

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券 投资基金 2022 年年度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：华泰柏瑞基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2023 年 3 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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 30 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。

本年度报告财务资料已经审计，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)为本基金出具了无保留意见的审计报告。

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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	8
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§ 6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§ 7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	23
§ 8 投资组合报告	178

8.1 期末基金资产组合情况	178
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	179
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	181
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	189
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	190
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	190
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	190
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	191
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	191
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	191
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	191
8.12 投资组合报告附注	191
§ 9 基金份额持有人信息	192
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	192
9.2 期末上市基金前十名持有人	193
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	193
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	193
§ 10 开放式基金份额变动	193
§ 11 重大事件揭示	194
11.1 基金份额持有人大会决议	194
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	194
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	194
11.4 基金投资策略的改变	194
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	194
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	195
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	195
11.8 其他重大事件	197
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	199
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	199
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	200
§ 13 备查文件目录	200
13.1 备查文件目录	200
13.2 存放地点	200
13.3 查阅方式	201

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华泰柏瑞沪深 300ETF(扩位证券简称: 沪深 300ETF)
场内简称	300ETF
基金主代码	510300
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2012 年 5 月 4 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	19,691,587,690.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2012 年 5 月 28 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数表现, 追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采取完全复制法, 即完全按照标的指数的成份股组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。但在因特殊情况(如流动性不足)导致无法获得足够数量的股票时, 基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合, 追求尽可能贴近目标指数的表现。
业绩比较基准	沪深 300 指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金, 股票最低仓位为 95%, 并采用完全复制的被动式投资策略: 一方面, 相对于混合基金、债券基金与货币市场基金而言, 其风险和收益较高, 属于股票型基金中高风险、高收益的产品; 另一方面, 相对于采用抽样复制的指数型基金而言, 其风险和收益特征将更能与标的指数保持基本一致。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华泰柏瑞基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	郭明
	联系电话	021-38601777	010-66105799
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		400-888-0001	95588
传真		021-38601799	010-66105798
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		200135	100140

法定代表人	贾波	陈四清
-------	----	-----

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.huatai-pb.com
基金年度报告备置地点	上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层及托管人住所

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)	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-5,553,712,516.70	4,812,806,598.71	8,865,982,822.14
本期利润	-9,940,263,108.48	-1,000,246,570.00	10,510,569,368.53
加权平均基金份额本期利润	-0.7999	-0.1192	1.1486
本期加权平均净值利润率	-19.26%	-2.32%	26.36%
本期基金份额净值增长率	-20.32%	-3.82%	29.09%
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	24,418,175,843.72	26,314,519,217.38	22,409,392,982.13
期末可供分配基金份额利润	1.2400	2.3204	2.5884
期末基金资产净值	77,502,503,225.35	56,886,059,237.46	45,748,405,887.28
期末基金	3.9358	5.0162	5.2842

份额净值			
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	69.92%	113.24%	121.71%

注：1、上述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额。本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、本基金于 2012 年 5 月 11 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买沪深 300ETF 后的实际份额净值变动情况。

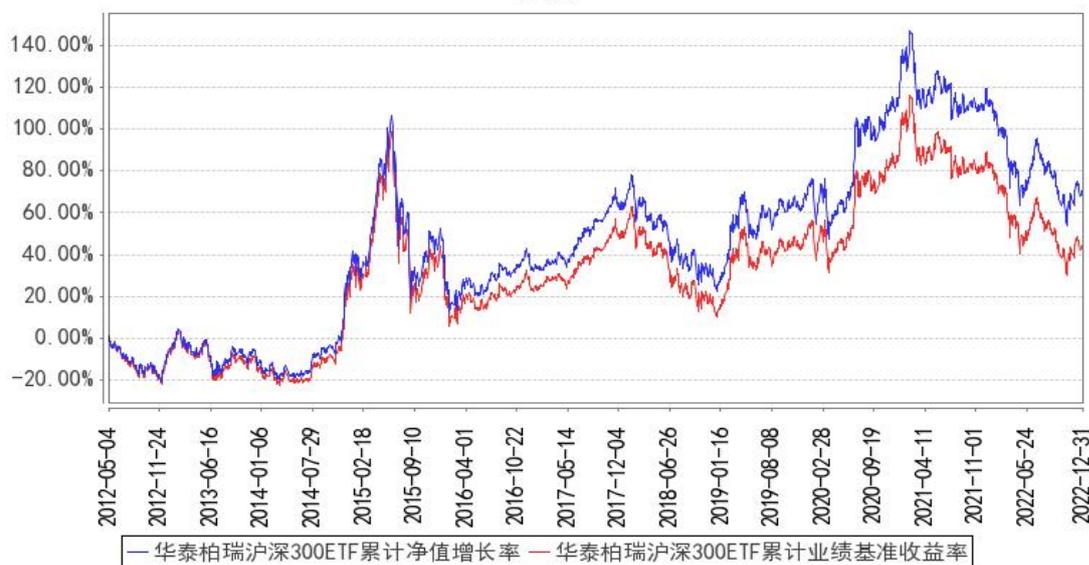
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.76%	1.28%	1.75%	1.29%	0.01%	-0.01%
过去六个月	-12.85%	1.10%	-13.68%	1.11%	0.83%	-0.01%
过去一年	-20.32%	1.28%	-21.63%	1.28%	1.31%	0.00%
过去三年	-1.06%	1.30%	-5.49%	1.30%	4.43%	0.00%
过去五年	3.90%	1.30%	-3.95%	1.30%	7.85%	0.00%
自基金合同生效起至今	69.92%	1.40%	43.85%	1.41%	26.07%	-0.01%

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

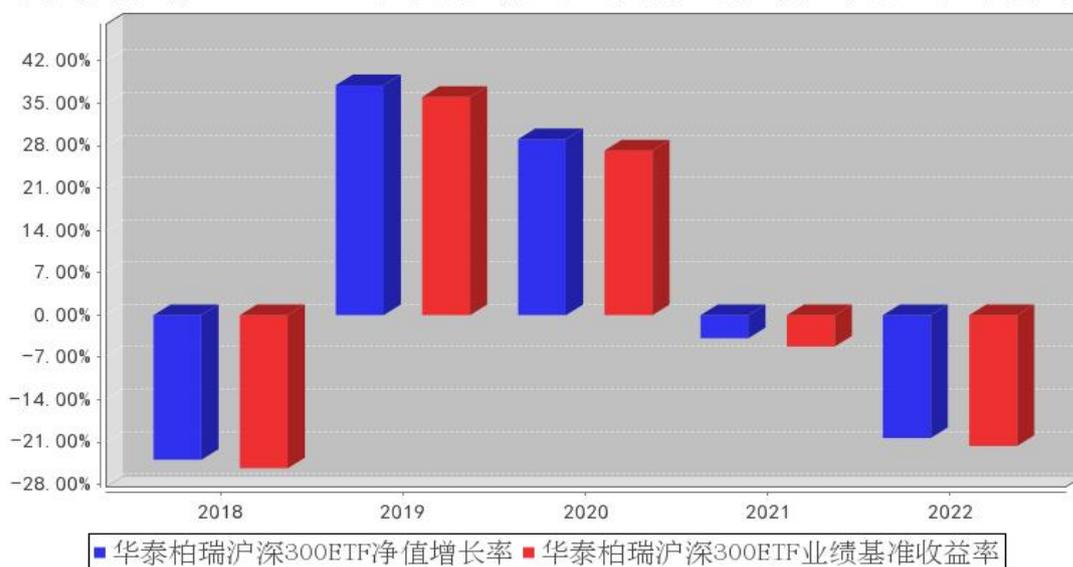
华泰柏瑞沪深300ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为 2012 年 5 月 4 日至 2022 年 12 月 31 日。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

华泰柏瑞沪深300ETF基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位：人民币元

年度	每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2022 年	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-
2021 年	0.7200	635,399,113.28	-	635,399,113.28	-
2020 年	-	-	-	-	-

合计	1.4700	1,498,963,195.43	-	1,498,963,195.43
----	--------	------------------	---	------------------

§ 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

本基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司。华泰柏瑞基金管理有限公司是经中国证监会批准，于 2004 年 11 月 18 日成立的合资基金管理公司，注册资本为 2 亿元人民币。目前的股东构成为华泰证券股份有限公司、柏瑞投资有限责任公司（原 AIGGIC）和苏州新区高新技术产业股份有限公司，出资比例分别为 49%、49%和 2%。目前公司旗下管理华泰柏瑞盛世中国混合型证券投资基金、华泰柏瑞金字塔稳本增利债券型证券投资基金、上证红利交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞积极成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞价值增长混合型证券投资基金、华泰柏瑞货币市场证券投资基金、华泰柏瑞行业领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化先行混合型证券投资基金、华泰柏瑞亚洲领导企业混合型证券投资基金、华泰柏瑞信用增利债券型证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞稳健收益债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化增强混合型证券投资基金、华泰柏瑞丰盛纯债债券型证券投资基金、华泰柏瑞季季红债券型证券投资基金、华泰柏瑞创新升级混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化优选灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞创新动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化驱动灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞积极优选股票型证券投资基金、华泰柏瑞新利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞消费成长灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化智慧灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞健康生活灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化绝对收益策略定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞交易型货币市场基金、华泰柏瑞激励动力灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞精选回报灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化对冲稳健收益定期开放混合型发起式证券投资基金、华泰柏瑞天添宝货币市场基金、华泰柏瑞多策略灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞新经济沪港深灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞鼎利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞享利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化创优灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞生物医药灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞富利灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞量化阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞港股通量化灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞战略新兴产业混合型证券投资基金、华泰柏瑞新金融地产灵活配置混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数基金、华泰柏瑞医疗健

康混合型证券投资基金、华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通指数基金联接基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化明选混合型证券投资基金、华泰柏瑞基本面智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞锦泰一年定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞益通三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞研究精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气回报一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞锦兴 39 个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞锦瑞债券型证券投资基金、华泰柏瑞益商一年定期开放债券型发起式证券投资基金、华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞质量成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞行业精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿利中短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞品质优选混合型证券投资基金、华泰柏瑞景利混合型证券投资基金、华泰柏瑞优势领航混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞锦乾债券型证券投资基金、华泰柏瑞量化创盈混合型证券投资基金、华泰柏瑞成长智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞量化创享混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量领先混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证动漫游戏交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞品质成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞质量精选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞港股通时代机遇混合型证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞行业严选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证企业核心竞争力 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞远见智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞恒利混合型证券投资基金、华泰柏瑞景气成长混合型证券投资基金、华泰柏瑞创业板科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、华泰柏瑞锦元债券型证券投资基金、华泰柏瑞上证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、华泰柏瑞中证沪港深品牌消费 50 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证稀土产业交易型开放式指数证券投资

资基金发起式联接基金、华泰柏瑞景气汇选三年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞聚优智选一年持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞匠心汇选混合型证券投资基金、华泰柏瑞鸿益 30 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通高股息投资交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞恒悦混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证全指电力公用事业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 500 指数增强型证券投资基金、华泰柏瑞鸿裕 90 天滚动持有短债债券型证券投资基金、华泰柏瑞恒泽混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证同业存单 AAA 指数 7 天持有期证券投资基金、华泰柏瑞匠心臻选混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证中药交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞低碳经济智选混合型证券投资基金、华泰柏瑞国证疫苗与生物科技交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金 (QDII)、华泰柏瑞益兴三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞景气驱动混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)、华泰柏瑞益安三个月定期开放债券型证券投资基金、华泰柏瑞行业优选 6 个月持有期混合型证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金 (QDII)。截至 2022 年 12 月 31 日，公司基金管理规模为 3,091.70 亿元。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2012 年 5 月 4 日	-	21 年	21 年证券（基金）从业经历，复旦大学财务管理硕士，2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务，2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员，2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。

				<p>2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 11 月任华泰柏瑞锦利灵活配置混合型证券投资基金和华泰柏瑞裕利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 3 月至 2018 年 10 月任华泰柏瑞泰利灵活配置混合型证券投资基金的基金经理。2018 年 4 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2018 年 10 月起任华泰柏瑞 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2018 年 12 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 7 月起任华泰柏瑞中证红利低波动交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2019 年 9 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2020 年 2 月至 2021 年 4 月任华泰柏瑞中证科技 100 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2020 年 9 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 3 月起任华泰柏瑞上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2021 年 5 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 7 月起任华泰柏瑞中证沪港深创新药产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 8 月起任华泰柏瑞中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月起任华泰柏瑞中证 500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月起任华泰柏瑞南方东英恒生科技指数交易型开放式指数证券投资基金联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 11 月起任华泰柏瑞中证韩交所中韩半导体交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p>
--	--	--	--	---

注：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。任职日期和离

职日期指基金管理公司作出决定之日。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

注：截至本报告期末，本基金的基金经理不存在兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券法》、《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》及其他相关法律、法规的规定以及本基金的《基金合同》的约定，在严格控制风险的基础上，忠实履行基金管理职责，为基金份额持有人谋求最大利益。在本报告期内，基金投资管理符合有关法律、法规的规定及基金合同的约定，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

报告期内，本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》的要求，建立了科学完善的公平交易管理制度，从事前、事中和事后等环节严格控制不同基金之间可能发生的利益输送。投资部和研究部通过规范的决策流程公平对待不同投资组合。交易部对投资指令的合规性、有效性及合理性进行独立审核，对于场内交易的非组合指令启用投资管理系统中的公平交易模块；对于场外交易按照时间优先价格优先的原则公平对待不同帐户。风险管理部对报告期内的交易进行日常监控和分析评估，同时对投资组合的交易价差在不同时间窗（如日内、3 日、5 日）下进行分析，综合判断各基金之间是否存在不公平交易或利益输送的可能，确保公平交易的实施。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，公司将投资管理职能和交易执行职能完全隔离，实行集中交易制度，由交易部为公募基金、专户理财和海外投资等业务统一交易服务，为公平交易的实施提供了较好的保障。

目前公司公募基金经理有兼任私募资产管理计划投资经理的情况，兼任业务遵照相关法律法规要求进行，同时遵守公司公平交易制度。公司机构设置合理，公平交易的相关管理制度健全，投资决策流程完善，各项制度执行情况良好。交易价差分析表明公司旗下各基金均得到了公平对待，不存在非公平交易和利益输送的行为。经过对不同基金之间交易相同证券时的同向交易价差进行分析发现，报告期内基金之间的买卖交易价差总体上处于正常的合理水平。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为

的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易共 3 次，系因被动跟踪标的指数需要，与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

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

2022 年市场以结构性机会为主，其中煤炭、综合板块、社会服务、交通运输的表现相对较好，涨跌幅分别为 10.95%、10.57%、-2.23%和-3.41%。整体来看，沪深 300、中证 500、中证 1000 和创业板的涨跌幅分别为-21.63%、-20.31%、-21.58%、和-29.37%。从市场风格来看，价值风格表现优于成长风格，期间沪深 300 价值指数和沪深 300 成长指数的涨跌幅分别为-14.51%和-30.69%，中证 500 价值相对中证 500 成长亦获得了显著的超额收益。

同比港股市场，恒生综合行业-能源业、恒生综合行业指数-电讯业、恒生沪深港基因及肿瘤学、恒生沪深港通大湾区消费服务指数等板块的表现相对较好，涨跌幅分别为 17.29%、6.87%、4.00%和 0.71%。恒生指数、恒生中国企业指数和恒生综合指数在今天的涨跌幅分别为-15.46%、-18.59%和-17.99%。

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.016%，期间日跟踪误差为 0.028%，较好地实现了本基金的投资目标。

本基金将继续严格遵守跟踪偏离最小化的被动投资策略，从而为基金投资人谋求与标的指数基本一致的投资回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末本基金份额净值为 3.9358 元；本报告期基金份额净值增长率为-20.32%，业绩比较基准收益率为-21.63%。

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，在俄乌冲突全面爆发之后，全球滞胀格局加剧，传统能源以及资源运输成为全年表现最为亮眼的行业；对于国内而言，疫情防控与房地产政策的变化始终影响着投资者的基本面预期，宏观波动率成为了定价的核心。展望 2023 年，疫情与地产政策边际回暖，海外通胀持续回落、美联储加息放缓几乎已成共识。在市场盈利增速修复的背景下，当前较低的估值水平下指数获得

估值修复的概率更大，市场整体 Beta 机会不可忽视。风格上，全年存在大小盘风格切换行情，海外加息放缓与“中国式现代化”特征的估值体系或成为风格切换的核心变量。行业层面，从海外经验，疫情达峰后带动消费复苏，食品饮料、旅游出行等板块会有修复性行情。同时，关注政策边际变化、困境反转的行业，比如地产、大金融板块。最后，关注景气改善的行业，比如光伏、TMT 等行业。即便如此，投资者在未来一段时间内依然时刻面临着诸多的不确定性，比如国内经济复苏的程度、海外经济衰退的程度等，投资仍需谨慎乐观。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

2022 年度，本基金管理人在为基金份额持有人谋求最大利益的同时，始终将合规运作、防范风险工作放在各项工作的首位。依照公司内部控制的整体要求，继续致力于内控机制的完善，加强内部风险的控制与防范，确保各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。公司监察部门按照规定的权限和程序，通过实时监控、现场检查、重点抽查和人员询问等方法，独立地开展基金运作和公司管理的合规性稽核，发现问题及时提出改进建议并督促业务部门进行整改，同时定期向董事长和公司管理层出具监察稽核报告。

本报告期内，基金管理人内部监察稽核主要工作如下：

(1) 全面开展基金运作合规监察工作，确保基金投资的独立性、公平性及合法合规

主要措施有：严格执行集中交易制度，各基金相互独立，交易指令由中央交易室统一执行完成；对基金投资交易系统事先进行合规性设置，并由风险控制部门进行实时监控，杜绝出现违规行为；严格检查基金的投资决策、研究支持、交易过程是否符合规定的程序；通过以上措施，保证了投资运作遵循投资决策程序与业务流程，保证了基金投资组合符合相关法规及基金合同规定，确保了基金投资行为的独立、公平及合法合规。

(2) 开展定期和专项监察稽核工作，确保各项业务活动的合法合规

本年度公司监察稽核部门开展了对公司基金投资、研究、销售、后台运营、反洗钱等方面的专项监察稽核活动。对稽核中发现问题及时发出合规提示函，要求相关部门限期整改，并对改进情况安排后续跟踪检查，确保各项业务开展合法合规。

(3) 促进公司各项内部管理制度的完善

按照相关法规、证监会等监管机关的相关规定和公司业务的发展的要求，公司法律监察部门及时要求各部门制订或修改相应制度，促进公司各项内部管理制度的进一步完善。

(4) 通过各种合规培训提高员工合规意识

本年度公司监察稽核部门通过对公司所有新入职员工进行入职前合规培训、对全体人员开展行为规范培训、对基金投资管理人员进行专项合规培训、对员工进行反洗钱培训等，有效提高了公司

员工的合规意识。

通过以上工作的开展，在本报告期内本基金运作过程中未发生违规情形，基金运作整体合法合规。在今后的工作中，本基金管理人承诺将一如既往的本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，不断提高内部监察稽核工作的科学性和有效性，努力防范各种风险，为基金持有人谋求最大利益。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本报告期内，基金管理人严格执行基金估值控制流程，定期评估估值技术的合理性，每日将估值结果报托管银行复核后对外披露。参与估值流程的人员包括负责运营的副总经理以及投资研究、风险控制和基金事务部门负责人，基金经理不参与估值流程。参与人员的相关工作经历均在五年以上。参与各方之间不存在任何重大利益冲突。已采用的估值技术相关参数或定价服务均来自独立第三方。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据基金合同的规定，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可进行收益分配。本报告期内，本基金符合分红条件，于 2022 年 1 月 19 日进行分配，每 10 份基金份额共派发红利 0.75 元，利润分配合计 863,564,082.15 元。

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

注：无。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——华泰柏瑞基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

准确和完整。

§ 6 审计报告

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 24632 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	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞沪深 300 ETF 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。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司(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。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金的财务报告过程。	
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。</p> <p>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：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(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。</p> <p>(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。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致华泰柏瑞沪深 300 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(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。</p> <p>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	朱宏宇	朱寅婷
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 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	155,603,662.35	235,699,884.97
结算备付金		1,179,756,245.63	1,222,370,183.37
存出保证金		113,458,113.95	142,546,631.84
交易性金融资产	7.4.7.2	76,183,605,477.34	55,381,502,659.10
其中：股票投资		76,183,605,477.34	55,381,502,659.10
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,829,488.24	19,407,797.62
应收股利		329,237.44	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	1,122,995.87	1,708,435.57
资产总计		77,636,705,220.82	57,003,235,592.47
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		30,652.12	67,951.26
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		53,830,041.48	5,546,645.91
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		30,555,976.07	20,251,085.76
应付托管费		6,111,195.25	4,050,217.15
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		11.83	308,093.67
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	43,674,118.72	86,952,361.26
负债合计		134,201,995.47	117,176,355.01
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	53,084,327,381.63	30,571,540,020.08
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	24,418,175,843.72	26,314,519,217.38
净资产合计		77,502,503,225.35	56,886,059,237.46
负债和净资产总计		77,636,705,220.82	57,003,235,592.47

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 3.9358 元，基金份额总额 19,691,587,690.00 份。

7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-9,614,693,720.31	-655,735,759.43
1. 利息收入		61,140,765.01	105,267,088.18
其中：存款利息收入	7.4.7.13	15,991,574.47	18,152,609.36
债券利息收入		-	17,826.56
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		45,149,190.54	87,096,652.26
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以 “-”填列）		-5,316,802,755.26	4,960,836,663.90
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-6,115,280,837.41	4,142,083,896.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	12,025,722.73	24,179,469.38
资产支持证券	7.4.7.16	-	-

投资收益			
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-229,759,415.22	87,673,689.32
股利收益	7.4.7.19	1,016,211,774.64	706,899,609.20
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）	7.4.7.20	-4,386,550,591.78	-5,813,053,168.71
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	27,518,861.72	91,213,657.20
减：二、营业总支出		325,569,388.17	344,510,810.57
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	258,135,795.38	214,959,646.71
2. 托管费	7.4.10.2.2	51,627,159.00	42,991,929.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	-	-
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	7.4.7.22	-	-
7. 税金及附加		39.32	315,682.61
8. 其他费用	7.4.7.23	15,806,394.47	86,243,551.89
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,940,263,108.48	-1,000,246,570.00
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,940,263,108.48	-1,000,246,570.00
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-9,940,263,108.48	-1,000,246,570.00

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46

产（基金净值）				
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）	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	22,512,787,361.55	-	-1,896,343,373.66	20,616,443,987.89
（一）、综合收益总额	-	-	-9,940,263,108.48	-9,940,263,108.48
（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）	22,512,787,361.55	-	8,907,483,816.97	31,420,271,178.52
其中：1. 基金申购款	69,083,856,794.64	-	36,075,203,038.81	105,159,059,833.45
2. 基金赎回款	-46,571,069,433.09	-	-27,167,719,221.84	-73,738,788,654.93
（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）	-	-	-863,564,082.15	-863,564,082.15
（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）	53,084,327,381.63	-	24,418,175,843.72	77,502,503,225.35
项目	上年度可比期间			
	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	23,339,012,905.15	-	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28
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）	23,339,012,905.15	-	22,409,392,982.13	45,748,405,887.28
三、本期增减变动	7,232,527,114.93	-	3,905,126,235.25	11,137,653,350.18

额(减少以“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-1,000,246,570.00	-1,000,246,570.00
(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)	7,232,527,114.93	-	5,540,771,918.53	12,773,299,033.46
其中:1.基金申购款	60,616,389,616.49	-	54,875,089,370.83	115,491,478,987.32
2.基金赎回款	-53,383,862,501.56	-	-49,334,317,452.30	-102,718,179,953.86
(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)	-	-	-635,399,113.28	-635,399,113.28
(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)	30,571,540,020.08	-	26,314,519,217.38	56,886,059,237.46

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:

韩勇

房伟力

赵景云

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

华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2012]392 号《关于核准华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金及联接基金募集的批复》核准,由华泰柏瑞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《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 32,967,336,606.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第 121 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏

瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2012 年 5 月 4 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 32,968,633,875.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 1,297,269.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金于 2012 年 5 月 11 日进行了基金份额折算，折算比例为 0.37094933，并于 2012 年 5 月 14 日进行了变更登记。

经上海证券交易所（以下简称“上交所”）上证基字[2012]14 号文审核同意，本基金 12,229,687,690.00 份基金份额于 2012 年 5 月 28 日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数沪深 300 指数成份股、备选成份股为主要投资对象；此外，为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于新股（一级市场初次发行或增发）、存托凭证、债券、权证、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。本基金投资标的指数成份股及备选成份股的比例不低于基金资产净值的 95%。在正常市场情况下，本基金日均跟踪偏离度（剔除成份股分红因素）的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。本基金的业绩比较基准为沪深 300 指数。

华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，于 2012 年 5 月 29 日募集成立了华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）。华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人华泰柏瑞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》、《华泰柏瑞沪深 300 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

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产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和资产支持证券投资，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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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,在资产负债表中以交易性金融负债列示。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。

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

金融资产和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和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债,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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金 1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且 2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金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基金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

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扣除按票面利率(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后的净额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。

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。本基金的基金管理人每季度定期对基金相对标的指数的超额收益率进行一次评估，基金收益评价日核定的基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率达到 1%以上，方可对超额收益进行分配；基于本基金的性质和特点，本基金的收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使还原后基金份额净值低于面值。基金收益分配比例为收益评价日符合上述分红条件的基金超额收益的 100%，自基金合同生效日起不满 3 个月可不进行收益分配，基金收益分配每年至多 4 次。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》提供的指数收益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(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场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——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、应收利息和应收证券清算款,金额分别为235,699,884.97元、1,222,370,183.37元、142,546,631.84元、1,708,435.57元和19,407,797.62元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收清算款,金额分别为235,739,584.30

元、1,222,958,695.23 元、142,548,983.86 元、1,077,872.36 元和 19,407,797.62 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 55,381,502,659.10 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 55,381,502,659.10 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付管理人报酬、应付托管费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,546,645.91 元、20,251,085.76 元、4,050,217.15 元、3,337,919.65 元和 83,236,770.49 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付管理人报酬、应付托管费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 5,546,645.91 元、20,251,085.76 元、4,050,217.15 元、3,337,919.65 元和 83,236,770.49 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负债为交易性金融负债，金额为 67,951.26 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负债为交易性金融负债，金额为 67,951.26 元。

(ii) 于 2021 年 12 月 31 日，“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，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，本基金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

本基金本报告期末发生会计估计变更。

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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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	上年度末
	2022 年 12 月 31 日	2021 年 12 月 31 日
活期存款	155,603,662.35	235,699,884.97
等于：本金	155,582,321.34	235,699,884.97
加：应计利息	21,341.01	-
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	155,603,662.35	235,699,884.97

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	80,745,303,515.26	-	76,183,605,477.34	-4,561,698,037.92
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	80,745,303,515.26	-	76,183,605,477.34	-4,561,698,037.92
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	55,548,196,088.44	-	55,381,502,659.10	-166,693,429.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	-	-	-	-
交易所市场	-	-	-	-

	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		55,548,196,088.44	-	55,381,502,659.10	-166,693,429.34

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				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	918,287,940.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	918,287,940.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	918,287,940.00	-	-	-	
项目	上年度末 2021年12月31日				备注
	合同/名义 金额	公允价值			
		资产	负债		
利率衍生工具	-	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	-	
权益衍生工具	1,168,432,020.00	-	-	-	
其中：股指期货投资	1,168,432,020.00	-	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	-	
合计	1,168,432,020.00	-	-	-	

注：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。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IF2303	沪深 2303	770.00	901,870,200.00	-16,417,740.00
合计				-16,417,740.00
减：可抵销期货暂收款				-16,417,740.00
净额				-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有黄金衍生品。

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

注：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

注：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。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

注：无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：截至本报告期末，本基金未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
应收利息	-	1,708,435.57
其他应收款	1,122,995.87	-
待摊费用	-	-
合计	1,122,995.87	1,708,435.57

7.4.7.9 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	500,000.00	500,000.00
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,121,318.42	3,337,919.65
其中：交易所市场	3,121,318.42	3,337,919.65
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	270,000.00	377,671.12
应付指数使用费	4,659,394.85	3,232,054.19
应退退补款	35,123,405.45	79,504,716.30
合计	43,674,118.72	86,952,361.26

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	11,340,487,690.00	30,571,540,020.08
本期申购	25,626,600,000.00	69,083,856,794.64
本期赎回（以“-”号填列）	-17,275,500,000.00	-46,571,069,433.09
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-

本期末	19,691,587,690.00	53,084,327,381.63
-----	-------------------	-------------------

注：投资者申购、赎回的基金份额需为最小申购赎回单位的整数倍。

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期末及上年度末未持有其他综合收益。

7.4.7.12 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	43,552,108,324.03	-17,237,589,106.65	26,314,519,217.38
本期利润	-5,553,712,516.70	-4,386,550,591.78	-9,940,263,108.48
本期基金份额交易产生的变动数	27,838,501,350.90	-18,931,017,533.93	8,907,483,816.97
其中：基金申购款	88,129,604,839.79	-52,054,401,800.98	36,075,203,038.81
基金赎回款	-60,291,103,488.89	33,123,384,267.05	-27,167,719,221.84
本期已分配利润	-863,564,082.15	-	-863,564,082.15
本期末	64,973,333,076.08	-40,555,157,232.36	24,418,175,843.72

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	882,907.64	656,448.03
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	14,991,250.54	17,385,272.93
其他	117,416.29	110,888.40
合计	15,991,574.47	18,152,609.36

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,620,066,765.68	2,146,951,248.12
股票投资收益——赎回差价收入	-2,495,214,071.73	1,995,132,647.88
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	-6,115,280,837.41	4,142,083,896.00

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	36,817,120,319.82	49,224,520,823.75
减：卖出股票成本总额	40,381,079,177.39	47,077,569,575.63
减：交易费用	56,107,908.11	-
买卖股票差价收入	-3,620,066,765.68	2,146,951,248.12

7.4.7.14.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	73,738,788,654.93	102,718,179,953.86
减：现金支付赎回款总额	31,722,424,822.93	41,480,920,620.86
减：赎回股票成本总额	44,511,577,903.73	59,242,126,685.12
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-2,495,214,071.73	1,995,132,647.88

7.4.7.14.4 股票投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-申购差价收入。

7.4.7.14.5 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无证券出借差价收入。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
债券投资收益——利息收入	12,356.37	-

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	12,013,366.36	24,179,469.38
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	12,025,722.73	24,179,469.38

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	65,583,286.62	134,251,227.73
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	53,556,400.00	110,051,100.00
减：应计利息总额	12,684.08	20,658.35
减：交易费用	836.18	-
买卖债券差价收入	12,013,366.36	24,179,469.38

7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17 贵金属投资收益

7.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

注：无。

7.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：无。

7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

7.4.7.18.2 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1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 收益金额 2021年1月1日至2021年12月31日
股指期货投资收益	-229,759,415.22	87,673,689.32

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,016,211,774.64	706,899,609.20
其中：证券出借权益补偿收入	36,029,729.17	85,926,527.85
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	1,016,211,774.64	706,899,609.20

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	-4,395,004,608.58	-5,714,033,608.71
股票投资	-4,395,004,608.58	-5,714,033,608.71

债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	8,425,680.00	-99,019,560.00
权证投资	-	-
期货投资	8,425,680.00	-99,019,560.00
3. 其他	28,336.80	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-4,386,550,591.78	-5,813,053,168.71

注：其他为可退替代款的公允价值变动。

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	27,518,861.72	87,464,474.82
其他	-	3,749,182.38
合计	27,518,861.72	91,213,657.20

注：1、替代损益是指投资者采用可以现金替代或退补现金替代方式申购(赎回)本基金时，补入(卖出)被替代股票的实际买入成本(实际卖出金额)与申购(赎回)确认日估值的差额或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购(赎回)确认日估值的差额。

2、其他为康美药业赔偿款。

7.4.7.22 信用减值损失

注：本基金本报告期及上年度可比期间无信用减值损失。

7.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31 日
审计费用	150,000.00	150,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	15,488,147.68	12,897,578.80
注册登记费	42,328.88	257,671.12
银行划款手续费	5,917.91	5,312.98
交易费用	-	72,812,988.99

合计	15,806,394.47	86,243,551.89
----	---------------	---------------

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03% 的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

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

本基金的基金管理人于 2023 年 1 月 9 日宣告 2022 年度第一次分红，向截至 2023 年 1 月 13 日止在本基金注册登记人华泰柏瑞基金管理有限公司在中国证券登记结算有限责任公司登记在册的全体持有人，按每 10 份基金份额派发红利 0.6400 元。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
华泰柏瑞基金管理有限公司（“华泰柏瑞基金”）	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司（“中国工商银行”）	基金托管人
华泰证券股份有限公司（“华泰证券”）	基金管理人的股东、申购赎回代理券商、基金销售机构
PineBridge Investment LLC	基金管理人的股东
苏州新区高新技术产业股份有限公司	基金管理人的股东
华泰联合证券有限责任公司（“华泰联合证券”）	基金管理人的股东华泰证券的控股子公司
华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华泰柏瑞沪深 300ETF 联接基金”）	本基金的基金管理人管理的其他基金

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	上年度可比期间
	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日

	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 (%)
华泰证券	12,431,878,258.66	14.25	3,196,733,220.10	3.08

7.4.10.1.2 权证交易

注：本报告期及上年度可比期间本基金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1月1日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	1,699,651.56	14.15	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
华泰证券	419,732.99	3.03	-	-

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1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
	当期发生的基金应支付的管理费	258,135,795.38
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人华泰柏瑞基金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 × 0.50% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日

	月 31 日	12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	51,627,159.00	42,991,929.36

注：支付基金托管人中国工商银行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 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

注：本基金本期及上年可比期间未与关联方进行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 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	14,458,871,596.00	10,685,021.23	851,135,092.00	326,166.32
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	43,142,400,035.00	42,187,145.91	1,011,362,053.00	347,444.29

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

单位：人民币元

本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位:股)	出借期限(单位: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
华泰证券	202206240008692	DR 石头科	2022 年 6 月 24 日	6,410,000.00	10,000	14	3.400	8,475.46	-	-
华泰证券	2022011300012276	爱尔眼科	2022 年 1 月 13 日	83,007.00	2,300	14	3.400	109.76	-	-
华泰证券	2022011400020420	爱尔眼科	2022 年 1 月 14 日	322,595.00	9,100	14	3.400	426.58	-	-
华泰证券	2022012700009931	爱尔眼科	2022 年 1 月 27 日	74,129.00	2,300	14	3.400	98.00	-	-

华泰证券	20220128000 18812	爱尔眼科	2022年1月 28日	293,657.00	9,100	14	3.400	388.22	-	-
华泰证券	20220127000 09939	爱尔眼科	2022年1月 27日	1,998,260.00	62,000	28	3.400	5,284.16	-	-
华泰证券	20220210000 00694	爱尔眼科	2022年2月 10日	100,770.00	3,000	14	3.400	133.28	-	-
华泰证券	20220211000 18618	爱尔眼科	2022年2月 11日	294,840.00	9,100	14	3.400	389.90	-	-
华泰证券	20220225000 18961	爱尔眼科	2022年2月 25日	321,958.00	9,100	14	3.400	425.74	-	-
华泰证券	20220606000 00632	爱尔眼科	2022年6月6 日	1,025,451.00	28,700	14	3.400	1,355.90	-	-
华泰证券	20220620000 12290	爱尔眼科	2022年6月 20日	1,175,552.00	28,700	14	3.400	1,554.28	-	-
华泰证券	20220615000 01698	爱尔眼科	2022年6月 15日	5,354,240.00	142,400	28	3.400	14,159.04	-	-
华泰证券	20220704000 12942	爱尔眼科	2022年7月4 日	1,281,742.00	28,700	14	3.400	1,694.70	-	-
华泰证券	20220718000 16231	爱尔眼科	2022年7月 18日	998,760.00	28,700	14	3.400	1,320.62	-	-
华泰证券	20220711000 00368	爱尔眼科	2022年7月 11日	240,352.00	7,400	28	3.400	635.60	-	-
华泰证券	20220712000 00448	爱尔眼科	2022年7月 12日	1,614,424.00	50,800	28	3.400	4,269.16	-	-
华泰证券	20220713000 26594	爱尔眼科	2022年7月 13日	4,586,704.00	142,400	28	3.400	12,129.32	-	-
华泰证券	20220801000 15641	爱尔眼科	2022年8月1 日	914,956.00	28,700	14	3.400	1,209.74	-	-
华泰证券	20220815000 17157	爱尔眼科	2022年8月 15日	847,798.00	28,700	14	3.400	1,120.98	-	-
华泰证券	20220818000 00867	爱尔眼科	2022年8月 18日	28,680.00	1,000	14	3.400	37.94	-	-
华泰证券	20220810000 31782	爱尔眼科	2022年8月 10日	4,190,832.00	142,400	28	3.400	11,082.40	-	-
华泰证券	20220816000 00567	爱尔眼科	2022年8月 16日	28,920,000.00	1,000,000	28	3.400	76,477.24	-	-
华泰证券	20220829000 17983	爱尔眼科	2022年8月 29日	814,506.00	28,700	14	3.400	1,153.95	-	-
华泰证券	20220817000 01534	爱尔眼科	2022年8月 17日	2,802,276.00	96,100	28	3.400	7,410.48	-	-
华泰证券	20220901000 15132	爱尔眼科	2022年9月1 日	29,070.00	1,000	14	3.400	38.50	-	-
华泰证券	20220823000	爱尔眼科	2022年8月	169,740.00	6,000	28	3.400	448.84	-	-

	00450		23 日								
华泰证券	20220830000 00427	爱尔眼科	2022 年 8 月 30 日	730,575.00	25,500	28	3.400	1,932.00	-	-	
华泰证券	20220913000 25325	爱尔眼科	2022 年 9 月 13 日	850,955.00	28,700	14	3.400	1,125.18	-	-	
华泰证券	20220901000 00782	爱尔眼科	2022 年 9 月 1 日	1,366,290.00	47,000	28	3.400	3,613.12	-	-	
华泰证券	20220915000 13591	爱尔眼科	2022 年 9 月 15 日	28,800.00	1,000	14	3.400	38.08	-	-	
华泰证券	20220905000 00545	爱尔眼科	2022 年 9 月 5 日	32,712.00	1,200	28	3.400	108.15	-	-	
华泰证券	20220907000 30316	爱尔眼科	2022 年 9 月 7 日	3,984,352.00	142,400	28	3.400	12,417.90	-	-	
华泰证券	20220908000 00491	爱尔眼科	2022 年 9 月 8 日	441,168.00	15,600	28	3.400	1,333.44	-	-	
华泰证券	20220913000 00694	爱尔眼科	2022 年 9 月 13 日	702,705.00	23,700	28	3.400	1,858.36	-	-	
华泰证券	20220913000 24375	爱尔眼科	2022 年 9 月 13 日	29,650,000.00	1,000,000	28	3.400	78,407.84	-	-	
华泰证券	20220927000 21953	爱尔眼科	2022 年 9 月 27 日	828,282.00	28,700	14	3.400	1,095.22	-	-	
华泰证券	20220914000 17782	爱尔眼科	2022 年 9 月 14 日	2,837,833.00	96,100	28	3.400	7,504.56	-	-	
华泰证券	20220929000 14767	爱尔眼科	2022 年 9 月 29 日	28,740.00	1,000	14	3.400	37.94	-	-	
华泰证券	20220920000 14239	爱尔眼科	2022 年 9 月 20 日	162,180.00	6,000	28	3.400	428.96	-	-	
华泰证券	20221011000 26935	爱尔眼科	2022 年 10 月 11 日	27,140,000.00	1,000,000	28	3.100	16,359.42	-	-	
华泰证券	20221018000 05474	爱尔眼科	2022 年 10 月 11 日	27,140,000.00	1,000,000	8	3.100	2,337.06	-	-	
华泰证券	20220927000 21999	爱尔眼科	2022 年 9 月 27 日	735,930.00	25,500	28	3.400	1,946.00	-	-	
华泰证券	20221011000 23287	爱尔眼科	2022 年 10 月 11 日	778,918.00	28,700	14	3.400	1,029.84	-	-	
华泰证券	20220929000 14601	爱尔眼科	2022 年 9 月 29 日	1,350,780.00	47,000	28	3.400	3,571.96	-	-	
华泰证券	20221010000 89687	爱尔眼科	2022 年 10 月 10 日	33,120.00	1,200	28	3.400	87.64	-	-	
华泰证券	20221010000 89709	爱尔眼科	2022 年 10 月 10 日	430,560.00	15,600	28	3.400	1,138.48	-	-	
华泰证券	20221010000 93987	爱尔眼科	2022 年 10 月 10 日	3,930,240.00	142,400	28	3.400	10,393.32	-	-	

华泰证券	20221011000 28077	爱尔眼科	2022年10月 11日	643,218.00	23,700	28	3.400	1,701.00	-	-
华泰证券	20221025000 26260	爱尔眼科	2022年10月 25日	798,721.00	28,700	14	3.400	1,056.16	-	-
华泰证券	20221012000 19230	爱尔眼科	2022年10月 12日	2,685,995.00	96,100	28	3.400	7,103.04	-	-
华泰证券	20221108000 21361	爱尔眼科	2022年11月 8日	756,245.00	28,700	14	3.400	999.88	-	-
华泰证券	20221107000 84043	爱尔眼科	2022年11月 7日	3,817,744.00	142,400	28	3.400	10,095.68	-	-
华泰证券	20221108000 22753	爱尔眼科	2022年11月 8日	624,495.00	23,700	28	3.400	1,651.44	-	-
华泰证券	20221109000 17609	爱尔眼科	2022年11月 9日	2,498,600.00	96,100	28	3.400	6,607.44	-	-
华泰证券	20221201000 00698	爱尔眼科	2022年12月 1日	2,836,662.00	100,200	14	3.400	3,750.74	-	-
华泰证券	20221206000 13970	爱尔眼科	2022年12月 6日	685,404.00	23,700	28	3.400	1,618.25	736,359.00	1,618.25
华泰证券	20221207000 13666	爱尔眼科	2022年12月 7日	2,798,432.00	96,100	28	3.400	6,343.20	2,985,827.00	6,343.20
华泰证券	20221230000 00549	爱尔眼科	2022年12月 30日	6,443,918.00	207,400	14	3.400	608.59	6,443,918.00	608.59
华泰证券	20220506000 00395	爱美客	2022年5月6 日	3,022,720.00	6,400	14	3.400	3,996.72	-	-
华泰证券	20220622000 00621	爱美客	2022年6月 22日	1,039,756.00	1,900	14	3.400	1,374.80	-	-
华泰证券	20220706000 12569	爱美客	2022年7月6 日	1,094,495.00	1,900	14	3.400	1,447.18	-	-
华泰证券	20220720000 12051	爱美客	2022年7月 20日	1,151,343.00	1,900	14	3.400	1,522.36	-	-
华泰证券	20220803000 15345	爱美客	2022年8月3 日	1,128,391.00	1,900	14	3.400	1,491.98	-	-
华泰证券	20220817000 15671	爱美客	2022年8月 17日	1,086,040.00	1,900	14	3.400	1,435.98	-	-
华泰证券	20220907000 00553	爱美客	2022年9月7 日	524,990.00	1,000	14	3.400	694.12	-	-
华泰证券	20220920000 00392	爱美客	2022年9月 20日	6,391,710.00	13,000	14	3.400	12,073.20	-	-
华泰证券	20220921000 31806	爱美客	2022年9月 21日	473,880.00	1,000	14	3.400	850.44	-	-
华泰证券	20221010000 01009	爱美客	2022年10月 10日	3,600,120.00	7,600	14	3.400	4,760.14	-	-
华泰证券	20221010000	爱美客	2022年10月	6,158,100.00	13,000	14	3.400	8,142.40	-	-

	89789		10日								
华泰证券	20221010000 93915	爱美客	2022年10月 10日	473,700.00	1,000	14	3.400	626.36	-	-	
华泰证券	20221011000 01952	爱美客	2022年10月 11日	5,455,248.00	11,600	14	3.400	7,213.08	-	-	
华泰证券	20221026000 00939	爱美客	2022年10月 26日	885,400.00	1,900	14	3.400	1,170.68	-	-	
华泰证券	20221109000 18951	爱美客	2022年11月 9日	915,990.00	1,900	14	3.400	1,211.14	-	-	
华泰证券	20221114000 00822	爱美客	2022年11月 14日	3,131,040.00	6,600	14	3.400	4,139.94	-	-	
华泰证券	20221123000 14710	爱美客	2022年11月 23日	861,669.00	1,900	14	3.400	1,139.32	-	-	
华泰证券	20221128000 10229	爱美客	2022年11月 28日	3,021,942.00	6,600	14	3.400	3,995.74	-	-	
华泰证券	20221202000 01045	爱美客	2022年12月 2日	2,626,150.00	5,300	14	3.400	3,472.42	-	-	
华泰证券	20221205000 00498	爱美客	2022年12月 5日	5,512,968.00	10,800	14	3.400	7,289.38	-	-	
华泰证券	20221207000 13712	爱美客	2022年12月 7日	994,593.00	1,900	14	3.400	1,315.02	-	-	
华泰证券	20221212000 40245	爱美客	2022年12月 12日	3,412,860.00	6,600	14	3.400	4,512.62	-	-	
华泰证券	20221219000 21756	爱美客	2022年12月 19日	5,598,828.00	10,800	14	3.400	6,345.36	6,116.580. 00	6,345.36	
华泰证券	20221226000 23741	爱美客	2022年12月 26日	3,557,400.00	6,600	14	3.400	1,679.90	3,737,910. 00	1,679.90	
华泰证券	20220105000 00791	安克创新	2022年1月5 日	968,060.00	9,700	14	3.400	1,280.02	-	-	
华泰证券	20220119000 09859	安克创新	2022年1月 19日	908,696.00	9,700	14	3.400	1,630.58	-	-	
华泰证券	20220207000 54887	安克创新	2022年2月7 日	931,782.00	9,700	14	3.400	1,232.00	-	-	
华泰证券	20220221000 37687	安克创新	2022年2月 21日	947,496.00	9,700	14	3.400	1,252.86	-	-	
华泰证券	20220816000 00569	安克创新	2022年8月 16日	407,602.00	6,100	14	3.400	539.00	-	-	
华泰证券	20220826000 00575	安克创新	2022年8月 26日	423,440.00	6,700	14	3.400	559.86	-	-	
华泰证券	20220830000 12454	安克创新	2022年8月 30日	382,409.00	6,100	14	3.400	505.68	-	-	
华泰证券	20220902000 00751	安克创新	2022年9月2 日	477,126.00	7,800	14	3.400	630.84	-	-	

华泰证券	20220913000 26619	安克创新	2022年9月 13日	368,989.00	6,100	14	3.400	487.90	-	-
华泰证券	20220927000 26075	安克创新	2022年9月 27日	347,151.00	6,100	14	3.400	459.06	-	-
华泰证券	20221011000 27183	安克创新	2022年10月 11日	317,505.00	6,100	14	3.400	419.86	-	-
华泰证券	20221101000 00415	安克创新	2022年11月 1日	113,100.00	2,000	14	3.400	149.52	-	-
华泰证券	20221114000 00818	安克创新	2022年11月 14日	298,300.00	5,000	14	3.400	394.38	-	-
华泰证券	20221128000 06217	安克创新	2022年11月 28日	289,700.00	5,000	14	3.400	383.04	-	-
华泰证券	20220927000 00454	北京君正	2022年9月 27日	3,628,380.00	48,900	14	3.400	4,797.52	-	-
华泰证券	20221011000 28807	北京君正	2022年10月 11日	3,166,275.00	48,900	14	3.400	4,186.56	-	-
华泰证券	20220613000 02235	贝泰妮	2022年6月 13日	6,304,320.00	32,000	14	3.400	8,335.74	-	-
华泰证券	20220627000 15376	贝泰妮	2022年6月 27日	7,130,560.00	32,000	14	3.400	9,428.16	-	-
华泰证券	20220711000 18758	贝泰妮	2022年7月 11日	6,464,000.00	32,000	14	3.400	8,546.86	-	-
华泰证券	20220725000 16070	贝泰妮	2022年7月 25日	6,481,600.00	32,000	14	3.400	8,570.10	-	-
华泰证券	20220808000 20417	贝泰妮	2022年8月8 日	6,010,560.00	32,000	14	3.400	7,947.24	-	-
华泰证券	20220822000 19099	贝泰妮	2022年8月 22日	5,830,400.00	32,000	14	3.400	7,709.10	-	-
华泰证券	20220905000 23143	贝泰妮	2022年9月5 日	5,838,080.00	32,000	14	3.400	7,719.18	-	-
华泰证券	20220919000 18984	贝泰妮	2022年9月 19日	5,295,360.00	32,000	14	3.400	10,502.52	-	-
华泰证券	20221010000 84425	贝泰妮	2022年10月 10日	5,329,280.00	32,000	14	3.400	7,046.48	-	-
华泰证券	20221024000 86411	贝泰妮	2022年10月 24日	4,768,000.00	32,000	14	3.400	6,304.34	-	-
华泰证券	20221107000 89677	贝泰妮	2022年11月 7日	5,238,080.00	32,000	14	3.400	6,925.94	-	-
华泰证券	20221114000 00794	贝泰妮	2022年11月 14日	1,818,700.00	13,000	14	3.400	2,404.78	-	-
华泰证券	20221121000 66598	贝泰妮	2022年11月 21日	4,322,880.00	32,000	14	3.400	5,715.78	-	-
华泰证券	20221128000	贝泰妮	2022年11月	1,682,460.00	13,000	14	3.400	2,224.60	-	-

	10235		28 日								
华泰证券	20221206000 00636	贝泰妮	2022 年 12 月 6 日	4,375,040.00	32,000	14	3.400	5,784.80			
华泰证券	20221212000 06010	贝泰妮	2022 年 12 月 12 日	3,983,810.00	31,000	14	3.400	5,267.50			
华泰证券	20221212000 38869	贝泰妮	2022 年 12 月 12 日	1,670,630.00	13,000	14	3.400	2,208.92			
华泰证券	20221220000 20544	贝泰妮	2022 年 12 月 20 日	4,108,800.00	32,000	14	3.400	4,268.55	4,775,680.00		4,268.55
华泰证券	20221226000 01180	贝泰妮	2022 年 12 月 26 日	417,900.00	3,000	14	3.400	197.35	447,720.00		197.35
华泰证券	20221226000 26353	贝泰妮	2022 年 12 月 26 日	1,810,900.00	13,000	14	3.400	855.15	1,940,120.00		855.15
华泰证券	20221226000 26379	贝泰妮	2022 年 12 月 26 日	4,318,300.00	31,000	14	3.400	2,039.20	4,626,440.00		2,039.20
华泰证券	20221227000 00477	贝泰妮	2022 年 12 月 27 日	608,920.00	4,000	14	3.400	230.04	596,960.00		230.04
华泰证券	20220906000 00433	传音控股	2022 年 9 月 6 日	1,911,864.00	29,600	14	3.400	2,527.98			
华泰证券	20220920000 14143	传音控股	2022 年 9 月 20 日	1,815,368.00	29,600	14	3.400	3,429.00			
华泰证券	20221010000 97517	传音控股	2022 年 10 月 10 日	1,684,240.00	29,600	14	3.400	2,226.98			
华泰证券	20221024000 93767	传音控股	2022 年 10 月 24 日	1,794,352.00	29,600	14	3.400	2,372.58			
华泰证券	20221107000 89769	传音控股	2022 年 11 月 7 日	2,036,480.00	29,600	14	3.400	2,692.62			
华泰证券	20221114000 00786	传音控股	2022 年 11 月 14 日	572,832.00	7,800	14	3.400	757.40			
华泰证券	20221121000 79448	传音控股	2022 年 11 月 21 日	2,221,480.00	29,600	14	3.400	2,937.34			
华泰证券	20221128000 06287	传音控股	2022 年 11 月 28 日	576,888.00	7,800	14	3.400	762.72			
华泰证券	20221205000 26934	传音控股	2022 年 12 月 5 日	2,425,424.00	29,600	14	3.400	3,206.98			
华泰证券	20221212000 38875	传音控股	2022 年 12 月 12 日	623,220.00	7,800	14	3.400	824.04			
华泰证券	20221219000 22798	传音控股	2022 年 12 月 19 日	2,362,080.00	29,600	14	3.400	2,677.08	2,353,792.00		2,677.08
华泰证券	20221226000 27359	传音控股	2022 年 12 月 26 日	606,138.00	7,800	14	3.400	286.25	620,256.00		286.25
华泰证券	20221212000 06020	大全能源	2022 年 12 月 12 日	2,689,000.00	50,000	14	3.400	3,555.44			

华泰证券	20221226000 26731	大全能源	2022 年 12 月 26 日	2,457,500.00	50,000	14	3.400	1,160.50	2,384,000. 00	1,160.50
华泰证券	20220104000 23097	东方财富	2022 年 1 月 4 日	8,229,870.00	229,500	14	3.400	10,881.78	-	-
华泰证券	20220110000 11421	东方财富	2022 年 1 月 10 日	10,059,000.00	300,000	14	3.400	13,300.28	-	-
华泰证券	20220111000 13271	东方财富	2022 年 1 月 11 日	10,020,000.00	300,000	14	3.400	13,248.62	-	-
华泰证券	20220118000 23974	东方财富	2022 年 1 月 18 日	7,591,860.00	229,500	14	3.400	14,340.20	-	-
华泰证券	20220124000 09128	东方财富	2022 年 1 月 24 日	9,777,000.00	300,000	14	3.400	12,927.32	-	-
华泰证券	20220125000 11630	东方财富	2022 年 1 月 25 日	9,516,000.00	300,000	14	3.400	12,582.22	-	-
华泰证券	20220113000 10162	东方财富	2022 年 1 月 13 日	16,645,601.00	511,700	28	3.400	44,018.24	-	-
华泰证券	20220114000 24520	东方财富	2022 年 1 月 14 日	3,222,000.00	100,000	28	3.400	8,520.40	-	-
华泰证券	20220207000 43929	东方财富	2022 年 2 月 7 日	7,394,490.00	229,500	14	3.400	9,777.18	-	-
华泰证券	20220207000 46361	东方财富	2022 年 2 月 7 日	9,666,000.00	300,000	14	3.400	12,780.60	-	-
华泰证券	20220208000 15672	东方财富	2022 年 2 月 8 日	9,639,000.00	300,000	14	3.400	12,744.90	-	-
华泰证券	20220221000 47323	东方财富	2022 年 2 月 21 日	7,845,000.00	300,000	14	3.400	10,372.88	-	-
华泰证券	20220221000 47325	东方财富	2022 年 2 月 21 日	6,001,425.00	229,500	14	3.400	7,935.20	-	-
华泰证券	20220222000 11099	东方财富	2022 年 2 月 22 日	7,614,000.00	300,000	14	3.400	10,067.40	-	-
华泰证券	20220210000 13528	东方财富	2022 年 2 月 10 日	16,446,038.00	511,700	28	3.400	43,490.72	-	-
华泰证券	20220211000 20144	东方财富	2022 年 2 月 11 日	3,173,000.00	100,000	28	3.400	8,390.76	-	-
华泰证券	20220307000 37858	东方财富	2022 年 3 月 7 日	7,464,000.00	300,000	14	3.400	9,869.02	-	-
华泰证券	20220308000 12444	东方财富	2022 年 3 月 8 日	7,458,000.00	300,000	14	3.400	9,861.18	-	-
华泰证券	20220322000 14297	东方财富	2022 年 3 月 22 日	7,536,000.00	300,000	14	3.400	10,675.95	-	-
华泰证券	20220406000 65857	东方财富	2022 年 4 月 6 日	7,788,000.00	300,000	14	3.400	10,297.42	-	-
华泰证券	20220420000	东方财富	2022 年 4 月	6,183,000.00	300,000	14	3.400	8,759.25	-	-

