

# 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 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：中国建设银行股份有限公司

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。

基金托管人中国建设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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
<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>17</b>
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>19</b>
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 净资产（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	24
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>152</b>

8.1 期末基金资产组合情况 .....	152
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	152
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 .....	154
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 .....	155
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 .....	157
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 .....	157
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 .....	157
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 .....	157
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 .....	157
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	157
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	157
8.12 投资组合报告附注 .....	157
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>158</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	158
9.2 期末上市基金前十名持有人 .....	159
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	159
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 .....	159
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>160</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>160</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	160
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 .....	160
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	160
11.4 基金投资策略的改变 .....	161
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	161
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 .....	161
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	161
11.8 其他重大事件 .....	165
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>166</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 .....	166
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	166
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>166</b>
13.1 备查文件目录 .....	166
13.2 存放地点 .....	166
13.3 查阅方式 .....	167

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	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
基金简称	科创板 ETF
场内简称	科创板(扩位证券简称:科创板 ETF)
基金主代码	588090
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 9 月 28 日
基金管理人	华泰柏瑞基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	3,571,672,758.00 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 11 月 16 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	上证科创板 50 成份指数
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期风险与收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金；本基金为指数型基金，主要采用完全复制策略，跟踪上证科创板 50 成份指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。

### 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	中国建设银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	刘万方
	联系电话	021-38601777
	电子邮箱	cs4008880001@huatai-pb.com
客户服务电话	400-888-0001	021-60637228
传真	021-38601799	021-60635778
注册地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证 大五道口广场 1 号 17 层	北京市西城区金融大街 25 号
办公地址	上海市浦东新区民生路 1199 弄证	北京市西城区闹市口大街 1 号院

	大五道口广场 1 号 17 层	1 号楼
邮政编码	200135	100033
法定代表人	贾波	田国立

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	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 9 月 28 日(基金合同生效日) - 2020 年 12 月 31 日
本期已实现收益	-550,265,870.53	364,918,413.06	-140,051,467.42
本期利润	-1,090,384,652.39	232,038,435.71	36,589,579.62
加权平均基金份额本期利润	-0.3930	0.0916	0.0083
本期加权平均净值利润率	-35.62%	6.34%	0.69%
本期基金份额净值增长率	-31.56%	0.78%	0.52%
3.1.2 期末数据和指标	2022 年末	2021 年末	2020 年末
期末可供分配利润	-1,568,604,607.32	37,940,294.95	-131,649,814.38
期末可供分配基金份额利润	-0.4392	0.0186	-0.0380
期末基金	3,546,598,670.07	2,952,488,056.43	4,984,218,491.66

资产净值			
期末基金份额净值	0.9930	1.4508	1.4395
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	-30.66%	1.31%	0.52%

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。

4、本基金于 2020 年 11 月 9 日建仓完毕并进行了基金份额折算，折算比例为 0.69829249。期末还原后基金份额累计净值=（期末基金份额净值+基金份额累计分红金额）×折算比例，该净值可反映投资者在认购期以份额面值 1.00 元购买科创板 ETF 后的实际份额净值变动情况。

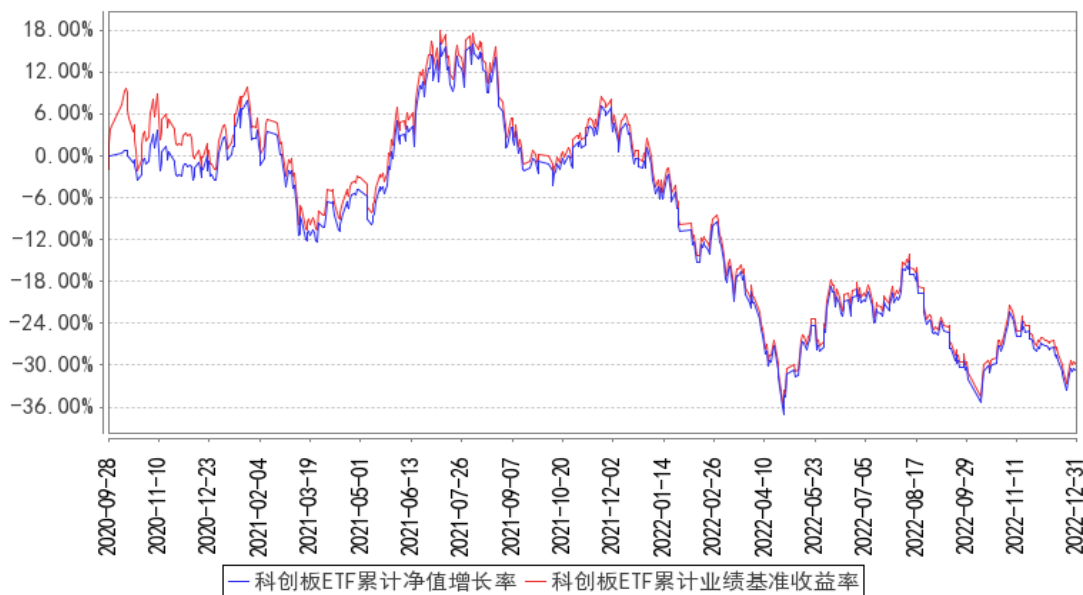
## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	1.91%	1.43%	2.19%	1.43%	-0.28%	0.00%
过去六个月	-13.51%	1.43%	-13.18%	1.43%	-0.33%	0.00%
过去一年	-31.56%	1.71%	-31.35%	1.72%	-0.21%	-0.01%
自基金合同生效起至今	-30.66%	1.59%	-29.63%	1.64%	-1.03%	-0.05%

### 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

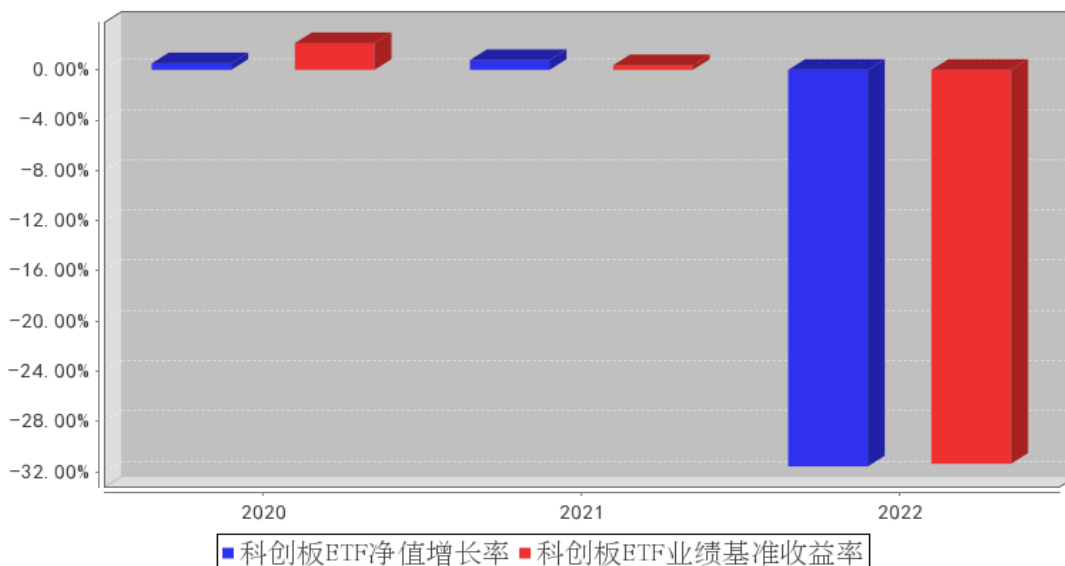
科创板ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



注：图示日期为2020年9月28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

科创板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9月28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		
柳军	指数投资部总监、本基金的基金经理	2020 年 9 月 28 日	-	21 年	21 年证券 (基金) 从业经历, 复旦大学财务管理硕士, 2000-2001 年任上海汽车集团财务有限公司财务, 2001-2004 年任华安基金管理有限公司高级基金核算员, 2004 年 7 月加入华泰柏瑞基金管理有限公司, 历任基金事务部总监、上证红利 ETF 基金经理助理。2009 年 6 月起任上证红利交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2010 年 10 月起担任指数投资部副总监。2011 年 1 月至 2020 年 2 月任华泰柏瑞上证中小盘 ETF 基金、华泰柏瑞上证中小盘 ETF 联接基金基金经理。2012 年 5 月起任华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金、华泰柏瑞沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2015 年 2 月起任指数投资部总监。2015 年 5 月起任华泰柏瑞中证 500 交易型开放式指数证券投资基金及华泰柏瑞中证

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

注：证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。任职日期和离职日期指基金管理公司作出决定之日。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

##### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本基金管理人根据《异常交易监控与管理办法》对投资交易过程中可能发生的异常交易行为进行监督和管理。投资部负责对异常交易行为进行事前识别和检查，交易部负责对异常交易行为的事中监督和控制，风险管理部及异常交易评估小组负责异常交易行为的事后审查和评估。本报

告期内，该制度执行情况良好，无论在二级市场还是在大宗交易或者一级市场申购等交易中，均没有发现影响证券价格或者严重误导其他投资者等异常交易行为。

本报告期内，本基金与公司所管理的其他投资组合参与交易所公开竞价单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的同日反向交易共 1 次，系因被动跟踪标的指数需要与其他组合发生反向交易，不存在利益输送行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

我们严格按照基金合同的规定，紧密跟踪标的指数、跟踪偏离最小化的投资策略进行被动投资。本报告期内，本基金的日均绝对跟踪偏离度为 0.015%，期间日跟踪误差为 0.031%，较好地实现了本基金的投资目标。

##### 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 0.9930 元，本报告期基金份额净值增长率为-31.56%，同期本基金的业绩比较基准收益率为-31.35%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2022 年，在俄乌冲突全面爆发之后，全球滞胀格局加剧，传统能源以及资源运输成为全年表现最为亮眼的行业；对于国内而言，疫情防控与房地产政策的变化始终影响着投资者的基本面预期，宏观波动率成为了定价的核心。展望 2023 年，疫情缓和与地产政策边际回暖，海外通胀持续回落、美联储加息放缓几乎已成共识。从投资的角度，较艰难的时刻或许已经过去。在市场盈利增速修复的背景下，当前较低的估值水平下指数获得估值修复的概率更大，市场整体 Beta 机会不可忽视。风格上，全年存在大小盘风格切换行情，海外加息放缓与“中国式现代化”特征的估值体系或成为风格切换的核心变量。行业层面，从海外经验，疫情达峰后带动消费复苏，食品饮料、

旅游出行等板块或会有修复性行情。同时，关注政策边际变化、可能困境反转的行业，比如地产、大金融板块。最后，关注景气改善的行业，比如光伏、TMT 等行业。即便如此，投资者在未来一段时间内依然时刻面临着诸多的不确定性，比如国内经济复苏的程度、海外经济衰退的程度等，投资或仍需谨慎乐观。

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

#### 4.6 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，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。



## § 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 24703 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	华泰柏瑞上证科创板 50 成份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上证科创板 50 成份交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF 基金”)的财务报表,包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表,2022 年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF 基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF 基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>华泰柏瑞上证科创板 50 成份 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上证科创板 50 成份 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上证科创板 50 成份 ETF 基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p>

	基金管理人治理层负责监督华泰柏瑞上证科创板 50 成份 ETF 基金的财务报告过程。	
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对华泰柏瑞上证科创板 50 成份 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上证科创板 50 成份 ETF 基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	朱宏宇	朱寅婷
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路 202 号领展企业广场 2 座普华永道中心 11 楼	
审计报告日期	2023 年 3 月 28 日	

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：华泰柏瑞上证科创板 50 成份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	18,208,559.64	15,953,240.31
结算备付金		1,134,273.81	1,202,947.99
存出保证金		13,974.20	31,061.12
交易性金融资产	7.4.7.2	3,529,224,926.48	2,937,813,770.32
其中：股票投资		3,529,224,926.48	2,937,813,770.32
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		987,908.31	370,675.50
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	99,539.25	177,151.97
资产总计		3,549,669,181.69	2,955,548,847.21
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2021 年 12 月 31 日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4.25
应付赎回款		-	-

应付管理人报酬		1,511,384.54	1,250,110.51
应付托管费		302,276.91	250,022.09
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		0.21	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	1,256,849.96	1,560,653.93
负债合计		3,070,511.62	3,060,790.78
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.10	5,115,203,277.39	2,914,547,761.48
其他综合收益	7.4.7.11	-	-
未分配利润	7.4.7.12	-1,568,604,607.32	37,940,294.95
净资产合计		3,546,598,670.07	2,952,488,056.43
负债和净资产总计		3,549,669,181.69	2,955,548,847.21

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.9930 元，基金份额总额 3,571,672,758.00 份。

## 7.2 利润表

会计主体：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

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>		-1,070,832,974.11	259,348,201.00
1. 利息收入		4,393,662.77	7,263,192.40
其中：存款利息收入	7.4.7.13	80,125.03	108,294.02
债券利息收入		-	1,347.83
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		4,313,537.74	7,153,550.55
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-535,188,957.99	384,791,397.85
其中：股票投资收益	7.4.7.14	-549,882,273.66	373,879,418.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.15	3,220,503.68	756,763.92
资产支持证券投	7.4.7.16	-	-

