

# 华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数 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及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 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 1 月 1 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b> .....	<b>2</b>
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
<b>§ 2 基金简介</b> .....	<b>5</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b> .....	<b>6</b>
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
<b>§ 4 管理人报告</b> .....	<b>9</b>
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 .....	12
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 .....	13
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 .....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 .....	16
<b>§ 5 托管人报告</b> .....	<b>16</b>
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
<b>§ 6 审计报告</b> .....	<b>16</b>
6.1 审计报告基本信息 .....	16
6.2 审计报告的基本内容 .....	16
<b>§ 7 年度财务报表</b> .....	<b>18</b>
7.1 资产负债表 .....	18
7.2 利润表 .....	19
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	21
7.4 报表附注 .....	23
<b>§ 8 投资组合报告</b> .....	<b>140</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	140
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	141
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 .....	143
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	145
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	147
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 .....	147
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 .....	147
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 .....	147
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 .....	147
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	147
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	147
8.12 投资组合报告附注 .....	147
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>148</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	148
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	149
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	150
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 .....	150
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>150</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>150</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	150
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 .....	150
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	151
11.4 基金投资策略的改变 .....	151
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	151
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 .....	151
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	151
11.8 其他重大事件 .....	156
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>158</b>
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 .....	158
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	158
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>158</b>
13.1 备查文件目录 .....	158
13.2 存放地点 .....	158
13.3 查阅方式 .....	158

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	光伏 ETF
场内简称	光伏 ETF (扩位证券简称: 光伏 ETF)
基金主代码	515790
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 12 月 7 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	9,991,494,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 12 月 18 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。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制法，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；当标的指数进行定期调整、指数样本空间或者编制规则变更时，本基金将根据标的指数的编制规则及调整公告，及时进行投资组合的优化调整，尽量降低跟踪误差，力争将日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。
业绩比较基准	中证光伏产业指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金中的指数型基金，采用完全复制的被动式投资策略，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征：一方面，相对于混合型基金、债券型基金与货币市场基金而言，其风险和收益较高；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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方	许俊
	联系电话	021-38601777	010-66596688
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-888-0001	95566
传真		021-38601799	010-66594942
注册地址		上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市西城区复兴门内大街 1 号

	大五道口广场 1 号 17 层	
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 1 号
邮政编码	200135	100818
法定代表人	贾波	刘连舸

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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 层及基金托管人住所

## 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 12 月 7 日 (基金合同生效日)-2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-511,588,172.00	3,211,193,478.84	72,117,939.80
本期利润	-2,542,269,062.35	3,380,967,877.05	500,146,939.87
加权平均基金份额本期利润	-0.2676	0.4274	0.1441
本期加权平均净值利润率	-17.82%	30.81%	13.32%
本期基金份额净值增长率	-19.58%	50.24%	13.66%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	3,729,854,685.27	4,092,732,491.03	108,228,062.01
期末可供分配基金	0.3733	0.4944	0.0127

份额利润			
期末基金资产净值	13,721,348,685.27	14,136,322,055.23	9,675,613,368.18
期末基金份额净值	1.3733	1.7076	1.1366
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	37.33%	70.76%	13.66%

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

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

3、对期末可供分配利润，采用期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

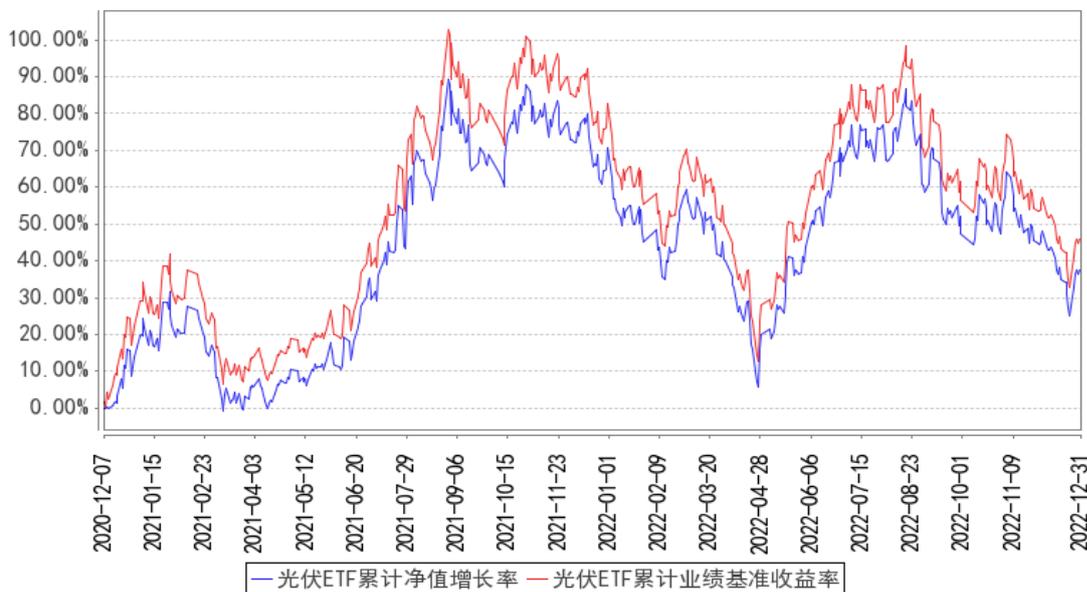
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.86%	2.16%	-6.85%	2.17%	-0.01%	-0.01%
过去六个月	-18.84%	2.21%	-18.85%	2.22%	0.01%	-0.01%
过去一年	-19.58%	2.36%	-20.15%	2.37%	0.57%	-0.01%
自基金合同生效起至今	37.33%	2.40%	45.77%	2.43%	-8.44%	-0.03%

### 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

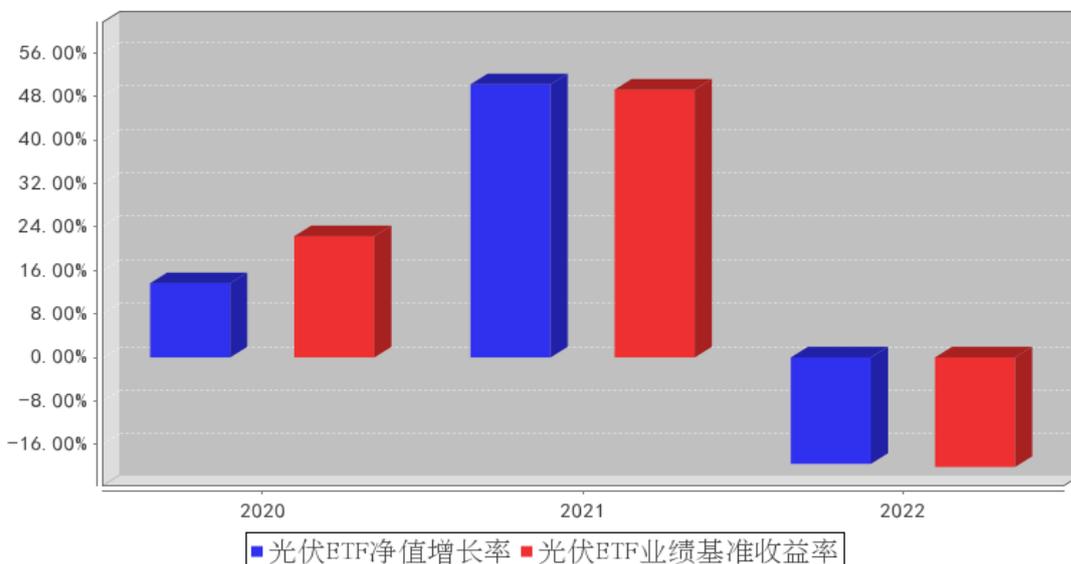
光伏ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2020年12月7日至2022年12月31日。

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

光伏ETF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



注：基金合同生效日为2020年12月7日，2020年度的相关数据根据当年的实际存续期计算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金未实施过利润分配。

## § 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		
李茜	本基金的基金经理	2020 年 12 月 7 日	-	7 年	曾任职于上海市虹口区金融服务局。2015 年 3 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任指数投资部助理研究员、研究员。2019 年 11 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金、上证中小盘交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞上证中小盘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 12 月起任华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞中证港股通 50 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 1 月起任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的基金经理。2021 年 2 月起任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的基金经理。

					2021 年 3 月起任华泰柏瑞中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金和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的基金经理。2021 年 9 月起任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的基金经理。2021 年 11 月起任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的基金经理。2022 年 1 月起任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的基金经理。2022 年 4 月起任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）的基金经理。2022 年 12 月起任华泰柏瑞中证香港 300 金融服务交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
李沐阳	指数投资部总监助理、本基金的基金经理	2021 年 1 月 5 日	-	4 年	美国哥伦比亚大学应用统计学硕士。2017 年 8 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司，历任指数投资部助理研究员、研究员、基金经理助理。2021 年 1 月起任华泰柏瑞中证光伏产业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、华泰柏瑞中证沪港深互联网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光伏产业交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 4 月起任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的基金经理。

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。

本报告期本基金与公司所管理的其他投资组合没有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。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本年度产品所跟踪的光伏产业指数涨跌幅为-20.15%，本产品涨跌幅为-19.58%。

全年来看，指数“下上下下”，走出一个小“n”形态。

一季度，产业链景气度向好，但市场风险偏好受到多重因素影响，如俄乌战争疫情加剧等，板块跟随市场行情下杀。

二季度，市场在经历恐慌性下跌以后强势反弹，板块在海外需求的刺激下继续上行，风光大基地二期规划推出继续打开需求空间。

三季度，在经历了二季度的大幅反弹，市场重新拾起硅料价格的关注，随之市场整体风险偏好回落，资金倾向于撤回稳增长板块避险。

四季度，硅料价格终于开始下行，市场担心预期需求不会起来，叠加外部宏观因素变化使得市场热度出现了转移，新能源整体热度不高。

2022 年光伏有两波行情，皆由于行业景气度的超预期：2 月（淡季不淡，海外抢装导致需求超预期）；4-8 月（欧洲能源危机下光储需求爆发）。

#### 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 1.3733 元，本报告期基金份额净值增长率为-19.58%，同期本基金的业绩比较基准收益率为-20.15%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020 年第一次提到“3060”政策，光伏也迈进了自身大发展的第三年。

没有了上游瓶颈的束缚，2023 年光伏也即将迈进自己阶段性盈利周期的高点，我们有望在今年看到过去期待已久的行业盈利的兑现。

产业周期中降价刺激下需求超预期仍然是行业最大的逻辑。在组件降价刺激下，2023 年需求有望继续超预期。当前行业估值已经充分定价行业未来可能存在的风险，在较好的价格下，看长赚盈利的钱，看短等事件驱动。在百年未有之大变局之下，希望能源安全在未来较长的时间里都将会是主线。

#### 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进行事先合规性设置，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

本报告期内，本基金未进行利润分配。

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

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

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

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

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

### § 6 审计报告

#### 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 24693 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	华泰柏瑞中证光伏产业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中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞中证光伏产业 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</p>

	<p>则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中证光伏产业 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>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞中证光伏产业 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>华泰柏瑞中证光伏产业 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中证光伏产业 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中证光伏产业 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞中证光伏产业 ETF 基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</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, 就可能对华泰柏瑞中证光伏产业 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中证光伏产业 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。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: 华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日: 2022 年 12 月 31 日

单位: 人民币元

资产	附注号	本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
银行存款	7.4.7.1	63,553,571.07	61,549,486.46
结算备付金		14,539,280.98	30,088,466.52
存出保证金		2,653,045.71	5,467,472.54
交易性金融资产	7.4.7.2	13,673,717,750.09	14,082,282,525.20
其中: 股票投资		13,673,717,750.09	14,082,282,525.20
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		23,281,382.42	54,224,246.89
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	481,662.95	304,991.40
资产总计		13,778,226,693.22	14,233,917,189.01
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		120,885.09	792,041.06
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,613.12	3,772,710.20
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		5,951,180.86	6,303,640.95
应付托管费		1,190,236.18	1,260,728.19
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		54.19	0.53
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	49,602,038.51	85,466,012.85
负债合计		56,878,007.95	97,595,133.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	9,991,494,000.00	8,278,494,000.00
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	3,729,854,685.27	5,857,828,055.23
净资产合计		13,721,348,685.27	14,136,322,055.23
负债和净资产总计		13,778,226,693.22	14,233,917,189.01

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.3733 元，基金份额总额 9,991,494,000.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年1月1日至2022年 12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021 年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-2,452,287,014.72	3,519,675,756.82
1. 利息收入		14,924,884.87	9,772,668.03
其中：存款利息收入	7.4.7.13	655,920.38	909,282.56
债券利息收入		-	6,749.60
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		14,268,964.49	8,856,635.87
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-487,210,598.12	3,247,143,978.58
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-609,481,138.08	3,204,893,215.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	21,006,461.59	2,586,451.84
资产支持证券投资	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	101,264,078.37	39,664,311.53
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	-2,030,680,890.35	169,774,398.21
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	50,679,588.88	92,984,712.00
<b>减：二、营业总支出</b>		89,982,047.63	138,707,879.77
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	71,035,874.36	54,826,766.97
2. 托管费	7.4.10.2.2	14,207,174.95	10,965,353.33
3. 销售服务费		-	-
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.22	-	-

7. 税金及附加		80.55	24.25
8. 其他费用	7.4.7.23	4,738,917.77	72,915,735.22
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-2,542,269,062.35	3,380,967,877.05
减: 所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-2,542,269,062.35	3,380,967,877.05
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-2,542,269,062.35	3,380,967,877.05

### 7.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体: 华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金

本报告期: 2022年1月1日至2022年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	8,278,494,000.00	-	5,857,828,055.23	14,136,322,055.23
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)	8,278,494,000.00	-	5,857,828,055.23	14,136,322,055.23
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,713,000,000.00	-	-2,127,973,369.96	-414,973,369.96
(一)、综合收益总额	-	-	-2,542,269,062.35	-2,542,269,062.35
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,713,000,000.00	-	414,295,692.39	2,127,295,692.39
其中: 1. 基金申购款	19,476,000,000.00	-	9,785,069,247.37	29,261,069,247.37

2. 基金赎回款	-17,763,000.00	-	-9,370,773,554.98	-27,133,773,554.98
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	9,991,494,000.00	-	3,729,854,685.27	13,721,348,685.27
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)	8,512,494,000.00	-	1,163,119,368.18	9,675,613,368.18
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)	8,512,494,000.00	-	1,163,119,368.18	9,675,613,368.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-234,000,000.00	-	4,694,708,687.05	4,460,708,687.05
(一)、综合收益总额	-	-	3,380,967,877.05	3,380,967,877.05
(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)	-234,000,000.00	-	1,313,740,810.00	1,079,740,810.00
其中: 1. 基金申购款	26,961,000,000.00	-	10,826,087,593.03	37,787,087,593.03

2. 基金赎回款	-27,195,000.00	-	-9,512,346,783.03	-36,707,346,783.03
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	8,278,494,000.00	-	5,857,828,055.23	14,136,322,055.23

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

基金管理人负责人

房伟力

主管会计工作负责人

赵景云

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]第 3012 号《关于准予华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》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《华泰柏瑞中证光伏产业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 1,718,494,000.00 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 1048 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 12 月 7 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,718,494,000.00 份基金份额,无认购资金利息折合基金份额。本基金的基金管理人为华泰柏瑞基金管理有限公司,基金托管人为中国银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律管理决定书[2020]409 号核准,本基金 1,718,494,000.00 份基金份额于 2020 年 12 月 18 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《华泰柏瑞中证光伏产业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部分非成份股（包括中小板、创业板以及其他经中国证监会核准或注册发行的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、短期融资券、超短期融资券、中期票据等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、货币市场工具、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可根据法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不得低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，本基金应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等；本基金参与融资业务时，在任何交易日日终，持有的融资买入股票与其他有价证券市值之和，不得超过基金资产净值的 95%。本基金力争日均跟踪偏离度控制在 0.2% 以内，年化跟踪误差控制在 2% 以内。本基金的业绩比较基准为中证光伏产业指数收益率。

本基金的基金管理人华泰柏瑞基金管理有限公司以本基金为目标 ETF，募集成立了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（以下简称“华泰柏瑞中证光伏产业 ETF 联接基金”）。华泰柏瑞中证光伏产业 ETF 联接基金为交易型开放式基金，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》、《华泰柏瑞中证光伏产业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商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资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、债券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占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；当基金累计报酬率超过标的指数同期累计报酬率(经汇率调整)达到 1%以上，可进行收益分配；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。在符合有关基金收益分配条件的前提下，本基金收益每年最多分配 4 次，每次基金收益分配数额由基金管理人根据实际情况确定。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 61,549,486.46 元、30,088,466.52 元、5,467,472.54 元、304,991.40 元和 54,224,246.89 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 61,555,847.07 元、30,103,354.29 元、5,470,178.87 元、281,036.69 元和 54,224,246.89 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 14,082,282,525.20 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 14,082,282,525.20 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 3,772,710.20 元、6,303,640.95 元、

1,260,728.19 元、11,932,637.38 元和 73,272,883.67 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 3,772,710.20 元、6,303,640.95 元、1,260,728.19 元、11,932,637.38 元和 73,272,883.67 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 792,041.06 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 792,041.06 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128 号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融-房地产开发-教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务

操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对资管产品在 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 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
活期存款	63,553,571.07	61,549,486.46
等于：本金	63,546,778.11	61,549,486.46
加：应计利息	6,792.96	-
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	63,553,571.07	61,549,486.46

## 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	15,106,596,349.91	-	13,673,717,750.09	-1,432,878,599.82
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	15,106,596,349.91	-	13,673,717,750.09	-1,432,878,599.82
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	13,484,489,066.92	-	14,082,282,525.20	597,793,458.28
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	13,484,489,066.92	-	14,082,282,525.20	597,793,458.28

### 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

注：本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有期货合约。

#### 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：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

#### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期末及上年度末未持有债权投资。

### 7.4.7.6 其他债权投资

#### 7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金本报告期末及上年度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：本基金本报告期末及上年度末未持有其他债权投资。

### 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：本基金本报告期末及上年度末未持有其他权益工具。

#### 7.4.7.7.2 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	-	304,991.40
其他应收款	481,662.95	-
待摊费用	-	-
合计	481,662.95	304,991.40

## 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	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	8,084,881.17	11,932,637.38
其中：交易所市场	8,084,881.17	11,932,637.38
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	280,491.80	260,491.80
应付指数使用费	1,056,384.63	1,083,593.34
应退退补款	40,180,280.91	72,189,290.33
合计	49,602,038.51	85,466,012.85

## 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	8,278,494,000.00	8,278,494,000.00
本期申购	19,476,000,000.00	19,476,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-17,763,000,000.00	-17,763,000,000.00
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	9,991,494,000.00	9,991,494,000.00

## 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	4,092,732,491.03	1,765,095,564.20	5,857,828,055.23
本期利润	-511,588,172.00	-2,030,680,890.35	-2,542,269,062.35
本期基金份额交易产生的变动数	973,121,129.85	-558,825,437.46	414,295,692.39
其中：基金申购款	9,036,728,152.74	748,341,094.63	9,785,069,247.37
基金赎回款	-8,063,607,022.89	-1,307,166,532.09	-9,370,773,554.98
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,554,265,448.88	-824,410,763.61	3,729,854,685.27

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	260,283.35	335,483.12
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	332,243.70	498,843.68
其他	63,393.33	74,955.76
合计	655,920.38	909,282.56

#### 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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-210,629,346.17	2,078,686,144.86
股票投资收益——赎回差价收入	-398,851,791.91	1,126,207,070.35
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	-609,481,138.08	3,204,893,215.21

##### 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	16,262,020,981.17	22,666,179,529.31

额		
减：卖出股票成本总额	16,422,619,988.42	20,587,493,384.45
减：交易费用	50,030,338.92	-
买卖股票差价收入	-210,629,346.17	2,078,686,144.86

#### 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	27,133,773,554.98	36,707,346,783.03
减：现金支付赎回款总额	13,441,786,911.98	19,195,906,951.03
减：赎回股票成本总额	14,090,838,434.91	16,385,232,761.65
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-398,851,791.91	1,126,207,070.35

#### 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：本基金本报告期内及上年度可比期间无股票投资收益-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	22,368.48	-
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,984,093.11	2,586,451.84
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	21,006,461.59	2,586,451.84

**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 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
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	91,080,407.09	50,633,303.72
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	70,071,900.00	48,039,900.00
减：应计利息总额	23,039.56	6,951.88
减：交易费用	1,374.42	-
买卖债券差价收入	20,984,093.11	2,586,451.84

**7.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内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：本基金本报告期内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-买卖资产支持证券差价收入。

**7.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

**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—申购差价收入。

**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：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益。

**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：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-赎回差价收入。

**7.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无贵金属投资收益-申购差价收入。

#### 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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益——其他投资收益。

#### 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	101,264,078.37	39,664,311.53
其中：证券出借权益补偿收入	3,722,220.61	393,461.10
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	101,264,078.37	39,664,311.53

#### 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	-2,030,680,890.35	169,774,398.21
股票投资	-2,030,680,890.35	169,774,398.21
债券投资	-	-
资产支持证券投资	-	-
基金投资	-	-
贵金属投资	-	-
其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-2,030,680,890.35	169,774,398.21

#### 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	50,679,588.88	92,982,798.08
其他收入	-	1,913.92
合计	50,679,588.88	92,984,712.00

注：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。

#### 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	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	4,262,152.41	3,289,606.08
注册登记费	150,000.00	150,000.00
IOPV 计算发布费	20,000.00	20,000.00
银行划款手续费	66,765.36	70,131.17
交易费用	-	69,145,997.97
合计	4,738,917.77	72,915,735.22

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，当季日均基金资产净值大于 5000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度(自然季度)人民币 35,000 元，计费期间不足一季度的，根据实际天数按比例计算。

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
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
中国银行股份有限公司(“中国银行”)	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(“华泰柏瑞中证光伏产业ETF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 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例(%)
华泰证券	12,673,931,132.65	37.28	13,360,384,761.46	28.86

###### 7.4.10.1.2 权证交易

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

###### 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	11,599,748.50	37.53	2,427,530.63	30.03
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	12,175,349.65	28.80	1,071,040.63	8.98

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	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
当期发生的基金应支付的管理费	71,035,874.36	54,826,766.97
其中：支付销售机构的客户维护费	761,757.79	837,529.25

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：

$$\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.50\% / \text{当年天数}。$$

### 7.4.10.2.2 基金托管费

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
当期发生的基金应支付的托管费	14,207,174.95	10,965,353.33

注：支付基金托管人中国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：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

### 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：本基金本报告期内及上年度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	6,294,807,617.00	4,364,729.19	368,685,102.00	122,882.94
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	5,165,716,208.00	3,635,576.94	483,087,077.00	126,051.46

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

单位：人民币元

本期 2022年1月1日至2022年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(单位: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	2022010400023077	晶盛机电	2022年1月4日	1,227,970.00	19,000	14	3.400	1,623.58	-	-
华泰证券	2022010400023087	东方日升	2022年1月4日	834,960.00	28,000	14	3.400	1,104.04	-	-
华泰证券	2022010400023103	东方日升	2022年1月4日	903,546.00	30,300	14	3.400	1,194.62	-	-
华泰证券	2022010400023105	阳光电源	2022年1月4日	3,655,800.00	27,000	14	3.400	4,833.78	-	-
华泰证券	2022010500000785	迈为股份	2022年1月5日	679,200.00	1,200	14	3.400	898.10	-	-
华泰证券	2022010500000787	阳光电源	2022年1月5日	4,631,100.00	35,900	14	3.400	6,123.32	-	-
华泰证券	2022010500000789	东方日升	2022年1月5日	1,007,130.00	35,400	14	3.400	1,331.68	-	-
华泰证券	2022010500000795	中信博	2022年1月5日	1,693,917.00	10,700	14	3.400	2,239.72	-	-
华泰证券	2022010500009067	天合光能	2022年1月5日	1,263,087.00	18,900	14	3.400	1,670.06	-	-
华泰证券	2022010500009069	中信博	2022年1月5日	664,902.00	4,200	14	3.400	879.20	-	-
华泰证券	2022010500009071	迈为股份	2022年1月5日	1,188,600.00	2,100	14	3.400	1,571.64	-	-
华泰证券	202201	先导智	2022年	1,893,25	27,300	14	3.400	2,503.	-	-

	050000 9073	能	1月5日	5.00				34		
华泰证券	202201 050000 9075	先导智 能	2022年 1月5日	2,524,34 0.00	36,400	14	3.400	3,337. 74	-	-
华泰证券	202201 050000 9077	阳光电 源	2022年 1月5日	2,979,90 0.00	23,100	14	3.400	3,940. 16	-	-
华泰证券	202201 050000 9079	晶盛机 电	2022年 1月5日	906,402. 00	14,700	14	3.400	1,198. 40	-	-
华泰证券	202201 050000 9081	阳光电 源	2022年 1月5日	4,695,60 0.00	36,400	14	3.400	6,208. 58	-	-
华泰证券	202201 050000 9083	晶盛机 电	2022年 1月5日	1,658,65 4.00	26,900	14	3.400	2,193. 10	-	-
华泰证券	202201 050000 9085	晶盛机 电	2022年 1月5日	1,553,83 2.00	25,200	14	3.400	2,054. 50	-	-
华泰证券	202201 050000 9087	东方日 升	2022年 1月5日	477,960. 00	16,800	14	3.400	631.96	-	-
华泰证券	202201 070000 9901	阳光电 源	2022年 1月7日	230,940. 00	1,800	14	3.400	305.34	-	-
华泰证券	202201 110001 1741	东方日 升	2022年 1月11 日	5,625,48 0.00	217,200	14	3.400	7,438. 20	-	-
华泰证券	202201 110001 3269	东方日 升	2022年 1月11 日	1,528,10 0.00	59,000	14	3.400	2,020. 48	-	-
华泰证券	202201 120001 6587	晶盛机 电	2022年 1月12 日	212,724. 00	3,600	14	3.400	281.26	-	-
华泰证券	202201 120001 6591	东方日 升	2022年 1月12 日	4,251,69 6.00	161,600	14	3.400	5,621. 70	-	-
华泰证券	202201 120001 6599	东方日 升	2022年 1月12 日	105,240. 00	4,000	14	3.400	139.16	-	-
华泰证券	202201 130000 0676	东方日 升	2022年 1月13 日	1,285,74 6.00	50,600	14	3.400	1,700. 02	-	-

华泰证券	202201 130001 0146	东方日 升	2022年 1月13 日	4,324,78 2.00	170,200	14	3.400	5,718. 30	-	-
华泰证券	202201 130001 0150	阳光电 源	2022年 1月13 日	36,915,0 00.00	300,000	14	3.400	48,809 .88	-	-
华泰证券	202201 130001 0152	中信博	2022年 1月13 日	12,318,0 00.00	100,000	14	3.400	16,287 .18	-	-
华泰证券	202201 130001 0156	迈为股 份	2022年 1月13 日	10,314,6 00.00	20,000	14	3.400	13,638 .24	-	-
华泰证券	202201 140000 0565	东方日 升	2022年 1月14 日	1,306,99 8.00	50,600	14	3.400	1,728. 16	-	-
华泰证券	202201 140002 0422	迈为股 份	2022年 1月14 日	924,647. 00	1,700	14	3.400	1,222. 62	-	-
华泰证券	202201 140002 0424	东方日 升	2022年 1月14 日	361,620. 00	14,000	14	3.400	478.10	-	-
华泰证券	202201 140002 0428	阳光电 源	2022年 1月14 日	9,640,80 0.00	78,000	14	3.400	12,747 .28	-	-
华泰证券	202201 140002 4082	东方日 升	2022年 1月14 日	619,920. 00	24,000	14	3.400	819.70	-	-
华泰证券	202201 140002 4088	迈为股 份	2022年 1月14 日	543,910. 00	1,000	14	3.400	719.18	-	-
华泰证券	202201 140002 4090	迈为股 份	2022年 1月14 日	598,301. 00	1,100	14	3.400	791.14	-	-
华泰证券	202201 140002 4092	东方日 升	2022年 1月14 日	1,239,84 0.00	48,000	14	3.400	1,639. 40	-	-
华泰证券	202201 140002 4096	东方日 升	2022年 1月14 日	671,580. 00	26,000	14	3.400	888.02	-	-
华泰证券	202201 140002 4098	东方日 升	2022年 1月14 日	51,660.0 0	2,000	14	3.400	68.32	-	-
华泰证券	202201 140002	固德威	2022年 1月14	10,550,1 00.00	30,000	14	3.400	13,949 .60	-	-