	38864		20 日							
华泰证券	20220505000 70287	东方财富	2022年5月5 日	6,720,000.00	300,000	14	3.400	8,885.38	-	-
华泰证券	20220519000 44979	东方财富	2022年5月 19日	6,651,000.00	300,000	14	3.400	8,794.10	-	-
华泰证券	20221114000 00731	东方财富	2022年11月 14日	10,899,225.00	602,500	14	3.400	14,411.18	-	-
华泰证券	20221128000 06213	东方财富	2022年11月 28日	10,519,650.00	602,500	14	3.400	13,909.28	-	-
华泰证券	20221212000 38831	东方财富	2022年12月 12日	11,917,450.00	602,500	14	3.400	15,757.56	-	-
华泰证券	20221226000 26341	东方财富	2022年12月 26日	11,465,575.00	602,500	14	3.400	5,414.30	11,688,500 .00	5,414.30
华泰证券	20220112000 17003	沪硅产业	2022年1月 12日	5,280,000.00	200,000	14	3.400	6,981.38	-	-
华泰证券	20220113000 10154	沪硅产业	2022年1月 13日	656,500.00	25,000	14	3.400	868.00	-	-
华泰证券	20220126000 11948	沪硅产业	2022年1月 26日	5,196,000.00	200,000	14	3.400	6,870.22	-	-
华泰证券	20220127000 09937	沪硅产业	2022年1月 27日	600,750.00	25,000	14	3.400	794.36	-	-
华泰证券	20220208000 01017	沪硅产业	2022年2月8 日	964,400.00	40,000	14	3.400	1,275.12	-	-
华泰证券	20220209000 16386	沪硅产业	2022年2月9 日	4,836,000.00	200,000	14	3.400	6,394.22	-	-
华泰证券	20220210000 13174	沪硅产业	2022年2月 10日	579,500.00	25,000	14	3.400	766.22	-	-
华泰证券	20220222000 11081	沪硅产业	2022年2月 22日	903,200.00	40,000	14	3.400	1,194.20	-	-
华泰证券	20220223000 13544	沪硅产业	2022年2月 23日	4,766,000.00	200,000	14	3.400	6,301.68	-	-
华泰证券	20220224000 11989	沪硅产业	2022年2月 24日	586,750.00	25,000	14	3.400	775.88	-	-
华泰证券	20220308000 12972	沪硅产业	2022年3月8 日	936,000.00	40,000	14	3.400	1,237.60	-	-
华泰证券	20220309000 18113	沪硅产业	2022年3月9 日	4,812,000.00	200,000	14	3.400	6,362.58	-	-
华泰证券	20220310000 12554	沪硅产业	2022年3月 10日	637,500.00	25,000	14	3.400	842.94	-	-
华泰证券	20220322000 14293	沪硅产业	2022年3月 22日	1,004,400.00	40,000	14	3.400	1,422.90	-	-
华泰证券	20220323000 12515	沪硅产业	2022年3月 23日	4,954,000.00	200,000	14	3.400	6,550.32	-	-

华泰证券	20220324000 12803	沪硅产业	2022年3月 24日	601,250.00	25,000	14	3.400	795.06	-	-
华泰证券	20220406000 48665	沪硅产业	2022年4月6 日	885,600.00	40,000	14	3.400	1,170.96	-	-
华泰证券	20220420000 46904	沪硅产业	2022年4月 20日	896,000.00	40,000	14	3.400	1,269.30	-	-
华泰证券	20220505000 70333	沪硅产业	2022年5月5 日	846,000.00	40,000	14	3.400	1,118.60	-	-
华泰证券	20220829000 00592	沪硅产业	2022年8月 29日	656,000.00	32,800	14	3.400	929.40	-	-
华泰证券	20220713000 00513	沪硅产业	2022年7月 13日	400,475.00	19,300	14	3.400	529.48	-	-
华泰证券	20220727000 27782	沪硅产业	2022年7月 27日	394,492.00	19,300	14	3.400	521.64	-	-
华泰证券	20220810000 29256	沪硅产业	2022年8月 10日	433,864.00	19,300	14	3.400	573.72	-	-
华泰证券	20220105000 00793	华大基因	2022年1月5 日	1,298,848.00	14,800	14	3.400	1,717.38	-	-
华泰证券	20220106000 00607	华大基因	2022年1月6 日	355,600.00	4,000	14	3.400	470.12	-	-
华泰证券	20220106000 10077	华大基因	2022年1月6 日	1,644,650.00	18,500	14	3.400	2,174.62	-	-
华泰证券	20220107000 00651	华大基因	2022年1月7 日	1,364,550.00	15,000	14	3.400	1,804.18	-	-
华泰证券	20220107000 09903	华大基因	2022年1月7 日	136,455.00	1,500	14	3.400	180.46	-	-
华泰证券	20220110000 11737	华大基因	2022年1月 11日	1,412,100.00	15,000	14	3.400	1,867.18	-	-
华泰证券	20220110000 13273	华大基因	2022年1月 11日	1,044,954.00	11,100	14	3.400	1,381.66	-	-
华泰证券	20220110000 13275	华大基因	2022年1月 11日	677,808.00	7,200	14	3.400	896.28	-	-
华泰证券	20220112000 16601	华大基因	2022年1月 12日	478,550.00	5,000	14	3.400	632.80	-	-
华泰证券	20220112000 16999	华大基因	2022年1月 12日	497,692.00	5,200	14	3.400	658.00	-	-
华泰证券	20220114000 24078	华大基因	2022年1月 14日	404,720.00	4,000	14	3.400	535.08	-	-
华泰证券	20220110000 11429	华大基因	2022年1月 10日	313,269.00	3,300	28	3.400	828.52	-	-
华泰证券	20220119000 09861	华大基因	2022年1月 19日	1,364,708.00	14,800	14	3.400	2,448.91	-	-
华泰证券	20220120000	华大基因	2022年1月	1,675,175.00	18,500	14	3.400	2,847.78	-	-

	08878		20 日								
华泰证券	20220120000 09668	华大基因	2022 年 1 月 20 日	362,200.00	4,000	14	3.400	615.78	-	-	
华泰证券	20220121000 11150	华大基因	2022 年 1 月 21 日	1,335,000.00	15,000	14	3.400	2,143.36	-	-	
华泰证券	20220121000 11244	华大基因	2022 年 1 月 21 日	133,500.00	1,500	14	3.400	214.37	-	-	
华泰证券	20220124000 00415	华大基因	2022 年 1 月 24 日	706,240.00	8,000	14	3.400	933.80	-	-	
华泰证券	20220125000 00526	华大基因	2022 年 1 月 25 日	254,220.00	3,000	14	3.400	336.14	-	-	
华泰证券	20220125000 09200	华大基因	2022 年 1 月 25 日	940,614.00	11,100	14	3.400	1,243.76	-	-	
华泰证券	20220125000 11626	华大基因	2022 年 1 月 25 日	1,271,100.00	15,000	14	3.400	1,680.70	-	-	
华泰证券	20220125000 11628	华大基因	2022 年 1 月 25 日	610,128.00	7,200	14	3.400	806.68	-	-	
华泰证券	20220126000 11942	华大基因	2022 年 1 月 26 日	422,500.00	5,000	14	3.400	558.60	-	-	
华泰证券	20220126000 11944	华大基因	2022 年 1 月 26 日	439,400.00	5,200	14	3.400	581.00	-	-	
华泰证券	20220128000 18798	华大基因	2022 年 1 月 28 日	336,000.00	4,000	14	3.400	444.22	-	-	
华泰证券	20220207000 43977	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,294,350.00	15,000	14	3.400	1,711.36	-	-	
华泰证券	20220207000 43979	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,277,092.00	14,800	14	3.400	1,688.54	-	-	
华泰证券	20220207000 43981	华大基因	2022 年 2 月 7 日	1,596,365.00	18,500	14	3.400	2,110.78	-	-	
华泰证券	20220207000 43983	华大基因	2022 年 2 月 7 日	129,435.00	1,500	14	3.400	171.08	-	-	
华泰证券	20220207000 43985	华大基因	2022 年 2 月 7 日	345,160.00	4,000	14	3.400	456.40	-	-	
华泰证券	20220207000 46355	华大基因	2022 年 2 月 7 日	690,320.00	8,000	14	3.400	912.80	-	-	
华泰证券	20220208000 15254	华大基因	2022 年 2 月 8 日	1,299,450.00	15,000	14	3.400	1,718.22	-	-	
华泰证券	20220208000 15664	华大基因	2022 年 2 月 8 日	961,593.00	11,100	14	3.400	1,271.48	-	-	
华泰证券	20220208000 15666	华大基因	2022 年 2 月 8 日	623,736.00	7,200	14	3.400	824.74	-	-	
华泰证券	20220208000 15668	华大基因	2022 年 2 月 8 日	259,890.00	3,000	14	3.400	343.70	-	-	

华泰证券	20220209000 16394	华大基因	2022年2月9 日	450,580.00	5,200	14	3.400	595.84	-	-
华泰证券	20220209000 16396	华大基因	2022年2月9 日	433,250.00	5,000	14	3.400	572.88	-	-
华泰证券	20220211000 18616	华大基因	2022年2月 11日	345,960.00	4,000	14	3.400	457.38	-	-
华泰证券	20220207000 48421	华大基因	2022年2月7 日	284,757.00	3,300	28	3.400	752.92	-	-
华泰证券	20220221000 47311	华大基因	2022年2月 21日	706,080.00	8,000	14	3.400	933.66	-	-
华泰证券	20220221000 47313	华大基因	2022年2月 21日	1,306,248.00	14,800	14	3.400	1,727.18	-	-
华泰证券	20220221000 47315	华大基因	2022年2月 21日	353,040.00	4,000	14	3.400	466.76	-	-
华泰证券	20220221000 47317	华大基因	2022年2月 21日	1,323,900.00	15,000	14	3.400	1,750.56	-	-
华泰证券	20220221000 47319	华大基因	2022年2月 21日	132,390.00	1,500	14	3.400	175.00	-	-
华泰证券	20220221000 47321	华大基因	2022年2月 21日	1,632,810.00	18,500	14	3.400	2,158.94	-	-
华泰证券	20220222000 11087	华大基因	2022年2月 22日	949,827.00	11,100	14	3.400	1,255.94	-	-
华泰证券	20220222000 11091	华大基因	2022年2月 22日	616,104.00	7,200	14	3.400	814.66	-	-
华泰证券	20220222000 11093	华大基因	2022年2月 22日	1,283,550.00	15,000	14	3.400	1,697.08	-	-
华泰证券	20220222000 11095	华大基因	2022年2月 22日	256,710.00	3,000	14	3.400	339.50	-	-
华泰证券	20220307000 36678	华大基因	2022年3月7 日	1,214,784.00	14,800	14	3.400	1,606.22	-	-
华泰证券	20220307000 36680	华大基因	2022年3月7 日	1,231,200.00	15,000	14	3.400	1,627.92	-	-
华泰证券	20220307000 36684	华大基因	2022年3月7 日	1,518,480.00	18,500	14	3.400	2,007.74	-	-
华泰证券	20220307000 36686	华大基因	2022年3月7 日	656,640.00	8,000	14	3.400	868.28	-	-
华泰证券	20220307000 36690	华大基因	2022年3月7 日	328,320.00	4,000	14	3.400	434.14	-	-
华泰证券	20220307000 36694	华大基因	2022年3月7 日	123,120.00	1,500	14	3.400	162.82	-	-
华泰证券	20220308000 12970	华大基因	2022年3月8 日	853,812.00	11,100	14	3.400	1,128.96	-	-
华泰证券	20220308000	华大基因	2022年3月8	230,760.00	3,000	14	3.400	305.06	-	-

	12976		日								
华泰证券	20220308000 12978	华大基因	2022年3月8 日	1,153,800.00	15,000	14	3.400	1,525.58	-	-	
华泰证券	20220308000 12980	华大基因	2022年3月8 日	553,824.00	7,200	14	3.400	732.34	-	-	
华泰证券	20220307000 37846	华大基因	2022年3月7 日	270,864.00	3,300	28	3.400	767.40	-	-	
华泰证券	20220321000 32895	华大基因	2022年3月 21日	1,322,084.00	14,800	14	3.400	1,997.76	-	-	
华泰证券	20220321000 32897	华大基因	2022年3月 21日	1,339,950.00	15,000	14	3.400	2,024.80	-	-	
华泰证券	20220321000 32899	华大基因	2022年3月 21日	357,320.00	4,000	14	3.400	540.00	-	-	
华泰证券	20220321000 35045	华大基因	2022年3月 21日	1,652,605.00	18,500	14	3.400	2,497.28	-	-	
华泰证券	20220321000 35047	华大基因	2022年3月 21日	714,640.00	8,000	14	3.400	1,079.84	-	-	
华泰证券	20220321000 35049	华大基因	2022年3月 21日	133,995.00	1,500	14	3.400	202.56	-	-	
华泰证券	20220322000 14275	华大基因	2022年3月 22日	1,263,150.00	15,000	14	3.400	1,789.50	-	-	
华泰证券	20220322000 14277	华大基因	2022年3月 22日	934,731.00	11,100	14	3.400	1,324.20	-	-	
华泰证券	20220322000 14281	华大基因	2022年3月 22日	606,312.00	7,200	14	3.400	858.90	-	-	
华泰证券	20220322000 14283	华大基因	2022年3月 22日	252,630.00	3,000	14	3.400	357.90	-	-	
华泰证券	20220406000 64093	华大基因	2022年4月6 日	1,513,485.00	18,500	14	3.400	2,001.16	-	-	
华泰证券	20220406000 64095	华大基因	2022年4月6 日	122,715.00	1,500	14	3.400	162.26	-	-	
华泰证券	20220406000 64097	华大基因	2022年4月6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.400	1,622.60	-	-	
华泰证券	20220406000 64099	华大基因	2022年4月6 日	1,227,150.00	15,000	14	3.400	1,622.60	-	-	
华泰证券	20220406000 64101	华大基因	2022年4月6 日	327,240.00	4,000	14	3.400	432.74	-	-	
华泰证券	20220406000 64103	华大基因	2022年4月6 日	245,430.00	3,000	14	3.400	324.52	-	-	
华泰证券	20220406000 64105	华大基因	2022年4月6 日	908,091.00	11,100	14	3.400	1,200.64	-	-	
华泰证券	20220406000 64107	华大基因	2022年4月6 日	589,032.00	7,200	14	3.400	778.82	-	-	

华泰证券	20220406000 64109	华大基因	2022年4月6 日	654,480.00	8,000	14	3.400	865.34	-	-
华泰证券	20220406000 64113	华大基因	2022年4月6 日	1,210,788.00	14,800	14	3.400	1,600.90	-	-
华泰证券	20220406000 64111	华大基因	2022年4月6 日	269,973.00	3,300	28	3.400	739.50	-	-
华泰证券	20220420000 38496	华大基因	2022年4月 20日	584,560.00	8,000	14	3.400	828.15	-	-
华泰证券	20220420000 38498	华大基因	2022年4月 20日	811,077.00	11,100	14	3.400	1,149.00	-	-
华泰证券	20220420000 38500	华大基因	2022年4月 20日	109,605.00	1,500	14	3.400	155.25	-	-
华泰证券	20220420000 38502	华大基因	2022年4月 20日	1,096,050.00	15,000	14	3.400	1,552.80	-	-
华泰证券	20220420000 38504	华大基因	2022年4月 20日	1,351,795.00	18,500	14	3.400	1,915.05	-	-
华泰证券	20220420000 38508	华大基因	2022年4月 20日	292,280.00	4,000	14	3.400	414.00	-	-
华泰证券	20220420000 38510	华大基因	2022年4月 20日	1,096,050.00	15,000	14	3.400	1,552.80	-	-
华泰证券	20220420000 38512	华大基因	2022年4月 20日	219,210.00	3,000	14	3.400	310.50	-	-
华泰证券	20220420000 38514	华大基因	2022年4月 20日	526,104.00	7,200	14	3.400	745.35	-	-
华泰证券	20220420000 38516	华大基因	2022年4月 20日	1,081,436.00	14,800	14	3.400	1,532.10	-	-
华泰证券	20220505000 70243	华大基因	2022年5月5 日	1,193,620.00	18,500	14	3.400	1,578.22	-	-
华泰证券	20220505000 70245	华大基因	2022年5月5 日	967,800.00	15,000	14	3.400	1,279.60	-	-
华泰证券	20220505000 70247	华大基因	2022年5月5 日	954,896.00	14,800	14	3.400	1,262.52	-	-
华泰证券	20220505000 70249	华大基因	2022年5月5 日	258,080.00	4,000	14	3.400	341.18	-	-
华泰证券	20220505000 70253	华大基因	2022年5月5 日	716,172.00	11,100	14	3.400	946.96	-	-
华泰证券	20220505000 70255	华大基因	2022年5月5 日	516,160.00	8,000	14	3.400	682.50	-	-
华泰证券	20220505000 70261	华大基因	2022年5月5 日	96,780.00	1,500	14	3.400	127.96	-	-
华泰证券	20220505000 70263	华大基因	2022年5月5 日	967,800.00	15,000	14	3.400	1,279.60	-	-
华泰证券	20220505000	华大基因	2022年5月5	193,560.00	3,000	14	3.400	255.92	-	-

	70269		日								
华泰证券	20220505000 70251	华大基因	2022年5月5 日	212,916.00	3,300	28	3.400	563.08			
华泰证券	20221114000 00798	华利集团	2022年11月 14日	161,304.00	3,300	14	3.400	213.22			
华泰证券	20221128000 10225	华利集团	2022年11月 28日	152,460.00	3,300	14	3.400	201.60			
华泰证券	20221212000 38867	华利集团	2022年12月 12日	173,217.00	3,300	14	3.400	229.04			
华泰证券	20221226000 23749	华利集团	2022年12月 26日	191,400.00	3,300	14	3.400	90.40	188,463.00		90.40
华泰证券	20221228000 01372	华利集团	2022年12月 28日	399,160.00	6,800	14	3.400	113.10	388,348.00		113.10
华泰证券	20220420000 00616	华润微	2022年4月 20日	486,500.00	10,000	14	3.400	689.25			
华泰证券	20220505000 70241	华润微	2022年5月5 日	484,700.00	10,000	14	3.400	640.92			
华泰证券	20220620000 00933	华润微	2022年6月 20日	911,818.00	15,800	14	3.400	1,205.68			
华泰证券	20220704000 12940	华润微	2022年7月4 日	867,894.00	15,800	14	3.400	1,147.58			
华泰证券	20221114000 00806	华润微	2022年11月 14日	167,456.00	3,200	14	3.400	221.48			
华泰证券	20221128000 06295	华润微	2022年11月 28日	164,448.00	3,200	14	3.400	217.42			
华泰证券	20221212000 38881	华润微	2022年12月 12日	177,888.00	3,200	14	3.400	235.20			
华泰证券	20221226000 26727	华润微	2022年12月 26日	169,504.00	3,200	14	3.400	80.05	168,480.00		80.05
华泰证券	20220105000 00797	华熙生物	2022年1月5 日	1,480,000.00	10,000	14	3.400	1,956.92			
华泰证券	20220119000 09865	华熙生物	2022年1月 19日	1,334,800.00	10,000	14	3.400	2,395.14			
华泰证券	20220207000 43903	华熙生物	2022年2月7 日	1,200,100.00	10,000	14	3.400	1,586.76			
华泰证券	20220221000 47335	华熙生物	2022年2月 21日	1,169,000.00	10,000	14	3.400	1,545.74			
华泰证券	20220307000 36700	华熙生物	2022年3月7 日	1,151,500.00	10,000	14	3.400	1,522.50			
华泰证券	20220321000 35023	华熙生物	2022年3月 21日	1,154,200.00	10,000	14	3.400	1,744.16			
华泰证券	20221103000 00680	华熙生物	2022年11月 3日	2,217,600.00	20,000	14	3.400	2,932.16			

华泰证券	20221114000 00790	华熙生物	2022 年 11 月 14 日	1,267,231.00	11,900	14	3.400	1,675.52	-	-
华泰证券	20221117000 07704	华熙生物	2022 年 11 月 17 日	2,269,200.00	20,000	14	3.400	3,000.34	-	-
华泰证券	20221128000 06211	华熙生物	2022 年 11 月 28 日	1,263,899.00	11,900	14	3.400	1,671.18	-	-
华泰证券	20221212000 38879	华熙生物	2022 年 12 月 12 日	1,453,585.00	11,900	14	3.400	1,921.92	-	-
华泰证券	20221226000 26719	华熙生物	2022 年 12 月 26 日	1,546,286.00	11,900	14	3.400	730.20	1,609,832. 00	730.20
华泰证券	20220111000 01250	汇川技术	2022 年 1 月 11 日	6,520,000.00	100,000	14	3.400	8,620.92	-	-
华泰证券	20220119000 00656	汇川技术	2022 年 1 月 19 日	6,619,800.00	100,300	14	3.400	11,878.80	-	-
华泰证券	20220125000 09194	汇川技术	2022 年 1 月 25 日	6,649,000.00	100,000	14	3.400	8,791.44	-	-
华泰证券	20220117000 02793	汇川技术	2022 年 1 月 17 日	986,524.00	15,400	28	3.400	2,608.76	-	-
华泰证券	20220207000 43921	汇川技术	2022 年 2 月 7 日	6,042,072.00	100,300	14	3.400	7,988.96	-	-
华泰证券	20220208000 15658	汇川技术	2022 年 2 月 8 日	5,970,000.00	100,000	14	3.400	7,893.62	-	-
华泰证券	20220128000 18800	汇川技术	2022 年 1 月 28 日	1,265,789.00	21,100	28	3.400	3,347.40	-	-
华泰证券	20220221000 35695	汇川技术	2022 年 2 月 21 日	6,449,290.00	100,300	14	3.400	8,527.40	-	-
华泰证券	20220222000 11101	汇川技术	2022 年 2 月 22 日	6,295,000.00	100,000	14	3.400	8,323.42	-	-
华泰证券	20220307000 36390	汇川技术	2022 年 3 月 7 日	6,018,000.00	100,300	14	3.400	7,957.18	-	-
华泰证券	20220308000 12956	汇川技术	2022 年 3 月 8 日	5,947,000.00	100,000	14	3.400	7,863.24	-	-
华泰证券	20220321000 33069	汇川技术	2022 年 3 月 21 日	5,777,280.00	100,300	14	3.400	8,730.08	-	-
华泰证券	20220322000 14285	汇川技术	2022 年 3 月 22 日	5,740,000.00	100,000	14	3.400	8,131.65	-	-
华泰证券	20220708000 00554	汇川技术	2022 年 7 月 8 日	12,886,000.00	200,000	14	3.400	17,038.14	-	-
华泰证券	20220110000 01144	健帆生物	2022 年 1 月 10 日	929,900.00	17,000	14	3.400	1,229.48	-	-
华泰证券	20220112000 16865	健帆生物	2022 年 1 月 12 日	654,489.00	12,100	14	3.400	865.34	-	-
华泰证券	20220118000	健帆生物	2022 年 1 月	1,665,000.00	30,000	14	3.400	3,145.00	-	-

	00726		18日							
华泰证券	20220124000 09220	健帆生物	2022年1月 24日	854,080.00	17,000	14	3.400	1,129.24	-	-
华泰证券	20220126000 11970	健帆生物	2022年1月 26日	572,693.00	12,100	14	3.400	757.26	-	-
华泰证券	20220207000 46377	健帆生物	2022年2月7 日	788,460.00	17,000	14	3.400	1,042.58	-	-
华泰证券	20220207000 54867	健帆生物	2022年2月7 日	1,391,400.00	30,000	14	3.400	1,839.74	-	-
华泰证券	20220209000 00844	健帆生物	2022年2月9 日	85,266.00	1,800	14	3.400	112.70	-	-
华泰证券	20220223000 11596	健帆生物	2022年2月 23日	84,438.00	1,800	14	3.400	111.72	-	-
华泰证券	20220915000 00665	健帆生物	2022年9月 15日	389,910.00	8,200	14	3.400	515.62	-	-
华泰证券	20221019000 00597	健帆生物	2022年10月 19日	241,362.00	4,600	14	3.400	319.20	-	-
华泰证券	20221031000 00691	健帆生物	2022年10月 31日	386,496.00	12,200	14	3.400	511.00	-	-
华泰证券	20221102000 00713	健帆生物	2022年11月 2日	432,284.00	13,400	14	3.400	571.62	-	-
华泰证券	20221102000 09590	健帆生物	2022年11月 2日	148,396.00	4,600	14	3.400	196.28	-	-
华泰证券	20221103000 00672	健帆生物	2022年11月 3日	639,734.00	20,200	14	3.400	845.88	-	-
华泰证券	20221114000 00704	健帆生物	2022年11月 14日	1,875,069.00	56,700	14	3.400	2,479.26	-	-
华泰证券	20221116000 08027	健帆生物	2022年11月 16日	155,572.00	4,600	14	3.400	205.66	-	-
华泰证券	20221116000 08029	健帆生物	2022年11月 16日	453,188.00	13,400	14	3.400	599.20	-	-
华泰证券	20221117000 07496	健帆生物	2022年11月 17日	674,276.00	20,200	14	3.400	891.52	-	-
华泰证券	20221128000 06255	健帆生物	2022年11月 28日	1,778,112.00	56,700	14	3.400	2,351.02	-	-
华泰证券	20221130000 07563	健帆生物	2022年11月 30日	145,682.00	4,600	14	3.400	192.64	-	-
华泰证券	20221130000 07567	健帆生物	2022年11月 30日	424,378.00	13,400	14	3.400	561.12	-	-
华泰证券	20221201000 07578	健帆生物	2022年12月 1日	653,874.00	20,200	14	3.400	864.64	-	-
华泰证券	20221212000 38847	健帆生物	2022年12月 12日	1,844,451.00	56,700	14	3.400	2,438.80	-	-

华泰证券	20221214000 26728	健帆生物	2022 年 12 月 14 日	426,656.00	13,400	14	3.400	564.20	-	-
华泰证券	20221215000 12327	健帆生物	2022 年 12 月 15 日	642,764.00	20,200	14	3.400	849.94	-	-
华泰证券	20221226000 23731	健帆生物	2022 年 12 月 26 日	1,745,793.00	56,700	14	3.400	824.40	1,755,999.00	824.40
华泰证券	20221228000 30107	健帆生物	2022 年 12 月 28 日	411,514.00	13,400	14	3.400	116.61	414,998.00	116.61
华泰证券	20221229000 12127	健帆生物	2022 年 12 月 29 日	632,866.00	20,200	14	3.400	119.54	625,594.00	119.54
华泰证券	20220106000 00608	金龙鱼	2022 年 1 月 6 日	9,475,752.00	145,200	14	3.400	12,529.02	-	-
华泰证券	20220107000 10145	金龙鱼	2022 年 1 月 7 日	1,107,119.00	16,900	14	3.400	1,463.84	-	-
华泰证券	20220110000 01142	金龙鱼	2022 年 1 月 10 日	65,340.00	1,000	14	3.400	86.38	-	-
华泰证券	20220110000 11425	金龙鱼	2022 年 1 月 10 日	1,385,208.00	21,200	14	3.400	1,831.62	-	-
华泰证券	20220124000 09216	金龙鱼	2022 年 1 月 24 日	1,294,048.00	21,200	14	3.400	1,711.08	-	-
华泰证券	20220207000 46381	金龙鱼	2022 年 2 月 7 日	1,216,244.00	21,200	14	3.400	1,608.18	-	-
华泰证券	20220217000 00373	金龙鱼	2022 年 2 月 17 日	57,590.00	1,000	14	3.400	76.16	-	-
华泰证券	20221114000 00787	金龙鱼	2022 年 11 月 14 日	220,116.00	5,200	14	3.400	291.06	-	-
华泰证券	20221114000 00799	金龙鱼	2022 年 11 月 14 日	3,098,556.00	73,200	14	3.400	4,096.96	-	-
华泰证券	20221128000 06199	金龙鱼	2022 年 11 月 28 日	211,328.00	5,200	14	3.400	279.44	-	-
华泰证券	20221212000 38865	金龙鱼	2022 年 12 月 12 日	227,604.00	5,200	14	3.400	301.00	-	-
华泰证券	20221226000 23747	金龙鱼	2022 年 12 月 26 日	225,056.00	5,200	14	3.400	106.30	226,512.00	106.30
华泰证券	20220112000 00560	金山办公	2022 年 1 月 12 日	7,816,500.00	30,000	14	3.400	10,335.22	-	-
华泰证券	20220113000 00690	金山办公	2022 年 1 月 13 日	5,080,200.00	20,000	14	3.600	7,112.28	-	-
华泰证券	20220126000 11964	金山办公	2022 年 1 月 26 日	7,673,100.00	30,000	14	3.400	10,145.52	-	-
华泰证券	20220127000 09925	金山办公	2022 年 1 月 27 日	4,937,400.00	20,000	14	3.600	6,912.36	-	-
华泰证券	20220209000	金山办公	2022 年 2 月 9	6,867,000.00	30,000	14	3.400	9,079.70	-	-

	17372		日								
华泰证券	20220210000 14024	金山办公	2022年2月 10日	4,277,600.00	20,000	14	3.600	5,988.64	-	-	
华泰证券	20220223000 13538	金山办公	2022年2月 23日	6,579,000.00	30,000	14	3.400	8,698.90	-	-	
华泰证券	20220224000 11333	金山办公	2022年2月 24日	4,153,000.00	20,000	14	3.600	5,814.20	-	-	
华泰证券	20220309000 18107	金山办公	2022年3月9 日	5,460,000.00	30,000	14	3.400	7,219.38	-	-	
华泰证券	20220323000 12513	金山办公	2022年3月 23日	5,702,700.00	30,000	14	3.400	7,540.26	-	-	
华泰证券	20220406000 64119	金山办公	2022年4月6 日	5,542,800.00	30,000	14	3.400	7,328.86	-	-	
华泰证券	20220420000 46438	金山办公	2022年4月 20日	5,454,000.00	30,000	14	3.400	7,726.50	-	-	
华泰证券	20220505000 70273	金山办公	2022年5月5 日	5,781,300.00	30,000	14	3.400	7,644.14	-	-	
华泰证券	20220519000 44993	金山办公	2022年5月 19日	6,228,000.00	30,000	14	3.400	8,234.80	-	-	
华泰证券	20220602000 22086	金山办公	2022年6月2 日	6,306,900.00	30,000	14	3.400	8,339.10	-	-	
华泰证券	20220616000 15563	金山办公	2022年6月 16日	6,212,100.00	30,000	14	3.400	8,213.80	-	-	
华泰证券	20221114000 00772	金山办公	2022年11月 14日	12,216,500.00	46,100	14	3.400	16,152.92	-	-	
华泰证券	20221128000 06267	金山办公	2022年11月 28日	11,695,570.00	46,100	14	3.400	15,464.12	-	-	
华泰证券	20221212000 38783	金山办公	2022年12月 12日	12,012,277.00	46,100	14	3.400	15,882.86	-	-	
华泰证券	20221226000 26701	金山办公	2022年12月 26日	11,534,220.00	46,100	14	3.400	5,446.70	12,192,989.00	5,446.70	
华泰证券	20221114000 00820	锦浪科技	2022年11月 14日	2,500,884.00	12,700	14	3.400	3,306.66	-	-	
华泰证券	20221117000 01188	锦浪科技	2022年11月 17日	1,394,300.00	7,300	14	3.400	1,843.52	-	-	
华泰证券	20221124000 00573	锦浪科技	2022年11月 24日	1,028,400.00	5,000	14	3.400	1,359.82	-	-	
华泰证券	20221128000 06297	锦浪科技	2022年11月 28日	2,521,966.00	12,700	14	3.400	3,334.66	-	-	
华泰证券	20221201000 08530	锦浪科技	2022年12月 1日	1,441,020.00	7,300	14	3.400	1,905.40	-	-	
华泰证券	20221206000 00634	锦浪科技	2022年12月 6日	564,090.00	3,000	14	3.400	745.92	-	-	

华泰证券	20221208000 13221	锦浪科技	2022 年 12 月 8 日	979,450.00	5,000	14	3.400	1,295.00	-	-
华泰证券	20221212000 38859	锦浪科技	2022 年 12 月 12 日	2,432,431.00	12,700	14	3.400	3,216.22	-	-
华泰证券	20221215000 12333	锦浪科技	2022 年 12 月 15 日	1,290,640.00	7,300	14	3.400	1,706.46	-	-
华泰证券	20221220000 19552	锦浪科技	2022 年 12 月 20 日	501,600.00	3,000	14	3.400	521.07	540,150.00	521.07
华泰证券	20221222000 14039	锦浪科技	2022 年 12 月 22 日	813,000.00	5,000	14	3.400	691.02	900,250.00	691.02
华泰证券	20221226000 26267	锦浪科技	2022 年 12 月 26 日	2,179,955.00	12,700	14	3.400	1,029.40	2,286,635.00	1,029.40
华泰证券	20221229000 12129	锦浪科技	2022 年 12 月 29 日	1,292,100.00	7,300	14	3.400	244.06	1,314,365.00	244.06
华泰证券	20220222000 00463	晶盛机电	2022 年 2 月 22 日	120,200.00	2,000	14	3.400	158.90	-	-
华泰证券	20220308000 12984	晶盛机电	2022 年 3 月 8 日	120,880.00	2,000	14	3.400	159.88	-	-
华泰证券	20220322000 14301	晶盛机电	2022 年 3 月 22 日	124,000.00	2,000	14	3.400	175.65	-	-
华泰证券	20220406000 48669	晶盛机电	2022 年 4 月 6 日	113,980.00	2,000	14	3.400	150.78	-	-
华泰证券	20220720000 00469	凯赛生物	2022 年 7 月 20 日	2,284,240.00	28,000	14	3.400	3,020.22	-	-
华泰证券	20220725000 00529	凯赛生物	2022 年 7 月 25 日	904,750.00	11,000	14	3.400	1,196.30	-	-
华泰证券	20220823000 00452	凯赛生物	2022 年 8 月 23 日	1,386,840.00	18,200	14	3.400	1,833.72	-	-
华泰证券	20220829000 00590	凯赛生物	2022 年 8 月 29 日	1,872,306.00	25,800	14	3.400	2,652.45	-	-
华泰证券	20220907000 00547	凯赛生物	2022 年 9 月 7 日	1,119,006.00	16,600	14	3.400	1,479.52	-	-
华泰证券	20220915000 00671	凯赛生物	2022 年 9 月 15 日	735,000.00	10,000	14	3.400	971.88	-	-
华泰证券	20221031000 00686	凯赛生物	2022 年 10 月 31 日	2,050,240.00	32,000	28	3.400	5,421.64	-	-
华泰证券	20221114000 00777	凯赛生物	2022 年 11 月 14 日	97,398.00	1,400	14	3.400	128.80	-	-
华泰证券	20221128000 06277	凯赛生物	2022 年 11 月 28 日	85,778.00	1,400	14	3.400	113.40	-	-
华泰证券	20221212000 38781	凯赛生物	2022 年 12 月 12 日	92,064.00	1,400	14	3.400	121.80	-	-
华泰证券	20221213000	凯赛生物	2022 年 12 月	3,191,237.00	49,700	14	3.400	4,219.46	-	-

	00751		13日							
华泰证券	20221226000 22319	凯赛生物	2022年12月 26日	87,304.00	1,400	14	3.400	41.25	85,806.00	41.25
华泰证券	20221227000 15755	凯赛生物	2022年12月 27日	3,099,292.00	49,700	14	3.400	1,170.84	3,046,113.00	1,170.84
华泰证券	20220120000 00805	康龙化成	2022年1月 20日	5,755,950.00	45,000	14	3.400	9,785.16		
华泰证券	20220127000 00541	康龙化成	2022年1月 27日	10,422,405.00	86,100	14	3.400	13,780.76		
华泰证券	20220207000 43953	康龙化成	2022年2月7 日	5,453,100.00	45,000	14	3.400	7,210.28		
华泰证券	20220208000 01021	康龙化成	2022年2月8 日	553,749.00	4,900	14	3.400	732.20		
华泰证券	20220210000 13168	康龙化成	2022年2月 10日	9,364,236.00	86,100	14	3.400	12,381.60		
华泰证券	20220221000 47301	康龙化成	2022年2月 21日	5,200,200.00	45,000	14	3.400	6,875.82		
华泰证券	20220222000 11097	康龙化成	2022年2月 22日	558,110.00	4,900	14	3.400	737.94		
华泰证券	20220224000 11987	康龙化成	2022年2月 24日	10,008,264.00	86,100	14	3.400	13,233.22		
华泰证券	20220307000 36676	康龙化成	2022年3月7 日	4,860,000.00	45,000	14	3.400	6,426.00		
华泰证券	20220308000 12974	康龙化成	2022年3月8 日	523,124.00	4,900	14	3.400	691.74		
华泰证券	20220310000 13042	康龙化成	2022年3月 10日	9,056,859.00	86,100	14	3.400	11,975.18		
华泰证券	20220901000 00780	康龙化成	2022年9月1 日	1,388,380.00	21,100	14	3.400	1,835.82		
华泰证券	20220915000 14193	康龙化成	2022年9月 15日	1,219,791.00	21,100	14	3.400	1,612.80		
华泰证券	20221114000 00816	康龙化成	2022年11月 14日	2,642,472.00	39,200	14	3.400	3,493.98		
华泰证券	20221123000 00463	康龙化成	2022年11月 23日	626,976.00	9,600	14	3.400	828.94		
华泰证券	20221128000 06299	康龙化成	2022年11月 28日	2,538,592.00	39,200	14	3.400	3,356.64		
华泰证券	20221207000 13660	康龙化成	2022年12月 7日	635,712.00	9,600	14	3.400	840.56		
华泰证券	20221212000 38861	康龙化成	2022年12月 12日	2,472,736.00	39,200	14	3.400	3,269.56		
华泰证券	20221213000 00759	康龙化成	2022年12月 13日	361,572.00	5,800	14	3.400	478.10		

华泰证券	20221221000 20081	康龙化成	2022 年 12 月 21 日	559,008.00	9,600	14	3.400	528.00	652,800.00	528.00
华泰证券	20221226000 26269	康龙化成	2022 年 12 月 26 日	2,382,968.00	39,200	14	3.400	1,125.30	2,665,600.00	1,125.30
华泰证券	20220530000 00481	康泰生物	2022 年 5 月 30 日	5,993,417.00	95,300	14	3.400	7,924.70	-	-
华泰证券	20220613000 19249	康泰生物	2022 年 6 月 13 日	3,737,666.00	95,300	14	3.400	4,942.00	-	-
华泰证券	20220712000 00446	康泰生物	2022 年 7 月 12 日	1,980,027.00	47,700	14	3.400	2,618.00	-	-
华泰证券	20220830000 00433	康泰生物	2022 年 8 月 30 日	130,884.00	3,900	28	3.400	346.08	-	-
华泰证券	20220927000 23677	康泰生物	2022 年 9 月 27 日	120,549.00	3,900	28	3.400	318.92	-	-
华泰证券	20221025000 27064	康泰生物	2022 年 10 月 25 日	113,100.00	3,900	28	3.400	299.04	-	-
华泰证券	20221114000 00696	康泰生物	2022 年 11 月 14 日	2,896,404.00	81,200	14	3.400	3,829.70	-	-
华泰证券	20221128000 00488	康泰生物	2022 年 11 月 28 日	1,220,600.00	35,900	14	3.400	1,613.92	-	-
华泰证券	20221128000 06241	康泰生物	2022 年 11 月 28 日	2,760,800.00	81,200	14	3.400	3,650.36	-	-
华泰证券	20221122000 20327	康泰生物	2022 年 11 月 22 日	139,230.00	3,900	28	3.400	368.20	-	-
华泰证券	20221212000 38853	康泰生物	2022 年 12 月 12 日	2,768,920.00	81,200	14	3.400	3,661.14	-	-
华泰证券	20221212000 38887	康泰生物	2022 年 12 月 12 日	1,224,190.00	35,900	14	3.400	1,618.68	-	-
华泰证券	20221226000 26345	康泰生物	2022 年 12 月 26 日	1,087,770.00	35,900	14	3.400	513.65	1,131,927.00	513.65
华泰证券	20221226000 26347	康泰生物	2022 年 12 月 26 日	2,460,360.00	81,200	14	3.400	1,161.85	2,560,236.00	1,161.85
华泰证券	20221220000 19534	康泰生物	2022 年 12 月 20 日	120,120.00	3,900	28	3.400	124.74	122,967.00	124.74
华泰证券	20220713000 00511	康泰生物	2022 年 7 月 13 日	40,870.00	1,000	14	3.400	54.04	-	-
华泰证券	20220727000 27362	康泰生物	2022 年 7 月 27 日	35,000.00	1,000	14	3.400	46.34	-	-
华泰证券	20220810000 26588	康泰生物	2022 年 8 月 10 日	34,380.00	1,000	14	3.400	45.50	-	-
华泰证券	20220824000 30859	康泰生物	2022 年 8 月 24 日	32,480.00	1,000	14	3.400	42.98	-	-
华泰证券	20220104000	蓝思科技	2022 年 1 月 4	1,239,744.00	52,800	14	3.400	1,639.26	-	-

	23117		日								
华泰证券	20220113000 00678	蓝思科技	2022年1月 13日	4,364,619.00	214,900	14	3.400	5,770.94			
华泰证券	20220208000 01025	蓝思科技	2022年2月8 日	65,317.00	4,300	14	3.400	86.38			
华泰证券	20220209000 00846	蓝思科技	2022年2月9 日	174,608.00	11,200	14	3.400	230.86			
华泰证券	20220222000 11071	蓝思科技	2022年2月 22日	62,952.00	4,300	14	3.400	83.30			
华泰证券	20220223000 11588	蓝思科技	2022年2月 23日	169,232.00	11,200	14	3.400	223.72			
华泰证券	20220308000 12966	蓝思科技	2022年3月8 日	56,674.00	4,300	14	3.400	74.90			
华泰证券	20220309000 18111	蓝思科技	2022年3月9 日	143,248.00	11,200	14	3.400	189.42			
华泰证券	20220322000 14305	蓝思科技	2022年3月 22日	52,546.00	4,300	14	3.400	74.40			
华泰证券	20220323000 12527	蓝思科技	2022年3月 23日	137,088.00	11,200	14	3.400	181.30			
华泰证券	20220406000 65859	蓝思科技	2022年4月6 日	49,751.00	4,300	14	3.400	65.80			
华泰证券	20220406000 65861	蓝思科技	2022年4月6 日	129,584.00	11,200	14	3.400	171.36			
华泰证券	20221114000 00684	蓝思科技	2022年11月 14日	205,020.00	20,100	14	3.400	271.04			
华泰证券	20221128000 06243	蓝思科技	2022年11月 28日	204,216.00	20,100	14	3.400	270.06			
华泰证券	20221212000 38841	蓝思科技	2022年12月 12日	221,100.00	20,100	14	3.400	292.32			
华泰证券	20221226000 23719	蓝思科技	2022年12月 26日	216,678.00	20,100	14	3.400	102.30	211,653.00	102.30	
华泰证券	20220107000 09907	澜起科技	2022年1月7 日	3,894,768.00	51,600	28	3.400	11,403.04			
华泰证券	20220207000 43933	澜起科技	2022年2月7 日	3,713,136.00	51,600	28	3.400	9,819.32			
华泰证券	20220906000 00435	澜起科技	2022年9月6 日	3,321,000.00	60,000	14	3.400	4,391.10			
华泰证券	20220920000 14343	澜起科技	2022年9月 20日	3,276,000.00	60,000	14	3.400	6,188.00			
华泰证券	20221010000 96685	澜起科技	2022年10月 10日	2,646,000.00	60,000	14	3.400	3,498.60			
华泰证券	20221024000 89467	澜起科技	2022年10月 24日	2,982,600.00	60,000	14	3.400	3,943.66			

华泰证券	20221107000 87107	澜起科技	2022 年 11 月 7 日	3,892,800.00	60,000	14	3.400	5,147.10	-	-
华泰证券	20221114000 00776	澜起科技	2022 年 11 月 14 日	2,657,622.00	40,200	14	3.400	3,514.00	-	-
华泰证券	20221121000 66850	澜起科技	2022 年 11 月 21 日	4,069,200.00	60,000	14	3.400	5,380.34	-	-
华泰证券	20221128000 06281	澜起科技	2022 年 11 月 28 日	2,797,116.00	40,200	14	3.400	3,698.38	-	-
华泰证券	20221205000 25320	澜起科技	2022 年 12 月 5 日	4,009,800.00	60,000	14	3.400	5,301.80	-	-
华泰证券	20221212000 38873	澜起科技	2022 年 12 月 12 日	2,834,502.00	40,200	14	3.400	3,747.80	-	-
华泰证券	20221219000 22786	澜起科技	2022 年 12 月 19 日	3,894,000.00	60,000	14	3.400	4,413.24	3,756,000.00	4,413.24
华泰证券	20221226000 22315	澜起科技	2022 年 12 月 26 日	2,524,962.00	40,200	14	3.400	1,192.35	2,516,520.00	1,192.35
华泰证券	20220704000 00477	乐普医疗	2022 年 7 月 4 日	126,918.00	6,600	14	3.400	167.86	-	-
华泰证券	20220718000 16229	乐普医疗	2022 年 7 月 18 日	116,292.00	6,600	14	3.400	153.72	-	-
华泰证券	20220801000 12979	乐普医疗	2022 年 8 月 1 日	119,130.00	6,600	14	3.400	157.50	-	-
华泰证券	20220815000 17417	乐普医疗	2022 年 8 月 15 日	119,130.00	6,600	14	3.400	157.50	-	-
华泰证券	20220829000 18183	乐普医疗	2022 年 8 月 29 日	120,054.00	6,600	14	3.400	170.10	-	-
华泰证券	20220913000 25323	乐普医疗	2022 年 9 月 13 日	141,174.00	6,600	14	3.400	186.62	-	-
华泰证券	20220927000 22045	乐普医疗	2022 年 9 月 27 日	133,584.00	6,600	14	3.400	176.68	-	-
华泰证券	20221011000 29919	乐普医疗	2022 年 10 月 11 日	135,828.00	6,600	14	3.400	179.62	-	-
华泰证券	20221025000 29850	乐普医疗	2022 年 10 月 25 日	159,984.00	6,600	14	3.400	211.54	-	-
华泰证券	20221108000 22325	乐普医疗	2022 年 11 月 8 日	158,532.00	6,600	14	3.400	209.58	-	-
华泰证券	20221122000 18879	乐普医疗	2022 年 11 月 22 日	151,008.00	6,600	14	3.400	199.64	-	-
华泰证券	20221026000 00941	迈瑞医疗	2022 年 10 月 26 日	3,912,000.00	12,000	14	3.400	5,172.58	-	-
华泰证券	20220707000 00402	迈为股份	2022 年 7 月 7 日	4,995,300.00	10,000	28	3.400	13,209.84	-	-
华泰证券	20220804000	迈为股份	2022 年 8 月 4	4,518,000.00	10,000	28	3.400	11,947.60	-	-

	13546		日								
华泰证券	202210250000603	迈为股份	2022年10月25日	4,386,560.00	9,200	14	3.400	5,800.06			
华泰证券	202211030000674	迈为股份	2022年11月3日	1,445,621.00	2,900	14	3.400	1,911.42			
华泰证券	202211140000808	迈为股份	2022年11月14日	1,796,145.00	3,900	14	3.400	2,374.96			
华泰证券	202211140000812	迈为股份	2022年11月14日	2,118,530.00	4,600	14	3.400	2,801.12			
华泰证券	202211280006221	迈为股份	2022年11月28日	2,049,622.00	4,600	14	3.400	2,710.12			
华泰证券	202212070000742	迈为股份	2022年12月7日	2,217,600.00	4,800	14	3.400	2,932.16			
华泰证券	2022121200038857	迈为股份	2022年12月12日	2,074,600.00	4,600	14	3.400	2,743.02			
华泰证券	2022121400004492	迈为股份	2022年12月14日	1,716,000.00	4,000	14	3.400	2,268.98			
华泰证券	2022122100021361	迈为股份	2022年12月21日	1,946,880.00	4,800	14	3.400	1,838.70	1,976,832.00		1,838.70
华泰证券	2022122600026351	迈为股份	2022年12月26日	1,876,800.00	4,600	14	3.400	886.25	1,894,464.00		886.25
华泰证券	2022122700000489	迈为股份	2022年12月27日	3,436,200.00	8,300	14	3.400	1,298.12	3,418,272.00		1,298.12
华泰证券	2022122800026633	迈为股份	2022年12月28日	1,644,640.00	4,000	14	3.400	465.99	1,647,360.00		465.99
华泰证券	2022010400023115	芒果超媒	2022年1月4日	4,003,063.00	68,300	28	3.400	12,854.38			
华泰证券	2022010400023119	芒果超媒	2022年1月4日	498,185.00	8,500	28	3.400	1,599.70			
华泰证券	2022010600010081	芒果超媒	2022年1月6日	1,701,792.00	31,100	28	3.400	5,143.04			
华泰证券	2022020700043993	芒果超媒	2022年2月7日	292,400.00	8,500	28	3.400	773.36			
华泰证券	202211140000682	芒果超媒	2022年11月14日	550,880.00	22,000	14	3.400	728.42			
华泰证券	2022111700001186	芒果超媒	2022年11月17日	3,708,894.00	139,800	14	3.400	4,903.92			
华泰证券	202211280006225	芒果超媒	2022年11月28日	544,720.00	22,000	14	3.400	720.30			
华泰证券	2022121200038839	芒果超媒	2022年12月12日	578,600.00	22,000	14	3.400	765.10			
华泰证券	2022122600023717	芒果超媒	2022年12月26日	674,520.00	22,000	14	3.400	318.55	660,440.00		318.55

华泰证券	20221114000 00810	宁德时代	2022 年 11 月 14 日	7,975,908.00	20,600	14	3.400	10,545.92	-	-
华泰证券	20221128000 06233	宁德时代	2022 年 11 月 28 日	7,628,386.00	20,600	14	3.400	10,086.44	-	-
华泰证券	20221212000 38855	宁德时代	2022 年 12 月 12 日	8,535,610.00	20,600	14	3.400	11,285.96	-	-
华泰证券	20221226000 23739	宁德时代	2022 年 12 月 26 日	8,320,752.00	20,600	14	3.400	3,929.25	8,104,452.00	3,929.25
华泰证券	20220104000 23069	欧普康视	2022 年 1 月 4 日	1,405,250.00	25,000	14	3.400	1,858.08	-	-
华泰证券	20220118000 23950	欧普康视	2022 年 1 月 18 日	1,228,250.00	25,000	14	3.400	2,320.00	-	-
华泰证券	20220207000 54863	欧普康视	2022 年 2 月 7 日	945,000.00	25,000	14	3.400	1,249.50	-	-
华泰证券	20220128000 18808	欧普康视	2022 年 1 月 28 日	1,861,236.00	49,200	28	3.400	4,921.84	-	-
华泰证券	20220221000 35759	欧普康视	2022 年 2 月 21 日	1,008,750.00	25,000	14	3.400	1,333.78	-	-
华泰证券	20220307000 36710	欧普康视	2022 年 3 月 7 日	930,000.00	25,000	14	3.400	1,229.62	-	-
华泰证券	20220321000 33071	欧普康视	2022 年 3 月 21 日	911,500.00	25,000	14	3.400	1,377.44	-	-
华泰证券	20220406000 66107	欧普康视	2022 年 4 月 6 日	881,250.00	25,000	14	3.400	1,165.22	-	-
华泰证券	20220420000 46446	欧普康视	2022 年 4 月 20 日	873,750.00	25,000	14	3.400	1,237.80	-	-
华泰证券	20220505000 70271	欧普康视	2022 年 5 月 5 日	928,250.00	25,000	14	3.400	1,227.38	-	-
华泰证券	20220523000 00531	欧普康视	2022 年 5 月 23 日	816,640.00	22,000	14	3.400	1,079.82	-	-
华泰证券	20220524000 00820	欧普康视	2022 年 5 月 24 日	703,400.00	20,000	14	3.400	930.02	-	-
华泰证券	20220606000 09622	欧普康视	2022 年 6 月 6 日	1,004,300.00	22,000	14	3.400	1,327.90	-	-
华泰证券	20220607000 08702	欧普康视	2022 年 6 月 7 日	886,000.00	20,000	14	3.400	1,171.52	-	-
华泰证券	20220620000 11958	欧普康视	2022 年 6 月 20 日	1,200,760.00	22,000	14	3.400	1,587.74	-	-
华泰证券	20220621000 09082	欧普康视	2022 年 6 月 21 日	1,065,400.00	20,000	14	3.400	1,408.68	-	-
华泰证券	20220704000 12946	欧普康视	2022 年 7 月 4 日	1,249,600.00	22,000	14	3.400	1,652.28	-	-
华泰证券	20220705000	欧普康视	2022 年 7 月 5	1,072,000.00	20,000	14	3.400	1,417.36	-	-

