-2023年01月03日	6.12	187,100	1,145,052.00
269	600517	国网英大	2023年01月03日-2023年01月10日	4.84	73,700	356,708.00
270	600521	华海药业	2023年01月03日-2023年01月12日	21.86	70,000	1,530,200.00
271	600528	中铁工业	2023年01月03日-2023年01月03日	7.63	27,600	210,588.00
272	600529	山东药玻	2023年01月03日-2023年01月03日	28.40	37,200	1,056,480.00
273	600535	天士力	2023年01月03日-2023年01月13日	10.76	30,200	324,952.00
274	600536	中国软件	2023年01月03日-2023年01月03日	58.33	24,200	1,411,586.00
275	600546	山煤国际	2023年01	14.49	76,600	1,109,934.0

			月03日-20 23年01月 05日			0
276	600549	厦门钨业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	19.55	17,600	344,080.00
277	600556	天下秀	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	6.74	73,000	492,020.00
278	600567	山鹰国际	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	2.48	261,100	647,528.00
279	600580	卧龙电驱	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.46	75,400	939,484.00
280	600582	天地科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	5.20	135,700	705,640.00
281	600597	光明乳业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	10.76	26,600	286,216.00
282	600598	北大荒	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	13.76	14,700	202,272.00
283	600623	华谊集团	2023年01 月03日-20 23年01月	6.32	61,000	385,520.00

			05日			
284	600637	东方明珠	2023年01月03日-2023年01月06日	6.65	165,500	1,100,575.00
285	600642	申能股份	2023年01月03日-2023年01月03日	5.49	50,900	279,441.00
286	600648	外高桥	2023年01月03日-2023年01月03日	11.95	16,200	193,590.00
287	600655	豫园股份	2023年01月03日-2023年01月04日	7.61	157,500	1,198,575.00
288	600663	陆家嘴	2023年01月03日-2023年01月11日	9.74	71,600	697,384.00
289	600667	太极实业	2023年01月03日-2023年01月10日	5.16	113,000	583,080.00
290	600673	东阳光	2023年01月03日-2023年01月05日	8.69	121,800	1,058,442.00
291	600704	物产中大	2023年01月03日-2023年01月04日	4.81	252,000	1,212,120.00
292	600705	中航产融	2023年01	3.28	428,300	1,404,824.0

			月03日-20 23年01月 04日			0
293	600707	彩虹股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.14	117,600	486,864.00
294	600718	东软集团	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	9.95	17,700	176,115.00
295	600728	佳都科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	5.28	115,300	608,784.00
296	600737	中粮糖业	2023年01 月03日-20 23年01月 06日	6.94	86,400	599,616.00
297	600739	辽宁成大	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.59	87,800	1,105,402.0 0
298	600755	厦门国贸	2023年01 月03日-20 23年01月 13日	7.14	71,300	509,082.00
299	600765	中航重机	2023年01 月03日-20 23年01月 10日	31.09	50,600	1,573,154.0 0
300	600782	新钢股份	2023年01 月03日-20 23年01月	4.09	39,600	161,964.00

			03日			
301	600787	中储股份	2023年01月03日-2023年01月03日	4.97	71,700	356,349.00
302	600801	华新水泥	2023年01月03日-2023年01月03日	14.82	55,900	828,438.00
303	600808	马钢股份	2023年01月03日-2023年01月03日	2.81	50,100	140,781.00
304	600820	隧道股份	2023年01月03日-2023年01月10日	5.27	98,900	521,203.00
305	600827	百联股份	2023年01月03日-2023年01月04日	12.12	64,800	785,376.00
306	600839	四川长虹	2023年01月03日-2023年01月04日	2.64	298,500	788,040.00
307	600848	上海临港	2023年01月03日-2023年01月10日	11.92	67,000	798,640.00
308	600859	王府井	2023年01月03日-2023年01月03日	28.14	55,200	1,553,328.00
309	600862	中航高科	2023年01	22.29	17,300	385,617.00

			月03日-2023年01月03日			
310	600863	内蒙华电	2023年01月03日-2023年01月03日	3.49	77,600	270,824.00
311	600867	通化东宝	2023年01月03日-2023年01月03日	9.18	28,900	265,302.00
312	600871	石化油服	2023年01月03日-2023年01月03日	1.98	333,700	660,726.00
313	600873	梅花生物	2023年01月03日-2023年01月03日	10.18	44,100	448,938.00
314	600879	航天电子	2023年01月03日-2023年01月04日	6.80	175,900	1,196,120.00
315	600885	宏发股份	2023年01月03日-2023年01月03日	33.41	17,200	574,652.00
316	600895	张江高科	2023年01月03日-2023年01月04日	11.34	62,500	708,750.00
317	600901	江苏金租	2023年01月03日-2023年01月	5.48	24,700	135,356.00

			03日			
318	600906	财达证券	2023年01月03日-2023年01月03日	7.57	26,900	203,633.00
319	600909	华安证券	2023年01月03日-2023年01月03日	4.59	58,400	268,056.00
320	600917	重庆燃气	2023年01月03日-2023年01月03日	7.96	17,900	142,484.00
321	600928	西安银行	2023年01月03日-2023年01月03日	3.52	27,600	97,152.00
322	600956	新天绿能	2023年01月03日-2023年01月03日	9.64	17,100	164,844.00
323	600959	江苏有线	2023年01月03日-2023年01月03日	2.97	62,100	184,437.00
324	600967	内蒙一机	2023年01月03日-2023年01月03日	8.26	17,600	145,376.00
325	600968	海油发展	2023年01月03日-2023年01月03日	2.88	42,100	121,248.00
326	600970	中材国际	2023年01	8.52	80,500	685,860.00

			月03日-20 23年01月 06日			
327	600985	淮北矿业	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	12.80	20,500	262,400.00
328	600988	赤峰黄金	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	18.05	102,800	1,855,540.0 0
329	600998	九州通	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	13.04	31,900	415,976.00
330	601000	唐山港	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	2.74	242,900	665,546.00
331	601005	重庆钢铁	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	1.58	138,900	219,462.00
332	601016	节能风电	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	3.81	316,000	1,203,960.0 0
333	601058	赛轮轮胎	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	10.02	198,100	1,984,962.0 0
334	601077	渝农商行	2023年01 月03日-20 23年01月	3.53	150,600	531,618.00

			06日			
335	601098	中南传媒	2023年01月03日-2023年01月03日	9.98	14,800	147,704.00
336	601106	中国一重	2023年01月03日-2023年01月03日	2.93	56,800	166,424.00
337	601108	财通证券	2023年01月03日-2023年01月03日	7.12	67,300	479,176.00
338	601118	海南橡胶	2023年01月03日-2023年01月03日	4.38	140,200	614,076.00
339	601128	常熟银行	2023年01月03日-2023年01月03日	7.55	56,800	428,840.00
340	601139	深圳燃气	2023年01月03日-2023年01月03日	6.54	47,100	308,034.00
341	601156	东航物流	2023年01月03日-2023年01月03日	15.26	29,100	444,066.00
342	601158	重庆水务	2023年01月03日-2023年01月03日	5.13	47,100	241,623.00
343	601162	天风证券	2023年01	2.87	143,700	412,419.00

			月03日-20 23年01月 03日			
344	601168	西部矿业	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	10.20	154,100	1,571,820.0 0
345	601179	中国西电	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	4.61	165,700	763,877.00
346	601198	东兴证券	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	7.72	39,400	304,168.00
347	601228	广州港	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	3.15	86,600	272,790.00
348	601231	环旭电子	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	16.23	53,200	863,436.00
349	601233	桐昆股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	14.45	34,900	504,305.00
350	601298	青岛港	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	5.61	56,400	316,404.00
351	601555	东吴证券	2023年01 月03日-20 23年01月	6.53	83,000	541,990.00