	4100		日								
华泰证券	202201 140002 4106	迈为股 份	2022年 1月14 日	707,083. 00	1,300	14	3.400	934.92	-	-	
华泰证券	202201 140002 4108	先导智 能	2022年 1月14 日	5,981,64 0.00	84,000	14	3.400	7,909. 02	-	-	
华泰证券	202201 140002 4112	晶盛机 电	2022年 1月14 日	3,307,50 0.00	54,000	14	3.400	4,373. 32	-	-	
华泰证券	202201 170000 0544	阳光电 源	2022年 1月17 日	960,190. 00	7,700	14	3.400	1,904. 28	-	-	
华泰证券	202201 170000 2791	阳光电 源	2022年 1月17 日	5,075,29 0.00	40,700	28	3.400	13,421 .24	-	-	
华泰证券	202201 180000 0732	先导智 能	2022年 1月18 日	133,740. 00	1,800	14	3.400	252.60	-	-	
华泰证券	202201 180000 0734	迈为股 份	2022年 1月18 日	3,992,96 6.00	7,400	14	3.400	7,542. 20	-	-	
华泰证券	202201 180000 0736	中信博	2022年 1月18 日	152,400. 00	1,200	14	3.400	287.80	-	-	
华泰证券	202201 180000 0738	奥特维	2022年 1月18 日	601,054. 00	2,900	14	3.400	1,135. 40	-	-	
华泰证券	202201 180002 3942	东方日 升	2022年 1月18 日	761,742. 00	30,300	14	3.400	1,438. 80	-	-	
华泰证券	202201 180002 3970	东方日 升	2022年 1月18 日	703,920. 00	28,000	14	3.400	1,329. 60	-	-	
华泰证券	202201 190000 9905	东方日 升	2022年 1月19 日	413,280. 00	16,800	14	3.400	741.57	-	-	
华泰证券	202201 190000 9907	迈为股 份	2022年 1月19 日	1,097,88 0.00	2,100	14	3.400	1,970. 11	-	-	
华泰证券	202201 190000 9911	阳光电 源	2022年 1月19 日	2,788,40 1.00	23,100	14	3.400	5,003. 65	-	-	
华泰证券	202201	晶盛机	2022年	1,536,94	25,200	14	3.400	2,758.	-	-	

	190000 9915	电	1月19日	8.00				04		
华泰证券	202201 190000 9927	先导智能	2022年 1月19日	2,657,200.00	36,400	14	3.400	4,768.24	-	-
华泰证券	202201 190000 9931	天合光能	2022年 1月19日	1,271,025.00	18,900	14	3.400	2,280.76	-	-
华泰证券	202201 190000 9933	迈为股份	2022年 1月19日	627,360.00	1,200	14	3.400	1,125.75	-	-
华泰证券	202201 190000 9939	阳光电源	2022年 1月19日	4,393,844.00	36,400	14	3.400	7,884.43	-	-
华泰证券	202201 190000 9943	晶盛机电	2022年 1月19日	896,553.00	14,700	14	3.400	1,608.73	-	-
华泰证券	202201 190000 9945	阳光电源	2022年 1月19日	4,333,489.00	35,900	14	3.400	7,776.13	-	-
华泰证券	202201 190000 9949	晶盛机电	2022年 1月19日	1,640,631.00	26,900	14	3.400	2,944.05	-	-
华泰证券	202201 190000 9953	先导智能	2022年 1月19日	1,992,900.00	27,300	14	3.400	3,576.18	-	-
华泰证券	202201 190000 9963	中信博	2022年 1月19日	1,294,700.00	10,700	14	3.400	2,323.32	-	-
华泰证券	202201 190000 9967	中信博	2022年 1月19日	508,200.00	4,200	14	3.400	912.00	-	-
华泰证券	202201 210000 0501	东方日升	2022年 1月21日	248,570.00	10,600	14	3.400	399.16	-	-
华泰证券	202201 250000 0524	东方日升	2022年 1月25日	3,853,590.00	159,900	14	3.400	5,095.30	-	-
华泰证券	202201 250001 1634	东方日升	2022年 1月25日	5,234,520.00	217,200	14	3.400	6,921.18	-	-
华泰证券	202201 260001 1946	晶盛机电	2022年 1月26日	221,400.00	3,600	14	3.400	292.74	-	-

华泰证券	202201 260001 1956	东方日 升	2022年 1月26 日	3,736,19 2.00	161,600	14	3.400	4,940. 04	-	-
华泰证券	202201 260001 1962	东方日 升	2022年 1月26 日	92,480.0 0	4,000	14	3.400	122.22	-	-
华泰证券	202201 270000 0555	迈为股 份	2022年 1月27 日	2,227,48 6.00	4,300	14	3.400	2,945. 18	-	-
华泰证券	202201 270000 0557	东方日 升	2022年 1月27 日	774,688. 00	34,400	14	3.400	1,024. 24	-	-
华泰证券	202201 270000 0559	中信博	2022年 1月27 日	1,099,94 0.00	8,600	14	3.400	1,454. 32	-	-
华泰证券	202201 270000 9933	东方日 升	2022年 1月27 日	1,139,51 2.00	50,600	14	3.400	1,506. 68	-	-
华泰证券	202201 270000 9935	中信博	2022年 1月27 日	12,790,0 00.00	100,000	14	3.400	16,911 .16	-	-
华泰证券	202201 270000 9941	东方日 升	2022年 1月27 日	3,832,90 4.00	170,200	14	3.400	5,068. 00	-	-
华泰证券	202201 270000 9947	迈为股 份	2022年 1月27 日	10,360,4 00.00	20,000	14	3.400	13,698 .72	-	-
华泰证券	202201 270000 9949	阳光电 源	2022年 1月27 日	33,300,0 00.00	300,000	14	3.400	44,030 .00	-	-
华泰证券	202201 280001 8802	先导智 能	2022年 1月28 日	6,036,24 0.00	84,000	14	3.400	7,981. 26	-	-
华泰证券	202201 280001 8806	阳光电 源	2022年 1月28 日	8,891,22 0.00	78,000	14	3.400	11,756 .22	-	-
华泰证券	202201 280001 8810	晶盛机 电	2022年 1月28 日	3,093,66 0.00	54,000	14	3.400	4,090. 52	-	-
华泰证券	202201 280001 8826	东方日 升	2022年 1月28 日	304,080. 00	14,000	14	3.400	402.08	-	-
华泰证券	202201 280001	东方日 升	2022年 1月28	521,280. 00	24,000	14	3.400	689.22	-	-

	8828		日							
华泰证券	202201 280001 8830	东方日 升	2022年 1月28 日	1,099,03 2.00	50,600	14	3.400	1,453. 20	-	-
华泰证券	202201 280001 8834	固德威	2022年 1月28 日	12,085,5 00.00	30,000	14	3.400	15,979 .74	-	-
华泰证券	202201 280002 1448	东方日 升	2022年 1月28 日	1,042,56 0.00	48,000	14	3.400	1,378. 44	-	-
华泰证券	202201 280002 1450	东方日 升	2022年 1月28 日	564,720. 00	26,000	14	3.400	746.62	-	-
华泰证券	202202 070004 3905	先导智 能	2022年 2月7日	2,629,53 6.00	36,400	14	3.400	3,476. 90	-	-
华泰证券	202202 070004 3909	先导智 能	2022年 2月7日	1,972,15 2.00	27,300	14	3.400	2,607. 64	-	-
华泰证券	202202 070004 3937	阳光电 源	2022年 2月7日	4,052,75 1.00	35,900	14	3.400	5,358. 64	-	-
华泰证券	202202 070004 3941	阳光电 源	2022年 2月7日	4,109,19 6.00	36,400	14	3.400	5,433. 26	-	-
华泰证券	202202 070004 3943	阳光电 源	2022年 2月7日	2,607,75 9.00	23,100	14	3.400	3,448. 06	-	-
华泰证券	202202 070004 3949	阳光电 源	2022年 2月7日	869,253. 00	7,700	14	3.400	1,149. 40	-	-
华泰证券	202202 070004 3965	迈为股 份	2022年 2月7日	3,785,54 4.00	7,400	14	3.400	5,005. 28	-	-
华泰证券	202202 070004 3967	迈为股 份	2022年 2月7日	1,074,27 6.00	2,100	14	3.400	1,420. 44	-	-
华泰证券	202202 070004 3969	迈为股 份	2022年 2月7日	613,872. 00	1,200	14	3.400	811.72	-	-
华泰证券	202202 070004 6401	奥特维	2022年 2月7日	566,167. 00	2,900	14	3.400	748.58	-	-
华泰证券	202202	晶盛机	2022年	873,621.	14,700	14	3.400	1,155.	-	-

	070004 9273	电	2月7日	00				14		
华泰证券	202202 070004 9277	晶盛机 电	2022年 2月7日	1,598,66 7.00	26,900	14	3.400	2,113. 86	-	-
华泰证券	202202 070004 9281	晶盛机 电	2022年 2月7日	1,497,63 6.00	25,200	14	3.400	1,980. 16	-	-
华泰证券	202202 070005 4827	中信博	2022年 2月7日	1,332,04 3.00	10,700	14	3.400	1,761. 20	-	-
华泰证券	202202 070005 4833	中信博	2022年 2月7日	522,858. 00	4,200	14	3.400	691.32	-	-
华泰证券	202202 070005 4841	天合光 能	2022年 2月7日	1,271,02 5.00	18,900	14	3.400	1,680. 56	-	-
华泰证券	202202 070005 4845	东方日 升	2022年 2月7日	380,016. 00	16,800	14	3.400	502.46	-	-
华泰证券	202202 080000 1013	先导智 能	2022年 2月8日	84,344.0 0	1,300	14	3.400	111.58	-	-
华泰证券	202202 090000 0830	迈为股 份	2022年 2月9日	1,208,88 0.00	2,400	14	3.400	1,598. 38	-	-
华泰证券	202202 090000 0832	先导智 能	2022年 2月9日	4,852,68 0.00	76,300	14	3.400	6,416. 34	-	-
华泰证券	202202 090000 0838	金博股 份	2022年 2月9日	1,316,40 0.00	5,000	14	3.400	1,740. 62	-	-
华泰证券	202202 090001 5794	晶盛机 电	2022年 2月9日	206,028. 00	3,600	14	3.400	272.44	-	-
华泰证券	202202 090001 7366	东方日 升	2022年 2月9日	3,626,30 4.00	161,600	14	3.400	4,794. 72	-	-
华泰证券	202202 090001 7368	东方日 升	2022年 2月9日	89,760.0 0	4,000	14	3.400	118.72	-	-
华泰证券	202202 100000 0692	东方日 升	2022年 2月10 日	4,546,36 6.00	209,800	14	3.400	6,011. 32	-	-

华泰证券	202202 100001 2260	中信博	2022年 2月10 日	9,797,00 0.00	100,000	14	3.400	12,953 .78	-	-
华泰证券	202202 100001 2262	中信博	2022年 2月10 日	842,542. 00	8,600	14	3.400	1,113. 98	-	-
华泰证券	202202 100001 3164	阳光电 源	2022年 2月10 日	30,330,0 00.00	300,000	14	3.400	40,103 .00	-	-
华泰证券	202202 100001 3170	迈为股 份	2022年 2月10 日	9,497,80 0.00	20,000	14	3.400	12,558 .14	-	-
华泰证券	202202 100001 3172	迈为股 份	2022年 2月10 日	2,042,02 7.00	4,300	14	3.400	2,700. 04	-	-
华泰证券	202202 100001 3180	东方日 升	2022年 2月10 日	745,448. 00	34,400	14	3.400	985.60	-	-
华泰证券	202202 100001 3182	东方日 升	2022年 2月10 日	1,096,50 2.00	50,600	14	3.400	1,449. 84	-	-
华泰证券	202202 100001 3184	东方日 升	2022年 2月10 日	3,688,23 4.00	170,200	14	3.400	4,876. 62	-	-
华泰证券	202202 110001 8826	先导智 能	2022年 2月11 日	5,208,00 0.00	84,000	14	3.400	6,886. 18	-	-
华泰证券	202202 110001 8828	固德威	2022年 2月11 日	10,230,0 00.00	30,000	14	3.400	13,526 .38	-	-
华泰证券	202202 110001 8830	晶盛机 电	2022年 2月11 日	2,918,16 0.00	54,000	14	3.400	3,858. 40	-	-
华泰证券	202202 110001 8832	阳光电 源	2022年 2月11 日	7,542,60 0.00	78,000	14	3.400	9,973. 04	-	-
华泰证券	202202 140000 0421	阳光电 源	2022年 2月14 日	630,828. 00	6,600	14	3.400	834.12	-	-
华泰证券	202202 140000 0423	东方日 升	2022年 2月14 日	4,558,95 4.00	209,800	14	3.400	6,027. 98	-	-
华泰证券	202202 140000	奥特维	2022年 2月14	730,380. 00	4,200	14	3.400	965.72	-	-

	0425		日								
华泰证券	202202 140000 0427	中信博	2022年 2月14 日	188,900. 00	2,000	14	3.400	249.76	-	-	
华泰证券	202202 140000 3326	阳光电源	2022年 2月14 日	3,890,10 6.00	40,700	28	3.400	10,287 .20	-	-	
华泰证券	202202 160000 0437	东方日升	2022年 2月16 日	4,710,01 0.00	209,800	14	3.400	6,227. 62	-	-	
华泰证券	202202 180000 0597	迈为股份	2022年 2月18 日	669,200. 00	1,400	14	3.400	884.80	-	-	
华泰证券	202202 210003 5717	东方日升	2022年 2月21 日	372,456. 00	16,800	14	3.400	492.52	-	-	
华泰证券	202202 210003 5719	先导智能	2022年 2月21 日	1,696,69 5.00	27,300	14	3.400	2,243. 36	-	-	
华泰证券	202202 210003 5739	晶盛机电	2022年 2月21 日	842,457. 00	14,700	14	3.400	1,113. 98	-	-	
华泰证券	202202 210003 5749	迈为股份	2022年 2月21 日	3,526,54 4.00	7,400	14	3.400	4,662. 84	-	-	
华泰证券	202202 210003 5751	迈为股份	2022年 2月21 日	1,000,77 6.00	2,100	14	3.400	1,323. 28	-	-	
华泰证券	202202 210004 7291	天合光能	2022年 2月21 日	1,112,83 2.00	18,900	14	3.400	1,471. 40	-	-	
华泰证券	202202 210004 7297	阳光电源	2022年 2月21 日	816,585. 00	7,700	14	3.400	1,079. 68	-	-	
华泰证券	202202 210004 7303	阳光电源	2022年 2月21 日	2,449,75 5.00	23,100	14	3.400	3,239. 18	-	-	
华泰证券	202202 210004 7305	阳光电源	2022年 2月21 日	3,807,19 5.00	35,900	14	3.400	5,033. 98	-	-	
华泰证券	202202 210004 7365	奥特维	2022年 2月21 日	503,440. 00	2,900	14	3.400	665.70	-	-	
华泰证券	202202	中信博	2022年	436,800.	4,200	14	3.400	577.50	-	-	

	210004 7375		2月21 日	00						
华泰证券	202202 210004 7381	中信博	2022年 2月21 日	1,112,80 0.00	10,700	14	3.400	1,471. 40	-	-
华泰证券	202202 220000 0531	晶盛机 电	2022年 2月22 日	120,200. 00	2,000	14	3.400	158.90	-	-
华泰证券	202202 220000 0533	固德威	2022年 2月22 日	2,476,50 0.00	6,500	14	3.400	3,274. 46	-	-
华泰证券	202202 230001 1598	迈为股 份	2022年 2月23 日	1,224,00 0.00	2,400	14	3.400	1,618. 40	-	-
华泰证券	202202 230001 3532	先导智 能	2022年 2月23 日	4,897,69 7.00	76,300	14	3.400	6,475. 84	-	-
华泰证券	202202 230001 3534	晶盛机 电	2022年 2月23 日	225,252. 00	3,600	14	3.400	297.78	-	-
华泰证券	202202 240001 1323	东方日 升	2022年 2月24 日	5,169,47 2.00	209,800	14	3.400	6,835. 22	-	-
华泰证券	202202 240001 1325	东方日 升	2022年 2月24 日	847,616. 00	34,400	14	3.400	1,120. 70	-	-
华泰证券	202202 240001 1329	迈为股 份	2022年 2月24 日	2,271,26 0.00	4,300	14	3.400	3,003. 14	-	-
华泰证券	202202 240001 1331	迈为股 份	2022年 2月24 日	10,564,0 00.00	20,000	14	3.400	13,967 .94	-	-
华泰证券	202202 240001 1339	阳光电 源	2022年 2月24 日	34,830,0 00.00	300,000	14	3.400	46,053 .00	-	-
华泰证券	202202 240001 1341	中信博	2022年 2月24 日	11,375,0 00.00	100,000	14	3.400	15,040 .34	-	-
华泰证券	202202 240001 1997	中信博	2022年 2月24 日	978,250. 00	8,600	14	3.400	1,293. 46	-	-
华泰证券	202202 250001 8981	阳光电 源	2022年 2月25 日	9,138,48 0.00	78,000	14	3.400	12,083 .12	-	-

华泰证券	202202 250001 8983	晶盛机 电	2022年 2月25 日	3,434,40 0.00	54,000	14	3.400	4,541. 04	-	-
华泰证券	202202 250001 8987	固德威	2022年 2月25 日	11,880,0 00.00	30,000	14	3.400	15,708 .00	-	-
华泰证券	202202 250001 9377	先导智 能	2022年 2月25 日	5,540,64 0.00	84,000	14	3.400	7,325. 92	-	-
华泰证券	202202 280000 3337	阳光电 源	2022年 2月28 日	799,260. 00	6,600	14	3.400	1,056. 86	-	-
华泰证券	202202 280000 3339	中信博	2022年 2月28 日	233,800. 00	2,000	14	3.400	309.12	-	-
华泰证券	202202 280000 3343	东方日 升	2022年 2月28 日	5,614,24 8.00	209,800	14	3.400	7,423. 22	-	-
华泰证券	202203 020000 3181	东方日 升	2022年 3月2日	5,977,20 2.00	209,800	14	3.400	7,903. 14	-	-
华泰证券	202203 070003 6382	阳光电 源	2022年 3月7日	2,862,55 2.00	23,100	14	3.400	3,784. 90	-	-
华泰证券	202203 070003 6384	先导智 能	2022年 3月7日	1,558,55 7.00	27,300	14	3.400	2,060. 80	-	-
华泰证券	202203 070003 6702	晶盛机 电	2022年 3月7日	892,878. 00	14,700	14	3.400	1,180. 62	-	-
华泰证券	202203 070003 6706	天合光 能	2022年 3月7日	1,383,29 1.00	18,900	14	3.400	1,828. 96	-	-
华泰证券	202203 070003 6718	迈为股 份	2022年 3月7日	3,857,10 2.00	7,400	14	3.400	5,099. 92	-	-
华泰证券	202203 070003 7864	奥特维	2022年 3月7日	605,172. 00	2,900	14	3.400	800.24	-	-
华泰证券	202203 070004 4866	迈为股 份	2022年 3月7日	1,094,58 3.00	2,100	14	3.400	1,447. 32	-	-
华泰证券	202203 070004	中信博	2022年 3月7日	425,040. 00	4,200	14	3.400	561.96	-	-

	4876										
华泰证券	202203 070004 4878	中信博	2022年 3月7日	1,082,84 0.00	10,700	14	3.400	1,431. 78	-	-	
华泰证券	202203 070004 4880	东方日 升	2022年 3月7日	471,744. 00	16,800	14	3.400	623.70	-	-	
华泰证券	202203 080001 2982	晶盛机 电	2022年 3月8日	120,880. 00	2,000	14	3.400	159.88	-	-	
华泰证券	202203 080001 3148	固德威	2022年 3月8日	2,722,72 0.00	6,500	14	3.400	3,600. 10	-	-	
华泰证券	202203 090001 5779	先导智 能	2022年 3月9日	4,191,92 2.00	76,300	14	3.400	5,542. 60	-	-	
华泰证券	202203 090001 8109	迈为股 份	2022年 3月9日	1,238,40 0.00	2,400	14	3.400	1,637. 44	-	-	
华泰证券	202203 100001 2546	东方日 升	2022年 3月10 日	1,048,16 8.00	34,400	14	3.400	1,385. 86	-	-	
华泰证券	202203 100001 2548	东方日 升	2022年 3月10 日	6,392,60 6.00	209,800	14	3.400	8,452. 50	-	-	
华泰证券	202203 100001 2550	中信博	2022年 3月10 日	823,192. 00	8,600	14	3.400	1,088. 50	-	-	
华泰证券	202203 100001 3032	迈为股 份	2022年 3月10 日	10,950,0 00.00	20,000	14	3.400	14,478 .38	-	-	
华泰证券	202203 100001 3034	迈为股 份	2022年 3月10 日	2,354,25 0.00	4,300	14	3.400	3,112. 90	-	-	
华泰证券	202203 100001 3040	阳光电 源	2022年 3月10 日	38,703,0 00.00	300,000	14	3.400	51,173 .92	-	-	
华泰证券	202203 100001 3044	中信博	2022年 3月10 日	9,572,00 0.00	100,000	14	3.400	12,656 .28	-	-	
华泰证券	202203 110001 6142	晶盛机 电	2022年 3月11 日	3,392,82 0.00	54,000	14	3.400	4,486. 02	-	-	
华泰证券	202203	先导智	2022年	4,971,12	84,000	14	3.400	6,572.	-	-	

	110001 6144	能	3月11 日	0.00				86		
华泰证券	202203 110001 6150	固德威	2022年 3月11 日	12,180,0 00.00	30,000	14	3.400	16,104 .62	-	-
华泰证券	202203 110001 9826	阳光电 源	2022年 3月11 日	9,868,56 0.00	78,000	14	3.400	13,048 .42	-	-
华泰证券	202203 140000 5188	东方日 升	2022年 3月14 日	5,933,14 4.00	209,800	14	3.400	7,844. 90	-	-
华泰证券	202203 160000 6568	东方日 升	2022年 3月16 日	5,962,51 6.00	209,800	14	3.400	7,883. 82	-	-
华泰证券	202203 210003 2911	阳光电 源	2022年 3月21 日	2,711,24 7.00	23,100	14	3.400	4,096. 96	-	-
华泰证券	202203 210003 2923	东方日 升	2022年 3月21 日	441,504. 00	16,800	14	3.400	667.20	-	-
华泰证券	202203 210003 2931	中信博	2022年 3月21 日	378,630. 00	4,200	14	3.400	572.16	-	-
华泰证券	202203 210003 2933	中信博	2022年 3月21 日	964,605. 00	10,700	14	3.400	1,457. 60	-	-
华泰证券	202203 210003 2939	迈为股 份	2022年 3月21 日	1,168,48 2.00	2,100	14	3.400	1,765. 76	-	-
华泰证券	202203 210003 5031	天合光 能	2022年 3月21 日	1,286,14 5.00	18,900	14	3.400	1,943. 52	-	-
华泰证券	202203 210003 5033	晶盛机 电	2022年 3月21 日	926,394. 00	14,700	14	3.400	1,399. 84	-	-
华泰证券	202203 210003 5035	先导智 能	2022年 3月21 日	1,658,74 8.00	27,300	14	3.400	2,506. 56	-	-
华泰证券	202203 220001 4303	晶盛机 电	2022年 3月22 日	124,000. 00	2,000	14	3.400	175.65	-	-
华泰证券	202203 220001 4309	固德威	2022年 3月22 日	2,440,75 0.00	6,500	14	3.400	3,457. 80	-	-

华泰证券	202203 230001 2493	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	202203 240001 1085	东方日升	2022年 3月24 日	5,339,410.00	209,800	14	3.400	7,059.92	-	-
华泰证券	202203 240001 1087	中信博	2022年 3月24 日	763,250.00	8,600	14	3.400	1,009.12	-	-
华泰证券	202203 240001 1089	中信博	2022年 3月24 日	8,875,000.00	100,000	14	3.400	11,734.66	-	-
华泰证券	202203 240001 1091	东方日升	2022年 3月24 日	875,480.00	34,400	14	3.400	1,157.52	-	-
华泰证券	202203 240001 2793	迈为股份	2022年 3月24 日	10,400,000.00	20,000	14	3.400	13,751.08	-	-
华泰证券	202203 240001 2797	迈为股份	2022年 3月24 日	2,236,000.00	4,300	14	3.400	2,956.52	-	-
华泰证券	202203 240001 2799	阳光电源	2022年 3月24 日	33,837,000.00	300,000	14	3.400	44,740.08	-	-
华泰证券	202203 250001 6838	先导智能	2022年 3月25 日	4,846,800.00	84,000	14	3.400	6,408.50	-	-
华泰证券	202203 250001 8792	晶盛机电	2022年 3月25 日	3,230,280.00	54,000	14	3.400	4,271.12	-	-
华泰证券	202203 250001 8798	固德威	2022年 3月25 日	10,980,000.00	30,000	14	3.400	14,518.00	-	-
华泰证券	202203 280000 4501	东方日升	2022年 3月28 日	5,297,450.00	209,800	14	3.400	7,004.34	-	-
华泰证券	202203 300000 6973	东方日升	2022年 3月30 日	5,203,040.00	209,800	14	3.400	6,879.60	-	-
华泰证券	202204 060004 8667	晶盛机电	2022年 4月6日	113,980.00	2,000	14	3.400	150.64	-	-
华泰证券	202204 060004	晶盛机电	2022年 4月6日	837,753.00	14,700	14	3.400	1,107.68	-	-