资收益			
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	11,472,811.99	10,155,215.82
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	-540,118,781.86	-132,879,977.35
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	81,102.97	173,588.10
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>19,551,678.28</b>	<b>27,309,765.29</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	15,216,741.78	18,374,188.31
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,043,348.34	3,674,837.64
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		8.69	4.86
8. 其他费用	7.4.7.23	1,291,579.47	5,260,734.48
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-1,090,384,652.39</b>	<b>232,038,435.71</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-1,090,384,652.39</b>	<b>232,038,435.71</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>	<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-1,090,384,652.39</b>	<b>232,038,435.71</b>

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：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

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）	2,914,547,761.	-	37,940,294.95	2,952,488,056.4

	48			3
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	2,914,547,761.48	-	37,940,294.95	2,952,488,056.43
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	2,200,655,515.91	-	-1,606,544,902.27	594,110,613.64
(一)、综合收益总额	-	-	-1,090,384,652.39	-1,090,384,652.39
(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)	2,200,655,515.91	-	-516,160,249.88	1,684,495,266.03
其中：1. 基金申购款	4,602,386,155.24	-	-1,051,334,866.17	3,551,051,289.07
2. 基金赎回款	-2,401,730,639.33	-	535,174,616.29	-1,866,556,023.04
(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)	5,115,203,277.39	-	-1,568,604,607.32	3,546,598,670.07
项目	上年度可比期间			
	2021年1月1日至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	4,958,811,514.	-	25,406,976.72	4,984,218,491.6

	94			6
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	4,958,811,514.94	-	25,406,976.72	4,984,218,491.66
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,044,263,753.46	-	12,533,318.23	-2,031,730,435.23
(一)、综合收益总额	-	-	232,038,435.71	232,038,435.71
(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)	-2,044,263,753.46	-	-219,505,117.48	-2,263,768,870.94
其中：1. 基金申购款	3,321,463,147.43	-	-27,700,721.28	3,293,762,426.15
2. 基金赎回款	-5,365,726,900.89	-	-191,804,396.20	-5,557,531,297.09
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,914,547,761.48	-	37,940,294.95	2,952,488,056.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

韩勇

房伟力

赵景云

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

华泰柏瑞上证科创板 50 成份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 2188 号《关于准予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注册的批复》注册,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《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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 5,498,735,457.00 元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第 0852 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《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基金合同》于 2020 年 9 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 5,498,735,457.00 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,基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]364 号核准,本基金 3,839,472,758.00 份基金份额于 2020 年 11 月 16 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《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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)、存托凭证、债券(包括国债、金融债、企业债、公司债、公开发行的次级债、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、金融衍生工具(包括股指期货、股票期权、国债期货等)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%。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上证科创板 50 成份指数收益率。

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》、《华泰柏瑞上证科创板 50 成份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、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

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

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关

资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息后的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，

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

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

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、债券投资和资产支持证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 15,953,240.31 元、1,202,947.99 元、31,061.12 元、177,151.97 元和 370,675.50 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 15,955,172.22 元、1,203,573.60 元、31,076.52 元、174,579.05 元和 370,675.50 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,937,813,770.32 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 2,937,813,770.32 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 4.25 元、1,250,110.51 元、250,022.09 元、1,097,892.70 元和 232,761.23 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 4.25 元、1,250,110.51 元、250,022.09 元、1,097,892.70 元和 232,761.23 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	18,208,559.64		15,953,240.31
等于：本金	18,206,705.20		15,953,240.31	
加：应计利息	1,854.44		-	
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	18,208,559.64		15,953,240.31	

## 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	4,025,582,638.65	-	3,529,224,926.48	-496,357,712.17
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	4,025,582,638.65	-	3,529,224,926.48	-496,357,712.17
项目	上年度末 2021年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,894,052,700.63	-	2,937,813,770.32	43,761,069.69

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	2,894,052,700.63	-	2,937,813,770.32	43,761,069.69

#### 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	-	177,151.97
其他应收款	99,539.25	-
待摊费用	-	-
合计	99,539.25	177,151.97

#### 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	784,949.30	1,097,892.70
其中：交易所市场	784,949.30	1,097,892.70
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	220,000.00	230,000.00
应付指数使用费	251,900.66	232,761.23
合计	1,256,849.96	1,560,653.93

#### 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	2,035,072,758.00	2,914,547,761.48
本期申购	3,213,600,000.00	4,602,386,155.24
本期赎回（以“-”号填列）	-1,677,000,000.00	-2,401,730,639.33
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	3,571,672,758.00	5,115,203,277.39

#### 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	246,601,245.67	-208,660,950.72	37,940,294.95
本期利润	-550,265,870.53	-540,118,781.86	-1,090,384,652.39
本期基金份额交易产生的变动数	35,773,758.21	-551,934,008.09	-516,160,249.88
其中：基金申购款	76,009,809.73	-1,127,344,675.90	-1,051,334,866.17
基金赎回款	-40,236,051.52	575,410,667.81	535,174,616.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-267,890,866.65	-1,300,713,740.67	-1,568,604,607.32

#### 7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
活期存款利息收入	45,438.79	45,088.45
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	34,086.87	57,197.28
其他	599.37	6,008.29
合计	80,125.03	108,294.02

#### 7.4.7.14 股票投资收益

##### 7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-295,817,812.98	43,655,967.96
股票投资收益——赎回差价收入	-254,064,460.68	330,223,450.15
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	-549,882,273.66	373,879,418.11

#### 7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	1,199,383,944.70	1,739,812,547.12
减：卖出股票成本总额	1,491,750,140.96	1,696,156,579.16
减：交易费用	3,451,616.72	-
买卖股票差价收入	-295,817,812.98	43,655,967.96

#### 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	1,866,556,023.04	5,557,531,297.09
减：现金支付赎回款总额	4,612,566.04	70,214,544.09
减：赎回股票成本总额	2,116,007,917.68	5,157,093,302.85
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-254,064,460.68	330,223,450.15

#### 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	2,392.76	-

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	3,218,110.92	756,763.92
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	3,220,503.68	756,763.92

#### 7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年1月1日至2022年12月31日	2021年1月1日至2021年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	14,192,862.58	5,933,152.20
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,972,000.00	5,175,000.00
减：应计利息总额	2,465.03	1,388.28
减：交易费用	286.63	-
买卖债券差价收入	3,218,110.92	756,763.92

#### 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	11,472,811.99	10,155,215.82
其中：证券出借权益补偿收入	539,302.63	575,647.60
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,472,811.99	10,155,215.82

#### 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	-540,118,781.86	-132,879,977.35
股票投资	-540,118,781.86	-132,879,977.35
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	-540,118,781.86	-132,879,977.35

#### 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	81,102.97	173,588.10
合计	81,102.97	173,588.10

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	100,000.00	110,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	913,004.51	1,102,451.29
存托服务费	7,973.20	-
银行划款手续费	601.76	716.94
交易费用	-	3,777,566.25
注册登记费(中登上海)	150,000.00	150,000.00
合计	1,291,579.47	5,260,734.48

#### 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
中国建设银行股份有限公司（“建设银行”）	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（“科创 50ETF 联接”）	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	-	-	2,017,772,494.54	56.86

##### 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	-	-	-	-
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	265,525.86	16.34	-	-
------	------------	-------	---	---

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

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

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	15,216,741.78	18,374,188.31
其中：支付销售机构的客户维护费	188,142.24	314,218.08

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 2022年1月1日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年1月1日至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,043,348.34	3,674,837.64

注：支付基金托管人中国建设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

注：本基金本报告期内及上年度可比期间未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

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

单位：人民币元

本期 2022年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	202201040000464	中芯国际	2022年1月4日	1,891,784.00	35,600	14	2.000	1,471.40	-	-
华泰证券	2022010400020257	康希诺	2022年1月4日	1,112,000.00	4,000	14	3.400	1,470.28	-	-
华泰证券	2022010400023063	传音控股	2022年1月4日	433,323.00	2,700	14	3.400	572.88	-	-
华泰证券	2022010400023073	中微公司	2022年1月4日	2,402,200.00	20,000	14	3.400	3,176.18	-	-
华泰证券	2022010400023079	康希诺	2022年1月4日	1,473,400.00	5,300	14	3.400	1,948.10	-	-
华泰证券	2022010400023083	恒玄科技	2022年1月4日	731,760.00	2,400	14	3.400	967.54	-	-
华泰证券	2022010400023085	金山办公	2022年1月4日	12,361,074.00	47,900	14	3.400	16,344.02	-	-
华泰证券	2022010500000799	传音控股	2022年1月5日	4,008,120.00	25,400	14	3.400	5,299.56	-	-
华泰证券	2022010500000801	华熙生物	2022年1月5日	2,960,000.00	20,000	14	3.400	3,913.84	-	-
华泰证券	2022010500000803	天奈科技	2022年1月5日	1,884,390.00	13,800	14	3.400	2,491.58	-	-
华泰证券	2022010500000805	圣湘生物	2022年1月5日	331,375.00	5,500	14	3.400	438.20	-	-
华泰证券	202201	嘉元科	2022年	412,685.	3,500	14	3.400	545.72	-	-

	050000 0807	技	1月5日	00						
华泰证券	202201 050000 0809	心脉医 疗	2022年 1月5日	1,891,20 0.00	8,000	14	3.400	2,500. 54	-	-
华泰证券	202201 050000 0811	道通科 技	2022年 1月5日	268,380. 00	3,600	14	3.400	354.90	-	-
华泰证券	202201 050000 0813	昊海生 科	2022年 1月5日	1,128,67 3.00	9,100	14	3.400	1,492. 40	-	-
华泰证券	202201 050000 0815	泽璟制 药	2022年 1月5日	1,203,72 0.00	21,000	14	3.400	1,591. 52	-	-
华泰证券	202201 050000 0817	南微医 学	2022年 1月5日	299,250. 00	1,500	14	3.400	395.64	-	-
华泰证券	202201 050000 9061	柏楚电 子	2022年 1月5日	1,684,84 2.00	4,600	28	3.400	5,250. 96	-	-
华泰证券	202201 050000 9063	道通科 技	2022年 1月5日	462,210. 00	6,200	14	3.400	611.10	-	-
华泰证券	202201 050000 9065	优刻得	2022年 1月5日	48,420.0 0	1,800	28	3.400	150.81	-	-
华泰证券	202201 050000 9097	昊海生 科	2022年 1月5日	223,254. 00	1,800	14	3.400	295.26	-	-
华泰证券	202201 050000 9099	君实生 物	2022年 1月5日	343,085. 00	5,900	14	3.400	453.60	-	-
华泰证券	202201 050000 9101	九号公 司	2022年 1月5日	1,611,60 0.00	23,700	28	3.400	5,022. 93	-	-
华泰证券	202201 050000 9103	道通科 技	2022年 1月5日	1,595,37 0.00	21,400	28	3.400	4,972. 11	-	-
华泰证券	202201 050000 9105	昊海生 科	2022年 1月5日	260,463. 00	2,100	14	3.400	344.40	-	-
华泰证券	202201 050000 9107	海尔生 物	2022年 1月5日	1,009,18 4.00	12,200	14	3.400	1,334. 34	-	-

华泰证券	202201 050000 9109	中微公 司	2022年 1月5日	2,378,00 0.00	20,000	14	3.400	3,144. 26	-	-
华泰证券	202201 050000 9111	南微医 学	2022年 1月5日	418,950. 00	2,100	28	3.400	1,305. 81	-	-
华泰证券	202201 050000 9113	南微医 学	2022年 1月5日	1,536,15 0.00	7,700	28	3.400	4,787. 64	-	-
华泰证券	202201 050000 9115	华兴源 创	2022年 1月5日	365,000. 00	10,000	14	3.400	482.58	-	-
华泰证券	202201 050000 9117	传音控 股	2022年 1月5日	473,400. 00	3,000	14	3.400	625.94	-	-
华泰证券	202201 050000 9119	传音控 股	2022年 1月5日	2,114,52 0.00	13,400	14	3.400	2,795. 80	-	-
华泰证券	202201 050000 9121	凯赛生 物	2022年 1月5日	1,237,51 5.00	6,900	28	3.400	3,857. 04	-	-
华泰证券	202201 050000 9123	晶晨股 份	2022年 1月5日	2,239,92 4.00	19,400	28	3.400	6,981. 15	-	-
华泰证券	202201 050000 9125	西部超 导	2022年 1月5日	87,000.0 0	1,000	14	3.400	115.08	-	-
华泰证券	202201 060001 0073	君实生 物	2022年 1月6日	476,112. 00	8,400	14	3.400	629.58	-	-
华泰证券	202201 060001 0079	九号公 司	2022年 1月6日	148,852. 00	2,200	14	3.400	196.84	-	-
华泰证券	202201 060001 0083	康希诺	2022年 1月6日	2,860,00 0.00	10,000	14	3.400	3,781. 54	-	-
华泰证券	202201 060001 0087	微芯生 物	2022年 1月6日	1,034,35 8.00	29,800	14	3.400	1,367. 66	-	-
华泰证券	202201 070000 0653	派能科 技	2022年 1月7日	201,756. 00	1,200	14	3.400	266.70	-	-
华泰证券	202201 070000	晶丰明 源	2022年 1月7日	1,404,00 0.00	5,000	14	3.400	1,856. 40	-	-