			03日			
352	601568	北元集团	2023年01月03日-2023年01月03日	5.67	97,700	553,959.00
353	601577	长沙银行	2023年01月03日-2023年01月06日	6.76	53,600	362,336.00
354	601598	中国外运	2023年01月03日-2023年01月03日	3.84	85,600	328,704.00
355	601607	上海医药	2023年01月03日-2023年01月12日	17.83	69,500	1,239,185.00
356	601608	中信重工	2023年01月03日-2023年01月03日	3.49	35,900	125,291.00
357	601611	中国核建	2023年01月03日-2023年01月03日	7.60	65,100	494,760.00
358	601636	旗滨集团	2023年01月03日-2023年01月03日	11.39	33,300	379,287.00
359	601665	齐鲁银行	2023年01月03日-2023年01月03日	4.17	47,400	197,658.00
360	601666	平煤股份	2023年01	10.81	28,700	310,247.00

			月03日-20 23年01月 03日			
361	601696	中银证券	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	10.57	34,500	364,665.00
362	601699	潞安环能	2023年01 月03日-20 23年01月 13日	16.85	34,800	586,380.00
363	601717	郑煤机	2023年01 月03日-20 23年01月 12日	11.16	73,900	824,724.00
364	601718	际华集团	2023年01 月03日-20 23年01月 04日	2.91	213,000	619,830.00
365	601778	晶科科技	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	5.50	140,400	772,200.00
366	601828	美凯龙	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	4.69	60,900	285,621.00
367	601866	中远海发	2023年01 月03日-20 23年01月 05日	2.42	320,400	775,368.00
368	601872	招商轮船	2023年01 月03日-20 23年01月	5.59	80,200	448,318.00

			03日			
369	601880	辽港股份	2023年01月03日-2023年01月03日	1.62	617,300	1,000,026.00
370	601928	凤凰传媒	2023年01月03日-2023年01月04日	7.92	61,700	488,664.00
371	601958	金钼股份	2023年01月03日-2023年01月03日	11.55	20,000	231,000.00
372	601969	海南矿业	2023年01月03日-2023年01月03日	7.41	50,000	370,500.00
373	601990	南京证券	2023年01月03日-2023年01月03日	7.93	45,800	363,194.00
374	601992	金隅集团	2023年01月03日-2023年01月03日	2.54	86,400	219,456.00
375	601997	贵阳银行	2023年01月03日-2023年01月06日	5.49	74,900	411,201.00
376	603000	人民网	2023年01月03日-2023年01月04日	16.87	44,300	747,341.00
377	603056	德邦股份	2023年01	20.83	18,500	385,355.00

			月04日-20 23年01月 04日			
378	603077	和邦生物	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	3.04	128,100	389,424.00
379	603156	养元饮品	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	22.27	10,400	231,608.00
380	603218	日月股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	20.30	32,900	667,870.00
381	603225	新凤鸣	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	10.88	62,700	682,176.00
382	603228	景旺电子	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	20.24	20,000	404,800.00
383	603233	大参林	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	39.60	23,200	918,720.00
384	603379	三美股份	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	28.46	14,400	409,824.00
385	603456	九洲药业	2023年01 月03日-20 23年01月	42.43	10,300	437,029.00

			03日			
386	603517	绝味食品	2023年01月03日-2023年01月03日	61.09	22,300	1,362,307.00
387	603568	伟明环保	2023年01月03日-2023年01月12日	18.53	40,800	756,024.00
388	603596	伯特利	2023年01月04日-2023年01月04日	79.80	14,600	1,165,080.00
389	603606	东方电缆	2023年01月04日-2023年01月04日	67.83	14,600	990,318.00
390	603613	国联股份	2023年01月03日-2023年01月04日	88.44	21,000	1,857,240.00
391	603638	艾迪精密	2023年01月03日-2023年01月03日	14.92	20,600	307,352.00
392	603707	健友股份	2023年01月03日-2023年01月03日	18.04	10,000	180,400.00
393	603816	顾家家居	2023年01月03日-2023年01月10日	42.71	39,500	1,687,045.00
394	603858	步长制药	2023年01	21.01	45,300	951,753.00

			月03日-20 23年01月 03日			
395	603866	桃李面包	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	15.40	43,700	672,980.00
396	603883	老百姓	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	40.47	14,100	570,627.00
397	603939	益丰药房	2023年01 月12日-20 23年01月 12日	63.84	21,400	1,366,176.0 0
398	688002	睿创微纳	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	37.19	5,900	219,421.00
399	688006	杭可科技	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	43.77	9,900	433,323.00
400	688009	中国通号	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	4.79	53,600	256,744.00
401	688029	南微医学	2023年01 月03日-20 23年01月 03日	82.13	7,200	591,336.00
402	688063	派能科技	2023年01 月03日-20 23年01月	315.65	7,300	2,304,245.0 0

			03日			
403	688088	虹软科技	2023年01月03日-2023年01月12日	22.51	16,100	362,411.00
404	688116	天奈科技	2023年01月03日-2023年01月06日	77.14	10,800	833,112.00
405	688185	康希诺	2023年01月03日-2023年01月03日	146.02	5,600	817,712.00
406	688188	柏楚电子	2023年01月12日-2023年01月12日	217.08	2,000	434,160.00
407	688208	道通科技	2023年01月03日-2023年01月13日	31.55	18,000	567,900.00
408	688385	复旦微电	2023年01月03日-2023年01月03日	69.81	21,500	1,500,915.00
409	688390	固德威	2023年01月03日-2023年01月05日	323.09	2,700	872,343.00
410	688521	芯原股份	2023年01月03日-2023年01月03日	44.07	5,100	224,757.00
411	688690	纳微科技	2023年01	51.77	12,900	667,833.00

			月03日-2023年01月03日			
412	688772	珠海冠宇	2023年01月03日-2023年01月03日	18.64	3,600	67,104.00
413	688777	中控技术	2023年01月03日-2023年01月03日	90.83	3,200	290,656.00
414	688779	长远锂科	2023年01月03日-2023年01月03日	14.59	15,900	231,981.00
415	688819	天能股份	2023年01月03日-2023年01月03日	36.74	2,700	99,198.00
合计					29,876,700	265,280,546.00

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

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约责任，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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
AAA	310,578.92	-
AAA以下	420,005.52	202,296.10
未评级	-	-
合计	730,584.44	202,296.10

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期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	30,541,972.80	-	-	-	30,541,972.80
结算备付金	40,615,283.86	-	-	20,617,715.07	61,232,998.93
存出保证金	248,125.41	-	-	13,652,105.60	13,900,231.01
交易性金融资产	-	-	730,584.44	2,232,596,024.84	2,233,326,609.28
应收股利	-	-	-	4,144.50	4,144.50
其他资产	-	-	-	140,915.40	140,915.40
资产总计	71,405,382.07	-	730,584.44	2,267,010,905.41	2,339,146,871.92
负债					
应付清算款	-	-	-	3,223,994.11	3,223,994.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,008,793.41	1,008,793.41
应付托管费	-	-	-	201,758.69	201,758.69
应交税费	-	-	-	5,202.43	5,202.43
其他负债	-	-	-	736,002.83	736,002.83
负债总计	-	-	-	5,175,751.47	5,175,751.47
利率敏感度缺口	71,405,382.07	-	730,584.44	2,261,835,153.94	2,333,971,120.45
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	45,464,854.58	-	-	-	45,464,854.58
结算备付金	116,831,782.44	-	-	1,001.00	116,832,783.44
存出保证金	641,430.76	-	-	24,789,408.00	25,430,838.76
交易性金融资产	-	-	202,296.10	2,190,025,003.29	2,190,227,299.39
应收证券清算款	-	-	-	260,190.17	260,190.17
应收利息	-	-	-	284,867.79	284,867.79