	8671										
华泰证券	202204 060006 4115	阳光电 源	2022年 4月6日	2,369,59 8.00	23,100	14	3.400	3,133. 20	-	-	
华泰证券	202204 060006 4121	天合光 能	2022年 4月6日	1,056,69 9.00	18,900	14	3.400	1,397. 20	-	-	
华泰证券	202204 060006 5867	中信博	2022年 4月6日	842,090. 00	10,700	14	3.400	1,113. 42	-	-	
华泰证券	202204 060006 5869	中信博	2022年 4月6日	330,540. 00	4,200	14	3.400	437.08	-	-	
华泰证券	202204 060006 6085	迈为股 份	2022年 4月6日	1,074,15 0.00	2,100	14	3.400	1,420. 30	-	-	
华泰证券	202204 060006 6087	东方日 升	2022年 4月6日	388,920. 00	16,800	14	3.400	514.22	-	-	
华泰证券	202204 060006 6093	先导智 能	2022年 4月6日	4,129,35 6.00	76,300	14	3.400	5,459. 86	-	-	
华泰证券	202204 060006 6095	先导智 能	2022年 4月6日	1,477,47 6.00	27,300	14	3.400	1,953. 56	-	-	
华泰证券	202204 070001 2872	东方日 升	2022年 4月7日	4,710,01 0.00	209,800	14	3.400	6,227. 62	-	-	
华泰证券	202204 070001 2874	东方日 升	2022年 4月7日	772,280. 00	34,400	14	3.400	1,021. 16	-	-	
华泰证券	202204 070001 2876	迈为股 份	2022年 4月7日	10,200,0 00.00	20,000	14	3.400	13,486 .62	-	-	
华泰证券	202204 070001 2878	迈为股 份	2022年 4月7日	2,193,00 0.00	4,300	14	3.400	2,899. 68	-	-	
华泰证券	202204 070001 3004	阳光电 源	2022年 4月7日	30,405,0 00.00	300,000	14	3.400	40,202 .12	-	-	
华泰证券	202204 070001 3006	中信博	2022年 4月7日	651,880. 00	8,600	14	3.400	861.98	-	-	
华泰证券	202204	中信博	2022年	7,580,00	100,000	14	3.400	10,022	-	-	

	070001 3008		4月7日	0.00				.46		
华泰证券	202204 080001 4671	固德威	2022年 4月8日	8,639,40 0.00	30,000	14	3.400	11,423 .16	-	-
华泰证券	202204 080001 4675	先导智 能	2022年 4月8日	4,487,28 0.00	84,000	14	3.400	5,933. 20	-	-
华泰证券	202204 080001 4807	晶盛机 电	2022年 4月8日	2,975,40 0.00	54,000	14	3.400	3,934. 14	-	-
华泰证券	202204 130001 0360	东方日 升	2022年 4月13 日	4,164,53 0.00	209,800	14	3.400	5,506. 48	-	-
华泰证券	202204 200003 8524	迈为股 份	2022年 4月20 日	674,100. 00	2,100	14	3.400	955.05	-	-
华泰证券	202204 200003 8526	先导智 能	2022年 4月20 日	1,280,37 0.00	27,300	14	3.400	1,813. 80	-	-
华泰证券	202204 200003 8528	先导智 能	2022年 4月20 日	3,578,47 0.00	76,300	14	3.400	5,069. 55	-	-
华泰证券	202204 200003 8532	天合光 能	2022年 4月20 日	971,271. 00	18,900	14	3.400	1,375. 95	-	-
华泰证券	202204 200004 6434	东方日 升	2022年 4月20 日	341,544. 00	16,800	14	3.400	483.90	-	-
华泰证券	202204 200004 6444	阳光电 源	2022年 4月20 日	1,665,04 8.00	23,100	14	3.400	2,358. 75	-	-
华泰证券	202204 200004 6484	中信博	2022年 4月20 日	258,720. 00	4,200	14	3.400	366.45	-	-
华泰证券	202204 210000 0503	迈为股 份	2022年 4月21 日	850,954. 00	2,600	14	3.400	1,125. 18	-	-
华泰证券	202204 210001 2021	阳光电 源	2022年 4月21 日	19,344,0 00.00	300,000	14	3.400	25,577 .02	-	-
华泰证券	202204 210001 2025	迈为股 份	2022年 4月21 日	6,545,80 0.00	20,000	14	3.400	8,654. 94	-	-

华泰证券	202204 210001 2027	迈为股 份	2022年 4月21 日	1,407,34 7.00	4,300	14	3.400	1,860. 88	-	-
华泰证券	202204 210001 2029	东方日 升	2022年 4月21 日	4,034,45 4.00	209,800	14	3.400	5,334. 42	-	-
华泰证券	202204 210001 2031	东方日 升	2022年 4月21 日	661,512. 00	34,400	14	3.400	874.72	-	-
华泰证券	202204 210001 3035	中信博	2022年 4月21 日	502,670. 00	8,600	14	3.400	664.58	-	-
华泰证券	202204 210001 3037	中信博	2022年 4月21 日	5,845,00 0.00	100,000	14	3.400	7,728. 42	-	-
华泰证券	202204 220001 6536	晶盛机 电	2022年 4月22 日	2,669,22 0.00	54,000	14	3.400	3,529. 26	-	-
华泰证券	202204 220001 6544	先导智 能	2022年 4月22 日	3,753,12 0.00	84,000	14	3.400	4,962. 44	-	-
华泰证券	202204 220001 7048	固德威	2022年 4月22 日	6,270,30 0.00	30,000	14	3.400	8,290. 80	-	-
华泰证券	202204 270001 1077	东方日 升	2022年 4月27 日	4,204,39 2.00	209,800	14	3.400	5,559. 12	-	-
华泰证券	202205 050007 0281	天合光 能	2022年 5月5日	984,312. 00	18,900	14	3.400	1,301. 44	-	-
华泰证券	202205 050007 0293	迈为股 份	2022年 5月5日	709,737. 00	2,100	14	3.400	938.42	-	-
华泰证券	202205 050007 0295	迈为股 份	2022年 5月5日	6,759,40 0.00	20,000	14	3.400	8,937. 46	-	-
华泰证券	202205 050007 0301	迈为股 份	2022年 5月5日	1,453,27 1.00	4,300	14	3.400	1,921. 50	-	-
华泰证券	202205 050007 0337	阳光电 源	2022年 5月5日	19,086,0 00.00	300,000	14	3.400	25,235 .98	-	-
华泰证券	202205 050007	阳光电 源	2022年 5月5日	1,469,62 2.00	23,100	14	3.400	1,943. 20	-	-

	0343										
华泰证券	202205 050007 0353	先导智 能	2022年 5月5日	1,219,76 4.00	27,300	14	3.400	1,612. 80	-	-	
华泰证券	202205 050007 0355	先导智 能	2022年 5月5日	3,409,08 4.00	76,300	14	3.400	4,507. 58	-	-	
华泰证券	202205 050007 0361	东方日 升	2022年 5月5日	4,548,46 4.00	209,800	14	3.400	6,014. 12	-	-	
华泰证券	202205 050007 0839	迈为股 份	2022年 5月5日	878,722. 00	2,600	14	3.400	1,161. 86	-	-	
华泰证券	202205 050007 2441	中信博	2022年 5月5日	460,960. 00	8,600	14	3.400	609.56	-	-	
华泰证券	202205 050007 4133	东方日 升	2022年 5月5日	745,792. 00	34,400	14	3.400	986.16	-	-	
华泰证券	202205 050007 4137	东方日 升	2022年 5月5日	364,224. 00	16,800	14	3.400	481.60	-	-	
华泰证券	202205 050007 4165	中信博	2022年 5月5日	225,120. 00	4,200	14	3.400	297.64	-	-	
华泰证券	202205 050007 4167	中信博	2022年 5月5日	5,360,00 0.00	100,000	14	3.400	7,087. 08	-	-	
华泰证券	202205 060001 4323	先导智 能	2022年 5月6日	3,645,60 0.00	84,000	14	3.400	4,820. 34	-	-	
华泰证券	202205 060001 4327	晶盛机 电	2022年 5月6日	2,749,68 0.00	54,000	14	3.400	3,635. 66	-	-	
华泰证券	202205 060001 4329	固德威	2022年 5月6日	5,389,20 0.00	30,000	14	3.400	7,125. 72	-	-	
华泰证券	202205 110000 8738	东方日 升	2022年 5月11 日	4,896,73 2.00	209,800	14	3.400	6,474. 58	-	-	
华泰证券	202205 180000 0708	晶盛机 电	2022年 5月18 日	2,968,38 0.00	54,000	14	3.400	3,924. 90	-	-	
华泰证券	202205	先导智	2022年	4,032,00	84,000	14	3.400	5,331.	-	-	

	180000 0710	能	5月18日	0.00				20		
华泰证券	202205 190004 2615	迈为股份	2022年 5月19日	958,100.00	2,600	14	3.400	1,266.86	-	-
华泰证券	202205 190004 2617	迈为股份	2022年 5月19日	773,850.00	2,100	14	3.400	1,023.26	-	-
华泰证券	202205 190004 2619	迈为股份	2022年 5月19日	1,584,550.00	4,300	14	3.400	2,095.10	-	-
华泰证券	202205 190004 4963	阳光电源	2022年 5月19日	24,696,000.00	300,000	14	3.400	32,653.60	-	-
华泰证券	202205 190004 4965	东方日升	2022年 5月19日	453,432.00	16,800	14	3.400	599.48	-	-
华泰证券	202205 190004 4967	东方日升	2022年 5月19日	928,456.00	34,400	14	3.400	1,227.66	-	-
华泰证券	202205 190004 4969	阳光电源	2022年 5月19日	1,901,592.00	23,100	14	3.400	2,514.26	-	-
华泰证券	202205 190004 4971	东方日升	2022年 5月19日	5,662,502.00	209,800	14	3.400	7,487.06	-	-
华泰证券	202205 190004 4975	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	202205 190004 4977	先导智能	2022年 5月19日	1,338,246.00	27,300	14	3.400	1,769.46	-	-
华泰证券	202205 190004 5005	中信博	2022年 5月19日	333,396.00	4,200	14	3.400	440.86	-	-
华泰证券	202205 190004 5007	天合光能	2022年 5月19日	1,201,662.00	18,900	14	3.400	1,588.86	-	-
华泰证券	202205 190004 5011	中信博	2022年 5月19日	7,938,000.00	100,000	14	3.400	10,495.80	-	-
华泰证券	202205 190004 6721	中信博	2022年 5月19日	682,668.00	8,600	14	3.400	902.58	-	-

华泰证券	202205 200001 4600	固德威	2022年 5月20 日	7,742,40 0.00	30,000	14	3.400	12,430 .91	-	-
华泰证券	202205 250000 7141	东方日 升	2022年 5月25 日	5,652,01 2.00	209,800	14	3.400	7,473. 20	-	-
华泰证券	202205 300000 0467	金博股 份	2022年 5月30 日	7,044,00 0.00	30,000	14	3.400	9,313. 78	-	-
华泰证券	202205 300000 0487	天合光 能	2022年 5月30 日	18,600,0 00.00	300,000	14	3.400	24,593 .38	-	-
华泰证券	202206 010000 4898	晶盛机 电	2022年 6月1日	2,926,80 0.00	54,000	14	3.400	3,869. 88	-	-
华泰证券	202206 010000 4900	先导智 能	2022年 6月1日	4,099,20 0.00	84,000	14	3.400	5,420. 10	-	-
华泰证券	202206 020001 5168	东方日 升	2022年 6月2日	5,603,75 8.00	209,800	14	3.400	7,409. 36	-	-
华泰证券	202206 020001 5170	阳光电 源	2022年 6月2日	25,500,0 00.00	300,000	14	3.400	33,716 .62	-	-
华泰证券	202206 020001 5172	东方日 升	2022年 6月2日	918,824. 00	34,400	14	3.400	1,214. 92	-	-
华泰证券	202206 020001 5174	阳光电 源	2022年 6月2日	1,963,50 0.00	23,100	14	3.400	2,596. 16	-	-
华泰证券	202206 020001 5176	东方日 升	2022年 6月2日	448,728. 00	16,800	14	3.400	593.32	-	-
华泰证券	202206 020002 2082	天合光 能	2022年 6月2日	1,170,47 7.00	18,900	14	3.400	1,547. 70	-	-
华泰证券	202206 020002 2092	先导智 能	2022年 6月2日	3,918,00 5.00	76,300	14	3.400	5,180. 42	-	-
华泰证券	202206 020002 2096	先导智 能	2022年 6月2日	1,401,85 5.00	27,300	14	3.400	1,853. 60	-	-
华泰证券	202206 020002	中信博	2022年 6月2日	8,423,00 0.00	100,000	14	3.400	11,137 .14	-	-

	2098										
华泰证券	202206 020002 2100	中信博	2022年 6月2日	353,766. 00	4,200	14	3.400	467.74	-	-	
华泰证券	202206 020002 2102	迈为股 份	2022年 6月2日	791,175. 00	2,100	14	3.400	1,046. 08	-	-	
华泰证券	202206 020002 2104	迈为股 份	2022年 6月2日	1,620,02 5.00	4,300	14	3.400	2,142. 00	-	-	
华泰证券	202206 020002 2106	中信博	2022年 6月2日	724,378. 00	8,600	14	3.400	957.74	-	-	
华泰证券	202206 020002 2108	迈为股 份	2022年 6月2日	979,550. 00	2,600	14	3.400	1,295. 14	-	-	
华泰证券	202206 060001 1192	固德威	2022年 6月6日	8,907,30 0.00	30,000	14	3.400	11,777 .50	-	-	
华泰证券	202206 080000 6533	东方日 升	2022年 6月8日	5,740,12 8.00	209,800	14	3.400	7,589. 68	-	-	
华泰证券	202206 130001 8433	金博股 份	2022年 6月13 日	8,580,00 0.00	30,000	14	3.400	11,344 .62	-	-	
华泰证券	202206 130001 9239	天合光 能	2022年 6月13 日	18,060,0 00.00	300,000	14	3.400	23,879 .38	-	-	
华泰证券	202206 150000 1426	迈为股 份	2022年 6月15 日	1,225,63 2.00	3,200	14	3.400	1,620. 50	-	-	
华泰证券	202206 150000 1428	东方日 升	2022年 6月15 日	935,922. 00	33,800	14	3.400	1,237. 46	-	-	
华泰证券	202206 150000 1429	先导智 能	2022年 6月15 日	3,103,13 7.00	51,300	14	3.400	4,102. 98	-	-	
华泰证券	202206 150000 1430	阳光电 源	2022年 6月15 日	4,223,26 4.00	48,700	14	3.400	5,584. 04	-	-	
华泰证券	202206 150000 1434	天合光 能	2022年 6月15 日	5,525,00 0.00	100,000	14	3.400	7,305. 34	-	-	
华泰证券	202206	海优新	2022年	480,000.	2,400	14	3.400	634.62	-	-	

	150000 1436	材	6月15日	00						
华泰证券	202206 150000 1438	天合光能	2022年 6月15日	2,806,700.00	50,800	14	3.400	3,711.12	-	-
华泰证券	202206 150000 1440	金博股份	2022年 6月15日	815,970.00	3,000	14	3.400	1,078.84	-	-
华泰证券	202206 150000 1442	中信博	2022年 6月15日	294,500.00	3,800	14	3.400	389.34	-	-
华泰证券	202206 150000 1444	固德威	2022年 6月15日	678,300.00	2,100	14	3.400	896.84	-	-
华泰证券	202206 150000 1446	奥特维	2022年 6月15日	482,030.00	1,900	14	3.400	637.42	-	-
华泰证券	202206 150000 1450	海优新材	2022年 6月15日	240,000.00	1,200	14	3.400	317.38	-	-
华泰证券	202206 150000 1454	天合光能	2022年 6月15日	1,464,125.00	26,500	14	3.400	1,935.92	-	-
华泰证券	202206 150000 1456	金博股份	2022年 6月15日	435,184.00	1,600	14	3.400	575.40	-	-
华泰证券	202206 150000 1458	中信博	2022年 6月15日	155,000.00	2,000	14	3.400	204.96	-	-
华泰证券	202206 150000 1460	奥特维	2022年 6月15日	253,700.00	1,000	14	3.400	335.44	-	-
华泰证券	202206 150000 1462	先导智能	2022年 6月15日	1,621,132.00	26,800	14	3.400	2,143.54	-	-
华泰证券	202206 150000 1464	迈为股份	2022年 6月15日	651,117.00	1,700	14	3.400	860.86	-	-
华泰证券	202206 150000 1466	固德威	2022年 6月15日	355,300.00	1,100	14	3.400	469.84	-	-
华泰证券	202206 150000 1468	晶盛机电	2022年 6月15日	943,884.00	15,700	14	3.400	1,247.96	-	-

华泰证券	202206 150000 1470	阳光电源	2022年 6月15 日	2,202,68 8.00	25,400	14	3.400	2,912. 42	-	-
华泰证券	202206 150000 1472	东方日升	2022年 6月15 日	487,344. 00	17,600	14	3.400	644.42	-	-
华泰证券	202206 150000 1474	晶盛机电	2022年 6月15 日	1,815,62 4.00	30,200	14	3.400	2,400. 72	-	-
华泰证券	202206 150002 2489	晶盛机电	2022年 6月15 日	3,246,48 0.00	54,000	14	3.400	4,292. 54	-	-
华泰证券	202206 150002 2651	先导智能	2022年 6月15 日	5,081,16 0.00	84,000	14	3.400	6,718. 46	-	-
华泰证券	202206 160001 4933	阳光电源	2022年 6月16 日	27,033,0 00.00	300,000	14	3.400	35,743 .68	-	-
华泰证券	202206 160001 4935	东方日升	2022年 6月16 日	1,005,16 8.00	34,400	14	3.400	1,329. 02	-	-
华泰证券	202206 160001 4937	东方日升	2022年 6月16 日	6,130,35 6.00	209,800	14	3.400	8,105. 72	-	-
华泰证券	202206 160001 4939	中信博	2022年 6月16 日	713,886. 00	8,600	14	3.400	943.88	-	-
华泰证券	202206 160001 5569	迈为股份	2022年 6月16 日	1,023,56 8.00	2,600	14	3.400	1,353. 38	-	-
华泰证券	202206 160001 5571	迈为股份	2022年 6月16 日	1,692,82 4.00	4,300	14	3.400	2,238. 32	-	-
华泰证券	202206 160001 5575	先导智能	2022年 6月16 日	4,693,21 3.00	76,300	14	3.400	6,205. 50	-	-
华泰证券	202206 220001 3569	东方日升	2022年 6月22 日	6,088,39 6.00	209,800	14	3.400	8,050. 28	-	-
华泰证券	202206 270001 3520	金博股份	2022年 6月27 日	9,150,00 0.00	30,000	14	3.400	12,098 .38	-	-
华泰证券	202206 270001	天合光能	2022年 6月27	20,247,0 00.00	300,000	14	3.400	26,771 .08	-	-

	4782		日								
华泰证券	202206 290002 1324	中信博	2022年 6月29 日	328,700. 00	3,800	14	3.400	434.56	-	-	
华泰证券	202206 290002 1326	迈为股 份	2022年 6月29 日	815,915. 00	1,700	14	3.400	1,078. 84	-	-	
华泰证券	202206 290002 1328	迈为股 份	2022年 6月29 日	1,535,84 0.00	3,200	14	3.400	2,030. 70	-	-	
华泰证券	202206 290002 1338	金博股 份	2022年 6月29 日	881,100. 00	3,000	14	3.400	1,165. 08	-	-	
华泰证券	202206 290002 1340	奥特维	2022年 6月29 日	488,205. 00	1,900	14	3.400	645.54	-	-	
华泰证券	202206 290002 2868	先导智 能	2022年 6月29 日	1,736,10 4.00	26,800	14	3.400	2,295. 58	-	-	
华泰证券	202206 290002 2870	先导智 能	2022年 6月29 日	3,323,21 4.00	51,300	14	3.400	4,394. 04	-	-	
华泰证券	202206 290002 2874	晶盛机 电	2022年 6月29 日	1,047,03 3.00	15,700	14	3.400	1,384. 46	-	-	
华泰证券	202206 290002 2876	天合光 能	2022年 6月29 日	1,763,57 5.00	26,500	14	3.400	2,331. 84	-	-	
华泰证券	202206 290002 2878	晶盛机 电	2022年 6月29 日	2,014,03 8.00	30,200	14	3.400	2,662. 94	-	-	
华泰证券	202206 290002 4440	天合光 能	2022年 6月29 日	3,380,74 0.00	50,800	14	3.400	4,470. 06	-	-	
华泰证券	202206 290002 4446	东方日 升	2022年 6月29 日	505,824. 00	17,600	14	3.400	668.78	-	-	
华泰证券	202206 290002 4448	东方日 升	2022年 6月29 日	971,412. 00	33,800	14	3.400	1,284. 36	-	-	
华泰证券	202206 290002 4452	固德威	2022年 6月29 日	592,830. 00	2,100	14	3.400	783.86	-	-	
华泰证券	202206	海优新	2022年	476,760.	2,400	14	3.400	630.42	-	-	

	290002 4456	材	6月29 日	00						
华泰证券	202206 290002 4468	阳光电 源	2022年 6月29 日	4,485,27 0.00	48,700	14	3.400	5,930. 54	-	-
华泰证券	202206 290002 4472	阳光电 源	2022年 6月29 日	2,339,34 0.00	25,400	14	3.400	3,093. 16	-	-
华泰证券	202206 300001 6005	先导智 能	2022年 6月30 日	4,820,63 4.00	76,300	14	3.400	6,373. 92	-	-
华泰证券	202206 300001 9525	东方日 升	2022年 6月30 日	6,153,43 4.00	209,800	14	3.400	8,136. 24	-	-
华泰证券	202207 010000 0369	金博股 份	2022年 7月1日	28,171,0 00.00	100,000	14	3.400	37,248 .26	-	-
华泰证券	202207 060001 3235	东方日 升	2022年 7月6日	6,331,76 4.00	209,800	14	3.400	8,372. 00	-	-
华泰证券	202207 110001 8750	天合光 能	2022年 7月11 日	19,995,0 00.00	300,000	14	3.400	26,437 .88	-	-
华泰证券	202207 110001 8754	金博股 份	2022年 7月11 日	8,802,00 0.00	30,000	14	3.400	11,638 .20	-	-
华泰证券	202207 130000 0472	天合光 能	2022年 7月13 日	34,850,0 00.00	500,000	28	3.400	92,158 .92	-	-
华泰证券	202207 130002 6574	阳光电 源	2022年 7月13 日	2,933,70 0.00	25,400	14	3.400	3,878. 98	-	-
华泰证券	202207 130002 6576	阳光电 源	2022年 7月13 日	5,624,85 0.00	48,700	14	3.400	7,437. 36	-	-
华泰证券	202207 130002 6580	东方日 升	2022年 7月13 日	1,021,77 4.00	33,800	14	3.400	1,351. 00	-	-
华泰证券	202207 130002 6582	东方日 升	2022年 7月13 日	532,048. 00	17,600	14	3.400	703.50	-	-
华泰证券	202207 130002 6586	海优新 材	2022年 7月13 日	427,704. 00	2,400	14	3.400	565.46	-	-

华泰证券	202207 130002 6588	迈为股份	2022年 7月13 日	1,504,00 0.00	3,200	14	3.400	1,988. 56	-	-
华泰证券	202207 130002 6592	迈为股份	2022年 7月13 日	799,000. 00	1,700	14	3.400	1,056. 44	-	-
华泰证券	202207 130002 8848	先导智能	2022年 7月13 日	3,138,53 4.00	51,300	14	3.400	4,149. 88	-	-
华泰证券	202207 130002 8850	先导智能	2022年 7月13 日	1,639,62 4.00	26,800	14	3.400	2,167. 90	-	-
华泰证券	202207 130002 8854	固德威	2022年 7月13 日	716,100. 00	2,100	14	3.400	946.82	-	-
华泰证券	202207 130002 8856	晶盛机电	2022年 7月13 日	2,038,50 0.00	30,200	14	3.400	2,695. 42	-	-
华泰证券	202207 130002 8858	晶盛机电	2022年 7月13 日	1,059,75 0.00	15,700	14	3.400	1,401. 26	-	-
华泰证券	202207 130002 8872	金博股份	2022年 7月13 日	947,190. 00	3,000	14	3.400	1,252. 44	-	-
华泰证券	202207 130002 8874	天合光能	2022年 7月13 日	1,847,05 0.00	26,500	14	3.400	2,442. 16	-	-
华泰证券	202207 130002 8876	天合光能	2022年 7月13 日	3,540,76 0.00	50,800	14	3.400	4,681. 74	-	-
华泰证券	202207 130002 8884	奥特维	2022年 7月13 日	562,324. 00	1,900	14	3.400	743.54	-	-
华泰证券	202207 130002 8886	中信博	2022年 7月13 日	355,338. 00	3,800	14	3.400	469.84	-	-
华泰证券	202207 140001 0706	东方日升	2022年 7月14 日	6,617,09 2.00	209,800	14	3.400	8,749. 30	-	-
华泰证券	202207 150001 3407	金博股份	2022年 7月15 日	32,950,0 00.00	100,000	14	3.400	43,567 .16	-	-
华泰证券	202207 200001	东方日升	2022年 7月20	6,713,60 0.00	209,800	14	3.400	8,876. 84	-	-

	3089		日							
华泰证券	202207 250001 6062	天合光 能	2022年 7月25 日	21,447,0 00.00	300,000	14	3.400	28,357 .70	-	-
华泰证券	202207 250001 6072	金博股 份	2022年 7月25 日	9,654,00 0.00	30,000	14	3.400	12,764 .78	-	-
华泰证券	202207 260000 0508	固德威	2022年 7月26 日	15,103,3 50.00	45,000	14	3.200	18,795 .28	-	-
华泰证券	202207 270000 0372	固德威	2022年 7月27 日	16,110,0 00.00	45,000	14	3.200	20,048 .00	-	-
华泰证券	202207 270002 5974	先导智 能	2022年 7月27 日	3,239,08 2.00	51,300	14	3.400	4,282. 74	-	-
华泰证券	202207 270002 5976	迈为股 份	2022年 7月27 日	850,306. 00	1,700	14	3.400	1,124. 34	-	-
华泰证券	202207 270002 5978	固德威	2022年 7月27 日	751,800. 00	2,100	14	3.400	994.00	-	-
华泰证券	202207 270002 5980	阳光电 源	2022年 7月27 日	3,041,65 0.00	25,400	14	3.400	4,021. 78	-	-
华泰证券	202207 270002 5984	阳光电 源	2022年 7月27 日	5,831,82 5.00	48,700	14	3.400	7,710. 92	-	-
华泰证券	202207 270002 5990	东方日 升	2022年 7月27 日	1,170,49 4.00	33,800	14	3.400	1,547. 70	-	-
华泰证券	202207 270002 7360	海优新 材	2022年 7月27 日	494,520. 00	2,400	14	3.400	653.80	-	-
华泰证券	202207 270002 7364	先导智 能	2022年 7月27 日	1,692,15 2.00	26,800	14	3.400	2,237. 34	-	-
华泰证券	202207 270002 7368	金博股 份	2022年 7月27 日	992,580. 00	3,000	14	3.400	1,312. 36	-	-
华泰证券	202207 270002 7370	晶盛机 电	2022年 7月27 日	1,172,00 5.00	15,700	14	3.400	1,549. 66	-	-
华泰证券	202207	晶盛机	2022年	2,254,43	30,200	14	3.400	2,980.	-	-