	9905										
华泰证券	202201 100001 1419	天奈科 技	2022年 1月10 日	387,520. 00	2,800	14	3.400	512.40			-
华泰证券	202201 100001 1423	嘉元科 技	2022年 1月10 日	2,335,40 0.00	20,000	14	3.400	3,087. 98			-
华泰证券	202201 100001 1427	传音控 股	2022年 1月10 日	1,596,00 0.00	10,500	14	3.400	2,110. 22			-
华泰证券	202201 100001 1433	固德威	2022年 1月10 日	2,299,38 0.00	6,000	14	3.400	3,040. 24			-
华泰证券	202201 100001 1755	天合光 能	2022年 1月10 日	646,100. 00	10,000	14	3.400	854.28			-
华泰证券	202201 110001 1743	圣湘生 物	2022年 1月11 日	198,300. 00	3,000	14	3.400	262.22			-
华泰证券	202201 110001 3267	恒玄科 技	2022年 1月11 日	275,050. 00	1,000	14	3.400	363.72			-
华泰证券	202201 110001 3277	寒武纪	2022年 1月11 日	1,736,60 0.00	19,000	14	3.400	2,296. 14			-
华泰证券	202201 110001 3279	传音控 股	2022年 1月11 日	2,816,00 0.00	20,000	14	3.400	3,723. 44			-
华泰证券	202201 120000 0561	圣湘生 物	2022年 1月12 日	2,054,08 5.00	29,500	14	3.400	2,716. 00			-
华泰证券	202201 120001 6595	博瑞医 药	2022年 1月12 日	2,477,52 0.00	72,000	14	3.400	3,275. 86			-
华泰证券	202201 120001 6597	海尔生 物	2022年 1月12 日	2,515,20 0.00	30,000	14	3.400	3,325. 70			-
华泰证券	202201 130000 0682	寒武纪	2022年 1月13 日	279,300. 00	3,000	14	3.400	369.32			-
华泰证券	202201 130000 0684	天奈科 技	2022年 1月13 日	881,450. 00	6,100	14	3.400	1,165. 50			-
华泰证券	202201	金山办	2022年	2,540,10	10,000	14	3.600	3,556.			-

	130000 0688	公	1月13 日	0.00				14		
华泰证券	202201 130001 0148	金山办 公	2022年 1月13 日	7,620,30 0.00	30,000		14 3.400	10,075 .80	-	-
华泰证券	202201 130001 0158	凯赛生 物	2022年 1月13 日	452,172. 00	2,800		14 3.400	597.94	-	-
华泰证券	202201 130001 0160	固德威	2022年 1月13 日	2,376,50 0.00	7,000		14 3.400	3,142. 30	-	-
华泰证券	202201 140000 0569	中国通 号	2022年 1月14 日	4,089,30 5.00	819,500		14 2.000	3,180. 52	-	-
华泰证券	202201 140002 4084	天合光 能	2022年 1月14 日	409,320. 00	6,000		14 3.400	541.24	-	-
华泰证券	202201 140002 4094	天合光 能	2022年 1月14 日	6,822,00 0.00	100,000		14 3.400	9,020. 20	-	-
华泰证券	202201 140002 4114	虹软科 技	2022年 1月14 日	247,020. 00	6,000		14 3.400	326.62	-	-
华泰证券	202201 170000 0598	极米科 技	2022年 1月17 日	4,940,50 0.00	10,000		14 3.400	9,798. 60	-	-
华泰证券	202201 170000 0600	容百科 技	2022年 1月17 日	5,054,00 0.00	38,000		14 3.400	10,023 .72	-	-
华泰证券	202201 170000 0602	圣湘生 物	2022年 1月17 日	70,550.0 0	1,000		14 3.400	139.86	-	-
华泰证券	202201 170000 0604	中控技 术	2022年 1月17 日	1,865,75 0.00	25,000		14 3.400	3,700. 41	-	-
华泰证券	202201 180002 3948	传音控 股	2022年 1月18 日	389,070. 00	2,700		14 3.400	735.00	-	-
华泰证券	202201 180002 3952	中微公 司	2022年 1月18 日	2,367,40 0.00	20,000		14 3.400	4,471. 80	-	-
华泰证券	202201 180002 3966	康希诺	2022年 1月18 日	1,527,14 2.00	5,300		14 3.400	2,884. 60	-	-

华泰证券	202201 180002 3972	康希诺	2022年 1月18 日	1,152,56 0.00	4,000	14	3.400	2,177. 00	-	-
华泰证券	202201 180002 3980	金山办 公	2022年 1月18 日	13,244,3 50.00	47,900	14	3.400	25,017 .20	-	-
华泰证券	202201 190000 0660	微芯生 物	2022年 1月19 日	1,005,45 2.00	29,800	14	3.400	1,804. 24	-	-
华泰证券	202201 190000 0664	容百科 技	2022年 1月19 日	6,527,48 8.00	51,200	14	3.400	11,713 .12	-	-
华泰证券	202201 190000 9517	圣湘生 物	2022年 1月19 日	341,000. 00	5,500	14	3.400	611.99	-	-
华泰证券	202201 190000 9871	海尔生 物	2022年 1月19 日	958,310. 00	12,200	14	3.400	1,719. 69	-	-
华泰证券	202201 190000 9873	传音控 股	2022年 1月19 日	3,605,53 0.00	25,400	14	3.400	6,469. 88	-	-
华泰证券	202201 190000 9875	中微公 司	2022年 1月19 日	2,337,20 0.00	20,000	14	3.400	4,194. 06	-	-
华泰证券	202201 190000 9877	昊海生 科	2022年 1月19 日	1,068,06 7.00	9,100	14	3.400	1,916. 53	-	-
华泰证券	202201 190000 9879	华兴源 创	2022年 1月19 日	368,800. 00	10,000	14	3.400	661.77	-	-
华泰证券	202201 190000 9881	传音控 股	2022年 1月19 日	425,850. 00	3,000	14	3.400	764.18	-	-
华泰证券	202201 190000 9883	华熙生 物	2022年 1月19 日	2,669,60 0.00	20,000	14	3.400	4,790. 47	-	-
华泰证券	202201 190000 9885	传音控 股	2022年 1月19 日	1,902,13 0.00	13,400	14	3.400	3,413. 35	-	-
华泰证券	202201 190001 0321	君实生 物	2022年 1月19 日	484,036. 00	5,900	14	3.400	868.49	-	-
华泰证券	202201 190001	泽璟制 药	2022年 1月19	1,093,68 0.00	21,000	14	3.400	1,962. 51	-	-



	0337		日								
华泰证券	202201 200000 0807	中望软件	2022年 1月20 日	333,800. 00	1,000	14	3.400	567.54	-	-	
华泰证券	202201 200000 8876	九号公司	2022年 1月20 日	142,736. 00	2,200	14	3.400	242.64	-	-	
华泰证券	202201 200000 9670	君实生物	2022年 1月20 日	693,252. 00	8,400	14	3.400	1,178. 46	-	-	
华泰证券	202201 210001 1148	晶丰明源	2022年 1月21 日	1,236,90 0.00	5,000	14	3.400	1,985. 94	-	-	
华泰证券	202201 240000 9210	固德威	2022年 1月24 日	2,412,36 0.00	6,000	14	3.400	3,189. 62	-	-	
华泰证券	202201 240000 9212	天奈科技	2022年 1月24 日	428,232. 00	2,800	14	3.400	566.16	-	-	
华泰证券	202201 240000 9214	嘉元科技	2022年 1月24 日	2,539,80 0.00	20,000	14	3.400	3,358. 18	-	-	
华泰证券	202201 240000 9800	传音控股	2022年 1月24 日	1,511,58 0.00	10,500	14	3.400	1,998. 64	-	-	
华泰证券	202201 240000 9816	天合光能	2022年 1月24 日	704,300. 00	10,000	14	3.400	931.28	-	-	
华泰证券	202201 250000 9198	圣湘生物	2022年 1月25 日	156,930. 00	3,000	14	3.400	207.48	-	-	
华泰证券	202201 250001 1596	恒玄科技	2022年 1月25 日	269,840. 00	1,000	14	3.400	356.72	-	-	
华泰证券	202201 250001 1624	寒武纪	2022年 1月25 日	1,573,39 0.00	19,000	14	3.400	2,080. 40	-	-	
华泰证券	202201 250001 1632	传音控股	2022年 1月25 日	2,817,80 0.00	20,000	14	3.400	3,725. 82	-	-	
华泰证券	202201 260001 1954	博瑞医药	2022年 1月26 日	2,412,00 0.00	72,000	14	3.400	3,189. 20	-	-	
华泰证券	202201	海尔生	2022年	2,171,40	30,000	14	3.400	2,871.	-	-	

	260001 1958	物	1月26 日	0.00				12		
华泰证券	202201 260001 1966	圣湘生 物	2022年 1月26 日	1,562,61 5.00	29,500	14	3.400	2,066. 12	-	-
华泰证券	202201 270000 0537	晶晨股 份	2022年 1月27 日	7,678,03 2.00	61,800	14	3.400	10,152 .10	-	-
华泰证券	202201 270000 0539	天合光 能	2022年 1月27 日	2,650,95 0.00	38,700	14	3.400	3,505. 18	-	-
华泰证券	202201 270000 9921	金山办 公	2022年 1月27 日	7,406,10 0.00	30,000	14	3.400	9,792. 58	-	-
华泰证券	202201 270000 9923	金山办 公	2022年 1月27 日	2,468,70 0.00	10,000	14	3.600	3,456. 18	-	-
华泰证券	202201 270000 9927	寒武纪	2022年 1月27 日	243,060. 00	3,000	14	3.400	321.44	-	-
华泰证券	202201 270000 9929	天奈科 技	2022年 1月27 日	894,870. 00	6,100	14	3.400	1,183. 28	-	-
华泰证券	202201 270000 9943	凯赛生 物	2022年 1月27 日	435,652. 00	2,800	14	3.400	575.96	-	-
华泰证券	202201 270000 9951	固德威	2022年 1月27 日	2,746,24 0.00	7,000	14	3.400	3,631. 18	-	-
华泰证券	202201 280001 8816	虹软科 技	2022年 1月28 日	231,180. 00	6,000	14	3.400	305.62	-	-
华泰证券	202201 280002 0694	中国通 号	2022年 1月28 日	3,949,99 0.00	819,500	14	2.000	3,072. 16	-	-
华泰证券	202201 280002 1446	天合光 能	2022年 1月28 日	399,420. 00	6,000	14	3.400	528.08	-	-
华泰证券	202202 070000 1179	天合光 能	2022年 2月7日	3,046,42 5.00	45,300	14	3.400	4,028. 08	-	-
华泰证券	202202 070000 1181	圣湘生 物	2022年 2月7日	998,800. 00	20,000	14	3.400	1,320. 62	-	-

华泰证券	202202 070000 1183	君实生 物	2022年 2月7日	482,980. 00	8,200	14	3.400	638.54	-	-
华泰证券	202202 070004 3907	华熙生 物	2022年 2月7日	2,400,20 0.00	20,000	14	3.400	3,173. 66	-	-
华泰证券	202202 070004 3913	圣湘生 物	2022年 2月7日	49,940.0 0	1,000	14	3.400	66.08	-	-
华泰证券	202202 070004 3917	圣湘生 物	2022年 2月7日	274,670. 00	5,500	14	3.400	363.16	-	-
华泰证券	202202 070004 3919	君实生 物	2022年 2月7日	347,510. 00	5,900	14	3.400	459.48	-	-
华泰证券	202202 070004 3923	君实生 物	2022年 2月7日	494,760. 00	8,400	14	3.400	654.22	-	-
华泰证券	202202 070004 3925	中控技 术	2022年 2月7日	1,833,50 0.00	25,000	14	3.400	2,424. 24	-	-
华泰证券	202202 070004 3931	中微公 司	2022年 2月7日	2,400,60 0.00	20,000	14	3.400	3,174. 08	-	-
华泰证券	202202 070004 3957	传音控 股	2022年 2月7日	1,783,80 8.00	13,400	14	3.400	2,358. 58	-	-
华泰证券	202202 070004 3959	传音控 股	2022年 2月7日	3,381,24 8.00	25,400	14	3.400	4,470. 76	-	-
华泰证券	202202 070004 3973	金山办 公	2022年 2月7日	11,627,7 25.00	47,900	14	3.400	15,374 .38	-	-
华泰证券	202202 070004 3995	南微医 学	2022年 2月7日	321,741. 00	2,100	28	3.400	850.92	-	-
华泰证券	202202 070004 6349	天合光 能	2022年 2月7日	672,500. 00	10,000	14	3.400	889.14	-	-
华泰证券	202202 070004 6353	固德威	2022年 2月7日	2,447,94 0.00	6,000	14	3.400	3,236. 66	-	-
华泰证券	202202 070004	嘉元科 技	2022年 2月7日	2,413,20 0.00	20,000	14	3.400	3,190. 74	-	-