	10716		日							
华泰证券	20220718000 13837	欧普康视	2022年7月 18日	1,170,840.00	22,000	14	3.400	1,548.12	-	-
华泰证券	20220719000 08510	欧普康视	2022年7月 19日	1,036,200.00	20,000	14	3.400	1,370.04	-	-
华泰证券	20220801000 15635	欧普康视	2022年8月1 日	1,057,760.00	22,000	14	3.400	1,398.60	-	-
华泰证券	20220802000 12433	欧普康视	2022年8月2 日	935,200.00	20,000	14	3.400	1,236.48	-	-
华泰证券	20220815000 15759	欧普康视	2022年8月 15日	993,520.00	22,000	14	3.400	1,313.62	-	-
华泰证券	20220816000 09226	欧普康视	2022年8月 16日	898,000.00	20,000	14	3.400	1,187.34	-	-
华泰证券	20220819000 00360	欧普康视	2022年8月 19日	129,930.00	3,000	14	3.400	171.78	-	-
华泰证券	20220829000 18253	欧普康视	2022年8月 29日	927,300.00	22,000	14	3.400	1,313.70	-	-
华泰证券	20220830000 00429	欧普康视	2022年8月 30日	438,360.00	10,400	14	3.400	579.60	-	-
华泰证券	20220830000 12492	欧普康视	2022年8月 30日	843,000.00	20,000	14	3.400	1,114.68	-	-
华泰证券	20220901000 00784	欧普康视	2022年9月1 日	289,800.00	7,000	14	3.400	383.18	-	-
华泰证券	20220902000 00753	欧普康视	2022年9月2 日	2,878,720.00	69,200	14	3.400	3,806.32	-	-
华泰证券	20220902000 09555	欧普康视	2022年9月2 日	124,800.00	3,000	14	3.400	165.06	-	-
华泰证券	20220905000 00543	欧普康视	2022年9月5 日	40,610.00	1,000	14	3.400	53.76	-	-
华泰证券	20220913000 00696	欧普康视	2022年9月 13日	130,650.00	3,000	14	3.400	172.76	-	-
华泰证券	20220913000 24383	欧普康视	2022年9月 13日	452,920.00	10,400	14	3.400	598.92	-	-
华泰证券	20220913000 24541	欧普康视	2022年9月 13日	871,000.00	20,000	14	3.400	1,151.64	-	-
华泰证券	20220913000 25311	欧普康视	2022年9月 13日	958,100.00	22,000	14	3.400	1,266.86	-	-
华泰证券	20220914000 00732	欧普康视	2022年9月 14日	129,090.00	3,000	14	3.400	170.66	-	-
华泰证券	20220915000 00666	欧普康视	2022年9月 15日	211,800.00	5,000	14	3.400	280.00	-	-
华泰证券	20220915000 15003	欧普康视	2022年9月 15日	296,520.00	7,000	14	3.400	392.14	-	-

华泰证券	20220916000 00544	欧普康视	2022年9月 16日	243,360.00	6,000	14	3.400	321.72	-	-
华泰证券	20220916000 10086	欧普康视	2022年9月 16日	2,806,752.00	69,200	14	3.400	3,711.12	-	-
华泰证券	20220916000 10128	欧普康视	2022年9月 16日	121,680.00	3,000	14	3.400	160.86	-	-
华泰证券	20220919000 00825	欧普康视	2022年9月 19日	235,680.00	6,000	14	3.400	467.46	-	-
华泰证券	20220919000 18944	欧普康视	2022年9月 19日	39,280.00	1,000	14	3.400	77.91	-	-
华泰证券	20220927000 23685	欧普康视	2022年9月 27日	122,340.00	3,000	14	3.400	161.70	-	-
华泰证券	20220927000 23773	欧普康视	2022年9月 27日	424,112.00	10,400	14	3.400	560.84	-	-
华泰证券	20220927000 23775	欧普康视	2022年9月 27日	815,600.00	20,000	14	3.400	1,078.42	-	-
华泰证券	20220927000 23777	欧普康视	2022年9月 27日	897,160.00	22,000	14	3.400	1,186.22	-	-
华泰证券	20220928000 14817	欧普康视	2022年9月 28日	121,140.00	3,000	14	3.400	160.16	-	-
华泰证券	20220929000 14763	欧普康视	2022年9月 29日	206,100.00	5,000	14	3.400	272.58	-	-
华泰证券	20220929000 14783	欧普康视	2022年9月 29日	288,540.00	7,000	14	3.400	381.50	-	-
华泰证券	20220930000 12033	欧普康视	2022年9月 30日	123,900.00	3,000	14	3.400	163.80	-	-
华泰证券	20220930000 12041	欧普康视	2022年9月 30日	247,800.00	6,000	14	3.400	327.60	-	-
华泰证券	20220930000 12073	欧普康视	2022年9月 30日	2,857,960.00	69,200	14	3.400	3,778.88	-	-
华泰证券	20221010000 81945	欧普康视	2022年10月 10日	238,620.00	6,000	14	3.400	315.56	-	-
华泰证券	20221011000 24545	欧普康视	2022年10月 11日	112,050.00	3,000	14	3.400	148.12	-	-
华泰证券	20221011000 24555	欧普康视	2022年10月 11日	388,440.00	10,400	14	3.400	513.66	-	-
华泰证券	20221011000 24557	欧普康视	2022年10月 11日	747,000.00	20,000	14	3.400	987.70	-	-
华泰证券	20221011000 24559	欧普康视	2022年10月 11日	821,700.00	22,000	14	3.400	1,086.54	-	-
华泰证券	20221012000 20092	欧普康视	2022年10月 12日	112,290.00	3,000	14	3.400	148.54	-	-
华泰证券	20221013000	欧普康视	2022年10月	265,090.00	7,000	14	3.400	350.56	-	-

	16280		13 日								
华泰证券	20221013000 16282	欧普康视	2022 年 10 月 13 日	189,350.00	5,000	14	3.400	250.32	-	-	
华泰证券	20221014000 11124	欧普康视	2022 年 10 月 14 日	129,630.00	3,000	14	3.400	171.36	-	-	
华泰证券	20221014000 11126	欧普康视	2022 年 10 月 14 日	259,260.00	6,000	14	3.400	342.86	-	-	
华泰证券	20221014000 11128	欧普康视	2022 年 10 月 14 日	2,990,132.00	69,200	14	3.400	3,953.60	-	-	
华泰证券	20221024000 86455	欧普康视	2022 年 10 月 24 日	253,380.00	6,000	14	3.400	335.02	-	-	
华泰证券	20221025000 26264	欧普康视	2022 年 10 月 25 日	120,660.00	3,000	14	3.400	159.60	-	-	
华泰证券	20221025000 26266	欧普康视	2022 年 10 月 25 日	418,288.00	10,400	14	3.400	553.14	-	-	
华泰证券	20221025000 26268	欧普康视	2022 年 10 月 25 日	804,400.00	20,000	14	3.400	1,063.58	-	-	
华泰证券	20221025000 26270	欧普康视	2022 年 10 月 25 日	884,840.00	22,000	14	3.400	1,169.98	-	-	
华泰证券	20221026000 19482	欧普康视	2022 年 10 月 26 日	125,580.00	3,000	14	3.400	166.04	-	-	
华泰证券	20221027000 14647	欧普康视	2022 年 10 月 27 日	234,430.00	7,000	14	3.400	309.96	-	-	
华泰证券	20221027000 19051	欧普康视	2022 年 10 月 27 日	167,450.00	5,000	14	3.400	221.48	-	-	
华泰证券	20221028000 12067	欧普康视	2022 年 10 月 28 日	93,900.00	3,000	14	3.400	124.18	-	-	
华泰证券	20221028000 12069	欧普康视	2022 年 10 月 28 日	187,800.00	6,000	14	3.400	248.36	-	-	
华泰证券	20221028000 12071	欧普康视	2022 年 10 月 28 日	2,165,960.00	69,200	14	3.400	2,863.84	-	-	
华泰证券	20221031000 00690	欧普康视	2022 年 10 月 31 日	118,880.00	4,000	14	3.400	157.22	-	-	
华泰证券	20221101000 00435	欧普康视	2022 年 11 月 1 日	61,920.00	2,000	14	3.400	81.90	-	-	
华泰证券	20221102000 00715	欧普康视	2022 年 11 月 2 日	309,300.00	10,000	14	3.400	408.94	-	-	
华泰证券	20221107000 00508	欧普康视	2022 年 11 月 7 日	296,460.00	9,000	14	3.400	392.00	-	-	
华泰证券	20221107000 84163	欧普康视	2022 年 11 月 7 日	197,640.00	6,000	14	3.400	261.38	-	-	
华泰证券	20221108000 00848	欧普康视	2022 年 11 月 8 日	1,799,392.00	55,400	14	3.400	2,379.16	-	-	

华泰证券	20221108000 21319	欧普康视	2022 年 11 月 8 日	97,440.00	3,000	14	3.400	128.80	-	-
华泰证券	20221108000 21321	欧普康视	2022 年 11 月 8 日	337,792.00	10,400	14	3.400	446.60	-	-
华泰证券	20221108000 21323	欧普康视	2022 年 11 月 8 日	649,600.00	20,000	14	3.400	858.90	-	-
华泰证券	20221109000 00522	欧普康视	2022 年 11 月 9 日	925,390.00	29,000	14	3.400	1,223.60	-	-
华泰证券	20221109000 20553	欧普康视	2022 年 11 月 9 日	95,730.00	3,000	14	3.400	126.56	-	-
华泰证券	20221110000 20258	欧普康视	2022 年 11 月 10 日	160,350.00	5,000	14	3.400	211.96	-	-
华泰证券	20221110000 20262	欧普康视	2022 年 11 月 10 日	224,490.00	7,000	14	3.400	296.80	-	-
华泰证券	20221111000 14067	欧普康视	2022 年 11 月 11 日	97,740.00	3,000	14	3.400	129.22	-	-
华泰证券	20221111000 14069	欧普康视	2022 年 11 月 11 日	195,480.00	6,000	14	3.400	258.44	-	-
华泰证券	20221111000 14071	欧普康视	2022 年 11 月 11 日	2,254,536.00	69,200	14	3.400	2,981.02	-	-
华泰证券	20221114000 00710	欧普康视	2022 年 11 月 14 日	2,828,550.00	86,500	14	3.400	3,739.96	-	-
华泰证券	20221114000 08481	欧普康视	2022 年 11 月 14 日	130,800.00	4,000	14	3.400	172.90	-	-
华泰证券	20221115000 08430	欧普康视	2022 年 11 月 15 日	66,740.00	2,000	14	3.400	88.20	-	-
华泰证券	20221116000 07353	欧普康视	2022 年 11 月 16 日	331,200.00	10,000	14	3.400	437.92	-	-
华泰证券	20221121000 64990	欧普康视	2022 年 11 月 21 日	291,690.00	9,000	14	3.400	385.70	-	-
华泰证券	20221121000 67950	欧普康视	2022 年 11 月 21 日	194,460.00	6,000	14	3.400	257.18	-	-
华泰证券	20221122000 18839	欧普康视	2022 年 11 月 22 日	93,540.00	3,000	14	3.400	123.62	-	-
华泰证券	20221122000 18841	欧普康视	2022 年 11 月 22 日	324,272.00	10,400	14	3.400	428.82	-	-
华泰证券	20221122000 20317	欧普康视	2022 年 11 月 22 日	1,727,372.00	55,400	14	3.400	2,283.96	-	-
华泰证券	20221123000 15810	欧普康视	2022 年 11 月 23 日	881,020.00	29,000	14	3.400	1,164.94	-	-
华泰证券	20221123000 17664	欧普康视	2022 年 11 月 23 日	91,140.00	3,000	14	3.400	120.54	-	-
华泰证券	20221124000	欧普康视	2022 年 11 月	153,050.00	5,000	14	3.400	202.44	-	-

	15974		24 日							
华泰证券	20221124000 15976	欧普康视	2022 年 11 月 24 日	214,270.00	7,000	14	3.400	283.36	-	-
华泰证券	20221125000 09682	欧普康视	2022 年 11 月 25 日	91,020.00	3,000	14	3.400	120.40	-	-
华泰证券	20221125000 09684	欧普康视	2022 年 11 月 25 日	182,040.00	6,000	14	3.400	240.66	-	-
华泰证券	20221125000 09686	欧普康视	2022 年 11 月 25 日	2,099,528.00	69,200	14	3.400	2,776.06	-	-
华泰证券	20221128000 06209	欧普康视	2022 年 11 月 28 日	2,614,030.00	86,500	14	3.400	3,456.32	-	-
华泰证券	20221128000 06365	欧普康视	2022 年 11 月 28 日	120,880.00	4,000	14	3.400	159.88	-	-
华泰证券	20221129000 15910	欧普康视	2022 年 11 月 29 日	62,900.00	2,000	14	3.400	83.16	-	-
华泰证券	20221130000 08589	欧普康视	2022 年 11 月 30 日	315,000.00	10,000	14	3.400	416.50	-	-
华泰证券	20221205000 20800	欧普康视	2022 年 12 月 5 日	294,120.00	9,000	14	3.400	388.92	-	-
华泰证券	20221205000 26562	欧普康视	2022 年 12 月 5 日	196,080.00	6,000	14	3.400	259.28	-	-
华泰证券	20221206000 11558	欧普康视	2022 年 12 月 6 日	1,837,618.00	55,400	14	3.400	2,429.70	-	-
华泰证券	20221206000 11560	欧普康视	2022 年 12 月 6 日	99,510.00	3,000	14	3.400	131.60	-	-
华泰证券	20221206000 11562	欧普康视	2022 年 12 月 6 日	344,968.00	10,400	14	3.400	456.12	-	-
华泰证券	20221207000 13702	欧普康视	2022 年 12 月 7 日	972,080.00	29,000	14	3.400	1,285.34	-	-
华泰证券	20221207000 13704	欧普康视	2022 年 12 月 7 日	100,560.00	3,000	14	3.400	133.00	-	-
华泰证券	20221208000 11231	欧普康视	2022 年 12 月 8 日	165,100.00	5,000	14	3.400	218.26	-	-
华泰证券	20221208000 13277	欧普康视	2022 年 12 月 8 日	231,140.00	7,000	14	3.400	305.62	-	-
华泰证券	20221209000 05818	欧普康视	2022 年 12 月 9 日	99,660.00	3,000	14	3.400	131.74	-	-
华泰证券	20221209000 05820	欧普康视	2022 年 12 月 9 日	199,320.00	6,000	14	3.400	263.62	-	-
华泰证券	20221209000 05822	欧普康视	2022 年 12 月 9 日	2,298,824.00	69,200	14	3.400	3,039.54	-	-
华泰证券	20221212000 38849	欧普康视	2022 年 12 月 12 日	2,871,800.00	86,500	14	3.400	3,797.22	-	-

华泰证券	20221212000 38851	欧普康视	2022 年 12 月 12 日	132,800.00	4,000	14	3.400	175.56	-	-
华泰证券	20221213000 12831	欧普康视	2022 年 12 月 13 日	65,300.00	2,000	14	3.400	86.38	-	-
华泰证券	20221214000 26740	欧普康视	2022 年 12 月 14 日	336,000.00	10,000	14	3.400	444.22	-	-
华泰证券	20221219000 22866	欧普康视	2022 年 12 月 19 日	192,960.00	6,000	14	3.400	218.64	214,200.00	218.64
华泰证券	20221219000 22868	欧普康视	2022 年 12 月 19 日	289,440.00	9,000	14	3.400	328.08	321,300.00	328.08
华泰证券	20221220000 19512	欧普康视	2022 年 12 月 20 日	1,746,762.00	55,400	14	3.400	1,814.67	1,977,780.00	1,814.67
华泰证券	20221220000 19516	欧普康视	2022 年 12 月 20 日	94,590.00	3,000	14	3.400	98.23	107,100.00	98.23
华泰证券	20221220000 19518	欧普康视	2022 年 12 月 20 日	327,912.00	10,400	14	3.400	340.67	371,280.00	340.67
华泰证券	20221221000 20087	欧普康视	2022 年 12 月 21 日	903,350.00	29,000	14	3.400	853.20	1,035,300.00	853.20
华泰证券	20221221000 20089	欧普康视	2022 年 12 月 21 日	93,450.00	3,000	14	3.400	88.30	107,100.00	88.30
华泰证券	20221222000 14013	欧普康视	2022 年 12 月 22 日	227,990.00	7,000	14	3.400	193.77	249,900.00	193.77
华泰证券	20221222000 14019	欧普康视	2022 年 12 月 22 日	162,850.00	5,000	14	3.400	138.42	178,500.00	138.42
华泰证券	20221223000 08502	欧普康视	2022 年 12 月 23 日	102,060.00	3,000	14	3.400	77.12	107,100.00	77.12
华泰证券	20221223000 08504	欧普康视	2022 年 12 月 23 日	204,120.00	6,000	14	3.400	154.24	214,200.00	154.24
华泰证券	20221223000 08506	欧普康视	2022 年 12 月 23 日	2,354,184.00	69,200	14	3.400	1,778.72	2,470,440.00	1,778.72
华泰证券	20221226000 23733	欧普康视	2022 年 12 月 26 日	2,871,800.00	86,500	14	3.400	1,356.15	3,088,050.00	1,356.15
华泰证券	20221226000 23735	欧普康视	2022 年 12 月 26 日	132,800.00	4,000	14	3.400	62.70	142,800.00	62.70
华泰证券	20221227000 12177	欧普康视	2022 年 12 月 27 日	72,080.00	2,000	14	3.400	27.24	71,400.00	27.24
华泰证券	20221228000 26631	欧普康视	2022 年 12 月 28 日	357,000.00	10,000	14	3.400	101.16	357,000.00	101.16
华泰证券	20221114000 00770	奇安信	2022 年 11 月 14 日	1,290,113.00	18,700	14	3.400	1,705.76	-	-
华泰证券	20221128000 06265	奇安信	2022 年 11 月 28 日	1,161,457.00	18,700	14	3.400	1,535.66	-	-
华泰证券	20221212000	奇安信	2022 年 12 月	1,224,476.00	18,700	14	3.400	1,619.10	-	-

	38883		12日								
华泰证券	20221226000 26709	奇安信	2022年12月 26日	1,266,177.00	18,700	14	3.400	597.90	1,229,899. 00	597.90	
华泰证券	20221114000 00784	容百科技	2022年11月 14日	2,680,006.00	32,200	14	3.400	3,543.54			-
华泰证券	20221128000 06285	容百科技	2022年11月 28日	2,380,868.00	32,200	14	3.400	3,148.04			-
华泰证券	20221212000 38871	容百科技	2022年12月 12日	2,438,184.00	32,200	14	3.400	3,223.78			-
华泰证券	20221226000 27357	容百科技	2022年12月 26日	2,219,546.00	32,200	14	3.400	1,048.10	2,213,750. 00	1,048.10	
华泰证券	20221114000 00720	三环集团	2022年11月 14日	373,364.00	12,400	14	3.400	493.64			-
华泰证券	20221128000 06235	三环集团	2022年11月 28日	363,320.00	12,400	14	3.400	480.34			-
华泰证券	20221205000 00492	三环集团	2022年12月 5日	30,490.00	1,000	14	3.400	40.32			-
华泰证券	20221212000 40101	三环集团	2022年12月 12日	381,672.00	12,400	14	3.400	504.70			-
华泰证券	20221219000 19186	三环集团	2022年12月 19日	30,150.00	1,000	14	3.400	34.20	30,710.00	34.20	
华泰证券	20221226000 26343	三环集团	2022年12月 26日	381,300.00	12,400	14	3.400	180.05	380,804.00	180.05	
华泰证券	20220830000 00431	深信服	2022年8月 30日	135,548.00	1,400	28	3.400	358.40			-
华泰证券	20221014000 00572	深信服	2022年10月 14日	347,760.00	3,600	14	3.400	459.76			-
华泰证券	20221018000 00652	深信服	2022年10月 18日	709,104.00	6,800	14	3.400	937.58			-
华泰证券	20221028000 12915	深信服	2022年10月 28日	442,800.00	3,600	14	3.400	585.48			-
华泰证券	20221031000 00688	深信服	2022年10月 31日	1,033,200.00	8,200	14	3.400	1,366.12			-
华泰证券	20221101000 08114	深信服	2022年11月 1日	883,320.00	6,800	14	3.400	1,168.02			-
华泰证券	20221111000 13067	深信服	2022年11月 11日	439,200.00	3,600	14	3.400	580.72			-
华泰证券	20221114000 08483	深信服	2022年11月 14日	979,818.00	8,200	14	3.400	1,295.56			-
华泰证券	20221115000 08432	深信服	2022年11月 15日	812,940.00	6,800	14	3.400	1,074.92			-
华泰证券	20221128000 06367	深信服	2022年11月 28日	906,100.00	8,200	14	3.400	1,198.12			-

华泰证券	20221129000 15912	深信服	2022 年 11 月 29 日	753,644.00	6,800	14	3.400	996.52	-	-
华泰证券	20220704000 00474	圣邦股份	2022 年 7 月 4 日	878,850.00	5,000	14	3.400	1,162.00	-	-
华泰证券	20220718000 13835	圣邦股份	2022 年 7 月 18 日	818,150.00	5,000	14	3.400	1,081.78	-	-
华泰证券	20220801000 13019	圣邦股份	2022 年 8 月 1 日	841,000.00	5,000	14	3.400	1,112.02	-	-
华泰证券	20220815000 17189	圣邦股份	2022 年 8 月 15 日	875,250.00	5,000	14	3.400	1,157.24	-	-
华泰证券	20220829000 18013	圣邦股份	2022 年 8 月 29 日	791,500.00	5,000	14	3.400	1,121.25	-	-
华泰证券	20220913000 25341	圣邦股份	2022 年 9 月 13 日	775,900.00	5,000	14	3.400	1,025.92	-	-
华泰证券	20220927000 22043	圣邦股份	2022 年 9 月 27 日	703,250.00	5,000	14	3.400	929.88	-	-
华泰证券	20221011000 29543	圣邦股份	2022 年 10 月 11 日	669,850.00	5,000	14	3.400	885.64	-	-
华泰证券	20221025000 21446	圣邦股份	2022 年 10 月 25 日	783,250.00	5,000	14	3.400	1,035.58	-	-
华泰证券	20221108000 21401	圣邦股份	2022 年 11 月 8 日	788,000.00	5,000	14	3.400	1,041.88	-	-
华泰证券	20221114000 00773	圣邦股份	2022 年 11 月 14 日	2,886,554.00	17,900	14	3.400	3,816.68	-	-
华泰证券	20221122000 18875	圣邦股份	2022 年 11 月 22 日	889,050.00	5,000	14	3.400	1,175.58	-	-
华泰证券	20221128000 06223	圣邦股份	2022 年 11 月 28 日	3,071,640.00	17,900	14	3.400	4,061.40	-	-
华泰证券	20221206000 13488	圣邦股份	2022 年 12 月 6 日	908,000.00	5,000	14	3.400	1,200.64	-	-
华泰证券	20221212000 38825	圣邦股份	2022 年 12 月 12 日	3,286,798.00	17,900	14	3.400	4,345.88	-	-
华泰证券	20221215000 02485	圣邦股份	2022 年 12 月 15 日	187,500.00	1,000	14	3.400	247.94	-	-
华泰证券	20221216000 01788	圣邦股份	2022 年 12 月 16 日	999,600.00	5,600	14	3.400	1,321.74	-	-
华泰证券	20221226000 26265	圣邦股份	2022 年 12 月 26 日	3,089,540.00	17,900	14	3.400	1,458.95	3,089,540.00	1,458.95
华泰证券	20221229000 10799	圣邦股份	2022 年 12 月 29 日	175,910.00	1,000	14	3.400	33.22	172,600.00	33.22
华泰证券	20221230000 00543	圣邦股份	2022 年 12 月 30 日	2,278,320.00	13,200	14	3.400	215.18	2,278,320.00	215.18
华泰证券	20221230000	圣邦股份	2022 年 12 月	966,560.00	5,600	14	3.400	91.29	966,560.00	91.29

	12159		30日								
华泰证券	202205270000410	石头科技	2022年5月27日	5,659,900.00	10,000	14	3.400	7,483.70			
华泰证券	2022061000004043	石头科技	2022年6月10日	6,893,400.00	10,000	14	3.400	9,114.56			
华泰证券	2022070800007980	石头科技	2022年7月8日	3,829,800.00	10,000	14	3.400	5,063.80			
华泰证券	2022072200008225	石头科技	2022年7月22日	3,361,500.00	10,000	14	3.400	4,444.72			
华泰证券	2022080500008585	石头科技	2022年8月5日	3,345,800.00	10,000	14	3.400	4,423.86			
华泰证券	2022081900008098	石头科技	2022年8月19日	3,430,000.00	10,000	14	3.400	4,535.16			
华泰证券	2022090200008969	石头科技	2022年9月2日	3,133,600.00	10,000	14	3.400	4,143.30			
华泰证券	20220916000010532	石头科技	2022年9月16日	2,920,000.00	10,000	14	3.400	3,860.92			
华泰证券	20220930000012069	石头科技	2022年9月30日	2,581,700.00	10,000	14	3.400	3,413.62			
华泰证券	20221014000010758	石头科技	2022年10月14日	2,604,900.00	10,000	14	3.400	3,444.28			
华泰证券	20221028000012161	石头科技	2022年10月28日	2,292,000.00	10,000	14	3.400	3,030.58			
华泰证券	20221111000014035	石头科技	2022年11月11日	2,540,000.00	10,000	14	3.400	3,358.46			
华泰证券	20221114000000796	石头科技	2022年11月14日	876,520.00	3,400	14	3.400	1,158.92			
华泰证券	20221128000006291	石头科技	2022年11月28日	836,502.00	3,400	14	3.400	1,106.00			
华泰证券	20221212000038877	石头科技	2022年12月12日	909,092.00	3,400	14	3.400	1,202.04			
华泰证券	20221226000027363	石头科技	2022年12月26日	889,270.00	3,400	14	3.400	419.95	842,350.00		419.95
华泰证券	20220110000001146	宋城演艺	2022年1月10日	288,028.00	19,100	14	3.400	380.80			
华泰证券	20220110000011431	宋城演艺	2022年1月10日	431,288.00	28,600	14	3.400	570.22			
华泰证券	20220124000009130	宋城演艺	2022年1月24日	299,870.00	19,100	14	3.400	396.48			
华泰证券	20220124000009218	宋城演艺	2022年1月24日	449,020.00	28,600	14	3.400	593.74			
华泰证券	20220125000000528	宋城演艺	2022年1月25日	615,060.00	40,200	14	3.400	813.26			

华泰证券	20220207000 01159	宋城演艺	2022年2月7 日	123,574.00	8,200	14	3.400	163.38	-	-
华泰证券	20220207000 46387	宋城演艺	2022年2月7 日	287,837.00	19,100	14	3.400	380.52	-	-
华泰证券	20220208000 01027	宋城演艺	2022年2月8 日	170,130.00	10,700	14	3.400	224.98	-	-
华泰证券	20220208000 15258	宋城演艺	2022年2月8 日	639,180.00	40,200	14	3.400	845.18	-	-
华泰证券	20220209000 00849	宋城演艺	2022年2月9 日	1,025,010.00	63,000	14	3.400	1,355.34	-	-
华泰证券	20220221000 43357	宋城演艺	2022年2月 21日	303,690.00	19,100	14	3.400	401.52	-	-
华泰证券	20220221000 43359	宋城演艺	2022年2月 21日	130,380.00	8,200	14	3.400	172.34	-	-
华泰证券	20220222000 11083	宋城演艺	2022年2月 22日	166,813.00	10,700	14	3.400	220.50	-	-
华泰证券	20220222000 11085	宋城演艺	2022年2月 22日	626,718.00	40,200	14	3.400	828.66	-	-
华泰证券	20220223000 13526	宋城演艺	2022年2月 23日	972,720.00	63,000	14	3.400	1,286.18	-	-
华泰证券	20220309000 15785	宋城演艺	2022年3月9 日	846,720.00	63,000	14	3.400	1,119.58	-	-
华泰证券	20220330000 00740	宋城演艺	2022年3月 30日	844,272.00	62,400	14	3.400	1,116.36	-	-
华泰证券	20220413000 10362	宋城演艺	2022年4月 13日	834,912.00	62,400	14	3.400	1,103.90	-	-
华泰证券	20220427000 11717	宋城演艺	2022年4月 27日	760,032.00	62,400	14	3.400	1,004.92	-	-
华泰证券	20220511000 08740	宋城演艺	2022年5月 11日	732,576.00	62,400	14	3.400	968.66	-	-
华泰证券	20220104000 00462	泰格医药	2022年1月4 日	11,854,000.00	100,000	14	3.400	15,673.56	-	-
华泰证券	20220118000 23976	泰格医药	2022年1月 18日	12,202,000.00	100,000	14	3.400	23,048.20	-	-
华泰证券	20220207000 54829	泰格医药	2022年2月7 日	10,468,000.00	100,000	14	3.400	13,840.96	-	-
华泰证券	20220209000 00848	泰格医药	2022年2月9 日	4,343,208.00	43,800	14	3.400	5,742.66	-	-
华泰证券	20220221000 35753	泰格医药	2022年2月 21日	9,995,000.00	100,000	14	3.400	13,215.58	-	-
华泰证券	20220307000 36696	泰格医药	2022年3月7 日	9,126,000.00	100,000	14	3.400	12,066.60	-	-
华泰证券	20220321000	泰格医药	2022年3月	9,437,000.00	100,000	14	3.400	14,260.32	-	-

	32903		21 日								
华泰证券	20220406000 66101	泰格医药	2022年4月6 日	10,588,000.00	100,000	14	3.400	13,999.72			
华泰证券	20221114000 00759	泰格医药	2022年11月 14日	687,067.00	7,100	14	3.400	908.46			
华泰证券	20221128000 06197	泰格医药	2022年11月 28日	630,977.00	7,100	14	3.400	834.26			
华泰证券	20221212000 38837	泰格医药	2022年12月 12日	644,112.00	7,100	14	3.400	851.62			
华泰证券	20221226000 23715	泰格医药	2022年12月 26日	682,026.00	7,100	14	3.400	322.05	744,080.00		322.05
华泰证券	20220301000 01220	天合光能	2022年3月1 日	3,392,100.00	45,000	14	3.400	4,485.18			
华泰证券	20220303000 00777	天合光能	2022年3月3 日	8,382,000.00	110,000	14	3.400	11,082.82			
华泰证券	20220301000 01222	天合光能	2022年3月1 日	753,800.00	10,000	28	3.400	1,993.32			
华泰证券	20220315000 10183	天合光能	2022年3月 15日	3,199,500.00	45,000	14	3.400	4,230.52			
华泰证券	20220303000 00782	天合光能	2022年3月3 日	9,144,000.00	120,000	28	3.400	24,180.80			
华泰证券	20220317000 04902	天合光能	2022年3月 17日	7,493,200.00	110,000	14	3.400	9,907.66			
华泰证券	20220331000 05962	天合光能	2022年3月 31日	6,479,000.00	110,000	14	3.400	8,566.74			
华泰证券	20220331000 05960	天合光能	2022年3月 31日	7,068,000.00	120,000	28	3.400	18,690.84			
华泰证券	20220414000 06337	天合光能	2022年4月 14日	5,320,700.00	110,000	14	3.400	7,035.14			
华泰证券	20220428000 06890	天合光能	2022年4月 28日	5,346,000.00	110,000	14	3.400	7,068.60			
华泰证券	20220428000 06892	天合光能	2022年4月 28日	5,832,000.00	120,000	28	3.400	15,422.40			
华泰证券	20220512000 08304	天合光能	2022年5月 12日	6,118,200.00	110,000	14	3.400	8,089.62			
华泰证券	20220601000 00871	天合光能	2022年6月1 日	12,899,052.00	212,400	14	3.400	17,055.36			
华泰证券	20220613000 02227	天合光能	2022年6月 13日	3,913,000.00	65,000	14	3.400	5,173.84			
华泰证券	20220615000 22653	天合光能	2022年6月 15日	11,735,100.00	212,400	14	3.400	15,516.48			
华泰证券	20220627000 15382	天合光能	2022年6月 27日	4,386,850.00	65,000	14	3.400	5,800.34			

华泰证券	20220629000 24444	天合光能	2022年6月 29日	14,135,220.00	212,400	14	3.400	18,689.86	-	-
华泰证券	20220711000 18752	天合光能	2022年7月 11日	4,332,250.00	65,000	14	3.400	5,728.24	-	-
华泰证券	20220713000 28878	天合光能	2022年7月 13日	14,804,280.00	212,400	14	3.400	19,574.52	-	-
华泰证券	20220725000 16064	天合光能	2022年7月 25日	4,646,850.00	65,000	14	3.400	6,144.18	-	-
华泰证券	20220727000 27378	天合光能	2022年7月 27日	17,076,960.00	212,400	14	3.400	22,579.48	-	-
华泰证券	20220808000 21819	天合光能	2022年8月8 日	5,135,000.00	65,000	14	3.400	6,789.58	-	-
华泰证券	20220810000 26656	天合光能	2022年8月 10日	17,716,284.00	212,400	14	3.400	23,424.80	-	-
华泰证券	20220822000 19085	天合光能	2022年8月 22日	4,637,100.00	65,000	14	3.400	6,131.30	-	-
华泰证券	20220824000 30665	天合光能	2022年8月 24日	15,080,400.00	212,400	14	3.400	19,939.64	-	-
华泰证券	20220905000 22455	天合光能	2022年9月5 日	4,631,250.00	65,000	14	3.400	6,123.60	-	-
华泰证券	20220907000 30840	天合光能	2022年9月7 日	15,938,496.00	212,400	14	3.400	21,074.20	-	-
华泰证券	20220908000 00495	天合光能	2022年9月8 日	3,006,297.00	40,100	14	3.400	3,975.02	-	-
华泰证券	20220916000 00554	天合光能	2022年9月 16日	1,505,464.00	22,700	14	3.400	1,990.52	-	-
华泰证券	20220919000 19040	天合光能	2022年9月 19日	4,159,350.00	65,000	14	3.400	8,249.43	-	-
华泰证券	20220921000 01014	天合光能	2022年9月 21日	1,940,539.00	29,300	14	3.400	3,482.13	-	-
华泰证券	20220921000 32128	天合光能	2022年9月 21日	14,067,252.00	212,400	14	3.400	25,242.83	-	-
华泰证券	20220922000 10885	天合光能	2022年9月 22日	2,684,294.00	40,100	14	3.400	4,563.36	-	-
华泰证券	20220923000 00330	天合光能	2022年9月 23日	2,692,000.00	40,000	14	3.400	4,322.08	-	-
华泰证券	20220930000 12045	天合光能	2022年9月 30日	1,455,297.00	22,700	14	3.400	1,924.30	-	-
华泰证券	20221010000 84337	天合光能	2022年10月 10日	2,515,072.00	40,100	14	3.400	3,325.42	-	-
华泰证券	20221010000 89777	天合光能	2022年10月 10日	2,508,800.00	40,000	14	3.400	3,317.16	-	-
华泰证券	20221010000	天合光能	2022年10月	4,076,800.00	65,000	14	3.400	5,390.42	-	-

	89801		10 日							
华泰证券	20221010000 93935	天合光能	2022 年 10 月 10 日	13,321,728.00	212,400	14	3.400	17,614.24	-	-
华泰证券	20221014000 10508	天合光能	2022 年 10 月 14 日	1,589,227.00	22,700	14	3.400	2,101.26	-	-
华泰证券	20221024000 77621	天合光能	2022 年 10 月 24 日	2,510,260.00	40,100	14	3.400	3,319.12	-	-
华泰证券	20221024000 88107	天合光能	2022 年 10 月 24 日	2,504,000.00	40,000	14	3.400	3,310.86	-	-
华泰证券	20221024000 91971	天合光能	2022 年 10 月 24 日	4,069,000.00	65,000	14	3.400	5,380.06	-	-
华泰证券	20221024000 93189	天合光能	2022 年 10 月 24 日	13,296,240.00	212,400	14	3.400	17,580.64	-	-
华泰证券	20221028000 00716	天合光能	2022 年 10 月 28 日	1,595,817.00	23,300	14	3.400	2,110.08	-	-
华泰证券	20221028000 12165	天合光能	2022 年 10 月 28 日	1,554,723.00	22,700	14	3.400	2,055.76	-	-
华泰证券	20221107000 84051	天合光能	2022 年 11 月 7 日	15,866,280.00	212,400	14	3.400	20,978.72	-	-
华泰证券	20221107000 87087	天合光能	2022 年 11 月 7 日	2,995,470.00	40,100	14	3.400	3,960.74	-	-
华泰证券	20221107000 87149	天合光能	2022 年 11 月 7 日	2,988,000.00	40,000	14	3.400	3,950.80	-	-
华泰证券	20221107000 89705	天合光能	2022 年 11 月 7 日	4,855,500.00	65,000	14	3.400	6,420.12	-	-
华泰证券	20221111000 14033	天合光能	2022 年 11 月 11 日	1,671,076.00	23,300	14	3.400	2,209.48	-	-
华泰证券	20221111000 14063	天合光能	2022 年 11 月 11 日	1,628,044.00	22,700	14	3.400	2,152.64	-	-
华泰证券	20221114000 00792	天合光能	2022 年 11 月 14 日	3,260,708.00	48,400	14	3.400	4,311.44	-	-
华泰证券	20221121000 76212	天合光能	2022 年 11 月 21 日	4,251,650.00	65,000	14	3.400	5,621.70	-	-
华泰证券	20221121000 78914	天合光能	2022 年 11 月 21 日	2,616,400.00	40,000	14	3.400	3,459.40	-	-
华泰证券	20221121000 78964	天合光能	2022 年 11 月 21 日	2,622,941.00	40,100	14	3.400	3,468.08	-	-
华泰证券	20221125000 09688	天合光能	2022 年 11 月 25 日	1,475,273.00	22,700	14	3.400	1,950.62	-	-
华泰证券	20221125000 09690	天合光能	2022 年 11 月 25 日	1,514,267.00	23,300	14	3.400	2,002.14	-	-
华泰证券	20221128000 06289	天合光能	2022 年 11 月 28 日	3,141,160.00	48,400	14	3.400	4,153.38	-	-

华泰证券	20221205000 25278	天合光能	2022 年 12 月 5 日	2,593,267.00	40,100	14	3.400	3,428.88	-	-
华泰证券	20221205000 25324	天合光能	2022 年 12 月 5 日	2,586,800.00	40,000	14	3.400	3,420.34	-	-
华泰证券	20221209000 05824	天合光能	2022 年 12 月 9 日	1,322,275.00	22,700	14	3.400	1,748.32	-	-
华泰证券	20221209000 05826	天合光能	2022 年 12 月 9 日	1,357,225.00	23,300	14	3.400	1,794.52	-	-
华泰证券	20221212000 38885	天合光能	2022 年 12 月 12 日	2,770,416.00	48,400	14	3.400	3,663.10	-	-
华泰证券	20221219000 22952	天合光能	2022 年 12 月 19 日	2,200,400.00	40,000	14	3.400	2,493.84	2,550,400.00	2,493.84
华泰证券	20221219000 22958	天合光能	2022 年 12 月 19 日	2,205,901.00	40,100	14	3.400	2,500.08	2,556,776.00	2,500.08
华泰证券	20221223000 08508	天合光能	2022 年 12 月 23 日	1,223,303.00	22,700	14	3.400	924.24	1,447,352.00	924.24
华泰证券	20221223000 09064	天合光能	2022 年 12 月 23 日	1,255,637.00	23,300	14	3.400	948.72	1,485,608.00	948.72
华泰证券	20221226000 26711	天合光能	2022 年 12 月 26 日	2,873,024.00	48,400	14	3.400	1,356.70	3,085,984.00	1,356.70
华泰证券	20220105000 09059	同花顺	2022 年 1 月 5 日	2,802,604.00	19,600	14	3.400	3,705.66	-	-
华泰证券	20220420000 00614	同花顺	2022 年 4 月 20 日	1,143,324.00	12,600	14	3.400	1,619.70	-	-
华泰证券	20220505000 70329	同花顺	2022 年 5 月 5 日	1,021,986.00	12,600	14	3.400	1,351.28	-	-
华泰证券	20220519000 45001	同花顺	2022 年 5 月 19 日	1,026,774.00	12,600	14	3.400	1,357.58	-	-
华泰证券	20220602000 16756	同花顺	2022 年 6 月 2 日	1,072,386.00	12,600	14	3.400	1,417.92	-	-
华泰证券	20220616000 15577	同花顺	2022 年 6 月 16 日	1,201,788.00	12,600	14	3.400	1,589.00	-	-
华泰证券	20220615000 01693	同花顺	2022 年 6 月 15 日	180,810.00	1,800	28	3.400	478.24	-	-
华泰证券	20220630000 16009	同花顺	2022 年 6 月 30 日	1,211,490.00	12,600	14	3.400	1,601.88	-	-
华泰证券	20220714000 10708	同花顺	2022 年 7 月 14 日	1,124,550.00	12,600	14	3.400	1,486.94	-	-
华泰证券	20220713000 28860	同花顺	2022 年 7 月 13 日	160,002.00	1,800	28	3.400	423.08	-	-
华泰证券	20220728000 14987	同花顺	2022 年 7 月 28 日	1,103,760.00	12,600	14	3.400	1,459.36	-	-
华泰证券	20220811000	同花顺	2022 年 8 月	1,132,992.00	12,600	14	3.400	1,498.14	-	-

	14256		11 日								
华泰证券	20221026000 00943	同花顺	2022 年 10 月 26 日	1,290,120.00	15,600	14	3.400	1,705.90	-	-	
华泰证券	20221109000 20593	同花顺	2022 年 11 月 9 日	1,377,168.00	15,600	14	3.400	1,820.98	-	-	
华泰证券	20221114000 00722	同花顺	2022 年 11 月 14 日	829,980.00	8,700	14	3.400	1,097.46	-	-	
华泰证券	20221123000 15248	同花顺	2022 年 11 月 23 日	1,460,940.00	15,600	14	3.400	1,931.72	-	-	
华泰证券	20221128000 06273	同花顺	2022 年 11 月 28 日	802,749.00	8,700	14	3.400	1,061.48	-	-	
华泰证券	20221212000 40095	同花顺	2022 年 12 月 12 日	890,706.00	8,700	14	3.400	1,177.68	-	-	
华泰证券	20221226000 23697	同花顺	2022 年 12 月 26 日	865,911.00	8,700	14	3.400	408.90	857,907.00	408.90	
华泰证券	20220104000 23095	温氏股份	2022 年 1 月 4 日	4,888,752.00	236,400	14	3.400	6,464.08	-	-	
华泰证券	20220105000 09057	温氏股份	2022 年 1 月 5 日	1,244,745.00	59,700	28	3.400	3,879.48	-	-	
华泰证券	20220118000 23946	温氏股份	2022 年 1 月 18 日	4,645,260.00	236,400	14	3.400	8,774.40	-	-	
华泰证券	20220207000 46337	温氏股份	2022 年 2 月 7 日	4,881,660.00	236,400	14	3.400	6,454.70	-	-	
华泰证券	20220221000 47351	温氏股份	2022 年 2 月 21 日	4,886,388.00	236,400	14	3.400	6,460.86	-	-	
华泰证券	20220307000 36380	温氏股份	2022 年 3 月 7 日	4,893,480.00	236,400	14	3.400	6,470.24	-	-	
华泰证券	20220321000 32905	温氏股份	2022 年 3 月 21 日	4,978,584.00	236,400	14	3.400	7,523.20	-	-	
华泰证券	20220406000 64091	温氏股份	2022 年 4 月 6 日	5,264,628.00	236,400	14	3.400	6,961.08	-	-	
华泰证券	20220420000 38494	温氏股份	2022 年 4 月 20 日	5,144,064.00	236,400	14	3.400	7,287.45	-	-	
华泰证券	20220530000 00479	温氏股份	2022 年 5 月 30 日	38,852.00	2,200	14	3.400	51.38	-	-	
华泰证券	20220608000 00839	温氏股份	2022 年 6 月 8 日	9,130,000.00	500,000	14	3.400	12,071.92	-	-	
华泰证券	20220622000 13491	温氏股份	2022 年 6 月 22 日	11,005,000.00	500,000	14	3.400	14,551.04	-	-	
华泰证券	20220706000 12559	温氏股份	2022 年 7 月 6 日	11,990,000.00	500,000	14	3.400	15,853.46	-	-	
华泰证券	20220720000 13093	温氏股份	2022 年 7 月 20 日	11,765,000.00	500,000	14	3.400	15,555.96	-	-	

华泰证券	20220803000 12639	温氏股份	2022年8月3 日	11,515,000.00	500,000	14	3.400	15,225.42	-	-
华泰证券	20220104000 23081	沃森生物	2022年1月4 日	616,896.00	11,200	14	3.400	815.64	-	-
华泰证券	20220106000 10085	沃森生物	2022年1月6 日	1,562,896.00	27,400	14	3.400	2,066.54	-	-
华泰证券	20220114000 24080	沃森生物	2022年1月 14日	1,007,600.00	17,600	14	3.400	1,332.24	-	-
华泰证券	20220118000 23962	沃森生物	2022年1月 18日	619,472.00	11,200	14	3.400	1,170.20	-	-
华泰证券	20220120000 09666	沃森生物	2022年1月 20日	1,477,682.00	27,400	14	3.400	2,512.08	-	-
华泰证券	20220207000 43987	沃森生物	2022年2月7 日	1,376,576.00	27,400	14	3.400	1,820.14	-	-
华泰证券	20220207000 49251	沃森生物	2022年2月7 日	562,688.00	11,200	14	3.400	743.96	-	-
华泰证券	20220128000 18804	沃森生物	2022年1月 28日	7,466,180.00	154,900	28	3.400	19,743.92	-	-
华泰证券	20220221000 35757	沃森生物	2022年2月 21日	1,373,562.00	27,400	14	3.400	1,816.22	-	-
华泰证券	20220221000 35761	沃森生物	2022年2月 21日	561,456.00	11,200	14	3.400	742.42	-	-
华泰证券	20220307000 36374	沃森生物	2022年3月7 日	486,304.00	11,200	14	3.400	643.02	-	-
华泰证券	20220307000 36376	沃森生物	2022年3月7 日	1,189,708.00	27,400	14	3.400	1,573.04	-	-
华泰证券	20220321000 35025	沃森生物	2022年3月 21日	1,641,260.00	27,400	14	3.400	2,480.16	-	-
华泰证券	20220321000 35029	沃森生物	2022年3月 21日	670,880.00	11,200	14	3.400	1,013.76	-	-
华泰证券	20220406000 66089	沃森生物	2022年4月6 日	646,800.00	11,200	14	3.400	855.26	-	-
华泰证券	20220406000 66091	沃森生物	2022年4月6 日	1,582,350.00	27,400	14	3.400	2,092.16	-	-
华泰证券	20220420000 46432	沃森生物	2022年4月 20日	1,563,992.00	27,400	14	3.400	2,215.65	-	-
华泰证券	20220420000 46436	沃森生物	2022年4月 20日	639,296.00	11,200	14	3.400	905.70	-	-
华泰证券	20220505000 70291	沃森生物	2022年5月5 日	1,413,292.00	27,400	14	3.400	1,868.72	-	-
华泰证券	20220505000 70305	沃森生物	2022年5月5 日	577,696.00	11,200	14	3.400	763.84	-	-
华泰证券	20221114000	沃森生物	2022年11月	3,469,455.00	81,500	14	3.400	4,587.38	-	-

	00766		14日								
华泰证券	20221128000 06247	沃森生物	2022年11月 28日	3,537,915.00	81,500	14	3.400	4,677.96			
华泰证券	20221212000 40097	沃森生物	2022年12月 12日	3,270,595.00	81,500	14	3.400	4,324.46			
华泰证券	20221226000 23703	沃森生物	2022年12月 26日	3,242,885.00	81,500	14	3.400	1,531.35	3,275,485. 00	1,531.35	
华泰证券	20220118000 00728	先导智能	2022年1月 18日	133,740.00	1,800	14	3.400	252.60			
华泰证券	20220208000 01023	先导智能	2022年2月8 日	84,344.00	1,300	14	3.400	111.58			
华泰证券	20220209000 00842	先导智能	2022年2月9 日	4,852,680.00	76,300	14	3.400	6,416.34			
华泰证券	20220223000 13530	先导智能	2022年2月 23日	4,897,697.00	76,300	14	3.400	6,475.84			
华泰证券	20220309000 15781	先导智能	2022年3月9 日	4,191,922.00	76,300	14	3.400	5,542.60			
华泰证券	20220323000 12491	先导智能	2022年3月 23日	4,619,202.00	76,300	14	3.400	6,107.64			
华泰证券	20220406000 66097	先导智能	2022年4月6 日	4,129,356.00	76,300	14	3.400	5,460.00			
华泰证券	20220420000 38866	先导智能	2022年4月 20日	3,578,470.00	76,300	14	3.400	5,069.55			
华泰证券	20220505000 70351	先导智能	2022年5月5 日	3,409,084.00	76,300	14	3.400	4,507.58			
华泰证券	20220519000 44985	先导智能	2022年5月 19日	3,740,226.00	76,300	14	3.400	4,945.36			
华泰证券	20220602000 22094	先导智能	2022年6月2 日	3,918,005.00	76,300	14	3.400	5,180.42			
华泰证券	20220616000 14943	先导智能	2022年6月 16日	4,693,213.00	76,300	14	3.400	6,205.50			
华泰证券	20220630000 16007	先导智能	2022年6月 30日	4,820,634.00	76,300	14	3.400	6,373.92			
华泰证券	20220714000 14478	先导智能	2022年7月 14日	4,806,900.00	76,300	14	3.400	6,355.86			
华泰证券	20221114000 00678	先导智能	2022年11月 14日	1,036,010.00	21,100	14	3.400	1,369.90			
华泰证券	20221121000 00918	先导智能	2022年11月 21日	3,158,708.00	67,900	14	3.400	4,176.48			
华泰证券	20221125000 00558	先导智能	2022年11月 25日	87,540.00	2,000	14	3.400	115.78			
华泰证券	20221128000 06207	先导智能	2022年11月 28日	917,639.00	21,100	14	3.400	1,213.38			

华泰证券	20221129000 00604	先导智能	2022 年 11 月 29 日	174,920.00	4,000	14	3.400	231.28	-	-
华泰证券	20221130000 00690	先导智能	2022 年 11 月 30 日	43,760.00	1,000	14	3.400	57.82	-	-
华泰证券	20221205000 26180	先导智能	2022 年 12 月 5 日	2,906,120.00	67,900	14	3.400	3,842.58	-	-
华泰证券	20221209000 06850	先导智能	2022 年 12 月 9 日	84,080.00	2,000	14	3.400	111.16	-	-
华泰证券	20221212000 38843	先导智能	2022 年 12 月 12 日	900,548.00	21,100	14	3.400	1,190.70	-	-
华泰证券	20221213000 12861	先导智能	2022 年 12 月 13 日	164,600.00	4,000	14	3.400	217.70	-	-
华泰证券	20221214000 26664	先导智能	2022 年 12 月 14 日	41,100.00	1,000	14	3.400	54.32	-	-
华泰证券	20221219000 19288	先导智能	2022 年 12 月 19 日	2,859,948.00	67,900	14	3.400	3,241.32	2,732,975.00	3,241.32
华泰证券	20221223000 09070	先导智能	2022 年 12 月 23 日	79,260.00	2,000	14	3.400	59.92	80,500.00	59.92
华泰证券	20221226000 26235	先导智能	2022 年 12 月 26 日	869,109.00	21,100	14	3.400	410.40	849,275.00	410.40
华泰证券	20221227000 12179	先导智能	2022 年 12 月 27 日	166,040.00	4,000	14	3.400	62.72	161,000.00	62.72
华泰证券	20221228000 30093	先导智能	2022 年 12 月 28 日	40,510.00	1,000	14	3.400	11.49	40,250.00	11.49
华泰证券	20220901000 00776	欣旺达	2022 年 9 月 1 日	277,680.00	10,400	14	3.400	367.22	-	-
华泰证券	20220913000 00692	欣旺达	2022 年 9 月 13 日	162,120.00	6,000	14	3.400	214.34	-	-
华泰证券	20220914000 00730	欣旺达	2022 年 9 月 14 日	156,540.00	6,000	14	3.400	206.92	-	-
华泰证券	20220915000 00663	欣旺达	2022 年 9 月 15 日	223,110.00	9,000	14	3.400	294.98	-	-
华泰证券	20220915000 14191	欣旺达	2022 年 9 月 15 日	257,816.00	10,400	14	3.400	340.90	-	-
华泰证券	20220916000 00546	欣旺达	2022 年 9 月 16 日	341,460.00	14,000	14	3.400	451.50	-	-
华泰证券	20220919000 00827	欣旺达	2022 年 9 月 19 日	294,960.00	12,000	14	3.400	585.06	-	-
华泰证券	20220921000 01008	欣旺达	2022 年 9 月 21 日	204,400.00	8,000	14	3.400	366.70	-	-
华泰证券	20220923000 00324	欣旺达	2022 年 9 月 23 日	185,347.00	7,300	14	3.400	297.67	-	-
华泰证券	20220926000	欣旺达	2022 年 9 月	325,650.00	13,000	14	3.400	430.64	-	-

	00472		26 日								
华泰证券	20220927000 00452	欣旺达	2022 年 9 月 27 日	688,506.00	27,300	14	3.400	910.42	-	-	
华泰证券	20220927000 23683	欣旺达	2022 年 9 月 27 日	151,320.00	6,000	14	3.400	200.06	-	-	
华泰证券	20220928000 00513	欣旺达	2022 年 9 月 28 日	96,000.00	4,000	14	3.400	126.98	-	-	
华泰证券	20220928000 15591	欣旺达	2022 年 9 月 28 日	144,000.00	6,000	14	3.400	190.40	-	-	
华泰证券	20220929000 14701	欣旺达	2022 年 9 月 29 日	249,704.00	10,400	14	3.400	330.12	-	-	
华泰证券	20220929000 14773	欣旺达	2022 年 9 月 29 日	216,090.00	9,000	14	3.400	285.74	-	-	
华泰证券	20220930000 12037	欣旺达	2022 年 9 月 30 日	325,920.00	14,000	14	3.400	430.92	-	-	
华泰证券	20221010000 01007	欣旺达	2022 年 10 月 10 日	363,520.00	16,000	14	3.400	480.62	-	-	
华泰证券	20221010000 80137	欣旺达	2022 年 10 月 10 日	295,360.00	13,000	14	3.400	390.60	-	-	
华泰证券	20221010000 89737	欣旺达	2022 年 10 月 10 日	165,856.00	7,300	14	3.400	219.24	-	-	
华泰证券	20221010000 89797	欣旺达	2022 年 10 月 10 日	181,760.00	8,000	14	3.400	240.38	-	-	
华泰证券	20221010000 89799	欣旺达	2022 年 10 月 10 日	272,640.00	12,000	14	3.400	360.50	-	-	
华泰证券	20221011000 01950	欣旺达	2022 年 10 月 11 日	256,300.00	11,000	14	3.400	338.94	-	-	
华泰证券	20221011000 24567	欣旺达	2022 年 10 月 11 日	139,800.00	6,000	14	3.400	184.80	-	-	
华泰证券	20221011000 28809	欣旺达	2022 年 10 月 11 日	636,090.00	27,300	14	3.400	841.12	-	-	
华泰证券	20221012000 00827	欣旺达	2022 年 10 月 12 日	246,500.00	10,000	14	3.400	325.92	-	-	
华泰证券	20221012000 16988	欣旺达	2022 年 10 月 12 日	98,600.00	4,000	14	3.400	130.34	-	-	
华泰证券	20221012000 17056	欣旺达	2022 年 10 月 12 日	147,900.00	6,000	14	3.400	195.58	-	-	
华泰证券	20221013000 00703	欣旺达	2022 年 10 月 13 日	48,660.00	2,000	14	3.400	64.40	-	-	
华泰证券	20221013000 16094	欣旺达	2022 年 10 月 13 日	253,032.00	10,400	14	3.400	334.60	-	-	
华泰证券	20221013000 16096	欣旺达	2022 年 10 月 13 日	218,970.00	9,000	14	3.400	289.52	-	-	