	270002 7372	电	7月27日	0.00				88		
华泰证券	202207 270002 7376	天合光能	2022年 7月27日	2,130,600.00	26,500	14	3.400	2,817.08	-	-
华泰证券	202207 270002 7380	迈为股份	2022年 7月27日	1,600,576.00	3,200	14	3.400	2,116.38	-	-
华泰证券	202207 270002 7382	天合光能	2022年 7月27日	4,084,320.00	50,800	14	3.400	5,400.36	-	-
华泰证券	202207 270002 7384	东方日升	2022年 7月27日	609,488.00	17,600	14	3.400	805.84	-	-
华泰证券	202207 270002 7386	中信博	2022年 7月27日	474,658.00	3,800	14	3.400	627.62	-	-
华泰证券	202207 270002 7400	奥特维	2022年 7月27日	596,999.00	1,900	14	3.400	789.32	-	-
华泰证券	202207 280001 0239	东方日升	2022年 7月28日	7,183,552.00	209,800	14	3.400	9,498.30	-	-
华泰证券	202207 290001 4416	金博股份	2022年 7月29日	35,915,000.00	100,000	14	3.400	47,487.58	-	-
华泰证券	202208 030001 3565	东方日升	2022年 8月3日	6,734,580.00	209,800	14	3.400	8,904.56	-	-
华泰证券	202208 080002 1815	天合光能	2022年 8月8日	23,700,000.00	300,000	14	3.400	31,336.62	-	-
华泰证券	202208 080002 1817	金博股份	2022年 8月8日	11,190,000.00	30,000	14	3.400	14,795.62	-	-
华泰证券	202208 090001 2882	固德威	2022年 8月9日	17,314,200.00	45,000	14	3.200	21,546.56	-	-
华泰证券	202208 100002 6536	天合光能	2022年 8月10日	41,705,000.00	500,000	28	3.400	110,286.68	-	-
华泰证券	202208 100002 6580	阳光电源	2022年 8月10日	3,271,520.00	25,400	14	3.400	4,325.72	-	-

华泰证券	202208 100002 6582	阳光电源	2022年 8月10 日	6,272,56 0.00	48,700	14	3.400	8,293. 74	-	-
华泰证券	202208 100002 6602	迈为股份	2022年 8月10 日	1,528,00 0.00	3,200	14	3.400	2,020. 34	-	-
华泰证券	202208 100002 6604	迈为股份	2022年 8月10 日	811,750. 00	1,700	14	3.400	1,073. 38	-	-
华泰证券	202208 100002 6624	奥特维	2022年 8月10 日	704,520. 00	1,900	14	3.400	931.56	-	-
华泰证券	202208 100002 6640	东方日升	2022年 8月10 日	624,272. 00	17,600	14	3.400	825.44	-	-
华泰证券	202208 100002 6642	东方日升	2022年 8月10 日	1,198,88 6.00	33,800	14	3.400	1,585. 22	-	-
华泰证券	202208 100002 6652	天合光能	2022年 8月10 日	4,237,22 8.00	50,800	14	3.400	5,602. 52	-	-
华泰证券	202208 100002 6654	天合光能	2022年 8月10 日	2,210,36 5.00	26,500	14	3.400	2,922. 64	-	-
华泰证券	202208 100002 7444	先导智能	2022年 8月10 日	1,531,08 4.00	26,800	14	3.400	2,024. 40	-	-
华泰证券	202208 100002 7466	固德威	2022年 8月10 日	819,000. 00	2,100	14	3.400	1,082. 90	-	-
华泰证券	202208 100002 7566	固德威	2022年 8月10 日	17,550,0 00.00	45,000	14	3.200	21,840 .00	-	-
华泰证券	202208 100002 7592	晶盛机电	2022年 8月10 日	1,118,31 1.00	15,700	14	3.400	1,478. 68	-	-
华泰证券	202208 100002 7594	晶盛机电	2022年 8月10 日	2,151,14 6.00	30,200	14	3.400	2,844. 24	-	-
华泰证券	202208 100002 7606	先导智能	2022年 8月10 日	2,930,76 9.00	51,300	14	3.400	3,875. 06	-	-
华泰证券	202208 100002	中信博	2022年 8月10	532,380. 00	3,800	14	3.400	703.92	-	-

	7614		日							
华泰证券	2022081000027616	金博股份	2022年8月10日	1,110,000.00	3,000	14	3.400	1,467.62	-	-
华泰证券	2022081000027624	海优新材	2022年8月10日	593,664.00	2,400	14	3.400	784.98	-	-
华泰证券	2022081200019015	金博股份	2022年8月12日	35,665,000.00	100,000	14	3.400	47,157.04	-	-
华泰证券	2022082200019083	天合光能	2022年8月22日	21,402,000.00	300,000	14	3.400	28,298.20	-	-
华泰证券	2022082200019163	金博股份	2022年8月22日	10,122,000.00	30,000	14	3.400	13,383.58	-	-
华泰证券	2022082300016982	固德威	2022年8月23日	20,095,650.00	45,000	14	3.200	25,007.92	-	-
华泰证券	2022082400026481	金博股份	2022年8月24日	990,630.00	3,000	14	3.400	1,309.84	-	-
华泰证券	2022082400028191	中信博	2022年8月24日	541,880.00	3,800	14	3.400	716.52	-	-
华泰证券	2022082400030821	先导智能	2022年8月24日	1,629,440.00	26,800	14	3.400	2,154.46	-	-
华泰证券	2022082400030877	阳光电源	2022年8月24日	3,469,132.00	25,400	14	3.400	4,586.96	-	-
华泰证券	2022082400030879	阳光电源	2022年8月24日	6,651,446.00	48,700	14	3.400	8,794.66	-	-
华泰证券	2022082400030887	迈为股份	2022年8月24日	1,650,816.00	3,200	14	3.400	2,182.74	-	-
华泰证券	2022082400030889	迈为股份	2022年8月24日	876,996.00	1,700	14	3.400	1,159.62	-	-
华泰证券	2022082400030891	奥特维	2022年8月24日	771,856.00	1,900	14	3.400	1,020.60	-	-
华泰证券	202208	固德威	2022年	905,121.	2,100	14	3.400	1,196.	-	-

	240003 0899		8月24日	00				72		
华泰证券	202208 240003 2723	天合光能	2022年 8月24日	3,606,800.00	50,800	14	3.400	4,768.96	-	-
华泰证券	202208 240003 2725	天合光能	2022年 8月24日	1,881,500.00	26,500	14	3.400	2,487.80	-	-
华泰证券	202208 240003 2733	东方日升	2022年 8月24日	557,744.00	17,600	14	3.400	737.52	-	-
华泰证券	202208 240003 2735	东方日升	2022年 8月24日	1,071,122.00	33,800	14	3.400	1,416.24	-	-
华泰证券	202208 240003 2741	固德威	2022年 8月24日	19,395,450.00	45,000	14	3.200	24,136.56	-	-
华泰证券	202208 240003 2751	晶盛机电	2022年 8月24日	1,263,850.00	15,700	14	3.400	1,671.04	-	-
华泰证券	202208 240003 2753	晶盛机电	2022年 8月24日	2,431,100.00	30,200	14	3.400	3,214.40	-	-
华泰证券	202208 240003 2755	海优新材	2022年 8月24日	519,120.00	2,400	14	3.400	686.42	-	-
华泰证券	202208 260001 8516	金博股份	2022年 8月26日	31,800,000.00	100,000	14	3.400	42,046.62	-	-
华泰证券	202209 010000 0524	锦浪科技	2022年 9月1日	790,364.00	3,400	14	3.400	1,045.10	-	-
华泰证券	202209 010000 0526	先导智能	2022年 9月1日	1,097,724.00	20,400	14	3.400	1,451.38	-	-
华泰证券	202209 010000 0528	迈为股份	2022年 9月1日	772,820.00	1,700	14	3.400	1,021.86	-	-
华泰证券	202209 010000 0530	晶盛机电	2022年 9月1日	886,193.00	11,900	14	3.400	1,171.80	-	-
华泰证券	202209 010000 0532	阳光电源	2022年 9月1日	2,280,720.00	20,400	14	3.400	3,015.60	-	-

华泰证券	202209 050002 3455	金博股份	2022年 9月5日	8,466,00 0.00	30,000	14	3.400	11,193 .98	-	-
华泰证券	202209 050002 3471	天合光能	2022年 9月5日	21,375,0 00.00	300,000	14	3.400	28,262 .50	-	-
华泰证券	202209 060001 3289	固德威	2022年 9月6日	15,088,0 50.00	45,000	14	3.200	18,776 .24	-	-
华泰证券	202209 070002 7236	金博股份	2022年 9月7日	923,340. 00	3,000	14	3.400	1,220. 80	-	-
华泰证券	202209 070002 7240	中信博	2022年 9月7日	456,000. 00	3,800	14	3.400	602.98	-	-
华泰证券	202209 070002 7244	天合光能	2022年 9月7日	3,812,03 2.00	50,800	14	3.400	5,040. 42	-	-
华泰证券	202209 070002 7246	天合光能	2022年 9月7日	1,988,56 0.00	26,500	14	3.400	2,629. 34	-	-
华泰证券	202209 070003 0174	晶盛机电	2022年 9月7日	1,237,63 1.00	15,700	14	3.400	1,636. 46	-	-
华泰证券	202209 070003 0176	晶盛机电	2022年 9月7日	2,380,66 6.00	30,200	14	3.400	3,147. 76	-	-
华泰证券	202209 070003 0184	固德威	2022年 9月7日	669,732. 00	2,100	14	3.400	885.50	-	-
华泰证券	202209 070003 0206	先导智能	2022年 9月7日	1,475,34 0.00	26,800	14	3.400	1,950. 76	-	-
华泰证券	202209 070003 0258	阳光电源	2022年 9月7日	3,102,86 4.00	25,400	14	3.400	4,102. 70	-	-
华泰证券	202209 070003 0260	阳光电源	2022年 9月7日	5,949,19 2.00	48,700	14	3.400	7,866. 18	-	-
华泰证券	202209 070003 0268	迈为股份	2022年 9月7日	1,726,40 0.00	3,200	14	3.400	2,282. 70	-	-
华泰证券	202209 070003	迈为股份	2022年 9月7日	917,150. 00	1,700	14	3.400	1,212. 68	-	-

	0270										
华泰证券	202209 070003 0272	奥特维	2022年 9月7日	753,160. 00	1,900	14	3.400	995.82			-
华泰证券	202209 070003 0278	东方日 升	2022年 9月7日	532,400. 00	17,600	14	3.400	703.92			-
华泰证券	202209 070003 0280	东方日 升	2022年 9月7日	1,022,45 0.00	33,800	14	3.400	1,351. 84			-
华泰证券	202209 070003 0298	固德威	2022年 9月7日	14,351,4 00.00	45,000	14	3.200	17,859 .52			-
华泰证券	202209 070003 0882	海优新 材	2022年 9月7日	504,720. 00	2,400	14	3.400	667.38			-
华泰证券	202209 070003 0928	天合光 能	2022年 9月7日	37,520,0 00.00	500,000	28	3.400	116,93 7.48			-
华泰证券	202209 090001 9385	金博股 份	2022年 9月9日	30,424,0 00.00	100,000	14	3.400	40,227 .32			-
华泰证券	202209 150001 4177	迈为股 份	2022年 9月15 日	831,300. 00	1,700	14	3.400	1,099. 14			-
华泰证券	202209 150001 4179	锦浪科 技	2022年 9月15 日	754,902. 00	3,400	14	3.400	998.20			-
华泰证券	202209 150001 4995	阳光电 源	2022年 9月15 日	2,195,04 0.00	20,400	14	3.400	2,902. 34			-
华泰证券	202209 150001 4997	晶盛机 电	2022年 9月15 日	868,700. 00	11,900	14	3.400	1,148. 56			-
华泰证券	202209 150001 4999	先导智 能	2022年 9月15 日	1,040,80 8.00	20,400	14	3.400	1,376. 20			-
华泰证券	202209 190001 9038	天合光 能	2022年 9月19 日	19,197,0 00.00	300,000	14	3.400	38,074 .05			-
华泰证券	202209 190001 9182	金博股 份	2022年 9月19 日	8,520,00 0.00	30,000	14	3.400	16,898 .07			-
华泰证券	202209	锦浪科	2022年	35,251,5	150,000	14	3.400	66,586			-

	200000 0360	技	9月20日	00.00				.20		
华泰证券	202209 200001 4495	固德威	2022年 9月20日	13,113,900.00	45,000	14	3.200	23,313.60	-	-
华泰证券	202209 210002 4912	先导智能	2022年 9月21日	1,352,596.00	26,800	14	3.400	2,427.25	-	-
华泰证券	202209 210002 7102	晶盛机电	2022年 9月21日	1,120,038.00	15,700	14	3.400	2,009.82	-	-
华泰证券	202209 210002 7150	东方日升	2022年 9月21日	473,616.00	17,600	14	3.400	849.87	-	-
华泰证券	202209 210002 7152	东方日升	2022年 9月21日	909,558.00	33,800	14	3.400	1,632.10	-	-
华泰证券	202209 210002 8370	迈为股份	2022年 9月21日	841,500.00	1,700	14	3.400	1,510.12	-	-
华泰证券	202209 210003 0112	奥特维	2022年 9月21日	661,732.00	1,900	14	3.400	1,187.50	-	-
华泰证券	202209 210003 1864	阳光电源	2022年 9月21日	2,865,120.00	25,400	14	3.400	5,141.21	-	-
华泰证券	202209 210003 1866	阳光电源	2022年 9月21日	5,493,360.00	48,700	14	3.400	9,857.58	-	-
华泰证券	202209 210003 2108	固德威	2022年 9月21日	12,759,300.00	45,000	14	3.200	21,549.04	-	-
华泰证券	202209 210003 2112	固德威	2022年 9月21日	595,434.00	2,100	14	3.400	1,068.56	-	-
华泰证券	202209 210003 2124	金博股份	2022年 9月21日	868,620.00	3,000	14	3.400	1,558.76	-	-
华泰证券	202209 210003 2126	中信博	2022年 9月21日	378,138.00	3,800	14	3.400	678.49	-	-
华泰证券	202209 210003 2132	天合光能	2022年 9月21日	1,755,095.00	26,500	14	3.400	3,149.44	-	-

华泰证券	202209 210003 2134	天合光 能	2022年 9月21 日	3,364,48 4.00	50,800	14	3.400	6,037. 44	-	-
华泰证券	202209 210003 2284	海优新 材	2022年 9月21 日	430,320. 00	2,400	14	3.400	772.16	-	-
华泰证券	202209 210003 2286	晶盛机 电	2022年 9月21 日	2,154,46 8.00	30,200	14	3.400	3,866. 12	-	-
华泰证券	202209 210003 2518	迈为股 份	2022年 9月21 日	1,584,00 0.00	3,200	14	3.400	2,842. 40	-	-
华泰证券	202209 230002 0106	金博股 份	2022年 9月23 日	28,876,0 00.00	100,000	14	3.400	46,362 .06	-	-
华泰证券	202210 100000 1025	晶盛机 电	2022年 10月10 日	19,770,0 00.00	300,000	14	3.400	26,140 .38	-	-
华泰证券	202210 100000 1027	天合光 能	2022年 10月10 日	15,052,8 00.00	240,000	14	3.400	19,903 .10	-	-
华泰证券	202210 100008 2603	天合光 能	2022年 10月10 日	18,816,0 00.00	300,000	14	3.400	24,878 .98	-	-
华泰证券	202210 100008 2611	金博股 份	2022年 10月10 日	8,250,00 0.00	30,000	14	3.400	10,908 .38	-	-
华泰证券	202210 100008 6341	阳光电 源	2022年 10月10 日	5,475,34 1.00	48,700	14	3.400	7,239. 68	-	-
华泰证券	202210 100008 6347	阳光电 源	2022年 10月10 日	2,855,72 2.00	25,400	14	3.400	3,775. 94	-	-
华泰证券	202210 100008 6361	迈为股 份	2022年 10月10 日	815,830. 00	1,700	14	3.400	1,078. 70	-	-
华泰证券	202210 100008 6363	迈为股 份	2022年 10月10 日	1,535,68 0.00	3,200	14	3.400	2,030. 56	-	-
华泰证券	202210 100008 6393	先导智 能	2022年 10月10 日	1,247,80 8.00	26,800	14	3.400	1,649. 90	-	-
华泰证券	202210 100008	奥特维	2022年 10月10	647,254. 00	1,900	14	3.400	855.82	-	-

	6401		日							
华泰证券	2022101000086467	海优新材	2022年10月10日	377,256.00	2,400	14	3.400	498.82	-	-
华泰证券	2022101000086469	晶盛机电	2022年10月10日	1,990,180.00	30,200	14	3.400	2,631.44	-	-
华泰证券	2022101000086475	晶盛机电	2022年10月10日	1,034,630.00	15,700	14	3.400	1,368.08	-	-
华泰证券	2022101000086489	天合光能	2022年10月10日	31,360,000.00	500,000	28	3.400	82,929.84	-	-
华泰证券	2022101000095665	固德威	2022年10月10日	12,419,550.00	45,000	14	3.200	15,455.44	-	-
华泰证券	2022101000095681	固德威	2022年10月10日	12,419,550.00	45,000	14	3.200	15,455.44	-	-
华泰证券	2022101000095685	固德威	2022年10月10日	579,579.00	2,100	14	3.400	766.36	-	-
华泰证券	2022101000095687	中信博	2022年10月10日	343,900.00	3,800	14	3.400	454.72	-	-
华泰证券	2022101000095689	金博股份	2022年10月10日	825,000.00	3,000	14	3.400	1,090.88	-	-
华泰证券	2022101000095695	天合光能	2022年10月10日	1,662,080.00	26,500	14	3.400	2,197.58	-	-
华泰证券	2022101000095697	天合光能	2022年10月10日	3,186,176.00	50,800	14	3.400	4,212.88	-	-
华泰证券	2022101000095701	金博股份	2022年10月10日	27,500,000.00	100,000	14	3.400	36,361.08	-	-
华泰证券	2022101000095755	东方日升	2022年10月10日	443,520.00	17,600	14	3.400	586.46	-	-
华泰证券	2022101000095757	东方日升	2022年10月10日	851,760.00	33,800	14	3.400	1,126.16	-	-
华泰证券	202210	东方日	2022年	3,058,80	120,000	14	3.400	4,044.	-	-

	110000 1948	升	10月11 日	0.00				46		
华泰证券	202210 240007 8825	晶盛机 电	2022年 10月24 日	20,619,0 00.00	300,000		14 3.400	27,262 .90	-	-
华泰证券	202210 240007 8827	天合光 能	2022年 10月24 日	15,024,0 00.00	240,000		14 3.400	19,865 .02	-	-
华泰证券	202210 240007 8837	阳光电 源	2022年 10月24 日	6,136,20 0.00	48,700		14 3.400	8,113. 42	-	-
华泰证券	202210 240007 8839	阳光电 源	2022年 10月24 日	3,200,40 0.00	25,400		14 3.400	4,231. 64	-	-
华泰证券	202210 240008 0571	天合光 能	2022年 10月24 日	18,780,0 00.00	300,000		14 3.400	24,831 .38	-	-
华泰证券	202210 240008 0573	金博股 份	2022年 10月24 日	7,295,10 0.00	30,000		14 3.400	9,645. 72	-	-
华泰证券	202210 240008 0641	迈为股 份	2022年 10月24 日	780,300. 00	1,700		14 3.400	1,031. 80	-	-
华泰证券	202210 240008 0643	迈为股 份	2022年 10月24 日	1,468,80 0.00	3,200		14 3.400	1,942. 08	-	-
华泰证券	202210 240008 0653	先导智 能	2022年 10月24 日	1,340,26 8.00	26,800		14 3.400	1,772. 12	-	-
华泰证券	202210 240008 0657	奥特维	2022年 10月24 日	645,791. 00	1,900		14 3.400	853.86	-	-
华泰证券	202210 240008 0679	海优新 材	2022年 10月24 日	388,080. 00	2,400		14 3.400	513.10	-	-
华泰证券	202210 240008 0681	晶盛机 电	2022年 10月24 日	2,075,64 6.00	30,200		14 3.400	2,744. 42	-	-
华泰证券	202210 240008 0683	固德威	2022年 10月24 日	14,589,0 00.00	45,000		14 3.200	18,155 .20	-	-
华泰证券	202210 240008 0693	金博股 份	2022年 10月24 日	24,317,0 00.00	100,000		14 3.400	32,152 .54	-	-

华泰证券	202210 240008 1551	东方日 升	2022年 10月24 日	463,056. 00	17,600	14	3.400	612.22	-	-
华泰证券	202210 240008 1553	东方日 升	2022年 10月24 日	889,278. 00	33,800	14	3.400	1,175. 86	-	-
华泰证券	202210 240008 1719	晶盛机 电	2022年 10月24 日	1,079,06 1.00	15,700	14	3.400	1,426. 74	-	-
华泰证券	202210 240008 1725	固德威	2022年 10月24 日	14,589,0 00.00	45,000	14	3.200	18,155 .20	-	-
华泰证券	202210 240008 1729	固德威	2022年 10月24 日	680,820. 00	2,100	14	3.400	900.20	-	-
华泰证券	202210 240008 1733	中信博	2022年 10月24 日	385,700. 00	3,800	14	3.400	510.02	-	-
华泰证券	202210 240008 1737	金博股 份	2022年 10月24 日	729,510. 00	3,000	14	3.400	964.60	-	-
华泰证券	202210 240008 1741	天合光 能	2022年 10月24 日	1,658,90 0.00	26,500	14	3.400	2,193. 38	-	-
华泰证券	202210 240008 1743	天合光 能	2022年 10月24 日	3,180,08 0.00	50,800	14	3.400	4,204. 76	-	-
华泰证券	202210 250002 2774	东方日 升	2022年 10月25 日	3,320,40 0.00	120,000	14	3.400	4,390. 26	-	-
华泰证券	202210 260000 0963	上能电 气	2022年 10月26 日	86,333.0 0	1,300	14	3.400	114.10	-	-
华泰证券	202210 260000 0965	海优新 材	2022年 10月26 日	167,760. 00	1,000	14	3.400	221.76	-	-
华泰证券	202210 260000 0967	奥特维	2022年 10月26 日	366,800. 00	1,000	14	3.400	484.96	-	-
华泰证券	202210 260000 0969	中信博	2022年 10月26 日	117,620. 00	1,000	14	3.400	155.54	-	-
华泰证券	202210 260000	固德威	2022年 10月26	370,260. 00	1,000	14	3.400	489.58	-	-

	0971		日							
华泰证券	202210 260000 0973	天合光 能	2022年 10月26 日	807,240. 00	12,000	14	3.400	1,067. 36	-	-
华泰证券	202210 260000 0975	金博股 份	2022年 10月26 日	243,500. 00	1,000	14	3.400	322.00	-	-
华泰证券	202210 260000 0977	捷佳伟 创	2022年 10月26 日	401,247. 00	2,700	14	3.400	530.60	-	-
华泰证券	202210 260000 0979	中来股 份	2022年 10月26 日	159,371. 00	9,700	14	3.400	240.80	-	-
华泰证券	202210 260000 0981	先导智 能	2022年 10月26 日	609,477. 00	12,100	14	3.400	805.84	-	-
华泰证券	202210 260000 0983	帝尔激 光	2022年 10月26 日	171,240. 00	1,000	14	3.400	226.38	-	-
华泰证券	202210 260000 0985	锦浪科 技	2022年 10月26 日	324,272. 00	1,600	14	3.400	428.82	-	-
华泰证券	202210 260000 0987	迈为股 份	2022年 10月26 日	480,500. 00	1,000	14	3.400	635.32	-	-
华泰证券	202210 260000 0989	晶盛机 电	2022年 10月26 日	545,351. 00	7,100	14	3.400	721.14	-	-
华泰证券	202210 260000 0991	阳光电 源	2022年 10月26 日	1,526,05 0.00	11,500	14	3.400	2,017. 82	-	-
华泰证券	202210 260000 0993	东方日 升	2022年 10月26 日	217,840. 00	8,000	14	3.400	287.98	-	-
华泰证券	202210 260000 0995	易成新 能	2022年 10月26 日	50,112.0 0	9,600	14	3.400	66.22	-	-
华泰证券	202211 070008 4009	固德威	2022年 11月7 日	17,370,0 00.00	45,000	14	3.200	21,616 .00	-	-
华泰证券	202211 070008 4025	海优新 材	2022年 11月7 日	431,616. 00	2,400	14	3.400	570.64	-	-
华泰证券	202211	晶盛机	2022年	2,314,83	30,200	14	3.400	3,060.	-	-

	070008 4027	电	11月7日	0.00				68		
华泰证券	202211 070008 4069	固德威	2022年 11月7日	17,370,000.00	45,000	14	3.200	21,616.00	-	-
华泰证券	202211 070008 4071	固德威	2022年 11月7日	810,600.00	2,100	14	3.400	1,071.84	-	-
华泰证券	202211 070008 4073	中信博	2022年 11月7日	482,410.00	3,800	14	3.400	637.84	-	-
华泰证券	202211 070008 4075	金博股份	2022年 11月7日	792,030.00	3,000	14	3.400	1,047.20	-	-
华泰证券	202211 070008 4195	晶盛机电	2022年 11月7日	1,203,405.00	15,700	14	3.400	1,591.10	-	-
华泰证券	202211 070008 9651	天合光能	2022年 11月7日	22,410,000.00	300,000	14	3.400	29,631.00	-	-
华泰证券	202211 070008 9653	金博股份	2022年 11月7日	7,920,300.00	30,000	14	3.400	10,472.42	-	-
华泰证券	202211 070008 9741	金博股份	2022年 11月7日	26,401,000.00	100,000	14	3.400	34,908.02	-	-
华泰证券	202211 070009 2079	阳光电源	2022年 11月7日	6,528,722.00	48,700	14	3.400	8,632.40	-	-
华泰证券	202211 070009 2081	阳光电源	2022年 11月7日	3,405,124.00	25,400	14	3.400	4,502.40	-	-
华泰证券	202211 070009 2181	天合光能	2022年 11月7日	1,979,550.00	26,500	14	3.400	2,617.44	-	-
华泰证券	202211 070009 2183	天合光能	2022年 11月7日	3,794,760.00	50,800	14	3.400	5,017.46	-	-
华泰证券	202211 070009 2247	天合光能	2022年 11月7日	37,350,000.00	500,000	28	3.400	98,770.00	-	-
华泰证券	202211 070009 5535	迈为股份	2022年 11月7日	865,555.00	1,700	14	3.400	1,144.50	-	-

华泰证券	202211 070009 5539	迈为股份	2022年 11月7 日	1,629,28 0.00	3,200	14	3.400	2,154. 32	-	-
华泰证券	202211 070009 5547	奥特维	2022年 11月7 日	663,100. 00	1,900	14	3.400	876.82	-	-
华泰证券	202211 070009 7961	晶盛机电	2022年 11月7 日	22,995,0 00.00	300,000	14	3.400	30,404 .50	-	-
华泰证券	202211 070009 7963	天合光能	2022年 11月7 日	17,928,0 00.00	240,000	14	3.400	23,704 .80	-	-
华泰证券	202211 070009 9361	东方日升	2022年 11月7 日	500,016. 00	17,600	14	3.400	661.08	-	-
华泰证券	202211 070009 9363	东方日升	2022年 11月7 日	960,258. 00	33,800	14	3.400	1,269. 66	-	-
华泰证券	202211 070010 2785	先导智能	2022年 11月7 日	1,425,76 0.00	26,800	14	3.400	1,885. 24	-	-
华泰证券	202211 080002 7855	东方日升	2022年 11月8 日	3,398,40 0.00	120,000	14	3.400	4,493. 44	-	-
华泰证券	202211 090001 8953	海优新材	2022年 11月9 日	172,500. 00	1,000	14	3.400	228.06	-	-
华泰证券	202211 090001 8955	奥特维	2022年 11月9 日	342,000. 00	1,000	14	3.400	452.20	-	-
华泰证券	202211 090001 8957	天合光能	2022年 11月9 日	854,520. 00	12,000	14	3.400	1,129. 80	-	-
华泰证券	202211 090001 9011	锦浪科技	2022年 11月9 日	334,416. 00	1,600	14	3.400	442.12	-	-
华泰证券	202211 090001 9019	易成新能	2022年 11月9 日	52,128.0 0	9,600	14	3.400	68.88	-	-
华泰证券	202211 090002 0587	迈为股份	2022年 11月9 日	511,010. 00	1,000	14	3.400	675.64	-	-
华泰证券	202211 090002	阳光电源	2022年 11月9	1,449,23 0.00	11,500	14	3.400	1,916. 18	-	-