	6357										
华泰证券	202202 070004 6395	传音控 股	2022年 2月7日	1,397,76 0.00	10,500	14	3.400	1,848. 14			
华泰证券	202202 070004 6407	天奈科 技	2022年 2月7日	408,380. 00	2,800	14	3.400	539.98			
华泰证券	202202 070004 9255	康希诺	2022年 2月7日	1,040,72 0.00	4,000	14	3.400	1,376. 06			
华泰证券	202202 070004 9261	康希诺	2022年 2月7日	1,378,95 4.00	5,300	14	3.400	1,823. 22			
华泰证券	202202 070004 9271	容百科 技	2022年 2月7日	4,953,30 0.00	38,000	14	3.400	6,549. 34			
华泰证券	202202 070005 2777	海尔生 物	2022年 2月7日	933,178. 00	12,200	14	3.400	1,233. 82			
华泰证券	202202 070005 4831	九号公 司	2022年 2月7日	1,453,52 1.00	23,700	28	3.400	3,843. 84			
华泰证券	202202 070005 4835	九号公 司	2022年 2月7日	134,926. 00	2,200	14	3.400	178.36			
华泰证券	202202 070005 4847	极米科 技	2022年 2月7日	5,535,00 0.00	10,000	14	3.400	7,318. 50			
华泰证券	202202 070005 4849	微芯生 物	2022年 2月7日	881,484. 00	29,800	14	3.400	1,165. 50			
华泰证券	202202 070005 4851	道通科 技	2022年 2月7日	1,270,73 2.00	21,400	28	3.400	3,360. 28			
华泰证券	202202 070005 4853	晶丰明 源	2022年 2月7日	1,177,80 0.00	5,000	14	3.400	1,557. 36			
华泰证券	202202 070005 4855	凯赛生 物	2022年 2月7日	1,072,81 2.00	6,900	28	3.400	2,836. 96			
华泰证券	202202 070005 4861	中望软 件	2022年 2月7日	313,980. 00	1,000	14	3.400	415.10			
华泰证券	202202	优刻得	2022年	39,096.0	1,800	28	3.400	103.32			

	070005 4877		2月7日	0						
华泰证券	202202 070005 4883	晶晨股 份	2022年 2月7日	2,378,82 8.00	19,400	28	3.400	6,290. 76	-	-
华泰证券	202202 070005 4897	泽璟制 药	2022年 2月7日	987,000. 00	21,000	14	3.400	1,305. 08	-	-
华泰证券	202202 070005 9373	容百科 技	2022年 2月7日	6,673,92 0.00	51,200	14	3.400	8,824. 34	-	-
华泰证券	202202 080000 1015	天奈科 技	2022年 2月8日	916,110. 00	6,500	14	3.400	1,211. 28	-	-
华泰证券	202202 080000 1019	天合光 能	2022年 2月8日	1,668,83 4.00	27,800	14	3.400	2,206. 54	-	-
华泰证券	202202 080001 5246	传音控 股	2022年 2月8日	2,613,40 0.00	20,000	14	3.400	3,455. 48	-	-
华泰证券	202202 080001 5260	寒武纪	2022年 2月8日	1,492,07 0.00	19,000	14	3.400	1,972. 88	-	-
华泰证券	202202 080001 5670	圣湘生 物	2022年 2月8日	153,930. 00	3,000	14	3.400	203.56	-	-
华泰证券	202202 090000 0834	嘉元科 技	2022年 2月9日	140,292. 00	1,200	14	3.400	185.50	-	-
华泰证券	202202 090000 0836	天合光 能	2022年 2月9日	248,009. 00	4,100	14	3.400	327.88	-	-
华泰证券	202202 090000 0840	虹软科 技	2022年 2月9日	316,960. 00	8,000	14	3.400	419.16	-	-
华泰证券	202202 090001 6392	圣湘生 物	2022年 2月9日	1,536,65 5.00	29,500	14	3.400	2,031. 82	-	-
华泰证券	202202 090001 7360	海尔生 物	2022年 2月9日	2,251,80 0.00	30,000	14	3.400	2,977. 38	-	-
华泰证券	202202 090001 7370	博瑞医 药	2022年 2月9日	2,175,12 0.00	72,000	14	3.400	2,876. 02	-	-

华泰证券	202202 100000 0686	华兴源 创	2022年 2月10 日	105,617. 00	3,100	14	3.400	139.58	-	-
华泰证券	202202 100000 0688	晶晨股 份	2022年 2月10 日	141,252. 00	1,200	14	3.400	186.76	-	-
华泰证券	202202 100000 0690	泽璟制 药	2022年 2月10 日	109,986. 00	2,300	14	3.400	145.46	-	-
华泰证券	202202 100001 2258	固德威	2022年 2月10 日	2,422,14 0.00	7,000	14	3.400	3,202. 64	-	-
华泰证券	202202 100001 3162	金山办 公	2022年 2月10 日	6,416,40 0.00	30,000	14	3.400	8,483. 86	-	-
华泰证券	202202 100001 3166	金山办 公	2022年 2月10 日	2,138,80 0.00	10,000	14	3.600	2,994. 32	-	-
华泰证券	202202 100001 3176	天奈科 技	2022年 2月10 日	793,000. 00	6,100	14	3.400	1,048. 46	-	-
华泰证券	202202 100001 3178	寒武纪	2022年 2月10 日	236,760. 00	3,000	14	3.400	313.04	-	-
华泰证券	202202 100001 4022	天合光 能	2022年 2月10 日	2,212,47 9.00	38,700	14	3.400	2,925. 44	-	-
华泰证券	202202 110000 0506	天合光 能	2022年 2月11 日	56,500.0 0	1,000	14	3.400	74.76	-	-
华泰证券	202202 110001 7240	中国通 号	2022年 2月11 日	4,089,30 5.00	819,500	14	2.000	3,180. 52	-	-
华泰证券	202202 110001 8822	天合光 能	2022年 2月11 日	339,000. 00	6,000	14	3.400	448.28	-	-
华泰证券	202202 110001 8824	虹软科 技	2022年 2月11 日	227,820. 00	6,000	14	3.400	301.28	-	-
华泰证券	202202 140000 0401	中望软 件	2022年 2月14 日	1,078,16 0.00	4,000	14	3.400	1,425. 62	-	-
华泰证券	202202 140000	恒玄科 技	2022年 2月14	490,240. 00	2,000	14	3.400	648.20	-	-

	0403		日								
华泰证券	202202 210000 0530	派能科 技	2022年 2月21 日	359,064. 00	2,400	14	3.400	474.74	-	-	
华泰证券	202202 210003 5709	中控技 术	2022年 2月21 日	1,852,75 0.00	25,000	14	3.400	2,449. 72	-	-	
华泰证券	202202 210003 5735	传音控 股	2022年 2月21 日	1,344,21 0.00	10,500	14	3.400	1,777. 30	-	-	
华泰证券	202202 210003 5743	传音控 股	2022年 2月21 日	3,251,70 8.00	25,400	14	3.400	4,299. 54	-	-	
华泰证券	202202 210003 5747	海尔生 物	2022年 2月21 日	880,596. 00	12,200	14	3.400	1,164. 38	-	-	
华泰证券	202202 210003 5755	固德威	2022年 2月21 日	2,287,92 0.00	6,000	14	3.400	3,025. 12	-	-	
华泰证券	202202 210003 7685	天奈科 技	2022年 2月21 日	385,168. 00	2,800	14	3.400	509.32	-	-	
华泰证券	202202 210004 7279	圣湘生 物	2022年 2月21 日	1,019,80 0.00	20,000	14	3.400	1,348. 34	-	-	
华泰证券	202202 210004 7281	君实生 物	2022年 2月21 日	406,982. 00	5,900	14	3.400	538.16	-	-	
华泰证券	202202 210004 7283	圣湘生 物	2022年 2月21 日	50,990.0 0	1,000	14	3.400	67.48	-	-	
华泰证券	202202 210004 7285	君实生 物	2022年 2月21 日	579,432. 00	8,400	14	3.400	766.08	-	-	
华泰证券	202202 210004 7287	君实生 物	2022年 2月21 日	565,636. 00	8,200	14	3.400	747.88	-	-	
华泰证券	202202 210004 7289	圣湘生 物	2022年 2月21 日	280,445. 00	5,500	14	3.400	370.86	-	-	
华泰证券	202202 210004 7295	嘉元科 技	2022年 2月21 日	2,200,00 0.00	20,000	14	3.400	2,908. 92	-	-	
华泰证券	202202	容百科	2022年	6,772,73	51,200	14	3.400	8,955.	-	-	

	210004 7299	技	2月21 日	6.00				10		
华泰证券	202202 210004 7333	泽璟制 药	2022年 2月21 日	971,460. 00	21,000	14	3.400	1,284. 50	-	-
华泰证券	202202 210004 7337	华熙生 物	2022年 2月21 日	2,338,00 0.00	20,000	14	3.400	3,091. 34	-	-
华泰证券	202202 210004 7349	中望软 件	2022年 2月21 日	264,620. 00	1,000	14	3.400	349.86	-	-
华泰证券	202202 210004 7361	极米科 技	2022年 2月21 日	4,615,00 0.00	10,000	14	3.400	6,102. 04	-	-
华泰证券	202202 220000 0521	固德威	2022年 2月22 日	762,000. 00	2,000	14	3.400	1,007. 58	-	-
华泰证券	202202 220001 1067	传音控 股	2022年 2月22 日	2,517,20 0.00	20,000	14	3.400	3,328. 36	-	-
华泰证券	202202 220001 1073	寒武纪	2022年 2月22 日	1,592,01 0.00	19,000	14	3.400	2,105. 04	-	-
华泰证券	202202 220001 1077	天合光 能	2022年 2月22 日	1,762,52 0.00	27,800	14	3.400	2,330. 44	-	-
华泰证券	202202 220001 1079	天奈科 技	2022年 2月22 日	879,905. 00	6,500	14	3.400	1,163. 40	-	-
华泰证券	202202 220001 1089	圣湘生 物	2022年 2月22 日	149,370. 00	3,000	14	3.400	197.54	-	-
华泰证券	202202 230000 0621	君实生 物	2022年 2月23 日	69,800.0 0	1,000	14	3.400	92.26	-	-
华泰证券	202202 230000 0623	柏楚电 子	2022年 2月23 日	679,074. 00	2,200	14	3.400	897.82	-	-
华泰证券	202202 230000 0627	博瑞医 药	2022年 2月23 日	29,400.0 0	1,000	14	3.400	38.92	-	-
华泰证券	202202 230001 1586	博瑞医 药	2022年 2月23 日	2,116,80 0.00	72,000	14	3.400	2,798. 88	-	-



华泰证券	202202 230001 3528	圣湘生物	2022年 2月23 日	1,483,85 0.00	29,500	14	3.400	1,961. 96	-	-
华泰证券	202202 230001 3536	海尔生物	2022年 2月23 日	2,200,50 0.00	30,000	14	3.400	2,909. 62	-	-
华泰证券	202202 240001 1327	天合光能	2022年 2月24 日	2,625,79 5.00	38,700	14	3.400	3,471. 86	-	-
华泰证券	202202 240001 1335	金山办公	2022年 2月24 日	2,076,50 0.00	10,000	14	3.600	2,907. 10	-	-
华泰证券	202202 240001 1337	金山办公	2022年 2月24 日	6,229,50 0.00	30,000	14	3.400	8,236. 76	-	-
华泰证券	202202 240001 1993	固德威	2022年 2月24 日	2,688,00 0.00	7,000	14	3.400	3,554. 18	-	-
华泰证券	202202 240001 1995	天奈科技	2022年 2月24 日	903,959. 00	6,100	14	3.400	1,195. 18	-	-
华泰证券	202202 250000 0400	寒武纪	2022年 2月25 日	482,940. 00	6,000	14	3.400	638.54	-	-
华泰证券	202202 250001 8985	中国通号	2022年 2月25 日	3,966,38 0.00	819,500	14	2.000	3,084. 90	-	-
华泰证券	202202 250001 9383	虹软科技	2022年 2月25 日	225,540. 00	6,000	14	3.400	298.20	-	-
华泰证券	202202 250001 9385	天合光能	2022年 2月25 日	72,020.0 0	1,000	14	3.400	95.20	-	-
华泰证券	202203 070003 6396	容百科技	2022年 3月7日	6,479,36 0.00	51,200	14	3.400	8,567. 16	-	-
华泰证券	202203 070003 6664	固德威	2022年 3月7日	2,615,40 0.00	6,000	14	3.400	3,458. 14	-	-
华泰证券	202203 070003 6666	圣湘生物	2022年 3月7日	928,200. 00	20,000	14	3.400	1,227. 24	-	-
华泰证券	202203 070003	圣湘生物	2022年 3月7日	46,410.0 0	1,000	14	3.400	61.32	-	-

	6670										
华泰证券	202203 070003 6672	传音控 股	2022年 3月7日	3,246,88 2.00	25,400	14	3.400	4,293. 10			
华泰证券	202203 070003 6674	传音控 股	2022年 3月7日	1,342,21 5.00	10,500	14	3.400	1,774. 64			
华泰证券	202203 070003 6698	中控技 术	2022年 3月7日	1,978,75 0.00	25,000	14	3.400	2,616. 32			
华泰证券	202203 070003 6704	华熙生 物	2022年 3月7日	2,303,00 0.00	20,000	14	3.400	3,045. 14			
华泰证券	202203 070003 6708	派能科 技	2022年 3月7日	327,600. 00	2,400	14	3.400	433.16			
华泰证券	202203 070003 6712	嘉元科 技	2022年 3月7日	1,942,00 0.00	20,000	14	3.400	2,567. 74			
华泰证券	202203 070003 6714	极米科 技	2022年 3月7日	3,845,00 0.00	10,000	14	3.400	5,083. 96			
华泰证券	202203 070003 7862	中望软 件	2022年 3月7日	246,000. 00	1,000	14	3.400	325.22			
华泰证券	202203 070004 4872	天奈科 技	2022年 3月7日	377,972. 00	2,800	14	3.400	499.80			
华泰证券	202203 080001 2958	固德威	2022年 3月8日	837,760. 00	2,000	14	3.400	1,107. 68			
华泰证券	202203 080001 2962	圣湘生 物	2022年 3月8日	130,920. 00	3,000	14	3.400	173.04			
华泰证券	202203 080001 2964	寒武纪	2022年 3月8日	1,642,93 0.00	19,000	14	3.400	2,172. 38			
华泰证券	202203 080001 2968	传音控 股	2022年 3月8日	2,416,20 0.00	20,000	14	3.400	3,194. 80			
华泰证券	202203 080001 2990	天合光 能	2022年 3月8日	2,034,68 2.00	27,800	14	3.400	2,690. 24			
华泰证券	202203	天奈科	2022年	876,525.	6,500	14	3.400	1,158.			