应收股利	-	-	-	539.00	539.00
资产总计	162,938,067.78	-	202,296.10	2,215,361,009.25	2,378,501,373.13
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,304,905.52	1,304,905.52
应付管理人报酬	-	-	-	1,015,836.23	1,015,836.23
应付托管费	-	-	-	203,167.27	203,167.27
应付交易费用	-	-	-	629,042.63	629,042.63
应交税费	-	-	-	189,223.40	189,223.40
其他负债	-	-	-	492,180.91	492,180.91
负债总计	-	-	-	3,834,355.96	3,834,355.96
利率敏感度缺口	162,938,067.78	-	202,296.10	2,211,526,653.29	2,374,667,017.17

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，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.03%(2021年12月31日：0.01%)，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，跟踪中证500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，中证500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	2,232,596,024.84	95.66	2,190,025,003.29	92.22
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	2,232,596,024.84	95.66	2,190,025,003.29	92.22

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 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%	115,088,115.95	111,379,378.69

	业绩比较基准下降5%	-115,088,115.95	-111,379,378.69
--	------------	-----------------	-----------------

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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	2,222,673,415.48	2,184,255,883.87
第二层次	8,889,959.52	4,801,041.35
第三层次	1,763,234.28	1,170,374.17
合计	2,233,326,609.28	2,190,227,299.39

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
----	----

项目	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	-	1,170,374.17	1,170,374.17
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,484,669.59	3,484,669.59
转出第三层次	-	4,549,492.08	4,549,492.08
当期利得或损失总额	-	1,657,682.60	1,657,682.60
其中：计入损益的利得或损失	-	1,657,682.60	1,657,682.60
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,763,234.28	1,763,234.28
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	-	-305,720.84	-305,720.84
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	-	740,433.66	740,433.66
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	-	429,940.51	429,940.51
其中：计入损益的利得或损失	-	429,940.51	429,940.51
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失			
期末余额	-	1,170,374.17	1,170,374.17
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	-	429,940.51	429,940.51

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	1,763,234.28	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	1,170,374.17	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2580~2.7417	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	2,232,596,024.84	95.44
	其中：股票	2,232,596,024.84	95.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	730,584.44	0.03
	其中：债券	730,584.44	0.03
	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	91,774,971.73	3.92
8	其他各项资产	14,045,290.91	0.60
9	合计	2,339,146,871.92	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 265,280,546.00 元，占基金资产净值的比例为 11.37%。

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	21,359,256.80	0.92
B	采矿业	97,813,264.80	4.19
C	制造业	1,356,989,573.07	58.14

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	74,666,984.20	3.20
E	建筑业	19,765,839.00	0.85
F	批发和零售业	94,695,444.13	4.06
G	交通运输、仓储和邮政业	49,744,056.00	2.13
H	住宿和餐饮业	5,842,880.00	0.25
I	信息传输、软件和信息技术服务业	159,509,343.82	6.83
J	金融业	194,244,167.12	8.32
K	房地产业	45,832,410.30	1.96
L	租赁和商务服务业	25,990,746.00	1.11
M	科学研究和技术服务业	24,505,500.40	1.05
N	水利、环境和公共设施管理业	12,496,528.70	0.54
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	4,422,427.66	0.19
R	文化、体育和娱乐业	29,531,849.00	1.27
S	综合	13,353,797.00	0.57
	合计	2,230,764,068.00	95.58

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	1,417,118.55	0.06
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	0.01
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	1,831,956.84	0.08

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	002340	格林美	1,800,000	13,374,000.00	0.57
2	300012	华测检测	588,760	13,129,348.00	0.56
3	600157	永泰能源	7,788,800	11,916,864.00	0.51
4	002384	东山精密	479,817	11,865,874.41	0.51
5	300724	捷佳伟创	97,600	11,128,352.00	0.48
6	688777	中控技术	122,000	11,081,260.00	0.47
7	603613	国联股份	122,139	10,801,973.16	0.46
8	688122	西部超导	114,000	10,794,660.00	0.46
9	300003	乐普医疗	461,600	10,602,952.00	0.45

10	002422	科伦药业	397,700	10,582,797.00	0.45
11	600487	亨通光电	691,800	10,418,508.00	0.45
12	002385	大北农	1,161,300	10,335,570.00	0.44
13	688063	派能科技	32,560	10,277,564.00	0.44
14	603345	安井食品	61,800	10,004,184.00	0.43
15	002966	苏州银行	1,285,789	10,003,438.42	0.43
16	603606	东方电缆	144,900	9,828,567.00	0.42
17	600885	宏发股份	292,260	9,764,406.60	0.42
18	600765	中航重机	309,540	9,623,598.60	0.41
19	600079	人福医药	401,000	9,579,890.00	0.41
20	600096	云天化	450,801	9,484,853.04	0.41
21	002497	雅化集团	403,800	9,388,350.00	0.40
22	601555	东吴证券	1,404,870	9,173,801.10	0.39
23	600352	浙江龙盛	912,600	9,034,740.00	0.39
24	002625	光启技术	529,200	9,006,984.00	0.39
25	002407	多氟多	268,700	8,953,084.00	0.38
26	002603	以岭药业	292,700	8,769,292.00	0.38
27	000009	中国宝安	724,300	8,756,787.00	0.38
28	601058	赛轮轮胎	859,400	8,611,188.00	0.37
29	601233	桐昆股份	591,200	8,542,840.00	0.37
30	002738	中矿资源	127,800	8,519,148.00	0.37
31	600988	赤峰黄金	467,000	8,429,350.00	0.36
32	688390	固德威	25,920	8,374,492.80	0.36
33	600489	中金黄金	1,019,700	8,351,343.00	0.36
34	603688	石英股份	63,400	8,325,688.00	0.36
35	603605	珀莱雅	49,700	8,323,756.00	0.36
36	600298	安琪酵母	182,900	8,270,738.00	0.35
37	002028	思源电气	214,600	8,202,012.00	0.35
38	300146	汤臣倍健	358,000	8,169,560.00	0.35
39	601108	财通证券	1,139,700	8,114,664.00	0.35
40	000807	云铝股份	729,500	8,112,040.00	0.35