华泰证券	20221014000 00578	欣旺达	2022年10月 14日	25,100.00	1,000	14	3.400	33.18	-	-
华泰证券	20221014000 10020	欣旺达	2022年10月 14日	351,400.00	14,000	14	3.400	464.66	-	-
华泰证券	20221020000 00625	欣旺达	2022年10月 20日	1,255,000.00	50,000	14	3.400	1,659.42	-	-
华泰证券	20221024000 86393	欣旺达	2022年10月 24日	315,900.00	13,000	14	3.400	417.76	-	-
华泰证券	20221024000 86473	欣旺达	2022年10月 24日	388,800.00	16,000	14	3.400	514.08	-	-
华泰证券	20221024000 88139	欣旺达	2022年10月 24日	194,400.00	8,000	14	3.400	257.04	-	-
华泰证券	20221024000 88169	欣旺达	2022年10月 24日	177,390.00	7,300	14	3.400	234.50	-	-
华泰证券	20221024000 89507	欣旺达	2022年10月 24日	291,600.00	12,000	14	3.400	385.56	-	-
华泰证券	20221025000 22776	欣旺达	2022年10月 25日	269,610.00	11,000	14	3.400	356.44	-	-
华泰证券	20221025000 22882	欣旺达	2022年10月 25日	669,123.00	27,300	14	3.400	884.80	-	-
华泰证券	20221025000 27042	欣旺达	2022年10月 25日	147,060.00	6,000	14	3.400	194.46	-	-
华泰证券	20221026000 17902	欣旺达	2022年10月 26日	150,780.00	6,000	14	3.400	199.36	-	-
华泰证券	20221026000 17904	欣旺达	2022年10月 26日	100,520.00	4,000	14	3.400	132.86	-	-
华泰证券	20221026000 17948	欣旺达	2022年10月 26日	251,300.00	10,000	14	3.400	332.22	-	-
华泰证券	20221027000 14583	欣旺达	2022年10月 27日	49,400.00	2,000	14	3.400	65.38	-	-
华泰证券	20221027000 14631	欣旺达	2022年10月 27日	256,880.00	10,400	14	3.400	339.64	-	-
华泰证券	20221027000 14633	欣旺达	2022年10月 27日	222,300.00	9,000	14	3.400	294.00	-	-
华泰证券	20221028000 12039	欣旺达	2022年10月 28日	23,160.00	1,000	14	3.400	30.66	-	-
华泰证券	20221028000 12143	欣旺达	2022年10月 28日	324,240.00	14,000	14	3.400	428.68	-	-
华泰证券	20221103000 06143	欣旺达	2022年11月 3日	1,265,000.00	50,000	14	3.400	1,672.58	-	-
华泰证券	20221107000 00502	欣旺达	2022年11月 7日	317,640.00	12,000	14	3.400	420.00	-	-
华泰证券	20221107000	欣旺达	2022年11月	211,760.00	8,000	14	3.400	280.00	-	-

	87147		7 日								
华泰证券	20221107000 87257	欣旺达	2022 年 11 月 7 日	423,520.00	16,000	14	3.400	560.00			
华泰证券	20221107000 89649	欣旺达	2022 年 11 月 7 日	193,231.00	7,300	14	3.400	255.50			
华泰证券	20221107000 89693	欣旺达	2022 年 11 月 7 日	344,110.00	13,000	14	3.400	455.00			
华泰证券	20221107000 89703	欣旺达	2022 年 11 月 7 日	317,640.00	12,000	14	3.400	420.00			
华泰证券	20221108000 00850	欣旺达	2022 年 11 月 8 日	51,660.00	2,000	14	3.400	68.32			
华泰证券	20221108000 23547	欣旺达	2022 年 11 月 8 日	154,980.00	6,000	14	3.400	204.96			
华泰证券	20221108000 23551	欣旺达	2022 年 11 月 8 日	705,159.00	27,300	14	3.400	932.40			
华泰证券	20221108000 23615	欣旺达	2022 年 11 月 8 日	284,130.00	11,000	14	3.400	375.62			
华泰证券	20221109000 00524	欣旺达	2022 年 11 月 9 日	509,200.00	20,000	14	3.400	673.26			
华泰证券	20221109000 20545	欣旺达	2022 年 11 月 9 日	152,760.00	6,000	14	3.400	202.02			
华泰证券	20221109000 20547	欣旺达	2022 年 11 月 9 日	101,840.00	4,000	14	3.400	134.68			
华泰证券	20221109000 20555	欣旺达	2022 年 11 月 9 日	254,600.00	10,000	14	3.400	336.70			
华泰证券	20221110000 00788	欣旺达	2022 年 11 月 10 日	99,080.00	4,000	14	3.400	131.04			
华泰证券	20221110000 20266	欣旺达	2022 年 11 月 10 日	49,540.00	2,000	14	3.400	65.52			
华泰证券	20221110000 20268	欣旺达	2022 年 11 月 10 日	257,608.00	10,400	14	3.400	340.62			
华泰证券	20221110000 20270	欣旺达	2022 年 11 月 10 日	222,930.00	9,000	14	3.400	294.70			
华泰证券	20221111000 13061	欣旺达	2022 年 11 月 11 日	363,440.00	14,000	14	3.400	480.62			
华泰证券	20221111000 13129	欣旺达	2022 年 11 月 11 日	25,960.00	1,000	14	3.400	34.30			
华泰证券	20221114000 00768	欣旺达	2022 年 11 月 14 日	1,571,829.00	62,300	14	3.400	2,078.30			
华泰证券	20221117000 07152	欣旺达	2022 年 11 月 17 日	1,227,000.00	50,000	14	3.400	1,622.32			
华泰证券	20221121000 66858	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	197,520.00	8,000	14	3.400	261.24			

华泰证券	20221121000 66864	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	296,280.00	12,000	14	3.400	391.72	-	-
华泰证券	20221121000 66926	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	395,040.00	16,000	14	3.400	522.34	-	-
华泰证券	20221121000 66978	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	180,237.00	7,300	14	3.400	238.28	-	-
华泰证券	20221121000 68280	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	296,280.00	12,000	14	3.400	391.72	-	-
华泰证券	20221121000 79386	欣旺达	2022 年 11 月 21 日	320,970.00	13,000	14	3.400	424.34	-	-
华泰证券	20221122000 18795	欣旺达	2022 年 11 月 22 日	48,480.00	2,000	14	3.400	64.12	-	-
华泰证券	20221122000 18921	欣旺达	2022 年 11 月 22 日	266,640.00	11,000	14	3.400	352.52	-	-
华泰证券	20221122000 18923	欣旺达	2022 年 11 月 22 日	145,440.00	6,000	14	3.400	192.36	-	-
华泰证券	20221122000 18925	欣旺达	2022 年 11 月 22 日	661,752.00	27,300	14	3.400	875.00	-	-
华泰证券	20221123000 15878	欣旺达	2022 年 11 月 23 日	242,700.00	10,000	14	3.400	320.88	-	-
华泰证券	20221123000 16000	欣旺达	2022 年 11 月 23 日	485,400.00	20,000	14	3.400	641.76	-	-
华泰证券	20221123000 16032	欣旺达	2022 年 11 月 23 日	145,620.00	6,000	14	3.400	192.50	-	-
华泰证券	20221123000 16034	欣旺达	2022 年 11 月 23 日	97,080.00	4,000	14	3.400	128.38	-	-
华泰证券	20221124000 16448	欣旺达	2022 年 11 月 24 日	219,510.00	9,000	14	3.400	290.22	-	-
华泰证券	20221124000 16480	欣旺达	2022 年 11 月 24 日	97,560.00	4,000	14	3.400	128.94	-	-
华泰证券	20221124000 16646	欣旺达	2022 年 11 月 24 日	48,780.00	2,000	14	3.400	64.54	-	-
华泰证券	20221124000 16648	欣旺达	2022 年 11 月 24 日	253,656.00	10,400	14	3.400	335.44	-	-
华泰证券	20221125000 09668	欣旺达	2022 年 11 月 25 日	334,740.00	14,000	14	3.400	442.54	-	-
华泰证券	20221125000 09670	欣旺达	2022 年 11 月 25 日	23,910.00	1,000	14	3.400	31.64	-	-
华泰证券	20221128000 06215	欣旺达	2022 年 11 月 28 日	1,475,887.00	62,300	14	3.400	1,951.46	-	-
华泰证券	20221201000 08710	欣旺达	2022 年 12 月 1 日	1,211,000.00	50,000	14	3.400	1,601.18	-	-
华泰证券	20221205000	欣旺达	2022 年 12 月	287,040.00	12,000	14	3.400	379.54	-	-

	20686		5 日								
华泰证券	20221205000 20732	欣旺达	2022 年 12 月 5 日	382,720.00	16,000	14	3.400	506.10	-	-	
华泰证券	20221205000 20740	欣旺达	2022 年 12 月 5 日	174,616.00	7,300	14	3.400	230.86	-	-	
华泰证券	20221205000 20822	欣旺达	2022 年 12 月 5 日	191,360.00	8,000	14	3.400	252.98	-	-	
华泰证券	20221205000 26524	欣旺达	2022 年 12 月 5 日	287,040.00	12,000	14	3.400	379.54	-	-	
华泰证券	20221205000 26576	欣旺达	2022 年 12 月 5 日	310,960.00	13,000	14	3.400	411.18	-	-	
华泰证券	20221206000 11676	欣旺达	2022 年 12 月 6 日	266,310.00	11,000	14	3.400	352.10	-	-	
华泰证券	20221206000 11678	欣旺达	2022 年 12 月 6 日	145,260.00	6,000	14	3.400	192.08	-	-	
华泰证券	20221206000 11680	欣旺达	2022 年 12 月 6 日	660,933.00	27,300	14	3.400	873.88	-	-	
华泰证券	20221206000 11682	欣旺达	2022 年 12 月 6 日	48,420.00	2,000	14	3.400	63.98	-	-	
华泰证券	20221207000 13730	欣旺达	2022 年 12 月 7 日	493,400.00	20,000	14	3.400	652.40	-	-	
华泰证券	20221207000 13732	欣旺达	2022 年 12 月 7 日	148,020.00	6,000	14	3.400	195.72	-	-	
华泰证券	20221207000 13734	欣旺达	2022 年 12 月 7 日	98,680.00	4,000	14	3.400	130.48	-	-	
华泰证券	20221207000 13736	欣旺达	2022 年 12 月 7 日	246,700.00	10,000	14	3.400	326.20	-	-	
华泰证券	20221208000 11155	欣旺达	2022 年 12 月 8 日	220,950.00	9,000	14	3.400	292.18	-	-	
华泰证券	20221208000 11157	欣旺达	2022 年 12 月 8 日	98,200.00	4,000	14	3.400	129.78	-	-	
华泰证券	20221208000 11159	欣旺达	2022 年 12 月 8 日	49,100.00	2,000	14	3.400	64.96	-	-	
华泰证券	20221208000 11161	欣旺达	2022 年 12 月 8 日	255,320.00	10,400	14	3.400	337.54	-	-	
华泰证券	20221209000 06938	欣旺达	2022 年 12 月 9 日	340,760.00	14,000	14	3.400	450.52	-	-	
华泰证券	20221209000 06940	欣旺达	2022 年 12 月 9 日	24,340.00	1,000	14	3.400	32.20	-	-	
华泰证券	20221212000 38835	欣旺达	2022 年 12 月 12 日	1,502,053.00	62,300	14	3.400	1,986.04	-	-	
华泰证券	20221215000 02495	欣旺达	2022 年 12 月 15 日	593,750.00	25,000	14	3.400	785.12	-	-	

华泰证券	20221215000 12335	欣旺达	2022 年 12 月 15 日	1,187,500.00	50,000	14	3.400	1,570.10	-	-
华泰证券	20221219000 19250	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	279,840.00	12,000	14	3.400	317.16	253,800.00	317.16
华泰证券	20221219000 19252	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	303,160.00	13,000	14	3.400	343.56	274,950.00	343.56
华泰证券	20221219000 19254	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	279,840.00	12,000	14	3.400	317.16	253,800.00	317.16
华泰证券	20221219000 19256	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	170,236.00	7,300	14	3.400	192.96	154,395.00	192.96
华泰证券	20221219000 19258	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	186,560.00	8,000	14	3.400	211.44	169,200.00	211.44
华泰证券	20221219000 19260	欣旺达	2022 年 12 月 19 日	373,120.00	16,000	14	3.400	422.88	338,400.00	422.88
华泰证券	20221220000 19440	欣旺达	2022 年 12 月 20 日	250,470.00	11,000	14	3.400	260.26	232,650.00	260.26
华泰证券	20221220000 19442	欣旺达	2022 年 12 月 20 日	136,620.00	6,000	14	3.400	141.90	126,900.00	141.90
华泰证券	20221220000 19444	欣旺达	2022 年 12 月 20 日	621,621.00	27,300	14	3.400	645.81	577,395.00	645.81
华泰证券	20221220000 19446	欣旺达	2022 年 12 月 20 日	45,540.00	2,000	14	3.400	47.30	42,300.00	47.30
华泰证券	20221221000 20101	欣旺达	2022 年 12 月 21 日	446,000.00	20,000	14	3.400	421.20	423,000.00	421.20
华泰证券	20221221000 20103	欣旺达	2022 年 12 月 21 日	133,800.00	6,000	14	3.400	126.40	126,900.00	126.40
华泰证券	20221221000 20105	欣旺达	2022 年 12 月 21 日	89,200.00	4,000	14	3.400	84.20	84,600.00	84.20
华泰证券	20221221000 20107	欣旺达	2022 年 12 月 21 日	223,000.00	10,000	14	3.400	210.60	211,500.00	210.60
华泰证券	20221222000 13983	欣旺达	2022 年 12 月 22 日	197,280.00	9,000	14	3.400	167.67	190,350.00	167.67
华泰证券	20221222000 13985	欣旺达	2022 年 12 月 22 日	87,680.00	4,000	14	3.400	74.52	84,600.00	74.52
华泰证券	20221222000 13987	欣旺达	2022 年 12 月 22 日	43,840.00	2,000	14	3.400	37.26	42,300.00	37.26
华泰证券	20221222000 13989	欣旺达	2022 年 12 月 22 日	227,968.00	10,400	14	3.400	193.77	219,960.00	193.77
华泰证券	20221223000 08550	欣旺达	2022 年 12 月 23 日	307,300.00	14,000	14	3.400	232.16	296,100.00	232.16
华泰证券	20221223000 08552	欣旺达	2022 年 12 月 23 日	21,950.00	1,000	14	3.400	16.56	21,150.00	16.56
华泰证券	20221226000	欣旺达	2022 年 12 月	1,729,420.00	77,000	14	3.400	816.65	1,628,550.	816.65

	01184		26 日						00	
华泰证券	20221226000 23709	欣旺达	2022 年 12 月 26 日	1,399,258.00	62,300	14	3.400	660.75	1,317,645. 00	660.75
华泰证券	20221227000 00485	欣旺达	2022 年 12 月 27 日	175,040.00	8,000	14	3.400	66.12	169,200.00	66.12
华泰证券	20221229000 00827	欣旺达	2022 年 12 月 29 日	21,310.00	1,000	14	3.400	4.02	21,150.00	4.02
华泰证券	20221229000 11247	欣旺达	2022 年 12 月 29 日	1,065,500.00	50,000	14	3.400	201.26	1,057,500. 00	201.26
华泰证券	20221229000 11261	欣旺达	2022 年 12 月 29 日	532,750.00	25,000	14	3.400	100.64	528,750.00	100.64
华泰证券	20221230000 00547	欣旺达	2022 年 12 月 30 日	63,450.00	3,000	14	3.400	5.99	63,450.00	5.99
华泰证券	20220105000 09055	阳光电源	2022 年 1 月 5 日	1,083,600.00	8,400	14	3.400	1,432.76	-	-
华泰证券	20220112000 00558	阳光电源	2022 年 1 月 12 日	2,384,310.00	19,000	14	3.400	3,152.66	-	-
华泰证券	20220119000 09869	阳光电源	2022 年 1 月 19 日	1,013,964.00	8,400	14	3.400	1,819.44	-	-
华泰证券	20220126000 10786	阳光电源	2022 年 1 月 26 日	2,459,550.00	19,000	14	3.400	3,252.06	-	-
华泰证券	20220117000 02563	阳光电源	2022 年 1 月 17 日	5,075,290.00	40,700	28	3.400	13,421.24	-	-
华泰证券	20220207000 43945	阳光电源	2022 年 2 月 7 日	948,276.00	8,400	14	3.400	1,253.84	-	-
华泰证券	20220209000 16390	阳光电源	2022 年 2 月 9 日	2,033,950.00	19,000	14	3.400	2,689.40	-	-
华泰证券	20220221000 47307	阳光电源	2022 年 2 月 21 日	890,820.00	8,400	14	3.400	1,177.82	-	-
华泰证券	20220214000 03324	阳光电源	2022 年 2 月 14 日	3,890,106.00	40,700	28	3.400	10,287.20	-	-
华泰证券	20220307000 36386	阳光电源	2022 年 3 月 7 日	1,040,928.00	8,400	14	3.400	1,376.34	-	-
华泰证券	20220629000 01182	阳光电源	2022 年 6 月 29 日	8,832,390.00	95,900	14	3.400	11,678.38	-	-
华泰证券	20220704000 00473	阳光电源	2022 年 7 月 4 日	4,863,014.00	52,100	14	3.400	6,430.06	-	-
华泰证券	20220708000 00556	阳光电源	2022 年 7 月 8 日	4,577,100.00	43,800	14	3.400	6,051.92	-	-
华泰证券	20220713000 26090	阳光电源	2022 年 7 月 13 日	11,076,450.00	95,900	14	3.400	14,645.54	-	-
华泰证券	20220718000 16107	阳光电源	2022 年 7 月 18 日	6,593,776.00	52,100	14	3.400	8,718.50	-	-

华泰证券	20220722000 07483	阳光电源	2022年7月 22日	5,003,274.00	43,800	14	3.400	6,615.42	-	-
华泰证券	20220727000 25986	阳光电源	2022年7月 27日	11,484,025.00	95,900	14	3.400	15,184.40	-	-
华泰证券	20220801000 13007	阳光电源	2022年8月1 日	6,670,884.00	52,100	14	3.400	8,820.42	-	-
华泰证券	20220805000 08723	阳光电源	2022年8月5 日	5,054,520.00	43,800	14	3.400	6,683.18	-	-
华泰证券	20220810000 26584	阳光电源	2022年8月 10日	12,351,920.00	95,900	14	3.400	16,331.98	-	-
华泰证券	20220815000 17195	阳光电源	2022年8月 15日	6,824,058.00	52,100	14	3.400	9,022.86	-	-
华泰证券	20220824000 30881	阳光电源	2022年8月 24日	13,098,022.00	95,900	14	3.400	17,318.56	-	-
华泰证券	20220829000 18233	阳光电源	2022年8月 29日	6,885,015.00	52,100	14	3.400	9,753.75	-	-
华泰证券	20220907000 30262	阳光电源	2022年9月7 日	11,715,144.00	95,900	14	3.400	15,490.02	-	-
华泰证券	20220913000 25307	阳光电源	2022年9月 13日	6,166,556.00	52,100	14	3.400	8,153.60	-	-
华泰证券	20220921000 31868	阳光电源	2022年9月 21日	10,817,520.00	95,900	14	3.400	19,411.54	-	-
华泰证券	20220929000 00401	阳光电源	2022年9月 29日	1,248,500.00	11,000	14	3.400	1,650.74	-	-
华泰证券	20221010000 86343	阳光电源	2022年10月 10日	10,782,037.00	95,900	14	3.400	14,256.20	-	-
华泰证券	20221019000 00593	阳光电源	2022年10月 19日	2,672,460.00	20,200	14	3.400	3,533.60	-	-
华泰证券	20221021000 00597	阳光电源	2022年10月 21日	3,405,342.00	25,800	14	3.400	4,502.68	-	-
华泰证券	20221024000 86485	阳光电源	2022年10月 24日	12,083,400.00	95,900	14	3.400	15,976.94	-	-
华泰证券	20221028000 00730	阳光电源	2022年10月 28日	5,100,635.00	39,500	14	3.400	6,744.22	-	-
华泰证券	20221102000 10102	阳光电源	2022年11月 2日	2,688,216.00	20,200	14	3.400	3,554.46	-	-
华泰证券	20221104000 00423	阳光电源	2022年11月 4日	13,675,140.00	98,100	14	3.400	18,081.56	-	-
华泰证券	20221104000 07181	阳光电源	2022年11月 4日	3,596,520.00	25,800	14	3.400	4,755.38	-	-
华泰证券	20221107000 84013	阳光电源	2022年11月 7日	12,856,354.00	95,900	14	3.400	16,998.94	-	-
华泰证券	20221108000	阳光电源	2022年11月	6,767,250.00	52,500	14	3.400	8,947.82	-	-

	00852		8 日								
华泰证券	20221111000 13031	阳光电源	2022 年 11 月 11 日	4,881,015.00	39,500	14	3.400	6,453.86	-	-	
华泰证券	20221114000 00764	阳光电源	2022 年 11 月 14 日	13,462,956.00	116,100	14	3.400	17,801.00	-	-	
华泰证券	20221118000 10842	阳光电源	2022 年 11 月 18 日	11,270,709.00	98,100	14	3.400	14,902.44	-	-	
华泰证券	20221118000 11058	阳光电源	2022 年 11 月 18 日	2,964,162.00	25,800	14	3.400	3,919.30	-	-	
华泰证券	20221121000 78972	阳光电源	2022 年 11 月 21 日	11,009,320.00	95,900	14	3.400	14,556.78	-	-	
华泰证券	20221122000 18815	阳光电源	2022 年 11 月 22 日	5,821,200.00	52,500	14	3.400	7,696.92	-	-	
华泰证券	20221125000 09680	阳光电源	2022 年 11 月 25 日	4,498,655.00	39,500	14	3.400	5,948.18	-	-	
华泰证券	20221128000 06227	阳光电源	2022 年 11 月 28 日	13,573,251.00	116,100	14	3.400	17,946.88	-	-	
华泰证券	20221202000 05908	阳光电源	2022 年 12 月 2 日	3,098,322.00	25,800	14	3.400	4,096.68	-	-	
华泰证券	20221202000 07896	阳光电源	2022 年 12 月 2 日	11,780,829.00	98,100	14	3.400	15,576.82	-	-	
华泰证券	20221205000 19260	阳光电源	2022 年 12 月 5 日	10,412,822.00	95,900	14	3.400	13,768.02	-	-	
华泰证券	20221206000 11550	阳光电源	2022 年 12 月 6 日	5,534,025.00	52,500	14	3.400	7,317.24	-	-	
华泰证券	20221209000 06932	阳光电源	2022 年 12 月 9 日	4,218,600.00	39,500	14	3.400	5,577.88	-	-	
华泰证券	20221212000 40099	阳光电源	2022 年 12 月 12 日	12,181,212.00	116,100	14	3.400	16,106.30	-	-	
华泰证券	20221216000 11401	阳光电源	2022 年 12 月 16 日	2,528,400.00	25,800	14	3.400	3,343.06	-	-	
华泰证券	20221216000 11497	阳光电源	2022 年 12 月 16 日	9,613,800.00	98,100	14	3.400	12,711.58	-	-	
华泰证券	20221220000 19482	阳光电源	2022 年 12 月 20 日	5,100,375.00	52,500	14	3.400	5,298.70	5,869,500.00	5,298.70	
华泰证券	20221223000 08548	阳光电源	2022 年 12 月 23 日	3,616,620.00	39,500	14	3.400	2,732.56	4,416,100.00	2,732.56	
华泰证券	20221226000 26233	阳光电源	2022 年 12 月 26 日	11,781,828.00	116,100	14	3.400	5,563.65	12,979,980.00	5,563.65	
华泰证券	20221230000 12057	阳光电源	2022 年 12 月 30 日	10,967,580.00	98,100	14	3.400	1,035.83	10,967,580.00	1,035.83	
华泰证券	20220713000 00508	阳光电源	2022 年 7 月 13 日	231,000.00	2,000	14	3.400	305.48	-	-	

华泰证券	20220727000 25988	阳光电源	2022年7月 27日	239,500.00	2,000	14	3.400	316.68	-	-
华泰证券	20220810000 26586	阳光电源	2022年8月 10日	257,600.00	2,000	14	3.400	340.62	-	-
华泰证券	20220824000 30883	阳光电源	2022年8月 24日	273,160.00	2,000	14	3.400	361.20	-	-
华泰证券	20220907000 30264	阳光电源	2022年9月7 日	244,320.00	2,000	14	3.400	323.12	-	-
华泰证券	20220921000 31870	阳光电源	2022年9月 21日	225,600.00	2,000	14	3.400	404.89	-	-
华泰证券	20221010000 86345	阳光电源	2022年10月 10日	224,860.00	2,000	14	3.400	297.36	-	-
华泰证券	20221024000 86487	阳光电源	2022年10月 24日	252,000.00	2,000	14	3.400	333.20	-	-
华泰证券	20221107000 84015	阳光电源	2022年11月 7日	268,120.00	2,000	14	3.400	354.48	-	-
华泰证券	20221121000 78974	阳光电源	2022年11月 21日	229,600.00	2,000	14	3.400	303.52	-	-
华泰证券	20221205000 19262	阳光电源	2022年12月 5日	217,160.00	2,000	14	3.400	287.14	-	-
华泰证券	20221219000 19224	阳光电源	2022年12月 19日	194,620.00	2,000	14	3.400	220.56	223,600.00	220.56
华泰证券	20220615000 01692	亿联网络	2022年6月 15日	2,865,240.00	37,800	14	3.400	3,788.54	-	-
华泰证券	20220816000 00571	亿联网络	2022年8月 16日	2,470,272.00	33,600	14	3.400	3,266.20	-	-
华泰证券	20220830000 12452	亿联网络	2022年8月 30日	2,368,128.00	33,600	14	3.400	3,131.24	-	-
华泰证券	20220913000 24531	亿联网络	2022年9月 13日	2,450,448.00	33,600	14	3.400	3,240.02	-	-
华泰证券	20220927000 21947	亿联网络	2022年9月 27日	2,171,904.00	33,600	14	3.400	2,871.68	-	-
华泰证券	20221011000 29535	亿联网络	2022年10月 11日	2,068,416.00	33,600	14	3.400	2,734.90	-	-
华泰证券	20221025000 29678	亿联网络	2022年10月 25日	2,202,480.00	33,600	14	3.400	2,912.14	-	-
华泰证券	20221108000 21359	亿联网络	2022年11月 8日	2,289,840.00	33,600	14	3.400	3,027.64	-	-
华泰证券	20221114000 00700	亿联网络	2022年11月 14日	67,770.00	1,000	14	3.400	89.60	-	-
华泰证券	20221122000 18831	亿联网络	2022年11月 22日	2,249,856.00	33,600	14	3.400	2,974.86	-	-
华泰证券	20221128000	亿联网络	2022年11月	64,170.00	1,000	14	3.400	84.84	-	-

	06237		28 日								
华泰证券	20221206000 13906	亿联网络	2022 年 12 月 6 日	2,140,656.00	33,600	14	3.400	2,830.38	-	-	
华泰证券	20221212000 38827	亿联网络	2022 年 12 月 12 日	62,410.00	1,000	14	3.400	82.46	-	-	
华泰证券	20221220000 19526	亿联网络	2022 年 12 月 20 日	2,010,960.00	33,600	14	3.400	2,089.12	2,035,824. 00	2,089.12	
华泰证券	20221226000 23737	亿联网络	2022 年 12 月 26 日	58,860.00	1,000	14	3.400	27.80	60,590.00	27.80	
华泰证券	20220713000 00507	亿联网络	2022 年 7 月 13 日	1,867,500.00	24,900	14	3.400	2,469.32	-	-	
华泰证券	20220110000 11417	亿纬锂能	2022 年 1 月 10 日	1,451,800.00	14,000	14	3.400	1,919.54	-	-	
华泰证券	20220124000 09132	亿纬锂能	2022 年 1 月 24 日	1,399,860.00	14,000	14	3.400	1,850.94	-	-	
华泰证券	20220207000 46359	亿纬锂能	2022 年 2 月 7 日	1,320,200.00	14,000	14	3.400	1,745.66	-	-	
华泰证券	20220221000 47329	亿纬锂能	2022 年 2 月 21 日	1,201,900.00	14,000	14	3.400	1,589.14	-	-	
华泰证券	20220307000 36372	亿纬锂能	2022 年 3 月 7 日	1,047,060.00	14,000	14	3.400	1,384.46	-	-	
华泰证券	20220321000 33065	亿纬锂能	2022 年 3 月 21 日	1,195,600.00	14,000	14	3.400	1,806.72	-	-	
华泰证券	20220406000 65863	亿纬锂能	2022 年 4 月 6 日	1,110,200.00	14,000	14	3.400	1,467.90	-	-	
华泰证券	20221114000 00740	亿纬锂能	2022 年 11 月 14 日	6,034,988.00	68,300	14	3.400	7,979.58	-	-	
华泰证券	20221128000 06245	亿纬锂能	2022 年 11 月 28 日	5,577,378.00	68,300	14	3.400	7,374.50	-	-	
华泰证券	20221212000 38829	亿纬锂能	2022 年 12 月 12 日	6,164,075.00	68,300	14	3.400	8,150.24	-	-	
华泰证券	20221226000 23693	亿纬锂能	2022 年 12 月 26 日	6,238,522.00	68,300	14	3.400	2,945.95	6,003,570. 00	2,945.95	
华泰证券	20220104000 23107	英科医疗	2022 年 1 月 4 日	219,830.00	3,800	14	3.400	290.64	-	-	
华泰证券	20220105000 09047	英科医疗	2022 年 1 月 5 日	113,460.00	2,000	14	3.400	150.08	-	-	
华泰证券	20220105000 09053	英科医疗	2022 年 1 月 5 日	561,627.00	9,900	14	3.400	742.56	-	-	
华泰证券	20220111000 11739	英科医疗	2022 年 1 月 11 日	105,111.00	1,700	14	3.400	139.02	-	-	
华泰证券	20220113000 00679	英科医疗	2022 年 1 月 13 日	378,900.00	6,000	14	3.400	501.06	-	-	

华泰证券	20220104000 23075	英科医疗	2022年1月4 日	578,500.00	10,000	28	3.400	1,857.76	-	-
华泰证券	20220118000 23982	英科医疗	2022年1月 18日	242,630.00	3,800	14	3.400	458.40	-	-
华泰证券	20220119000 09857	英科医疗	2022年1月 19日	630,927.00	9,900	14	3.400	1,132.21	-	-
华泰证券	20220119000 09863	英科医疗	2022年1月 19日	127,460.00	2,000	14	3.400	228.76	-	-
华泰证券	20220125000 00530	英科医疗	2022年1月 25日	56,000.00	1,000	14	3.400	74.06	-	-
华泰证券	20220125000 11636	英科医疗	2022年1月 25日	95,200.00	1,700	14	3.400	125.86	-	-
华泰证券	20220127000 09945	英科医疗	2022年1月 27日	321,600.00	6,000	14	3.400	425.18	-	-
华泰证券	20220128000 00260	英科医疗	2022年1月 28日	523,314.00	9,900	14	3.400	691.88	-	-
华泰证券	20220207000 44001	英科医疗	2022年2月7 日	202,046.00	3,800	14	3.400	267.12	-	-
华泰证券	20220207000 44005	英科医疗	2022年2月7 日	106,340.00	2,000	14	3.400	140.56	-	-
华泰证券	20220208000 15248	英科医疗	2022年2月8 日	92,242.00	1,700	14	3.400	121.94	-	-
华泰证券	20220208000 15250	英科医疗	2022年2月8 日	54,260.00	1,000	14	3.400	71.68	-	-
华泰证券	20220211000 18612	英科医疗	2022年2月 11日	506,484.00	9,900	14	3.400	669.62	-	-
华泰证券	20220214000 00399	英科医疗	2022年2月 14日	848,924.00	16,600	14	3.400	1,122.52	-	-
华泰证券	20220216000 00439	英科医疗	2022年2月 16日	540,853.00	10,300	14	3.400	715.12	-	-
华泰证券	20220207000 44003	英科医疗	2022年2月7 日	531,700.00	10,000	28	3.400	1,406.16	-	-
华泰证券	20220221000 35699	英科医疗	2022年2月 21日	105,960.00	2,000	14	3.400	140.14	-	-
华泰证券	20220221000 35705	英科医疗	2022年2月 21日	201,324.00	3,800	14	3.400	266.14	-	-
华泰证券	20220222000 11069	英科医疗	2022年2月 22日	87,159.00	1,700	14	3.400	115.22	-	-
华泰证券	20220222000 11075	英科医疗	2022年2月 22日	51,270.00	1,000	14	3.400	67.76	-	-
华泰证券	20220225000 18979	英科医疗	2022年2月 25日	500,247.00	9,900	14	3.400	661.50	-	-
华泰证券	20220228000	英科医疗	2022年2月	850,418.00	16,600	14	3.400	1,124.48	-	-

	03341		28 日								
华泰证券	20220302000 03459	英科医疗	2022年3月2 日	524,785.00	10,300	14	3.400	693.84	-	-	
华泰证券	20220307000 37856	英科医疗	2022年3月7 日	100,440.00	2,000	14	3.400	132.86	-	-	
华泰证券	20220307000 37860	英科医疗	2022年3月7 日	190,836.00	3,800	14	3.400	252.28	-	-	
华泰证券	20220308000 12986	英科医疗	2022年3月8 日	48,050.00	1,000	14	3.400	63.56	-	-	
华泰证券	20220308000 12988	英科医疗	2022年3月8 日	81,685.00	1,700	14	3.400	108.08	-	-	
华泰证券	20220311000 16146	英科医疗	2022年3月 11日	483,813.00	9,900	14	3.400	639.66	-	-	
华泰证券	20220307000 37852	英科医疗	2022年3月7 日	502,200.00	10,000	28	3.400	1,422.90	-	-	
华泰证券	20220321000 33073	英科医疗	2022年3月 21日	98,120.00	2,000	14	3.400	148.32	-	-	
华泰证券	20220321000 33075	英科医疗	2022年3月 21日	186,428.00	3,800	14	3.400	281.76	-	-	
华泰证券	20220322000 14295	英科医疗	2022年3月 22日	47,800.00	1,000	14	3.400	67.65	-	-	
华泰证券	20220322000 14299	英科医疗	2022年3月 22日	81,260.00	1,700	14	3.400	115.05	-	-	
华泰证券	20220325000 18794	英科医疗	2022年3月 25日	455,202.00	9,900	14	3.400	601.86	-	-	
华泰证券	20220408000 14673	英科医疗	2022年4月8 日	441,738.00	9,900	14	3.400	584.08	-	-	
华泰证券	20220422000 17046	英科医疗	2022年4月 22日	395,406.00	9,900	14	3.400	522.76	-	-	
华泰证券	20220506000 14325	英科医疗	2022年5月6 日	274,824.00	9,900	14	3.400	363.44	-	-	
华泰证券	20220105000 09049	智飞生物	2022年1月5 日	2,467,712.00	20,800	14	3.400	3,262.84	-	-	
华泰证券	20220105000 09051	智飞生物	2022年1月5 日	3,630,384.00	30,600	14	3.400	4,800.18	-	-	
华泰证券	20220114000 00575	智飞生物	2022年1月 14日	192,508.00	1,700	14	3.400	254.52	-	-	
华泰证券	20220114000 24102	智飞生物	2022年1月 14日	113,240.00	1,000	14	3.400	149.80	-	-	
华泰证券	20220119000 00658	智飞生物	2022年1月 19日	3,882,870.00	36,500	14	3.400	6,967.68	-	-	
华泰证券	20220119000 09867	智飞生物	2022年1月 19日	3,255,228.00	30,600	14	3.400	5,841.36	-	-	

华泰证券	20220119000 10333	智飞生物	2022 年 1 月 19 日	2,212,704.00	20,800	14	3.400	3,970.62	-	-
华泰证券	20220128000 18824	智飞生物	2022 年 1 月 28 日	105,620.00	1,000	14	3.400	139.72	-	-
华泰证券	20220207000 43951	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	2,297,776.00	20,800	14	3.400	3,038.14	-	-
华泰证券	20220207000 43955	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	4,032,155.00	36,500	14	3.400	5,331.34	-	-
华泰证券	20220207000 43961	智飞生物	2022 年 2 月 7 日	3,380,382.00	30,600	14	3.400	4,469.64	-	-
华泰证券	20220221000 35703	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	3,843,666.00	30,600	14	3.400	5,082.14	-	-
华泰证券	20220221000 35707	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	4,584,765.00	36,500	14	3.400	6,062.14	-	-
华泰证券	20220221000 35711	智飞生物	2022 年 2 月 21 日	2,612,688.00	20,800	14	3.400	3,454.50	-	-
华泰证券	20220307000 36388	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	2,536,144.00	20,800	14	3.400	3,353.42	-	-
华泰证券	20220307000 36392	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	3,731,058.00	30,600	14	3.400	4,933.32	-	-
华泰证券	20220307000 36394	智飞生物	2022 年 3 月 7 日	4,450,445.00	36,500	14	3.400	5,884.48	-	-
华泰证券	20221114000 00758	智飞生物	2022 年 11 月 14 日	12,154,100.00	125,300	14	3.400	16,070.46	-	-
华泰证券	20221128000 06275	智飞生物	2022 年 11 月 28 日	11,195,555.00	125,300	14	3.400	14,803.04	-	-
华泰证券	20221212000 38833	智飞生物	2022 年 12 月 12 日	10,589,103.00	125,300	14	3.400	14,001.12	-	-
华泰证券	20221226000 23699	智飞生物	2022 年 12 月 26 日	10,725,680.00	125,300	14	3.400	5,064.90	11,005,099 .00	5,064.90
华泰证券	20220127000 00543	中国通号	2022 年 1 月 27 日	5,255,406.00	1,092,600	14	3.400	6,948.76	-	-
华泰证券	20220406000 00812	中国通号	2022 年 4 月 6 日	179,601.00	39,300	28	3.400	491.84	-	-
华泰证券	20220505000 70289	中国通号	2022 年 5 月 5 日	173,313.00	39,300	28	3.400	458.36	-	-
华泰证券	20220907000 00551	中科创达	2022 年 9 月 7 日	6,340,000.00	50,000	14	3.400	8,382.92	-	-
华泰证券	20220921000 25804	中科创达	2022 年 9 月 21 日	5,587,500.00	50,000	14	3.400	10,026.49	-	-
华泰证券	20221010000 96781	中科创达	2022 年 10 月 10 日	5,127,500.00	50,000	14	3.400	6,779.64	-	-
华泰证券	20221024000	中科创达	2022 年 10 月	5,320,000.00	50,000	14	3.400	7,034.16	-	-

	77719		24 日								
华泰证券	20221027000 00533	中科创达	2022 年 10 月 27 日	1,730,232.00	16,800	14	3.400	2,287.74	-	-	
华泰证券	20221107000 00504	中科创达	2022 年 11 月 7 日	119,000.00	1,000	14	3.400	157.36	-	-	
华泰证券	20221107000 98075	中科创达	2022 年 11 月 7 日	5,950,000.00	50,000	14	3.400	7,867.16	-	-	
华泰证券	20221110000 20408	中科创达	2022 年 11 月 10 日	1,985,424.00	16,800	14	3.400	2,625.14	-	-	
华泰证券	20221114000 00690	中科创达	2022 年 11 月 14 日	1,034,000.00	8,800	14	3.400	1,367.24	-	-	
华泰证券	20221121000 78936	中科创达	2022 年 11 月 21 日	121,990.00	1,000	14	3.400	161.28	-	-	
华泰证券	20221121000 79312	中科创达	2022 年 11 月 21 日	6,099,500.00	50,000	14	3.400	8,064.84	-	-	
华泰证券	20221124000 13716	中科创达	2022 年 11 月 24 日	1,963,920.00	16,800	14	3.400	2,596.72	-	-	
华泰证券	20221128000 06231	中科创达	2022 年 11 月 28 日	977,768.00	8,800	14	3.400	1,292.90	-	-	
华泰证券	20221205000 20752	中科创达	2022 年 12 月 5 日	5,606,000.00	50,000	14	3.400	7,412.44	-	-	
华泰证券	20221205000 20802	中科创达	2022 年 12 月 5 日	112,120.00	1,000	14	3.400	148.26	-	-	
华泰证券	20221208000 13241	中科创达	2022 年 12 月 8 日	1,863,624.00	16,800	14	3.400	2,464.14	-	-	
华泰证券	20221212000 38845	中科创达	2022 年 12 月 12 日	981,552.00	8,800	14	3.400	1,297.80	-	-	
华泰证券	20221219000 19292	中科创达	2022 年 12 月 19 日	105,020.00	1,000	14	3.400	119.04	100,300.00	119.04	
华泰证券	20221219000 22860	中科创达	2022 年 12 月 19 日	5,251,000.00	50,000	14	3.400	5,951.16	5,015,000.00	5,951.16	
华泰证券	20221222000 14005	中科创达	2022 年 12 月 22 日	1,763,832.00	16,800	14	3.400	1,499.22	1,685,040.00	1,499.22	
华泰证券	20221226000 01176	中科创达	2022 年 12 月 26 日	554,944.00	5,200	14	3.400	262.05	521,560.00	262.05	
华泰证券	20221226000 23727	中科创达	2022 年 12 月 26 日	939,136.00	8,800	14	3.400	443.50	882,640.00	443.50	
华泰证券	20220104000 23091	中微公司	2022 年 1 月 4 日	2,402,200.00	20,000	14	3.400	3,176.18	-	-	
华泰证券	20220104000 23111	中微公司	2022 年 1 月 4 日	3,831,509.00	31,900	14	3.400	5,066.18	-	-	
华泰证券	20220107000 00654	中微公司	2022 年 1 月 7 日	3,621,000.00	30,000	14	3.400	4,787.72	-	-	

华泰证券	20220118000 23954	中微公司	2022 年 1 月 18 日	2,367,400.00	20,000	14	3.400	4,471.80	-	-
华泰证券	20220118000 23968	中微公司	2022 年 1 月 18 日	3,776,003.00	31,900	14	3.400	7,132.40	-	-
华泰证券	20220121000 11242	中微公司	2022 年 1 月 21 日	3,394,500.00	30,000	14	3.400	5,450.03	-	-
华泰证券	20220207000 43927	中微公司	2022 年 2 月 7 日	3,600,900.00	30,000	14	3.400	4,761.26	-	-
华泰证券	20221114000 00781	中微公司	2022 年 11 月 14 日	5,121,688.00	48,400	14	3.400	6,772.08	-	-
华泰证券	20221128000 06283	中微公司	2022 年 11 月 28 日	4,736,424.00	48,400	14	3.400	6,262.62	-	-
华泰证券	20221206000 00641	中微公司	2022 年 12 月 6 日	1,559,400.00	15,000	14	3.400	2,061.92	-	-
华泰证券	20221212000 38779	中微公司	2022 年 12 月 12 日	5,237,848.00	48,400	14	3.400	6,925.66	-	-
华泰证券	20221226000 22317	中微公司	2022 年 12 月 26 日	4,989,072.00	48,400	14	3.400	2,355.95	4,743,684. 00	2,355.95
华泰证券	20220613000 02237	中伟股份	2022 年 6 月 13 日	6,425,000.00	50,000	14	3.400	8,495.34	-	-
华泰证券	20220627000 15378	中伟股份	2022 年 6 月 27 日	6,378,000.00	50,000	14	3.400	8,433.18	-	-
华泰证券	20220711000 18748	中伟股份	2022 年 7 月 11 日	6,952,500.00	50,000	14	3.400	9,192.82	-	-
华泰证券	20220725000 16066	中伟股份	2022 年 7 月 25 日	6,571,000.00	50,000	14	3.400	8,688.26	-	-
华泰证券	20220808000 21811	中伟股份	2022 年 8 月 8 日	6,250,000.00	50,000	14	3.400	8,263.92	-	-
华泰证券	20220822000 19123	中伟股份	2022 年 8 月 22 日	5,467,000.00	50,000	14	3.400	7,228.62	-	-
华泰证券	20220905000 22483	中伟股份	2022 年 9 月 5 日	4,600,500.00	50,000	14	3.400	6,082.86	-	-
华泰证券	20220919000 19174	中伟股份	2022 年 9 月 19 日	4,447,000.00	50,000	14	3.400	8,819.79	-	-
华泰证券	20220927000 00456	中伟股份	2022 年 9 月 27 日	106,488.00	1,200	14	3.400	140.84	-	-
华泰证券	20221010000 82717	中伟股份	2022 年 10 月 10 日	4,010,000.00	50,000	14	3.400	5,302.08	-	-
华泰证券	20221011000 22691	中伟股份	2022 年 10 月 11 日	95,688.00	1,200	14	3.400	126.56	-	-
华泰证券	20221024000 86517	中伟股份	2022 年 10 月 24 日	3,778,000.00	50,000	14	3.400	4,995.34	-	-
华泰证券	20221025000	中伟股份	2022 年 10 月	137,844.00	1,800	14	3.400	182.28	-	-

	00601		25 日								
华泰证券	20221025000 22948	中伟股份	2022 年 10 月 25 日	91,896.00	1,200	14	3.400	121.52	-	-	
华泰证券	20221107000 87159	中伟股份	2022 年 11 月 7 日	4,451,500.00	50,000	14	3.400	5,885.88	-	-	
华泰证券	20221108000 22227	中伟股份	2022 年 11 月 8 日	105,084.00	1,200	14	3.400	138.88	-	-	
华泰证券	20221108000 23553	中伟股份	2022 年 11 月 8 日	157,626.00	1,800	14	3.400	208.46	-	-	
华泰证券	20221201000 00700	中伟股份	2022 年 12 月 1 日	7,548,750.00	99,000	14	3.400	9,981.16	-	-	
华泰证券	20221212000 06016	中伟股份	2022 年 12 月 12 日	1,929,500.00	25,000	14	3.400	2,551.22	-	-	
华泰证券	20221213000 00749	中伟股份	2022 年 12 月 13 日	74,980.00	1,000	14	3.400	99.12	-	-	
华泰证券	20221215000 12345	中伟股份	2022 年 12 月 15 日	7,406,190.00	99,000	14	3.400	9,792.58	-	-	
华泰证券	20221226000 26363	中伟股份	2022 年 12 月 26 日	1,709,750.00	25,000	14	3.400	807.40	1,640,250.00	807.40	
华泰证券	20221227000 00479	中伟股份	2022 年 12 月 27 日	620,280.00	9,000	14	3.400	234.32	590,490.00	234.32	
华泰证券	20221227000 15903	中伟股份	2022 年 12 月 27 日	68,920.00	1,000	14	3.400	26.04	65,610.00	26.04	
华泰证券	20221229000 11249	中伟股份	2022 年 12 月 29 日	6,689,430.00	99,000	14	3.400	1,263.56	6,495,390.00	1,263.56	
华泰证券	20221114000 00801	中芯国际	2022 年 11 月 14 日	1,420,020.00	34,300	14	3.400	1,877.54	-	-	
华泰证券	20221128000 06293	中芯国际	2022 年 11 月 28 日	1,374,744.00	34,300	14	3.400	1,817.76	-	-	
华泰证券	20221212000 38817	中芯国际	2022 年 12 月 12 日	1,438,885.00	34,300	14	3.400	1,902.60	-	-	
华泰证券	20221226000 26745	中芯国际	2022 年 12 月 26 日	1,421,049.00	34,300	14	3.400	671.05	1,411,102.00	671.05	
华泰证券	20220831000 00783	卓胜微	2022 年 8 月 31 日	498,526.00	4,900	14	3.400	659.12	-	-	
华泰证券	20221114000 00824	卓胜微	2022 年 11 月 14 日	908,160.00	8,800	14	3.400	1,200.78	-	-	
华泰证券	20221128000 06203	卓胜微	2022 年 11 月 28 日	1,004,784.00	8,800	14	3.400	1,328.60	-	-	
华泰证券	20221212000 06012	卓胜微	2022 年 12 月 12 日	140,616.00	1,200	14	3.400	185.92	-	-	
华泰证券	20221212000 38863	卓胜微	2022 年 12 月 12 日	1,031,184.00	8,800	14	3.400	1,363.46	-	-	

华泰证券	20221226000 26273	卓胜微	2022 年 12 月 26 日	1,005,224.00	8,800	14	3.400	474.70	1,005,840.00	474.70
华泰证券	20221230000 00545	卓胜微	2022 年 12 月 30 日	228,600.00	2,000	14	3.400	21.59	228,600.00	21.59
上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日										
关联方 名称	合约 编号	证券 名称	成交时间	交易金额	交易 数量(单位:股)	出借期限 (单位: 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
华泰证券	20210104000 00197	东方财富	2021 年 1 月 4 日	27,370,000.00	850,000	14	5.400	57,477.00	-	-
华泰证券	20210104000 13120	亿纬锂能	2021 年 1 月 4 日	14,612,487.00	156,300	14	3.400	19,320.98	-	-
华泰证券	20210105000 00360	沃森生物	2021 年 1 月 5 日	152,120.00	4,000	14	3.400	201.18	-	-
华泰证券	20210105000 10640	沃森生物	2021 年 1 月 5 日	76,060.00	2,000	14	3.400	100.52	-	-
华泰证券	20210105000 10642	沃森生物	2021 年 1 月 5 日	950,750.00	25,000	14	4.400	1,626.80	-	-
华泰证券	20210106000 00415	蓝思科技	2021 年 1 月 6 日	311,322.00	8,900	14	3.400	411.60	-	-
华泰证券	20210106000 07229	蓝思科技	2021 年 1 月 6 日	1,626,570.00	46,500	14	4.400	2,783.20	-	-
华泰证券	20210106000 07919	沃森生物	2021 年 1 月 6 日	579,900.00	15,000	14	3.400	766.78	-	-
华泰证券	20210107000 11772	沃森生物	2021 年 1 月 7 日	4,661,125.00	122,500	14	3.400	6,163.08	-	-
华泰证券	20210107000 11774	东方财富	2021 年 1 月 7 日	728,700.00	21,000	14	4.400	1,246.84	-	-
华泰证券	20210111000 08228	泰格医药	2021 年 1 月 11 日	2,885,400.00	17,500	14	3.400	3,815.14	-	-
华泰证券	20210111000 08992	蓝思科技	2021 年 1 月 11 日	1,295,000.00	35,000	14	3.400	1,712.34	-	-
华泰证券	20210111000 08994	蓝思科技	2021 年 1 月 11 日	518,000.00	14,000	14	3.400	684.88	-	-
华泰证券	20210112000 06485	蓝思科技	2021 年 1 月 12 日	56,025.00	1,500	14	3.400	74.06	-	-
华泰证券	20210115000 00417	蓝思科技	2021 年 1 月 15 日	3,095,001.00	81,900	14	6.400	7,703.08	-	-
华泰证券	20210115000 00421	亿纬锂能	2021 年 1 月 15 日	644,000.00	7,000	14	4.400	1,101.94	-	-
华泰证券	20210104000 00191	同花顺	2021 年 1 月 4 日	1,134,270.00	9,000	28	4.400	3,881.64	-	-

华泰证券	20210104000 00195	东方财富	2021年1月4 日	15,134,000.00	470,000	28	5.400	63,562.80	-	-
华泰证券	20210118000 09218	东方财富	2021年1月 18日	32,113,000.00	850,000	14	5.400	67,437.30	-	-
华泰证券	20210118000 09332	亿纬锂能	2021年1月 18日	14,707,830.00	156,300	14	3.400	19,446.98	-	-
华泰证券	20210105000 00358	东方财富	2021年1月5 日	45,402.00	1,400	28	3.400	120.12	-	-
华泰证券	20210105000 00362	沃森生物	2021年1月5 日	1,064,840.00	28,000	28	3.400	2,815.96	-	-
华泰证券	20210119000 00165	华大基因	2021年1月 19日	624,204.00	4,200	14	4.400	1,068.06	-	-
华泰证券	20210120000 00224	东方财富	2021年1月 20日	524,300.00	14,000	14	4.400	897.12	-	-
华泰证券	20210120000 05916	蓝思科技	2021年1月 20日	1,807,920.00	46,500	14	4.400	3,093.58	-	-
华泰证券	20210120000 05918	蓝思科技	2021年1月 20日	346,032.00	8,900	14	3.400	457.52	-	-
华泰证券	20210121000 00315	华大基因	2021年1月 21日	1,163,400.00	7,000	14	3.400	1,538.32	-	-
华泰证券	20210121000 12311	沃森生物	2021年1月 21日	4,575,375.00	122,500	14	3.400	6,049.68	-	-
华泰证券	20210121000 12313	东方财富	2021年1月 21日	833,280.00	21,000	14	4.400	1,425.90	-	-
华泰证券	20210122000 00351	华大基因	2021年1月 22日	1,993,712.00	11,200	14	5.400	4,186.84	-	-
华泰证券	20210111000 00305	澜起科技	2021年1月 11日	18,164,000.00	200,000	28	3.400	48,033.72	-	-
华泰证券	20210125000 00264	智飞生物	2021年1月 25日	918,500.00	5,500	14	3.400	1,214.50	-	-
华泰证券	20210125000 08568	蓝思科技	2021年1月 25日	496,720.00	14,000	14	3.400	656.74	-	-
华泰证券	20210125000 08570	蓝思科技	2021年1月 25日	1,241,800.00	35,000	14	3.400	1,641.92	-	-
华泰证券	20210125000 08766	泰格医药	2021年1月 25日	3,351,425.00	17,500	14	3.400	4,431.28	-	-
华泰证券	20210126000 06530	蓝思科技	2021年1月 26日	52,665.00	1,500	14	3.400	69.58	-	-
华泰证券	20210115000 00419	亿纬锂能	2021年1月 15日	1,932,000.00	21,000	28	4.400	8,028.42	-	-
华泰证券	20210118000 00287	中国通号	2021年1月 18日	2,999,934.00	492,600	28	2.000	5,166.46	-	-
华泰证券	20210118000	亿纬锂能	2021年1月	1,646,750.00	17,500	28	4.400	6,239.37	-	-