	080001 5720	技	3月8日	00				92		
华泰证券	202203 090001 5783	海尔生 物	2022年 3月9日	2,096,40 0.00	30,000	14	3.400	2,771. 86	-	-
华泰证券	202203 090001 8105	圣湘生 物	2022年 3月9日	1,265,55 0.00	29,500	14	3.400	1,673. 28	-	-
华泰证券	202203 100001 2540	固德威	2022年 3月10 日	2,953,93 0.00	7,000	14	3.400	3,905. 72	-	-
华泰证券	202203 100001 2542	金山办 公	2022年 3月10 日	5,640,00 0.00	30,000	14	3.400	7,457. 38	-	-
华泰证券	202203 100001 2544	金山办 公	2022年 3月10 日	1,880,00 0.00	10,000	14	3.600	2,632. 00	-	-
华泰证券	202203 100001 3036	天奈科 技	2022年 3月10 日	871,690. 00	6,100	14	3.400	1,152. 62	-	-
华泰证券	202203 100001 3038	天合光 能	2022年 3月10 日	2,849,09 4.00	38,700	14	3.400	3,767. 12	-	-
华泰证券	202203 110001 6148	虹软科 技	2022年 3月11 日	186,120. 00	6,000	14	3.400	246.12	-	-
华泰证券	202203 210003 2909	派能科 技	2022年 3月21 日	301,968. 00	2,400	14	3.400	456.32	-	-
华泰证券	202203 210003 2917	天奈科 技	2022年 3月21 日	425,600. 00	2,800	14	3.400	643.20	-	-
华泰证券	202203 210003 2921	固德威	2022年 3月21 日	2,367,00 0.00	6,000	14	3.400	3,576. 80	-	-
华泰证券	202203 210003 2929	嘉元科 技	2022年 3月21 日	1,911,60 0.00	20,000	14	3.400	2,888. 64	-	-
华泰证券	202203 210003 2937	极米科 技	2022年 3月21 日	3,590,00 0.00	10,000	14	3.400	5,424. 96	-	-
华泰证券	202203 210003 5021	容百科 技	2022年 3月21 日	7,068,16 0.00	51,200	14	3.400	10,680 .80	-	-

华泰证券	202203 210003 5027	华熙生 物	2022年 3月21 日	2,308,40 0.00	20,000	14	3.400	3,488. 32	-	-
华泰证券	202203 210003 5037	中控技 术	2022年 3月21 日	1,863,75 0.00	25,000	14	3.400	2,816. 32	-	-
华泰证券	202203 210003 5041	圣湘生 物	2022年 3月21 日	934,800. 00	20,000	14	3.400	1,412. 64	-	-
华泰证券	202203 210003 5043	圣湘生 物	2022年 3月21 日	46,740.0 0	1,000	14	3.400	70.56	-	-
华泰证券	202203 220001 4271	天合光 能	2022年 3月22 日	1,834,80 0.00	27,800	14	3.400	2,599. 35	-	-
华泰证券	202203 220001 4273	圣湘生 物	2022年 3月22 日	134,310. 00	3,000	14	3.400	190.20	-	-
华泰证券	202203 220001 4287	天奈科 技	2022年 3月22 日	978,900. 00	6,500	14	3.400	1,386. 75	-	-
华泰证券	202203 220001 4289	寒武纪	2022年 3月22 日	1,231,96 0.00	19,000	14	3.400	1,745. 25	-	-
华泰证券	202203 220001 4291	传音控 股	2022年 3月22 日	1,994,40 0.00	20,000	14	3.400	2,825. 40	-	-
华泰证券	202203 220001 4307	固德威	2022年 3月22 日	751,000. 00	2,000	14	3.400	1,063. 95	-	-
华泰证券	202203 230001 2495	圣湘生 物	2022年 3月23 日	1,335,76 0.00	29,500	14	3.400	1,766. 24	-	-
华泰证券	202203 230001 2511	海尔生 物	2022年 3月23 日	2,241,30 0.00	30,000	14	3.400	2,963. 52	-	-
华泰证券	202203 240000 0371	柏楚电 子	2022年 3月24 日	6,019,80 0.00	20,000	28	3.400	15,919 .12	-	-
华泰证券	202203 240001 2789	金山办 公	2022年 3月24 日	1,921,10 0.00	10,000	14	3.600	2,689. 54	-	-
华泰证券	202203 240001	金山办 公	2022年 3月24	5,763,30 0.00	30,000	14	3.400	7,620. 34	-	-

	2791		日								
华泰证券	202203 240001 2795	天奈科 技	2022年 3月24 日	907,192. 00	6,100	14	3.400	1,199. 52	-	-	
华泰证券	202203 240001 2801	固德威	2022年 3月24 日	2,628,50 0.00	7,000	14	3.400	3,475. 50	-	-	
华泰证券	202203 240001 2805	天合光 能	2022年 3月24 日	2,517,43 5.00	38,700	14	3.400	3,328. 64	-	-	
华泰证券	202203 250001 8796	虹软科 技	2022年 3月25 日	175,560. 00	6,000	14	3.400	232.12	-	-	
华泰证券	202204 060004 8673	天奈科 技	2022年 4月6日	888,875. 00	6,500	14	3.400	1,175. 30	-	-	
华泰证券	202204 060004 8675	天奈科 技	2022年 4月6日	382,900. 00	2,800	14	3.400	506.24	-	-	
华泰证券	202204 060005 6665	圣湘生 物	2022年 4月6日	136,590. 00	3,000	14	3.400	180.60	-	-	
华泰证券	202204 060005 6669	圣湘生 物	2022年 4月6日	45,530.0 0	1,000	14	3.400	60.20	-	-	
华泰证券	202204 060005 6673	圣湘生 物	2022年 4月6日	1,343,13 5.00	29,500	14	3.400	1,775. 90	-	-	
华泰证券	202204 060006 4117	固德威	2022年 4月6日	1,908,96 0.00	6,000	14	3.400	2,524. 06	-	-	
华泰证券	202204 060006 5865	派能科 技	2022年 4月6日	317,136. 00	2,400	14	3.400	419.30	-	-	
华泰证券	202204 060006 5871	中控技 术	2022年 4月6日	1,675,00 0.00	25,000	14	3.400	2,214. 66	-	-	
华泰证券	202204 060006 6077	传音控 股	2022年 4月6日	1,876,40 0.00	20,000	14	3.400	2,481. 08	-	-	
华泰证券	202204 060006 6079	寒武纪	2022年 4月6日	1,192,25 0.00	19,000	14	3.400	1,576. 40	-	-	
华泰证券	202204	容百科	2022年	6,348,80	51,200	14	3.400	8,394.	-	-	

	060006 6081	技	4月6日	0.00				54		
华泰证券	202204 060006 6083	天合光 能	2022年 4月6日	1,554,29 8.00	27,800	14	3.400	2,055. 06	-	-
华泰证券	202204 060006 6099	海尔生 物	2022年 4月6日	2,181,30 0.00	30,000	14	3.400	2,884. 14	-	-
华泰证券	202204 060006 6103	极米科 技	2022年 4月6日	3,961,60 0.00	10,000	14	3.400	5,238. 10	-	-
华泰证券	202204 070001 2866	天合光 能	2022年 4月7日	2,024,01 0.00	38,700	14	3.400	2,676. 24	-	-
华泰证券	202204 070001 2868	金山办 公	2022年 4月7日	5,408,40 0.00	30,000	14	3.400	7,151. 06	-	-
华泰证券	202204 070001 2870	金山办 公	2022年 4月7日	1,802,80 0.00	10,000	14	3.600	2,523. 92	-	-
华泰证券	202204 070001 2882	天奈科 技	2022年 4月7日	836,005. 00	6,100	14	3.400	1,105. 44	-	-
华泰证券	202204 070001 2884	固德威	2022年 4月7日	2,123,80 0.00	7,000	14	3.400	2,808. 12	-	-
华泰证券	202204 080001 4809	虹软科 技	2022年 4月8日	162,120. 00	6,000	14	3.400	214.34	-	-
华泰证券	202204 180000 0699	海尔生 物	2022年 4月18 日	5,352,00 0.00	80,000	14	3.400	8,592. 99	-	-
华泰证券	202204 200003 8484	容百科 技	2022年 4月20 日	5,087,74 4.00	51,200	14	3.400	7,207. 65	-	-
华泰证券	202204 200003 8522	中控技 术	2022年 4月20 日	1,625,25 0.00	25,000	14	3.400	2,302. 50	-	-
华泰证券	202204 200003 8536	天合光 能	2022年 4月20 日	1,428,64 2.00	27,800	14	3.400	2,023. 95	-	-
华泰证券	202204 200004 6430	传音控 股	2022年 4月20 日	1,789,40 0.00	20,000	14	3.400	2,535. 00	-	-

华泰证券	202204 200004 6440	寒武纪	2022年 4月20 日	1,125,56 0.00	19,000	14	3.400	1,594. 50	-	-
华泰证券	202204 200004 6458	海尔生 物	2022年 4月20 日	1,941,90 0.00	30,000	14	3.400	2,751. 00	-	-
华泰证券	202204 200004 6466	圣湘生 物	2022年 4月20 日	42,220.0 0	1,000	14	3.400	59.85	-	-
华泰证券	202204 200004 6468	圣湘生 物	2022年 4月20 日	126,660. 00	3,000	14	3.400	179.40	-	-
华泰证券	202204 200004 6474	极米科 技	2022年 4月20 日	3,520,00 0.00	10,000	14	3.400	4,986. 60	-	-
华泰证券	202204 200004 6906	派能科 技	2022年 4月20 日	364,224. 00	2,400	14	3.400	516.00	-	-
华泰证券	202204 210001 2019	天合光 能	2022年 4月21 日	1,872,30 6.00	38,700	14	3.400	2,475. 62	-	-
华泰证券	202204 210001 2023	天奈科 技	2022年 4月21 日	707,722. 00	6,100	14	3.400	935.76	-	-
华泰证券	202204 210001 2033	柏楚电 子	2022年 4月21 日	5,055,00 0.00	20,000	28	3.400	13,367 .76	-	-
华泰证券	202204 210001 2035	金山办 公	2022年 4月21 日	1,768,90 0.00	10,000	14	3.600	2,476. 46	-	-
华泰证券	202204 210001 2037	金山办 公	2022年 4月21 日	5,306,70 0.00	30,000	14	3.400	7,016. 66	-	-
华泰证券	202204 210001 2039	固德威	2022年 4月21 日	1,560,93 0.00	7,000	14	3.400	2,063. 88	-	-
华泰证券	202204 220001 6540	虹软科 技	2022年 4月22 日	147,900. 00	6,000	14	3.400	195.58	-	-
华泰证券	202205 050007 0265	金山办 公	2022年 5月5日	5,781,30 0.00	30,000	14	3.400	7,644. 14	-	-
华泰证券	202205 050007	金山办 公	2022年 5月5日	1,927,10 0.00	10,000	14	3.600	2,697. 94	-	-

	0267										
华泰证券	202205 050007 0285	天合光 能	2022年 5月5日	2,015,49 6.00	38,700	14	3.400	2,664. 90	-	-	
华泰证券	202205 050007 0297	传音控 股	2022年 5月5日	1,690,00 0.00	20,000	14	3.400	2,234. 54	-	-	
华泰证券	202205 050007 0313	圣湘生 物	2022年 5月5日	44,300.0 0	1,000	14	3.400	58.52	-	-	
华泰证券	202205 050007 0323	圣湘生 物	2022年 5月5日	132,900. 00	3,000	14	3.400	175.70	-	-	
华泰证券	202205 050007 0335	寒武纪	2022年 5月5日	1,005,10 0.00	19,000	14	3.400	1,329. 02	-	-	
华泰证券	202205 050007 0341	固德威	2022年 5月5日	1,270,50 0.00	7,000	14	3.400	1,679. 86	-	-	
华泰证券	202205 050007 0345	海尔生 物	2022年 5月5日	2,134,20 0.00	30,000	14	3.400	2,821. 84	-	-	
华泰证券	202205 050007 0347	海尔生 物	2022年 5月5日	5,691,20 0.00	80,000	14	3.400	7,525. 00	-	-	
华泰证券	202205 050007 0349	天奈科 技	2022年 5月5日	695,400. 00	6,100	14	3.400	919.52	-	-	
华泰证券	202205 050007 0359	中控技 术	2022年 5月5日	1,637,50 0.00	25,000	14	3.400	2,165. 10	-	-	
华泰证券	202205 050007 0363	容百科 技	2022年 5月5日	4,618,24 0.00	51,200	14	3.400	6,106. 38	-	-	
华泰证券	202205 050007 4147	极米科 技	2022年 5月5日	3,590,00 0.00	10,000	14	3.400	4,746. 84	-	-	
华泰证券	202205 060000 0399	九号公 司	2022年 5月6日	721,000. 00	20,000	14	3.400	953.26	-	-	
华泰证券	202205 060000 0401	海尔生 物	2022年 5月6日	718,500. 00	10,000	14	3.400	950.04	-	-	
华泰证券	202205	虹软科	2022年	134,040.	6,000	14	3.400	177.24	-	-	