41	600536	中国软件	138,260	8,064,705.80	0.35
42	000630	铜陵有色	2,583,100	8,059,272.00	0.35
43	603939	益丰药房	126,100	8,050,224.00	0.34
44	300144	宋城演艺	550,400	8,035,840.00	0.34
45	600418	江淮汽车	612,000	8,035,560.00	0.34
46	300073	当升科技	142,200	8,020,080.00	0.34
47	300037	新宙邦	182,460	7,931,536.20	0.34
48	600399	抚顺特钢	553,600	7,922,016.00	0.34
49	600141	兴发集团	273,000	7,917,000.00	0.34
50	300699	光威复材	109,000	7,875,250.00	0.34
51	600859	王府井	278,800	7,845,432.00	0.34
52	603517	绝味食品	127,710	7,801,803.90	0.33
53	300285	国瓷材料	281,608	7,763,932.56	0.33
54	601077	渝农商行	2,170,500	7,661,865.00	0.33
55	300568	星源材质	359,500	7,642,970.00	0.33
56	600873	梅花生物	746,600	7,600,388.00	0.33
57	600563	法拉电子	47,400	7,578,312.00	0.32
58	300390	天华超净	134,800	7,532,624.00	0.32
59	002185	华天科技	899,390	7,455,943.10	0.32
60	603456	九洲药业	175,700	7,454,951.00	0.32
61	002138	顺络电子	282,400	7,393,232.00	0.32
62	603816	顾家家居	172,900	7,384,559.00	0.32
63	600160	巨化股份	473,300	7,340,883.00	0.31
64	603589	口子窖	125,800	7,254,886.00	0.31
65	601128	常熟银行	960,800	7,254,040.00	0.31
66	000783	长江证券	1,356,600	7,230,678.00	0.31
67	600153	建发股份	527,400	7,199,010.00	0.31
68	688099	晶晨股份	101,529	7,158,809.79	0.31
69	000629	钒钛股份	1,508,200	7,133,786.00	0.31
70	002192	融捷股份	72,800	7,127,120.00	0.31
71	300357	我武生物	128,600	7,085,860.00	0.30

72	605358	立昂微	166,100	7,075,860.00	0.30
73	601699	潞安环能	419,300	7,065,205.00	0.30
74	601162	天风证券	2,430,900	6,976,683.00	0.30
75	000683	远兴能源	888,000	6,961,920.00	0.30
76	601607	上海医药	389,700	6,948,351.00	0.30
77	603596	伯特利	86,400	6,894,720.00	0.30
78	600392	盛和资源	491,600	6,882,400.00	0.29
79	002568	百润股份	184,100	6,877,976.00	0.29
80	688567	孚能科技	254,400	6,876,432.00	0.29
81	600161	天坛生物	288,700	6,850,851.00	0.29
82	000932	华菱钢铁	1,452,800	6,828,160.00	0.29
83	601168	西部矿业	668,600	6,819,720.00	0.29
84	600109	国金证券	783,200	6,813,840.00	0.29
85	600521	华海药业	311,600	6,811,576.00	0.29
86	600499	科达制造	478,500	6,799,485.00	0.29
87	000831	中国稀土	206,411	6,786,793.68	0.29
88	600486	扬农化工	65,200	6,774,280.00	0.29
89	600027	华电国际	1,143,400	6,723,192.00	0.29
90	002223	鱼跃医疗	210,609	6,710,002.74	0.29
91	002797	第一创业	1,178,000	6,632,140.00	0.28
92	603077	和邦生物	2,167,400	6,588,896.00	0.28
93	600862	中航高科	293,300	6,537,657.00	0.28
94	002078	太阳纸业	565,600	6,515,712.00	0.28
95	688385	复旦微电	93,000	6,492,330.00	0.28
96	000999	华润三九	138,300	6,473,823.00	0.28
97	000975	银泰黄金	583,920	6,446,476.80	0.28
98	601636	旗滨集团	564,900	6,434,211.00	0.28
99	002294	信立泰	195,600	6,425,460.00	0.28
100	601872	招商轮船	1,139,400	6,369,246.00	0.27
101	002268	卫士通	207,300	6,328,869.00	0.27
102	600143	金发科技	652,600	6,323,694.00	0.27

103	600497	驰宏锌锗	1,249,500	6,322,470.00	0.27
104	002025	航天电器	95,200	6,307,000.00	0.27
105	002532	天山铝业	815,800	6,297,976.00	0.27
106	002299	圣农发展	261,900	6,204,411.00	0.27
107	300253	卫宁健康	601,980	6,188,354.40	0.27
108	601696	中银证券	584,300	6,176,051.00	0.26
109	600177	雅戈尔	973,500	6,162,255.00	0.26
110	601990	南京证券	775,500	6,149,715.00	0.26
111	600705	中航产融	1,858,000	6,094,240.00	0.26
112	002439	启明星辰	233,200	6,081,856.00	0.26
113	002624	完美世界	476,200	6,057,264.00	0.26
114	000591	太阳能	822,400	6,028,192.00	0.26
115	603737	三棵树	52,800	6,010,224.00	0.26
116	600348	华阳股份	420,900	5,997,825.00	0.26
117	000998	隆平高科	369,600	5,939,472.00	0.25
118	000738	航发控制	230,300	5,904,892.00	0.25
119	600026	中远海能	487,300	5,871,965.00	0.25
120	688301	奕瑞科技	12,800	5,860,864.00	0.25
121	600258	首旅酒店	235,600	5,842,880.00	0.25
122	600549	厦门钨业	298,400	5,833,720.00	0.25
123	002850	科达利	49,000	5,821,690.00	0.25
124	000728	国元证券	918,500	5,814,105.00	0.25
125	000988	华工科技	353,100	5,794,371.00	0.25
126	600482	中国动力	378,800	5,791,852.00	0.25
127	000519	中兵红箭	293,200	5,758,448.00	0.25
128	002273	水晶光电	487,500	5,747,625.00	0.25
129	002673	西部证券	940,400	5,727,036.00	0.25
130	300604	长川科技	126,500	5,639,370.00	0.24
131	601997	贵阳银行	1,025,900	5,632,191.00	0.24
132	002507	涪陵榨菜	217,772	5,611,984.44	0.24
133	300136	信维通信	339,900	5,611,749.00	0.24

134	300832	新产业	110,297	5,530,291.58	0.24
135	300363	博腾股份	133,600	5,457,560.00	0.23
136	002092	中泰化学	730,105	5,446,583.30	0.23
137	002430	杭氧股份	137,800	5,423,808.00	0.23
138	000703	恒逸石化	770,900	5,419,427.00	0.23
139	600325	华发股份	593,600	5,378,016.00	0.23
140	002030	达安基因	345,220	5,371,623.20	0.23
141	002739	万达电影	382,200	5,350,800.00	0.23
142	002056	横店东磁	285,200	5,344,648.00	0.23
143	002557	洽洽食品	106,540	5,327,000.00	0.23
144	300308	中际旭创	196,700	5,316,801.00	0.23
145	600529	山东药玻	186,500	5,296,600.00	0.23
146	603233	大参林	132,900	5,262,840.00	0.23
147	601666	平煤股份	486,600	5,260,146.00	0.23
148	600704	物产中大	1,093,500	5,259,735.00	0.23
149	601198	东兴证券	680,400	5,252,688.00	0.23
150	002465	海格通信	646,755	5,251,650.60	0.23
151	000729	燕京啤酒	493,700	5,243,094.00	0.22
152	002156	通富微电	317,900	5,238,992.00	0.22
153	601016	节能风电	1,370,270	5,220,728.70	0.22
154	600655	豫园股份	683,200	5,199,152.00	0.22
155	600879	航天电子	762,800	5,187,040.00	0.22
156	300088	长信科技	860,900	5,139,573.00	0.22
157	603658	安图生物	82,400	5,096,440.00	0.22
158	600546	山煤国际	348,000	5,042,520.00	0.22
159	600415	小商品城	961,400	5,037,736.00	0.22
160	002409	雅克科技	100,000	5,037,000.00	0.22
161	688116	天奈科技	65,200	5,029,528.00	0.22
162	002353	杰瑞股份	180,200	5,029,382.00	0.22
163	002080	中材科技	234,300	5,021,049.00	0.22
164	000830	鲁西化工	403,600	5,000,604.00	0.21