	00289		18日								
华泰证券	20210119000 07934	亿纬锂能	2021年1月 19日	960,750.00	10,500	28	4.400	3,522.90	-	-	
华泰证券	20210120000 00220	亿纬锂能	2021年1月 20日	8,400,938.00	80,600	28	4.400	29,776.62	-	-	
华泰证券	20210120000 00222	智飞生物	2021年1月 20日	3,978,800.00	28,000	28	4.400	14,102.70	-	-	
华泰证券	20210129000 01805	亿纬锂能	2021年1月 29日	745,500.00	7,000	14	4.400	1,822.40	-	-	
华泰证券	20210129000 01807	蓝思科技	2021年1月 29日	2,735,460.00	81,900	14	6.400	9,726.00	-	-	
华泰证券	20210201000 00238	东方财富	2021年2月1 日	186,576.00	5,200	14	4.400	387.60	-	-	
华泰证券	20210201000 09316	东方财富	2021年2月1 日	30,498,000.00	850,000	14	5.400	77,769.90	-	-	
华泰证券	20210201000 09320	亿纬锂能	2021年2月1 日	16,072,329.00	156,300	14	3.400	25,804.98	-	-	
华泰证券	20210202000 00375	沃森生物	2021年2月2 日	600,990.00	13,800	14	4.400	1,175.20	-	-	
华泰证券	20210202000 08615	华大基因	2021年2月2 日	613,116.00	4,200	14	4.400	1,199.04	-	-	
华泰证券	20210203000 06532	东方财富	2021年2月3 日	494,760.00	14,000	14	4.400	907.05	-	-	
华泰证券	20210203000 06818	蓝思科技	2021年2月3 日	1,442,895.00	46,500	14	4.400	2,645.25	-	-	
华泰证券	20210204000 13799	沃森生物	2021年2月4 日	5,258,925.00	122,500	14	3.400	6,953.52	-	-	
华泰证券	20210204000 13801	东方财富	2021年2月4 日	743,190.00	21,000	14	4.400	1,271.62	-	-	
华泰证券	20210208000 00380	乐普医疗	2021年2月8 日	1,668,744.00	53,900	14	3.400	2,206.40	-	-	
华泰证券	20210208000 08536	泰格医药	2021年2月8 日	3,253,425.00	17,500	14	3.400	4,301.78	-	-	
华泰证券	20210126000 06182	沃森生物	2021年1月 26日	280,140.00	7,000	28	4.400	958.72	-	-	
华泰证券	20210209000 00451	传音控股	2021年2月9 日	637,520.00	2,600	14	3.800	942.06	-	-	
华泰证券	20210127000 00576	中国通号	2021年1月 27日	2,727,244.00	465,400	28	2.000	4,242.28	-	-	
华泰证券	20210128000 09720	东方财富	2021年1月 28日	506,800.00	14,000	28	4.400	1,734.32	-	-	
华泰证券	20210129000 00184	沃森生物	2021年1月 29日	546,480.00	13,800	28	5.400	2,295.16	-	-	

华泰证券	20210201000 00240	华大基因	2021年2月1 日	435,860.00	3,100	28	4.400	1,491.56	-	-
华泰证券	20210201000 09318	东方财富	2021年2月1 日	16,863,600.00	470,000	28	5.400	70,827.12	-	-
华泰证券	20210202000 00377	同花顺	2021年2月2 日	456,475.00	3,100	28	4.400	1,562.12	-	-
华泰证券	20210202000 00379	乐普医疗	2021年2月2 日	433,048.00	14,800	28	4.400	1,482.04	-	-
华泰证券	20210202000 09125	沃森生物	2021年2月2 日	1,219,400.00	28,000	28	3.400	3,224.76	-	-
华泰证券	20210202000 09127	东方财富	2021年2月2 日	51,590.00	1,400	28	3.400	136.36	-	-
华泰证券	20210204000 00303	康泰生物	2021年2月4 日	434,520.00	2,400	28	5.400	1,825.04	-	-
华泰证券	20210218000 00877	智飞生物	2021年2月 18日	703,259.00	3,700	14	4.400	1,203.30	-	-
华泰证券	20210218000 00881	沃森生物	2021年2月 18日	1,314,873.00	24,300	14	4.400	2,249.94	-	-
华泰证券	20210218000 00883	蓝思科技	2021年2月 18日	675,990.00	21,000	14	4.400	1,156.68	-	-
华泰证券	20210218000 40046	亿纬锂能	2021年2月 18日	16,192,680.00	156,300	14	3.400	21,410.34	-	-
华泰证券	20210218000 41546	沃森生物	2021年2月 18日	6,628,475.00	122,500	14	3.400	8,764.28	-	-
华泰证券	20210219000 00537	温氏股份	2021年2月 19日	1,201,959.00	63,900	14	3.400	1,589.28	-	-
华泰证券	20210219000 01423	同花顺	2021年2月 19日	1,523,018.00	9,800	14	3.400	2,013.76	-	-
华泰证券	20210208000 07670	澜起科技	2021年2月8 日	19,100,000.00	200,000	28	3.400	50,508.92	-	-
华泰证券	20210223000 00207	乐普医疗	2021年2月 23日	1,060,076.00	33,200	14	3.400	1,401.68	-	-
华泰证券	20210301000 00244	爱尔眼科	2021年3月1 日	1,284,825.00	18,500	14	3.400	1,698.76	-	-
华泰证券	20210301000 00246	同花顺	2021年3月1 日	1,112,211.00	8,100	14	3.400	1,470.56	-	-
华泰证券	20210301000 00247	东方财富	2021年3月1 日	1,369,121.00	43,700	14	3.400	1,810.34	-	-
华泰证券	20210302000 00190	蓝思科技	2021年3月2 日	504,966.00	15,400	14	3.400	667.66	-	-
华泰证券	20210302000 00192	亿纬锂能	2021年3月2 日	5,879,720.00	64,400	14	3.400	7,774.34	-	-
华泰证券	20210218000	爱尔眼科	2021年2月	2,738,044.00	31,100	28	3.400	7,240.52	-	-

	00879		18日							
华泰证券	20210218000 40040	中国通号	2021年2月 18日	2,748,708.00	492,600	28	2.000	4,275.88	-	-
华泰证券	20210218000 41548	智飞生物	2021年2月 18日	5,321,960.00	28,000	28	4.400	18,212.88	-	-
华泰证券	20210218000 41550	亿纬锂能	2021年2月 18日	2,175,600.00	21,000	28	4.400	7,445.48	-	-
华泰证券	20210305000 00410	康泰生物	2021年3月5 日	1,541,916.00	10,800	14	3.400	2,038.82	-	-
华泰证券	20210305000 00416	泰格医药	2021年3月5 日	1,621,155.00	11,500	14	3.400	2,143.54	-	-
华泰证券	20210223000 06710	沃森生物	2021年2月 23日	360,850.00	7,000	28	4.400	1,234.80	-	-
华泰证券	20210224000 06458	中国通号	2021年2月 24日	2,722,590.00	465,400	28	2.000	4,235.28	-	-
华泰证券	20210225000 00588	中国通号	2021年2月 25日	189,120.00	32,000	28	1.800	264.88	-	-
华泰证券	20210311000 00307	智飞生物	2021年3月 11日	159,000.00	1,000	14	3.400	210.28	-	-
华泰证券	20210226000 03840	沃森生物	2021年2月 26日	632,178.00	13,800	28	5.400	2,655.24	-	-
华泰证券	20210312000 00271	智飞生物	2021年3月 12日	1,526,760.00	9,000	14	3.400	2,018.66	-	-
华泰证券	20210302000 04713	同花顺	2021年3月2 日	397,420.00	3,100	28	4.400	1,359.96	-	-
华泰证券	20210302000 04715	东方财富	2021年3月2 日	43,022.00	1,400	28	3.400	113.68	-	-
华泰证券	20210302000 04837	沃森生物	2021年3月2 日	1,278,480.00	28,000	28	3.400	3,381.00	-	-
华泰证券	20210302000 04839	乐普医疗	2021年3月2 日	459,984.00	14,800	28	4.400	1,574.16	-	-
华泰证券	20210316000 06418	亿纬锂能	2021年3月 16日	5,267,920.00	64,400	14	3.400	6,965.42	-	-
华泰证券	20210303000 00704	信维通信	2021年3月3 日	420,000.00	12,500	28	3.400	1,110.76	-	-
华泰证券	20210303000 00706	沃森生物	2021年3月3 日	1,625,900.00	35,500	28	3.400	4,299.68	-	-
华泰证券	20210303000 00708	爱尔眼科	2021年3月3 日	6,208,466.00	90,200	28	3.400	16,418.08	-	-
华泰证券	20210319000 00191	泰格医药	2021年3月 19日	1,516,620.00	11,500	14	3.400	2,005.36	-	-
华泰证券	20210308000 09001	澜起科技	2021年3月8 日	14,900,000.00	200,000	28	3.400	40,809.38	-	-

华泰证券	20210309000 00367	华大基因	2021年3月9 日	1,854,930.00	15,400	28	3.400	4,905.32	-	-
华泰证券	20210309000 00369	爱尔眼科	2021年3月9 日	4,766,817.00	87,900	28	1.800	6,673.52	-	-
华泰证券	20210310000 00164	中国通号	2021年3月 10日	265,080.00	47,000	28	1.800	371.00	-	-
华泰证券	20210310000 00166	华大基因	2021年3月 10日	565,551.00	4,700	28	3.400	1,495.48	-	-
华泰证券	20210311000 00309	智飞生物	2021年3月 11日	1,113,000.00	7,000	28	3.400	2,943.36	-	-
华泰证券	20210311000 00310	华大基因	2021年3月 11日	169,960.00	1,400	28	3.400	449.40	-	-
华泰证券	20210402000 00265	东方财富	2021年4月2 日	34,644,000.00	1,200,000	7	3.400	22,903.51	-	-
华泰证券	20210316000 00626	智飞生物	2021年3月 16日	2,323,300.00	14,000	28	3.400	6,143.76	-	-
华泰证券	20210330000 08607	亿纬锂能	2021年3月 30日	4,810,680.00	64,400	14	3.400	6,360.76	-	-
华泰证券	20210317000 00620	亿纬锂能	2021年3月 17日	593,600.00	7,000	28	3.400	1,569.68	-	-
华泰证券	20210318000 34044	亿纬锂能	2021年3月 18日	1,782,900.00	21,000	28	4.400	6,101.48	-	-
华泰证券	20210318000 35262	爱尔眼科	2021年3月 18日	1,873,775.00	31,100	28	3.400	4,955.16	-	-
华泰证券	20210318000 35264	智飞生物	2021年3月 18日	4,922,400.00	28,000	28	4.400	16,845.64	-	-
华泰证券	20210319000 00189	智飞生物	2021年3月 19日	2,361,800.00	14,000	28	3.400	6,245.68	-	-
华泰证券	20210324000 06250	中国通号	2021年3月 24日	2,657,434.00	465,400	28	2.000	4,133.92	-	-
华泰证券	20210407000 00297	芒果超媒	2021年4月7 日	685,190.00	11,000	14	3.400	905.94	-	-
华泰证券	20210325000 00472	亿纬锂能	2021年3月 25日	373,410.00	5,400	28	3.400	987.56	-	-
华泰证券	20210325000 06340	中国通号	2021年3月 25日	181,120.00	32,000	28	1.800	253.68	-	-
华泰证券	20210326000 00331	亿纬锂能	2021年3月 26日	3,005,200.00	40,000	28	3.400	7,946.96	-	-
华泰证券	20210330000 08601	东方财富	2021年3月 30日	39,130.00	1,400	28	3.400	103.60	-	-
华泰证券	20210330000 08603	沃森生物	2021年3月 30日	1,302,280.00	28,000	28	3.400	3,443.72	-	-
华泰证券	20210330000	乐普医疗	2021年3月	430,532.00	14,800	28	4.400	1,473.36	-	-

	08605		30 日							
华泰证券	20210330000 08845	同花顺	2021 年 3 月 30 日	383,501.00	3,100	28	4.400	1,312.36	-	-
华泰证券	20210413000 07917	亿纬锂能	2021 年 4 月 13 日	4,482,240.00	64,400	14	3.400	5,926.48	-	-
华泰证券	20210331000 06114	沃森生物	2021 年 3 月 31 日	1,604,245.00	35,500	28	3.400	4,242.28	-	-
华泰证券	20210331000 06766	信维通信	2021 年 3 月 31 日	354,875.00	12,500	28	3.400	938.56	-	-
华泰证券	20210406000 16598	爱尔眼科	2021 年 4 月 6 日	5,534,184.00	87,900	28	1.800	8,301.30	-	-
华泰证券	20210407000 08547	中国通号	2021 年 4 月 7 日	269,310.00	47,000	28	1.800	390.63	-	-
华泰证券	20210408000 04889	华大基因	2021 年 4 月 8 日	170,646.00	1,400	28	3.400	451.36	-	-
华泰证券	20210408000 05125	智飞生物	2021 年 4 月 8 日	1,326,500.00	7,000	28	3.400	3,507.84	-	-
华泰证券	20210419000 00468	沃森生物	2021 年 4 月 19 日	843,972.00	15,900	14	3.400	1,355.07	-	-
华泰证券	20210420000 00929	东方财富	2021 年 4 月 20 日	988,696.00	33,200	14	3.400	1,494.08	-	-
华泰证券	20210420000 00931	澜起科技	2021 年 4 月 20 日	10,035,000.00	150,000	14	3.400	15,164.00	-	-
华泰证券	20210413000 08407	智飞生物	2021 年 4 月 13 日	2,528,400.00	14,000	28	3.400	6,686.12	-	-
华泰证券	20210427000 11518	亿纬锂能	2021 年 4 月 27 日	5,302,696.00	64,400	14	3.400	7,011.34	-	-
华泰证券	20210414000 00188	宋城演艺	2021 年 4 月 14 日	232,560.00	11,400	28	3.400	614.88	-	-
华泰证券	20210414000 00190	健帆生物	2021 年 4 月 14 日	435,855.00	4,900	28	3.400	1,152.48	-	-
华泰证券	20210415000 00208	智飞生物	2021 年 4 月 15 日	1,265,600.00	7,000	28	3.400	3,346.84	-	-
华泰证券	20210415000 30086	智飞生物	2021 年 4 月 15 日	5,062,400.00	28,000	28	4.400	17,324.72	-	-
华泰证券	20210415000 31038	爱尔眼科	2021 年 4 月 15 日	1,858,225.00	31,100	28	3.400	4,914.00	-	-
华泰证券	20210429000 00355	沃森生物	2021 年 4 月 29 日	669,978.00	11,400	14	3.400	885.92	-	-
华泰证券	20210421000 07957	中国通号	2021 年 4 月 21 日	2,671,396.00	465,400	28	2.000	4,155.48	-	-
华泰证券	20210422000 00358	康泰生物	2021 年 4 月 22 日	451,825.00	3,100	28	3.400	1,194.76	-	-

华泰证券	202104220007384	中国通号	2021年4月22日	184,000.00	32,000	28	1.800	257.60	-	-
华泰证券	2021050600000539	宋城演艺	2021年5月6日	26,728.00	1,300	14	3.400	35.28	-	-
华泰证券	2021050600000541	沃森生物	2021年5月6日	3,902,500.00	70,000	14	3.400	5,159.98	-	-
华泰证券	2021050600000543	温氏股份	2021年5月6日	28,340.00	2,000	14	3.400	37.52	-	-
华泰证券	2021050600000545	蓝思科技	2021年5月6日	28,391.00	1,100	14	3.400	37.52	-	-
华泰证券	2021050600000547	乐普医疗	2021年5月6日	31,000.00	1,000	14	3.400	41.02	-	-
华泰证券	2021042300005720	亿纬锂能	2021年4月23日	3,424,000.00	40,000	28	3.400	9,054.64	-	-
华泰证券	2021050700000312	乐普医疗	2021年5月7日	29,950.00	1,000	14	3.400	39.62	-	-
华泰证券	2021050700000314	宋城演艺	2021年5月7日	25,285.00	1,300	14	3.400	33.46	-	-
华泰证券	2021050700000316	温氏股份	2021年5月7日	28,340.00	2,000	14	3.400	37.52	-	-
华泰证券	2021042600000637	亿纬锂能	2021年4月26日	591,990.00	7,000	28	3.400	1,565.48	-	-
华泰证券	2021051000000279	温氏股份	2021年5月10日	27,400.00	2,000	14	3.400	36.26	-	-
华泰证券	2021051000000281	宋城演艺	2021年5月10日	25,740.00	1,300	14	3.400	34.02	-	-
华泰证券	2021051000000283	乐普医疗	2021年5月10日	30,030.00	1,000	14	3.400	39.76	-	-
华泰证券	2021042700000282	同花顺	2021年4月27日	389,130.00	3,500	28	3.400	1,029.00	-	-
华泰证券	2021042700011436	同花顺	2021年4月27日	344,658.00	3,100	28	4.400	1,179.64	-	-
华泰证券	2021042700011438	东方财富	2021年4月27日	42,294.00	1,400	28	3.400	111.72	-	-
华泰证券	2021042700011516	沃森生物	2021年4月27日	1,727,320.00	28,000	28	3.400	4,567.92	-	-
华泰证券	2021051100000448	温氏股份	2021年5月11日	27,580.00	2,000	14	3.400	36.54	-	-
华泰证券	2021051100000452	宋城演艺	2021年5月11日	25,454.00	1,300	14	3.400	33.60	-	-
华泰证券	2021051100000454	乐普医疗	2021年5月11日	30,410.00	1,000	14	3.400	40.18	-	-
华泰证券	2021051100000454	亿纬锂能	2021年5月	5,569,312.00	64,400	14	3.400	7,363.86	-	-

	09773		11日								
华泰证券	20210428000 09122	信维通信	2021年4月 28日	350,625.00	12,500	28	3.400	927.08			
华泰证券	20210428000 10642	沃森生物	2021年4月 28日	2,180,765.00	35,500	28	3.400	5,766.88			
华泰证券	20210512000 00590	康泰生物	2021年5月 12日	2,312,604.00	12,600	14	3.400	3,057.74			
华泰证券	20210512000 00592	温氏股份	2021年5月 12日	27,960.00	2,000	14	3.400	36.96			
华泰证券	20210512000 00594	乐普医疗	2021年5月 12日	30,480.00	1,000	14	3.400	40.32			
华泰证券	20210512000 00596	宋城演艺	2021年5月 12日	24,570.00	1,300	14	3.400	32.48			
华泰证券	20210512000 00598	三环集团	2021年5月 12日	36,420.00	1,000	14	3.400	48.16			
华泰证券	20210513000 00355	温氏股份	2021年5月 13日	19,292.00	1,400	14	3.400	25.48			
华泰证券	20210513000 00357	三环集团	2021年5月 13日	35,900.00	1,000	14	3.400	47.46			
华泰证券	20210513000 00359	乐普医疗	2021年5月 13日	30,430.00	1,000	14	3.400	40.18			
华泰证券	20210513000 00361	沃森生物	2021年5月 13日	555,408.00	8,700	14	3.400	734.44			
华泰证券	20210513000 00363	信维通信	2021年5月 13日	25,520.00	1,000	14	3.400	33.74			
华泰证券	20210513000 00365	同花顺	2021年5月 13日	2,830,575.00	27,500	14	3.400	3,742.62			
华泰证券	20210513000 25172	沃森生物	2021年5月 13日	727,776.00	11,400	14	3.400	962.22			
华泰证券	20210517000 00478	温氏股份	2021年5月 17日	14,030.00	1,000	14	3.400	18.62			
华泰证券	20210517000 00480	三环集团	2021年5月 17日	38,000.00	1,000	14	3.400	50.26			
华泰证券	20210517000 00482	沃森生物	2021年5月 17日	1,470,000.00	21,000	14	3.400	1,943.62			
华泰证券	20210518000 00304	三环集团	2021年5月 18日	37,400.00	1,000	14	3.400	49.42			
华泰证券	20210518000 00306	信维通信	2021年5月 18日	26,600.00	1,000	14	3.400	35.14			
华泰证券	20210518000 00308	沃森生物	2021年5月 18日	144,501.00	2,100	14	3.400	191.10			
华泰证券	20210506000 28126	中国通号	2021年5月6 日	264,140.00	47,000	28	1.800	369.88			

华泰证券	20210506000 28128	爱尔眼科	2021年5月6 日	6,363,081.00	87,900	28	1.800	8,908.20	-	-
华泰证券	20210506000 29208	华大基因	2021年5月6 日	170,030.00	1,400	28	3.400	449.68	-	-
华泰证券	20210520000 00391	信维通信	2021年5月 20日	26,800.00	1,000	14	3.400	35.42	-	-
华泰证券	20210520000 16849	温氏股份	2021年5月 20日	28,200.00	2,000	14	3.400	37.24	-	-
华泰证券	20210520000 16851	宋城演艺	2021年5月 20日	23,881.00	1,300	14	3.400	31.64	-	-
华泰证券	20210520000 16853	乐普医疗	2021年5月 20日	32,190.00	1,000	14	3.400	42.56	-	-
华泰证券	20210520000 17059	沃森生物	2021年5月 20日	4,818,800.00	70,000	14	3.400	6,371.54	-	-
华泰证券	20210520000 17061	蓝思科技	2021年5月 20日	30,998.00	1,100	14	3.400	41.02	-	-
华泰证券	20210521000 00363	汇川技术	2021年5月 21日	273,450.00	3,000	14	3.400	361.62	-	-
华泰证券	20210521000 05938	温氏股份	2021年5月 21日	27,560.00	2,000	14	3.400	36.40	-	-
华泰证券	20210521000 05940	乐普医疗	2021年5月 21日	31,730.00	1,000	14	3.400	42.00	-	-
华泰证券	20210521000 05942	宋城演艺	2021年5月 21日	23,582.00	1,300	14	3.400	31.22	-	-
华泰证券	20210524000 05448	温氏股份	2021年5月 24日	27,380.00	2,000	14	3.400	36.26	-	-
华泰证券	20210524000 05450	宋城演艺	2021年5月 24日	23,647.00	1,300	14	3.400	31.22	-	-
华泰证券	20210524000 05452	乐普医疗	2021年5月 24日	31,220.00	1,000	14	3.400	41.30	-	-
华泰证券	20210511000 09775	智飞生物	2021年5月 11日	2,937,480.00	14,000	28	3.400	7,768.04	-	-
华泰证券	20210525000 08938	宋城演艺	2021年5月 25日	23,998.00	1,300	14	3.400	31.78	-	-
华泰证券	20210525000 08940	亿纬锂能	2021年5月 25日	6,909,476.00	64,400	14	3.400	9,135.84	-	-
华泰证券	20210525000 08942	温氏股份	2021年5月 25日	28,020.00	2,000	14	3.400	37.10	-	-
华泰证券	20210525000 08944	乐普医疗	2021年5月 25日	31,890.00	1,000	14	3.400	42.14	-	-
华泰证券	20210512000 09919	宋城演艺	2021年5月 12日	215,460.00	11,400	28	3.400	569.80	-	-
华泰证券	20210526000	康泰生物	2021年5月	2,250,486.00	12,600	14	3.400	2,975.70	-	-

	10270		26 日								
华泰证券	20210526000 10736	温氏股份	2021 年 5 月 26 日	28,120.00	2,000	14	3.400	37.24			
华泰证券	20210526000 10740	三环集团	2021 年 5 月 26 日	37,080.00	1,000	14	3.400	49.00			
华泰证券	20210526000 10742	宋城演艺	2021 年 5 月 26 日	23,959.00	1,300	14	3.400	31.64			
华泰证券	20210526000 10744	乐普医疗	2021 年 5 月 26 日	32,760.00	1,000	14	3.400	43.26			
华泰证券	20210513000 25174	爱尔眼科	2021 年 5 月 13 日	2,332,189.00	31,100	28	3.400	6,167.28			
华泰证券	20210513000 25176	智飞生物	2021 年 5 月 13 日	5,846,400.00	28,000	28	4.400	20,007.68			
华泰证券	20210513000 25178	智飞生物	2021 年 5 月 13 日	1,461,600.00	7,000	28	3.400	3,865.12			
华泰证券	20210527000 00652	温氏股份	2021 年 5 月 27 日	28,540.00	2,000	14	3.400	37.80			
华泰证券	20210527000 00654	宋城演艺	2021 年 5 月 27 日	23,738.00	1,300	14	3.400	31.36			
华泰证券	20210527000 00656	沃森生物	2021 年 5 月 27 日	614,341.00	9,100	14	3.400	812.28			
华泰证券	20210527000 18443	乐普医疗	2021 年 5 月 27 日	34,840.00	1,000	14	3.400	46.06			
华泰证券	20210527000 18445	沃森生物	2021 年 5 月 27 日	587,337.00	8,700	14	3.400	776.58			
华泰证券	20210527000 18447	信维通信	2021 年 5 月 27 日	28,120.00	1,000	14	3.400	37.24			
华泰证券	20210527000 18449	三环集团	2021 年 5 月 27 日	38,420.00	1,000	14	3.400	50.82			
华泰证券	20210527000 18451	沃森生物	2021 年 5 月 27 日	769,614.00	11,400	14	3.400	1,017.66			
华泰证券	20210527000 18453	温氏股份	2021 年 5 月 27 日	19,978.00	1,400	14	3.400	26.46			
华泰证券	20210528000 00468	温氏股份	2021 年 5 月 28 日	19,698.00	1,400	14	3.400	26.04			
华泰证券	20210528000 00470	三环集团	2021 年 5 月 28 日	37,590.00	1,000	14	3.400	49.70			
华泰证券	20210528000 00472	宋城演艺	2021 年 5 月 28 日	23,231.00	1,300	14	3.400	30.66			
华泰证券	20210528000 00474	乐普医疗	2021 年 5 月 28 日	33,950.00	1,000	14	3.400	44.94			
华泰证券	20210601000 02563	三环集团	2021 年 6 月 1 日	37,820.00	1,000	14	3.400	49.98			

华泰证券	20210601000 02565	信维通信	2021年6月1 日	29,080.00	1,000	14	3.400	38.50	-	-
华泰证券	20210519000 02611	中国通号	2021年5月 19日	2,638,818.00	465,400	28	1.800	3,694.32	-	-
华泰证券	20210520000 16913	中国通号	2021年5月 20日	181,760.00	32,000	28	1.800	254.52	-	-
华泰证券	20210603000 10758	蓝思科技	2021年6月3 日	31,856.00	1,100	14	3.400	42.14	-	-
华泰证券	20210521000 06036	亿纬锂能	2021年5月 21日	4,028,800.00	40,000	28	3.400	10,654.00	-	-
华泰证券	20210604000 00256	汇川技术	2021年6月4 日	335,280.00	5,500	14	3.400	443.38	-	-
华泰证券	20210604000 00258	信维通信	2021年6月4 日	229,360.00	8,000	14	3.400	303.24	-	-
华泰证券	20210604000 05333	汇川技术	2021年6月4 日	182,880.00	3,000	14	3.400	241.78	-	-
华泰证券	20210524000 06150	亿纬锂能	2021年5月 24日	715,400.00	7,000	28	3.400	1,891.96	-	-
华泰证券	20210607000 00879	沃森生物	2021年6月7 日	2,269,355.00	34,100	14	3.400	3,000.62	-	-
华泰证券	20210525000 08982	同花顺	2021年5月 25日	421,960.00	3,500	28	3.400	1,115.80	-	-
华泰证券	20210525000 09192	东方财富	2021年5月 25日	53,172.00	1,400	28	3.400	140.56	-	-
华泰证券	20210525000 09684	沃森生物	2021年5月 25日	1,901,480.00	28,000	28	3.400	5,028.24	-	-
华泰证券	20210608000 00552	亿联网络	2021年6月8 日	424,050.00	5,500	14	3.400	560.70	-	-
华泰证券	20210608000 00554	沃森生物	2021年6月8 日	1,132,191.00	17,100	14	3.400	1,497.02	-	-
华泰证券	20210608000 00556	汇川技术	2021年6月8 日	3,027,500.00	50,000	14	3.400	4,003.02	-	-
华泰证券	20210608000 05761	亿纬锂能	2021年6月8 日	6,293,812.00	64,400	14	3.400	8,321.88	-	-
华泰证券	20210526000 10738	沃森生物	2021年5月 26日	2,440,625.00	35,500	28	3.400	6,454.00	-	-
华泰证券	20210526000 10746	信维通信	2021年5月 26日	346,250.00	12,500	28	3.400	915.60	-	-
华泰证券	20210610000 07334	沃森生物	2021年6月 10日	585,949.00	9,100	14	3.400	774.76	-	-
华泰证券	20210610000 07336	沃森生物	2021年6月 10日	560,193.00	8,700	14	3.400	740.74	-	-
华泰证券	20210610000	沃森生物	2021年6月	734,046.00	11,400	14	3.400	970.62	-	-

	07338		10日								
华泰证券	20210610000 07926	信维通信	2021年6月 10日	28,400.00	1,000	14	3.400	37.52			
华泰证券	20210611000 03556	乐普医疗	2021年6月 11日	30,930.00	1,000	14	3.400	40.88			
华泰证券	20210615000 00797	中微公司	2021年6月 15日	6,710,500.00	50,000	14	3.400	8,872.78			
华泰证券	20210615000 00799	华润微	2021年6月 15日	759,000.00	10,000	14	3.400	1,003.52			
华泰证券	20210616000 00534	康泰生物	2021年6月 16日	1,471,600.00	10,000	14	3.400	1,945.72			
华泰证券	20210616000 00536	欧普康视	2021年6月 16日	577,551.00	5,900	14	3.400	763.70			
华泰证券	20210603000 10556	中国通号	2021年6月3 日	266,490.00	47,000	28	1.800	372.96			
华泰证券	20210603000 10760	爱尔眼科	2021年6月3 日	7,515,450.00	87,900	28	1.800	10,521.56			
华泰证券	20210617000 00599	欧普康视	2021年6月 17日	579,675.00	5,900	14	3.400	766.50			
华泰证券	20210618000 00932	先导智能	2021年6月 18日	1,829,100.00	30,000	14	3.400	2,418.50			
华泰证券	20210618000 00934	英科医疗	2021年6月 18日	583,687.00	5,900	14	3.400	771.82			
华泰证券	20210618000 00940	华润微	2021年6月 18日	1,471,572.00	16,400	14	3.400	1,945.72			
华泰证券	20210618000 00944	阳光电源	2021年6月 18日	1,989,800.00	20,000	14	3.400	2,631.02			
华泰证券	20210618000 00946	芒果超媒	2021年6月 18日	17,082,500.00	250,000	14	3.400	22,586.90			
华泰证券	20210618000 00954	亿纬锂能	2021年6月 18日	1,054,500.00	10,000	14	3.400	1,394.26			
华泰证券	20210621000 00661	华熙生物	2021年6月 21日	7,763,700.00	30,000	14	3.400	10,265.36			
华泰证券	20210621000 00667	先导智能	2021年6月 21日	1,220,400.00	20,000	14	3.400	1,613.64			
华泰证券	20210621000 00671	阳光电源	2021年6月 21日	2,056,000.00	20,000	14	3.400	2,718.52			
华泰证券	20210621000 00713	沪硅产业	2021年6月 21日	1,501,000.00	50,000	14	3.400	1,984.64			
华泰证券	20210621000 11643	沃森生物	2021年6月 21日	2,034,065.00	34,100	14	3.400	2,689.54			
华泰证券	20210608000 05759	智飞生物	2021年6月8 日	2,617,720.00	14,000	28	3.400	6,922.44			

华泰证券	20210622000 01296	华润微	2021年6月 22日	1,181,040.00	13,300	14	3.400	1,561.56	-	-
华泰证券	20210622000 01298	温氏股份	2021年6月 22日	1,251,000.00	90,000	14	3.400	1,654.10	-	-
华泰证券	20210622000 01300	先导智能	2021年6月 22日	1,198,000.00	20,000	14	3.400	1,583.96	-	-
华泰证券	20210622000 01302	阳光电源	2021年6月 22日	1,020,900.00	10,000	14	3.400	1,349.88	-	-
华泰证券	20210622000 11578	亿联网络	2021年6月 22日	415,250.00	5,500	14	3.400	549.08	-	-
华泰证券	20210622000 11654	汇川技术	2021年6月 22日	3,375,500.00	50,000	14	3.400	4,463.20	-	-
华泰证券	20210622000 11656	沃森生物	2021年6月 22日	1,050,282.00	17,100	14	3.400	1,388.66	-	-
华泰证券	20210622000 11768	亿纬锂能	2021年6月 22日	6,536,600.00	64,400	14	3.400	8,642.90	-	-
华泰证券	20210623000 00994	先导智能	2021年6月 23日	1,769,700.00	30,000	14	3.400	2,339.96	-	-
华泰证券	20210623000 00996	阳光电源	2021年6月 23日	1,025,000.00	10,000	14	3.400	1,355.34	-	-
华泰证券	20210610000 07928	爱尔眼科	2021年6月 10日	2,706,011.00	31,100	28	3.400	7,155.96	-	-
华泰证券	20210610000 08082	智飞生物	2021年6月 10日	1,281,000.00	7,000	28	3.400	3,387.44	-	-
华泰证券	20210610000 08084	智飞生物	2021年6月 10日	5,124,000.00	28,000	28	4.400	17,535.56	-	-
华泰证券	20210624000 00692	沪硅产业	2021年6月 24日	1,125,930.00	39,000	14	3.400	1,488.76	-	-
华泰证券	20210624000 00694	华润微	2021年6月 24日	880,600.00	10,000	14	3.400	1,164.38	-	-
华泰证券	20210624000 00718	英科医疗	2021年6月 24日	1,021,100.00	10,000	14	3.400	1,350.16	-	-
华泰证券	20210624000 00720	阳光电源	2021年6月 24日	1,069,100.00	10,000	14	3.400	1,413.58	-	-
华泰证券	20210624000 00722	先导智能	2021年6月 24日	1,120,000.00	20,000	14	3.400	1,480.92	-	-
华泰证券	20210624000 08869	沃森生物	2021年6月 24日	543,543.00	9,100	14	3.400	718.62	-	-
华泰证券	20210624000 08871	沃森生物	2021年6月 24日	519,651.00	8,700	14	3.400	687.12	-	-
华泰证券	20210624000 08873	沃森生物	2021年6月 24日	680,922.00	11,400	14	3.400	900.34	-	-
华泰证券	20210624000	信维通信	2021年6月	31,690.00	1,000	14	3.400	41.86	-	-

	09067		24 日							
华泰证券	20210625000 00484	英科医疗	2021 年 6 月 25 日	1,050,000.00	10,000	14	3.400	1,388.38	-	-
华泰证券	20210625000 00486	沪硅产业	2021 年 6 月 25 日	795,984.00	27,600	14	3.400	1,052.52	-	-
华泰证券	20210625000 00488	华润微	2021 年 6 月 25 日	1,111,446.00	12,600	14	3.400	1,469.58	-	-
华泰证券	20210628000 00462	华润微	2021 年 6 月 28 日	890,300.00	10,000	14	3.400	1,177.12	-	-
华泰证券	20210629000 17921	中微公司	2021 年 6 月 29 日	8,094,500.00	50,000	14	3.400	10,702.72	-	-
华泰证券	20210616000 07187	中国通号	2021 年 6 月 16 日	2,592,278.00	465,400	28	1.800	3,629.08	-	-
华泰证券	20210630000 00595	中微公司	2021 年 6 月 30 日	3,318,400.00	20,000	14	3.400	4,387.60	-	-
华泰证券	20210630000 06121	欧普康视	2021 年 6 月 30 日	610,945.00	5,900	14	3.400	807.80	-	-
华泰证券	20210630000 06123	康泰生物	2021 年 6 月 30 日	1,490,000.00	10,000	14	3.400	1,970.08	-	-
华泰证券	20210617000 17115	中国通号	2021 年 6 月 17 日	180,160.00	32,000	28	1.800	252.28	-	-
华泰证券	20210701000 00500	沪硅产业	2021 年 7 月 1 日	279,000.00	10,000	14	3.400	368.90	-	-
华泰证券	20210701000 13852	欧普康视	2021 年 7 月 1 日	619,500.00	5,900	14	3.400	819.14	-	-
华泰证券	20210618000 00956	沃森生物	2021 年 6 月 18 日	1,768,500.00	30,000	28	3.400	4,676.84	-	-
华泰证券	20210702000 00525	沪硅产业	2021 年 7 月 2 日	649,040.00	24,400	14	3.400	858.20	-	-
华泰证券	20210702000 00527	华润微	2021 年 7 月 2 日	1,327,590.00	14,900	14	3.400	1,755.32	-	-
华泰证券	20210702000 00533	英科医疗	2021 年 7 月 2 日	952,320.00	8,000	14	3.400	1,259.16	-	-
华泰证券	20210702000 10546	英科医疗	2021 年 7 月 2 日	702,336.00	5,900	14	3.400	928.62	-	-
华泰证券	20210702000 10548	阳光电源	2021 年 7 月 2 日	2,101,800.00	20,000	14	3.400	2,779.00	-	-
华泰证券	20210702000 10550	华润微	2021 年 7 月 2 日	1,461,240.00	16,400	14	3.400	1,932.14	-	-
华泰证券	20210705000 10881	沪硅产业	2021 年 7 月 5 日	1,387,000.00	50,000	14	3.400	1,833.86	-	-
华泰证券	20210705000 10883	华熙生物	2021 年 7 月 5 日	9,177,000.00	30,000	14	3.400	12,134.08	-	-

华泰证券	20210705000 11583	阳光电源	2021年7月5日	2,154,400.00	20,000	14	3.400	2,848.58	-	-
华泰证券	20210622000 01304	爱尔眼科	2021年6月22日	1,746,000.00	20,000	28	3.400	4,617.20	-	-
华泰证券	20210706000 01076	华润微	2021年7月6日	860,300.00	10,000	14	3.400	1,137.50	-	-
华泰证券	20210706000 10718	亿纬锂能	2021年7月6日	6,539,820.00	64,400	14	3.400	8,647.10	-	-
华泰证券	20210706000 11224	阳光电源	2021年7月6日	1,053,000.00	10,000	14	3.400	1,392.30	-	-
华泰证券	20210706000 11310	亿联网络	2021年7月6日	469,150.00	5,500	14	3.400	620.34	-	-
华泰证券	20210623000 18432	沃森生物	2021年6月23日	2,167,985.00	35,500	28	3.400	5,733.00	-	-
华泰证券	20210623000 18492	信维通信	2021年6月23日	395,125.00	12,500	28	3.400	1,044.96	-	-
华泰证券	20210707000 01681	华润微	2021年7月7日	1,135,687.00	13,300	14	3.400	1,501.64	-	-
华泰证券	20210707000 01683	英科医疗	2021年7月7日	1,161,500.00	10,000	14	3.400	1,535.80	-	-
华泰证券	20210707000 01685	阳光电源	2021年7月7日	3,630,840.00	31,600	14	3.400	4,800.74	-	-
华泰证券	20210707000 15897	阳光电源	2021年7月7日	1,149,000.00	10,000	14	3.400	1,519.28	-	-
华泰证券	20210708000 07553	华润微	2021年7月8日	878,000.00	10,000	14	3.400	1,160.88	-	-
华泰证券	20210708000 07555	阳光电源	2021年7月8日	1,183,500.00	10,000	14	3.400	1,564.92	-	-
华泰证券	20210708000 07557	信维通信	2021年7月8日	32,100.00	1,000	14	3.400	42.42	-	-
华泰证券	20210708000 07659	先导智能	2021年7月8日	1,283,200.00	20,000	14	3.400	1,696.66	-	-
华泰证券	20210708000 07663	沃森生物	2021年7月8日	545,490.00	8,700	14	3.400	721.28	-	-
华泰证券	20210708000 07665	沃森生物	2021年7月8日	714,780.00	11,400	14	3.400	945.14	-	-
华泰证券	20210708000 07667	沃森生物	2021年7月8日	570,570.00	9,100	14	3.400	754.46	-	-
华泰证券	20210708000 07733	英科医疗	2021年7月8日	1,132,400.00	10,000	14	3.400	1,497.30	-	-
华泰证券	20210708000 07735	沪硅产业	2021年7月8日	1,152,840.00	39,000	14	3.400	1,524.32	-	-
华泰证券	20210709000	华润微	2021年7月9日	1,085,868.00	12,600	14	3.400	1,435.70	-	-

	05621		日								
华泰证券	20210709000 05623	沪硅产业	2021年7月9 日	810,888.00	27,600	14	3.400	1,072.12	-	-	
华泰证券	20210709000 05625	英科医疗	2021年7月9 日	1,194,900.00	10,000	14	3.400	1,579.90	-	-	
华泰证券	20210712000 03461	华润微	2021年7月 12日	868,300.00	10,000	14	3.400	1,148.14	-	-	
华泰证券	20210713000 01216	阳光电源	2021年7月 13日	23,796,000.00	200,000	14	3.400	31,463.60	-	-	
华泰证券	20210713000 19517	中微公司	2021年7月 13日	8,400,000.00	50,000	14	3.400	11,106.62	-	-	
华泰证券	20210714000 06408	中微公司	2021年7月 14日	3,360,000.00	20,000	14	3.400	4,442.62	-	-	
华泰证券	20210714000 06410	康泰生物	2021年7月 14日	1,521,200.00	10,000	14	3.400	2,011.38	-	-	
华泰证券	20210714000 06412	欧普康视	2021年7月 14日	603,452.00	5,900	14	3.400	797.86	-	-	
华泰证券	20210701000 00502	乐普医疗	2021年7月1 日	1,595,000.00	50,000	28	3.400	4,217.92	-	-	
华泰证券	20210701000 00504	同花顺	2021年7月1 日	1,417,130.00	13,000	28	3.400	3,747.52	-	-	
华泰证券	20210701000 14010	中国通号	2021年7月1 日	267,430.00	47,000	28	1.800	374.36	-	-	
华泰证券	20210715000 15036	欧普康视	2021年7月 15日	592,183.00	5,900	14	3.400	783.02	-	-	
华泰证券	20210715000 16524	沪硅产业	2021年7月 15日	270,200.00	10,000	14	3.400	357.28	-	-	
华泰证券	20210702000 00529	乐普医疗	2021年7月2 日	1,547,500.00	50,000	28	3.400	4,092.20	-	-	
华泰证券	20210702000 00531	同花顺	2021年7月2 日	1,381,379.00	12,700	28	3.400	3,652.88	-	-	
华泰证券	20210716000 00456	英科医疗	2021年7月 16日	721,680.00	6,000	14	3.400	954.24	-	-	
华泰证券	20210716000 15840	英科医疗	2021年7月 16日	962,240.00	8,000	14	3.400	1,272.32	-	-	
华泰证券	20210716000 15842	华润微	2021年7月 16日	1,328,072.00	16,400	14	3.400	1,756.02	-	-	
华泰证券	20210716000 15846	华润微	2021年7月 16日	1,206,602.00	14,900	14	3.400	1,595.44	-	-	
华泰证券	20210716000 16218	阳光电源	2021年7月 16日	2,518,000.00	20,000	14	3.400	3,329.34	-	-	
华泰证券	20210716000 16222	沪硅产业	2021年7月 16日	662,460.00	24,400	14	3.400	875.98	-	-	

华泰证券	20210716000 16224	英科医疗	2021年7月 16日	709,652.00	5,900	14	3.400	938.28	-	-
华泰证券	20210705000 00943	乐普医疗	2021年7月5 日	719,295.00	23,700	28	3.400	1,902.04	-	-
华泰证券	20210719000 12803	华熙生物	2021年7月 19日	8,790,900.00	30,000	14	3.400	11,623.50	-	-
华泰证券	20210719000 12805	沪硅产业	2021年7月 19日	1,349,000.00	50,000	14	3.400	1,783.74	-	-
华泰证券	20210719000 12843	阳光电源	2021年7月 19日	2,540,200.00	20,000	14	3.400	3,358.74	-	-
华泰证券	20210706000 01078	芒果超媒	2021年7月6 日	996,000.00	16,600	28	3.400	2,633.96	-	-
华泰证券	20210706000 10716	智飞生物	2021年7月6 日	2,408,140.00	14,000	28	3.400	6,368.32	-	-
华泰证券	20210720000 11955	阳光电源	2021年7月 20日	1,261,000.00	10,000	14	3.400	1,667.26	-	-
华泰证券	20210720000 11957	华润微	2021年7月 20日	825,600.00	10,000	14	3.400	1,091.58	-	-
华泰证券	20210720000 11961	亿纬锂能	2021年7月 20日	7,630,756.00	64,400	14	3.400	10,089.52	-	-
华泰证券	20210707000 01687	芒果超媒	2021年7月7 日	320,814.00	5,400	28	3.400	848.40	-	-
华泰证券	20210721000 00507	健帆生物	2021年7月 21日	684,600.00	8,400	14	3.400	905.24	-	-
华泰证券	20210721000 16715	华润微	2021年7月 21日	1,104,299.00	13,300	14	3.400	1,460.20	-	-
华泰证券	20210721000 16717	阳光电源	2021年7月 21日	4,360,168.00	31,600	14	3.400	5,765.06	-	-
华泰证券	20210721000 19975	阳光电源	2021年7月 21日	1,379,800.00	10,000	14	3.400	1,824.34	-	-
华泰证券	20210721000 19979	英科医疗	2021年7月 21日	1,149,100.00	10,000	14	3.400	1,519.42	-	-
华泰证券	20210708000 07661	智飞生物	2021年7月8 日	1,274,350.00	7,000	28	3.400	3,370.08	-	-
华泰证券	20210708000 07737	爱尔眼科	2021年7月8 日	2,017,768.00	31,100	28	3.400	5,335.96	-	-
华泰证券	20210722000 00835	亿联网络	2021年7月 22日	394,002.00	4,200	14	3.400	520.94	-	-
华泰证券	20210722000 06984	沃森生物	2021年7月 22日	664,680.00	8,700	14	3.400	878.92	-	-
华泰证券	20210722000 06986	沃森生物	2021年7月 22日	870,960.00	11,400	14	3.400	1,151.64	-	-
华泰证券	20210722000	沃森生物	2021年7月	695,240.00	9,100	14	3.400	919.24	-	-

	06988		22 日								
华泰证券	20210722000 06990	阳光电源	2021 年 7 月 22 日	1,430,500.00	10,000	14	3.400	1,891.40	-	-	
华泰证券	20210722000 06992	先导智能	2021 年 7 月 22 日	1,330,000.00	20,000	14	3.400	1,758.54	-	-	
华泰证券	20210722000 06994	英科医疗	2021 年 7 月 22 日	1,139,000.00	10,000	14	3.400	1,505.98	-	-	
华泰证券	20210722000 08614	华润微	2021 年 7 月 22 日	878,100.00	10,000	14	3.400	1,161.02	-	-	
华泰证券	20210722000 08616	沪硅产业	2021 年 7 月 22 日	1,187,160.00	39,000	14	3.400	1,569.68	-	-	
华泰证券	20210709000 00560	康泰生物	2021 年 7 月 9 日	1,395,000.00	10,000	28	3.400	3,689.00	-	-	
华泰证券	20210709000 00562	沃森生物	2021 年 7 月 9 日	665,689.00	10,300	28	3.400	1,760.36	-	-	
华泰证券	20210723000 05353	英科医疗	2021 年 7 月 23 日	1,059,000.00	10,000	14	3.400	1,400.28	-	-	
华泰证券	20210723000 06549	华润微	2021 年 7 月 23 日	1,085,616.00	12,600	14	3.400	1,435.42	-	-	
华泰证券	20210723000 06551	沪硅产业	2021 年 7 月 23 日	831,312.00	27,600	14	3.400	1,099.14	-	-	
华泰证券	20210726000 05458	华润微	2021 年 7 月 26 日	900,300.00	10,000	14	3.400	1,190.42	-	-	
华泰证券	20210713000 01214	同花顺	2021 年 7 月 13 日	2,021,482.00	19,300	28	3.400	5,345.76	-	-	
华泰证券	20210727000 20195	中微公司	2021 年 7 月 27 日	10,048,000.00	50,000	14	3.400	13,285.72	-	-	
华泰证券	20210727000 20435	阳光电源	2021 年 7 月 27 日	25,194,000.00	200,000	14	3.400	33,312.02	-	-	
华泰证券	20210714000 00532	澜起科技	2021 年 7 月 14 日	941,700.00	14,600	28	3.400	2,490.32	-	-	
华泰证券	20210714000 00534	同花顺	2021 年 7 月 14 日	1,435,890.00	13,800	28	3.400	3,797.08	-	-	
华泰证券	20210728000 00795	宋城演艺	2021 年 7 月 28 日	3,517,857.00	265,900	14	3.400	4,651.36	-	-	
华泰证券	20210728000 08072	欧普康视	2021 年 7 月 28 日	520,380.00	5,900	14	3.400	688.10	-	-	
华泰证券	20210728000 08074	中微公司	2021 年 7 月 28 日	3,913,000.00	20,000	14	3.400	5,173.84	-	-	
华泰证券	20210715000 01021	沃森生物	2021 年 7 月 15 日	498,760.00	7,400	28	3.400	1,319.08	-	-	
华泰证券	20210715000 01023	信维通信	2021 年 7 月 15 日	742,835.00	23,500	28	3.400	1,964.48	-	-	

华泰证券	20210715000 15032	中国通号	2021年7月 15日	172,480.00	32,000	28	1.800	241.36	-	-
华泰证券	20210729000 16099	欧普康视	2021年7月 29日	544,334.00	5,900	14	3.400	719.74	-	-
华泰证券	20210729000 16107	沪硅产业	2021年7月 29日	349,700.00	10,000	14	3.400	462.42	-	-
华泰证券	20210716000 15844	沃森生物	2021年7月 16日	2,216,400.00	30,000	28	3.400	5,861.24	-	-
华泰证券	20210730000 01023	沃森生物	2021年7月 30日	1,513,424.00	17,600	14	3.400	2,001.02	-	-
华泰证券	20210730000 01025	信维通信	2021年7月 30日	380,289.00	14,700	14	3.400	502.88	-	-
华泰证券	20210730000 13092	华润微	2021年7月 30日	1,490,000.00	14,900	14	3.400	1,970.08	-	-
华泰证券	20210730000 13094	华润微	2021年7月 30日	1,640,000.00	16,400	14	3.400	2,168.46	-	-
华泰证券	20210730000 13096	沪硅产业	2021年7月 30日	917,440.00	24,400	14	3.400	1,213.10	-	-
华泰证券	20210730000 13100	阳光电源	2021年7月 30日	3,356,000.00	20,000	14	3.400	4,437.44	-	-
华泰证券	20210730000 13102	英科医疗	2021年7月 30日	935,920.00	8,000	14	3.400	1,237.46	-	-
华泰证券	20210730000 13106	英科医疗	2021年7月 30日	701,940.00	6,000	14	3.400	928.06	-	-
华泰证券	20210730000 13108	英科医疗	2021年7月 30日	690,241.00	5,900	14	3.400	912.66	-	-
华泰证券	20210802000 13098	华熙生物	2021年8月2 日	6,753,000.00	30,000	14	3.400	8,928.92	-	-
华泰证券	20210802000 13100	沪硅产业	2021年8月2 日	1,891,500.00	50,000	14	3.400	2,500.96	-	-
华泰证券	20210802000 13790	阳光电源	2021年8月2 日	3,212,000.00	20,000	14	3.400	4,247.04	-	-
华泰证券	20210720000 01099	温氏股份	2021年7月 20日	393,316.00	30,800	28	3.400	1,040.20	-	-
华泰证券	20210720000 11959	爱尔眼科	2021年7月 20日	1,327,600.00	20,000	28	3.400	3,510.64	-	-
华泰证券	20210803000 12736	亿纬锂能	2021年8月3 日	7,093,660.00	64,400	14	3.400	9,379.44	-	-
华泰证券	20210803000 12744	阳光电源	2021年8月3 日	1,439,800.00	10,000	14	3.400	1,903.72	-	-
华泰证券	20210803000 12756	华润微	2021年8月3 日	866,600.00	10,000	14	3.400	1,145.90	-	-
华泰证券	20210721000	沃森生物	2021年7月	2,768,645.00	35,500	28	3.400	7,321.44	-	-

	19977		21 日								
华泰证券	20210721000 19981	信维通信	2021 年 7 月 21 日	327,500.00	12,500	28	3.400	866.04			
华泰证券	20210804000 00897	英科医疗	2021 年 8 月 4 日	1,185,129.00	9,900	14	3.400	1,567.02			
华泰证券	20210804000 17594	阳光电源	2021 年 8 月 4 日	4,844,280.00	31,600	14	3.400	6,405.28			
华泰证券	20210804000 18398	华润微	2021 年 8 月 4 日	1,195,803.00	13,300	14	3.400	1,581.16			
华泰证券	20210804000 18400	英科医疗	2021 年 8 月 4 日	1,197,100.00	10,000	14	3.400	1,582.84			
华泰证券	20210804000 18402	阳光电源	2021 年 8 月 4 日	1,533,000.00	10,000	14	3.400	2,026.92			
华泰证券	20210804000 18404	健帆生物	2021 年 8 月 4 日	514,080.00	8,400	14	3.400	679.70			
华泰证券	20210805000 09009	先导智能	2021 年 8 月 5 日	1,552,000.00	20,000	14	3.400	2,052.12			
华泰证券	20210805000 10383	沃森生物	2021 年 8 月 5 日	815,886.00	8,700	14	3.400	1,078.84			
华泰证券	20210805000 10385	英科医疗	2021 年 8 月 5 日	1,143,100.00	10,000	14	3.400	1,511.44			
华泰证券	20210805000 10387	阳光电源	2021 年 8 月 5 日	1,543,100.00	10,000	14	3.400	2,040.36			
华泰证券	20210805000 10389	沃森生物	2021 年 8 月 5 日	853,398.00	9,100	14	3.400	1,128.40			
华泰证券	20210805000 10391	沃森生物	2021 年 8 月 5 日	1,069,092.00	11,400	14	3.400	1,413.58			
华泰证券	20210805000 10393	沪硅产业	2021 年 8 月 5 日	1,360,320.00	39,000	14	3.400	1,798.72			
华泰证券	20210805000 10395	华润微	2021 年 8 月 5 日	894,600.00	10,000	14	3.400	1,182.86			
华泰证券	20210723000 00249	中国通号	2021 年 7 月 23 日	3,612,393.00	680,300	28	2.000	5,619.32			
华泰证券	20210806000 07580	英科医疗	2021 年 8 月 6 日	1,090,100.00	10,000	14	3.400	1,441.30			
华泰证券	20210806000 07582	华润微	2021 年 8 月 6 日	1,119,636.00	12,600	14	3.400	1,480.36			
华泰证券	20210806000 07584	沪硅产业	2021 年 8 月 6 日	916,872.00	27,600	14	3.400	1,212.26			
华泰证券	20210726000 00858	亿纬锂能	2021 年 7 月 26 日	13,486,107.00	112,300	28	3.400	35,663.32			
华泰证券	20210809000 04776	华润微	2021 年 8 月 9 日	845,000.00	10,000	14	3.400	1,117.34			