	060001 4331	技	5月6日	00						
华泰证券	202205 160000 0660	大全能源	2022年 5月16 日	9,181,70 0.00	170,000	14	3.400	12,140 .24	-	-
华泰证券	202205 190004 2623	圣湘生物	2022年 5月19 日	127,950. 00	3,000	14	3.400	169.12	-	-
华泰证券	202205 190004 2625	圣湘生物	2022年 5月19 日	42,650.0 0	1,000	14	3.400	56.42	-	-
华泰证券	202205 190004 2629	海尔生物	2022年 5月19 日	5,597,60 0.00	80,000	14	3.400	7,401. 24	-	-
华泰证券	202205 190004 2631	海尔生物	2022年 5月19 日	2,099,10 0.00	30,000	14	3.400	2,775. 50	-	-
华泰证券	202205 190004 2633	极米科技	2022年 5月19 日	3,798,80 0.00	10,000	14	3.400	5,022. 92	-	-
华泰证券	202205 190004 2635	寒武纪	2022年 5月19 日	1,046,14 0.00	19,000	14	3.400	1,383. 20	-	-
华泰证券	202205 190004 4973	天奈科技	2022年 5月19 日	822,768. 00	6,100	14	3.400	1,087. 94	-	-
华泰证券	202205 190004 4983	中控技术	2022年 5月19 日	1,739,50 0.00	25,000	14	3.400	2,300. 06	-	-
华泰证券	202205 190004 4991	金山办公	2022年 5月19 日	2,076,00 0.00	10,000	14	3.600	2,906. 40	-	-
华泰证券	202205 190004 4995	金山办公	2022年 5月19 日	6,228,00 0.00	30,000	14	3.400	8,234. 80	-	-
华泰证券	202205 190004 4999	固德威	2022年 5月19 日	1,788,36 0.00	7,000	14	3.400	2,364. 60	-	-
华泰证券	202205 190004 5009	天合光能	2022年 5月19 日	2,460,54 6.00	38,700	14	3.400	3,253. 32	-	-
华泰证券	202205 190004 9811	柏楚电子	2022年 5月19 日	5,746,60 0.00	20,000	28	3.400	15,196 .44	-	-

华泰证券	202205 200001 4596	海尔生 物	2022年 5月20 日	716,000. 00	10,000	14	3.400	1,149. 54	-	-
华泰证券	202205 200001 4602	九号公 司	2022年 5月20 日	861,000. 00	20,000	14	3.400	1,382. 44	-	-
华泰证券	202205 240000 0822	圣湘生 物	2022年 5月24 日	2,878,80 0.00	60,000	14	3.400	3,806. 46	-	-
华泰证券	202205 300000 4360	大全能 源	2022年 5月30 日	10,021,5 00.00	170,000	14	3.400	13,250 .72	-	-
华泰证券	202206 020001 5164	金山办 公	2022年 6月2日	2,102,30 0.00	10,000	14	3.600	2,943. 22	-	-
华泰证券	202206 020001 5166	海尔生 物	2022年 6月2日	6,038,40 0.00	80,000	14	3.400	7,984. 06	-	-
华泰证券	202206 020001 5178	天奈科 技	2022年 6月2日	843,325. 00	6,100	14	3.400	1,115. 10	-	-
华泰证券	202206 020002 2080	天合光 能	2022年 6月2日	2,396,69 1.00	38,700	14	3.400	3,168. 90	-	-
华泰证券	202206 020002 2084	金山办 公	2022年 6月2日	6,306,90 0.00	30,000	14	3.400	8,339. 10	-	-
华泰证券	202206 020002 2088	中控技 术	2022年 6月2日	1,975,00 0.00	25,000	14	3.400	2,611. 42	-	-
华泰证券	202206 020002 2090	圣湘生 物	2022年 6月2日	32,650.0 0	1,000	14	3.400	43.12	-	-
华泰证券	202206 020002 2112	固德威	2022年 6月2日	1,970,43 0.00	7,000	14	3.400	2,605. 40	-	-
华泰证券	202206 060001 1194	海尔生 物	2022年 6月6日	765,800. 00	10,000	14	3.400	1,012. 62	-	-
华泰证券	202206 060001 1196	九号公 司	2022年 6月6日	1,100,00 0.00	20,000	14	3.400	1,454. 46	-	-
华泰证券	202206 070000	圣湘生 物	2022年 6月7日	1,951,80 0.00	60,000	14	3.400	2,580. 76	-	-

	8712										
华泰证券	202206 130002 1675	大全能源	2022年 6月13 日	12,138,0 00.00	170,000	14	3.400	16,049 .18			-
华泰证券	202206 160001 4929	中控技术	2022年 6月16 日	1,933,75 0.00	25,000	14	3.400	2,556. 82			-
华泰证券	202206 160001 4941	柏楚电子	2022年 6月16 日	4,154,20 0.00	20,000	28	3.400	10,985 .52			-
华泰证券	202206 160001 4945	海尔生物	2022年 6月16 日	5,992,80 0.00	80,000	14	3.400	7,923. 86			-
华泰证券	202206 160001 5565	金山办公	2022年 6月16 日	2,070,70 0.00	10,000	14	3.600	2,898. 98			-
华泰证券	202206 160001 5567	天合光能	2022年 6月16 日	2,304,97 2.00	38,700	14	3.400	3,047. 66			-
华泰证券	202206 160001 5573	天奈科技	2022年 6月16 日	890,966. 00	6,100	14	3.400	1,178. 10			-
华泰证券	202206 200001 2288	九号公司	2022年 6月20 日	929,000. 00	20,000	14	3.400	1,228. 36			-
华泰证券	202206 210000 9086	圣湘生物	2022年 6月21 日	1,819,80 0.00	60,000	14	3.400	2,406. 18			-
华泰证券	202206 270001 5380	大全能源	2022年 6月27 日	11,393,4 00.00	170,000	14	3.400	15,064 .56			-
华泰证券	202206 300001 6003	天奈科技	2022年 6月30 日	1,033,82 8.00	6,100	14	3.400	1,366. 96			-
华泰证券	202206 300001 6011	海尔生物	2022年 6月30 日	5,826,40 0.00	80,000	14	3.400	7,703. 78			-
华泰证券	202206 300001 9523	金山办公	2022年 6月30 日	1,971,20 0.00	10,000	14	3.600	2,759. 68			-
华泰证券	202206 300001 9527	中控技术	2022年 6月30 日	1,819,00 0.00	25,000	14	3.400	2,405. 06			-
华泰证券	202207	九号公	2022年	884,000.	20,000	14	3.400	1,168.			-

	040001 2944	司	7月4日	00				86		
华泰证券	202207 050001 0718	圣湘生物	2022年 7月5日	1,813,80 0.00	60,000	14	3.400	2,398. 20	-	-
华泰证券	202207 110001 8756	大全能源	2022年 7月11 日	12,267,2 00.00	170,000	14	3.400	16,219 .98	-	-
华泰证券	202207 120000 0352	中控技术	2022年 7月12 日	1,723,50 0.00	25,000	14	3.400	2,278. 92	-	-
华泰证券	202207 140001 0704	海尔生物	2022年 7月14 日	5,708,00 0.00	80,000	14	3.400	7,547. 26	-	-
华泰证券	202207 140001 1250	柏楚电子	2022年 7月14 日	3,991,80 0.00	20,000	28	3.400	10,556 .00	-	-
华泰证券	202207 180001 3833	九号公司	2022年 7月18 日	948,400. 00	20,000	14	3.400	1,253. 98	-	-
华泰证券	202207 190000 8508	圣湘生物	2022年 7月19 日	1,720,80 0.00	60,000	14	3.400	2,275. 28	-	-
华泰证券	202207 220000 0454	中芯国际	2022年 7月22 日	240,410. 00	5,800	28	3.400	635.88	-	-
华泰证券	202207 250001 6068	大全能源	2022年 7月25 日	10,249,3 00.00	170,000	14	3.400	13,551 .86	-	-
华泰证券	202207 260001 0544	中控技术	2022年 7月26 日	1,997,50 0.00	25,000	14	3.400	2,641. 10	-	-
华泰证券	202207 270000 0376	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 280001 4997	海尔生物	2022年 7月28 日	5,495,20 0.00	80,000	14	3.400	7,265. 86	-	-
华泰证券	202208 010001 3071	九号公司	2022年 8月1日	1,086,60 0.00	20,000	14	3.400	1,436. 68	-	-
华泰证券	202208 020001 1697	圣湘生物	2022年 8月2日	1,654,20 0.00	60,000	14	3.400	2,187. 22	-	-

华泰证券	2022080800021821	大全能源	2022年8月8日	10,084,400.00	170,000	14	3.400	13,333.88	-	-
华泰证券	2022080900012914	中控技术	2022年8月9日	2,062,000.00	25,000	14	3.400	2,726.36	-	-
华泰证券	2022081000027396	固德威	2022年8月10日	17,550,000.00	45,000	14	3.200	21,840.00	-	-
华泰证券	2022081100012408	柏楚电子	2022年8月11日	4,887,000.00	20,000	28	3.400	12,923.40	-	-
华泰证券	2022081100013368	海尔生物	2022年8月11日	6,068,800.00	80,000	14	3.400	8,024.24	-	-
华泰证券	2022081500015763	九号公司	2022年8月15日	1,091,000.00	20,000	14	3.400	1,442.56	-	-
华泰证券	2022081600009196	圣湘生物	2022年8月16日	1,728,000.00	60,000	14	3.400	2,284.80	-	-
华泰证券	2022081900008002	中芯国际	2022年8月19日	237,742.00	5,800	28	3.400	628.60	-	-
华泰证券	2022082200019107	大全能源	2022年8月22日	10,305,400.00	170,000	14	3.400	13,626.06	-	-
华泰证券	2022082300016968	中控技术	2022年8月23日	2,089,750.00	25,000	14	3.400	2,763.18	-	-
华泰证券	2022082400000454	西部超导	2022年8月24日	16,156,500.00	150,000	14	3.200	20,105.82	-	-
华泰证券	2022082400032739	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	2022082500011136	海尔生物	2022年8月25日	5,865,600.00	80,000	14	3.400	7,755.58	-	-
华泰证券	2022082900018179	九号公司	2022年8月29日	890,200.00	20,000	14	3.400	1,261.05	-	-
华泰证券	202208300001	圣湘生物	2022年8月30日	1,664,400.00	60,000	14	3.400	2,200.66	-	-

	2504		日							
华泰证券	202209 050002 2495	大全能 源	2022年 9月5日	9,480,90 0.00	170,000	14	3.400	12,535 .88	-	-
华泰证券	202209 060000 0419	澜起科 技	2022年 9月6日	4,981,50 0.00	90,000	14	3.400	6,586. 72	-	-
华泰证券	202209 060001 3281	中控技 术	2022年 9月6日	1,881,25 0.00	25,000	14	3.400	2,487. 38	-	-
华泰证券	202209 070002 7170	西部超 导	2022年 9月7日	16,780,5 00.00	150,000	14	3.200	20,882 .40	-	-
华泰证券	202209 070003 0182	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 080001 3144	海尔生 物	2022年 9月8日	5,084,80 0.00	80,000	14	3.400	6,723. 22	-	-
华泰证券	202209 090000 0609	柏楚电 子	2022年 9月9日	4,100,00 0.00	20,000	14	3.400	5,421. 08	-	-
华泰证券	202209 130002 6969	九号公 司	2022年 9月13 日	852,000. 00	20,000	14	3.400	1,126. 58	-	-
华泰证券	202209 160001 0150	中芯国 际	2022年 9月16 日	230,782. 00	5,800	28	3.400	610.40	-	-
华泰证券	202209 190001 9032	大全能 源	2022年 9月19 日	8,841,70 0.00	170,000	14	3.400	17,536 .05	-	-
华泰证券	202209 200001 4441	澜起科 技	2022年 9月20 日	4,914,00 0.00	90,000	14	3.400	9,282. 00	-	-
华泰证券	202209 200001 4533	中控技 术	2022年 9月20 日	1,983,75 0.00	25,000	14	3.400	3,747. 00	-	-
华泰证券	202209 210003 2110	固德威	2022年 9月21 日	12,759,3 00.00	45,000	14	3.200	21,549 .04	-	-
华泰证券	202209 220001 1007	海尔生 物	2022年 9月22 日	4,663,20 0.00	80,000	14	3.400	7,927. 38	-	-
华泰证券	202209	柏楚电	2022年	3,581,40	20,000	14	3.400	5,750.	-	-