	0589		日								
华泰证券	202211 090002 0645	上能电 气	2022年 11月9 日	82,550.0 0	1,300	14	3.400	109.20	-	-	
华泰证券	202211 090002 0647	中信博	2022年 11月9 日	123,740. 00	1,000	14	3.400	163.66	-	-	
华泰证券	202211 090002 0649	固德威	2022年 11月9 日	356,000. 00	1,000	14	3.400	470.68	-	-	
华泰证券	202211 090002 3701	金博股 份	2022年 11月9 日	258,530. 00	1,000	14	3.400	341.88	-	-	
华泰证券	202211 090002 3703	捷佳伟 创	2022年 11月9 日	384,750. 00	2,700	14	3.400	508.76	-	-	
华泰证券	202211 090002 3705	先导智 能	2022年 11月9 日	618,310. 00	12,100	14	3.400	817.60	-	-	
华泰证券	202211 090002 3707	东方日 升	2022年 11月9 日	224,000. 00	8,000	14	3.400	296.24	-	-	
华泰证券	202211 090002 3709	晶盛机 电	2022年 11月9 日	520,998. 00	7,100	14	3.400	688.94	-	-	
华泰证券	202211 090002 3715	帝尔激 光	2022年 11月9 日	167,100. 00	1,000	14	3.400	220.92	-	-	
华泰证券	202211 110001 4031	中来股 份	2022年 11月11 日	168,392. 00	9,700	14	3.400	222.60	-	-	
华泰证券	202211 140000 0826	上能电 气	2022年 11月14 日	3,108,98 9.00	53,300	14	3.400	4,110. 82	-	-	
华泰证券	202211 140000 0828	中来股 份	2022年 11月14 日	971,850. 00	58,900	14	3.400	1,285. 06	-	-	
华泰证券	202211 140000 0830	中信博	2022年 11月14 日	1,317,20 6.00	12,100	14	3.400	1,741. 60	-	-	
华泰证券	202211 140000 0832	捷佳伟 创	2022年 11月14 日	7,912,17 0.00	63,000	14	3.400	10,461 .64	-	-	
华泰证券	202211	金博股	2022年	992,200.	4,100	14	3.400	1,311.	-	-	

	140000 0834	份	11月14 日	00				94		
华泰证券	202211 140000 0836	海优新材	2022年 11月14 日	1,665,88 3.00	10,700	14	3.400	2,202. 62	-	-
华泰证券	202211 140000 0838	东方日升	2022年 11月14 日	1,719,96 0.00	66,000	14	3.400	2,274. 16	-	-
华泰证券	202211 140000 0840	奥特维	2022年 11月14 日	312,870. 00	1,000	14	3.400	413.70	-	-
华泰证券	202211 210006 5156	金博股份	2022年 11月21 日	26,200,0 00.00	100,000	14	3.400	34,642 .16	-	-
华泰证券	202211 210006 5166	中信博	2022年 11月21 日	404,282. 00	3,800	14	3.400	534.52	-	-
华泰证券	202211 210006 5168	金博股份	2022年 11月21 日	786,000. 00	3,000	14	3.400	1,039. 22	-	-
华泰证券	202211 210006 6600	海优新材	2022年 11月21 日	354,960. 00	2,400	14	3.400	469.28	-	-
华泰证券	202211 210006 6892	固德威	2022年 11月21 日	14,895,0 00.00	45,000	14	3.200	18,536 .00	-	-
华泰证券	202211 210006 6944	固德威	2022年 11月21 日	14,895,0 00.00	45,000	14	3.200	18,536 .00	-	-
华泰证券	202211 210006 6946	固德威	2022年 11月21 日	695,100. 00	2,100	14	3.400	919.10	-	-
华泰证券	202211 210006 6998	东方日升	2022年 11月21 日	470,272. 00	17,600	14	3.400	621.74	-	-
华泰证券	202211 210006 7000	东方日升	2022年 11月21 日	903,136. 00	33,800	14	3.400	1,194. 20	-	-
华泰证券	202211 210006 8254	晶盛机电	2022年 11月21 日	2,064,47 2.00	30,200	14	3.400	2,729. 72	-	-
华泰证券	202211 210007 2064	迈为股份	2022年 11月21 日	1,462,84 8.00	3,200	14	3.400	1,934. 24	-	-

华泰证券	202211 210007 2074	奥特维	2022年 11月21 日	588,943. 00	1,900	14	3.400	778.68	-	-
华泰证券	202211 210007 4098	迈为股 份	2022年 11月21 日	777,138. 00	1,700	14	3.400	1,027. 60	-	-
华泰证券	202211 210007 4204	晶盛机 电	2022年 11月21 日	1,073,25 2.00	15,700	14	3.400	1,419. 04	-	-
华泰证券	202211 210007 4362	先导智 能	2022年 11月21 日	1,246,73 6.00	26,800	14	3.400	1,648. 50	-	-
华泰证券	202211 210007 8976	阳光电 源	2022年 11月21 日	5,590,76 0.00	48,700	14	3.400	7,392. 28	-	-
华泰证券	202211 210007 8978	阳光电 源	2022年 11月21 日	2,915,92 0.00	25,400	14	3.400	3,855. 46	-	-
华泰证券	202211 210007 9032	天合光 能	2022年 11月21 日	1,733,36 5.00	26,500	14	3.400	2,291. 94	-	-
华泰证券	202211 210007 9034	天合光 能	2022年 11月21 日	3,322,82 8.00	50,800	14	3.400	4,393. 48	-	-
华泰证券	202211 210007 9326	天合光 能	2022年 11月21 日	15,698,4 00.00	240,000	14	3.400	20,756 .82	-	-
华泰证券	202211 220000 0543	锦浪科 技	2022年 11月22 日	1,036,58 4.00	5,400	14	3.400	1,370. 60	-	-
华泰证券	202211 220000 0552	上能电 气	2022年 11月22 日	152,118. 00	2,700	14	3.400	201.18	-	-
华泰证券	202211 220000 0555	帝尔激 光	2022年 11月22 日	360,180. 00	2,700	14	3.400	476.28	-	-
华泰证券	202211 220000 0561	金博股 份	2022年 11月22 日	1,362,31 2.00	5,400	14	3.400	1,801. 24	-	-
华泰证券	202211 220000 0589	迈为股 份	2022年 11月22 日	1,203,28 2.00	2,700	14	3.400	1,590. 96	-	-
华泰证券	202211 220000	先导智 能	2022年 11月22	1,458,00 0.00	32,400	14	3.400	1,927. 80	-	-

	0590		日								
华泰证券	202211 220000 0591	晶盛机 电	2022年 11月22 日	1,254,96 0.00	18,900	14	3.400	1,659. 28	-	-	
华泰证券	202211 220000 0593	捷佳伟 创	2022年 11月22 日	1,041,49 8.00	8,100	14	3.400	1,377. 04	-	-	
华泰证券	202211 220000 0595	东方日 升	2022年 11月22 日	554,256. 00	21,600	14	3.400	732.90	-	-	
华泰证券	202211 220000 0597	阳光电 源	2022年 11月22 日	3,592,51 2.00	32,400	14	3.400	4,750. 06	-	-	
华泰证券	202211 220000 0598	易成新 能	2022年 11月22 日	138,780. 00	27,000	14	3.400	183.54	-	-	
华泰证券	202211 220000 0600	中来股 份	2022年 11月22 日	428,220. 00	27,000	14	3.400	566.16	-	-	
华泰证券	202211 220001 6053	东方日 升	2022年 11月22 日	3,079,20 0.00	120,000	14	3.400	4,071. 34	-	-	
华泰证券	202211 230001 4746	海优新 材	2022年 11月23 日	145,880. 00	1,000	14	3.400	192.92	-	-	
华泰证券	202211 230001 4816	奥特维	2022年 11月23 日	211,500. 00	1,000	14	3.400	279.72	-	-	
华泰证券	202211 230001 4914	捷佳伟 创	2022年 11月23 日	361,611. 00	2,700	14	3.400	478.10	-	-	
华泰证券	202211 230001 5906	晶盛机 电	2022年 11月23 日	490,042. 00	7,100	14	3.400	647.92	-	-	
华泰证券	202211 230001 5924	阳光电 源	2022年 11月23 日	1,354,81 5.00	11,500	14	3.400	1,791. 30	-	-	
华泰证券	202211 230001 5930	迈为股 份	2022年 11月23 日	451,900. 00	1,000	14	3.400	597.52	-	-	
华泰证券	202211 230001 6056	锦浪科 技	2022年 11月23 日	323,008. 00	1,600	14	3.400	427.14	-	-	
华泰证券	202211	先导智	2022年	548,251.	12,100	14	3.400	724.92	-	-	

	230001 6112	能	11月23 日	00						
华泰证券	202211 230001 6132	金博股 份	2022年 11月23 日	268,990. 00	1,000	14	3.400	355.60	-	-
华泰证券	202211 230001 6134	中信博	2022年 11月23 日	105,690. 00	1,000	14	3.400	139.72	-	-
华泰证券	202211 230001 6136	天合光 能	2022年 11月23 日	795,240. 00	12,000	14	3.400	1,051. 54	-	-
华泰证券	202211 230001 7666	上能电 气	2022年 11月23 日	79,053.0 0	1,300	14	3.400	104.58	-	-
华泰证券	202211 230001 7688	固德威	2022年 11月23 日	339,680. 00	1,000	14	3.400	449.12	-	-
华泰证券	202211 230001 8126	帝尔激 光	2022年 11月23 日	138,400. 00	1,000	14	3.400	182.98	-	-
华泰证券	202211 230001 8160	东方日 升	2022年 11月23 日	212,640. 00	8,000	14	3.400	281.12	-	-
华泰证券	202211 230001 8212	易成新 能	2022年 11月23 日	49,920.0 0	9,600	14	3.400	65.94	-	-
华泰证券	202211 250000 9672	中来股 份	2022年 11月25 日	151,223. 00	9,700	14	3.400	199.92	-	-
华泰证券	202211 280000 6201	中信博	2022年 11月28 日	1,115,37 8.00	12,100	14	3.400	1,474. 76	-	-
华泰证券	202211 280000 6205	上能电 气	2022年 11月28 日	3,059,95 3.00	53,300	14	3.400	4,046. 00	-	-
华泰证券	202211 280000 6219	东方日 升	2022年 11月28 日	1,698,18 0.00	66,000	14	3.400	2,245. 32	-	-
华泰证券	202211 280000 6239	中来股 份	2022年 11月28 日	928,853. 00	58,900	14	3.400	1,228. 22	-	-
华泰证券	202211 280000 6269	捷佳伟 创	2022年 11月28 日	8,207,64 0.00	63,000	14	3.400	10,852 .38	-	-

华泰证券	202211 280000 6271	奥特维	2022年 11月28 日	199,010. 00	1,000	14	3.400	263.20	-	-
华泰证券	202211 280000 6301	金博股 份	2022年 11月28 日	1,066,73 8.00	4,100	14	3.400	1,410. 50	-	-
华泰证券	202211 280000 6303	海优新 材	2022年 11月28 日	1,465,15 1.00	10,700	14	3.400	1,937. 32	-	-
华泰证券	202212 020000 1055	晶盛机 电	2022年 12月2 日	1,924,34 4.00	30,200	14	3.400	2,544. 36	-	-
华泰证券	202212 020000 1057	固德威	2022年 12月2 日	722,379. 00	2,100	14	3.400	955.08	-	-
华泰证券	202212 020000 1059	迈为股 份	2022年 12月2 日	1,444,76 8.00	3,200	14	3.400	1,910. 30	-	-
华泰证券	202212 020000 1060	阳光电 源	2022年 12月2 日	5,848,38 3.00	48,700	14	3.400	7,732. 90	-	-
华泰证券	202212 020000 1063	中信博	2022年 12月2 日	347,966. 00	3,800	14	3.400	460.04	-	-
华泰证券	202212 020000 1065	奥特维	2022年 12月2 日	576,800. 00	2,800	14	3.400	762.72	-	-
华泰证券	202212 020000 1067	金博股 份	2022年 12月2 日	800,400. 00	3,000	14	3.400	1,058. 26	-	-
华泰证券	202212 020000 1069	天合光 能	2022年 12月2 日	3,419,34 8.00	50,800	14	3.400	4,521. 16	-	-
华泰证券	202212 020000 1071	海优新 材	2022年 12月2 日	376,488. 00	2,400	14	3.400	497.84	-	-
华泰证券	202212 020000 1073	东方日 升	2022年 12月2 日	919,360. 00	33,800	14	3.400	1,215. 62	-	-
华泰证券	202212 050002 0728	固德威	2022年 12月5 日	14,085,0 00.00	45,000	14	3.200	17,528 .00	-	-
华泰证券	202212 050002	金博股 份	2022年 12月5 日	26,078,0 00.00	100,000	14	3.400	34,480 .88	-	-

	3652		日							
华泰证券	202212 050002 3746	天合光 能	2022年 12月5 日	32,335,0 00.00	500,000	28	3.400	79,400 .36	31,880 ,000.0 0	79,400. 36
华泰证券	202212 050002 5312	天合光 能	2022年 12月5 日	15,520,8 00.00	240,000	14	3.400	20,521 .90		-
华泰证券	202212 050002 6510	固德威	2022年 12月5 日	14,085,0 00.00	45,000	14	3.200	17,528 .00		-
华泰证券	202212 060001 1516	阳光电 源	2022年 12月6 日	3,415,28 4.00	32,400	14	3.400	4,515. 70		-
华泰证券	202212 060001 1518	中来股 份	2022年 12月6 日	432,270. 00	27,000	14	3.400	571.62		-
华泰证券	202212 060001 3364	帝尔激 光	2022年 12月6 日	347,544. 00	2,700	14	3.400	459.48		-
华泰证券	202212 060001 3366	迈为股 份	2022年 12月6 日	1,242,00 0.00	2,700	14	3.400	1,642. 20		-
华泰证券	202212 060001 3382	锦浪科 技	2022年 12月6 日	1,015,36 2.00	5,400	14	3.400	1,342. 60		-
华泰证券	202212 060001 3386	金博股 份	2022年 12月6 日	1,424,89 8.00	5,400	14	3.400	1,883. 98		-
华泰证券	202212 060001 3390	东方日 升	2022年 12月6 日	566,352. 00	21,600	14	3.400	748.86		-
华泰证券	202212 060001 3392	晶盛机 电	2022年 12月6 日	1,274,04 9.00	18,900	14	3.400	1,684. 62		-
华泰证券	202212 060001 3482	东方日 升	2022年 12月6 日	3,146,40 0.00	120,000	14	3.400	4,160. 24		-
华泰证券	202212 060001 3886	捷佳伟 创	2022年 12月6 日	958,311. 00	8,100	14	3.400	1,267. 14		-
华泰证券	202212 070000 9564	捷佳伟 创	2022年 12月7 日	320,625. 00	2,700	14	3.400	423.92		-
华泰证券	202212	金博股	2022年	268,220.	1,000	14	3.400	354.62		-

	070000 9580	份	12月7日	00						
华泰证券	202212 070000 9582	天合光能	2022年 12月7日	690,600.00	12,000	14	3.400	913.08	-	-
华泰证券	202212 070000 9588	海优新材	2022年 12月7日	158,010.00	1,000	14	3.400	208.88	-	-
华泰证券	202212 070000 9590	晶盛机电	2022年 12月7日	497,000.00	7,100	14	3.400	657.16	-	-
华泰证券	202212 070000 9600	固德威	2022年 12月7日	309,700.00	1,000	14	3.400	409.50	-	-
华泰证券	202212 070000 9602	中信博	2022年 12月7日	86,980.00	1,000	14	3.400	114.94	-	-
华泰证券	202212 070000 9604	奥特维	2022年 12月7日	201,640.00	1,000	14	3.400	266.56	-	-
华泰证券	202212 070000 9610	迈为股份	2022年 12月7日	462,000.00	1,000	14	3.400	610.82	-	-
华泰证券	202212 070000 9612	锦浪科技	2022年 12月7日	307,792.00	1,600	14	3.400	406.98	-	-
华泰证券	202212 070000 9614	帝尔激光	2022年 12月7日	129,080.00	1,000	14	3.400	170.66	-	-
华泰证券	202212 070000 9690	东方日升	2022年 12月7日	207,600.00	8,000	14	3.400	274.54	-	-
华泰证券	202212 070000 9700	阳光电源	2022年 12月7日	1,220,495.00	11,500	14	3.400	1,613.78	-	-
华泰证券	202212 090000 5844	中来股份	2022年 12月9日	162,863.00	9,700	14	3.400	215.32	-	-
华泰证券	202212 120003 7597	捷佳伟创	2022年 12月12日	7,501,410.00	63,000	14	3.400	9,918.58	-	-
华泰证券	202212 120003 7621	东方日升	2022年 12月12日	1,720,620.00	66,000	14	3.400	2,275.00	-	-

华泰证券	202212 120003 7627	中来股份	2022年 12月12 日	934,154. 00	58,900	14	3.400	1,235. 22	-	-
华泰证券	202212 120003 7671	中信博	2022年 12月12 日	1,047,86 0.00	12,100	14	3.400	1,385. 44	-	-
华泰证券	202212 120003 7673	奥特维	2022年 12月12 日	195,160. 00	1,000	14	3.400	258.02	-	-
华泰证券	202212 120003 7675	金博股份	2022年 12月12 日	1,060,54 7.00	4,100	14	3.400	1,402. 24	-	-
华泰证券	202212 120003 7677	海优新材	2022年 12月12 日	1,716,60 1.00	10,700	14	3.400	2,269. 68	-	-
华泰证券	202212 160000 1786	金博股份	2022年 12月16 日	23,960,0 00.00	100,000	14	3.400	31,680 .46	-	-
华泰证券	202212 160000 1796	锦浪科技	2022年 12月16 日	70,304,0 00.00	416,000	14	3.400	92,957 .48	-	-
华泰证券	202212 160001 1099	固德威	2022年 12月16 日	612,612. 00	2,100	14	3.400	810.04	-	-
华泰证券	202212 160001 1101	天合光能	2022年 12月16 日	2,791,46 0.00	50,800	14	3.400	3,690. 96	-	-
华泰证券	202212 160001 1105	东方日升	2022年 12月16 日	797,342. 00	33,800	14	3.400	1,054. 20	-	-
华泰证券	202212 160001 1109	晶盛机电	2022年 12月16 日	2,098,90 0.00	30,200	14	3.400	2,775. 22	-	-
华泰证券	202212 160001 1111	阳光电源	2022年 12月16 日	4,772,60 0.00	48,700	14	3.400	6,310. 50	-	-
华泰证券	202212 160001 1115	迈为股份	2022年 12月16 日	1,325,31 2.00	3,200	14	3.400	1,752. 38	-	-
华泰证券	202212 160001 1505	中信博	2022年 12月16 日	309,206. 00	3,800	14	3.400	408.80	-	-
华泰证券	202212 160001	奥特维	2022年 12月16	531,972. 00	2,800	14	3.400	703.36	-	-

	1507		日							
华泰证券	202212 160001 1509	金博股 份	2022年 12月16 日	718,800. 00	3,000	14	3.400	950.46	-	-
华泰证券	202212 160001 1513	海优新 材	2022年 12月16 日	368,904. 00	2,400	14	3.400	487.76	-	-
华泰证券	202212 190002 0478	固德威	2022年 12月19 日	13,179,1 50.00	45,000	14	3.200	14,057 .76	14,539 ,050.0 0	14,057. 76
华泰证券	202212 190002 0634	天合光 能	2022年 12月19 日	13,202,4 00.00	240,000	14	3.400	14,962 .68	15,302 ,400.0 0	14,962. 68
华泰证券	202212 190002 2792	固德威	2022年 12月19 日	13,179,1 50.00	45,000	14	3.200	14,057 .76	14,539 ,050.0 0	14,057. 76
华泰证券	202212 200002 0172	锦浪科 技	2022年 12月20 日	902,880. 00	5,400	14	3.400	937.97	972,27 0.00	937.97
华泰证券	202212 200002 0176	帝尔激 光	2022年 12月20 日	326,619. 00	2,700	14	3.400	339.35	340,20 0.00	339.35
华泰证券	202212 200002 0180	东方日 升	2022年 12月20 日	530,280. 00	21,600	14	3.400	550.88	536,11 2.00	550.88
华泰证券	202212 200002 0182	东方日 升	2022年 12月20 日	2,946,00 0.00	120,000	14	3.400	3,060. 53	2,978, 400.00	3,060.5 3
华泰证券	202212 200002 0456	金博股 份	2022年 12月20 日	1,259,87 4.00	5,400	14	3.400	1,308. 89	1,185, 192.00	1,308.8 9
华泰证券	202212 200002 0468	阳光电 源	2022年 12月20 日	3,147,66 0.00	32,400	14	3.400	3,270. 08	3,622, 320.00	3,270.0 8
华泰证券	202212 200002 0476	晶盛机 电	2022年 12月20 日	1,288,98 0.00	18,900	14	3.400	1,339. 14	1,201, 284.00	1,339.1 4
华泰证券	202212 200002 0482	中来股 份	2022年 12月20 日	400,950. 00	27,000	14	3.400	416.57	400,14 0.00	416.57
华泰证券	202212 200002 0530	捷佳伟 创	2022年 12月20 日	909,387. 00	8,100	14	3.400	944.79	923,56 2.00	944.79
华泰证券	202212	迈为股	2022年	1,123,06	2,700	14	3.400	1,166.	1,111,	1,166.7

	200002 0540	份	12月20 日	5.00				77	968.00	7
华泰证券	202212 210000 2419	东方日 升	2022年 12月21 日	2,852,40 0.00	120,000	14	3.400	2,693. 90	2,978, 400.00	2,693.9 0
华泰证券	202212 210002 0657	金博股 份	2022年 12月21 日	227,500. 00	1,000	14	3.400	214.90	219,48 0.00	214.90
华泰证券	202212 210002 0659	天合光 能	2022年 12月21 日	643,800. 00	12,000	14	3.400	608.00	765,12 0.00	608.00
华泰证券	202212 210002 0663	固德威	2022年 12月21 日	285,690. 00	1,000	14	3.400	269.80	323,09 0.00	269.80
华泰证券	202212 210002 0665	中信博	2022年 12月21 日	79,460.0 0	1,000	14	3.400	75.00	98,400 .00	75.00
华泰证券	202212 210002 0667	奥特维	2022年 12月21 日	189,610. 00	1,000	14	3.400	179.10	201,00 0.00	179.10
华泰证券	202212 210002 0669	海优新 材	2022年 12月21 日	149,190. 00	1,000	14	3.400	140.90	185,30 0.00	140.90
华泰证券	202212 210002 0671	晶盛机 电	2022年 12月21 日	465,192. 00	7,100	14	3.400	439.30	451,27 6.00	439.30
华泰证券	202212 210002 0673	迈为股 份	2022年 12月21 日	405,600. 00	1,000	14	3.400	383.10	411,84 0.00	383.10
华泰证券	202212 210002 0675	锦浪科 技	2022年 12月21 日	264,592. 00	1,600	14	3.400	249.90	288,08 0.00	249.90
华泰证券	202212 210002 0677	帝尔激 光	2022年 12月21 日	118,940. 00	1,000	14	3.400	112.30	126,00 0.00	112.30
华泰证券	202212 210002 0687	阳光电 源	2022年 12月21 日	1,098,02 0.00	11,500	14	3.400	1,037. 00	1,285, 700.00	1,037.0 0
华泰证券	202212 210002 0689	东方日 升	2022年 12月21 日	190,160. 00	8,000	14	3.400	179.60	198,56 0.00	179.60
华泰证券	202212 210002 0691	捷佳伟 创	2022年 12月21 日	294,570. 00	2,700	14	3.400	278.20	307,85 4.00	278.20

华泰证券	202212 220000 0225	东方日 升	2022年 12月22 日	372,280. 00	16,400	14	3.400	316.44	407,04 8.00	316.44
华泰证券	202212 220000 0227	高测股 份	2022年 12月22 日	296,058. 00	4,200	14	3.400	251.64	315,08 4.00	251.64
华泰证券	202212 220000 0229	金博股 份	2022年 12月22 日	370,600. 00	1,700	14	3.400	315.00	373,11 6.00	315.00
华泰证券	202212 220000 0233	奥特维	2022年 12月22 日	324,000. 00	1,800	14	3.400	275.40	361,80 0.00	275.40
华泰证券	202212 220000 0237	帝尔激 光	2022年 12月22 日	229,720. 00	2,000	14	3.400	195.30	252,00 0.00	195.30
华泰证券	202212 220000 0239	海优新 材	2022年 12月22 日	172,824. 00	1,200	14	3.400	146.88	222,36 0.00	146.88
华泰证券	202212 220000 0240	锦浪科 技	2022年 12月22 日	699,180. 00	4,300	14	3.400	594.27	774,21 5.00	594.27
华泰证券	202212 220000 0243	天合光 能	2022年 12月22 日	1,385,25 0.00	25,000	14	3.400	1,177. 47	1,594, 000.00	1,177.4 7
华泰证券	202212 220000 0245	中信博	2022年 12月22 日	157,168. 00	1,900	14	3.400	133.56	186,96 0.00	133.56
华泰证券	202212 220000 0247	美畅股 份	2022年 12月22 日	207,636. 00	4,400	14	3.400	176.49	216,30 4.00	176.49
华泰证券	202212 220000 0249	铭利达	2022年 12月22 日	44,210.0 0	1,000	14	3.400	37.62	50,210 .00	37.62
华泰证券	202212 220000 0251	迈为股 份	2022年 12月22 日	792,000. 00	2,000	14	3.400	673.20	823,68 0.00	673.20
华泰证券	202212 220000 0253	晶盛机 电	2022年 12月22 日	915,060. 00	15,100	14	3.400	777.78	959,75 6.00	777.78
华泰证券	202212 220000 0254	固德威	2022年 12月22 日	474,028. 00	1,700	14	3.400	402.93	549,25 3.00	402.93
华泰证券	202212 220000	大全能 源	2022年 12月22	330,579. 00	6,900	14	3.400	280.98	328,99 2.00	280.98

	0257		日							
华泰证券	202212 220000 0259	阳光电源	2022年 12月22 日	2,260,560.00	24,000	14	3.400	1,921.50	2,683,200.00	1,921.50
华泰证券	202212 220000 0261	易事特	2022年 12月22 日	181,972.00	26,800	14	3.400	154.71	183,044.00	154.71
华泰证券	202212 220000 0262	捷佳伟创	2022年 12月22 日	668,160.00	6,400	14	3.400	567.90	729,728.00	567.90
华泰证券	202212 220000 0265	中来股份	2022年 12月22 日	269,943.00	20,100	14	3.400	229.41	297,882.00	229.41
华泰证券	202212 230000 8316	中来股份	2022年 12月23 日	133,569.00	9,700	14	3.400	100.88	143,754.00	100.88
华泰证券	202212 260002 5075	金博股份	2022年 12月26 日	904,009.00	4,100	14	3.400	426.90	899,868.00	426.90
华泰证券	202212 260002 6231	东方日升	2022年 12月26 日	1,584,000.00	66,000	14	3.400	748.00	1,638,120.00	748.00
华泰证券	202212 260002 6263	中来股份	2022年 12月26 日	854,639.00	58,900	14	3.400	403.60	872,898.00	403.60
华泰证券	202212 260002 6349	捷佳伟创	2022年 12月26 日	6,942,600.00	63,000	14	3.400	3,278.45	7,183,260.00	3,278.45
华泰证券	202212 260002 6725	中信博	2022年 12月26 日	1,114,652.00	12,100	14	3.400	526.35	1,190,640.00	526.35
华泰证券	202212 260002 6729	奥特维	2022年 12月26 日	192,000.00	1,000	14	3.400	90.65	201,000.00	90.65
华泰证券	202212 260002 6737	海优新材	2022年 12月26 日	1,875,924.00	10,700	14	3.400	885.85	1,982,710.00	885.85
华泰证券	202212 300001 0605	固德威	2022年 12月30 日	678,489.00	2,100	14	3.400	64.08	678,489.00	64.08
华泰证券	202212 300001 0607	东方日升	2022年 12月30 日	838,916.00	33,800	14	3.400	79.23	838,916.00	79.23
华泰证券	202212	晶盛机	2022年	1,919,51	30,200	14	3.400	181.29	1,919,	181.29