华泰证券	202107270000769	东方财富	2021年7月27日	443,014.00	14,300	28	3.400	1,171.52	-	-
华泰证券	2021081000021613	阳光电源	2021年8月10日	30,892,000.00	200,000	14	3.400	40,846.12	-	-
华泰证券	2021081000021621	中微公司	2021年8月10日	9,027,500.00	50,000	14	3.400	11,936.40	-	-
华泰证券	2021072800000797	芒果超媒	2021年7月28日	1,027,650.00	19,500	28	3.400	2,717.68	-	-
华泰证券	2021081100010748	中微公司	2021年8月11日	3,646,000.00	20,000	14	3.400	4,820.76	-	-
华泰证券	2021081100010752	欧普康视	2021年8月11日	530,941.00	5,900	14	3.400	701.96	-	-
华泰证券	2021081100010754	宋城演艺	2021年8月11日	3,523,175.00	265,900	14	3.400	4,658.36	-	-
华泰证券	2021072900000713	中国通号	2021年7月29日	55,880.00	11,000	28	2.000	86.80	-	-
华泰证券	2021072900000715	爱尔眼科	2021年7月29日	4,996,719.00	81,900	28	3.400	13,213.48	-	-
华泰证券	2021072900000717	宋城演艺	2021年7月29日	13,330.00	1,000	28	3.400	35.28	-	-
华泰证券	2021072900016101	乐普医疗	2021年7月29日	1,284,500.00	50,000	28	3.400	3,396.68	-	-
华泰证券	2021072900016103	同花顺	2021年7月29日	1,234,870.00	13,000	28	3.400	3,265.64	-	-
华泰证券	2021072900016105	中国通号	2021年7月29日	238,760.00	47,000	28	1.800	334.32	-	-
华泰证券	2021081200016851	沪硅产业	2021年8月12日	332,200.00	10,000	14	3.400	439.18	-	-
华泰证券	2021081200016857	欧普康视	2021年8月12日	526,280.00	5,900	14	3.400	695.80	-	-
华泰证券	2021073000013098	乐普医疗	2021年7月30日	1,289,000.00	50,000	28	3.400	3,408.72	-	-
华泰证券	2021073000013104	同花顺	2021年7月30日	1,176,909.00	12,700	28	3.400	3,112.20	-	-
华泰证券	2021081300042476	华润微	2021年8月13日	1,363,660.00	16,400	14	3.400	1,803.06	-	-
华泰证券	2021081300042478	华润微	2021年8月13日	1,238,935.00	14,900	14	3.400	1,638.14	-	-
华泰证券	2021081300042480	沪硅产业	2021年8月13日	760,792.00	24,400	14	3.400	1,005.90	-	-
华泰证券	2021081300042482	英科医疗	2021年8月13日	659,820.00	6,000	14	3.400	872.48	-	-
华泰证券	20210813000	英科医疗	2021年8月	648,823.00	5,900	14	3.400	857.92	-	-

	42484		13 日							
华泰证券	20210813000 42486	英科医疗	2021 年 8 月 13 日	879,760.00	8,000	14	3.400	1,163.26	-	-
华泰证券	20210813000 42488	信维通信	2021 年 8 月 13 日	386,022.00	14,700	14	3.400	510.44	-	-
华泰证券	20210813000 42490	阳光电源	2021 年 8 月 13 日	2,879,600.00	20,000	14	3.400	3,807.44	-	-
华泰证券	20210813000 42494	沃森生物	2021 年 8 月 13 日	1,350,272.00	17,600	14	3.400	1,785.42	-	-
华泰证券	20210802000 13792	乐普医疗	2021 年 8 月 2 日	620,229.00	23,700	28	3.400	1,640.24	-	-
华泰证券	20210816000 12199	华熙生物	2021 年 8 月 16 日	6,561,000.00	30,000	14	3.400	8,675.10	-	-
华泰证券	20210816000 12201	沪硅产业	2021 年 8 月 16 日	1,572,000.00	50,000	14	3.400	2,078.58	-	-
华泰证券	20210816000 13623	阳光电源	2021 年 8 月 16 日	2,816,000.00	20,000	14	3.400	3,723.44	-	-
华泰证券	20210803000 12740	智飞生物	2021 年 8 月 3 日	2,448,740.00	14,000	28	3.400	6,475.56	-	-
华泰证券	20210817000 12860	华润微	2021 年 8 月 17 日	819,700.00	10,000	14	3.400	1,083.88	-	-
华泰证券	20210817000 12892	亿纬锂能	2021 年 8 月 17 日	6,721,428.00	64,400	14	3.400	8,887.20	-	-
华泰证券	20210817000 12894	阳光电源	2021 年 8 月 17 日	1,447,000.00	10,000	14	3.400	1,913.24	-	-
华泰证券	20210804000 17592	芒果超媒	2021 年 8 月 4 日	285,660.00	5,400	28	3.400	755.44	-	-
华泰证券	20210818000 18552	华润微	2021 年 8 月 18 日	1,065,330.00	13,300	14	3.400	1,408.54	-	-
华泰证券	20210818000 18554	阳光电源	2021 年 8 月 18 日	1,345,000.00	10,000	14	3.400	1,778.42	-	-
华泰证券	20210818000 18556	阳光电源	2021 年 8 月 18 日	4,250,200.00	31,600	14	3.400	5,619.74	-	-
华泰证券	20210818000 18558	健帆生物	2021 年 8 月 18 日	455,784.00	8,400	14	3.400	602.70	-	-
华泰证券	20210818000 18560	英科医疗	2021 年 8 月 18 日	1,056,825.00	9,900	14	3.400	1,397.34	-	-
华泰证券	20210818000 18562	英科医疗	2021 年 8 月 18 日	1,067,500.00	10,000	14	3.400	1,411.48	-	-
华泰证券	20210805000 00783	温氏股份	2021 年 8 月 5 日	1,250,565.00	95,100	28	3.400	3,307.08	-	-
华泰证券	20210805000 10397	智飞生物	2021 年 8 月 5 日	1,240,610.00	7,000	28	3.400	3,280.76	-	-

华泰证券	20210819000 11053	沪硅产业	2021年8月 19日	1,195,740.00	39,000	14	3.400	1,581.02	-	-
华泰证券	20210819000 11055	沃森生物	2021年8月 19日	737,646.00	9,100	14	3.400	975.38	-	-
华泰证券	20210819000 11057	英科医疗	2021年8月 19日	1,049,900.00	10,000	14	3.400	1,388.24	-	-
华泰证券	20210819000 11059	阳光电源	2021年8月 19日	1,371,700.00	10,000	14	3.400	1,813.70	-	-
华泰证券	20210819000 11061	沃森生物	2021年8月 19日	705,222.00	8,700	14	3.400	932.40	-	-
华泰证券	20210819000 11063	沃森生物	2021年8月 19日	924,084.00	11,400	14	3.400	1,221.78	-	-
华泰证券	20210819000 11531	华润微	2021年8月 19日	851,900.00	10,000	14	3.400	1,126.44	-	-
华泰证券	20210806000 07588	康泰生物	2021年8月6 日	1,453,100.00	10,000	28	3.400	3,842.72	-	-
华泰证券	20210806000 07590	沃森生物	2021年8月6 日	893,010.00	10,300	28	3.400	2,361.52	-	-
华泰证券	20210820000 07644	华润微	2021年8月 20日	1,099,980.00	12,600	14	3.400	1,454.46	-	-
华泰证券	20210820000 07646	沪硅产业	2021年8月 20日	856,428.00	27,600	14	3.400	1,132.46	-	-
华泰证券	20210820000 07650	英科医疗	2021年8月 20日	1,024,700.00	10,000	14	3.400	1,354.92	-	-
华泰证券	20210823000 07657	华润微	2021年8月 23日	866,600.00	10,000	14	3.400	1,145.90	-	-
华泰证券	20210810000 21617	同花顺	2021年8月 10日	1,916,297.00	19,300	28	3.400	5,067.44	-	-
华泰证券	20210824000 17973	中微公司	2021年8月 24日	9,100,000.00	50,000	14	3.400	12,032.16	-	-
华泰证券	20210824000 19307	阳光电源	2021年8月 24日	29,418,000.00	200,000	14	3.400	38,897.18	-	-
华泰证券	20210811000 10750	澜起科技	2021年8月 11日	939,072.00	14,600	28	3.400	2,483.32	-	-
华泰证券	20210811000 10756	同花顺	2021年8月 11日	1,359,162.00	13,800	28	3.400	3,594.36	-	-
华泰证券	20210825000 07973	中微公司	2021年8月 25日	3,570,200.00	20,000	14	3.400	4,720.66	-	-
华泰证券	20210825000 07977	欧普康视	2021年8月 25日	468,460.00	5,900	14	3.400	619.36	-	-
华泰证券	20210812000 00326	温氏股份	2021年8月 12日	1,413,146.00	104,600	28	3.400	3,736.88	-	-
华泰证券	20210812000	信维通信	2021年8月	626,745.00	23,500	28	3.400	1,657.32	-	-

	16853		12日							
华泰证券	20210812000 16855	沃森生物	2021年8月 12日	597,772.00	7,400	28	3.400	1,580.88	-	-
华泰证券	20210826000 15509	沪硅产业	2021年8月 26日	290,000.00	10,000	14	3.400	383.46	-	-
华泰证券	20210826000 15587	欧普康视	2021年8月 26日	444,034.00	5,900	14	3.400	587.16	-	-
华泰证券	20210813000 00523	温氏股份	2021年8月 13日	1,031,036.00	76,600	28	3.400	2,726.64	-	-
华泰证券	20210813000 42492	沃森生物	2021年8月 13日	2,301,600.00	30,000	28	3.400	6,086.36	-	-
华泰证券	20210827000 12595	华润微	2021年8月 27日	1,328,400.00	16,400	14	3.400	1,756.44	-	-
华泰证券	20210827000 12597	华润微	2021年8月 27日	1,206,900.00	14,900	14	3.400	1,595.86	-	-
华泰证券	20210827000 12599	沪硅产业	2021年8月 27日	714,676.00	24,400	14	3.400	945.00	-	-
华泰证券	20210827000 12601	英科医疗	2021年8月 27日	631,260.00	6,000	14	3.400	834.68	-	-
华泰证券	20210827000 12603	英科医疗	2021年8月 27日	841,680.00	8,000	14	3.400	1,112.86	-	-
华泰证券	20210827000 12605	英科医疗	2021年8月 27日	620,739.00	5,900	14	3.400	820.82	-	-
华泰证券	20210827000 12611	阳光电源	2021年8月 27日	2,983,600.00	20,000	14	3.400	3,944.92	-	-
华泰证券	20210827000 12613	沃森生物	2021年8月 27日	1,435,808.00	17,600	14	3.400	1,898.40	-	-
华泰证券	20210830000 15481	华熙生物	2021年8月 30日	5,579,400.00	30,000	14	3.400	7,377.16	-	-
华泰证券	20210830000 15483	沪硅产业	2021年8月 30日	1,499,000.00	50,000	14	3.400	1,981.98	-	-
华泰证券	20210830000 15491	阳光电源	2021年8月 30日	3,247,600.00	20,000	14	3.400	4,294.08	-	-
华泰证券	20210817000 00692	芒果超媒	2021年8月 17日	3,640,390.00	68,300	28	3.400	9,626.68	-	-
华泰证券	20210817000 12890	温氏股份	2021年8月 17日	403,480.00	30,800	28	3.400	1,067.08	-	-
华泰证券	20210817000 12896	爱尔眼科	2021年8月 17日	1,040,000.00	20,000	28	3.400	2,750.16	-	-
华泰证券	20210831000 00307	宋城演艺	2021年8月 31日	681,488.00	44,600	14	3.400	901.04	-	-
华泰证券	20210831000 12105	华润微	2021年8月 31日	754,000.00	10,000	14	3.400	996.94	-	-

华泰证券	20210831000 12113	阳光电源	2021年8月 31日	1,572,800.00	10,000	14	3.400	2,079.56	-	-
华泰证券	20210818000 00581	温氏股份	2021年8月 18日	785,652.00	59,700	28	3.400	2,077.60	-	-
华泰证券	20210901000 16219	华润微	2021年9月1 日	1,009,603.00	13,300	14	3.400	1,334.90	-	-
华泰证券	20210901000 19189	英科医疗	2021年9月1 日	1,028,700.00	10,000	14	3.400	1,360.24	-	-
华泰证券	20210901000 19191	英科医疗	2021年9月1 日	1,018,413.00	9,900	14	3.400	1,346.52	-	-
华泰证券	20210901000 19193	阳光电源	2021年9月1 日	1,420,900.00	10,000	14	3.400	1,878.80	-	-
华泰证券	20210901000 19195	阳光电源	2021年9月1 日	4,490,044.00	31,600	14	3.400	5,936.84	-	-
华泰证券	20210901000 19197	健帆生物	2021年9月1 日	413,280.00	8,400	14	3.400	546.42	-	-
华泰证券	20210819000 00741	温氏股份	2021年8月 19日	234,669.00	17,900	28	3.400	620.48	-	-
华泰证券	20210819000 00743	汇川技术	2021年8月 19日	832,923.00	11,700	28	3.400	2,202.76	-	-
华泰证券	20210819000 00745	芒果超媒	2021年8月 19日	1,719,830.00	31,100	28	3.400	4,548.04	-	-
华泰证券	20210902000 00616	泰格医药	2021年9月2 日	4,134,000.00	31,800	14	3.400	5,466.02	-	-
华泰证券	20210902000 12002	华润微	2021年9月2 日	716,100.00	10,000	14	3.400	946.82	-	-
华泰证券	20210902000 12004	沪硅产业	2021年9月2 日	1,130,220.00	39,000	14	3.400	1,494.36	-	-
华泰证券	20210902000 12566	沃森生物	2021年9月2 日	643,104.00	8,700	14	3.400	850.36	-	-
华泰证券	20210902000 12568	沃森生物	2021年9月2 日	672,672.00	9,100	14	3.400	889.42	-	-
华泰证券	20210902000 12572	沃森生物	2021年9月2 日	842,688.00	11,400	14	3.400	1,114.26	-	-
华泰证券	20210902000 12574	英科医疗	2021年9月2 日	1,001,200.00	10,000	14	3.400	1,323.84	-	-
华泰证券	20210902000 12576	阳光电源	2021年9月2 日	1,429,000.00	10,000	14	3.400	1,889.44	-	-
华泰证券	20210820000 00766	芒果超媒	2021年8月 20日	580,534.00	10,900	28	3.400	1,535.24	-	-
华泰证券	20210820000 07648	中国通号	2021年8月 20日	3,462,727.00	680,300	28	2.000	5,386.36	-	-
华泰证券	20210903000	澜起科技	2021年9月3	2,793,280.00	46,400	14	1.700	1,846.74	-	-

	00551		日								
华泰证券	20210903000 09429	英科医疗	2021年9月3 日	999,800.00	10,000	14	3.400	1,322.02			
华泰证券	20210903000 09691	华润微	2021年9月3 日	930,258.00	12,600	14	3.400	1,230.04			
华泰证券	20210903000 09693	沪硅产业	2021年9月3 日	818,616.00	27,600	14	3.400	1,082.34			
华泰证券	20210823000 00459	芒果超媒	2021年8月 23日	387,940.00	7,000	28	3.400	1,099.20			
华泰证券	20210823000 00461	智飞生物	2021年8月 23日	931,952.00	5,600	28	3.400	2,640.60			
华泰证券	20210823000 07659	亿纬锂能	2021年8月 23日	11,252,460.00	112,300	28	3.400	31,881.90			
华泰证券	20210824000 17975	东方财富	2021年8月 24日	460,031.00	14,300	28	3.400	1,260.05			
华泰证券	20210825000 00775	爱尔眼科	2021年8月 25日	2,695,784.00	52,900	28	3.400	7,128.80			
华泰证券	20210825000 07975	芒果超媒	2021年8月 25日	1,056,120.00	19,500	28	3.400	2,792.72			
华泰证券	20210906000 06456	华润微	2021年9月6 日	751,600.00	10,000	14	3.400	1,135.68			
华泰证券	20210907000 18931	阳光电源	2021年9月7 日	28,400,000.00	200,000	14	3.400	40,233.30			
华泰证券	20210907000 18933	中微公司	2021年9月7 日	7,950,000.00	50,000	14	3.400	11,262.45			
华泰证券	20210908000 11399	中微公司	2021年9月8 日	3,183,200.00	20,000	14	3.400	4,208.96			
华泰证券	20210908000 11401	欧普康视	2021年9月8 日	392,173.00	5,900	14	3.400	518.56			
华泰证券	20210826000 15511	中国通号	2021年8月 26日	56,320.00	11,000	28	2.000	87.64			
华泰证券	20210826000 15513	同花顺	2021年8月 26日	1,457,950.00	13,000	28	3.400	3,855.60			
华泰证券	20210826000 15515	爱尔眼科	2021年8月 26日	3,989,349.00	81,900	28	3.400	10,549.56			
华泰证券	20210909000 00391	泰格医药	2021年9月9 日	7,980,000.00	53,200	14	3.400	10,551.38			
华泰证券	20210909000 14327	欧普康视	2021年9月9 日	392,055.00	5,900	14	3.400	518.42			
华泰证券	20210909000 16205	沪硅产业	2021年9月9 日	292,300.00	10,000	14	3.400	386.54			
华泰证券	20210827000 00480	温氏股份	2021年8月 27日	1,991,296.00	150,400	28	3.400	5,265.96			

华泰证券	20210827000 12607	同花顺	2021年8月 27日	1,450,340.00	12,700	28	3.400	3,835.44	-	-
华泰证券	20210827000 12609	乐普医疗	2021年8月 27日	1,251,000.00	50,000	28	3.400	3,308.20	-	-
华泰证券	20210910000 16199	华润微	2021年9月 10日	1,243,120.00	16,400	14	3.400	1,643.74	-	-
华泰证券	20210910000 16201	华润微	2021年9月 10日	1,129,420.00	14,900	14	3.400	1,493.38	-	-
华泰证券	20210910000 16203	沪硅产业	2021年9月 10日	732,000.00	24,400	14	3.400	967.82	-	-
华泰证券	20210910000 16205	英科医疗	2021年9月 10日	567,720.00	6,000	14	3.400	750.68	-	-
华泰证券	20210910000 16207	英科医疗	2021年9月 10日	756,960.00	8,000	14	3.400	1,000.86	-	-
华泰证券	20210910000 16209	沃森生物	2021年9月 10日	1,324,400.00	17,600	14	3.400	1,751.12	-	-
华泰证券	20210910000 16213	英科医疗	2021年9月 10日	558,258.00	5,900	14	3.400	738.08	-	-
华泰证券	20210910000 16217	阳光电源	2021年9月 10日	2,870,200.00	20,000	14	3.400	3,794.98	-	-
华泰证券	20210830000 00656	三环集团	2021年8月 30日	53,508.00	1,400	28	3.400	141.40	-	-
华泰证券	20210830000 00658	亿纬锂能	2021年8月 30日	315,000.00	3,000	28	3.400	833.00	-	-
华泰证券	20210830000 15489	乐普医疗	2021年8月 30日	605,061.00	23,700	28	3.400	1,599.92	-	-
华泰证券	20210913000 15810	华熙生物	2021年9月 13日	5,225,100.00	30,000	14	3.400	6,908.72	-	-
华泰证券	20210913000 15812	沪硅产业	2021年9月 13日	1,437,500.00	50,000	14	3.400	1,900.64	-	-
华泰证券	20210913000 15814	阳光电源	2021年9月 13日	2,690,800.00	20,000	14	3.400	3,557.82	-	-
华泰证券	20210914000 13088	宋城演艺	2021年9月 14日	664,094.00	44,600	14	3.400	878.08	-	-
华泰证券	20210914000 13504	华润微	2021年9月 14日	709,500.00	10,000	14	3.400	938.14	-	-
华泰证券	20210914000 13510	阳光电源	2021年9月 14日	1,352,900.00	10,000	14	3.400	1,788.78	-	-
华泰证券	20210901000 00635	乐普医疗	2021年9月1 日	379,152.00	14,400	28	3.400	1,002.68	-	-
华泰证券	20210901000 00637	爱尔眼科	2021年9月1 日	1,493,720.00	34,900	28	3.400	3,949.96	-	-
华泰证券	20210901000	芒果超媒	2021年9月1	238,680.00	5,400	28	3.400	631.12	-	-

	19199		日								
华泰证券	20210915000 18160	健帆生物	2021年9月 15日	409,164.00	8,400	14	3.400	540.96	-	-	
华泰证券	20210915000 19022	华润微	2021年9月 15日	937,251.00	13,300	14	3.400	1,239.28	-	-	
华泰证券	20210915000 19024	阳光电源	2021年9月 15日	4,351,952.00	31,600	14	3.400	5,754.28	-	-	
华泰证券	20210915000 19026	英科医疗	2021年9月 15日	940,203.00	9,900	14	3.400	1,243.20	-	-	
华泰证券	20210915000 19028	阳光电源	2021年9月 15日	1,377,200.00	10,000	14	3.400	1,820.98	-	-	
华泰证券	20210915000 19030	英科医疗	2021年9月 15日	949,700.00	10,000	14	3.400	1,255.66	-	-	
华泰证券	20210902000 00618	三环集团	2021年9月2 日	2,300,368.00	64,400	28	3.400	6,083.28	-	-	
华泰证券	20210902000 00620	爱尔眼科	2021年9月2 日	5,021,694.00	122,900	28	3.400	13,279.56	-	-	
华泰证券	20210902000 00622	汇川技术	2021年9月2 日	1,558,884.00	22,200	28	3.400	4,122.44	-	-	
华泰证券	20210902000 12570	智飞生物	2021年9月2 日	1,184,330.00	7,000	28	3.400	3,131.80	-	-	
华泰证券	20210902000 12578	温氏股份	2021年9月2 日	1,242,957.00	95,100	28	3.400	3,286.92	-	-	
华泰证券	20210916000 11173	华润微	2021年9月 16日	678,500.00	10,000	14	3.400	897.12	-	-	
华泰证券	20210916000 11175	沪硅产业	2021年9月 16日	1,117,350.00	39,000	14	3.400	1,477.42	-	-	
华泰证券	20210916000 11177	英科医疗	2021年9月 16日	907,000.00	10,000	14	3.400	1,199.24	-	-	
华泰证券	20210916000 11179	沃森生物	2021年9月 16日	607,789.00	9,100	14	3.400	803.60	-	-	
华泰证券	20210916000 11185	阳光电源	2021年9月 16日	1,265,000.00	10,000	14	3.400	1,672.58	-	-	
华泰证券	20210916000 11187	沃森生物	2021年9月 16日	581,073.00	8,700	14	3.400	768.32	-	-	
华泰证券	20210916000 12125	泰格医药	2021年9月 16日	5,128,068.00	31,800	14	3.400	6,780.48	-	-	
华泰证券	20210916000 12127	沃森生物	2021年9月 16日	761,406.00	11,400	14	3.400	1,006.74	-	-	
华泰证券	20210903000 00553	亿纬锂能	2021年9月3 日	1,673,070.00	18,600	28	3.400	5,530.35	-	-	
华泰证券	20210903000 00555	汇川技术	2021年9月3 日	1,455,900.00	21,100	28	3.400	4,812.50	-	-	

华泰证券	20210903000 00557	先导智能	2021年9月3 日	3,274,648.00	48,100	28	3.400	10,824.45	-	-
华泰证券	20210903000 00559	康泰生物	2021年9月3 日	1,899,940.00	16,400	28	3.400	6,280.40	-	-
华泰证券	20210903000 00561	三环集团	2021年9月3 日	2,339,008.00	64,400	28	3.400	7,731.85	-	-
华泰证券	20210903000 00563	芒果超媒	2021年9月3 日	343,420.00	7,700	28	3.400	1,135.05	-	-
华泰证券	20210903000 09427	沃森生物	2021年9月3 日	743,660.00	10,300	28	3.400	2,458.05	-	-
华泰证券	20210903000 09431	康泰生物	2021年9月3 日	1,158,500.00	10,000	28	3.400	3,829.35	-	-
华泰证券	20210906000 00535	智飞生物	2021年9月6 日	5,782,368.00	34,800	28	3.400	17,475.52	-	-
华泰证券	20210906000 00541	三环集团	2021年9月6 日	1,239,672.00	32,900	28	3.400	3,746.56	-	-
华泰证券	20210907000 00521	沃森生物	2021年9月7 日	12,063,612.00	154,900	28	3.400	35,319.54	-	-
华泰证券	20210907000 00523	欧普康视	2021年9月7 日	3,295,416.00	49,200	28	3.400	9,648.13	-	-
华泰证券	20210907000 18935	同花顺	2021年9月7 日	2,603,956.00	19,300	28	3.400	7,623.83	-	-
华泰证券	20210908000 11397	澜起科技	2021年9月8 日	851,180.00	14,600	28	3.400	2,411.70	-	-
华泰证券	20210908000 11403	同花顺	2021年9月8 日	189,487.00	13,800	28	3.400	5,368.80	-	-
华泰证券	20210909000 14329	温氏股份	2021年9月9 日	1,430,928.00	104,600	28	3.400	3,919.06	-	-
华泰证券	20210909000 14331	沃森生物	2021年9月9 日	550,190.00	7,400	28	3.400	1,506.84	-	-
华泰证券	20210909000 14333	信维通信	2021年9月9 日	563,530.00	23,500	28	3.400	1,543.38	-	-
华泰证券	20210910000 00508	爱尔眼科	2021年9月 10日	2,739,510.00	61,000	28	3.400	7,244.44	-	-
华泰证券	20210910000 16211	沃森生物	2021年9月 10日	2,257,500.00	30,000	28	3.400	5,969.88	-	-
华泰证券	20210910000 16215	温氏股份	2021年9月 10日	1,045,590.00	76,600	28	3.400	2,765.00	-	-
华泰证券	20210917000 08009	沪硅产业	2021年9月 17日	781,080.00	27,600	14	3.400	1,549.17	-	-
华泰证券	20210917000 08011	华润微	2021年9月 17日	871,920.00	12,600	14	3.400	1,729.35	-	-
华泰证券	20210917000	澜起科技	2021年9月	2,610,000.00	46,400	14	1.700	2,588.25	-	-

	08013		17日							
华泰证券	20210917000 08019	英科医疗	2021年9月 17日	919,600.00	10,000	14	3.400	1,823.85	-	-
华泰证券	20210922000 30767	中微公司	2021年9月 22日	7,887,500.00	50,000	14	3.400	11,918.88	-	-
华泰证券	20210922000 30769	华润微	2021年9月 22日	699,600.00	10,000	14	3.400	1,057.12	-	-
华泰证券	20210922000 30771	中微公司	2021年9月 22日	3,155,000.00	20,000	14	3.400	4,767.52	-	-
华泰证券	20210922000 30775	阳光电源	2021年9月 22日	24,870,000.00	200,000	14	3.400	37,581.28	-	-
华泰证券	20210922000 30777	欧普康视	2021年9月 22日	470,820.00	5,900	14	3.400	711.52	-	-
华泰证券	20210923000 14535	沪硅产业	2021年9月 23日	288,400.00	10,000	14	3.400	408.60	-	-
华泰证券	20210923000 14539	欧普康视	2021年9月 23日	472,000.00	5,900	14	3.400	668.70	-	-
华泰证券	20210923000 14543	泰格医药	2021年9月 23日	9,043,468.00	53,200	14	3.400	12,811.65	-	-
华泰证券	20210924000 13323	华润微	2021年9月 24日	1,038,530.00	14,900	14	3.400	1,373.12	-	-
华泰证券	20210924000 13325	华润微	2021年9月 24日	1,143,080.00	16,400	14	3.400	1,511.44	-	-
华泰证券	20210924000 13327	沪硅产业	2021年9月 24日	704,428.00	24,400	14	3.400	931.42	-	-
华泰证券	20210924000 13329	英科医疗	2021年9月 24日	551,280.00	6,000	14	3.400	728.98	-	-
华泰证券	20210924000 13333	沃森生物	2021年9月 24日	1,150,160.00	17,600	14	3.400	1,520.82	-	-
华泰证券	20210924000 13337	英科医疗	2021年9月 24日	735,040.00	8,000	14	3.400	971.88	-	-
华泰证券	20210924000 13339	英科医疗	2021年9月 24日	542,092.00	5,900	14	3.400	716.80	-	-
华泰证券	20210924000 13341	阳光电源	2021年9月 24日	2,808,000.00	20,000	14	3.400	3,712.80	-	-
华泰证券	20210913000 00357	芒果超媒	2021年9月 13日	1,018,560.00	24,000	28	3.400	2,693.60	-	-
华泰证券	20210927000 13997	华熙生物	2021年9月 27日	5,734,800.00	30,000	14	3.400	7,582.68	-	-
华泰证券	20210927000 13999	沪硅产业	2021年9月 27日	1,445,000.00	50,000	14	3.400	1,910.58	-	-
华泰证券	20210927000 14003	阳光电源	2021年9月 27日	2,955,000.00	20,000	14	3.400	3,907.12	-	-

华泰证券	20210914000 00647	温氏股份	2021年9月 14日	783,486.00	59,400	28	3.400	2,072.00	-	-
华泰证券	20210914000 00649	汇川技术	2021年9月 14日	2,392,065.00	35,100	28	3.400	6,325.76	-	-
华泰证券	20210914000 00651	芒果超媒	2021年9月 14日	366,095.00	8,500	28	3.400	968.24	-	-
华泰证券	20210914000 00653	爱尔眼科	2021年9月 14日	5,778,080.00	123,200	28	3.400	15,279.88	-	-
华泰证券	20210914000 00655	乐普医疗	2021年9月 14日	209,760.00	8,000	28	3.400	554.68	-	-
华泰证券	20210914000 13502	温氏股份	2021年9月 14日	406,252.00	30,800	28	3.400	1,074.36	-	-
华泰证券	20210914000 13506	爱尔眼科	2021年9月 14日	938,000.00	20,000	28	3.400	2,480.52	-	-
华泰证券	20210914000 13508	芒果超媒	2021年9月 14日	2,941,681.00	68,300	28	3.400	7,779.24	-	-
华泰证券	20210928000 00399	贝达药业	2021年9月 28日	391,188.00	4,200	14	3.400	517.30	-	-
华泰证券	20210928000 13868	华润微	2021年9月 28日	697,800.00	10,000	14	3.400	922.60	-	-
华泰证券	20210928000 13870	阳光电源	2021年9月 28日	1,432,200.00	10,000	14	3.400	1,893.64	-	-
华泰证券	20210928000 13872	宋城演艺	2021年9月 28日	643,578.00	44,600	14	3.400	850.92	-	-
华泰证券	20210915000 00905	中国通号	2021年9月 15日	318,600.00	60,000	28	3.400	842.52	-	-
华泰证券	20210915000 00907	东方财富	2021年9月 15日	4,466,715.00	126,500	28	3.400	11,812.08	-	-
华泰证券	20210915000 18162	温氏股份	2021年9月 15日	777,891.00	59,700	28	3.400	2,057.16	-	-
华泰证券	20210929000 18157	华润微	2021年9月 29日	913,045.00	13,300	14	3.400	1,207.22	-	-
华泰证券	20210929000 18159	英科医疗	2021年9月 29日	878,600.00	10,000	14	3.400	1,161.72	-	-
华泰证券	20210929000 18161	英科医疗	2021年9月 29日	869,814.00	9,900	14	3.400	1,150.10	-	-
华泰证券	20210929000 18163	健帆生物	2021年9月 29日	481,320.00	8,400	14	3.400	636.44	-	-
华泰证券	20210929000 18165	阳光电源	2021年9月 29日	4,657,524.00	31,600	14	3.400	6,158.32	-	-
华泰证券	20210929000 18167	阳光电源	2021年9月 29日	1,473,900.00	10,000	14	3.400	1,948.80	-	-
华泰证券	20210916000	康泰生物	2021年9月	102,400.00	1,000	28	3.400	270.76	-	-

	00571		16日							
华泰证券	20210916000 11181	汇川技术	2021年9月 16日	762,255.00	11,700	28	3.400	2,015.72	-	-
华泰证券	20210916000 11183	芒果超媒	2021年9月 16日	1,299,980.00	31,100	28	3.400	3,437.84	-	-
华泰证券	20210930000 12511	华润微	2021年9月 30日	688,500.00	10,000	14	3.400	910.42	-	-
华泰证券	20210930000 12513	沪硅产业	2021年9月 30日	1,117,740.00	39,000	14	3.400	1,477.84	-	-
华泰证券	20210930000 12519	泰格医药	2021年9月 30日	5,533,200.00	31,800	14	3.400	7,316.12	-	-
华泰证券	20210930000 12521	阳光电源	2021年9月 30日	1,483,800.00	10,000	14	3.400	1,961.96	-	-
华泰证券	20210930000 12523	英科医疗	2021年9月 30日	586,300.00	10,000	14	3.400	775.18	-	-
华泰证券	20210930000 12529	沃森生物	2021年9月 30日	720,252.00	11,400	14	3.400	952.28	-	-
华泰证券	20210930000 12531	沃森生物	2021年9月 30日	549,666.00	8,700	14	3.400	726.74	-	-
华泰证券	20210930000 12533	沃森生物	2021年9月 30日	574,938.00	9,100	14	3.400	760.20	-	-
华泰证券	20210917000 00335	中国通号	2021年9月 17日	529,000.00	100,000	28	2.000	822.92	-	-
华泰证券	20210917000 00337	澜起科技	2021年9月 17日	2,902,500.00	51,600	28	3.400	7,675.64	-	-
华泰证券	20210917000 08015	中国通号	2021年9月 17日	3,598,787.00	680,300	28	2.000	5,598.04	-	-
华泰证券	20210917000 08017	芒果超媒	2021年9月 17日	460,852.00	10,900	28	3.400	1,218.84	-	-
华泰证券	20210922000 30773	芒果超媒	2021年9月 22日	807,495.00	19,500	28	3.400	2,135.28	-	-
华泰证券	20210922000 30779	芒果超媒	2021年9月 22日	289,870.00	7,000	28	3.400	766.64	-	-
华泰证券	20210922000 30781	爱尔眼科	2021年9月 22日	2,831,208.00	52,900	28	3.400	7,486.92	-	-
华泰证券	20210922000 30783	亿纬锂能	2021年9月 22日	10,042,989.00	112,300	28	3.400	26,558.00	-	-
华泰证券	20210923000 00710	东方财富	2021年9月 23日	17,566,661.00	511,700	28	3.400	46,453.96	-	-
华泰证券	20210923000 14537	中国通号	2021年9月 23日	58,960.00	11,000	28	2.000	91.84	-	-
华泰证券	20210923000 14541	爱尔眼科	2021年9月 23日	4,287,465.00	81,900	28	3.400	11,338.04	-	-

华泰证券	20210923000 14545	同花顺	2021年9月 23日	1,723,150.00	13,000	28	3.400	4,556.72	-	-
华泰证券	20210924000 13331	同花顺	2021年9月 24日	1,661,541.00	12,700	28	3.400	4,393.76	-	-
华泰证券	20210924000 13335	乐普医疗	2021年9月 24日	1,344,000.00	50,000	28	3.400	3,554.04	-	-
华泰证券	20210924000 13343	温氏股份	2021年9月 24日	2,074,016.00	150,400	28	3.400	5,484.64	-	-
华泰证券	20211008000 00645	蓝思科技	2021年10月 8日	212,100.00	10,000	14	3.400	280.42	-	-
华泰证券	20211008000 00647	健帆生物	2021年10月 8日	2,332,280.00	39,800	14	3.400	3,083.78	-	-
华泰证券	20211008000 59899	华润微	2021年10月 8日	1,143,572.00	16,400	14	3.400	1,512.00	-	-
华泰证券	20211008000 59901	华润微	2021年10月 8日	1,038,977.00	14,900	14	3.400	1,373.82	-	-
华泰证券	20211008000 59903	沪硅产业	2021年10月 8日	708,088.00	24,400	14	3.400	936.32	-	-
华泰证券	20211008000 59905	沃森生物	2021年10月 8日	1,050,016.00	17,600	14	3.400	1,388.38	-	-
华泰证券	20211008000 59907	英科医疗	2021年10月 8日	338,188.00	5,900	14	3.400	447.16	-	-
华泰证券	20211008000 59909	英科医疗	2021年10月 8日	343,920.00	6,000	14	3.400	454.72	-	-
华泰证券	20211008000 59911	英科医疗	2021年10月 8日	458,560.00	8,000	14	3.400	606.34	-	-
华泰证券	20211008000 59913	阳光电源	2021年10月 8日	3,004,000.00	20,000	14	3.400	3,971.94	-	-
华泰证券	20211008000 71279	中微公司	2021年10月 8日	3,083,600.00	20,000	14	3.400	4,077.22	-	-
华泰证券	20211008000 71281	中微公司	2021年10月 8日	7,709,000.00	50,000	14	3.400	10,192.98	-	-
华泰证券	20211008000 71283	澜起科技	2021年10月 8日	2,779,824.00	46,400	14	1.700	1,837.78	-	-
华泰证券	20211008000 71287	华润微	2021年10月 8日	697,300.00	10,000	14	3.400	922.04	-	-
华泰证券	20211008000 71289	华润微	2021年10月 8日	878,598.00	12,600	14	3.400	1,161.72	-	-
华泰证券	20211008000 71291	沪硅产业	2021年10月 8日	800,952.00	27,600	14	3.400	1,059.10	-	-
华泰证券	20211008000 71293	沪硅产业	2021年10月 8日	290,200.00	10,000	14	3.400	383.74	-	-
华泰证券	20211008000	英科医疗	2021年10月	573,200.00	10,000	14	3.400	757.96	-	-

	71297		8 日								
华泰证券	20211008000 71301	欧普康视	2021 年 10 月 8 日	476,484.00	5,900	14	3.400	630.00			
华泰证券	20211008000 71313	欧普康视	2021 年 10 月 8 日	476,484.00	5,900	14	3.400	630.00			
华泰证券	20211008000 71329	阳光电源	2021 年 10 月 8 日	30,040,000.00	200,000	14	3.400	39,719.54			
华泰证券	20211008000 73899	泰格医药	2021 年 10 月 8 日	9,220,624.00	53,200	14	3.400	12,191.76			
华泰证券	20210927000 00247	汇川技术	2021 年 9 月 27 日	1,009,162.00	15,400	28	3.400	2,668.68			
华泰证券	20210927000 14001	乐普医疗	2021 年 9 月 27 日	635,871.00	23,700	28	3.400	1,681.40			
华泰证券	20210927000 14005	亿纬锂能	2021 年 9 月 27 日	281,490.00	3,000	28	3.400	744.52			
华泰证券	20211011000 01150	英科医疗	2021 年 10 月 11 日	228,304.00	3,800	14	3.400	301.84			
华泰证券	20211011000 01164	贝达药业	2021 年 10 月 11 日	975,100.00	10,000	14	3.400	1,289.26			
华泰证券	20211011000 18618	华熙生物	2021 年 10 月 11 日	5,512,500.00	30,000	14	3.400	7,288.82			
华泰证券	20211011000 18620	沪硅产业	2021 年 10 月 11 日	1,429,500.00	50,000	14	3.400	1,890.14			
华泰证券	20211011000 18622	阳光电源	2021 年 10 月 11 日	2,780,200.00	20,000	14	3.400	3,675.98			
华泰证券	20210928000 00401	芒果超媒	2021 年 9 月 28 日	759,600.00	18,000	28	3.400	2,008.72			
华泰证券	20210928000 00403	三环集团	2021 年 9 月 28 日	524,524.00	14,300	28	3.400	1,387.12			
华泰证券	20211012000 00710	东方财富	2021 年 10 月 12 日	983,400.00	30,000	14	3.400	1,300.32			
华泰证券	20211012000 00712	贝达药业	2021 年 10 月 12 日	249,054.00	2,600	14	3.400	329.28			
华泰证券	20211012000 14813	阳光电源	2021 年 10 月 12 日	1,435,000.00	10,000	14	3.400	1,897.42			
华泰证券	20211012000 14817	宋城演艺	2021 年 10 月 12 日	642,686.00	44,600	14	3.400	849.80			
华泰证券	20211012000 16745	华润微	2021 年 10 月 12 日	660,100.00	10,000	14	3.400	872.76			
华泰证券	20210929000 18169	芒果超媒	2021 年 9 月 29 日	235,440.00	5,400	28	3.400	622.72			
华泰证券	20210929000 18171	乐普医疗	2021 年 9 月 29 日	389,232.00	14,400	28	3.400	1,029.28			

华泰证券	20211013000 00775	健帆生物	2021年10月 13日	551,250.00	9,800	14	3.400	728.84	-	-
华泰证券	20211013000 00777	智飞生物	2021年10月 13日	1,831,180.00	13,000	14	3.400	2,421.30	-	-
华泰证券	20211013000 00779	东方财富	2021年10月 13日	1,328,000.00	40,000	14	3.400	1,755.88	-	-
华泰证券	20211013000 17709	华润微	2021年10月 13日	920,227.00	13,300	14	3.400	1,216.74	-	-
华泰证券	20211013000 17713	英科医疗	2021年10月 13日	615,483.00	9,900	14	3.400	813.82	-	-
华泰证券	20211013000 17715	英科医疗	2021年10月 13日	621,700.00	10,000	14	3.400	822.08	-	-
华泰证券	20211013000 17719	阳光电源	2021年10月 13日	4,788,348.00	31,600	14	3.400	6,331.22	-	-
华泰证券	20211013000 17721	健帆生物	2021年10月 13日	472,500.00	8,400	14	3.400	624.82	-	-
华泰证券	20211013000 17723	阳光电源	2021年10月 13日	1,515,300.00	10,000	14	3.400	2,003.54	-	-
华泰证券	20210930000 10515	爱尔眼科	2021年9月 30日	6,562,860.00	122,900	28	3.400	17,355.24	-	-
华泰证券	20210930000 12517	三环集团	2021年9月 30日	2,389,240.00	64,400	28	3.400	6,318.20	-	-
华泰证券	20210930000 12527	温氏股份	2021年9月 30日	1,376,097.00	95,100	28	3.400	3,638.88	-	-
华泰证券	20210930000 12535	汇川技术	2021年9月 30日	1,398,600.00	22,200	28	3.400	3,698.52	-	-
华泰证券	20211014000 13000	英科医疗	2021年10月 14日	631,800.00	10,000	14	3.400	835.38	-	-
华泰证券	20211014000 13144	阳光电源	2021年10月 14日	1,534,500.00	10,000	14	3.400	2,029.02	-	-
华泰证券	20211014000 13146	华润微	2021年10月 14日	688,500.00	10,000	14	3.400	910.42	-	-
华泰证券	20211014000 13148	沪硅产业	2021年10月 14日	1,083,420.00	39,000	14	3.400	1,432.48	-	-
华泰证券	20211014000 14502	泰格医药	2021年10月 14日	5,197,392.00	31,800	14	3.400	6,872.18	-	-
华泰证券	20211008000 71285	澜起科技	2021年10月 8日	874,686.00	14,600	28	3.400	2,313.08	-	-
华泰证券	20211008000 71299	温氏股份	2021年10月 8日	1,603,518.00	104,600	28	3.400	4,240.32	-	-
华泰证券	20211008000 71303	先导智能	2021年10月 8日	3,371,810.00	48,100	28	3.400	8,916.60	-	-
华泰证券	20211008000	温氏股份	2021年10月	1,174,278.00	76,600	28	3.400	3,105.20	-	-

	71305		8 日							
华泰证券	20211008000 71307	康泰生物	2021 年 10 月 8 日	1,752,668.00	16,400	28	3.400	4,634.84	-	-
华泰证券	20211008000 71309	康泰生物	2021 年 10 月 8 日	1,068,700.00	10,000	28	3.400	2,826.04	-	-
华泰证券	20211008000 71311	欧普康视	2021 年 10 月 8 日	3,973,392.00	49,200	28	3.400	10,507.28	-	-
华泰证券	20211008000 71315	沃森生物	2021 年 10 月 8 日	9,241,334.00	154,900	28	3.400	24,438.12	-	-
华泰证券	20211008000 71317	沃森生物	2021 年 10 月 8 日	614,498.00	10,300	28	3.400	1,625.12	-	-
华泰证券	20211008000 71319	汇川技术	2021 年 10 月 8 日	1,353,776.00	21,100	28	3.400	3,580.08	-	-
华泰证券	20211008000 71321	信维通信	2021 年 10 月 8 日	546,375.00	23,500	28	3.400	1,444.80	-	-
华泰证券	20211008000 71323	三环集团	2021 年 10 月 8 日	2,390,528.00	64,400	28	3.400	6,321.56	-	-
华泰证券	20211008000 71325	三环集团	2021 年 10 月 8 日	1,221,248.00	32,900	28	3.400	3,229.52	-	-
华泰证券	20211008000 71327	沃森生物	2021 年 10 月 8 日	1,789,800.00	30,000	28	3.400	4,733.12	-	-
华泰证券	20211008000 71331	亿纬锂能	2021 年 10 月 8 日	1,872,276.00	18,600	28	3.400	4,951.24	-	-
华泰证券	20211008000 71333	爱尔眼科	2021 年 10 月 8 日	3,243,980.00	61,000	28	3.400	8,578.64	-	-
华泰证券	20211008000 71335	同花顺	2021 年 10 月 8 日	1,684,980.00	13,800	28	3.400	4,455.92	-	-
华泰证券	20211008000 71337	智飞生物	2021 年 10 月 8 日	5,085,672.00	34,800	28	3.400	13,448.68	-	-
华泰证券	20211008000 71339	同花顺	2021 年 10 月 8 日	2,356,530.00	19,300	28	3.400	6,231.68	-	-
华泰证券	20211022000 00530	东方财富	2021 年 10 月 22 日	1,662,000.00	50,000	14	3.400	2,197.58	-	-
华泰证券	20211022000 50824	阳光电源	2021 年 10 月 22 日	3,147,400.00	20,000	14	3.400	4,161.50	-	-
华泰证券	20211022000 50826	阳光电源	2021 年 10 月 22 日	31,474,000.00	200,000	14	3.400	41,615.56	-	-
华泰证券	20211022000 57360	沪硅产业	2021 年 10 月 22 日	767,832.00	27,600	14	3.400	1,015.28	-	-
华泰证券	20211022000 57362	华润微	2021 年 10 月 22 日	1,029,143.00	14,900	14	3.400	1,360.80	-	-
华泰证券	20211022000 57364	沪硅产业	2021 年 10 月 22 日	278,200.00	10,000	14	3.400	367.78	-	-

华泰证券	20211022000 57366	华润微	2021年10月 22日	690,700.00	10,000	14	3.400	913.22	-	-
华泰证券	20211022000 57368	华润微	2021年10月 22日	870,282.00	12,600	14	3.400	1,150.66	-	-
华泰证券	20211022000 57370	华润微	2021年10月 22日	1,132,748.00	16,400	14	3.400	1,497.72	-	-
华泰证券	20211022000 57372	中微公司	2021年10月 22日	3,136,000.00	20,000	14	3.400	4,146.52	-	-
华泰证券	20211022000 57374	沪硅产业	2021年10月 22日	678,808.00	24,400	14	3.400	897.54	-	-
华泰证券	20211022000 57376	澜起科技	2021年10月 22日	2,619,280.00	46,400	14	1.700	1,731.66	-	-
华泰证券	20211022000 57378	中微公司	2021年10月 22日	7,840,000.00	50,000	14	3.400	10,366.16	-	-
华泰证券	20211022000 57380	英科医疗	2021年10月 22日	560,300.00	10,000	14	3.400	740.88	-	-
华泰证券	20211022000 57382	英科医疗	2021年10月 22日	330,577.00	5,900	14	3.400	437.08	-	-
华泰证券	20211022000 57384	英科医疗	2021年10月 22日	448,240.00	8,000	14	3.400	592.62	-	-
华泰证券	20211022000 57386	泰格医药	2021年10月 22日	8,725,864.00	53,200	14	3.400	11,537.54	-	-
华泰证券	20211022000 57390	沃森生物	2021年10月 22日	1,056,704.00	17,600	14	3.400	1,397.20	-	-
华泰证券	20211022000 57392	健帆生物	2021年10月 22日	2,173,080.00	39,800	14	3.400	2,873.36	-	-
华泰证券	20211022000 57394	英科医疗	2021年10月 22日	336,180.00	6,000	14	3.400	444.50	-	-
华泰证券	20211022000 57396	蓝思科技	2021年10月 22日	197,200.00	10,000	14	3.400	260.68	-	-
华泰证券	20211011000 01162	东方财富	2021年10月 11日	6,882,000.00	200,000	28	3.400	18,199.16	-	-
华泰证券	20211011000 17198	芒果超媒	2021年10月 11日	1,101,600.00	24,000	28	3.400	2,913.12	-	-
华泰证券	20211025000 16452	华熙生物	2021年10月 25日	5,170,800.00	30,000	14	3.400	6,836.90	-	-
华泰证券	20211025000 16454	沪硅产业	2021年10月 25日	1,394,500.00	50,000	14	3.400	1,843.80	-	-
华泰证券	20211025000 16456	英科医疗	2021年10月 25日	207,176.00	3,800	14	3.400	273.98	-	-
华泰证券	20211025000 16458	阳光电源	2021年10月 25日	3,440,000.00	20,000	14	3.400	4,548.46	-	-
华泰证券	20211012000	英科医疗	2021年10月	627,200.00	10,000	28	3.400	1,658.72	-	-

	00714		12日							
华泰证券	20211012000 15891	芒果超媒	2021年10月 12日	2,675,994.00	68,300	28	3.400	7,076.44	-	-
华泰证券	20211012000 15893	芒果超媒	2021年10月 12日	333,030.00	8,500	28	3.400	880.60	-	-
华泰证券	20211012000 15895	温氏股份	2021年10月 12日	469,084.00	30,800	28	3.400	1,240.40	-	-
华泰证券	20211012000 15897	温氏股份	2021年10月 12日	904,662.00	59,400	28	3.400	2,392.32	-	-
华泰证券	20211012000 15899	乐普医疗	2021年10月 12日	218,400.00	8,000	28	3.400	577.64	-	-
华泰证券	20211012000 15901	爱尔眼科	2021年10月 12日	6,332,480.00	123,200	28	3.400	16,745.96	-	-
华泰证券	20211012000 15903	汇川技术	2021年10月 12日	2,088,801.00	35,100	28	3.400	5,523.84	-	-
华泰证券	20211012000 15905	爱尔眼科	2021年10月 12日	1,028,000.00	20,000	28	3.400	2,718.52	-	-
华泰证券	20211026000 12662	华润微	2021年10月 26日	700,200.00	10,000	14	3.400	925.82	-	-
华泰证券	20211026000 12664	贝达药业	2021年10月 26日	218,738.00	2,600	14	3.400	289.24	-	-
华泰证券	20211026000 12666	阳光电源	2021年10月 26日	1,703,000.00	10,000	14	3.400	2,251.76	-	-
华泰证券	20211026000 14824	宋城演艺	2021年10月 26日	621,278.00	44,600	14	3.400	821.52	-	-
华泰证券	20211026000 14826	东方财富	2021年10月 26日	1,017,300.00	30,000	14	3.400	1,345.12	-	-
华泰证券	20211013000 18453	东方财富	2021年10月 13日	4,199,800.00	126,500	28	3.400	11,106.20	-	-
华泰证券	20211013000 18455	温氏股份	2021年10月 13日	897,888.00	59,700	28	3.400	2,374.40	-	-
华泰证券	20211027000 00514	温氏股份	2021年10月 27日	24,672.00	1,600	14	3.400	32.62	-	-
华泰证券	20211027000 16741	华润微	2021年10月 27日	826,462.00	13,300	14	3.400	1,092.84	-	-
华泰证券	20211027000 16747	东方财富	2021年10月 27日	1,316,000.00	40,000	14	3.400	1,740.06	-	-
华泰证券	20211027000 16749	英科医疗	2021年10月 27日	539,300.00	10,000	14	3.400	713.02	-	-
华泰证券	20211027000 16751	英科医疗	2021年10月 27日	533,907.00	9,900	14	3.400	705.88	-	-
华泰证券	20211027000 16753	阳光电源	2021年10月 27日	1,725,400.00	10,000	14	3.400	2,281.30	-	-

华泰证券	20211027000 16755	智飞生物	2021年10月 27日	1,908,400.00	13,000	14	3.400	2,523.36	-	-
华泰证券	20211027000 16757	阳光电源	2021年10月 27日	5,452,264.00	31,600	14	3.400	7,209.16	-	-
华泰证券	20211027000 16759	健帆生物	2021年10月 27日	497,840.00	9,800	14	3.400	658.28	-	-
华泰证券	20211027000 16761	健帆生物	2021年10月 27日	426,720.00	8,400	14	3.400	564.20	-	-
华泰证券	20211014000 10778	康泰生物	2021年10月 14日	108,940.00	1,000	28	3.400	288.12	-	-
华泰证券	20211014000 10780	汇川技术	2021年10月 14日	698,490.00	11,700	28	3.400	1,847.16	-	-
华泰证券	20211014000 10782	芒果超媒	2021年10月 14日	1,224,718.00	31,100	28	3.400	3,238.76	-	-
华泰证券	20211028000 12643	华润微	2021年10月 28日	600,600.00	10,000	14	3.400	794.08	-	-
华泰证券	20211028000 12645	沪硅产业	2021年10月 28日	1,080,300.00	39,000	14	3.400	1,428.42	-	-
华泰证券	20211028000 12651	阳光电源	2021年10月 28日	1,710,000.00	10,000	14	3.400	2,261.00	-	-
华泰证券	20211028000 12653	英科医疗	2021年10月 28日	512,200.00	10,000	14	3.400	677.18	-	-
华泰证券	20211015000 03151	中国通号	2021年10月 15日	3,483,136.00	680,300	28	2.000	5,418.28	-	-
华泰证券	20211015000 03153	澜起科技	2021年10月 15日	3,028,404.00	51,600	28	3.400	8,008.56	-	-
华泰证券	20211015000 03155	中国通号	2021年10月 15日	512,000.00	100,000	28	2.000	796.32	-	-
华泰证券	20211018000 00708	东方财富	2021年10月 18日	5,041,500.00	150,000	28	3.400	13,331.92	-	-
华泰证券	20211101000 00615	亿纬锂能	2021年11月 1日	1,528,100.00	14,000	14	3.400	2,020.48	-	-
华泰证券	20211020000 05973	亿纬锂能	2021年10月 20日	12,804,446.00	112,300	28	3.400	33,860.68	-	-
华泰证券	20211020000 05975	爱尔眼科	2021年10月 20日	2,476,249.00	52,900	28	3.400	6,548.36	-	-
华泰证券	20211103000 00494	汇川技术	2021年11月 3日	106,576.00	1,600	14	3.400	140.98	-	-
华泰证券	20211021000 00513	东方财富	2021年10月 21日	671,400.00	20,000	28	3.400	1,775.48	-	-
华泰证券	20211021000 04372	东方财富	2021年10月 21日	17,177,769.00	511,700	28	3.400	45,425.80	-	-
华泰证券	20211021000	中国通号	2021年10月	56,320.00	11,000	28	2.000	87.64	-	-