165	002683	广东宏大	184,100	4,963,336.00	0.21
166	000960	锡业股份	351,600	4,957,560.00	0.21
167	603267	鸿远电子	48,900	4,946,724.00	0.21
168	000400	许继电气	247,600	4,944,572.00	0.21
169	000878	云南铜业	420,800	4,944,400.00	0.21
170	600516	方大炭素	800,000	4,896,000.00	0.21
171	000623	吉林敖东	326,000	4,886,740.00	0.21
172	600170	上海建工	1,873,300	4,870,580.00	0.21
173	603160	汇顶科技	95,900	4,814,180.00	0.21
174	002444	巨星科技	253,358	4,808,734.84	0.21
175	300418	昆仑万维	332,400	4,789,884.00	0.21
176	600637	东方明珠	718,900	4,780,685.00	0.20
177	300017	网宿科技	855,400	4,773,132.00	0.20
178	002531	天顺风能	315,100	4,767,463.00	0.20
179	600038	中直股份	102,600	4,761,666.00	0.20
180	601577	长沙银行	704,300	4,761,068.00	0.20
181	002372	伟星新材	222,776	4,754,039.84	0.20
182	603712	七一二	135,500	4,731,660.00	0.20
183	600166	福田汽车	1,683,800	4,731,478.00	0.20
184	600739	辽宁成大	375,800	4,731,322.00	0.20
185	600642	申能股份	860,800	4,725,792.00	0.20
186	600699	均胜电子	336,000	4,720,800.00	0.20
187	300373	扬杰科技	89,600	4,712,960.00	0.20
188	601456	国联证券	418,100	4,703,625.00	0.20
189	002326	永太科技	215,000	4,693,450.00	0.20
190	603444	吉比特	15,000	4,692,600.00	0.20
191	002203	海亮股份	413,300	4,670,290.00	0.20
192	000970	中科三环	341,707	4,660,883.48	0.20
193	688002	睿创微纳	125,304	4,660,055.76	0.20
194	002508	老板电器	166,600	4,624,816.00	0.20
195	000155	川能动力	258,800	4,616,992.00	0.20

196	603127	昭衍新药	79,040	4,616,726.40	0.20
197	600673	东阳光	529,000	4,597,010.00	0.20
198	603026	胜华新材	49,800	4,596,540.00	0.20
199	600380	健康元	405,500	4,578,095.00	0.20
200	689009	九号公司	150,100	4,576,549.00	0.20
201	000039	中集集团	646,250	4,549,600.00	0.19
202	600909	华安证券	987,510	4,532,670.90	0.19
203	600056	中国医药	262,941	4,530,473.43	0.19
204	300676	华大基因	87,100	4,502,199.00	0.19
205	600867	通化东宝	489,000	4,489,020.00	0.19
206	600118	中国卫星	207,400	4,469,470.00	0.19
207	600985	淮北矿业	348,400	4,459,520.00	0.19
208	000739	普洛药业	206,700	4,452,318.00	0.19
209	002065	东华软件	786,600	4,452,156.00	0.19
210	000750	国海证券	1,335,900	4,448,547.00	0.19
211	300244	迪安诊断	175,982	4,422,427.66	0.19
212	300058	蓝色光标	873,000	4,408,650.00	0.19
213	600008	首创环保	1,543,550	4,368,246.50	0.19
214	600369	西南证券	1,164,700	4,367,625.00	0.19
215	688009	中国通号	907,400	4,346,446.00	0.19
216	002152	广电运通	436,050	4,334,337.00	0.19
217	300474	景嘉微	79,360	4,330,675.20	0.19
218	600372	中航电子	270,900	4,326,273.00	0.19
219	300558	贝达药业	87,600	4,316,052.00	0.18
220	002831	裕同科技	130,200	4,305,714.00	0.18
221	601880	辽港股份	2,640,100	4,276,962.00	0.18
222	600998	九州通	327,900	4,275,816.00	0.18
223	000513	丽珠集团	131,232	4,262,415.36	0.18
224	000027	深圳能源	667,300	4,244,028.00	0.18
225	600435	北方导航	365,800	4,243,280.00	0.18
226	002936	郑州银行	1,803,100	4,237,285.00	0.18

227	000547	航天发展	450,500	4,230,195.00	0.18
228	300866	安克创新	71,300	4,225,951.00	0.18
229	300070	碧水源	890,200	4,210,646.00	0.18
230	000636	风华高科	283,900	4,210,237.00	0.18
231	002408	齐翔腾达	597,880	4,209,075.20	0.18
232	300026	红日药业	738,000	4,191,840.00	0.18
233	002131	利欧股份	2,368,000	4,191,360.00	0.18
234	002506	协鑫集成	1,435,700	4,177,887.00	0.18
235	002926	华西证券	552,600	4,161,078.00	0.18
236	603883	老百姓	102,674	4,155,216.78	0.18
237	002212	天融信	415,212	4,147,967.88	0.18
238	600378	昊华科技	95,800	4,110,778.00	0.18
239	002183	怡亚通	638,000	4,102,340.00	0.18
240	300682	朗新科技	186,000	4,088,280.00	0.18
241	603858	步长制药	194,200	4,080,142.00	0.17
242	600820	隧道股份	771,500	4,065,805.00	0.17
243	300383	光环新网	497,800	4,062,048.00	0.17
244	002572	索菲亚	223,500	4,058,760.00	0.17
245	600271	航天信息	389,600	4,055,736.00	0.17
246	002195	二三四五	2,007,100	4,034,271.00	0.17
247	603893	瑞芯微	58,600	4,032,266.00	0.17
248	002250	联化科技	259,600	4,023,800.00	0.17
249	600580	卧龙电驱	322,500	4,018,350.00	0.17
250	002368	太极股份	142,720	4,014,713.60	0.17
251	300296	利亚德	708,800	4,011,808.00	0.17
252	000887	中鼎股份	277,200	4,011,084.00	0.17
253	600848	上海临港	336,300	4,008,696.00	0.17
254	600390	五矿资本	788,400	4,005,072.00	0.17
255	002500	山西证券	755,536	4,004,340.80	0.17
256	600863	内蒙华电	1,144,300	3,993,607.00	0.17
257	603156	养元饮品	177,600	3,955,152.00	0.17

258	600021	上海电力	395,100	3,954,951.00	0.17
259	688779	长远锂科	270,600	3,948,054.00	0.17
260	002958	青农商行	1,363,100	3,939,359.00	0.17
261	601958	金钼股份	340,000	3,927,000.00	0.17
262	688538	和辉光电	1,459,400	3,911,192.00	0.17
263	300024	机器人	435,510	3,910,879.80	0.17
264	300001	特锐德	255,900	3,892,239.00	0.17
265	002244	滨江集团	437,100	3,859,593.00	0.17
266	300009	安科生物	410,460	3,841,905.60	0.16
267	600208	新湖中宝	1,507,600	3,829,304.00	0.16
268	002155	湖南黄金	294,900	3,818,955.00	0.16
269	600755	厦门国贸	532,600	3,802,764.00	0.16
270	600316	洪都航空	150,900	3,801,171.00	0.16
271	002511	中顺洁柔	276,400	3,797,736.00	0.16
272	688256	寒武纪	69,568	3,795,630.08	0.16
273	600315	上海家化	118,900	3,786,965.00	0.16
274	688521	芯原股份	85,900	3,785,613.00	0.16
275	000997	新大陆	289,600	3,767,696.00	0.16
276	300776	帝尔激光	29,900	3,767,400.00	0.16
277	000060	中金岭南	917,700	3,762,570.00	0.16
278	603885	吉祥航空	232,200	3,756,996.00	0.16
279	601231	环旭电子	231,000	3,749,130.00	0.16
280	000050	深天马 A	431,400	3,735,924.00	0.16
281	600060	海信视像	275,400	3,728,916.00	0.16
282	601005	重庆钢铁	2,350,900	3,714,422.00	0.16
283	601992	金隅集团	1,461,100	3,711,194.00	0.16
284	300850	新强联	69,600	3,708,288.00	0.16
285	603927	中科软	124,840	3,696,512.40	0.16
286	600511	国药股份	132,000	3,682,800.00	0.16
287	603218	日月股份	180,000	3,654,000.00	0.16
288	601717	郑煤机	322,800	3,602,448.00	0.15