	300001 0609	电	12月30 日	2.00					512.00	
华泰证券	202212 300001 0617	奥特维	2022年 12月30 日	562,800. 00	2,800	14	3.400	53.15	562,80 0.00	53.15
华泰证券	202212 300001 2041	天合光 能	2022年 12月30 日	3,239,00 8.00	50,800	14	3.400	305.91	3,239, 008.00	305.91
华泰证券	202212 300001 2043	阳光电 源	2022年 12月30 日	5,444,66 0.00	48,700	14	3.400	514.22	5,444, 660.00	514.22
华泰证券	202212 300001 2045	迈为股 份	2022年 12月30 日	1,317,88 8.00	3,200	14	3.400	124.47	1,317, 888.00	124.47
华泰证券	202212 300001 2061	中信博	2022年 12月30 日	373,920. 00	3,800	14	3.400	35.31	373,92 0.00	35.31
华泰证券	202212 300001 2063	金博股 份	2022年 12月30 日	658,440. 00	3,000	14	3.400	62.19	658,44 0.00	62.19
华泰证券	202212 300001 2065	海优新 材	2022年 12月30 日	444,720. 00	2,400	14	3.400	42.00	444,72 0.00	42.00
华泰证券	202212 300001 2157	金博股 份	2022年 12月30 日	21,948,0 00.00	100,000	14	3.400	2,072. 87	21,948 ,000.0 0	2,072.8 7
华泰证券	202212 300001 2161	锦浪科 技	2022年 12月30 日	74,900,8 00.00	416,000	14	3.400	7,073. 96	74,900 ,800.0 0	7,073.9 6
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	202106 230000 0992	先导智 能	2021年 6月23 日	1,008,72 9.00	17,100	14	3.400	1,333. 78	-	-
华泰证券	202106 230000 1052	晶盛机 电	2021年 6月23 日	499,200. 00	10,400	14	3.400	660.10	-	-
华泰证券	202106 230000	东方日 升	2021年 6月23	187,920. 00	12,000	14	3.400	248.50	-	-

	1088		日							
华泰证券	202106 230000 1090	阳光电 源	2021年 6月23 日	1,937,25 0.00	18,900	14	3.400	2,561. 44	-	-
华泰证券	202106 240000 0686	先导智 能	2021年 6月24 日	13,440,0 00.00	240,000	14	3.400	17,770 .62	-	-
华泰证券	202106 240000 0688	阳光电 源	2021年 6月24 日	9,621,90 0.00	90,000	14	3.400	12,722 .36	-	-
华泰证券	202106 250000 0482	东方日 升	2021年 6月25 日	11,074,0 50.00	631,000	14	3.400	14,642 .32	-	-
华泰证券	202107 070000 1677	晶盛机 电	2021年 7月7日	1,212,68 0.00	24,400	14	3.400	1,603. 42	-	-
华泰证券	202107 070000 1679	阳光电 源	2021年 7月7日	3,630,84 0.00	31,600	14	3.400	4,800. 74	-	-
华泰证券	202107 070001 5931	东方日 升	2021年 7月7日	243,120. 00	12,000	14	3.400	321.44	-	-
华泰证券	202107 080000 7655	先导智 能	2021年 7月8日	15,398,4 00.00	240,000	14	3.400	20,360 .06	-	-
华泰证券	202107 080000 7657	阳光电 源	2021年 7月8日	10,651,5 00.00	90,000	14	3.400	14,083 .72	-	-
华泰证券	202107 090000 5627	东方日 升	2021年 7月9日	13,118,4 90.00	631,000	14	3.400	17,345 .58	-	-
华泰证券	202107 140000 0526	阳光电 源	2021年 7月14 日	36,306,0 00.00	300,000	14	3.400	48,004 .60	-	-
华泰证券	202107 190000 0694	迈为股 份	2021年 7月19 日	2,221,02 0.00	4,500	14	3.400	2,936. 64	-	-
华泰证券	202107 200000 1091	先导智 能	2021年 7月20 日	1,719,90 0.00	27,000	14	3.400	2,274. 16	-	-
华泰证券	202107 200000 1093	晶盛机 电	2021年 7月20 日	984,010. 00	19,000	14	3.400	1,301. 02	-	-
华泰证券	202107	阳光电	2021年	3,404,70	27,000	14	3.400	4,501.	-	-

	200000 1095	源	7月20 日	0.00				84		
华泰证券	202107 210001 6719	晶盛机 电	2021年 7月21 日	1,338,34 0.00	24,400	14	3.400	1,769. 60	-	-
华泰证券	202107 210001 6721	阳光电 源	2021年 7月21 日	4,360,16 8.00	31,600	14	3.400	5,765. 06	-	-
华泰证券	202107 210001 9899	东方日 升	2021年 7月21 日	229,440. 00	12,000	14	3.400	303.38	-	-
华泰证券	202107 220000 8010	阳光电 源	2021年 7月22 日	12,874,5 00.00	90,000	14	3.400	17,023 .02	-	-
华泰证券	202107 220000 8012	先导智 能	2021年 7月22 日	15,960,0 00.00	240,000	14	3.400	21,102 .62	-	-
华泰证券	202107 230000 6205	东方日 升	2021年 7月23 日	13,074,3 20.00	631,000	14	3.400	17,287 .20	-	-
华泰证券	202107 260000 0854	迈为股 份	2021年 7月26 日	1,203,30 0.00	2,100	14	3.400	1,591. 10	-	-
华泰证券	202107 260000 0856	东方日 升	2021年 7月26 日	610,500. 00	30,000	14	3.400	807.24	-	-
华泰证券	202107 280000 8070	阳光电 源	2021年 7月28 日	39,231,0 00.00	300,000	14	3.400	51,872 .10	-	-
华泰证券	202108 020001 3794	迈为股 份	2021年 8月2日	2,809,57 5.00	4,500	14	3.400	3,714. 90	-	-
华泰证券	202108 030001 2770	晶盛机 电	2021年 8月3日	1,236,52 0.00	19,000	14	3.400	1,634. 92	-	-
华泰证券	202108 030001 2772	先导智 能	2021年 8月3日	2,079,00 0.00	27,000	14	3.400	2,748. 90	-	-
华泰证券	202108 030001 2774	阳光电 源	2021年 8月3日	3,887,46 0.00	27,000	14	3.400	5,140. 10	-	-
华泰证券	202108 040000 0893	东方日 升	2021年 8月4日	330,400. 00	16,000	14	3.400	436.80	-	-

华泰证券	202108 040001 8392	阳光电 源	2021年 8月4日	4,844,28 0.00	31,600	14	3.400	6,405. 28	-	-
华泰证券	202108 040001 8394	东方日 升	2021年 8月4日	247,800. 00	12,000	14	3.400	327.60	-	-
华泰证券	202108 040001 8396	晶盛机 电	2021年 8月4日	1,639,68 0.00	24,400	14	3.400	2,168. 04	-	-
华泰证券	202108 050000 9011	先导智 能	2021年 8月5日	18,624,0 00.00	240,000	14	3.400	24,625 .02	-	-
华泰证券	202108 050001 0415	阳光电 源	2021年 8月5日	13,887,9 00.00	90,000	14	3.400	18,362 .96	-	-
华泰证券	202108 060000 7592	东方日 升	2021年 8月6日	13,888,3 10.00	631,000	14	3.400	18,363 .38	-	-
华泰证券	202108 090000 4772	东方日 升	2021年 8月9日	666,000. 00	30,000	14	3.400	880.60	-	-
华泰证券	202108 090000 4774	迈为股 份	2021年 8月9日	1,522,05 9.00	2,100	14	3.400	2,012. 50	-	-
华泰证券	202108 100000 0496	东方日 升	2021年 8月10 日	43,960.0 0	2,000	14	3.400	58.10	-	-
华泰证券	202108 110001 0758	阳光电 源	2021年 8月11 日	45,936,0 00.00	300,000	14	3.400	60,737 .60	-	-
华泰证券	202108 120000 0324	迈为股 份	2021年 8月12 日	721,090. 00	1,000	14	3.400	953.40	-	-
华泰证券	202108 130000 0521	迈为股 份	2021年 8月13 日	908,453. 00	1,300	14	3.400	1,201. 20	-	-
华泰证券	202108 020000 0456	迈为股 份	2021年 8月2日	31,217,5 00.00	50,000	28	3.400	82,552 .96	-	-
华泰证券	202108 160000 0526	迈为股 份	2021年 8月16 日	857,428. 00	1,300	14	3.400	1,133. 72	-	-
华泰证券	202108 160000	东方日 升	2021年 8月16	20,670.0 0	1,000	14	3.400	27.30	-	-

	0528		日							
华泰证券	202108 160001 3629	迈为股 份	2021年 8月16 日	2,968,02 0.00	4,500	14	3.400	3,924. 34	-	-
华泰证券	202108 170001 2898	晶盛机 电	2021年 8月17 日	1,128,22 0.00	19,000	14	3.400	1,491. 70	-	-
华泰证券	202108 170001 2900	阳光电 源	2021年 8月17 日	3,906,90 0.00	27,000	14	3.400	5,165. 86	-	-
华泰证券	202108 170001 2902	先导智 能	2021年 8月17 日	1,969,65 0.00	27,000	14	3.400	2,604. 28	-	-
华泰证券	202108 180001 8564	东方日 升	2021年 8月18 日	319,360. 00	16,000	14	3.400	422.24	-	-
华泰证券	202108 180001 8566	东方日 升	2021年 8月18 日	239,520. 00	12,000	14	3.400	316.68	-	-
华泰证券	202108 180001 8568	阳光电 源	2021年 8月18 日	4,250,20 0.00	31,600	14	3.400	5,619. 74	-	-
华泰证券	202108 180001 8570	晶盛机 电	2021年 8月18 日	1,439,60 0.00	24,400	14	3.400	1,903. 44	-	-
华泰证券	202108 190001 1529	阳光电 源	2021年 8月19 日	12,345,3 00.00	90,000	14	3.400	16,323 .30	-	-
华泰证券	202108 200000 8412	东方日 升	2021年 8月20 日	13,068,0 10.00	631,000	14	3.400	17,278 .80	-	-
华泰证券	202108 230000 7671	东方日 升	2021年 8月23 日	653,400. 00	30,000	14	3.400	863.94	-	-
华泰证券	202108 230000 7673	迈为股 份	2021年 8月23 日	1,574,76 9.00	2,100	14	3.400	2,082. 22	-	-
华泰证券	202108 240001 9331	东方日 升	2021年 8月24 日	43,100.0 0	2,000	14	3.400	56.98	-	-
华泰证券	202108 250000 8657	阳光电 源	2021年 8月25 日	46,185,0 00.00	300,000	14	3.400	61,066 .88	-	-
华泰证券	202108	迈为股	2021年	769,010.	1,000	14	3.400	1,016.	-	-

	260001 2967	份	8月26 日	00				82		
华泰证券	202108 270001 2615	迈为股 份	2021年 8月27 日	988,949. 00	1,300	14	3.400	1,307. 60	-	-
华泰证券	202108 300001 4385	迈为股 份	2021年 8月30 日	3,585,73 5.00	4,500	14	3.400	4,741. 10	-	-
华泰证券	202108 300001 4387	东方日 升	2021年 8月30 日	24,030.0 0	1,000	14	3.400	31.78	-	-
华泰证券	202108 300001 5495	迈为股 份	2021年 8月30 日	1,035,87 9.00	1,300	14	3.400	1,369. 62	-	-
华泰证券	202108 310001 1453	晶盛机 电	2021年 8月31 日	1,475,73 0.00	19,000	14	3.400	1,951. 18	-	-
华泰证券	202108 310001 1455	阳光电 源	2021年 8月31 日	4,246,56 0.00	27,000	14	3.400	5,614. 84	-	-
华泰证券	202109 010000 0631	晶盛机 电	2021年 9月1日	2,067,53 4.00	26,900	14	3.400	2,733. 78	-	-
华泰证券	202109 010001 9201	东方日 升	2021年 9月1日	363,200. 00	16,000	14	3.400	480.20	-	-
华泰证券	202109 010001 9203	晶盛机 电	2021年 9月1日	1,875,38 4.00	24,400	14	3.400	2,479. 68	-	-
华泰证券	202109 010001 9205	阳光电 源	2021年 9月1日	4,490,04 4.00	31,600	14	3.400	5,936. 84	-	-
华泰证券	202109 010001 9207	东方日 升	2021年 9月1日	272,400. 00	12,000	14	3.400	360.22	-	-
华泰证券	202109 020000 0608	东方日 升	2021年 9月2日	142,740. 00	6,000	14	3.400	188.72	-	-
华泰证券	202109 020000 0610	迈为股 份	2021年 9月2日	965,034. 00	1,400	14	3.400	1,275. 96	-	-
华泰证券	202109 030000 9433	东方日 升	2021年 9月3日	14,304,7 70.00	631,000	14	3.400	18,914 .14	-	-

华泰证券	202109 060000 0517	东方日 升	2021年 9月6日	528,000. 00	24,000	14	3.400	797.92	-	-
华泰证券	202109 060000 0519	迈为股 份	2021年 9月6日	1,113,46 6.00	1,700	14	3.400	1,682. 56	-	-
华泰证券	202109 060000 6450	迈为股 份	2021年 9月6日	1,375,45 8.00	2,100	14	3.400	2,078. 40	-	-
华泰证券	202109 060000 6452	东方日 升	2021年 9月6日	660,000. 00	30,000	14	3.400	997.28	-	-
华泰证券	202109 070000 0519	东方日 升	2021年 9月7日	313,460. 00	14,000	14	3.400	444.00	-	-
华泰证券	202109 070002 0815	东方日 升	2021年 9月7日	44,780.0 0	2,000	14	3.400	63.45	-	-
华泰证券	202109 080000 0591	阳光电 源	2021年 9月8日	27,342,0 00.00	200,000	14	3.400	36,152 .20	-	-
华泰证券	202109 080001 1413	阳光电 源	2021年 9月8日	41,013,0 00.00	300,000	14	3.400	54,228 .30	-	-
华泰证券	202109 090000 0387	东方日 升	2021年 9月9日	660,900. 00	30,000	14	3.400	873.88	-	-
华泰证券	202109 090001 6893	迈为股 份	2021年 9月9日	633,000. 00	1,000	14	3.400	836.92	-	-
华泰证券	202109 100000 0474	迈为股 份	2021年 9月10 日	723,800. 00	1,100	14	3.400	957.04	-	-
华泰证券	202109 100000 0478	东方日 升	2021年 9月10 日	1,063,68 0.00	48,000	14	3.400	1,406. 44	-	-
华泰证券	202109 100001 6219	迈为股 份	2021年 9月10 日	855,400. 00	1,300	14	3.400	1,131. 06	-	-
华泰证券	202108 300001 5493	迈为股 份	2021年 8月30 日	39,841,5 00.00	50,000	28	3.400	105,35 8.68	-	-
华泰证券	202109 130001	迈为股 份	2021年 9月13	2,798,23 5.00	4,500	14	3.400	3,699. 92	-	-

	5826		日							
华泰证券	202109 130001 5828	迈为股 份	2021年 9月13 日	808,379. 00	1,300	14	3.400	1,068. 90	-	-
华泰证券	202109 130001 5830	东方日 升	2021年 9月13 日	21,200.0 0	1,000	14	3.400	28.00	-	-
华泰证券	202108 310000 0299	阳光电 源	2021年 8月31 日	27,335,2 64.00	173,800	28	3.400	72,286 .48	-	-
华泰证券	202109 140001 3806	晶盛机 电	2021年 9月14 日	1,341,40 0.00	19,000	14	3.400	1,773. 66	-	-
华泰证券	202109 140001 3808	阳光电 源	2021年 9月14 日	3,652,83 0.00	27,000	14	3.400	4,829. 86	-	-
华泰证券	202109 150001 9082	晶盛机 电	2021年 9月15 日	1,745,08 8.00	24,400	14	3.400	2,307. 34	-	-
华泰证券	202109 150001 9084	晶盛机 电	2021年 9月15 日	1,923,88 8.00	26,900	14	3.400	2,543. 80	-	-
华泰证券	202109 150001 9086	东方日 升	2021年 9月15 日	274,080. 00	12,000	14	3.400	362.46	-	-
华泰证券	202109 150001 9088	东方日 升	2021年 9月15 日	365,440. 00	16,000	14	3.400	483.14	-	-
华泰证券	202109 150001 9090	阳光电 源	2021年 9月15 日	4,351,95 2.00	31,600	14	3.400	5,754. 28	-	-
华泰证券	202109 160000 0573	东方日 升	2021年 9月16 日	2,298,24 0.00	108,000	14	3.400	3,038. 84	-	-
华泰证券	202109 160001 1189	迈为股 份	2021年 9月16 日	856,856. 00	1,400	14	3.400	1,133. 02	-	-
华泰证券	202109 160001 1191	东方日 升	2021年 9月16 日	127,680. 00	6,000	14	3.400	168.84	-	-
华泰证券	202109 030000 0547	先导智 能	2021年 9月3日	3,274,64 8.00	48,100	28	3.400	10,824 .45	-	-
华泰证券	202109	东方日	2021年	13,080,6	631,000	14	3.400	25,943	-	-

	170000 8021	升	9月17 日	30.00				.19		
华泰证券	202109 220003 0785	迈为股 份	2021年 9月22 日	1,033,60 0.00	1,700	14	3.400	1,561. 92	-	-
华泰证券	202109 220003 0787	迈为股 份	2021年 9月22 日	1,276,80 0.00	2,100	14	3.400	1,929. 44	-	-
华泰证券	202109 220003 0789	阳光电 源	2021年 9月22 日	24,870,0 00.00	200,000	14	3.400	37,581 .28	-	-
华泰证券	202109 220003 0791	东方日 升	2021年 9月22 日	612,600. 00	30,000	14	3.400	925.76	-	-
华泰证券	202109 220003 0793	东方日 升	2021年 9月22 日	490,080. 00	24,000	14	3.400	740.64	-	-
华泰证券	202109 220003 0795	阳光电 源	2021年 9月22 日	37,305,0 00.00	300,000	14	3.400	56,372 .00	-	-
华泰证券	202109 220003 0797	东方日 升	2021年 9月22 日	40,840.0 0	2,000	14	3.400	61.76	-	-
华泰证券	202109 220003 0799	东方日 升	2021年 9月22 日	285,880. 00	14,000	14	3.400	432.00	-	-
华泰证券	202109 230001 4533	迈为股 份	2021年 9月23 日	597,900. 00	1,000	14	3.400	847.05	-	-
华泰证券	202109 240001 3317	东方日 升	2021年 9月24 日	986,400. 00	48,000	14	3.400	1,304. 24	-	-
华泰证券	202109 240001 3319	迈为股 份	2021年 9月24 日	685,311. 00	1,100	14	3.400	906.08	-	-
华泰证券	202109 240001 3321	迈为股 份	2021年 9月24 日	809,913. 00	1,300	14	3.400	1,070. 86	-	-
华泰证券	202109 270001 5475	迈为股 份	2021年 9月27 日	2,835,00 0.00	4,500	14	3.400	3,748. 50	-	-
华泰证券	202109 270001 5477	迈为股 份	2021年 9月27 日	819,000. 00	1,300	14	3.400	1,082. 90	-	-

华泰证券	202109 270001 5479	东方日 升	2021年 9月27 日	19,610.0 0	1,000	14	3.400	25.90	-	-
华泰证券	202109 280001 2390	晶盛机 电	2021年 9月28 日	1,261,98 0.00	19,000	14	3.400	1,668. 66	-	-
华泰证券	202109 280001 2392	阳光电 源	2021年 9月28 日	3,866,94 0.00	27,000	14	3.400	5,112. 94	-	-
华泰证券	202109 290001 6269	晶盛机 电	2021年 9月29 日	1,560,38 0.00	24,400	14	3.400	2,063. 18	-	-
华泰证券	202109 290001 6275	阳光电 源	2021年 9月29 日	4,657,52 4.00	31,600	14	3.400	6,158. 32	-	-
华泰证券	202109 290001 6279	晶盛机 电	2021年 9月29 日	1,720,25 5.00	26,900	14	3.400	2,274. 58	-	-
华泰证券	202109 290001 6281	东方日 升	2021年 9月29 日	224,400. 00	12,000	14	3.400	296.66	-	-
华泰证券	202109 290001 6283	东方日 升	2021年 9月29 日	299,200. 00	16,000	14	3.400	395.64	-	-
华泰证券	202109 300001 2505	东方日 升	2021年 9月30 日	115,620. 00	6,000	14	3.400	152.88	-	-
华泰证券	202109 300001 2507	东方日 升	2021年 9月30 日	2,081,16 0.00	108,000	14	3.400	2,751. 70	-	-
华泰证券	202109 300001 2509	迈为股 份	2021年 9月30 日	853,342. 00	1,400	14	3.400	1,128. 26	-	-
华泰证券	202110 080005 9917	迈为股 份	2021年 10月8 日	628,100. 00	1,100	14	3.400	830.48	-	-
华泰证券	202110 080005 9919	迈为股 份	2021年 10月8 日	742,300. 00	1,300	14	3.400	981.54	-	-
华泰证券	202110 080005 9921	东方日 升	2021年 10月8 日	899,520. 00	48,000	14	3.400	1,189. 30	-	-
华泰证券	202110 080007	迈为股 份	2021年 10月8	571,000. 00	1,000	14	3.400	755.02	-	-

	1255		日							
华泰证券	202110 080007 1257	迈为股 份	2021年 10月8 日	970,700. 00	1,700	14	3.400	1,283. 52	-	-
华泰证券	202110 080007 1259	东方日 升	2021年 10月8 日	37,480.0 0	2,000	14	3.400	49.56	-	-
华泰证券	202110 080007 1261	东方日 升	2021年 10月8 日	11,824,9 40.00	631,000	14	3.400	15,635 .20	-	-
华泰证券	202110 080007 1263	东方日 升	2021年 10月8 日	562,200. 00	30,000	14	3.400	743.40	-	-
华泰证券	202110 080007 1265	东方日 升	2021年 10月8 日	262,360. 00	14,000	14	3.400	346.92	-	-
华泰证券	202110 080007 1269	迈为股 份	2021年 10月8 日	1,199,10 0.00	2,100	14	3.400	1,585. 50	-	-
华泰证券	202110 080007 1271	阳光电 源	2021年 10月8 日	30,040,0 00.00	200,000	14	3.400	39,719 .54	-	-
华泰证券	202110 080007 1273	东方日 升	2021年 10月8 日	449,760. 00	24,000	14	3.400	594.72	-	-
华泰证券	202110 080007 1275	阳光电 源	2021年 10月8 日	45,060,0 00.00	300,000	14	3.400	59,579 .38	-	-
华泰证券	202109 270000 0235	先导智 能	2021年 9月27 日	5,819,52 0.00	84,000	28	2.000	9,052. 68	-	-
华泰证券	202109 270000 0237	迈为股 份	2021年 9月27 日	3,780,00 0.00	6,000	28	2.000	5,880. 00	-	-
华泰证券	202109 270000 0241	晶盛机 电	2021年 9月27 日	3,657,96 0.00	54,000	28	2.000	5,690. 16	-	-
华泰证券	202109 270000 0243	东方日 升	2021年 9月27 日	1,176,60 0.00	60,000	28	2.000	1,830. 36	-	-
华泰证券	202109 270000 0245	阳光电 源	2021年 9月27 日	11,524,5 00.00	78,000	28	2.000	17,927 .00	-	-
华泰证券	202109	迈为股	2021年	31,500,0	50,000	28	3.400	83,300	-	-

	270001 5473	份	9月27 日	00.00				.00		
华泰证券	202110 110001 8662	迈为股 份	2021年 10月11 日	771,173. 00	1,300	14	3.400	1,019. 62	-	-
华泰证券	202110 110001 8664	迈为股 份	2021年 10月11 日	2,669,44 5.00	4,500	14	3.400	3,529. 54	-	-
华泰证券	202110 110001 8666	东方日 升	2021年 10月11 日	17,930.0 0	1,000	14	3.400	23.66	-	-
华泰证券	202110 280001 2394	阳光电 源	2021年 9月28 日	24,891,6 36.00	173,800	28	3.400	65,824 .64	-	-
华泰证券	202110 120001 6989	阳光电 源	2021年 10月12 日	3,874,50 0.00	27,000	14	3.400	5,123. 02	-	-
华泰证券	202110 120001 6991	晶盛机 电	2021年 10月12 日	1,164,70 0.00	19,000	14	3.400	1,540. 00	-	-
华泰证券	202110 130001 7687	晶盛机 电	2021年 10月13 日	1,708,68 8.00	26,900	14	3.400	2,259. 32	-	-
华泰证券	202110 130001 7689	阳光电 源	2021年 10月13 日	4,788,34 8.00	31,600	14	3.400	6,331. 22	-	-
华泰证券	202110 130001 7691	东方日 升	2021年 10月13 日	217,920. 00	12,000	14	3.400	288.12	-	-
华泰证券	202110 130001 7693	东方日 升	2021年 10月13 日	290,560. 00	16,000	14	3.400	384.16	-	-
华泰证券	202110 130001 8381	晶盛机 电	2021年 10月13 日	1,549,88 8.00	24,400	14	3.400	2,049. 32	-	-
华泰证券	202110 140001 4596	东方日 升	2021年 10月14 日	1,988,28 0.00	108,000	14	3.400	2,628. 92	-	-
华泰证券	202110 140001 4598	东方日 升	2021年 10月14 日	110,460. 00	6,000	14	3.400	146.02	-	-
华泰证券	202110 080007 1267	先导智 能	2021年 10月8 日	3,371,81 0.00	48,100	28	3.400	8,916. 60	-	-