	04374		21 日							
华泰证券	20211021000 04376	同花顺	2021 年 10 月 21 日	1,515,800.00	13,000	28	3.400	4,008.48	-	-
华泰证券	20211021000 04428	爱尔眼科	2021 年 10 月 21 日	3,814,902.00	81,900	28	3.400	10,088.40	-	-
华泰证券	20211022000 00532	东方财富	2021 年 10 月 22 日	3,390,480.00	102,000	28	3.400	8,965.88	-	-
华泰证券	20211022000 45192	乐普医疗	2021 年 10 月 22 日	1,294,000.00	50,000	28	3.400	3,421.88	-	-
华泰证券	20211022000 57388	同花顺	2021 年 10 月 22 日	1,488,694.00	12,700	28	3.400	3,936.80	-	-
华泰证券	20211022000 57398	温氏股份	2021 年 10 月 22 日	2,361,280.00	150,400	28	3.400	6,244.28	-	-
华泰证券	20211105000 00638	乐普医疗	2021 年 11 月 5 日	47,300.00	2,200	14	3.400	62.58	-	-
华泰证券	20211105000 52999	健帆生物	2021 年 11 月 5 日	2,027,412.00	39,800	14	3.400	2,680.72	-	-
华泰证券	20211105000 53001	英科医疗	2021 年 11 月 5 日	328,040.00	5,900	14	3.400	433.72	-	-
华泰证券	20211105000 53003	英科医疗	2021 年 11 月 5 日	333,600.00	6,000	14	3.400	441.14	-	-
华泰证券	20211105000 53005	英科医疗	2021 年 11 月 5 日	444,800.00	8,000	14	3.400	588.14	-	-
华泰证券	20211105000 53007	东方财富	2021 年 11 月 5 日	1,636,500.00	50,000	14	3.400	2,163.84	-	-
华泰证券	20211105000 53015	蓝思科技	2021 年 11 月 5 日	219,700.00	10,000	14	3.400	290.50	-	-
华泰证券	20211105000 53017	泰格医药	2021 年 11 月 5 日	7,729,960.00	53,200	14	3.400	10,220.70	-	-
华泰证券	20211105000 53019	阳光电源	2021 年 11 月 5 日	3,115,600.00	20,000	14	3.400	4,119.50	-	-
华泰证券	20211105000 53027	阳光电源	2021 年 11 月 5 日	31,156,000.00	200,000	14	3.400	41,195.14	-	-
华泰证券	20211105000 53869	华润微	2021 年 11 月 5 日	843,444.00	12,600	14	3.400	1,115.24	-	-
华泰证券	20211105000 53871	沪硅产业	2021 年 11 月 5 日	285,400.00	10,000	14	3.400	377.30	-	-
华泰证券	20211105000 53873	沪硅产业	2021 年 11 月 5 日	787,704.00	27,600	14	3.400	1,041.46	-	-
华泰证券	20211105000 53875	华润微	2021 年 11 月 5 日	1,097,816.00	16,400	14	3.400	1,451.52	-	-
华泰证券	20211105000 53877	华润微	2021 年 11 月 5 日	997,406.00	14,900	14	3.400	1,318.80	-	-

华泰证券	20211105000 53879	华润微	2021年11月 5日	669,400.00	10,000	14	3.400	885.08	-	-
华泰证券	20211105000 53881	沪硅产业	2021年11月 5日	696,376.00	24,400	14	3.400	920.78	-	-
华泰证券	20211105000 53883	中微公司	2021年11月 5日	7,859,500.00	50,000	14	3.400	10,392.06	-	-
华泰证券	20211105000 53887	中微公司	2021年11月 5日	3,143,800.00	20,000	14	3.400	4,156.74	-	-
华泰证券	20211105000 53889	英科医疗	2021年11月 5日	556,000.00	10,000	14	3.400	735.14	-	-
华泰证券	20211105000 54059	沃森生物	2021年11月 5日	906,928.00	17,600	14	3.400	1,199.10	-	-
华泰证券	20211105000 65013	澜起科技	2021年11月 5日	3,448,912.00	46,400	14	1.700	2,280.18	-	-
华泰证券	20211025000 00409	温氏股份	2021年10月 25日	1,221,400.00	77,500	28	3.400	3,229.80	-	-
华泰证券	20211025000 16460	乐普医疗	2021年10月 25日	615,252.00	23,700	28	3.400	1,627.08	-	-
华泰证券	20211025000 16648	亿纬锂能	2021年10月 25日	349,500.00	3,000	28	3.400	924.28	-	-
华泰证券	20211025000 16650	汇川技术	2021年10月 25日	954,800.00	15,400	28	3.400	2,525.04	-	-
华泰证券	20211108000 00756	信维通信	2021年11月 8日	126,429.00	5,100	14	3.400	167.16	-	-
华泰证券	20211108000 17028	沪硅产业	2021年11月 8日	1,399,000.00	50,000	14	3.400	1,849.82	-	-
华泰证券	20211108000 17030	华熙生物	2021年11月 8日	4,991,700.00	30,000	14	3.400	6,600.16	-	-
华泰证券	20211108000 17032	阳光电源	2021年11月 8日	3,160,000.00	20,000	14	3.400	4,178.16	-	-
华泰证券	20211108000 17034	英科医疗	2021年11月 8日	202,502.00	3,800	14	3.400	267.82	-	-
华泰证券	20211026000 00717	温氏股份	2021年10月 26日	214,760.00	14,000	28	3.400	567.84	-	-
华泰证券	20211109000 00597	金山办公	2021年11月 9日	10,074,252.00	34,800	14	3.400	13,320.44	-	-
华泰证券	20211109000 00599	温氏股份	2021年11月 9日	3,964,428.00	236,400	14	3.400	5,241.88	-	-
华泰证券	20211109000 14226	贝达药业	2021年11月 9日	208,338.00	2,600	14	3.400	275.52	-	-
华泰证券	20211109000 17796	华润微	2021年11月 9日	677,200.00	10,000	14	3.400	895.44	-	-
华泰证券	20211109000	阳光电源	2021年11月	1,602,100.00	10,000	14	3.400	2,118.34	-	-

	17798		9 日							
华泰证券	20211109000 17800	东方财富	2021 年 11 月 9 日	1,004,700.00	30,000	14	3.400	1,328.46	-	-
华泰证券	20211027000 16745	乐普医疗	2021 年 10 月 27 日	360,576.00	14,400	28	3.400	953.40	-	-
华泰证券	20211027000 16763	芒果超媒	2021 年 10 月 27 日	211,248.00	5,400	28	3.400	558.60	-	-
华泰证券	20211110000 00891	智飞生物	2021 年 11 月 10 日	3,948,624.00	30,600	14	3.400	5,221.02	-	-
华泰证券	20211110000 16931	东方财富	2021 年 11 月 10 日	1,344,800.00	40,000	14	3.400	1,778.14	-	-
华泰证券	20211110000 16933	英科医疗	2021 年 11 月 10 日	545,000.00	10,000	14	3.400	720.58	-	-
华泰证券	20211110000 16935	阳光电源	2021 年 11 月 10 日	5,021,240.00	31,600	14	3.400	6,639.22	-	-
华泰证券	20211110000 16937	健帆生物	2021 年 11 月 10 日	417,396.00	8,400	14	3.400	551.88	-	-
华泰证券	20211110000 16939	智飞生物	2021 年 11 月 10 日	1,677,520.00	13,000	14	3.400	2,218.02	-	-
华泰证券	20211110000 16941	阳光电源	2021 年 11 月 10 日	1,589,000.00	10,000	14	3.400	2,100.98	-	-
华泰证券	20211110000 16943	英科医疗	2021 年 11 月 10 日	539,550.00	9,900	14	3.400	713.44	-	-
华泰证券	20211110000 16945	健帆生物	2021 年 11 月 10 日	486,962.00	9,800	14	3.400	643.86	-	-
华泰证券	20211110000 19197	华润微	2021 年 11 月 10 日	905,597.00	13,300	14	3.400	1,197.42	-	-
华泰证券	20211110000 19227	温氏股份	2021 年 11 月 10 日	26,672.00	1,600	14	3.400	35.28	-	-
华泰证券	20211028000 12647	汇川技术	2021 年 10 月 28 日	1,460,760.00	22,200	28	3.400	3,862.88	-	-
华泰证券	20211028000 12649	爱尔眼科	2021 年 10 月 28 日	5,623,904.00	122,900	28	3.400	14,872.20	-	-
华泰证券	20211028000 12655	温氏股份	2021 年 10 月 28 日	1,473,099.00	95,100	28	3.400	3,895.64	-	-
华泰证券	20211111000 12830	沪硅产业	2021 年 11 月 11 日	1,193,400.00	39,000	14	3.400	1,577.94	-	-
华泰证券	20211111000 14584	华润微	2021 年 11 月 11 日	696,800.00	10,000	14	3.400	921.34	-	-
华泰证券	20211111000 14618	英科医疗	2021 年 11 月 11 日	548,800.00	10,000	14	3.400	725.62	-	-
华泰证券	20211111000 14620	阳光电源	2021 年 11 月 11 日	1,609,800.00	10,000	14	3.400	2,128.56	-	-

华泰证券	20211115000 06407	亿纬锂能	2021年11月 15日	1,780,660.00	14,000	14	3.400	2,354.38	-	-
华泰证券	20211116000 00785	华大基因	2021年11月 16日	669,528.00	7,200	14	3.400	885.22	-	-
华泰证券	20211117000 00602	传音控股	2021年11月 17日	14,102,325.00	80,700	14	3.400	18,646.46	-	-
华泰证券	20211117000 00604	智飞生物	2021年11月 17日	5,173,980.00	38,100	14	3.400	6,841.10	-	-
华泰证券	20211118000 00808	三环集团	2021年11月 18日	8,236,000.00	200,000	14	3.400	10,889.76	-	-
华泰证券	20211118000 00810	乐普医疗	2021年11月 18日	370,239.00	16,700	14	3.400	489.58	-	-
华泰证券	20211118000 00812	传音控股	2021年11月 18日	1,695,400.00	10,000	14	3.400	2,241.68	-	-
华泰证券	20211105000 53009	爱尔眼科	2021年11月 5日	2,957,890.00	61,000	28	3.400	7,822.08	-	-
华泰证券	20211105000 53011	同花顺	2021年11月 5日	2,179,935.00	19,300	28	3.400	5,764.64	-	-
华泰证券	20211105000 53013	智飞生物	2021年11月 5日	4,622,136.00	34,800	28	3.400	12,223.12	-	-
华泰证券	20211105000 53021	温氏股份	2021年11月 5日	1,284,582.00	76,600	28	3.400	3,396.96	-	-
华泰证券	20211105000 53023	温氏股份	2021年11月 5日	1,754,142.00	104,600	28	3.400	4,638.76	-	-
华泰证券	20211105000 53025	先导智能	2021年11月 5日	4,060,602.00	48,100	28	3.400	10,738.00	-	-
华泰证券	20211105000 53029	沃森生物	2021年11月 5日	7,981,997.00	154,900	28	3.400	21,108.08	-	-
华泰证券	20211105000 53885	澜起科技	2021年11月 5日	1,085,218.00	14,600	28	3.400	2,869.72	-	-
华泰证券	20211105000 53891	欧普康视	2021年11月 5日	3,119,280.00	49,200	28	3.400	8,248.80	-	-
华泰证券	20211105000 54051	信维通信	2021年11月 5日	594,550.00	23,500	28	3.400	1,572.20	-	-
华泰证券	20211105000 54053	汇川技术	2021年11月 5日	1,437,332.00	21,100	28	3.400	3,801.00	-	-
华泰证券	20211105000 54055	沃森生物	2021年11月 5日	530,759.00	10,300	28	3.400	1,403.64	-	-
华泰证券	20211105000 54057	沃森生物	2021年11月 5日	1,545,900.00	30,000	28	3.400	4,088.00	-	-
华泰证券	20211105000 59363	同花顺	2021年11月 5日	1,558,710.00	13,800	28	3.400	4,121.88	-	-
华泰证券	20211105000	亿纬锂能	2021年11月	2,110,914.00	18,600	28	3.400	5,582.08	-	-

	65567		5 日							
华泰证券	20211105000 65569	康泰生物	2021 年 11 月 5 日	1,088,500.00	10,000	28	3.400	2,878.40	-	-
华泰证券	20211105000 65571	康泰生物	2021 年 11 月 5 日	1,785,140.00	16,400	28	3.400	4,720.80	-	-
华泰证券	20211119000 00571	三环集团	2021 年 11 月 19 日	474,980.00	11,000	14	3.400	628.04	-	-
华泰证券	20211119000 42267	华润微	2021 年 11 月 19 日	821,520.00	12,600	14	3.400	1,086.26	-	-
华泰证券	20211119000 42269	华润微	2021 年 11 月 19 日	1,069,280.00	16,400	14	3.400	1,413.86	-	-
华泰证券	20211119000 42271	华润微	2021 年 11 月 19 日	971,480.00	14,900	14	3.400	1,284.50	-	-
华泰证券	20211119000 42273	华润微	2021 年 11 月 19 日	652,000.00	10,000	14	3.400	862.12	-	-
华泰证券	20211119000 42275	中微公司	2021 年 11 月 19 日	3,290,000.00	20,000	14	3.400	4,350.08	-	-
华泰证券	20211119000 42277	中微公司	2021 年 11 月 19 日	8,225,000.00	50,000	14	3.400	10,875.34	-	-
华泰证券	20211119000 42279	英科医疗	2021 年 11 月 19 日	325,031.00	5,900	14	3.400	429.80	-	-
华泰证券	20211119000 42281	英科医疗	2021 年 11 月 19 日	330,540.00	6,000	14	3.400	437.08	-	-
华泰证券	20211119000 42283	英科医疗	2021 年 11 月 19 日	440,720.00	8,000	14	3.400	582.68	-	-
华泰证券	20211119000 42285	英科医疗	2021 年 11 月 19 日	550,900.00	10,000	14	3.400	728.42	-	-
华泰证券	20211119000 42287	阳光电源	2021 年 11 月 19 日	3,030,400.00	20,000	14	3.400	4,006.80	-	-
华泰证券	20211119000 42289	沃森生物	2021 年 11 月 19 日	1,098,064.00	17,600	14	3.400	1,451.94	-	-
华泰证券	20211119000 42291	阳光电源	2021 年 11 月 19 日	30,304,000.00	200,000	14	3.400	40,068.56	-	-
华泰证券	20211119000 42293	蓝思科技	2021 年 11 月 19 日	231,000.00	10,000	14	3.400	305.48	-	-
华泰证券	20211119000 42297	东方财富	2021 年 11 月 19 日	1,761,000.00	50,000	14	3.400	2,328.48	-	-
华泰证券	20211108000 17036	东方财富	2021 年 11 月 8 日	6,664,000.00	200,000	28	3.400	17,622.64	-	-
华泰证券	20211122000 00832	欧普康视	2021 年 11 月 22 日	1,557,500.00	25,000	14	3.400	2,059.40	-	-
华泰证券	20211122000 00834	东方财富	2021 年 11 月 22 日	8,229,870.00	229,500	14	3.400	10,881.78	-	-

华泰证券	20211122000 14942	华熙生物	2021年11月 22日	5,007,300.00	30,000	14	3.400	6,620.74	-	-
华泰证券	20211122000 14944	英科医疗	2021年11月 22日	207,632.00	3,800	14	3.400	274.54	-	-
华泰证券	20211122000 14952	阳光电源	2021年11月 22日	3,160,600.00	20,000	14	3.400	4,179.00	-	-
华泰证券	20211109000 17426	英科医疗	2021年11月 9日	534,300.00	10,000	28	3.400	1,412.88	-	-
华泰证券	20211109000 17868	芒果超媒	2021年11月 9日	373,660.00	8,500	28	3.400	988.12	-	-
华泰证券	20211109000 17870	芒果超媒	2021年11月 9日	3,002,468.00	68,300	28	3.400	7,939.96	-	-
华泰证券	20211123000 00644	沃森生物	2021年11月 23日	682,528.00	11,200	14	3.400	902.44	-	-
华泰证券	20211123000 12492	华润微	2021年11月 23日	727,400.00	10,000	14	3.400	961.80	-	-
华泰证券	20211123000 12496	阳光电源	2021年11月 23日	1,566,100.00	10,000	14	3.400	2,070.74	-	-
华泰证券	20211123000 12498	温氏股份	2021年11月 23日	3,936,060.00	236,400	14	3.400	5,204.36	-	-
华泰证券	20211123000 12500	东方财富	2021年11月 23日	1,070,700.00	30,000	14	3.400	1,415.68	-	-
华泰证券	20211123000 12944	贝达药业	2021年11月 23日	227,188.00	2,600	14	3.400	300.44	-	-
华泰证券	20211110000 16929	东方财富	2021年11月 10日	4,252,930.00	126,500	28	3.400	11,246.76	-	-
华泰证券	20211110000 19229	温氏股份	2021年11月 10日	995,199.00	59,700	28	3.400	2,631.72	-	-
华泰证券	20211124000 00449	金山办公	2021年11月 24日	4,174,002.00	15,700	14	3.400	5,518.94	-	-
华泰证券	20211124000 00451	先导智能	2021年11月 24日	2,908,360.00	36,400	14	3.400	3,845.52	-	-
华泰证券	20211124000 00453	阳光电源	2021年11月 24日	1,276,716.00	8,400	14	3.400	1,688.12	-	-
华泰证券	20211124000 00455	智飞生物	2021年11月 24日	2,699,008.00	20,800	14	3.400	3,568.74	-	-
华泰证券	20211124000 15283	英科医疗	2021年11月 24日	539,352.00	9,900	14	3.400	713.16	-	-
华泰证券	20211124000 15285	英科医疗	2021年11月 24日	544,800.00	10,000	14	3.400	720.30	-	-
华泰证券	20211124000 16909	华润微	2021年11月 24日	971,033.00	13,300	14	3.400	1,283.94	-	-
华泰证券	20211124000	智飞生物	2021年11月	3,970,656.00	30,600	14	3.400	5,250.14	-	-

	16911		24 日							
华泰证券	20211124000 16913	智飞生物	2021 年 11 月 24 日	1,686,880.00	13,000	14	3.400	2,230.48	-	-
华泰证券	20211124000 16917	阳光电源	2021 年 11 月 24 日	1,519,900.00	10,000	14	3.400	2,009.70	-	-
华泰证券	20211124000 16919	健帆生物	2021 年 11 月 24 日	456,204.00	8,400	14	3.400	603.26	-	-
华泰证券	20211124000 16923	健帆生物	2021 年 11 月 24 日	532,238.00	9,800	14	3.400	703.78	-	-
华泰证券	20211124000 16925	阳光电源	2021 年 11 月 24 日	4,802,884.00	31,600	14	3.400	6,350.54	-	-
华泰证券	20211111000 12832	芒果超媒	2021 年 11 月 11 日	1,344,142.00	31,100	28	3.400	3,554.60	-	-
华泰证券	20211111000 14622	康泰生物	2021 年 11 月 11 日	105,760.00	1,000	28	3.400	279.72	-	-
华泰证券	20211125000 00648	健帆生物	2021 年 11 月 25 日	443,620.00	8,200	14	3.400	586.60	-	-
华泰证券	20211125000 00650	先导智能	2021 年 11 月 25 日	948,360.00	12,000	14	3.400	1,253.98	-	-
华泰证券	20211125000 00652	华大基因	2021 年 11 月 25 日	1,675,175.00	18,500	14	3.400	2,214.94	-	-
华泰证券	20211125000 00654	乐普医疗	2021 年 11 月 25 日	1,249,908.00	55,700	14	3.400	1,652.70	-	-
华泰证券	20211125000 00656	泰格医药	2021 年 11 月 25 日	668,208.00	4,800	14	3.400	883.54	-	-
华泰证券	20211125000 00658	沃森生物	2021 年 11 月 25 日	1,844,294.00	27,400	14	3.400	2,438.52	-	-
华泰证券	20211125000 09490	华润微	2021 年 11 月 25 日	733,300.00	10,000	14	3.400	969.64	-	-
华泰证券	20211125000 09492	阳光电源	2021 年 11 月 25 日	1,484,900.00	10,000	14	3.400	1,963.36	-	-
华泰证券	20211125000 09494	英科医疗	2021 年 11 月 25 日	565,600.00	10,000	14	3.400	747.88	-	-
华泰证券	20211112000 04783	澜起科技	2021 年 11 月 12 日	3,983,520.00	51,600	28	3.400	10,534.16	-	-
华泰证券	20211126000 00689	华大基因	2021 年 11 月 26 日	134,100.00	1,500	14	3.400	177.38	-	-
华泰证券	20211115000 06409	东方财富	2021 年 11 月 15 日	5,299,500.00	150,000	28	3.400	14,014.28	-	-
华泰证券	20211129000 00542	健帆生物	2021 年 11 月 29 日	185,815.00	3,500	14	3.400	245.70	-	-
华泰证券	20211129000 00544	蓝思科技	2021 年 11 月 29 日	168,960.00	8,000	14	3.400	223.44	-	-

华泰证券	20211129000 00546	宋城演艺	2021年11月 29日	376,090.00	28,600	14	3.400	497.28	-	-
华泰证券	20211129000 05015	亿纬锂能	2021年11月 29日	2,072,000.00	14,000	14	3.400	2,739.66	-	-
华泰证券	20211130000 04157	华大基因	2021年11月 30日	684,000.00	7,200	14	3.400	904.40	-	-
华泰证券	20211117000 06139	亿纬锂能	2021年11月 17日	14,138,570.00	112,300	28	3.400	37,388.68	-	-
华泰证券	20211201000 00762	健帆生物	2021年12月 1日	617,463.00	12,100	14	3.400	816.48	-	-
华泰证券	20211201000 04873	传音控股	2021年12月 1日	12,859,545.00	80,700	14	3.400	17,003.14	-	-
华泰证券	20211118000 06309	东方财富	2021年11月 18日	693,800.00	20,000	28	3.400	1,834.84	-	-
华泰证券	20211118000 06311	东方财富	2021年11月 18日	17,750,873.00	511,700	28	3.400	46,941.16	-	-
华泰证券	20211202000 04991	传音控股	2021年12月 2日	1,555,500.00	10,000	14	3.400	2,056.74	-	-
华泰证券	20211202000 04997	乐普医疗	2021年12月 2日	363,058.00	16,700	14	3.400	480.06	-	-
华泰证券	20211119000 42295	东方财富	2021年11月 19日	3,592,440.00	102,000	28	3.400	9,500.12	-	-
华泰证券	20211203000 00872	爱尔眼科	2021年12月 3日	383,565.00	9,100	14	3.400	507.22	-	-
华泰证券	20211203000 00874	智飞生物	2021年12月 3日	1,356,864.00	11,100	14	3.400	1,794.10	-	-
华泰证券	20211203000 16161	英科医疗	2021年12月 3日	608,500.00	10,000	14	3.400	804.58	-	-
华泰证券	20211203000 16163	华润微	2021年12月 3日	922,320.00	12,600	14	3.400	1,219.54	-	-
华泰证券	20211203000 16165	蓝思科技	2021年12月 3日	208,400.00	10,000	14	3.400	275.52	-	-
华泰证券	20211203000 16177	阳光电源	2021年12月 3日	3,059,800.00	20,000	14	3.400	4,045.72	-	-
华泰证券	20211203000 16183	英科医疗	2021年12月 3日	486,800.00	8,000	14	3.400	643.72	-	-
华泰证券	20211203000 23737	沃森生物	2021年12月 3日	1,159,488.00	17,600	14	3.400	1,533.14	-	-
华泰证券	20211203000 23743	英科医疗	2021年12月 3日	359,015.00	5,900	14	3.400	474.74	-	-
华泰证券	20211203000 23749	英科医疗	2021年12月 3日	365,100.00	6,000	14	3.400	482.72	-	-
华泰证券	20211203000	中微公司	2021年12月	3,138,000.00	20,000	14	3.400	4,149.18	-	-

	23753		3 日							
华泰证券	20211203000 23757	东方财富	2021 年 12 月 3 日	1,743,500.00	50,000	14	3.400	2,305.24	-	-
华泰证券	20211203000 23759	华润微	2021 年 12 月 3 日	732,000.00	10,000	14	3.400	967.82	-	-
华泰证券	20211203000 23771	阳光电源	2021 年 12 月 3 日	30,598,000.00	200,000	14	3.400	40,457.34	-	-
华泰证券	20211122000 14946	温氏股份	2021 年 11 月 22 日	1,314,400.00	77,500	28	3.400	3,475.92	-	-
华泰证券	20211122000 14948	亿纬锂能	2021 年 11 月 22 日	418,740.00	3,000	28	3.400	1,107.40	-	-
华泰证券	20211122000 14950	乐普医疗	2021 年 11 月 22 日	529,458.00	23,700	28	3.400	1,400.00	-	-
华泰证券	20211122000 14954	汇川技术	2021 年 11 月 22 日	1,022,868.00	15,400	28	3.400	2,704.80	-	-
华泰证券	20211206000 00741	中微公司	2021 年 12 月 6 日	4,881,657.00	31,900	14	3.400	6,454.70	-	-
华泰证券	20211206000 00743	三环集团	2021 年 12 月 6 日	434,434.00	9,800	14	3.400	574.42	-	-
华泰证券	20211206000 08756	华熙生物	2021 年 12 月 6 日	4,770,000.00	30,000	14	3.400	6,307.00	-	-
华泰证券	20211206000 08758	英科医疗	2021 年 12 月 6 日	222,490.00	3,800	14	3.400	294.14	-	-
华泰证券	20211206000 08762	东方财富	2021 年 12 月 6 日	8,099,055.00	229,500	14	3.400	10,708.74	-	-
华泰证券	20211206000 08908	欧普康视	2021 年 12 月 6 日	1,381,500.00	25,000	14	3.400	1,826.72	-	-
华泰证券	20211123000 12494	温氏股份	2021 年 11 月 23 日	233,100.00	14,000	28	3.400	616.56	-	-
华泰证券	20211207000 08239	温氏股份	2021 年 12 月 7 日	4,146,456.00	236,400	14	3.400	5,482.54	-	-
华泰证券	20211207000 08241	沃森生物	2021 年 12 月 7 日	703,808.00	11,200	14	3.400	930.58	-	-
华泰证券	20211208000 00909	同花顺	2021 年 12 月 8 日	2,540,552.00	19,600	14	3.400	3,359.16	-	-
华泰证券	20211208000 07242	健帆生物	2021 年 12 月 8 日	497,448.00	9,800	14	3.400	657.72	-	-
华泰证券	20211208000 07246	智飞生物	2021 年 12 月 8 日	3,792,258.00	30,600	14	3.400	5,014.24	-	-
华泰证券	20211208000 07248	阳光电源	2021 年 12 月 8 日	4,746,320.00	31,600	14	3.400	6,275.64	-	-
华泰证券	20211208000 07258	英科医疗	2021 年 12 月 8 日	605,600.00	10,000	14	3.400	800.80	-	-

华泰证券	20211208000 07440	智飞生物	2021 年 12 月 8 日	2,577,744.00	20,800	14	3.400	3,408.30	-	-
华泰证券	20211208000 07454	阳光电源	2021 年 12 月 8 日	1,261,680.00	8,400	14	3.400	1,668.24	-	-
华泰证券	20211208000 07460	英科医疗	2021 年 12 月 8 日	599,544.00	9,900	14	3.400	792.68	-	-
华泰证券	20211209000 06671	乐普医疗	2021 年 12 月 9 日	1,246,566.00	55,700	14	3.400	1,648.22	-	-
华泰证券	20211209000 08223	健帆生物	2021 年 12 月 9 日	428,696.00	8,200	14	3.400	566.86	-	-
华泰证券	20211209000 08227	阳光电源	2021 年 12 月 9 日	1,480,300.00	10,000	14	3.400	1,957.34	-	-
华泰证券	20211209000 08233	沃森生物	2021 年 12 月 9 日	1,729,214.00	27,400	14	3.400	2,286.48	-	-
华泰证券	20211209000 08793	英科医疗	2021 年 12 月 9 日	599,200.00	10,000	14	3.400	792.26	-	-
华泰证券	20211209000 08795	华大基因	2021 年 12 月 9 日	1,706,625.00	18,500	14	3.400	2,256.52	-	-
华泰证券	20211210000 04307	华大基因	2021 年 12 月 10 日	138,315.00	1,500	14	3.400	182.84	-	-
华泰证券	20211213000 01034	智飞生物	2021 年 12 月 13 日	308,472.00	2,400	14	3.400	407.82	-	-
华泰证券	20211213000 01038	东方财富	2021 年 12 月 13 日	11,439,000.00	300,000	14	3.400	15,124.90	-	-
华泰证券	20211213000 09563	宋城演艺	2021 年 12 月 13 日	394,394.00	28,600	14	3.400	521.50	-	-
华泰证券	20211213000 09565	亿纬锂能	2021 年 12 月 13 日	1,924,020.00	14,000	14	3.400	2,543.94	-	-
华泰证券	20211213000 09935	健帆生物	2021 年 12 月 13 日	184,940.00	3,500	14	3.400	244.58	-	-
华泰证券	20211214000 01093	英科医疗	2021 年 12 月 14 日	102,102.00	1,700	14	3.400	134.96	-	-
华泰证券	20211214000 01095	华大基因	2021 年 12 月 14 日	1,034,520.00	11,100	14	3.400	1,367.94	-	-
华泰证券	20211214000 01097	东方财富	2021 年 12 月 14 日	11,493,000.00	300,000	14	3.400	15,196.30	-	-
华泰证券	20211214000 12760	华大基因	2021 年 12 月 14 日	671,040.00	7,200	14	3.400	887.32	-	-
华泰证券	20211215000 01919	华大基因	2021 年 12 月 15 日	451,000.00	5,000	14	3.400	596.26	-	-
华泰证券	20211215000 01923	沪硅产业	2021 年 12 月 15 日	5,420,000.00	200,000	14	3.400	7,166.46	-	-
华泰证券	20211215000	传音控股	2021 年 12 月	12,234,120.00	80,700	14	3.400	16,176.30	-	-

	15539		15 日								
华泰证券	20211215000 15541	健帆生物	2021 年 12 月 15 日	633,072.00	12,100	14	3.400	837.06			
华泰证券	20211216000 00912	沪硅产业	2021 年 12 月 16 日	677,500.00	25,000	14	3.400	895.86			
华泰证券	20211216000 00916	爱尔眼科	2021 年 12 月 16 日	100,050.00	2,300	14	3.400	132.30			
华泰证券	20211216000 08325	传音控股	2021 年 12 月 16 日	1,539,300.00	10,000	14	3.400	2,035.32			
华泰证券	20211203000 20565	汇川技术	2021 年 12 月 3 日	1,389,646.00	21,100	28	3.400	3,674.72			
华泰证券	20211203000 20569	沃森生物	2021 年 12 月 3 日	10,204,812.00	154,900	28	3.400	26,986.12			
华泰证券	20211203000 23551	沃森生物	2021 年 12 月 3 日	678,564.00	10,300	28	3.400	1,794.52			
华泰证券	20211203000 23553	温氏股份	2021 年 12 月 3 日	1,830,500.00	104,600	28	3.400	4,840.64			
华泰证券	20211203000 23557	欧普康视	2021 年 12 月 3 日	2,736,012.00	49,200	28	3.400	7,235.20			
华泰证券	20211203000 23559	温氏股份	2021 年 12 月 3 日	1,340,500.00	76,600	28	3.400	3,544.80			
华泰证券	20211203000 23561	澜起科技	2021 年 12 月 3 日	1,126,682.00	14,600	28	3.400	2,979.48			
华泰证券	20211217000 01494	华大基因	2021 年 12 月 17 日	360,440.00	4,000	14	3.400	476.56			
华泰证券	20211217000 24228	英科医疗	2021 年 12 月 17 日	448,640.00	8,000	14	3.400	593.18			
华泰证券	20211217000 25310	爱尔眼科	2021 年 12 月 17 日	389,753.00	9,100	14	3.400	515.34			
华泰证券	20211217000 26110	阳光电源	2021 年 12 月 17 日	29,300,000.00	200,000	14	3.400	38,741.08			
华泰证券	20211217000 27152	英科医疗	2021 年 12 月 17 日	336,480.00	6,000	14	3.400	444.92			
华泰证券	20211217000 27160	沃森生物	2021 年 12 月 17 日	1,171,280.00	17,600	14	3.400	1,548.68			
华泰证券	20211217000 27964	蓝思科技	2021 年 12 月 17 日	237,100.00	10,000	14	3.400	313.46			
华泰证券	20211207000 08237	英科医疗	2021 年 12 月 7 日	590,000.00	10,000	28	3.400	1,337.28	578,400.00		1,337.28
华泰证券	20211207000 08243	芒果超媒	2021 年 12 月 7 日	384,115.00	8,500	28	3.400	870.72	486,370.00		870.72
华泰证券	20211207000 08245	芒果超媒	2021 年 12 月 7 日	3,086,477.00	68,300	28	3.400	6,996.00	3,908,126.00		6,996.00

华泰证券	20211220000 09179	欧普康视	2021 年 12 月 20 日	1,498,000.00	25,000	14	3.400	1,556.28	1,434,250.00	1,556.28
华泰证券	20211220000 09187	英科医疗	2021 年 12 月 20 日	227,848.00	3,800	14	3.400	236.72	219,792.00	236.72
华泰证券	20211220000 09331	中微公司	2021 年 12 月 20 日	4,244,295.00	31,900	14	3.400	4,409.35	4,038,540.00	4,409.35
华泰证券	20211220000 09333	东方财富	2021 年 12 月 20 日	8,622,315.00	229,500	14	3.400	8,957.63	8,516,745.00	8,957.63
华泰证券	20211221000 01105	中微公司	2021 年 12 月 21 日	2,638,400.00	20,000	14	3.400	2,491.80	2,532,000.00	2,491.80
华泰证券	20211221000 01107	蓝思科技	2021 年 12 月 21 日	1,247,664.00	52,800	14	3.400	1,178.40	1,213,344.00	1,178.40
华泰证券	20211221000 19181	沃森生物	2021 年 12 月 21 日	692,048.00	11,200	14	3.400	653.60	629,440.00	653.60
华泰证券	20211221000 20059	温氏股份	2021 年 12 月 21 日	4,255,200.00	236,400	14	3.400	4,018.80	4,553,064.00	4,018.80
华泰证券	20211208000 07238	温氏股份	2021 年 12 月 8 日	1,044,153.00	59,700	28	3.400	2,268.03	1,149,822.00	2,268.03
华泰证券	20211208000 07350	东方财富	2021 年 12 月 8 日	4,570,445.00	126,500	28	3.400	9,927.95	4,694,415.00	9,927.95
华泰证券	20211222000 01223	英科医疗	2021 年 12 月 22 日	115,160.00	2,000	14	3.400	97.92	115,680.00	97.92
华泰证券	20211222000 11790	英科医疗	2021 年 12 月 22 日	575,800.00	10,000	14	3.400	489.42	578,400.00	489.42
华泰证券	20211222000 11792	英科医疗	2021 年 12 月 22 日	570,042.00	9,900	14	3.400	484.56	572,616.00	484.56
华泰证券	20211222000 11794	阳光电源	2021 年 12 月 22 日	1,154,160.00	8,400	14	3.400	981.00	1,224,720.00	981.00
华泰证券	20211222000 11796	阳光电源	2021 年 12 月 22 日	4,341,840.00	31,600	14	3.400	3,690.54	4,607,280.00	3,690.54
华泰证券	20211222000 11798	智飞生物	2021 年 12 月 22 日	2,686,944.00	20,800	14	3.400	2,283.93	2,591,680.00	2,283.93
华泰证券	20211222000 11800	同花顺	2021 年 12 月 22 日	2,813,188.00	19,600	14	3.400	2,391.21	2,833,768.00	2,391.21
华泰证券	20211222000 11866	智飞生物	2021 年 12 月 22 日	3,952,908.00	30,600	14	3.400	3,359.97	3,812,760.00	3,359.97
华泰证券	20211209000 08231	芒果超媒	2021 年 12 月 9 日	1,454,858.00	31,100	28	3.400	3,022.80	1,779,542.00	3,022.80
华泰证券	20211223000 00566	蓝思科技	2021 年 12 月 23 日	1,724,800.00	70,000	14	3.400	1,303.20	1,608,600.00	1,303.20
华泰证券	20211223000 11355	华大基因	2021 年 12 月 23 日	1,642,985.00	18,500	14	3.400	1,241.36	1,624,300.00	1,241.36
华泰证券	20211223000	沃森生物	2021 年 12 月	1,644,548.00	27,400	14	3.400	1,242.56	1,539,880.00	1,242.56

	11357		23 日						00	
华泰证券	20211210000 03405	澜起科技	2021 年 12 月 10 日	3,870,000.00	51,600	28	3.400	7,675.50	4,327,692.00	7,675.50
华泰证券	20211224000 01144	金龙鱼	2021 年 12 月 24 日	1,074,164.00	16,900	14	3.400	710.15	1,063,517.00	710.15
华泰证券	20211224000 11144	华大基因	2021 年 12 月 24 日	133,440.00	1,500	14	3.400	88.20	131,700.00	88.20
华泰证券	20211213000 01028	康泰生物	2021 年 12 月 13 日	167,010.00	1,500	28	3.400	283.86	147,810.00	283.86
华泰证券	20211213000 01030	华大基因	2021 年 12 月 13 日	305,019.00	3,300	28	3.400	518.58	289,740.00	518.58
华泰证券	20211213000 01032	欧普康视	2021 年 12 月 13 日	88,578.00	1,400	28	3.400	150.66	80,318.00	150.66
华泰证券	20211213000 01036	贝达药业	2021 年 12 月 13 日	246,570.00	3,000	28	3.400	419.22	239,490.00	419.22
华泰证券	20211227000 01064	阳光电源	2021 年 12 月 27 日	936,330.00	6,900	14	3.400	353.72	1,006,020.00	353.72
华泰证券	20211227000 01066	金龙鱼	2021 年 12 月 27 日	1,370,792.00	21,200	14	3.400	517.84	1,334,116.00	517.84
华泰证券	20211227000 08154	东方财富	2021 年 12 月 27 日	11,091,000.00	300,000	14	3.400	4,189.92	11,133,000.00	4,189.92
华泰证券	20211227000 08156	宋城演艺	2021 年 12 月 27 日	406,406.00	28,600	14	3.400	153.52	409,552.00	153.52
华泰证券	20211227000 08158	亿纬锂能	2021 年 12 月 27 日	1,659,000.00	14,000	14	3.400	626.72	1,654,520.00	626.72
华泰证券	20211228000 01197	华大基因	2021 年 12 月 28 日	1,329,750.00	15,000	14	3.400	376.77	1,317,000.00	376.77
华泰证券	20211228000 01199	爱尔眼科	2021 年 12 月 28 日	7,817,480.00	179,300	14	3.400	2,214.96	7,580,804.00	2,214.96
华泰证券	20211228000 14204	东方财富	2021 年 12 月 28 日	11,298,000.00	300,000	14	3.400	3,201.09	11,133,000.00	3,201.09
华泰证券	20211228000 14206	华大基因	2021 年 12 月 28 日	984,015.00	11,100	14	3.400	278.82	974,580.00	278.82
华泰证券	20211228000 14210	英科医疗	2021 年 12 月 28 日	96,441.00	1,700	14	3.400	27.33	98,328.00	27.33
华泰证券	20211228000 14214	华大基因	2021 年 12 月 28 日	638,280.00	7,200	14	3.400	180.84	632,160.00	180.84
华泰证券	20211215000 01925	东方财富	2021 年 12 月 15 日	2,126,850.00	55,000	28	3.400	3,213.92	2,041,050.00	3,213.92
华泰证券	20211215000 15543	亿纬锂能	2021 年 12 月 15 日	14,823,600.00	112,300	28	3.400	22,400.16	13,271,614.00	22,400.16
华泰证券	20211229000 00845	中芯国际	2021 年 12 月 29 日	6,628,161.00	125,700	14	3.400	1,251.98	6,660,843.00	1,251.98

华泰证券	2021122900000848	华大基因	2021年12月29日	458,588.00	5,200	14	3.400	86.62	456,560.00	86.62
华泰证券	2021122900010504	华大基因	2021年12月29日	440,950.00	5,000	14	3.400	83.30	439,000.00	83.30
华泰证券	2021122900010984	沪硅产业	2021年12月29日	5,106,000.00	200,000	14	3.400	964.46	5,164,000.00	964.46
华泰证券	2021122900010992	健帆生物	2021年12月29日	631,862.00	12,100	14	3.400	119.36	644,930.00	119.36
华泰证券	2021121600000914	东方财富	2021年12月16日	3,878,000.00	100,000	28	3.400	5,493.90	3,711,000.00	5,493.90
华泰证券	2021121600008321	东方财富	2021年12月16日	19,843,726.00	511,700	28	3.400	28,111.95	18,989,187.00	28,111.95
华泰证券	2021121700001496	东方财富	2021年12月17日	3,793,000.00	100,000	28	3.400	5,015.22	3,711,000.00	5,015.22
华泰证券	2021122000001209	中芯国际	2021年12月20日	31,722,000.00	600,000	28	3.400	32,955.67	31,794,000.00	32,955.67
华泰证券	2021122000001213	阳光电源	2021年12月20日	5,600,320.00	40,700	28	3.400	5,818.12	5,934,060.00	5,818.12
华泰证券	2021122000009327	汇川技术	2021年12月20日	1,082,928.00	15,400	28	3.400	1,125.08	1,056,440.00	1,125.08
华泰证券	2021122100001109	爱尔眼科	2021年12月21日	5,139,904.00	119,200	28	3.400	4,854.40	5,039,776.00	4,854.40
华泰证券	2021123000000728	爱尔眼科	2021年12月30日	2,706,300.00	62,000	28	3.400	255.60	2,621,360.00	255.60
华泰证券	2021123000008920	爱尔眼科	2021年12月30日	100,395.00	2,300	14	3.400	9.48	97,244.00	9.48
华泰证券	2021123000008922	沪硅产业	2021年12月30日	647,500.00	25,000	14	3.400	61.15	645,500.00	61.15
华泰证券	2021123100000915	智飞生物	2021年12月31日	124,600.00	1,000	14	3.400	-	124,600.00	-
华泰证券	2021123100000917	中芯国际	2021年12月31日	5,611,641.00	105,900	14	2.000	-	5,611,641.00	-
华泰证券	20211231000023486	欧普康视	2021年12月31日	2,822,604.00	49,200	28	3.400	-	2,822,604.00	-
华泰证券	20211231000023496	沃森生物	2021年12月31日	989,120.00	17,600	14	3.400	-	989,120.00	-
华泰证券	20211231000027210	汇川技术	2021年12月31日	1,447,460.00	21,100	28	3.400	-	1,447,460.00	-
华泰证券	20211231000027214	英科医疗	2021年12月31日	347,040.00	6,000	14	3.400	-	347,040.00	-
华泰证券	20211231000027216	爱尔眼科	2021年12月31日	384,748.00	9,100	14	3.400	-	384,748.00	-
华泰证券	202112310000	温氏股份	2021年12月	1,475,316.00	76,600	28	3.400	-	1,475,316.00	-

	27218		31 日						00	
华泰证券	20211231000 27220	沃森生物	2021 年 12 月 31 日	8,705,380.00	154,900	28	3.400	-	8,705,380.00	-
华泰证券	20211231000 27228	华大基因	2021 年 12 月 31 日	351,200.00	4,000	14	3.400	-	351,200.00	-

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

注：本报告期及上年度，基金管理人未投资本基金。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2022 年 12 月 31 日		上年度末 2021 年 12 月 31 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的 比例 (%)	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比 例 (%)
华泰柏瑞沪 深300交易型 开放式指数 证券投资基金 联接基金	1,145,234,077.00	5.8159	481,477,669.00	4.2457
华泰证券股 份有限公司	515,934,470.00	2.6201	228,708,740.00	2.0167

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	155,603,662.35	882,907.64	235,699,884.97	656,448.03

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

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

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股）	总金额
本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日					
华泰联合证券	301207	华兰疫苗	网下申购	5,687	323,476.56
华泰联合证券	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40

华泰联合证券	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
华泰联合证券	688253	英诺特	网下申购	4,364	113,725.84
华泰联合证券	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
华泰联合证券	301160	翔楼新材	网下申购	3,918	123,652.08
华泰联合证券	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
华泰联合证券	688353	华盛锂电	网下申购	4,358	428,609.30
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
华泰联合证券	688351	微电生理	网下申购	10,946	180,718.46
华泰联合证券	301339	通行宝	网下申购	9,127	171,405.06
华泰联合证券	301316	慧博云通	网下申购	3,584	27,238.40
华泰联合证券	301327	华宝新能	网下申购	2,417	574,037.50
华泰联合证券	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合证券	301290	东星医疗	网下申购	3,291	145,100.19
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
上年度可比期间					
2021 年 1 月 1 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
华泰联合证券	301155	海力风电	网下申购	10,533	638,931.78
华泰联合证券	688192	迪哲医药	网下申购	8,926	469,329.08
华泰联合证券	688151	华强科技	网下申购	12,238	429,431.42
华泰联合证券	688280	精进电动	网下申购	21,211	292,287.58
华泰联合证券	688083	中望软件	网下申购	1,837	276,468.50
华泰联合证券	301093	华兰股份	网下申购	4,088	237,431.04
华泰联合证券	601728	中国电信	网上配售	29,000	131,370.00
华泰联合证券	301179	泽宇智能	网下申购	2,941	129,374.59
华泰联合证券	688236	春立医疗	网下申购	4,052	120,790.12
华泰联合证券	688161	威高骨科	网下申购	3,069	111,159.18
华泰联合证券	600905	三峡能源	网上配售	34,000	90,100.00
华泰联合证券	688656	浩欧博	网下申购	1,371	48,341.46
华泰联合证券	688097	博众精工	网下申购	3,983	44,888.41
华泰联合证券	301078	孩子王	网下申购	7,551	43,569.27
华泰联合证券	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
华泰联合证券	300952	恒辉安防	网下申购	3,398	39,824.56
华泰联合证券	688350	富淼科技	网下申购	2,552	34,656.16
华泰联合证券	688787	海天瑞声	网下申购	817	30,179.98
华泰联合证券	605499	东鹏饮料	网下申购	632	29,242.64
华泰联合证券	688314	康拓医疗	网下申购	1,085	18,813.90
华泰联合证券	688722	同益中	网下申购	3,687	16,628.37
华泰联合证券	301033	迈普医学	网下申购	1,076	16,290.64
华泰联合证券	605389	长龄液压	网下申购	356	14,026.40
华泰联合证券	605208	永茂泰	网下申购	801	10,733.40
华泰联合证券	001234	泰慕士	网下申购	333	5,504.49

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

于 2022 年 12 月 31 日，本基金持有 21,127,905 股华泰证券的普通股，成本总额为人民币 288,480,415.79 元，估值总额为人民币 269,169,509.70 元，占基金净资产的比例为 0.35% (2021 年 12 月 31 日：无)；本基金持有 143,359,957 股中国工商银行的普通股，成本总额为人民币 639,741,301.90 元，估值总额为人民币 622,182,213.38 元，占基金净资产的比例为 0.80% (2021 年 12 月 31 日：无)。

7.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

序号	权益登记日	除息日		每 10 份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	本期利润分配合计	备注
		场内	场外					
1	2022 年 01 月 18 日	2022 年 1 月 19 日	-	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-
合计	-	-	-	0.7500	863,564,082.15	-	863,564,082.15	-

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
301095	广立微	2022 年 7 月 28 日	6 个月	新股锁定期内	58.00	86.49	740	42,920.00	64,002.60	-
301121	紫建电子	2022 年 8 月 1 日	6 个月	新股锁定期内	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301132	满坤科技	2022 年 8 月 3 日	6 个月	新股锁定期内	26.80	24.48	468	12,542.40	11,456.64	-
301139	元道通信	2022 年 6 月 30 日	6 个月	新股锁定期内	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	-
301152	天力锂能	2022 年 8 月 19 日	6 个月	新股锁定期内	57.00	46.64	433	24,681.00	20,195.12	-

301161	唯万密封	2022年 9月6日	6个月	新股锁 定期内	18.66	21.73	346	6,456.36	7,518.58	-
301165	锐捷网络	2022年 11月14日	6个月	新股锁 定期内	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	-
301171	易点天下	2022年 8月10日	6个月	新股锁 定期内	18.18	17.72	985	17,907.30	17,454.20	-
301175	中科环保	2022年 6月30日	6个月	新股锁 定期内	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	-
301176	逸豪新材	2022年 9月21日	6个月	新股锁 定期内	23.88	16.89	544	12,990.72	9,188.16	-
301197	工大科雅	2022年 7月29日	6个月	新股锁 定期内	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	-
301227	森鹰窗业	2022年 9月16日	6个月	新股锁 定期内	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	-
301230	泓博医药	2022年 10月21日	6个月	新股锁 定期内	40.00	48.32	269	10,760.00	12,998.08	-
301231	荣信文化	2022年 8月31日	6个月	新股锁 定期内	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	-
301233	盛帮股份	2022年 6月24日	6个月	新股锁 定期内	41.52	34.30	158	6,560.16	5,419.40	-
301239	普瑞眼科	2022年 6月22日	6个月	新股锁 定期内	33.65	69.68	575	19,348.75	40,066.00	-
301265	华新环保	2022年 12月8日	6个月	新股锁 定期内	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	-
301267	华夏眼科	2022年 10月26日	6个月	新股锁 定期内	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	-
301269	华大九天	2022年 7月21日	6个月	新股锁 定期内	32.69	87.94	1,168	38,181.92	102,713.92	-
301270	汉仪股份	2022年 8月19日	6个月	新股锁 定期内	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-

		日									
301277	新天地	2022年 11月9日	6个月	新股锁 定期内	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42		-
301282	金禄 电子	2022年 8月18日	6个月	新股锁 定期内	30.38	25.25	434	13,184.92	10,958.50		-
301283	聚胶 股份	2022年 8月26日	6个月	新股锁 定期内	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35		-
301285	鸿日 达	2022年 9月21日	6个月	新股锁 定期内	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00		-
301290	东星 医疗	2022年 11月23日	6个月	新股锁 定期内	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90		-
301296	新巨 丰	2022年 8月26日	6个月	新股锁 定期内	18.19	14.90	1,042	18,953.98	15,525.80		-
301297	富乐 德	2022年 12月23日	6个月	新股锁 定期内	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85		-
301300	远翔 新材	2022年 8月9日	6个月	新股锁 定期内	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07		-
301301	川宁 生物	2022年 12月20日	6个月	新股锁 定期内	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22		-
301306	西测 测试	2022年 7月19日	6个月	新股锁 定期内	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95		-
301309	万得 凯	2022年 9月8日	6个月	新股锁 定期内	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88		-
301311	昆船 智能	2022年 11月23日	6个月	新股锁 定期内	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52		-
301313	凡拓 数创	2022年 9月22日	6个月	新股锁 定期内	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58		-
301316	慧博 云通	2022年 9月29日	6个月	新股锁 定期内	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88		-
301319	唯特	2022年	6个月	新股锁	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05		-

	偶	9月22日		定期内							
301326	捷邦科技	2022年9月9日	6个月	新股锁定期内	51.72	36.62	227	11,740.44	8,312.74		-
301327	华宝新能	2022年9月8日	6个月	新股锁定期内	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74		-
301328	维峰电子	2022年8月30日	6个月	新股锁定期内	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36		-
301338	凯格精机	2022年8月8日	6个月	新股锁定期内	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43		-
301339	通行宝	2022年9月2日	6个月	新股锁定期内	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67		-
301349	信德新材	2022年8月30日	6个月	新股锁定期内	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60		-
301359	东南电子	2022年11月2日	6个月	新股锁定期内	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20		-
301361	众智科技	2022年11月8日	6个月	新股锁定期内	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32		-
301363	美好医疗	2022年9月28日	6个月	新股锁定期内	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25		-
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股锁定期内	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94		-
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股锁定期内	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20		-
301396	宏景科技	2022年11月4日	6个月	新股锁定期内	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40		-
688132	邦彦技术	2022年9月16日	6个月	新股锁定期内	28.88	22.80	4,844	139,894.72	110,443.20		-
688143	长盈通	2022年12月1日	6个月	新股锁定期内	35.67	42.66	1,938	69,128.46	82,675.08		-

688409	富创精密	2022年9月26日	6个月	新股锁定期内	69.99	95.65	6,334	443,316.66	605,847.10	-
688432	有研硅	2022年11月3日	6个月	新股锁定期内	9.91	11.24	20,044	198,636.04	225,294.56	-
688480	赛恩斯	2022年11月18日	6个月	新股锁定期内	19.18	20.19	2,302	44,152.36	46,477.38	-

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。

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

注：本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

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

注：本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

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	000063	中兴通讯	2023年1月3日-2023年1月11日	25.86	1,273,900	32,943,054.00
2	000568	泸州老窖	2023年1月2日-2023年1月10日	224.28	44,000	9,868,320.00
3	300769	德方纳米	2023年1月10日	229.59	10,000	2,295,900.00
4	300782	卓胜微	2023年1月2日-2023年1月13日	114.30	201,100	22,985,730.00