289	600528	中铁工业	467,600	3,567,788.00	0.15
290	300251	光线传媒	410,900	3,558,394.00	0.15
291	600801	华新水泥	239,000	3,541,980.00	0.15
292	600201	生物股份	392,507	3,536,488.07	0.15
293	600566	济川药业	129,000	3,511,380.00	0.15
294	002939	长城证券	423,800	3,509,064.00	0.15
295	300168	万达信息	416,000	3,506,880.00	0.15
296	688185	康希诺	24,000	3,504,480.00	0.15
297	000021	深科技	327,700	3,503,113.00	0.15
298	600066	宇通客车	466,000	3,499,660.00	0.15
299	600171	上海贝岭	199,600	3,479,028.00	0.15
300	000825	太钢不锈	803,600	3,471,552.00	0.15
301	002373	千方科技	387,700	3,458,284.00	0.15
302	600906	财达证券	455,300	3,446,621.00	0.15
303	600598	北大荒	250,100	3,441,376.00	0.15
304	600839	四川长虹	1,295,100	3,419,064.00	0.15
305	300677	英科医疗	162,400	3,415,272.00	0.15
306	600827	百联股份	281,700	3,414,204.00	0.15
307	600282	南钢股份	1,080,000	3,402,000.00	0.15
308	600535	天士力	315,400	3,393,704.00	0.15
309	600970	中材国际	397,300	3,384,996.00	0.15
310	601866	中远海发	1,390,200	3,364,284.00	0.14
311	601778	晶科科技	608,600	3,347,300.00	0.14
312	601665	齐鲁银行	802,300	3,345,591.00	0.14
313	600500	中化国际	504,200	3,332,762.00	0.14
314	002128	电投能源	270,000	3,331,800.00	0.14
315	688188	柏楚电子	15,290	3,319,153.20	0.14
316	601179	中国西电	719,500	3,316,895.00	0.14
317	603568	伟明环保	178,790	3,312,978.70	0.14
318	002127	南极电商	688,300	3,310,723.00	0.14
319	300861	美畅股份	67,300	3,308,468.00	0.14

320	002153	石基信息	220,340	3,302,896.60	0.14
321	600498	烽火通信	250,200	3,287,628.00	0.14
322	000930	中粮科技	392,300	3,279,628.00	0.14
323	000709	河钢股份	1,449,300	3,275,418.00	0.14
324	603000	人民网	194,100	3,274,467.00	0.14
325	002595	豪迈科技	139,700	3,234,055.00	0.14
326	300182	捷成股份	723,000	3,231,810.00	0.14
327	000012	南玻 A	481,600	3,231,536.00	0.14
328	300888	稳健医疗	44,900	3,210,350.00	0.14
329	600398	海澜之家	605,400	3,208,620.00	0.14
330	002701	奥瑞金	631,957	3,191,382.85	0.14
331	002019	亿帆医药	258,400	3,165,400.00	0.14
332	000987	越秀资本	528,330	3,164,696.70	0.14
333	002985	北摩高科	70,081	3,160,653.10	0.14
334	002124	天邦食品	515,180	3,147,749.80	0.13
335	002396	星网锐捷	164,200	3,146,072.00	0.13
336	000581	威孚高科	176,500	3,129,345.00	0.13
337	600959	江苏有线	1,051,700	3,123,549.00	0.13
338	600895	张江高科	271,600	3,079,944.00	0.13
339	000598	兴蓉环境	629,000	3,075,810.00	0.13
340	603707	健友股份	170,391	3,073,853.64	0.13
341	000401	冀东水泥	373,100	3,070,613.00	0.13
342	000778	新兴铸管	839,900	3,065,635.00	0.13
343	300618	寒锐钴业	76,000	3,043,800.00	0.13
344	300115	长盈精密	294,643	3,043,662.19	0.13
345	600582	天地科技	580,200	3,017,040.00	0.13
346	002670	国盛金控	406,900	3,015,129.00	0.13
347	600663	陆家嘴	308,400	3,003,816.00	0.13
348	002249	大洋电机	583,900	2,989,568.00	0.13
349	600718	东软集团	300,200	2,986,990.00	0.13
350	600297	广汇汽车	1,421,800	2,985,780.00	0.13

351	300482	万孚生物	93,520	2,980,482.40	0.13
352	688208	道通科技	93,892	2,962,292.60	0.13
353	002690	美亚光电	123,690	2,956,191.00	0.13
354	002266	浙富控股	753,400	2,945,794.00	0.13
355	600329	达仁堂	100,700	2,930,370.00	0.13
356	688690	纳微科技	56,600	2,930,182.00	0.13
357	603225	新凤鸣	268,600	2,922,368.00	0.13
358	600517	国网英大	601,000	2,908,840.00	0.12
359	000883	湖北能源	690,800	2,901,360.00	0.12
360	600507	方大特钢	481,200	2,896,824.00	0.12
361	603866	桃李面包	187,356	2,885,282.40	0.12
362	002505	鹏都农牧	1,117,700	2,883,666.00	0.12
363	600409	三友化工	434,900	2,874,689.00	0.12
364	600259	广晟有色	71,100	2,858,220.00	0.12
365	601000	唐山港	1,039,100	2,847,134.00	0.12
366	300212	易华录	139,480	2,846,786.80	0.12
367	600022	山东钢铁	1,918,600	2,839,528.00	0.12
368	002002	鸿达兴业	875,300	2,835,972.00	0.12
369	000089	深圳机场	359,800	2,828,028.00	0.12
370	000656	金科股份	1,480,600	2,827,946.00	0.12
371	600871	石化油服	1,427,300	2,826,054.00	0.12
372	601106	中国一重	961,600	2,817,488.00	0.12
373	600567	山鹰国际	1,133,200	2,810,336.00	0.12
374	000785	居然之家	686,400	2,807,376.00	0.12
375	600064	南京高科	424,080	2,803,168.80	0.12
376	300376	易事特	407,100	2,780,493.00	0.12
377	600216	浙江医药	237,800	2,779,882.00	0.12
378	002468	申通快递	268,800	2,776,704.00	0.12
379	002429	兆驰股份	793,200	2,768,268.00	0.12
380	600782	新钢股份	670,900	2,743,981.00	0.12
381	601333	广深铁路	1,189,600	2,700,392.00	0.12