华泰证券	202110 220004 5194	迈为股份	2021年 10月22 日	730,763. 00	1,100	14	3.400	966.28	-	-
华泰证券	202110 220004 5196	迈为股份	2021年 10月22 日	1,395,09 3.00	2,100	14	3.400	1,844. 64	-	-
华泰证券	202110 220004 5198	东方日升	2021年 10月22 日	465,600. 00	24,000	14	3.400	615.58	-	-
华泰证券	202110 220004 5200	东方日升	2021年 10月22 日	271,600. 00	14,000	14	3.400	359.10	-	-
华泰证券	202110 220004 5202	东方日升	2021年 10月22 日	582,000. 00	30,000	14	3.400	769.58	-	-
华泰证券	202110 220004 5204	东方日升	2021年 10月22 日	38,800.0 0	2,000	14	3.400	51.24	-	-
华泰证券	202110 220004 5206	迈为股份	2021年 10月22 日	664,330. 00	1,000	14	3.400	878.36	-	-
华泰证券	202110 220004 5208	迈为股份	2021年 10月22 日	863,629. 00	1,300	14	3.400	1,141. 84	-	-
华泰证券	202110 220004 5210	迈为股份	2021年 10月22 日	1,129,36 1.00	1,700	14	3.400	1,493. 24	-	-
华泰证券	202110 220004 5212	东方日升	2021年 10月22 日	931,200. 00	48,000	14	3.400	1,231. 30	-	-
华泰证券	202110 220004 5214	东方日升	2021年 10月22 日	12,241,4 00.00	631,000	14	3.400	16,185 .82	-	-
华泰证券	202110 220005 1500	阳光电源	2021年 10月22 日	31,474,0 00.00	200,000	14	3.400	41,615 .56	-	-
华泰证券	202110 220005 1502	阳光电源	2021年 10月22 日	47,211,0 00.00	300,000	14	3.400	62,423 .48	-	-
华泰证券	202110 250001 5760	东方日升	2021年 10月25 日	22,130.0 0	1,000	14	3.400	29.26	-	-
华泰证券	202110 250001	迈为股份	2021年 10月25	3,188,47 5.00	4,500	14	3.400	4,215. 82	-	-

	5980		日							
华泰证券	2021102500017360	迈为股份	2021年10月25日	921,115.00	1,300	14	3.400	1,217.86	-	-
华泰证券	2021102600013194	晶盛机电	2021年10月26日	1,410,180.00	19,000	14	3.400	1,864.52	-	-
华泰证券	2021102600013196	阳光电源	2021年10月26日	4,598,100.00	27,000	14	3.400	6,079.78	-	-
华泰证券	2021102700016237	东方日升	2021年10月27日	359,040.00	16,000	14	3.400	474.74	-	-
华泰证券	2021102700016239	晶盛机电	2021年10月27日	2,016,155.00	26,900	14	3.400	2,665.74	-	-
华泰证券	2021102700016241	晶盛机电	2021年10月27日	1,828,780.00	24,400	14	3.400	2,418.08	-	-
华泰证券	2021102700016243	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	2021102700016245	东方日升	2021年10月27日	269,280.00	12,000	14	3.400	356.02	-	-
华泰证券	2021102800000669	东方日升	2021年10月28日	206,934.00	9,100	14	3.400	273.56	-	-
华泰证券	2021102800013113	东方日升	2021年10月28日	2,455,920.00	108,000	14	3.400	3,247.30	-	-
华泰证券	2021102800013115	东方日升	2021年10月28日	136,440.00	6,000	14	3.400	180.46	-	-
华泰证券	2021102900000500	东方日升	2021年10月29日	5,604,846.00	235,300	14	3.400	7,410.90	-	-
华泰证券	2021110500000636	东方日升	2021年11月5日	654,680.00	26,000	14	3.400	865.62	-	-
华泰证券	20211105000053467	东方日升	2021年11月5日	15,888,580.00	631,000	14	3.400	21,008.26	-	-
华泰证券	202111	东方日	2021年	1,208,64	48,000	14	3.400	1,598.	-	-

	050005 3469	升	11月5日	0.00				10		
华泰证券	202111 050005 3471	迈为股份	2021年 11月5日	923,299.00	1,300	14	3.400	1,220.80	-	-
华泰证券	202111 050005 3473	迈为股份	2021年 11月5日	1,207,391.00	1,700	14	3.400	1,596.42	-	-
华泰证券	202111 050005 3475	迈为股份	2021年 11月5日	1,491,483.00	2,100	14	3.400	1,972.04	-	-
华泰证券	202111 050005 3477	迈为股份	2021年 11月5日	710,230.00	1,000	14	3.400	939.12	-	-
华泰证券	202111 050005 3479	迈为股份	2021年 11月5日	781,253.00	1,100	14	3.400	1,033.06	-	-
华泰证券	202111 050005 3481	东方日升	2021年 11月5日	352,520.00	14,000	14	3.400	466.06	-	-
华泰证券	202111 050005 3483	东方日升	2021年 11月5日	604,320.00	24,000	14	3.400	798.98	-	-
华泰证券	202111 050005 3485	东方日升	2021年 11月5日	50,360.00	2,000	14	3.400	66.64	-	-
华泰证券	202111 050005 5597	阳光电源	2021年 11月5日	46,734,000.00	300,000	14	3.400	61,792.78	-	-
华泰证券	202111 050005 5601	东方日升	2021年 11月5日	755,400.00	30,000	14	3.400	998.76	-	-
华泰证券	202111 050005 6617	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	202110 250001 5976	先导智能	2021年 10月25日	6,411,720.00	84,000	28	2.000	9,973.88	-	-
华泰证券	202110 250001 5978	晶盛机电	2021年 10月25日	4,047,840.00	54,000	28	2.000	6,296.64	-	-
华泰证券	202110 250001 5982	迈为股份	2021年 10月25日	35,427,500.00	50,000	28	3.400	93,686.04	-	-

华泰证券	202110 250001 5984	迈为股份	2021年 10月25 日	4,251,30 0.00	6,000	28	2.000	6,613. 04	-	-
华泰证券	202110 250001 5986	东方日升	2021年 10月25 日	1,327,80 0.00	60,000	28	2.000	2,065. 56	-	-
华泰证券	202110 250001 5988	阳光电源	2021年 10月25 日	13,416,0 00.00	78,000	28	2.000	20,869 .24	-	-
华泰证券	202111 080001 6872	迈为股份	2021年 11月8 日	3,155,40 0.00	4,500	14	3.400	4,172. 14	-	-
华泰证券	202111 080001 6874	迈为股份	2021年 11月8 日	911,560. 00	1,300	14	3.400	1,205. 26	-	-
华泰证券	202111 080001 6876	东方日升	2021年 11月8 日	25,840.0 0	1,000	14	3.400	34.16	-	-
华泰证券	202110 260001 3198	阳光电源	2021年 10月26 日	29,598,1 40.00	173,800	28	3.400	78,270 .64	-	-
华泰证券	202111 090000 0595	东方日升	2021年 11月9 日	640,000. 00	25,000	14	3.400	846.16	-	-
华泰证券	202111 090001 5816	晶盛机电	2021年 11月9 日	1,474,97 0.00	19,000	14	3.400	1,950. 20	-	-
华泰证券	202111 090001 5818	阳光电源	2021年 11月9 日	4,325,67 0.00	27,000	14	3.400	5,719. 56	-	-
华泰证券	202110 270000 0512	东方日升	2021年 10月27 日	5,937,62 4.00	264,600	28	3.400	15,701 .84	-	-
华泰证券	202111 100001 7005	东方日升	2021年 11月10 日	443,840. 00	16,000	14	3.400	586.88	-	-
华泰证券	202111 100001 7007	东方日升	2021年 11月10 日	332,880. 00	12,000	14	3.400	440.16	-	-
华泰证券	202111 100001 7009	晶盛机电	2021年 11月10 日	2,143,39 2.00	26,900	14	3.400	2,834. 02	-	-
华泰证券	202111 100001	阳光电源	2021年 11月10 日	5,021,24 0.00	31,600	14	3.400	6,639. 22	-	-

	7011		日								
华泰证券	202111 110000 0451	东方日升	2021年 11月11 日	114,000. 00	4,000	14	3.400	150.78	-	-	
华泰证券	202111 110001 4650	东方日升	2021年 11月11 日	259,350. 00	9,100	14	3.400	342.86	-	-	
华泰证券	202111 110001 4652	东方日升	2021年 11月11 日	3,078,00 0.00	108,000	14	3.400	4,069. 80	-	-	
华泰证券	202111 110001 4654	东方日升	2021年 11月11 日	171,000. 00	6,000	14	3.400	226.10	-	-	
华泰证券	202111 120000 3941	东方日升	2021年 11月12 日	6,964,88 0.00	235,300	14	3.400	9,209. 06	-	-	
华泰证券	202111 150000 1255	东方日升	2021年 11月15 日	712,560. 00	24,000	14	3.400	942.20	-	-	
华泰证券	202111 160000 0779	东方日升	2021年 11月16 日	1,657,90 0.00	59,000	14	3.400	2,192. 12	-	-	
华泰证券	202111 170000 0596	晶盛机电	2021年 11月17 日	266,400. 00	3,600	14	3.400	352.24	-	-	
华泰证券	202111 170000 0598	东方日升	2021年 11月17 日	122,200. 00	4,000	14	3.400	161.56	-	-	
华泰证券	202111 180000 0814	迈为股份	2021年 11月18 日	32,895,0 00.00	50,000	14	3.400	43,494 .50	-	-	
华泰证券	202111 180000 0816	迈为股份	2021年 11月18 日	13,158,0 00.00	20,000	14	3.400	17,397 .80	-	-	
华泰证券	202111 050005 5599	先导智能	2021年 11月5 日	4,060,60 2.00	48,100	28	3.400	10,738 .00	-	-	
华泰证券	202111 190000 0559	迈为股份	2021年 11月19 日	3,945,00 0.00	6,000	14	3.400	5,216. 12	-	-	
华泰证券	202111 190000 0561	先导智能	2021年 11月19 日	6,660,36 0.00	84,000	14	3.400	8,806. 42	-	-	
华泰证券	202111	东方日	2021年	2,160,00	60,000	14	3.400	2,856.	-	-	

	190000 0565	升	11月19 日	0.00				00		
华泰证券	202111 190000 0567	阳光电 源	2021年 11月19 日	11,818,5 60.00	78,000	14	3.400	15,626 .80	-	-
华泰证券	202111 190000 0569	晶盛机 电	2021年 11月19 日	3,890,16 0.00	54,000	14	3.400	5,143. 60	-	-
华泰证券	202111 190003 8651	阳光电 源	2021年 11月19 日	45,456,0 00.00	300,000	14	3.400	60,102 .98	-	-
华泰证券	202111 190003 9071	阳光电 源	2021年 11月19 日	30,304,0 00.00	200,000	14	3.400	40,068 .56	-	-
华泰证券	202111 190004 3953	迈为股 份	2021年 11月19 日	1,117,75 0.00	1,700	14	3.400	1,477. 98	-	-
华泰证券	202111 190004 3955	迈为股 份	2021年 11月19 日	723,250. 00	1,100	14	3.400	956.34	-	-
华泰证券	202111 190004 3957	迈为股 份	2021年 11月19 日	1,380,75 0.00	2,100	14	3.400	1,825. 60	-	-
华泰证券	202111 190004 3959	迈为股 份	2021年 11月19 日	657,500. 00	1,000	14	3.400	869.40	-	-
华泰证券	202111 190004 3961	东方日 升	2021年 11月19 日	72,000.0 0	2,000	14	3.400	95.20	-	-
华泰证券	202111 190004 3963	东方日 升	2021年 11月19 日	504,000. 00	14,000	14	3.400	666.40	-	-
华泰证券	202111 190004 3965	东方日 升	2021年 11月19 日	864,000. 00	24,000	14	3.400	1,142. 40	-	-
华泰证券	202111 190004 3967	东方日 升	2021年 11月19 日	1,080,00 0.00	30,000	14	3.400	1,428. 00	-	-
华泰证券	202111 190004 3969	迈为股 份	2021年 11月19 日	854,750. 00	1,300	14	3.400	1,130. 22	-	-
华泰证券	202111 190004 4175	东方日 升	2021年 11月19 日	936,000. 00	26,000	14	3.400	1,237. 60	-	-

华泰证券	202111 190004 4177	东方日 升	2021年 11月19 日	22,716,0 00.00	631,000	14	3.400	30,035 .60	-	-
华泰证券	202111 190004 4179	东方日 升	2021年 11月19 日	1,728,00 0.00	48,000	14	3.400	2,284. 80	-	-
华泰证券	202111 220001 4506	迈为股 份	2021年 11月22 日	3,023,64 0.00	4,500	14	3.400	3,997. 98	-	-
华泰证券	202111 220001 4508	迈为股 份	2021年 11月22 日	873,496. 00	1,300	14	3.400	1,155. 00	-	-
华泰证券	202111 220001 4984	东方日 升	2021年 11月22 日	37,000.0 0	1,000	14	3.400	48.86	-	-
华泰证券	202111 230001 2742	东方日 升	2021年 11月23 日	936,500. 00	25,000	14	3.400	1,238. 30	-	-
华泰证券	202111 230001 2744	阳光电 源	2021年 11月23 日	4,228,47 0.00	27,000	14	3.400	5,591. 04	-	-
华泰证券	202111 230001 2746	晶盛机 电	2021年 11月23 日	1,353,56 0.00	19,000	14	3.400	1,789. 76	-	-
华泰证券	202111 240000 0441	先导智 能	2021年 11月24 日	2,908,36 0.00	36,400	14	3.400	3,845. 52	-	-
华泰证券	202111 240000 0443	晶盛机 电	2021年 11月24 日	1,712,08 8.00	25,200	14	3.400	2,263. 80	-	-
华泰证券	202111 240000 0445	东方日 升	2021年 11月24 日	995,400. 00	28,000	14	3.400	1,316. 14	-	-
华泰证券	202111 240000 0447	阳光电 源	2021年 11月24 日	5,532,43 6.00	36,400	14	3.400	7,315. 14	-	-
华泰证券	202111 240001 5009	晶盛机 电	2021年 11月24 日	1,827,58 6.00	26,900	14	3.400	2,416. 54	-	-
华泰证券	202111 240001 5011	东方日 升	2021年 11月24 日	568,800. 00	16,000	14	3.400	752.08	-	-
华泰证券	202111 240001	阳光电 源	2021年 11月24	4,802,88 4.00	31,600	14	3.400	6,350. 54	-	-

	5013		日								
华泰证券	202111 240001 5015	东方日 升	2021年 11月24 日	426,600. 00	12,000	14	3.400	564.06	-	-	
华泰证券	202111 250000 0644	东方日 升	2021年 11月25 日	5,268,01 5.00	150,300	14	3.400	6,965. 42	-	-	
华泰证券	202111 250000 0646	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	202111 250000 6924	东方日 升	2021年 11月25 日	318,955. 00	9,100	14	3.400	421.68	-	-	
华泰证券	202111 250000 6926	东方日 升	2021年 11月25 日	140,200. 00	4,000	14	3.400	185.36	-	-	
华泰证券	202111 250000 6928	东方日 升	2021年 11月25 日	210,300. 00	6,000	14	3.400	278.04	-	-	
华泰证券	202111 250000 6930	东方日 升	2021年 11月25 日	3,785,40 0.00	108,000	14	3.400	5,005. 14	-	-	
华泰证券	202111 260000 0681	东方日 升	2021年 11月26 日	4,653,27 2.00	131,300	14	3.400	6,152. 72	-	-	
华泰证券	202111 260000 0685	阳光电 源	2021年 11月26 日	275,112. 00	1,800	14	3.400	363.72	-	-	
华泰证券	202111 260000 3282	东方日 升	2021年 11月26 日	8,339,03 2.00	235,300	14	3.400	11,026 .12	-	-	
华泰证券	202111 290000 5017	东方日 升	2021年 11月29 日	864,000. 00	24,000	14	3.400	1,142. 40	-	-	
华泰证券	202111 300000 4527	东方日 升	2021年 11月30 日	2,124,00 0.00	59,000	14	3.400	2,808. 40	-	-	
华泰证券	202112 010000 4861	东方日 升	2021年 12月1 日	133,600. 00	4,000	14	3.400	176.68	-	-	
华泰证券	202112 010000 4871	晶盛机 电	2021年 12月1 日	248,112. 00	3,600	14	3.400	328.02	-	-	
华泰证券	202112	迈为股	2021年	35,600,0	50,000	14	3.400	47,071	-	-	

	020000 4845	份	12月2 日	00.00				.08		
华泰证券	202112 020000 5001	迈为股 份	2021年 12月2 日	14,240,0 00.00	20,000	14	3.400	18,828 .46	-	-
华泰证券	202112 030001 6159	东方日 升	2021年 12月3 日	20,457,0 20.00	631,000	14	3.400	27,048 .70	-	-
华泰证券	202112 030001 6169	东方日 升	2021年 12月3 日	842,920. 00	26,000	14	3.400	1,114. 54	-	-
华泰证券	202112 030001 6171	东方日 升	2021年 12月3 日	453,880. 00	14,000	14	3.400	600.18	-	-
华泰证券	202112 030001 6175	迈为股 份	2021年 12月3 日	1,181,94 2.00	1,700	14	3.400	1,562. 82	-	-
华泰证券	202112 030001 6181	东方日 升	2021年 12月3 日	778,080. 00	24,000	14	3.400	1,028. 86	-	-
华泰证券	202112 030001 6187	迈为股 份	2021年 12月3 日	903,838. 00	1,300	14	3.400	1,195. 04	-	-
华泰证券	202112 030002 0563	先导智 能	2021年 12月3 日	6,825,84 0.00	84,000	14	3.400	9,025. 24	-	-
华泰证券	202112 030002 0567	晶盛机 电	2021年 12月3 日	3,682,80 0.00	54,000	14	3.400	4,869. 48	-	-
华泰证券	202112 030002 1047	阳光电 源	2021年 12月3 日	30,598,0 00.00	200,000	14	3.400	40,457 .34	-	-
华泰证券	202112 030002 3555	阳光电 源	2021年 12月3 日	11,933,2 20.00	78,000	14	3.400	15,778 .42	-	-
华泰证券	202112 030002 3739	迈为股 份	2021年 12月3 日	764,786. 00	1,100	14	3.400	1,011. 22	-	-
华泰证券	202112 030002 3741	阳光电 源	2021年 12月3 日	45,897,0 00.00	300,000	14	3.400	60,686 .08	-	-
华泰证券	202112 030002 3745	东方日 升	2021年 12月3 日	1,556,16 0.00	48,000	14	3.400	2,057. 58	-	-

华泰证券	202112 030002 3755	东方日 升	2021年 12月3 日	64,840.0 0	2,000	14	3.400	85.68	-	-
华泰证券	202112 030002 3761	东方日 升	2021年 12月3 日	972,600. 00	30,000	14	3.400	1,286. 04	-	-
华泰证券	202112 030002 3763	迈为股 份	2021年 12月3 日	695,260. 00	1,000	14	3.400	919.24	-	-
华泰证券	202112 030002 3767	迈为股 份	2021年 12月3 日	1,460,04 6.00	2,100	14	3.400	1,930. 46	-	-
华泰证券	202111 220001 4986	迈为股 份	2021年 11月22 日	33,596,0 00.00	50,000	28	3.400	88,842 .88	-	-
华泰证券	202112 070000 8977	晶盛机 电	2021年 12月7 日	1,292,57 0.00	19,000	14	3.400	1,709. 12	-	-
华泰证券	202112 070000 8979	阳光电 源	2021年 12月7 日	4,014,90 0.00	27,000	14	3.400	5,308. 66	-	-
华泰证券	202112 080000 6964	先导智 能	2021年 12月8 日	2,897,44 0.00	36,400	14	3.400	3,831. 10	-	-
华泰证券	202112 080000 6966	阳光电 源	2021年 12月8 日	5,467,28 0.00	36,400	14	3.400	7,228. 90	-	-
华泰证券	202112 080000 7352	晶盛机 电	2021年 12月8 日	1,786,17 6.00	25,200	14	3.400	2,361. 66	-	-
华泰证券	202112 080000 7438	晶盛机 电	2021年 12月8 日	1,906,67 2.00	26,900	14	3.400	2,520. 98	-	-
华泰证券	202112 090000 8785	先导智 能	2021年 12月9 日	952,800. 00	12,000	14	3.400	1,259. 86	-	-
华泰证券	202112 100000 4309	阳光电 源	2021年 12月10 日	269,982. 00	1,800	14	3.400	357.00	-	-
华泰证券	202112 130000 1014	东方日 升	2021年 12月13 日	8,339,64 6.00	233,800	14	3.400	11,026 .82	-	-
华泰证券	202112 140000	东方日 升	2021年 12月14	7,441,27 2.00	217,200	14	3.400	9,839. 06	-	-

	1091		日							
华泰证券	202112 140001 1852	东方日 升	2021年 12月14 日	2,021,34 0.00	59,000	14	3.400	2,672. 60	-	-
华泰证券	202112 150001 5545	晶盛机 电	2021年 12月15 日	260,280. 00	3,600	14	3.400	344.12	-	-
华泰证券	202112 150001 6611	东方日 升	2021年 12月15 日	137,520. 00	4,000	14	3.400	181.86	-	-
华泰证券	202112 160000 0910	中信博	2021年 12月16 日	21,250,0 00.00	100,000	14	3.400	28,097 .16	-	-
华泰证券	202112 160000 7859	迈为股 份	2021年 12月16 日	36,667,5 00.00	50,000	14	3.400	48,482 .56	-	-
华泰证券	202112 160000 8077	迈为股 份	2021年 12月16 日	14,667,0 00.00	20,000	14	3.400	19,393 .08	-	-
华泰证券	202112 170000 1492	固德威	2021年 12月17 日	13,860,0 00.00	30,000	14	3.400	18,326 .00	-	-
华泰证券	202112 170002 5624	迈为股 份	2021年 12月17 日	1,198,09 2.00	1,700	14	3.400	1,584. 10	-	-
华泰证券	202112 170002 5626	迈为股 份	2021年 12月17 日	775,236. 00	1,100	14	3.400	1,025. 08	-	-
华泰证券	202112 170002 5628	迈为股 份	2021年 12月17 日	1,479,99 6.00	2,100	14	3.400	1,956. 92	-	-
华泰证券	202112 170002 5630	先导智 能	2021年 12月17 日	6,669,60 0.00	84,000	14	3.400	8,818. 74	-	-
华泰证券	202112 170002 5632	东方日 升	2021年 12月17 日	67,320.0 0	2,000	14	3.400	89.04	-	-
华泰证券	202112 170002 5634	迈为股 份	2021年 12月17 日	916,188. 00	1,300	14	3.400	1,211. 42	-	-
华泰证券	202112 170002 5638	阳光电 源	2021年 12月17 日	11,427,0 00.00	78,000	14	3.400	15,109 .08	-	-
华泰证券	202112	阳光电	2021年	29,300,0	200,000	14	3.400	38,741	-	-

	170002 6078	源	12月17 日	00.00				.08		
华泰证券	202112 170002 6094	东方日 升	2021年 12月17 日	807,840. 00	24,000	14	3.400	1,068. 20	-	-
华泰证券	202112 170002 6096	东方日 升	2021年 12月17 日	1,615,68 0.00	48,000	14	3.400	2,136. 26	-	-
华泰证券	202112 170002 6098	东方日 升	2021年 12月17 日	875,160. 00	26,000	14	3.400	1,157. 10	-	-
华泰证券	202112 170002 6100	晶盛机 电	2021年 12月17 日	3,819,42 0.00	54,000	14	3.400	5,050. 08	-	-
华泰证券	202112 170002 6102	东方日 升	2021年 12月17 日	471,240. 00	14,000	14	3.400	623.14	-	-
华泰证券	202112 170002 6106	迈为股 份	2021年 12月17 日	704,760. 00	1,000	14	3.400	931.84	-	-
华泰证券	202112 170002 6108	东方日 升	2021年 12月17 日	1,009,80 0.00	30,000	14	3.400	1,335. 18	-	-
华泰证券	202112 170002 7156	阳光电 源	2021年 12月17 日	43,950,0 00.00	300,000	14	3.400	58,111 .62	-	-
华泰证券	202112 200000 1205	东方日 升	2021年 12月20 日	896,000. 00	28,000	14	3.400	930.82	909,16 0.00	930.82
华泰证券	202112 210000 1103	东方日 升	2021年 12月21 日	1,063,53 0.00	30,300	14	3.400	1,004. 40	983,84 1.00	1,004.4 0
华泰证券	202112 210001 9843	晶盛机 电	2021年 12月21 日	1,295,80 0.00	19,000	14	3.400	1,223. 80	1,320, 500.00	1,223.8 0
华泰证券	202112 210001 9845	阳光电 源	2021年 12月21 日	3,653,64 0.00	27,000	14	3.400	3,450. 70	3,936, 600.00	3,450.7 0
华泰证券	202112 220000 1187	迈为股 份	2021年 12月22 日	1,363,88 7.00	2,100	14	3.400	1,159. 29	1,348, 830.00	1,159.2 9
华泰证券	202112 220000 1189	中信博	2021年 12月22 日	821,772. 00	4,200	14	3.400	698.49	741,34 2.00	698.49

华泰证券	202112 220000 1191	天合光 能	2021年 12月22 日	1,420,33 5.00	18,900	14	3.400	1,207. 26	1,491, 210.00	1,207.2 6
华泰证券	202112 220000 1193	阳光电 源	2021年 12月22 日	3,173,94 0.00	23,100	14	3.400	2,697. 84	3,367, 980.00	2,697.8 4
华泰证券	202112 220000 1195	晶盛机 电	2021年 12月22 日	1,022,53 2.00	14,700	14	3.400	869.13	1,021, 650.00	869.13
华泰证券	202112 220000 1197	东方日 升	2021年 12月22 日	589,344. 00	16,800	14	3.400	500.94	545,49 6.00	500.94
华泰证券	202112 220000 1199	先导智 能	2021年 12月22 日	2,074,52 7.00	27,300	14	3.400	1,763. 37	2,030, 301.00	1,763.3 7
华泰证券	202112 220001 1404	先导智 能	2021年 12月22 日	2,766,03 6.00	36,400	14	3.400	2,351. 16	2,707, 068.00	2,351.1 6
华泰证券	202112 220001 1406	晶盛机 电	2021年 12月22 日	1,752,91 2.00	25,200	14	3.400	1,489. 95	1,751, 400.00	1,489.9 5
华泰证券	202112 220001 1408	阳光电 源	2021年 12月22 日	5,001,36 0.00	36,400	14	3.400	4,251. 15	5,307, 120.00	4,251.1 5
华泰证券	202112 220001 1410	晶盛机 电	2021年 12月22 日	1,871,16 4.00	26,900	14	3.400	1,590. 48	1,869, 550.00	1,590.4 8
华泰证券	202112 230001 1367	先导智 能	2021年 12月23 日	919,320. 00	12,000	14	3.400	694.56	892,44 0.00	694.56
华泰证券	202112 240001 1148	阳光电 源	2021年 12月24 日	239,778. 00	1,800	14	3.400	158.55	262,44 0.00	158.55
华泰证券	202112 270000 8266	东方日 升	2021年 12月27 日	7,785,54 0.00	233,800	14	3.400	2,941. 20	7,591, 486.00	2,941.2 0
华泰证券	202112 280001 4208	东方日 升	2021年 12月28 日	2,065,00 0.00	59,000	14	3.400	585.09	1,915, 730.00	585.09
华泰证券	202112 280001 4212	东方日 升	2021年 12月28 日	7,602,00 0.00	217,200	14	3.400	2,153. 91	7,052, 484.00	2,153.9 1
华泰证券	202112 290000	东方日 升	2021年 12月29	5,365,12 0.00	161,600	14	3.400	1,013. 42	5,247, 152.00	1,013.4 2