5	300896	爱美客	2023年1月2日-2023年1月13日	566.35	38,400	21,747,840.00
6	300919	中伟股份	2023年1月9日-2023年1月12日	65.61	134,000	8,791,740.00
7	300957	贝泰妮	2023年1月3日-2023年1月10日	149.24	83,000	12,386,920.00
8	300979	华利集团	2023年1月9日-2023年1月13日	57.11	97,800	5,585,358.00
9	300999	金龙鱼	2023年1月2日-2023年1月12日	43.56	141,200	6,150,672.00
10	600009	上海机场	2023年1月2日-2023年1月13日	57.71	383,600	22,137,556.00
11	600010	包钢股份	2023年1月2日-2023年1月13日	1.92	11,735,700	22,532,544.00
12	600011	华能国际	2023年1月2日-2023年1月13日	7.61	1,555,400	11,836,594.00
13	000596	古井贡酒	2023年1月4日-2023年1月9日	266.90	45,000	12,010,500.00
14	600018	上港集团	2023年1月2日-2023年1月3日	5.34	191,800	1,024,212.00
15	600025	华能水电	2023年1月3日-2023年1月4日	6.60	201,700	1,331,220.00
16	600028	中国石化	2023年1月3日	4.36	230,400	1,004,544.00
17	600029	南方航空	2023年1月2日-2023年1月13日	7.60	3,860,000	29,336,000.00
18	600031	三一重工	2023年1月2日-2023年1月13日	15.80	2,866,600	45,292,280.00
19	600036	招商银行	2023年1月9日	37.26	105,700	3,938,382.00
20	600048	保利发展	2023年1月10日-2023年1月13日	15.13	4,061,400	61,448,982.00
21	600050	中国联通	2023年1月2日-2023年1月13日	4.48	9,388,000	42,058,240.00
22	600085	同仁堂	2023年1月4日-2023年1月18日	44.68	248,800	11,116,384.00
23	600089	特变电工	2023年1月4日-2023年1月12日	20.08	151,100	3,034,088.00
24	000625	长安汽车	2023年1月2日-2023年1月13日	12.31	3,443,400	42,388,254.00
25	600104	上汽集团	2023年1月2日-2023年1月3日	14.41	205,300	2,958,373.00
26	600111	北方稀土	2023年1月2日-2023年1月12日	25.05	331,100	8,294,055.00
27	600115	中国东航	2023年1月2日-2023年1月13日	5.53	4,541,000	25,111,730.00
28	600132	重庆啤酒	2023年1月9日-2023年1月13日	127.38	20,000	2,547,600.00
29	600150	中国船舶	2023年1月2日-2023年1月12日	22.28	199,300	4,440,404.00
30	600176	中国巨石	2023年1月3日	13.71	20,000	274,200.00
31	600183	生益科技	2023年1月2日-2023年1月13日	14.41	697,600	10,052,416.00
32	600188	兖矿能源	2023年1月2日-2023年1月12日	33.58	368,000	12,357,440.00
33	600196	复星医药	2023年1月2日-2023年1月13日	35.24	770,600	27,155,944.00
34	600219	南山铝业	2023年1月5日-2023年1月12日	3.27	239,300	782,511.00
35	000661	长春高新	2023年1月9日	166.45	13,400	2,230,430.00
36	600276	恒瑞医药	2023年1月3日-2023年1月9日	38.53	194,000	7,474,820.00
37	600332	白云山	2023年1月2日-2023年1月12日	29.79	260,400	7,757,316.00
38	600346	恒力石化	2023年1月3日-2023年1月10日	15.53	380,300	5,906,059.00
39	600362	江西铜业	2023年1月4日-2023年1月9日	17.43	286,000	4,984,980.00
40	600383	金地集团	2023年1月2日-2023年1月11日	10.23	993,900	10,167,597.00
41	600406	国电南瑞	2023年1月2日-2023年1月3日	24.40	114,300	2,788,920.00
42	600426	华鲁恒升	2023年1月9日	33.15	10,000	331,500.00
43	600436	片仔癀	2023年1月12日-2023年1月17日	288.46	20,000	5,769,200.00
44	600438	通威股份	2023年1月2日-2023年1月13日	38.58	1,002,300	38,668,734.00
45	600460	士兰微	2023年1月2日-2023年1月12日	32.79	576,900	18,916,551.00
46	000708	中信特钢	2023年1月2日-2023年1月12日	17.16	222,500	3,818,100.00

47	600519	贵州茅台	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 10 日	1,727.00	24,200	41,793,400.00
48	600547	山东黄金	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 4 日	19.16	103,100	1,975,396.00
49	600570	恒生电子	2023 年 1 月 9 日	40.46	111,500	4,511,290.00
50	600584	长电科技	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 9 日	23.05	92,900	2,141,345.00
51	600585	海螺水泥	2023 年 1 月 3 日	27.38	20,000	547,600.00
52	600588	用友网络	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	24.17	475,300	11,488,001.00
53	600600	青岛啤酒	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	107.50	110,500	11,878,750.00
54	600606	绿地控股	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	2.98	2,657,000	7,917,860.00
55	600674	川投能源	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 13 日	12.23	250,300	3,061,169.00
56	600690	海尔智家	2023 年 1 月 11 日-2023 年 1 月 12 日	24.46	75,000	1,834,500.00
57	000725	京东方 A	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 3 日	3.38	3,129,900	10,579,062.00
58	600741	华域汽车	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	17.33	328,000	5,684,240.00
59	600745	闻泰科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 9 日	52.58	270,200	14,207,116.00
60	600760	中航沈飞	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	58.63	26,000	1,524,380.00
61	600763	通策医疗	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 18 日	152.99	104,200	15,941,558.00
62	600803	新奥股份	2023 年 1 月 10 日	16.10	122,300	1,969,030.00
63	600845	宝信软件	2023 年 1 月 2 日	44.80	50,100	2,244,480.00
64	600919	江苏银行	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 12 日	7.29	485,000	3,535,650.00
65	600941	中国移动	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	67.67	119,900	8,113,633.00
66	600989	宝丰能源	2023 年 1 月 2 日	12.07	98,400	1,187,688.00
67	601006	大秦铁路	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 12 日	6.68	589,700	3,939,196.00
68	000768	中航西飞	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 11 日	25.45	215,800	5,492,110.00
69	601012	隆基绿能	2023 年 1 月 9 日	42.26	167,600	7,082,776.00
70	601021	春秋航空	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	64.25	295,000	18,953,750.00
71	601066	中信建投	2023 年 1 月 13 日	23.75	81,400	1,933,250.00
72	601088	中国神华	2023 年 1 月 9 日	27.62	80,000	2,209,600.00
73	601100	恒立液压	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	63.15	320,400	20,233,260.00
74	601111	中国国航	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 16 日	10.60	1,977,400	20,960,440.00
75	601117	中国化学	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 12 日	7.94	472,700	3,753,238.00
76	601138	工业富联	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	9.18	220,000	2,019,600.00
77	601155	新城控股	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	20.50	584,100	11,974,050.00
78	601186	中国铁建	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	7.73	1,581,600	12,225,768.00
79	000786	北新建材	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 13 日	25.88	133,600	3,457,568.00
80	601216	君正集团	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	3.99	574,700	2,293,053.00
81	601225	陕西煤业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	18.58	199,500	3,706,710.00
82	601236	红塔证券	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 18 日	7.40	446,900	3,307,060.00
83	601238	广汽集团	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	11.03	807,400	8,905,622.00
84	601319	中国人保	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 5 日	5.22	232,800	1,215,216.00
85	601360	三六零	2023 年 1 月 2 日	6.54	261,400	1,709,556.00
86	601377	兴业证券	2023 年 1 月 13 日	5.74	427,600	2,454,424.00
87	601600	中国铝业	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 13 日	4.47	1,233,200	5,512,404.00
88	601615	明阳智能	2023 年 1 月 10 日	25.26	77,500	1,957,650.00
89	601618	中国中冶	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 10 日	3.18	1,508,200	4,796,076.00

90	000792	盐湖股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	22.69	1,776,300	40,304,247.00
91	601628	中国人寿	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 27 日	37.12	77,000	2,858,240.00
92	601633	长城汽车	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	29.62	850,900	25,203,658.00
93	601669	中国电建	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	7.08	5,561,000	39,371,880.00
94	601698	中国卫通	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	11.42	316,000	3,608,720.00
95	601728	中国电信	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	4.19	417,100	1,747,649.00
96	601766	中国中车	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 5 日	5.11	368,700	1,884,057.00
97	601788	光大证券	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	14.87	254,700	3,787,389.00
98	601799	星宇股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	127.37	50,000	6,368,500.00
99	601800	中国交建	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 10 日	8.05	1,858,700	14,962,535.00
100	601808	中海油服	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	16.58	279,400	4,632,452.00
101	000800	一汽解放	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	7.73	253,700	1,961,101.00
102	601865	福莱特	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	33.31	326,000	10,859,060.00
103	601868	中国能建	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	2.29	5,326,000	12,196,540.00
104	601877	正泰电器	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	27.70	254,100	7,038,570.00
105	601878	浙商证券	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 11 日	9.93	32,400	321,732.00
106	601888	中国中免	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 9 日	216.03	21,100	4,558,233.00
107	601898	中煤能源	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	8.62	801,600	6,909,792.00
108	601899	紫金矿业	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 12 日	10.00	490,700	4,907,000.00
109	601901	方正证券	2023 年 1 月 3 日	6.38	293,600	1,873,168.00
110	601919	中远海控	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	10.29	1,395,600	14,360,724.00
111	601966	玲珑轮胎	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 12 日	20.48	75,600	1,548,288.00
112	000069	华侨城 A	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	5.33	1,649,200	8,790,236.00
113	000858	五粮液	2023 年 1 月 2 日	180.69	42,300	7,643,187.00
114	601989	中国重工	2023 年 1 月 11 日	3.49	355,700	1,241,393.00
115	601995	中金公司	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 11 日	38.13	64,900	2,474,637.00
116	603019	中科曙光	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	22.14	730,800	16,179,912.00
117	603185	上机数控	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 10 日	105.85	63,000	6,668,550.00
118	603195	公牛集团	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 9 日	143.26	44,100	6,317,766.00
119	603259	药明康德	2023 年 1 月 9 日	81.00	149,900	12,141,900.00
120	603260	合盛硅业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	82.94	113,500	9,413,690.00
121	603288	海天味业	2023 年 1 月 6 日-2023 年 1 月 11 日	79.60	160,000	12,736,000.00
122	603290	斯达半导	2023 年 1 月 9 日	329.30	45,000	14,818,500.00
123	603392	万泰生物	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	126.70	76,000	9,629,200.00
124	000876	新希望	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	12.91	524,900	6,776,459.00
125	603486	科沃斯	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	72.94	145,100	10,583,594.00
126	603501	韦尔股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	77.09	214,700	16,551,223.00
127	603659	璞泰来	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	51.89	482,500	25,036,925.00
128	603799	华友钴业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	55.63	49,900	2,775,937.00
129	603806	福斯特	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	66.44	324,100	21,533,204.00
130	603833	欧派家居	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	121.53	71,100	8,640,783.00
131	603882	金域医学	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 13 日	78.20	38,000	2,971,600.00
132	603899	晨光股份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 13 日	54.98	88,300	4,854,734.00

133	603986	兆易创新	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	102.47	77,400	7,931,178.00
134	603993	洛阳钼业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	4.55	871,000	3,963,050.00
135	000877	天山股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	8.52	373,400	3,181,368.00
136	605117	德业股份	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 16 日	331.20	56,000	18,547,200.00
137	605499	东鹏饮料	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 9 日	177.90	22,500	4,002,750.00
138	688005	容百科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	68.75	175,000	12,031,250.00
139	688008	澜起科技	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	62.60	344,300	21,553,180.00
140	688012	中微公司	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 9 日	98.01	58,400	5,723,784.00
141	688036	传音控股	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	79.52	37,400	2,974,048.00
142	688065	凯赛生物	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	61.29	62,800	3,849,012.00
143	688111	金山办公	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 11 日	264.49	86,100	22,772,589.00
144	688126	沪硅产业	2023 年 1 月 12 日	17.61	14,300	251,823.00
145	688169	石头科技	2023 年 1 月 9 日	247.75	3,400	842,350.00
146	000895	双汇发展	2023 年 1 月 2 日	25.93	10,000	259,300.00
147	688303	大全能源	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 11 日	47.68	55,700	2,655,776.00
148	688363	华熙生物	2023 年 1 月 9 日	135.28	11,900	1,609,832.00
149	688396	华润微	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	52.65	53,200	2,800,980.00
150	688561	奇安信	2023 年 1 月 9 日	65.77	18,700	1,229,899.00
151	688599	天合光能	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	63.76	379,600	24,203,296.00
152	688981	中芯国际	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	41.14	84,300	3,468,102.00
153	000938	紫光股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 4 日	19.51	205,300	4,005,403.00
154	000963	华东医药	2023 年 1 月 12 日	46.80	10,000	468,000.00
155	000977	浪潮信息	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 10 日	21.52	679,000	14,612,080.00
156	001289	龙源电力	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 11 日	18.27	93,000	1,699,110.00
157	001979	招商蛇口	2023 年 1 月 2 日	12.63	199,700	2,522,211.00
158	002001	新和成	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	18.75	183,100	3,433,125.00
159	000100	TCL 科技	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	3.72	10,010,000	37,237,200.00
160	002007	华兰生物	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	22.63	322,700	7,302,701.00
161	002008	大族激光	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	25.65	283,300	7,266,645.00
162	002032	苏泊尔	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	49.46	76,000	3,758,960.00
163	002049	紫光国微	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 11 日	131.82	55,100	7,263,282.00
164	002050	三花智控	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 5 日	21.22	243,000	5,156,460.00
165	002064	华峰化学	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 10 日	6.80	671,700	4,567,560.00
166	002074	国轩高科	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	28.83	405,600	11,693,448.00
167	002120	韵达股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	14.38	1,076,000	15,472,880.00
168	002129	TCL 中环	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	37.66	254,400	9,580,704.00
169	002202	金风科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	11.00	353,700	3,890,700.00
170	000157	中联重科	2023 年 1 月 2 日	5.44	171,500	932,960.00
171	002230	科大讯飞	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 12 日	32.83	188,300	6,181,889.00
172	002236	大华股份	2023 年 1 月 13 日	11.31	83,500	944,385.00
173	002241	歌尔股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	16.83	1,025,700	17,262,531.00
174	002252	上海莱士	2023 年 1 月 5 日-2023 年 1 月 11 日	6.34	1,301,100	8,248,974.00
175	002271	东方雨虹	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	33.57	341,300	11,457,441.00

176	002311	海大集团	2023 年 1 月 9 日	61.73	33,900	2,092,647.00
177	002352	顺丰控股	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	57.76	739,600	42,719,296.00
178	002371	北方华创	2023 年 1 月 9 日	225.30	54,400	12,256,320.00
179	002410	广联达	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	59.95	95,500	5,725,225.00
180	002414	高德红外	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	11.00	269,800	2,967,800.00
181	000301	东方盛虹	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	13.04	1,445,000	18,842,800.00
182	002415	海康威视	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	34.68	843,300	29,245,644.00
183	002459	晶澳科技	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	60.09	922,200	55,414,998.00
184	002460	赣锋锂业	2023 年 1 月 9 日-2023 年 1 月 12 日	69.51	35,600	2,474,556.00
185	002466	天齐锂业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	78.99	174,400	13,775,856.00
186	002475	立讯精密	2023 年 1 月 11 日-2023 年 1 月 13 日	31.75	25,600	812,800.00
187	002493	荣盛石化	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 23 日	12.30	537,500	6,611,250.00
188	002555	三七互娱	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	18.10	633,600	11,468,160.00
189	002594	比亚迪	2023 年 1 月 9 日	256.97	26,600	6,835,402.00
190	002600	领益智造	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	4.54	1,712,300	7,773,842.00
191	002601	龙佰集团	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	18.92	202,400	3,829,408.00
192	000333	美的集团	2023 年 1 月 12 日	51.80	10,000	518,000.00
193	002602	世纪华通	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	3.81	866,000	3,299,460.00
194	002648	卫星化学	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 10 日	15.50	229,400	3,555,700.00
195	002709	天赐材料	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	43.86	890,000	39,035,400.00
196	002714	牧原股份	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 13 日	48.75	1,091,000	53,186,250.00
197	002736	国信证券	2023 年 1 月 3 日	8.88	20,000	177,600.00
198	002756	永兴材料	2023 年 1 月 9 日	92.17	14,500	1,336,465.00
199	002812	恩捷股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	131.29	212,600	27,912,254.00
200	002821	凯莱英	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	148.00	125,300	18,544,400.00
201	002841	视源股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	59.04	249,600	14,736,384.00
202	002916	深南电路	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	72.15	98,600	7,113,990.00
203	000408	藏格矿业	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	25.97	457,000	11,868,290.00
204	002920	德赛西威	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 13 日	105.34	103,600	10,913,224.00
205	002938	鹏鼎控股	2023 年 1 月 3 日	27.44	38,400	1,053,696.00
206	003816	中国广核	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 10 日	2.69	1,120,800	3,014,952.00
207	300014	亿纬锂能	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 20 日	87.90	120,300	10,574,370.00
208	300015	爱尔眼科	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	31.07	397,200	12,341,004.00
209	300033	同花顺	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	98.61	76,300	7,523,943.00
210	300059	东方财富	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 9 日	19.40	652,500	12,658,500.00
211	300122	智飞生物	2023 年 1 月 9 日	87.83	125,300	11,005,099.00
212	300142	沃森生物	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	40.19	265,800	10,682,502.00
213	300207	欣旺达	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	21.15	944,000	19,965,600.00
214	000425	徐工机械	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	5.07	352,900	1,789,203.00
215	300223	北京君正	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	70.44	41,500	2,923,260.00
216	300274	阳光电源	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	111.80	360,200	40,270,360.00
217	300316	晶盛机电	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	63.56	11,200	711,872.00
218	300347	泰格医药	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	104.80	12,500	1,310,000.00

219	300408	三环集团	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 20 日	30.71	185,100	5,684,421.00
220	300413	芒果超媒	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	30.02	319,000	9,576,380.00
221	300433	蓝思科技	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 20 日	10.53	349,600	3,681,288.00
222	300450	先导智能	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	40.25	776,000	31,234,000.00
223	300454	深信服	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	112.55	62,900	7,079,395.00
224	300496	中科创达	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	100.30	247,000	24,774,100.00
225	000538	云南白药	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	54.36	39,200	2,130,912.00
226	300498	温氏股份	2023 年 1 月 4 日-2023 年 1 月 5 日	19.63	111,900	2,196,597.00
227	300529	健帆生物	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 12 日	30.97	114,700	3,552,259.00
228	300595	欧普康视	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 11 日	35.70	351,500	12,548,550.00
229	300601	康泰生物	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 17 日	31.53	346,600	10,928,298.00
230	300628	亿联网络	2023 年 1 月 3 日-2023 年 1 月 20 日	60.59	53,800	3,259,742.00
231	300661	圣邦股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	172.60	165,000	28,479,000.00
232	300750	宁德时代	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 9 日	393.42	131,800	51,852,756.00
233	300751	迈为股份	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	411.84	51,300	21,127,392.00
234	300759	康龙化成	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 12 日	68.00	266,800	18,142,400.00
235	300763	锦浪科技	2023 年 1 月 2 日-2023 年 1 月 13 日	180.05	86,000	15,484,300.00
合计	-	-	-	-	140,938,500	2,488,714,672.00

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

本基金为被动式指数基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金，主要投资于标的指数成份股和备选成份股。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，力争实现保持基金净值增长率与标的指数增长率间的高度正相关，并保持跟踪误差在合同约定的范围内。

本基金的基金管理人建立的风险管理体系由“组织、制度、流程和报告”等四个方面构成。组织是指公司的风险管理组织架构包括董事会下设的风险管理与审计委员会、公司管理层的风险控制委员会、风险管理部和合规法律部以及公司各业务部门，董事会对建立基金风险管理内部控制系统和维持其有效性承担最终责任；制度是指风险管理相关的规章制度，是对组织职能及其工作流程等的具体规定；流程是风险管理的工作流程，它详细规定了各部门之间风险管理工作的内容和程序；报告是对流程的必要反映和记录，既是风险管理工作的重要环节，也是对风险管理工作的总结和披露。

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。本基金的银行存款存放在本基金的托管人中国工商银行，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。

于 2022 年 12 月 31 日，本基金无债券投资(2021 年 12 月 31 日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。于 2022 年 12 月 31 日，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。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。

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逆回购交易质押品管理制度：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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	155,603,662.35	-	-	-	-	-	155,603,662.35
结算备付金	1,179,756,245.63	-	-	-	-	-	1,179,756,245.63
存出保证金	5,233,689.95	-	-	-	-	108,224,424.00	113,458,113.95
交易性金融资产	-	-	-	-	-	76,183,605,477.34	76,183,605,477.34
应收股利	-	-	-	-	-	329,237.44	329,237.44

应收清算款	-	-	-	-	-	2,829,488.24	2,829,488.24
其他资产	-	-	-	-	-	1,122,995.87	1,122,995.87
资产总计	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,296,111,622.89	77,636,705,220.82
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	30,652.12	30,652.12
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	30,555,976.07	30,555,976.07
应付托管费	-	-	-	-	-	6,111,195.25	6,111,195.25
应付清算款	-	-	-	-	-	53,830,041.48	53,830,041.48
应交税费	-	-	-	-	-	11.83	11.83
其他负债	-	-	-	-	-	43,674,118.72	43,674,118.72
负债总计	-	-	-	-	-	134,201,995.47	134,201,995.47
利率敏感度缺口	1,340,593,597.93	-	-	-	-	76,161,909,627.42	77,502,503,225.35
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	235,699,884.97	-	-	-	-	-	235,699,884.97
结算备付金	1,222,370,183.37	-	-	-	-	-	1,222,370,183.37
存出保证金	4,751,631.44	-	-	-	-	137,795,000.40	142,546,631.84
交易性金融资产	-	-	-	-	-	55,381,502,659.10	55,381,502,659.10
应收证券清算款	-	-	-	-	-	19,407,797.62	19,407,797.62
其他资产	-	-	-	-	-	1,708,435.57	1,708,435.57
资产总计	1,462,821,699.78	-	-	-	-	55,540,413,892.69	57,003,235,592.47
负债	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	67,951.26	67,951.26
应付证券清算款	-	-	-	-	-	5,546,645.91	5,546,645.91
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	20,251,085.76	20,251,085.76
应付托管费	-	-	-	-	-	4,050,217.15	4,050,217.15
应交税费	-	-	-	-	-	308,093.67	308,093.67
其他负债	-	-	-	-	-	86,952,361.26	86,952,361.26
负债总计	-	-	-	-	-	117,176,355.01	117,176,355.01
利率敏感度缺口	1,462,821,699.78	-	-	-	-	55,423,237,537.68	56,886,059,237.46

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约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

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

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。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，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	76,183,605,477.34	98.30	55,381,502,659.10	97.36
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	-30,652.12	-0.00	-67,951.26	-
合计	76,183,574,825.22	98.30	55,381,434,707.84	97.36

注：其他包含：1、可退替代款。2、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	除沪深 300 指数以外的其他市场变量保持不变		
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)	
分析	沪深 300 指数上升 5%	3,831,464,307.45	2,815,474,920.97
	沪深 300 指数下降	-3,831,464,307.45	-2,815,474,920.97

	5%		
--	----	--	--

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
第一层次	76,181,672,587.51	55,379,541,438.20
第二层次	-	1,961,220.90
第三层次	1,932,889.83	-
合计	76,183,605,477.34	55,381,502,659.10

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的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		合计
	交易性金融资产		
	债券投资	股票投资	

期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,058,988.63	4,058,988.63
转出第三层次	-	4,273,739.27	4,273,739.27
当期利得或损失总额	-	2,147,640.47	2,147,640.47
其中：计入损益的利得或损失	-	2,147,640.47	2,147,640.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,932,889.83	1,932,889.83
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	-	269,864.73	269,864.73
项目	上年度可比同期 2021年1月1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	-	-	-
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	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
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	-	-	-

注：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
证券交易所上市但尚在限售期内的股票	1,932,889.83	平均价格亚式期权模型	预期波动率	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
-	-	-	-	-	-

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

(1) 基金申购款

于 2022 年度，本基金申购基金份额的对价总额为 105,159,059,833.45 元(2021 年度：115,491,478,987.32 元)，其中包括以股票支付的申购款 59,562,854,288.89 元和以现金支付的申购款 45,596,205,544.56 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 68,224,286,895.92 元和以现金支付的申购款 47,267,192,091.40 元)。

(2) 除基金申购款外，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	76,183,605,477.34	98.13
	其中：股票	76,183,605,477.34	98.13
2	基金投资	-	-

3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,335,359,907.98	1.72
8	其他各项资产	117,739,835.50	0.15
9	合计	77,636,705,220.82	100.00

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借股票的公允价值为 2,488,714,672.00 元，占本基金期末资产净值的 3.21%。其中，报告期内本基金与关联方进行转融通证券出借业务的证券 8,163,230 手，报告期末本基金与关联方进行转融通证券出借业务的余额为 1,086,596,630.00 元。

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	953,980,175.85	1.23
B	采矿业	2,198,380,850.01	2.84
C	制造业	43,345,274,415.56	55.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,129,000,808.93	2.75
E	建筑业	1,655,738,669.94	2.14
F	批发和零售业	171,068,508.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,553,067,739.68	3.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,915,956,532.64	3.76
J	金融业	15,877,253,228.38	20.49
K	房地产业	1,414,972,672.76	1.83
L	租赁和商务服务业	1,146,675,227.16	1.48
M	科学研究和技术服务业	1,047,728,960.00	1.35
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和	-	-

	其他服务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	682,428,724.48	0.88
R	文化、体育和娱乐业	90,077,351.56	0.12
S	综合	-	-
	合计	76,181,603,864.95	98.30

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

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	1,516,327.92	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,288.81	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,966.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	84,761.08	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	2,001,612.39	0.00

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：注：本基金本报告期内未持有港股通股票。

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	600519	贵州茅台	2,547,369	4,399,306,263.00	5.68
2	300750	宁德时代	6,041,844	2,376,982,266.48	3.07
3	601318	中国平安	44,522,018	2,092,534,846.00	2.70
4	600036	招商银行	50,734,988	1,890,385,652.88	2.44
5	000858	五粮液	8,005,901	1,446,586,251.69	1.87
6	601012	隆基绿能	24,956,036	1,054,642,081.36	1.36
7	601166	兴业银行	59,729,121	1,050,635,238.39	1.36
8	000333	美的集团	20,055,073	1,038,852,781.40	1.34
9	600900	长江电力	46,722,563	981,173,823.00	1.27
10	002594	比亚迪	3,756,451	965,295,213.47	1.25
11	601888	中国中免	4,026,828	869,915,652.84	1.12
12	300059	东方财富	43,366,339	841,306,976.60	1.09
13	600887	伊利股份	26,102,723	809,184,413.00	1.04
14	600030	中信证券	40,118,250	798,754,357.50	1.03
15	600309	万华化学	7,749,448	717,986,357.20	0.93
16	600276	恒瑞医药	18,238,534	702,730,715.02	0.91
17	603259	药明康德	8,436,108	683,324,748.00	0.88
18	002415	海康威视	19,358,442	671,350,768.56	0.87
19	000568	泸州老窖	2,964,735	664,930,765.80	0.86
20	002475	立讯精密	20,314,829	644,995,820.75	0.83
21	300760	迈瑞医疗	2,000,385	632,061,648.45	0.82
22	601398	工商银行	143,359,957	622,182,213.38	0.80
23	000651	格力电器	18,563,521	599,972,998.72	0.77
24	601899	紫金矿业	59,072,231	590,722,310.00	0.76
25	002352	顺丰控股	10,039,695	579,892,783.20	0.75
26	600809	山西汾酒	2,012,096	573,427,239.04	0.74
27	300124	汇川技术	7,700,898	535,212,411.00	0.69
28	601328	交通银行	112,686,102	534,132,123.48	0.69
29	002714	牧原股份	10,905,181	531,627,573.75	0.69
30	002142	宁波银行	16,321,820	529,643,059.00	0.68
31	000001	平安银行	39,760,838	523,252,628.08	0.68
32	000725	京东方 A	153,807,547	519,869,508.86	0.67
33	000002	万科 A	27,940,825	508,523,015.00	0.66
34	000792	盐湖股份	22,119,016	501,880,473.04	0.65
35	601816	京沪高铁	99,325,404	488,680,987.68	0.63
36	300274	阳光电源	4,271,323	477,533,911.40	0.62
37	601668	中国建筑	86,069,645	467,358,172.35	0.60
38	300015	爱尔眼科	14,757,725	458,522,515.75	0.59

39	603288	海天味业	5,749,699	457,676,040.40	0.59
40	600048	保利发展	29,550,193	447,094,420.09	0.58
41	300014	亿纬锂能	4,971,255	436,973,314.50	0.56
42	600438	通威股份	11,061,152	426,739,244.16	0.55
43	300498	温氏股份	21,515,670	422,352,602.10	0.54
44	002129	TCL 中环	10,598,407	399,136,007.62	0.51
45	002304	洋河股份	2,452,912	393,692,376.00	0.51
46	600031	三一重工	24,361,500	384,911,700.00	0.50
47	601288	农业银行	131,048,206	381,350,279.46	0.49
48	600690	海尔智家	15,506,208	379,281,847.68	0.49
49	600436	片仔癀	1,293,660	373,169,163.60	0.48
50	601088	中国神华	13,495,335	372,741,152.70	0.48
51	002049	紫光国微	2,757,538	363,498,659.16	0.47
52	600919	江苏银行	48,214,947	351,486,963.63	0.45
53	600016	民生银行	101,801,117	351,213,853.65	0.45
54	600050	中国联通	78,210,801	350,384,388.48	0.45
55	600000	浦发银行	48,114,102	350,270,662.56	0.45
56	601601	中国太保	14,077,840	345,188,636.80	0.45
57	600837	海通证券	39,546,456	343,658,702.64	0.44
58	000063	中兴通讯	13,049,724	337,465,862.64	0.44
59	002466	天齐锂业	4,251,040	335,789,649.60	0.43
60	600406	国电南瑞	13,680,155	333,795,782.00	0.43
61	688981	中芯国际	8,071,398	332,057,313.72	0.43
62	002460	赣锋锂业	4,612,994	320,649,212.94	0.41
63	600089	特变电工	15,831,862	317,903,788.96	0.41
64	601225	陕西煤业	15,866,007	294,790,410.06	0.38
65	300122	智飞生物	3,339,519	293,309,953.77	0.38
66	002812	恩捷股份	2,194,102	288,063,651.58	0.37
67	603799	华友钴业	5,157,407	286,906,551.41	0.37
68	688599	天合光能	4,428,114	282,336,548.64	0.36
69	002271	东方雨虹	8,297,003	278,530,390.71	0.36
70	600104	上汽集团	19,206,211	276,761,500.51	0.36
71	002027	分众传媒	41,431,074	276,759,574.32	0.36
72	603986	兆易创新	2,700,777	276,748,619.19	0.36
73	601988	中国银行	86,458,469	273,208,762.04	0.35
74	600585	海螺水泥	9,924,581	271,735,027.78	0.35
75	601688	华泰证券	21,127,905	269,169,509.70	0.35
76	601919	中远海控	26,102,860	268,598,429.40	0.35
77	300142	沃森生物	6,558,454	263,584,266.26	0.34
78	601169	北京银行	60,695,791	261,598,859.21	0.34
79	002371	北方华创	1,153,491	259,881,522.30	0.34
80	601728	中国电信	60,954,093	255,397,649.67	0.33
81	601766	中国中车	49,884,209	254,908,307.99	0.33

82	600570	恒生电子	6,256,025	253,118,771.50	0.33
83	002230	科大讯飞	7,697,875	252,721,236.25	0.33
84	601628	中国人寿	6,797,133	252,309,576.96	0.33
85	601211	国泰君安	18,564,980	252,298,078.20	0.33
86	000625	长安汽车	20,322,514	250,170,147.34	0.32
87	601229	上海银行	40,822,367	241,260,188.97	0.31
88	600028	中国石化	54,782,900	238,853,444.00	0.31
89	600009	上海机场	4,100,191	236,622,022.61	0.31
90	002410	广联达	3,940,977	236,261,571.15	0.30
91	601390	中国中铁	42,230,071	234,799,194.76	0.30
92	002459	晶澳科技	3,892,853	233,921,536.77	0.30
93	600893	航发动力	5,527,801	233,715,426.28	0.30
94	601985	中国核电	38,688,040	232,128,240.00	0.30
95	600660	福耀玻璃	6,561,312	230,105,211.84	0.30
96	000661	长春高新	1,374,471	228,780,697.95	0.30
97	000338	潍柴动力	22,207,986	226,077,297.48	0.29
98	300347	泰格医药	2,152,600	225,592,480.00	0.29
99	300896	爱美客	397,990	225,401,636.50	0.29
100	600111	北方稀土	8,917,692	223,388,184.60	0.29
101	601009	南京银行	21,193,733	220,838,697.86	0.28
102	603501	韦尔股份	2,863,499	220,747,137.91	0.28
103	601669	中国电建	30,995,785	219,450,157.80	0.28
104	002311	海大集团	3,461,237	213,662,160.01	0.28
105	000100	TCL 科技	56,812,973	211,344,259.56	0.27
106	601818	光大银行	67,756,007	208,010,941.49	0.27
107	002709	天赐材料	4,721,996	207,106,744.56	0.27
108	601658	邮储银行	44,715,800	206,586,996.00	0.27
109	600019	宝钢股份	36,559,145	204,365,620.55	0.26
110	600588	用友网络	8,402,809	203,095,893.53	0.26
111	600426	华鲁恒升	6,124,107	203,014,147.05	0.26
112	600999	招商证券	15,212,009	202,319,719.70	0.26
113	688008	澜起科技	3,228,540	202,106,604.00	0.26
114	600905	三峡能源	35,152,700	198,612,755.00	0.26
115	601857	中国石油	39,746,918	197,542,182.46	0.25
116	002179	中航光电	3,325,891	192,103,464.16	0.25
117	600958	东方证券	21,466,052	191,906,504.88	0.25
118	000776	广发证券	12,211,136	189,150,496.64	0.24
119	002050	三花智控	8,790,490	186,534,197.80	0.24
120	688111	金山办公	696,954	184,337,363.46	0.24
121	600760	中航沈飞	3,138,400	184,004,392.00	0.24
122	600196	复星医药	5,173,725	182,322,069.00	0.24
123	300450	先导智能	4,481,250	180,370,312.50	0.23
124	600010	包钢股份	93,448,268	179,420,674.56	0.23

125	002180	纳思达	3,418,672	177,394,890.08	0.23
126	000963	华东医药	3,655,310	171,068,508.00	0.22
127	300408	三环集团	5,538,930	170,100,540.30	0.22
128	688012	中微公司	1,728,173	169,378,235.73	0.22
129	300316	晶盛机电	2,662,400	169,222,144.00	0.22
130	000733	振华科技	1,475,938	168,596,397.74	0.22
131	600029	南方航空	22,064,941	167,693,551.60	0.22
132	002241	歌尔股份	9,870,993	166,128,812.19	0.21
133	300661	圣邦股份	960,469	165,776,949.40	0.21
134	000596	古井贡酒	615,400	164,250,260.00	0.21
135	601989	中国重工	46,858,738	163,536,995.62	0.21
136	600600	青岛啤酒	1,517,560	163,137,700.00	0.21
137	601377	兴业证券	28,323,045	162,574,278.30	0.21
138	601006	大秦铁路	24,330,733	162,529,296.44	0.21
139	600150	中国船舶	7,292,000	162,465,760.00	0.21
140	601615	明阳智能	6,349,831	160,396,731.06	0.21
141	600926	杭州银行	12,228,882	159,953,776.56	0.21
142	001979	招商蛇口	12,659,614	159,890,924.82	0.21
143	000938	紫光股份	8,179,375	159,579,606.25	0.21
144	600745	闻泰科技	3,004,875	157,996,327.50	0.20
145	000538	云南白药	2,905,889	157,964,126.04	0.20
146	600795	国电电力	36,591,897	156,247,400.19	0.20
147	300782	卓胜微	1,360,487	155,503,664.10	0.20
148	601939	建设银行	27,616,609	155,481,508.67	0.20
149	002493	荣盛石化	12,521,951	154,019,997.30	0.20
150	601138	工业富联	16,375,500	150,327,090.00	0.19
151	600941	中国移动	2,214,307	149,842,154.69	0.19
152	601633	长城汽车	4,987,975	147,743,819.50	0.19
153	000166	申万宏源	36,960,259	147,101,830.82	0.19
154	601186	中国铁建	18,943,950	146,436,733.50	0.19
155	000768	中航西飞	5,732,155	145,883,344.75	0.19
156	603659	璞泰来	2,806,363	145,622,176.07	0.19
157	601600	中国铝业	32,456,629	145,081,131.63	0.19
158	603806	福斯特	2,181,638	144,948,028.72	0.19
159	002001	新和成	7,685,151	144,096,581.25	0.19
160	600547	山东黄金	7,365,811	141,128,938.76	0.18
161	300759	康龙化成	2,041,349	138,811,732.00	0.18
162	601838	成都银行	9,024,311	138,071,958.30	0.18
163	601995	中金公司	3,589,921	136,883,687.73	0.18
164	600011	华能国际	17,966,029	136,721,480.69	0.18
165	600233	圆通速递	6,797,400	136,559,766.00	0.18
166	300496	中科创达	1,360,228	136,430,868.40	0.18
167	600176	中国巨石	9,924,984	136,071,530.64	0.18

168	600584	长电科技	5,883,200	135,607,760.00	0.17
169	601100	恒立液压	2,144,034	135,395,747.10	0.17
170	600015	华夏银行	26,058,726	135,244,787.94	0.17
171	600346	恒力石化	8,659,339	134,479,534.67	0.17
172	600886	国投电力	12,305,799	133,271,803.17	0.17
173	300751	迈为股份	323,539	133,246,301.76	0.17
174	600383	金地集团	12,923,486	132,207,261.78	0.17
175	603993	洛阳钼业	28,889,243	131,446,055.65	0.17
176	601111	中国国航	12,317,702	130,567,641.20	0.17
177	603369	今世缘	2,531,286	128,842,457.40	0.17
178	600763	通策医疗	838,007	128,206,690.93	0.17
179	600188	兖矿能源	3,797,610	127,523,743.80	0.16
180	002920	德赛西威	1,200,726	126,484,476.84	0.16
181	002074	国轩高科	4,370,894	126,012,874.02	0.16
182	601066	中信建投	5,270,798	125,181,452.50	0.16
183	300763	锦浪科技	694,000	124,954,700.00	0.16
184	002202	金风科技	11,272,614	123,998,754.00	0.16
185	600115	中国东航	22,382,356	123,774,428.68	0.16
186	600085	同仁堂	2,765,147	123,546,767.96	0.16
187	000425	徐工机械	24,191,643	122,651,630.01	0.16
188	002252	上海莱士	19,254,395	122,072,864.30	0.16
189	601868	中国能建	53,305,300	122,069,137.00	0.16
190	601877	正泰电器	4,398,421	121,836,261.70	0.16
191	601788	光大证券	8,064,024	119,912,036.88	0.15
192	000876	新希望	9,259,985	119,546,406.35	0.15
193	601117	中国化学	15,046,544	119,469,559.36	0.15
194	601800	中国交建	14,537,905	117,030,135.25	0.15
195	600460	士兰微	3,540,633	116,097,356.07	0.15
196	002821	凯莱英	758,100	112,198,800.00	0.14
197	600741	华域汽车	6,467,744	112,086,003.52	0.14
198	002601	龙佰集团	5,923,345	112,069,687.40	0.14
199	605117	德业股份	337,920	111,919,104.00	0.14
200	600132	重庆啤酒	875,879	111,569,467.02	0.14
201	000895	双汇发展	4,286,634	111,152,419.62	0.14
202	300207	欣旺达	5,254,349	111,129,481.35	0.14
203	000157	中联重科	20,275,295	110,297,604.80	0.14
204	688396	华润微	2,063,397	108,637,852.05	0.14
205	600989	宝丰能源	8,976,700	108,348,769.00	0.14
206	000786	北新建材	4,178,111	108,129,512.68	0.14
207	601901	方正证券	16,932,547	108,029,649.86	0.14
208	600845	宝信软件	2,390,885	107,111,648.00	0.14
209	002648	卫星化学	6,865,461	106,414,645.50	0.14
210	300999	金龙鱼	2,428,700	105,794,172.00	0.14

211	603019	中科曙光	4,757,275	105,326,068.50	0.14
212	601021	春秋航空	1,638,347	105,263,794.75	0.14
213	601336	新华保险	3,495,252	105,137,180.16	0.14
214	300454	深信服	928,126	104,460,581.30	0.13
215	002736	国信证券	11,759,400	104,423,472.00	0.13
216	601689	拓普集团	1,758,300	103,001,214.00	0.13
217	300769	德方纳米	444,999	102,167,320.41	0.13
218	002007	华兰生物	4,468,968	101,132,745.84	0.13
219	000301	东方盛虹	7,708,000	100,512,320.00	0.13
220	002555	三七互娱	5,550,628	100,466,366.80	0.13
221	601238	广汽集团	9,011,140	99,392,874.20	0.13
222	688036	传音控股	1,244,151	98,934,887.52	0.13
223	603882	金域医学	1,223,779	95,699,517.80	0.12
224	000723	美锦能源	10,513,315	94,830,101.30	0.12
225	600219	南山铝业	28,741,230	93,983,822.10	0.12
226	601618	中国中冶	29,408,948	93,520,454.64	0.12
227	300628	亿联网络	1,520,232	92,110,856.88	0.12
228	000977	浪潮信息	4,217,312	90,756,554.24	0.12
229	300413	芒果超媒	3,000,578	90,077,351.56	0.12
230	002008	大族激光	3,509,334	90,014,417.10	0.12
231	000069	华侨城 A	16,878,129	89,960,427.57	0.12
232	003816	中国广核	32,414,300	87,194,467.00	0.11
233	603392	万泰生物	688,028	87,173,147.60	0.11
234	002841	视源股份	1,470,512	86,819,028.48	0.11
235	300433	蓝思科技	8,219,589	86,552,272.17	0.11
236	002120	韵达股份	5,996,068	86,223,457.84	0.11
237	603899	晨光股份	1,558,539	85,688,474.22	0.11
238	300601	康泰生物	2,716,002	85,635,543.06	0.11
239	600674	川投能源	6,981,574	85,384,650.02	0.11
240	600332	白云山	2,842,752	84,685,582.08	0.11
241	600039	四川路桥	7,560,485	84,072,593.20	0.11
242	002236	大华股份	7,400,847	83,703,579.57	0.11
243	603290	斯达半导	251,500	82,818,950.00	0.11
244	603833	欧派家居	679,607	82,592,638.71	0.11
245	600884	杉杉股份	4,482,162	81,575,348.40	0.11
246	002602	世纪华通	21,277,817	81,068,482.77	0.10
247	603185	上机数控	760,525	80,501,571.25	0.10
248	601878	浙商证券	8,038,736	79,824,648.48	0.10
249	688126	沪硅产业	4,461,616	78,569,057.76	0.10
250	601155	新城控股	3,770,567	77,296,623.50	0.10
251	002938	鹏鼎控股	2,801,600	76,875,904.00	0.10
252	601360	三六零	11,625,605	76,031,456.70	0.10
253	300033	同花顺	769,696	75,899,722.56	0.10

254	600362	江西铜业	4,264,129	74,323,768.47	0.10
255	688005	容百科技	1,075,231	73,922,131.25	0.10
256	600918	中泰证券	11,355,400	72,788,114.00	0.09
257	300957	贝泰妮	486,264	72,570,039.36	0.09
258	002756	永兴材料	777,656	71,676,553.52	0.09
259	000708	中信特钢	4,162,754	71,432,858.64	0.09
260	688561	奇安信	1,080,122	71,039,623.94	0.09
261	601865	福莱特	2,097,025	69,851,902.75	0.09
262	601799	星宇股份	547,192	69,695,845.04	0.09
263	603260	合盛硅业	831,412	68,957,311.28	0.09
264	601319	中国人保	13,086,800	68,313,096.00	0.09
265	600183	生益科技	4,729,235	68,148,276.35	0.09
266	600061	国投资本	10,574,244	67,569,419.16	0.09
267	600018	上港集团	12,483,442	66,661,580.28	0.09
268	300595	欧普康视	1,862,367	66,486,501.90	0.09
269	000408	藏格矿业	2,544,700	66,085,859.00	0.09
270	601898	中煤能源	7,414,759	63,915,222.58	0.08
271	603486	科沃斯	869,000	63,384,860.00	0.08
272	601998	中信银行	12,619,266	62,843,944.68	0.08
273	300223	北京君正	889,200	62,635,248.00	0.08
274	300529	健帆生物	2,009,270	62,227,091.90	0.08
275	600803	新奥股份	3,736,000	60,149,600.00	0.08
276	002414	高德红外	5,388,558	59,274,138.00	0.08
277	002064	华峰化学	8,098,095	55,067,046.00	0.07
278	601216	君正集团	13,751,309	54,867,722.91	0.07
279	688303	大全能源	1,141,530	54,428,150.40	0.07
280	688187	时代电气	975,463	53,231,015.91	0.07
281	688169	石头科技	211,465	52,390,453.75	0.07
282	002600	领益智造	11,472,221	52,083,883.34	0.07
283	600606	绿地控股	17,292,796	51,532,532.08	0.07
284	300919	中伟股份	779,522	51,144,438.42	0.07
285	002916	深南电路	708,861	51,144,321.15	0.07
286	688363	华熙生物	370,550	50,128,004.00	0.06
287	601966	玲珑轮胎	2,390,461	48,956,641.28	0.06
288	601881	中国银河	5,200,952	48,316,844.08	0.06
289	600025	华能水电	7,287,700	48,098,820.00	0.06
290	603195	公牛集团	288,500	41,330,510.00	0.05
291	601808	中海油服	2,395,500	39,717,390.00	0.05
292	688065	凯赛生物	634,077	38,862,579.33	0.05
293	000877	天山股份	3,867,800	32,953,656.00	0.04
294	300979	华利集团	551,209	31,479,545.99	0.04
295	000800	一汽解放	3,879,700	29,990,081.00	0.04
296	002032	苏泊尔	602,651	29,807,118.46	0.04

297	601236	红塔证券	3,925,310	29,047,294.00	0.04
298	605499	东鹏饮料	160,000	28,464,000.00	0.04
299	601698	中国卫通	1,785,700	20,392,694.00	0.03
300	001289	龙源电力	548,318	10,017,769.86	0.01

注：上述股票价值不包括可退替代估增。

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	688409	富创精密	6,334	605,847.10	0.00
2	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.00
3	688132	邦彦技术	4,844	110,443.20	0.00
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	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
7	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
8	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
9	688480	赛恩斯	2,302	46,477.38	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	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
16	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
17	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
18	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
19	301363	美好医疗	445	16,843.25	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	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
23	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
24	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
25	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
26	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
27	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
28	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
29	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
30	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
31	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
32	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00
33	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
34	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00

35	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
36	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
37	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
38	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
39	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
40	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
41	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
42	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
43	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
44	301285	鸿日达	565	7,119.00	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	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
48	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
49	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
50	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
51	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
52	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
53	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	3,891,112,605.60	6.84
2	000858	五粮液	1,947,599,311.82	3.42
3	000333	美的集团	1,554,938,525.64	2.73
4	002594	比亚迪	1,520,854,791.17	2.67
5	300059	东方财富	1,281,073,812.00	2.25
6	002475	立讯精密	945,552,850.33	1.66
7	002415	海康威视	935,077,471.37	1.64
8	300760	迈瑞医疗	886,448,004.45	1.56
9	000651	格力电器	857,290,815.35	1.51
10	000725	京东方 A	797,379,221.42	1.40
11	002714	牧原股份	775,386,605.72	1.36
12	000792	盐湖股份	770,182,740.38	1.35
13	002371	北方华创	769,047,020.83	1.35
14	002142	宁波银行	756,414,085.93	1.33
15	000001	平安银行	747,645,645.70	1.31
16	300124	汇川技术	706,264,685.60	1.24
17	000002	万科 A	702,420,514.79	1.23
18	002352	顺丰控股	699,797,676.32	1.23
19	000568	泸州老窖	668,065,544.70	1.17

20	300274	阳光电源	610,673,236.44	1.07
----	--------	------	----------------	------

注：不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	2,914,445,823.70	5.12
2	000858	五粮液	1,479,611,387.06	2.60
3	000333	美的集团	1,201,092,071.58	2.11
4	002594	比亚迪	1,184,091,505.52	2.08
5	300059	东方财富	965,080,597.87	1.70
6	002475	立讯精密	721,122,762.68	1.27
7	002415	海康威视	711,252,198.53	1.25
8	002371	北方华创	675,070,909.80	1.19
9	000651	格力电器	659,781,376.23	1.16
10	300760	迈瑞医疗	652,366,947.60	1.15
11	002142	宁波银行	575,316,045.85	1.01
12	000001	平安银行	572,326,798.02	1.01
13	002714	牧原股份	552,936,415.61	0.97
14	000725	京东方 A	528,289,986.52	0.93
15	300124	汇川技术	524,561,929.73	0.92
16	000002	万科 A	520,049,963.52	0.91
17	002460	赣锋锂业	491,943,150.95	0.86
18	300122	智飞生物	478,013,925.08	0.84
19	002812	恩捷股份	446,137,426.00	0.78
20	000661	长春高新	438,847,329.74	0.77

注：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	50,526,910,219.05
卖出股票收入（成交）总额	36,817,120,319.82

注：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

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

注：本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：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

注：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

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本报告期内，基金投资股指期货的目的是为了提升基金的流动性水平，以及在期货贴水时作为现货的替代。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

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 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查的，也没有在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.12.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

基金投资的前十名股票中，没有投资于超出基金合同规定备选股票库之外的。

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	113,458,113.95
2	应收清算款	2,829,488.24
3	应收股利	329,237.44
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	1,122,995.87
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	117,739,835.50

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300750	宁德时代	51,852,756.00	0.07	转融通证券出借
2	600519	贵州茅台	41,793,400.00	0.05	转融通证券出借
3	000858	五粮液	7,643,187.00	0.01	转融通证券出借
4	601012	隆基绿能	7,082,776.00	0.01	转融通证券出借
5	002594	比亚迪	6,835,402.00	0.01	转融通证券出借
6	600036	招商银行	3,938,382.00	0.01	转融通证券出借
7	000333	美的集团	518,000.00	0.00	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	688409	富创精密	605,847.10	0.00	新股锁定期内
2	688432	有研硅	225,294.56	0.00	新股锁定期内
3	688132	邦彦技术	110,443.20	0.00	新股锁定期内
4	301269	华大九天	102,713.92	0.00	新股锁定期内
5	688143	长盈通	82,675.08	0.00	新股锁定期内

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		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 (%)
472,878	41,642.00	12,825,880,291.00	65.13	5,720,473,322.00	29.05	1,145,234,077.00	5.82

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中央汇金投资有限责任公司	2,423,958,601.00	12.31
2	国泰君安证券股份有限公司	910,106,653.00	4.62
3	香港上海汇丰银行有限公司	635,385,600.00	3.23
4	华泰证券股份有限公司	505,848,900.00	2.57
5	广发证券股份有限公司	431,989,453.00	2.19
6	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	269,712,700.00	1.37
7	国泰君安—建行—香港上海汇丰银行有限公司	231,877,000.00	1.18
8	友邦人寿保险有限公司—传统	177,891,000.00	0.90
9	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	177,763,500.00	0.90
10	安信证券股份有限公司	170,794,000.00	0.87

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	10,000.00	0.0001

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（2012年5月4日）基金份额总额	32,968,633,875.00
本报告期期初基金份额总额	11,340,487,690.00
本报告期基金总申购份额	25,626,600,000.00

减：本报告期基金总赎回份额	17,275,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	19,691,587,690.00

§ 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

基金管理人的重大人事变动：

2022 年 3 月 15 日，公司股东会书面决定 Kirk Chester SWEENEY 先生担任公司第六届董事会董事，Anthony Gerard Fasso 先生不再担任公司董事。

2022 年 11 月 18 日，公司进行董事会、监事会换届选举，股东会批准贾波先生、陆春光先生、韩勇先生、Kirk Chester SWEENEY 先生、杨智雅女士担任公司第七届董事会董事，陆楨女士、李晗女士、田中荣治先生、孙茂竹先生担任公司第七届董事会独立董事，刘晓冰先生、卞时珍女士、柳军先生、刘声先生担任公司第七届监事会监事。文光伟先生、李亦宜女士不再担任公司独立董事。

2022 年 12 月 12 日，经公司董事会批准裴晓思先生担任公司副总经理，周俊梁先生担任公司财务总监。

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

为本基金审计的会计师事务所为普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内基金未改聘为其审计的会计师事务所。本报告期基金应支付给普华永道中天会计师事务所（特

殊普通合伙)的报酬为 150,000.00 元人民币,该事务所已向本基金提供 11 年的审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:报告期内基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注:报告期内基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
广发证券	4	58,637,419,172.85	67.23	8,049,495.65	67.00	-
中信建投	2	15,483,534,862.76	17.75	2,177,791.65	18.13	-
华泰证券	2	12,431,878,258.66	14.25	1,699,651.56	14.15	-
方正证券	2	660,251,272.40	0.76	86,676.03	0.72	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
安信证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安	2	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	2	-	-	-	-	-
湘财证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

注：1、选择代理证券买卖的证券经营机构的标准：公司应选择财务状况良好，经营行为规范，具备研究实力的证券公司及专业研究机构，向其或其合作券商租用基金专用交易席位。公司选择的提供交易单元的券商应当满足下列基本条件：1) 具有相应的业务经营资格；2) 诚信记录良好，最近两年无重大违法违规行，未受监管机构重大处罚；3) 资金雄厚，信誉良好。内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本基金运作高度保密的要求；4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需要，并能为基金提供全面的信息服；5) 具备研究实力，有固定的研究机构和专门研究人员，能及时全面地为基金提供宏观经济、行业情况、市场走向、股票分析的研究报告及周到的信息服务，并能根据基金投资的特定要求，提供专题研究报告。2、选择代理证券买卖的证券经营机构的程序 基金管理人根据以上标准进行考察后确定证券经营机构的选择。基金管理人与被选择的证券经营机构签订交易单元租用协议和证券研究服务协议。3、本基金本报告期内未变更租用交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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(%)
广发证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	65,583,286.62	100.00	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
长江证	-	-	-	-	-	-

券						
德邦证 券	-	-	-	-	-	-
东方证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
国都证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
海通证 券	-	-	-	-	-	-
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
平安证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
山西证 券	-	-	-	-	-	-
上海证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
----	------	--------	--------

1	华泰柏瑞基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 12 月 13 日
2	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 12 月 1 日
3	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 23 日
4	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 10 日
5	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金持有停牌证券估值调整的提示性公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 11 月 3 日
6	华泰柏瑞基金管理有限公司关于对旗下基金中基金资产管理计划通过直销渠道申赎旗下公募基金免除相关费用的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 10 月 10 日
7	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 30 日
8	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与上海中欧财富基金销售有限公司费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 28 日
9	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 9 日
10	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 9 月 4 日
11	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与兴业证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 8 月 26 日
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 8 月 24 日
13	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 8 月 14 日
14	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 22 日
15	华泰柏瑞基金管理有限公司关于暂停北京微动利基金销售有限公司、喜鹊	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 20 日

	财富基金销售有限公司、乾道基金销售有限公司销售机构办理相关销售业务的公告		
16	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 17 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 7 日
18	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 日
19	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 28 日
20	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 26 日
21	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 5 月 11 日
22	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资北交所上市股票的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 29 日
23	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下部分基金参与平安银行股份有限公司行 E 通平台费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 18 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金参与财通证券股份有限公司配股的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 4 月 13 日
25	华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金分红公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 12 日
26	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 日
27	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销期内承销证券的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 1 日

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		间区间					
机构	1	20220101-20220121;20220214-20220425;20220517-20220527;20220531-20220919;20220922-20220922;	2,423,958,601.00	0.00	0.00	2,423,958,601.00	12.31

产品特有风险

本基金报告期内有单一持有人持有基金份额超过 20% 的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、本基金的中国证监会批准募集文件
- 2、本基金的《基金合同》
- 3、本基金的《招募说明书》
- 4、本基金的《托管协议》
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 6、本基金的公告

13.2 存放地点

上海市浦东新区民生路 1199 弄证大五道口广场 1 号楼 17 层
 托管人住所

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。投资者对本报告如有疑问，可咨询基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司。客户服务热线：400-888-0001（免长途费） 021-3878 4638 公司网址：www.huatai-pb.com

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023 年 3 月 31 日