	230001 7490	子	9月23 日	0.00				08		
华泰证券	202209 270002 3751	九号公 司	2022年 9月27 日	793,600. 00	20,000	14	3.400	1,049. 30	-	-
华泰证券	202210 100008 2749	大全能 源	2022年 10月10 日	8,052,90 0.00	170,000	14	3.400	10,647 .70	-	-
华泰证券	202210 100009 5667	澜起科 技	2022年 10月10 日	3,969,00 0.00	90,000	14	3.400	5,247. 90	-	-
华泰证券	202210 100009 5683	固德威	2022年 10月10 日	12,419,5 50.00	45,000	14	3.200	15,455 .44	-	-
华泰证券	202210 100009 5725	柏楚电 子	2022年 10月10 日	3,744,00 0.00	20,000	14	3.400	4,950. 40	-	-
华泰证券	202210 100009 5787	中控技 术	2022年 10月10 日	1,849,50 0.00	25,000	14	3.400	2,445. 52	-	-
华泰证券	202210 110002 3125	九号公 司	2022年 10月11 日	748,200. 00	20,000	14	3.400	989.24	-	-
华泰证券	202210 140000 9336	中芯国 际	2022年 10月14 日	219,588. 00	5,800	28	3.400	580.72	-	-
华泰证券	202210 240008 0107	柏楚电 子	2022年 10月24 日	4,019,60 0.00	20,000	14	3.400	5,314. 82	-	-
华泰证券	202210 240008 0583	大全能 源	2022年 10月24 日	8,321,50 0.00	170,000	14	3.400	11,002 .88	-	-
华泰证券	202210 240008 0685	澜起科 技	2022年 10月24 日	4,473,90 0.00	90,000	14	3.400	5,915. 56	-	-
华泰证券	202210 240008 0767	中控技 术	2022年 10月24 日	2,275,50 0.00	25,000	14	3.400	3,008. 74	-	-
华泰证券	202210 240008 1727	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 250000 0605	诺唯赞	2022年 10月25 日	1,176,60 0.00	20,000	14	3.400	1,555. 68	-	-

华泰证券	202211 020000 0723	睿创微 纳	2022年 11月2 日	1,412,70 0.00	30,000	14	3.400	1,867. 88	-	-
华泰证券	202211 030000 0678	澜起科 技	2022年 11月3 日	6,590,00 0.00	100,000	14	3.400	8,713. 46	-	-
华泰证券	202211 040000 0048	澜起科 技	2022年 11月4 日	3,275,50 0.00	50,000	14	3.400	4,330. 90	-	-
华泰证券	202211 040000 0419	大全能 源	2022年 11月4 日	2,748,00 0.00	50,000	14	3.400	3,633. 42	-	-
华泰证券	202211 070009 2151	澜起科 技	2022年 11月7 日	5,839,20 0.00	90,000	14	3.400	7,720. 72	-	-
华泰证券	202211 070009 2175	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 070009 9253	中控技 术	2022年 11月7 日	2,235,00 0.00	25,000	14	3.400	2,955. 12	-	-
华泰证券	202211 070010 3285	柏楚电 子	2022年 11月7 日	4,477,60 0.00	20,000	14	3.400	5,920. 32	-	-
华泰证券	202211 080000 0818	大全能 源	2022年 11月8 日	6,608,40 0.00	120,000	14	3.400	8,737. 82	-	-
华泰证券	202211 080002 1337	诺唯赞	2022年 11月8 日	1,404,00 0.00	20,000	14	3.400	1,856. 40	-	-
华泰证券	202211 140000 0688	芯原股 份	2022年 11月14 日	513,264. 00	10,200	14	3.400	678.58	-	-
华泰证券	202211 140000 0691	格科微	2022年 11月14 日	39,146.0 0	2,300	14	3.400	51.80	-	-
华泰证券	202211 140000 0692	思瑞浦	2022年 11月14 日	1,099,62 0.00	4,100	14	3.400	1,453. 90	-	-
华泰证券	202211 140000 0697	恒玄科 技	2022年 11月14 日	686,290. 00	5,500	14	3.400	907.48	-	-
华泰证券	202211 140000	纳微科 技	2022年 11月14	239,834. 00	3,700	14	3.400	317.10	-	-



	0702		日								
华泰证券	202211 140000 0706	固德威	2022年 11月14 日	2,902,50 0.00	9,000	14	3.400	3,837. 82	-	-	
华泰证券	202211 140000 0707	珠海冠 宇	2022年 11月14 日	323,584. 00	15,800	14	3.400	427.84	-	-	
华泰证券	202211 140000 0712	百克生 物	2022年 11月14 日	1,458,48 0.00	20,600	14	3.400	1,928. 50	-	-	
华泰证券	202211 140000 0713	天能股 份	2022年 11月14 日	302,325. 00	7,500	14	3.400	399.70	-	-	
华泰证券	202211 140000 0716	奕瑞科 技	2022年 11月14 日	1,220,67 0.00	2,700	14	3.400	1,614. 06	-	-	
华泰证券	202211 140000 0718	嘉元科 技	2022年 11月14 日	63,852.0 0	1,200	14	3.400	84.42	-	-	
华泰证券	202211 140000 0723	晶晨股 份	2022年 11月14 日	221,375. 00	3,500	14	3.400	292.74	-	-	
华泰证券	202211 140000 0724	长远锂 科	2022年 11月14 日	93,338.0 0	5,900	14	3.400	123.48	-	-	
华泰证券	202211 140000 0727	盛美上 海	2022年 11月14 日	782,739. 00	8,700	14	3.400	1,035. 02	-	-	
华泰证券	202211 140000 0730	九号公 司	2022年 11月14 日	311,422. 00	9,400	14	3.400	411.74	-	-	
华泰证券	202211 140000 0734	康希诺	2022年 11月14 日	15,633,8 00.00	65,000	14	3.400	20,671 .42	-	-	
华泰证券	202211 140000 0735	寒武纪	2022年 11月14 日	219,384. 00	3,300	14	3.400	290.08	-	-	
华泰证券	202211 140000 0738	时代电 气	2022年 11月14 日	98,498.0 0	1,700	14	3.400	130.20	-	-	
华泰证券	202211 140000 0742	诺唯赞	2022年 11月14 日	237,545. 00	3,500	14	3.400	314.02	-	-	
华泰证券	202211	禾迈股	2022年	1,348,10	1,300	14	3.400	1,782.	-	-	

	140000 0744	份	11月14 日	0.00				48		
华泰证券	202211 140000 0746	南微医 学	2022年 11月14 日	1,595,40 6.00	17,400	14	3.400	2,109. 52	-	-
华泰证券	202211 140000 0748	天奈科 技	2022年 11月14 日	342,754. 00	3,400	14	3.400	453.18	-	-
华泰证券	202211 140000 0750	柏楚电 子	2022年 11月14 日	462,340. 00	2,000	14	3.400	611.38	-	-
华泰证券	202211 140000 0752	美迪西	2022年 11月14 日	2,234,99 2.00	8,200	14	3.400	2,955. 12	-	-
华泰证券	202211 140000 0754	睿创微 纳	2022年 11月14 日	867,640. 00	19,900	14	3.400	1,147. 16	-	-
华泰证券	202211 140000 0756	君实生 物	2022年 11月14 日	12,502,0 00.00	178,600	14	3.400	16,530 .36	-	-
华泰证券	202211 140000 0760	道通科 技	2022年 11月14 日	957,975. 00	24,100	14	3.400	1,266. 72	-	-
华泰证券	202211 160000 8025	睿创微 纳	2022年 11月16 日	1,350,00 0.00	30,000	14	3.400	1,785. 00	-	-
华泰证券	202211 170000 7284	澜起科 技	2022年 11月17 日	7,290,00 0.00	100,000	14	3.400	9,639. 00	-	-
华泰证券	202211 180001 0836	澜起科 技	2022年 11月18 日	3,439,00 0.00	50,000	14	3.400	4,547. 06	-	-
华泰证券	202211 180001 1066	大全能 源	2022年 11月18 日	2,702,00 0.00	50,000	14	3.400	3,572. 66	-	-
华泰证券	202211 210000 0920	天合光 能	2022年 11月21 日	6,541,00 0.00	100,000	14	3.400	8,648. 64	-	-
华泰证券	202211 210006 6916	澜起科 技	2022年 11月21 日	6,103,80 0.00	90,000	14	3.400	8,070. 58	-	-
华泰证券	202211 210006 6942	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 210007 9322	中控技术	2022年 11月21 日	2,461,250.00	25,000	14	3.400	3,254.30	-	-
华泰证券	202211 220001 8813	大全能源	2022年 11月22 日	6,556,800.00	120,000	14	3.400	8,669.50	-	-
华泰证券	202211 220001 8861	诺唯赞	2022年 11月22 日	1,286,000.00	20,000	14	3.400	1,700.44	-	-
华泰证券	202211 240000 0571	石头科技	2022年 11月24 日	2,498,000.00	10,000	14	3.400	3,302.88	-	-
华泰证券	202211 280000 6229	恒玄科技	2022年 11月28 日	704,605.00	5,500	14	3.400	931.70	-	-
华泰证券	202211 280000 6249	长远锂科	2022年 11月28 日	95,875.00	5,900	14	3.400	126.70	-	-
华泰证券	202211 280000 6251	思瑞浦	2022年 11月28 日	1,235,412.00	4,100	14	3.400	1,633.52	-	-
华泰证券	202211 280000 6253	芯原股份	2022年 11月28 日	479,298.00	10,200	14	3.400	633.78	-	-
华泰证券	202211 280000 6257	固德威	2022年 11月28 日	3,083,310.00	9,000	14	3.400	4,076.80	-	-
华泰证券	202211 280000 6259	百克生物	2022年 11月28 日	1,416,250.00	20,600	14	3.400	1,872.64	-	-
华泰证券	202211 280000 6261	奕瑞科技	2022年 11月28 日	1,238,922.00	2,700	14	3.400	1,638.14	-	-
华泰证券	202211 280000 6263	嘉元科技	2022年 11月28 日	60,408.00	1,200	14	3.400	79.94	-	-
华泰证券	202211 280000 7711	纳微科技	2022年 11月28 日	205,535.00	3,700	14	3.400	271.74	-	-
华泰证券	202211 280000 7713	珠海冠宇	2022年 11月28 日	355,500.00	15,800	14	3.400	470.12	-	-
华泰证券	202211 280000	天能股份	2022年 11月28	285,750.00	7,500	14	3.400	377.86	-	-

	7715		日								
华泰证券	202211 280001 0233	格科微	2022年 11月28 日	41,400.0 0	2,300	14	3.400	54.74	-	-	
华泰证券	202211 280001 0237	道通科 技	2022年 11月28 日	925,681. 00	24,100	14	3.400	1,224. 02	-	-	
华泰证券	202211 280001 0239	南微医 学	2022年 11月28 日	1,351,11 0.00	17,400	14	3.400	1,786. 40	-	-	
华泰证券	202211 280001 0241	柏楚电 子	2022年 11月28 日	451,360. 00	2,000	14	3.400	596.82	-	-	
华泰证券	202211 280001 0243	睿创微 纳	2022年 11月28 日	803,960. 00	19,900	14	3.400	1,063. 02	-	-	
华泰证券	202211 280001 0245	晶晨股 份	2022年 11月28 日	243,915. 00	3,500	14	3.400	322.56	-	-	
华泰证券	202211 280001 0247	盛美上 海	2022年 11月28 日	703,830. 00	8,700	14	3.400	930.58	-	-	
华泰证券	202211 280001 0249	康希诺	2022年 11月28 日	13,910,0 00.00	65,000	14	3.400	18,392 .08	-	-	
华泰证券	202211 280001 0251	时代电 气	2022年 11月28 日	93,976.0 0	1,700	14	3.400	124.32	-	-	
华泰证券	202211 280001 0253	诺唯赞	2022年 11月28 日	220,920. 00	3,500	14	3.400	292.04	-	-	
华泰证券	202211 280001 0259	九号公 司	2022年 11月28 日	310,200. 00	9,400	14	3.400	410.20	-	-	
华泰证券	202211 280001 0261	寒武纪	2022年 11月28 日	205,425. 00	3,300	14	3.400	271.60	-	-	
华泰证券	202211 280001 0271	天奈科 技	2022年 11月28 日	325,686. 00	3,400	14	3.400	430.64	-	-	
华泰证券	202211 280001 0273	君实生 物	2022年 11月28 日	11,332,1 70.00	178,600	14	3.400	14,983 .64	-	-	
华泰证券	202211	美迪西	2022年	1,783,50	8,200	14	3.400	2,358.	-	-	

	280001 0275		11月28 日	0.00				16		
华泰证券	202211 280001 0277	禾迈股 份	2022年 11月28 日	1,363,70 0.00	1,300	14	3.400	1,803. 06	-	-
华泰证券	202212 010000 8732	澜起科 技	2022年 12月1 日	6,666,00 0.00	100,000	14	3.400	8,813. 98	-	-
华泰证券	202212 020000 6882	大全能 源	2022年 12月2 日	2,697,00 0.00	50,000	14	3.400	3,566. 08	-	-
华泰证券	202212 020000 6884	澜起科 技	2022年 12月2 日	3,305,00 0.00	50,000	14	3.400	4,369. 96	-	-
华泰证券	202212 050002 3618	中控技 术	2022年 12月5 日	2,302,00 0.00	25,000	14	3.400	3,043. 74	-	-
华泰证券	202212 050002 5284	澜起科 技	2022年 12月5 日	6,014,70 0.00	90,000	14	3.400	7,952. 84	-	-
华泰证券	202212 050002 5302	天合光 能	2022年 12月5 日	6,467,00 0.00	100,000	14	3.400	8,550. 78	-	-
华泰证券	202212 050002 6508	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 1630	大全能 源	2022年 12月6 日	6,518,40 0.00	120,000	14	3.400	8,618. 82	-	-
华泰证券	202212 060001 3556	诺唯赞	2022年 12月6 日	1,297,60 0.00	20,000	14	3.400	1,715. 70	-	-
华泰证券	202212 070000 0740	华熙生 物	2022年 12月7 日	12,453,0 00.00	100,000	14	3.400	16,465 .68	-	-
华泰证券	202212 080001 1141	石头科 技	2022年 12月8 日	2,702,60 0.00	10,000	14	3.400	3,573. 50	-	-
华泰证券	202212 120003 7639	天奈科 技	2022年 12月12 日	313,922. 00	3,400	14	3.400	415.10	-	-
华泰证券	202212 120003 7645	君实生 物	2022年 12月12 日	11,144,6 40.00	178,600	14	3.400	14,735 .70	-	-