382	688029	南微医学	32,865	2,699,202.45	0.12
383	601718	际华集团	924,500	2,690,295.00	0.12
384	600667	太极实业	516,300	2,664,108.00	0.11
385	002081	金螳螂	548,600	2,660,710.00	0.11
386	601187	厦门银行	463,000	2,652,990.00	0.11
387	600062	华润双鹤	146,800	2,626,252.00	0.11
388	601118	海南橡胶	599,600	2,626,248.00	0.11
389	002010	传化智联	491,700	2,625,678.00	0.11
390	002191	劲嘉股份	361,400	2,612,922.00	0.11
391	600597	光明乳业	242,700	2,611,452.00	0.11
392	600737	中粮糖业	375,300	2,604,582.00	0.11
393	600728	佳都科技	493,200	2,604,096.00	0.11
394	300463	迈克生物	150,400	2,601,920.00	0.11
395	000537	广宇发展	196,100	2,594,403.00	0.11
396	600155	华创阳安	396,200	2,575,300.00	0.11
397	600376	首开股份	452,500	2,574,725.00	0.11
398	000540	中天金融	1,693,800	2,557,638.00	0.11
399	601156	东航物流	166,900	2,546,894.00	0.11
400	002221	东华能源	332,500	2,536,975.00	0.11
401	002745	木林森	312,100	2,531,131.00	0.11
402	600131	国网信通	169,100	2,529,736.00	0.11
403	601098	中南传媒	252,300	2,517,954.00	0.11
404	300072	海新能科	576,900	2,515,284.00	0.11
405	002416	爱施德	261,400	2,478,072.00	0.11
406	600967	内蒙一机	298,700	2,467,262.00	0.11
407	600126	杭钢股份	592,200	2,445,786.00	0.10
408	603379	三美股份	85,640	2,437,314.40	0.10
409	000156	华数传媒	324,600	2,431,254.00	0.10
410	601991	大唐发电	869,200	2,425,068.00	0.10
411	603228	景旺电子	118,900	2,406,536.00	0.10
412	002048	宁波华翔	171,600	2,385,240.00	0.10

413	600808	马钢股份	847,800	2,382,318.00	0.10
414	601568	北元集团	417,550	2,367,508.50	0.10
415	000937	冀中能源	371,900	2,365,284.00	0.10
416	002281	光迅科技	147,700	2,321,844.00	0.10
417	002423	中粮资本	322,800	2,311,248.00	0.10
418	001914	招商积余	149,300	2,296,234.00	0.10
419	600901	江苏租赁	418,600	2,293,928.00	0.10
420	600373	中文传媒	238,500	2,282,445.00	0.10
421	600095	湘财股份	300,300	2,270,268.00	0.10
422	688289	圣湘生物	103,331	2,268,115.45	0.10
423	300630	普利制药	91,853	2,265,094.98	0.10
424	003035	南网能源	398,100	2,257,227.00	0.10
425	000559	万向钱潮	463,460	2,257,050.20	0.10
426	603056	德邦股份	108,000	2,249,640.00	0.10
427	000898	鞍钢股份	840,600	2,244,402.00	0.10
428	603317	天味食品	80,220	2,204,445.60	0.09
429	000402	金融街	418,878	2,199,109.50	0.09
430	301029	怡合达	33,200	2,182,568.00	0.09
431	002434	万里扬	270,900	2,180,745.00	0.09
432	000563	陕国投 A	718,000	2,175,540.00	0.09
433	002867	周大生	154,550	2,168,336.50	0.09
434	600556	天下秀	316,400	2,132,536.00	0.09
435	601598	中国外运	553,300	2,124,672.00	0.09
436	601928	凤凰传媒	268,100	2,123,352.00	0.09
437	601608	中信重工	608,300	2,122,967.00	0.09
438	601611	中国核建	278,900	2,119,640.00	0.09
439	600707	彩虹股份	503,100	2,082,834.00	0.09
440	300257	开山股份	138,800	2,082,000.00	0.09
441	002948	青岛银行	619,520	2,081,587.20	0.09
442	600195	中牧股份	179,100	2,081,142.00	0.09
443	000959	首钢股份	548,600	2,068,222.00	0.09

444	600968	海油发展	713,800	2,055,744.00	0.09
445	001203	大中矿业	158,800	2,053,284.00	0.09
446	000967	盈峰环境	446,500	2,027,110.00	0.09
447	600167	联美控股	320,500	2,025,560.00	0.09
448	002110	三钢闽光	430,800	2,024,760.00	0.09
449	603650	彤程新材	62,800	1,936,124.00	0.08
450	002705	新宝股份	115,700	1,926,405.00	0.08
451	000415	渤海租赁	867,200	1,916,512.00	0.08
452	000990	诚志股份	212,900	1,873,520.00	0.08
453	300869	康泰医学	56,700	1,846,719.00	0.08
454	688006	杭可科技	42,101	1,842,760.77	0.08
455	002925	盈趣科技	109,790	1,813,730.80	0.08
456	600307	酒钢宏兴	1,098,700	1,812,855.00	0.08
457	601828	美凯龙	379,900	1,781,731.00	0.08
458	002242	九阳股份	107,500	1,771,600.00	0.08
459	603638	艾迪精密	117,780	1,757,277.60	0.08
460	600339	中油工程	587,300	1,750,154.00	0.07
461	600764	中国海防	74,900	1,719,704.00	0.07
462	688819	天能股份	46,400	1,704,736.00	0.07
463	000031	大悦城	451,100	1,696,136.00	0.07
464	002653	海思科	75,806	1,686,683.50	0.07
465	002399	海普瑞	130,900	1,682,065.00	0.07
466	600623	华谊集团	265,200	1,676,064.00	0.07
467	002146	荣盛发展	762,300	1,654,191.00	0.07
468	600928	西安银行	467,800	1,646,656.00	0.07
469	688088	虹软科技	70,561	1,588,328.11	0.07
470	601969	海南矿业	213,800	1,584,258.00	0.07
471	600006	东风汽车	280,900	1,567,422.00	0.07
472	600648	外高桥	130,800	1,563,060.00	0.07
473	600787	中储股份	306,900	1,525,293.00	0.07
474	603719	良品铺子	40,800	1,504,296.00	0.06

475	002563	森马服饰	283,300	1,484,492.00	0.06
476	000961	中南建设	671,000	1,469,490.00	0.06
477	000869	张裕 A	47,731	1,443,385.44	0.06
478	600377	宁沪高速	174,400	1,433,568.00	0.06
479	601869	长飞光纤	42,800	1,396,564.00	0.06
480	000553	安道麦 A	153,400	1,388,270.00	0.06
481	601298	青岛港	246,500	1,382,865.00	0.06
482	600350	山东高速	236,600	1,346,254.00	0.06
483	000062	深圳华强	110,052	1,343,734.92	0.06
484	601139	深圳燃气	201,600	1,318,464.00	0.06
485	002945	华林证券	94,700	1,248,146.00	0.05
486	001872	招商港口	81,900	1,176,084.00	0.05
487	601228	广州港	370,500	1,167,075.00	0.05
488	600299	安迪苏	140,500	1,160,530.00	0.05
489	603355	莱克电气	40,320	1,130,572.80	0.05
490	603868	飞科电器	16,600	1,117,678.00	0.05
491	601158	重庆水务	201,700	1,034,721.00	0.04
492	600956	新天绿能	107,100	1,032,444.00	0.04
493	300741	华宝股份	43,200	1,016,496.00	0.04
494	603786	科博达	14,000	921,620.00	0.04
495	600927	永安期货	56,100	904,332.00	0.04
496	600917	重庆燃气	110,200	877,192.00	0.04
497	600032	浙江新能	72,800	836,472.00	0.04
498	001227	兰州银行	219,200	826,384.00	0.04
499	688772	珠海冠宇	39,400	734,416.00	0.03
500	002901	大博医疗	19,500	663,585.00	0.03