	0842		日							
华泰证券	2021122900010506	晶盛机电	2021年12月29日	244,800.00	3,600	14	3.400	46.24	250,200.00	46.24
华泰证券	2021122900010988	东方日升	2021年12月29日	132,800.00	4,000	14	3.400	25.08	129,880.00	25.08
华泰证券	2021122000001207	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	2021122000009185	迈为股份	2021年12月20日	33,749,500.00	50,000	28	3.400	35,061.95	32,115,000.00	35,061.95
华泰证券	2021123000000726	东方日升	2021年12月30日	5,226,842.00	170,200	14	3.400	493.65	5,526,394.00	493.65
华泰证券	2021123000001201	阳光电源	2021年12月30日	42,291,000.00	300,000	14	3.400	3,994.15	43,740,000.00	3,994.15
华泰证券	2021123000009048	中信博	2021年12月30日	17,000,000.00	100,000	14	3.400	1,605.56	17,651,000.00	1,605.56
华泰证券	2021123000009050	迈为股份	2021年12月30日	12,700,000.00	20,000	14	3.400	1,199.44	12,846,000.00	1,199.44
华泰证券	2021123100023484	东方日升	2021年12月31日	64,940.00	2,000	14	3.400	-	64,940.00	-
华泰证券	2021123100023488	先导智能	2021年12月31日	6,247,080.00	84,000	14	3.400	-	6,247,080.00	-
华泰证券	2021123100023490	迈为股份	2021年12月31日	1,348,830.00	2,100	14	3.400	-	1,348,830.00	-
华泰证券	2021123100023498	迈为股份	2021年12月31日	642,300.00	1,000	14	3.400	-	642,300.00	-
华泰证券	2021123100023856	固德威	2021年12月31日	13,787,400.00	30,000	14	3.400	-	13,787,400.00	-
华泰证券	2021123100027206	迈为股份	2021年12月31日	1,091,910.00	1,700	14	3.400	-	1,091,910.00	-
华泰证券	202112	东方日	2021年	844,220.	26,000	14	3.400	-	844,22	-

	310002 7212	升	12月31 日	00					0.00	
华泰证券	202112 310002 7222	东方日 升	2021年 12月31 日	974,100. 00	30,000	14	3.400	-	974,10 0.00	-
华泰证券	202112 310002 7224	东方日 升	2021年 12月31 日	454,580. 00	14,000	14	3.400	-	454,58 0.00	-
华泰证券	202112 310002 7226	迈为股 份	2021年 12月31 日	834,990. 00	1,300	14	3.400	-	834,99 0.00	-
华泰证券	202112 310002 7230	阳光电 源	2021年 12月31 日	11,372,4 00.00	78,000	14	3.400	-	11,372 ,400.0 0	-
华泰证券	202112 310002 7232	东方日 升	2021年 12月31 日	1,558,56 0.00	48,000	14	3.400	-	1,558, 560.00	-
华泰证券	202112 310002 7234	迈为股 份	2021年 12月31 日	706,530. 00	1,100	14	3.400	-	706,53 0.00	-
华泰证券	202112 310002 7236	东方日 升	2021年 12月31 日	779,280. 00	24,000	14	3.400	-	779,28 0.00	-
华泰证券	202112 310002 7238	晶盛机 电	2021年 12月31 日	3,753,00 0.00	54,000	14	3.400	-	3,753, 000.00	-

#### 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自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(%)
华泰柏瑞中 证光伏产业 交易型开放 式指数证券 投资基金联 接基金	546,979,026.00	5.4744	377,684,830.00	4.5622

华泰证券股份有限公司	7,515,347.00	0.0752	38,107,158.00	0.4603
------------	--------------	--------	---------------	--------

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年1月1日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国银行	63,553,571.07	260,283.35	61,549,486.46	335,483.12

注：本基金的银行存款由基金托管人中国银行保管，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

本期 2022年1月1日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
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	688353	华盛锂电	网下申购	4,358	428,609.30
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	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	301256	华融化学	网下申购	18,308	147,379.40
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	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64
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	301277	新天地	网下申购	4,384	118,368.00
华泰联合证券	688420	美腾科技	网下申购	2,408	117,895.68
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	301298	东利机械	网下申购	6,340	80,391.20
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	001258	立新能源	网下申购	3,188	10,775.44
华泰联合证券	001231	农心科技	网下申购	355	6,308.35
上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合证券	113630	赛伍转债	网上配售	9,430	943,000.00
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	30,000	135,900.00
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	33,000	87,450.00
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

本基金本报告期内及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 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	-

		日									
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	2022年	6个月	新股锁	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20		-

	眼科	10月26日		定期内							
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		-
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	唯特偶	2022年9月22日	6个月	新股锁定期内	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-
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	-

		日								
688114	华大智造	2022年9月2日	6个月	新股锁定期内	87.18	105.05	5,336	465,192.48	560,546.80	-
688141	杰华特	2022年12月16日	6个月	新股锁定期内	38.26	43.89	9,946	380,533.96	436,529.94	-
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	-
688353	华盛锂电	2022年7月6日	6个月	新股锁定期内	98.35	63.86	4,358	428,609.30	278,301.88	-
688376	美埃科技	2022年11月10日	6个月	新股锁定期内	29.19	28.49	3,713	108,382.47	105,783.37	-

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。

#### 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	000012	南玻A	2023年1月3日-2023年	6.71	223,400	1,499,014

			1月13日			.00
2	002610	爱康科技	2023年1月2日-2023年1月18日	2.85	7,190,600	20,493,210.00
3	002617	露笑科技	2023年1月2日-2023年1月13日	9.23	2,932,800	27,069,744.00
4	003022	联泓新科	2023年1月3日-2023年1月10日	30.35	96,400	2,925,740.00
5	003035	南网能源	2023年1月3日-2023年1月13日	5.67	190,700	1,081,269.00
6	300118	东方日升	2023年1月2日-2023年1月13日	24.82	1,201,700	29,826,194.00
7	300274	阳光电源	2023年1月2日-2023年1月13日	111.80	206,300	23,064,340.00
8	300316	晶盛机电	2023年1月3日-2023年1月13日	63.56	107,300	6,819,988.00
9	300376	易事特	2023年1月5日-2023年1月12日	6.83	78,500	536,155.00
10	300393	中来股份	2023年1月3日-2023年1月10日	14.82	157,200	2,329,704.00
11	300724	捷佳伟创	2023年1月3日-2023年1月10日	114.02	86,100	9,817,122.00
12	000591	太阳能	2023年1月2日-2023年1月13日	7.33	5,897,700	43,230,141.00
13	300751	迈为股份	2023年1月2日-2023年1月13日	411.84	15,000	6,177,600.00
14	300763	锦浪科技	2023年1月2日-2023年1月13日	180.05	484,500	87,234,225.00
15	300776	帝尔激光	2023年1月3日-2023年1月10日	126.00	8,600	1,083,600.00
16	300861	美畅股份	2023年1月5日-2023年1月12日	49.16	13,000	639,080.00
17	301268	铭利达	2023年1月5日-2023年1月12日	50.21	2,000	100,420.00
18	600032	浙江新能	2023年1月4日-2023年1月6日	11.49	30,000	344,700.00
19	600089	特变电工	2023年1月2日-2023年1月13日	20.08	713,000	14,317,040.00
20	600151	航天机电	2023年1月3日-2023年1月13日	8.15	167,400	1,364,310.00
21	600438	通威股份	2023年1月2日-2023年1月13日	38.58	496,900	19,170,402.00
22	600481	双良节能	2023年1月2日-2023年1月13日	12.94	1,521,000	19,681,740.00
23	000875	吉电股	2023年1月2日-2023年	6.09	813,100	4,951,779

		份	1月13日			.00
24	600732	爱旭股份	2023年1月3日-2023年1月4日	37.82	1,760,000	66,563,200.00
25	601012	隆基绿能	2023年1月3日-2023年1月12日	42.26	219,800	9,288,748.00
26	601222	林洋能源	2023年1月2日-2023年1月13日	8.59	385,800	3,314,022.00
27	601778	晶科科技	2023年1月4日-2023年1月10日	5.50	141,400	777,700.00
28	601865	福莱特	2023年1月2日-2023年1月13日	33.31	628,200	20,925,342.00
29	601877	正泰电器	2023年1月3日-2023年1月13日	27.70	180,500	4,999,850.00
30	601908	京运通	2023年1月2日-2023年1月13日	6.57	698,200	4,587,174.00
31	603063	禾望电气	2023年1月4日-2023年1月10日	27.88	50,000	1,394,000.00
32	603098	森特股份	2023年1月4日-2023年1月6日	28.22	30,000	846,600.00
33	603185	上机数控	2023年1月2日-2023年1月13日	105.85	290,000	30,696,500.00
34	002056	横店东磁	2023年1月3日-2023年1月13日	18.74	222,500	4,169,650.00
35	603688	石英股份	2023年1月5日-2023年1月12日	131.32	20,000	2,626,400.00
36	603806	福斯特	2023年1月3日-2023年1月13日	66.44	94,700	6,291,868.00
37	605117	德业股份	2023年1月5日-2023年1月12日	331.20	20,000	6,624,000.00
38	688303	大全能源	2023年1月5日-2023年1月10日	47.68	214,500	10,227,360.00
39	688390	固德威	2023年1月2日-2023年1月13日	323.09	144,800	46,783,432.00
40	688408	中信博	2023年1月2日-2023年1月13日	98.40	33,300	3,276,720.00
41	688516	奥特维	2023年1月2日-2023年1月13日	201.00	10,600	2,130,600.00
42	688556	高测股份	2023年1月5日-2023年1月12日	75.02	12,300	922,746.00
43	688598	金博股份	2023年1月3日-2023年1月13日	219.48	117,500	25,788,900.00
44	688599	天合光能	2023年1月2日-2023年1月13日	63.76	2,057,800	131,205,328.00
45	002129	TCL中	2023年1月3日-2023年	37.66	388,600	14,634,67

		环	1月13日			6.00
46	688680	海优新材	2023年1月2日-2023年1月13日	185.30	35,600	6,596,680.00
47	002335	科华数据	2023年1月4日-2023年1月10日	49.89	137,800	6,874,842.00
48	002459	晶澳科技	2023年1月2日-2023年1月12日	60.09	2,286,600	137,401,794.00
49	002506	协鑫集成	2023年1月3日-2023年1月13日	2.91	573,700	1,669,467.00
50	002518	科士达	2023年1月2日-2023年1月13日	57.60	159,700	9,198,720.00
合计	-	-	-	-	33,547,100	883,573,836.00

#### 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、流通受限的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。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	63,553,571.07	-	-	-	-	-	63,553,571.07
结算备付金	14,539,280.98	-	-	-	-	-	14,539,280.98
存出保证金	2,653,045.71	-	-	-	-	-	2,653,045.71
交易性金融资产	-	-	-	-	-	13,673,717,750.09	13,673,717,750.09
应收清算款	-	-	-	-	-	23,281,382.42	23,281,382.42
其他资产	-	-	-	-	-	481,662.95	481,662.95
资产总计	80,745,897.76	-	-	-	-	13,697,480,795.46	13,778,226,693.22

负债							
交易性金融负债						120,885.09	120,885.09
应付管理人报酬						5,951,180.86	5,951,180.86
应付托管费						1,190,236.18	1,190,236.18
应付清算款						13,613.12	13,613.12
应交税费						54.19	54.19
其他负债						49,602,038.51	49,602,038.51
负债总计						56,878,007.95	56,878,007.95
利率敏感度缺口	80,745,897.76					-13,640,602,787.51	13,721,348,685.27
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	61,549,486.46						61,549,486.46
结算备付金	30,088,466.52						30,088,466.52
存出保证金	5,467,472.54						5,467,472.54
交易性金融资产						-14,082,282,525.20	14,082,282,525.20
应收清算款						54,224,246.89	54,224,246.89
其他资产						304,991.40	304,991.40
资产总计	97,105,425.52					-14,136,811,763.49	14,233,917,189.01
负债							
交易性金融负债						792,041.06	792,041.06
应付管理人报酬						6,303,640.95	6,303,640.95
应付托管费						1,260,728.19	1,260,728.19
应付清算款						3,772,710.20	3,772,710.20
应交税费						0.53	0.53
其他负债						85,466,012.85	85,466,012.85
负债总计						97,595,133.78	97,595,133.78
利率敏感度缺口	97,105,425.52					-14,039,216,629.71	14,136,322,055.23

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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的股票，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	13,673,717,750.09	99.65	14,082,282,525.20	99.62
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	-120,885.09	-0.00	-792,041.06	-0.01
合计	13,673,596,865.00	99.65	14,081,490,484.14	99.61

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除中证光伏产业指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末（2022年12月31日）	上年度末（2021年12月31日）
	中证光伏产业指数	681,311,842.22	700,807,755.95

	上升 5%		
	中证光伏产业指数	-681,311,842.22	-700,807,755.95
	下降 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	13,671,391,760.51	14,079,747,927.08
第二层次	-	2,534,598.12
第三层次	2,325,989.58	-
合计	13,673,717,750.09	14,082,282,525.20

###### 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		
	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	-	2,894,233.21	2,894,233.21
转出第三层次	-	662,274.07	662,274.07
当期利得或损失总额	-	94,030.44	94,030.44
其中：计入损益的利得或损失	-	94,030.44	94,030.44
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	2,325,989.58	2,325,989.58
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	-	106,246.05	106,246.05
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	2,325,989.58	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 29,261,069,247.37 元(2021 年度：37,787,087,593.03 元)，其中包括以股票支付的申购款 14,363,991,586.76 元和以现金支付的申购款 14,897,077,660.61 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 17,622,152,345.21 元和以现金支付的申购款 20,164,935,247.82 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	13,673,717,750.09	99.24
	其中：股票	13,673,717,750.09	99.24
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	78,092,852.05	0.57
8	其他各项资产	26,416,091.08	0.19
9	合计	13,778,226,693.22	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 883,573,836.00 元，占本基金期末资产净值的 6.44%。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 3,933,328 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 603,805,185.00 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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	13,125,717,018.85	95.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	418,020,418.56	3.05
E	建筑业	61,927,068.58	0.45
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	-	-
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	65,658,531.96	0.48
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	13,671,323,037.95	99.64

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	1,955,905.05	0.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	251,288.81	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	36,966.88	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	106,663.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,394,712.14	0.02

注：上述股票投资不包括可退替代款估值增值。

### 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：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

## 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	601012	隆基绿能	30,544,360	1,290,804,653.60	9.41
2	300274	阳光电源	10,587,947	1,183,732,474.60	8.63
3	600438	通威股份	27,510,113	1,061,340,159.54	7.73
4	002129	TCL 中环	26,317,931	991,133,281.46	7.22
5	600089	特变电工	39,446,669	792,089,113.52	5.77
6	688599	天合光能	11,046,121	704,300,674.96	5.13
7	002459	晶澳科技	9,593,990	576,502,859.10	4.20
8	300316	晶盛机电	6,654,462	422,957,604.72	3.08
9	300751	迈为股份	881,056	362,854,103.04	2.64
10	603806	福斯特	5,427,882	360,628,480.08	2.63
11	300763	锦浪科技	1,918,890	345,496,144.50	2.52
12	300724	捷佳伟创	2,835,805	323,338,486.10	2.36
13	605117	德业股份	958,167	317,344,910.40	2.31
14	601877	正泰电器	10,949,736	303,307,687.20	2.21
15	600732	爱旭股份	6,965,960	263,452,607.20	1.92
16	688390	固德威	763,802	246,776,788.18	1.80
17	603688	石英股份	1,776,906	233,343,295.92	1.70
18	603185	上机数控	2,092,566	221,498,111.10	1.61
19	300118	东方日升	7,268,077	180,393,671.14	1.31
20	000591	太阳能	23,898,940	175,179,230.20	1.28
21	601865	福莱特	5,185,084	172,715,148.04	1.26
22	688598	金博股份	769,883	168,973,920.84	1.23
23	688516	奥特维	821,160	165,053,160.00	1.20
24	002335	科华数据	3,290,802	164,178,111.78	1.20
25	002056	横店东磁	8,286,718	155,293,095.32	1.13
26	688303	大全能源	2,913,763	138,928,219.84	1.01
27	002518	科士达	2,373,265	136,700,064.00	1.00
28	688556	高测股份	1,794,115	134,594,507.30	0.98
29	300393	中来股份	8,882,460	131,638,057.20	0.96
30	002610	爱康科技	45,644,300	130,086,255.00	0.95
31	601222	林洋能源	14,692,847	126,211,555.73	0.92
32	003022	联泓新科	4,081,315	123,867,910.25	0.90
33	600481	双良节能	9,510,015	123,059,594.10	0.90
34	002506	协鑫集成	41,726,587	121,424,368.17	0.88
35	000875	吉电股份	19,901,254	121,198,636.86	0.88
36	300776	帝尔激光	868,764	109,464,264.00	0.80
37	002617	露笑科技	11,757,000	108,517,110.00	0.79
38	601778	晶科科技	17,692,133	97,306,731.50	0.71

39	601908	京运通	14,760,351	96,975,506.07	0.71
40	688680	海优新材	520,067	96,368,415.10	0.70
41	300861	美畅股份	1,952,866	96,002,892.56	0.70
42	000012	南玻 A	13,985,506	93,842,745.26	0.68
43	603063	禾望电气	3,146,600	87,727,208.00	0.64
44	600151	航天机电	10,224,984	83,333,619.60	0.61
45	688408	中信博	833,681	82,034,210.40	0.60
46	300376	易事特	11,814,100	80,690,303.00	0.59
47	003035	南网能源	11,579,988	65,658,531.96	0.48
48	603098	森特股份	2,194,439	61,927,068.58	0.45
49	600032	浙江新能	2,118,000	24,335,820.00	0.18
50	301268	铭利达	333,433	16,741,670.93	0.12

注：股票明细不包含可退替代款估值增（减）值。

### 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	688114	华大智造	5,336	560,546.80	0.00
2	688141	N杰华特	9,946	436,529.94	0.00
3	688353	华盛锂电	4,358	278,301.88	0.00
4	688376	美埃科技	3,713	105,783.37	0.00
5	301269	华大九天	1,168	102,713.92	0.00
6	688143	长盈通	1,938	82,675.08	0.00
7	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.00
8	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
9	301095	广立微	740	64,002.60	0.00
10	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
11	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
12	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
13	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
14	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
15	301301	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	300274	阳光电源	2,483,073,507.83	17.57
2	002129	TCL 中环	2,289,584,236.80	16.20
3	300450	先导智能	1,298,000,117.19	9.18
4	002459	晶澳科技	1,260,295,452.47	8.92
5	300751	迈为股份	973,906,547.75	6.89
6	300316	晶盛机电	879,222,665.87	6.22
7	300763	锦浪科技	709,805,255.42	5.02
8	300724	捷佳伟创	577,553,981.66	4.09
9	300118	东方日升	418,403,437.06	2.96
10	000591	太阳能	405,722,164.00	2.87
11	300776	帝尔激光	385,983,081.93	2.73

12	002610	爱康科技	350,307,854.91	2.48
13	605117	德业股份	346,413,321.00	2.45
14	300393	中来股份	334,698,880.66	2.37
15	002056	横店东磁	331,288,278.95	2.34
16	601012	隆基绿能	324,539,288.76	2.30
17	002506	协鑫集成	309,402,725.19	2.19
18	000875	吉电股份	304,512,645.40	2.15
19	003022	联泓新科	303,044,643.94	2.14
20	002617	露笑科技	289,371,309.19	2.05

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	300274	阳光电源	2,309,622,363.46	16.34
2	002129	TCL 中环	2,141,031,450.93	15.15
3	300450	先导智能	1,737,680,768.50	12.29
4	002459	晶澳科技	1,217,280,608.52	8.61
5	300751	迈为股份	952,464,532.31	6.74
6	300316	晶盛机电	851,290,024.70	6.02
7	300763	锦浪科技	628,473,583.80	4.45
8	300724	捷佳伟创	497,372,310.77	3.52
9	300118	东方日升	413,697,814.20	2.93
10	300776	帝尔激光	376,760,107.37	2.67
11	000591	太阳能	368,722,818.46	2.61
12	002056	横店东磁	342,549,107.34	2.42
13	002610	爱康科技	338,584,355.57	2.40
14	002506	协鑫集成	303,148,328.96	2.14
15	601012	隆基绿能	285,562,659.87	2.02
16	300393	中来股份	285,511,061.26	2.02
17	002617	露笑科技	272,985,171.99	1.93
18	000875	吉电股份	270,738,961.45	1.92
19	000012	南玻 A	205,601,642.27	1.45
20	002335	科华数据	183,761,509.30	1.30

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	17,771,574,119.56
卖出股票收入（成交）总额	16,262,020,981.17

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

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

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

注：本基金本报告期末未持有股指期货。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

#### 8.11.1 本期国债期货投资政策

注：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

注：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。

#### 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	2,653,045.71
2	应收清算款	23,281,382.42
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	481,662.95

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	26,416,091.08

#### 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	002459	晶澳科技	137,401,794.00	1.00	转融通证券出借
2	688599	天合光能	131,205,328.00	0.96	转融通证券出借
3	300274	阳光电源	23,064,340.00	0.17	转融通证券出借
4	600438	通威股份	19,170,402.00	0.14	转融通证券出借
5	002129	TCL 中环	14,634,676.00	0.11	转融通证券出借
6	600089	特变电工	14,317,040.00	0.10	转融通证券出借
7	601012	隆基绿能	9,288,748.00	0.07	转融通证券出借
8	300316	晶盛机电	6,819,988.00	0.05	转融通证券出借
9	603806	福斯特	6,291,868.00	0.05	转融通证券出借
10	300751	迈为股份	6,177,600.00	0.05	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	688114	华大智造	560,546.80	0.00	新股锁定期内
2	688141	杰华特	436,529.94	0.00	新股锁定期内
3	688353	华盛锂电	278,301.88	0.00	新股锁定期内
4	688376	美埃科技	105,783.37	0.00	新股锁定期内
5	301269	华大九天	102,713.92	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	户均持有	持有人结构
-----	------	-------

户数 (户)	的基金份 额	机构投资者		个人投资者		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	
		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 (%)
246,057	40,606.42	4,922,553,788.00	49.27	4,521,961,186.00	45.26	546,979,026.00	5.47

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	汇添富基金—中国人 寿保险股份有限公司 —分红险—汇添富基 金国寿股份成长股票 型组合	453,110,542.00	4.53
2	华夏基金—中央汇金 资产管理有限责任公 司—华夏基金—汇金 资管单一资产管理计 划	396,843,836.00	3.97
3	中国人寿保险股份有 限公司	239,125,613.00	2.39
4	汇添富基金—中国人 寿保险股份有限公司 —传统险—汇添富国 寿股份成长股票传统 可供出	212,012,200.00	2.12
5	北京诚通金控投资有 限公司	174,297,300.00	1.74
6	中国人寿保险 (集团) 公司	152,215,442.00	1.52
7	华夏人寿保险股份有 限公司—自有资金	103,135,400.00	1.03
8	招商财富资管—青银 理财璀璨人生奋斗系 列开放式净值型人民 币个人理财计划—招 商财富	100,843,400.00	1.01
9	中国平安财产保险股 份有限公司—传统— 普通保险产品	96,325,153.00	0.96

10	中国平安人寿保险股份有限公司一万个险万能	89,775,200.00	0.90
----	----------------------	---------------	------

### 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	45,600.00	0.0005

### 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（2020年12月7日）基金份额总额	1,718,494,000.00
本报告期期初基金份额总额	8,278,494,000.00
本报告期基金总申购份额	19,476,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	17,763,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	9,991,494,000.00

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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，陆桢女士、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。

本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 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

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 120,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 2 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 (%)	
华泰证券	4	12,673,931,132.65	37.28	11,599,748.50	37.53	-
长江证券	4	7,813,592,148.40	22.98	7,198,682.61	23.29	-
东方证券	3	2,486,562,030.46	7.31	2,285,495.68	7.40	-
东北证券	1	2,444,837,798.50	7.19	2,276,898.62	7.37	-
中信证券	5	2,077,046,204.06	6.11	1,498,178.47	4.85	-
申港证券	2	1,780,454,05	5.24	1,640,338.00	5.31	-

		6.19				
东方财富 证券	2	1,716,975,65 0.25	5.05	1,592,804.74	5.15	-
海通证券	2	1,400,396,99 6.07	4.12	1,330,467.05	4.31	-
中信建投	2	961,715,520. 04	2.83	886,033.83	2.87	-
国信证券	2	247,272,687. 63	0.73	230,285.00	0.75	-
华鑫证券	1	194,122,627. 93	0.57	177,712.55	0.58	-
中泰证券	4	180,109,877. 29	0.53	167,738.00	0.54	-
银河证券	5	21,215,443.8 2	0.06	19,545.77	0.06	-
安信证券	3	-	-	-	-	-
北京高华	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
财通证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
大同证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国都证券	1	-	-	-	-	-
国海证券	1	-	-	-	-	-
国金证券	1	-	-	-	-	-
国联证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
国元证券	1	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华福证券	1	-	-	-	-	-
华龙证券	1	-	-	-	-	-
华融证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源	3	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

西藏同信	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
湘财证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	2	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	3	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-
浙商证券	2	-	-	-	-	-
中金财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中银国际	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为，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务；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、本报告期内，无变更租用证券公司交易单元的情况。

### 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(%)
华泰证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-

东方证 券	-	-	-	-	-	-
东北证 券	16,681,282. 69	18.31	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
申港证 券	-	-	-	-	-	-
东方财 富证券	12,442,201. 20	13.66	-	-	-	-
海通证 券	4,680,463.4 8	5.14	-	-	-	-
中信建 投	-	-	-	-	-	-
国信证 券	36,203,573. 90	39.75	-	-	-	-
华鑫证 券	4,830,600.4 9	5.30	-	-	-	-
中泰证 券	16,242,285. 33	17.83	-	-	-	-
银河证 券	-	-	-	-	-	-
安信证 券	-	-	-	-	-	-
北京高 华	-	-	-	-	-	-
渤海证 券	-	-	-	-	-	-
财通证 券	-	-	-	-	-	-
长城证 券	-	-	-	-	-	-
大同证 券	-	-	-	-	-	-
东吴证 券	-	-	-	-	-	-
东兴证 券	-	-	-	-	-	-
方正证 券	-	-	-	-	-	-
光大证 券	-	-	-	-	-	-
广发证 券	-	-	-	-	-	-

国都证 券	-	-	-	-	-	-
国海证 券	-	-	-	-	-	-
国金证 券	-	-	-	-	-	-
国联证 券	-	-	-	-	-	-
国泰君 安	-	-	-	-	-	-
国元证 券	-	-	-	-	-	-
恒泰证 券	-	-	-	-	-	-
华安证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华福证 券	-	-	-	-	-	-
华龙证 券	-	-	-	-	-	-
华融证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
瑞银证 券	-	-	-	-	-	-
申万宏 源	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西藏同 信	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
湘财证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-

信达证 券	-	-	-	-	-	-
兴业证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中金财 富证券	-	-	-	-	-	-
中金公 司	-	-	-	-	-	-
中银国 际	-	-	-	-	-	-

### 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	证监会规定报刊和网站	2022年9月4日

	基金投资关联方承销期内承销证券的公告		
11	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
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 14 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 7 月 22 日
14	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	证监会规定报刊和网站	2022 年 7 月 20 日
15	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
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 7 日
17	华泰柏瑞基金管理有限公司关于旗下管理的上海证券交易所上市 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 6 月 17 日
18	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
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 26 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 11 日
21	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
22	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 4 月 16 日
23	关于同意中国国际金融股份有限公司为华泰柏瑞中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金提供主做市服务的公告	证监会规定报刊和网站	2022 年 3 月 23 日
24	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加	证监会规定报刊和网站	2022 年 1 月 4 日

	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		
25	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

注：本基金本报告期内未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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 层及托管人住所

### 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