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	688392	骄成超声	2,745	368,571.15	0.02
2	688035	德邦科技	4,981	243,172.42	0.01
3	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
4	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
5	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.00
6	688455	科捷智能	5,277	69,234.24	0.00
7	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
8	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
9	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
10	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
11	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
12	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
13	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
14	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
15	301301	C川宁	3,574	26,912.22	0.00
16	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
17	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
18	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
19	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
20	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
21	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
22	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
23	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
24	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
25	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
26	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
27	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
28	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
29	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
30	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
31	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00

32	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
33	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
34	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
35	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
36	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
37	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
38	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
39	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
40	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
41	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
42	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
43	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
44	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
45	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
46	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
47	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
48	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
49	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
50	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
51	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
52	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
53	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
54	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	600096	云天化	14,734,205.70	0.62
2	300769	德方纳米	14,667,613.40	0.62

3	002340	格林美	14,522,097.05	0.61
4	300012	华测检测	13,881,017.84	0.58
5	002497	雅化集团	13,366,769.00	0.56
6	002240	盛新锂能	13,036,426.47	0.55
7	688122	西部超导	11,727,529.45	0.49
8	688063	派能科技	11,356,209.96	0.48
9	688180	君实生物	11,305,613.53	0.48
10	300390	天华超净	11,139,864.00	0.47
11	688777	中控技术	11,089,658.03	0.47
12	002407	多氟多	11,014,455.18	0.46
13	601058	赛轮轮胎	10,719,662.80	0.45
14	300073	当升科技	10,715,860.08	0.45
15	300003	乐普医疗	10,646,278.85	0.45
16	605358	立昂微	10,411,668.48	0.44
17	002756	永兴材料	9,975,101.00	0.42
18	002738	中矿资源	9,857,368.00	0.42
19	603606	东方电缆	9,836,666.00	0.41
20	603345	安井食品	9,827,049.66	0.41

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 累计卖出金额超初期基金资产净值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	600256	广汇能源	19,873,652.00	0.84
2	600522	中天科技	18,780,695.78	0.79
3	601615	明阳智能	18,759,071.50	0.79
4	000733	振华科技	17,149,279.00	0.72
5	600188	兖矿能源	15,034,283.00	0.63
6	002340	格林美	14,602,124.00	0.61

7	002180	纳思达	14,289,610.00	0.60
8	600732	爱旭股份	13,523,302.00	0.57
9	688005	容百科技	13,028,045.53	0.55
10	600233	圆通速递	12,585,077.08	0.53
11	300751	迈为股份	12,470,245.40	0.53
12	601117	中国化学	12,337,466.79	0.52
13	300769	德方纳米	11,866,738.94	0.50
14	000723	美锦能源	11,634,508.93	0.49
15	600884	杉杉股份	10,938,544.00	0.46
16	000983	山西焦煤	10,434,115.40	0.44
17	605358	立昂微	10,188,529.94	0.43
18	600875	东方电气	9,939,651.00	0.42
19	601689	拓普集团	9,868,409.00	0.42
20	002240	盛新锂能	9,791,282.00	0.41

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	1,259,424,916.20
卖出股票收入（成交）总额	949,754,302.24

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	730,584.44	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	730,584.44	0.03

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118030	睿创转债	4,200	420,005.52	0.02
2	113065	齐鲁转债	3,230	310,578.92	0.01

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

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头存应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪

不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

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	13,900,231.01
2	应收清算款	-
3	应收股利	4,144.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	140,915.40
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,045,290.91

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	002422	科伦药业	2,442,798.00	0.10	转融通证券出借
2	603613	国联股份	1,857,240.00	0.08	转融通证券出借
3	600157	永泰能源	1,577,124.00	0.07	转融通证券出借
4	300012	华测检测	1,373,680.00	0.06	转融通证券出借
5	300724	捷佳伟创	980,572.00	0.04	转融通证券出借
6	300003	乐普医疗	799,356.00	0.03	转融通证券出借
7	002340	格林美	790,552.00	0.03	转融通证券出借
8	002384	东山精密	699,859.00	0.03	转融通证券出借
9	688777	中控技术	290,656.00	0.01	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	688392	骄成超声	368,571.15	0.02	科创板打新限售
2	688035	德邦科技	243,172.42	0.01	科创板打新限售
3	688084	晶品特装	140,118.75	0.01	科创板打新限售

4	301269	华大九天	102,713.92	0.00	创业板打新限售
5	688143	长盈通	82,675.08	0.00	科创板打新限售

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

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		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
5,463	453,305.60	13,503,167.00	0.55%	87,480,734.00	3.53%	2,375,424,569.00	95.92%

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中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,375,424,569.00	95.92%
2	中国国际金融股份有限公司	3,924,614.00	0.16%
3	赵梦野	3,000,000.00	0.12%
4	中信建投证券股份有限公司	2,267,784.00	0.09%

5	新疆友好（集团）股份有限公司	2,068,600.0 0	0.08%
6	冯书生	2,058,000.0 0	0.08%
7	张如依	2,045,100.0 0	0.08%
8	刘国胜	1,981,700.0 0	0.08%
9	广发证券股份有限公司	1,672,034.0 0	0.07%
10	赵中相	1,500,000.0 0	0.06%

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	2,000.00	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 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月07日)基金份额总额	333,908,470.00
本报告期期初基金份额总额	2,056,408,470.00
本报告期基金总申购份额	627,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	207,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,476,408,470.00

§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 80,000.00 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 2 年 5 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	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	

	数量					
安信证券	3	410,223,567.21	18.94%	177,068.60	20.68%	-
东方财富证券	2	83,502,485.92	3.86%	35,730.20	4.17%	-
方正证券	5	428,870,986.82	19.80%	185,021.65	21.61%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	42,542,612.34	1.96%	18,349.18	2.14%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	388,551,704.99	17.94%	89,791.68	10.49%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	34,462,179.15	1.59%	14,863.65	1.74%	-
华鑫证券	1	61,212,924.11	2.83%	26,401.74	3.08%	-
江海证券	2	35,259,228.33	1.63%	15,210.67	1.78%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	616,722,550.34	28.47%	265,995.01	31.06%	-
信达证券	1	60,339,399.28	2.79%	26,030.03	3.04%	-
银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

中信建投证券	2	4,359,732.86	0.20%	1,880.45	0.22%	-
--------	---	--------------	-------	----------	-------	---

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。

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	6,053,248.54	41.75%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	2,377,200.00	16.40%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	777,696.15	5.36%	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	398,000.00	2.75%	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	630,527.56	4.35%	-	-	-	-	-	-
信达证券	4,261,855.13	29.40%	-	-	-	-	-	-
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	2022-01-06
3	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-01-22
4	天弘中证500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
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-05
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-17
7	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
8	天弘中证500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	2022-03-18
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-23
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-24
11	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-28
12	天弘中证500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
13	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-03-31
14	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-04-08
15	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
16	天弘中证500交易型开放式	中国证监会规定媒介	2022-04-22

	指数证券投资基金2022年第一季度报告		
17	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
18	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
19	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
20	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-06-01
21	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
22	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
23	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-07-11
24	天弘中证500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
25	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
26	天弘中证500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	2022-08-11
27	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-08-29
28	天弘中证500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
29	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2022-09-01

	旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告		
30	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-05
31	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-09
32	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-10
33	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-09-13
34	天弘中证500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
35	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-10-28
36	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500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
37	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
38	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-11-28
39	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-12-09
40	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2022-12-16
41	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500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%	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		的时间区 间					
联接基金	1	20220101- 20221231	1,933,324, 319.00	642,247,70 0.00	200,147,45 0.00	2,375,424, 569.00	95.9 2%
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中证500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500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