华泰证券	202212 120003 7647	康希诺	2022年 12月12 日	12,382,5 00.00	65,000	14	3.400	16,372 .44	-	-
华泰证券	202212 120003 7649	时代电 气	2022年 12月12 日	96,509.0 0	1,700	14	3.400	127.54	-	-
华泰证券	202212 120003 7669	固德威	2022年 12月12 日	2,790,90 0.00	9,000	14	3.400	3,690. 26	-	-
华泰证券	202212 120003 7679	格科微	2022年 12月12 日	45,011.0 0	2,300	14	3.400	59.50	-	-
华泰证券	202212 120003 9773	盛美上 海	2022年 12月12 日	700,872. 00	8,700	14	3.400	926.66	-	-
华泰证券	202212 120003 9775	禾迈股 份	2022年 12月12 日	1,220,49 2.00	1,300	14	3.400	1,613. 78	-	-
华泰证券	202212 120003 9779	晶晨股 份	2022年 12月12 日	293,650. 00	3,500	14	3.400	388.22	-	-
华泰证券	202212 120003 9781	诺唯赞	2022年 12月12 日	245,350. 00	3,500	14	3.400	324.38	-	-
华泰证券	202212 120003 9785	奕瑞科 技	2022年 12月12 日	1,151,25 3.00	2,700	14	3.400	1,522. 22	-	-
华泰证券	202212 120003 9809	柏楚电 子	2022年 12月12 日	448,240. 00	2,000	14	3.400	592.62	-	-
华泰证券	202212 120003 9823	美迪西	2022年 12月12 日	1,682,31 2.00	8,200	14	3.400	2,224. 46	-	-
华泰证券	202212 120003 9825	寒武纪	2022年 12月12 日	221,463. 00	3,300	14	3.400	292.88	-	-
华泰证券	202212 120003 9827	百克生 物	2022年 12月12 日	1,538,82 0.00	20,600	14	3.400	2,034. 62	-	-
华泰证券	202212 120003 9829	思瑞浦	2022年 12月12 日	1,379,65 0.00	4,100	14	3.400	1,824. 20	-	-
华泰证券	202212 120003	芯原股 份	2022年 12月12	516,324. 00	10,200	14	3.400	682.64	-	-

	9831		日								
华泰证券	202212 120003 9833	纳微科技	2022年 12月12 日	220,594. 00	3,700	14	3.400	291.62	-	-	
华泰证券	202212 120003 9835	珠海冠宇	2022年 12月12 日	350,286. 00	15,800	14	3.400	463.12	-	-	
华泰证券	202212 120003 9837	天能股份	2022年 12月12 日	281,625. 00	7,500	14	3.400	372.40	-	-	
华泰证券	202212 120003 9839	长远锂科	2022年 12月12 日	96,760.0 0	5,900	14	3.400	127.96	-	-	
华泰证券	202212 120003 9841	九号公司	2022年 12月12 日	313,490. 00	9,400	14	3.400	414.54	-	-	
华泰证券	202212 150001 2337	澜起科技	2022年 12月15 日	6,651,00 0.00	100,000	14	3.400	8,794. 10	-	-	
华泰证券	202212 160001 1471	大全能源	2022年 12月16 日	2,610,00 0.00	50,000	14	3.400	3,451. 00	-	-	
华泰证券	202212 160001 1473	澜起科技	2022年 12月16 日	3,270,00 0.00	50,000	14	3.400	4,323. 62	-	-	
华泰证券	202212 190002 2782	澜起科技	2022年 12月19 日	5,841,00 0.00	90,000	14	3.400	6,619. 80	5,634, 000.00	6,619.8 0	
华泰证券	202212 190002 2790	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 2812	中控技术	2022年 12月19 日	2,212,50 0.00	25,000	14	3.400	2,507. 52	2,270, 750.00	2,507.5 2	
华泰证券	202212 190002 2956	天合光能	2022年 12月19 日	5,501,00 0.00	100,000	14	3.400	6,234. 48	6,376, 000.00	6,234.4 8	
华泰证券	202212 200001 6506	诺唯赞	2022年 12月20 日	1,180,00 0.00	20,000	14	3.400	1,225. 84	1,062, 800.00	1,225.8 4	
华泰证券	202212 200001 6512	大全能源	2022年 12月20 日	6,159,60 0.00	120,000	14	3.400	6,399. 14	5,721, 600.00	6,399.1 4	
华泰证券	202212	华熙生	2022年	12,420,0	100,000	14	3.400	11,730	13,528	11,730.	

	210002 1353	物	12月21 日	00.00				.00	,000.0 0	00
华泰证券	202212 220001 5417	石头科 技	2022年 12月22 日	2,539,50 0.00	10,000	14	3.400	2,158. 56	2,477, 500.00	2,158.5 6
华泰证券	202212 260002 5055	禾迈股 份	2022年 12月26 日	1,181,86 9.00	1,300	14	3.400	558.10	1,218, 295.00	558.10
华泰证券	202212 260002 5063	盛美上 海	2022年 12月26 日	676,512. 00	8,700	14	3.400	319.45	695,13 0.00	319.45
华泰证券	202212 260002 5065	晶晨股 份	2022年 12月26 日	254,415. 00	3,500	14	3.400	120.15	246,78 5.00	120.15
华泰证券	202212 260002 5067	诺唯赞	2022年 12月26 日	192,220. 00	3,500	14	3.400	90.75	185,99 0.00	90.75
华泰证券	202212 260002 5069	天奈科 技	2022年 12月26 日	273,360. 00	3,400	14	3.400	129.10	262,27 6.00	129.10
华泰证券	202212 260002 5073	君实生 物	2022年 12月26 日	9,719,41 2.00	178,600	14	3.400	4,589. 70	11,180 ,360.0 0	4,589.7 0
华泰证券	202212 260002 5077	柏楚电 子	2022年 12月26 日	424,000. 00	2,000	14	3.400	200.20	434,16 0.00	200.20
华泰证券	202212 260002 5079	时代电 气	2022年 12月26 日	92,854.0 0	1,700	14	3.400	43.85	92,769 .00	43.85
华泰证券	202212 260002 5081	美迪西	2022年 12月26 日	1,572,59 6.00	8,200	14	3.400	742.60	1,753, 898.00	742.60
华泰证券	202212 260002 5089	寒武纪	2022年 12月26 日	188,562. 00	3,300	14	3.400	89.05	180,04 8.00	89.05
华泰证券	202212 260002 5091	百克生 物	2022年 12月26 日	1,403,06 6.00	20,600	14	3.400	662.55	1,423, 666.00	662.55
华泰证券	202212 260002 5107	芯原股 份	2022年 12月26 日	471,444. 00	10,200	14	3.400	222.65	449,51 4.00	222.65
华泰证券	202212 260002 5109	思瑞浦	2022年 12月26 日	1,168,09 0.00	4,100	14	3.400	551.60	1,129, 181.00	551.60



华泰证券	202212 260002 5115	纳微科技	2022年 12月26 日	206,460. 00	3,700	14	3.400	97.50	191,54 9.00	97.50
华泰证券	202212 260002 5117	九号公司	2022年 12月26 日	303,150. 00	9,400	14	3.400	143.15	286,60 6.00	143.15
华泰证券	202212 260002 5119	天能股份	2022年 12月26 日	271,350. 00	7,500	14	3.400	128.15	275,55 0.00	128.15
华泰证券	202212 260002 5121	长远锂科	2022年 12月26 日	89,739.0 0	5,900	14	3.400	42.40	86,081 .00	42.40
华泰证券	202212 260002 6707	康希诺	2022年 12月26 日	10,133,5 00.00	65,000	14	3.400	4,785. 25	9,491, 300.00	4,785.2 5
华泰证券	202212 260002 6717	奕瑞科技	2022年 12月26 日	1,128,51 9.00	2,700	14	3.400	532.90	1,236, 276.00	532.90
华泰证券	202212 260002 6723	固德威	2022年 12月26 日	2,681,82 0.00	9,000	14	3.400	1,266. 40	2,907, 810.00	1,266.4 0
华泰证券	202212 260002 6739	格科微	2022年 12月26 日	42,159.0 0	2,300	14	3.400	19.90	40,342 .00	19.90
华泰证券	202212 260002 6743	珠海冠宇	2022年 12月26 日	308,100. 00	15,800	14	3.400	145.50	294,51 2.00	145.50
华泰证券	202212 290001 0785	澜起科技	2022年 12月29 日	6,365,00 0.00	100,000	14	3.400	1,202. 28	6,260, 000.00	1,202.2 8
华泰证券	202212 300001 0613	大全能源	2022年 12月30 日	2,384,00 0.00	50,000	14	3.400	225.16	2,384, 000.00	225.16
华泰证券	202212 300001 0615	澜起科技	2022年 12月30 日	3,130,00 0.00	50,000	14	3.400	295.61	3,130, 000.00	295.61
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	202103	海尔生	2021年	314,965.	3,500	14	3.400	416.50	-	-

	290000 0638	物	3月29 日	00						
华泰证券	202103 290000 0640	天奈科 技	2021年 3月29 日	122,843. 00	2,300	14	3.400	162.40	-	-
华泰证券	202103 290000 0642	长阳科 技	2021年 3月29 日	381,969. 00	14,100	14	3.400	504.98	-	-
华泰证券	202103 290000 0644	容百科 技	2021年 3月29 日	838,970. 00	14,500	14	3.400	1,109. 36	-	-
华泰证券	202103 290000 0646	三达膜	2021年 3月29 日	454,454. 00	28,600	14	3.400	600.88	-	-
华泰证券	202103 290000 0782	华兴源 创	2021年 3月29 日	324,960. 00	9,600	14	3.400	429.66	-	-
华泰证券	202103 290000 0788	睿创微 纳	2021年 3月29 日	106,752. 00	1,200	14	3.400	141.12	-	-
华泰证券	202103 290000 0790	光峰科 技	2021年 3月29 日	340,328. 00	15,200	14	3.400	449.96	-	-
华泰证券	202103 290000 0792	澜起科 技	2021年 3月29 日	1,266,74 8.00	19,600	14	3.400	1,674. 96	-	-
华泰证券	202103 290000 0794	中微公 司	2021年 3月29 日	1,560,00 0.00	15,000	14	3.400	2,062. 62	-	-
华泰证券	202103 290000 0796	安集科 技	2021年 3月29 日	378,480. 00	1,900	14	3.400	500.50	-	-
华泰证券	202103 290000 0798	南微医 学	2021年 3月29 日	834,210. 00	4,500	14	3.400	1,103. 06	-	-
华泰证券	202103 290000 0800	传音控 股	2021年 3月29 日	726,840. 00	3,600	14	3.400	961.10	-	-
华泰证券	202103 290000 0802	虹软科 技	2021年 3月29 日	86,496.0 0	1,700	14	3.400	114.38	-	-
华泰证券	202103 290000 0804	申联生 物	2021年 3月29 日	29,400.0 0	2,100	14	3.400	38.92	-	-

华泰证券	202103 290000 0806	西部超 导	2021年 3月29 日	1,614,84 8.00	30,400	14	3.400	2,135. 14	-	-
华泰证券	202103 290000 0808	沪硅产 业	2021年 3月29 日	2,323,22 4.00	98,400	14	3.400	3,071. 88	-	-
华泰证券	202103 290000 0810	博瑞医 药	2021年 3月29 日	57,434.0 0	1,300	14	3.400	75.88	-	-
华泰证券	202103 290000 0814	石头科 技	2021年 3月29 日	1,160,00 0.00	1,000	14	3.400	1,533. 84	-	-
华泰证券	202103 290000 0816	道通科 技	2021年 3月29 日	969,714. 00	15,300	14	3.400	1,282. 12	-	-
华泰证券	202103 290000 0818	华熙生 物	2021年 3月29 日	2,112,40 3.00	13,700	14	3.400	2,793. 00	-	-
华泰证券	202103 290000 0824	昊海生 科	2021年 3月29 日	837,902. 00	7,400	14	3.400	1,107. 96	-	-
华泰证券	202103 290000 0840	普门科 技	2021年 3月29 日	315,776. 00	12,800	14	3.400	417.48	-	-
华泰证券	202103 310000 0651	海尔生 物	2021年 3月31 日	2,591,70 0.00	30,000	14	3.400	3,426. 78	-	-
华泰证券	202103 290000 0648	中芯国 际	2021年 3月29 日	8,679,69 5.00	159,700	28	1.800	12,151 .44	-	-
华泰证券	202104 120000 3850	华兴源 创	2021年 4月12 日	347,904. 00	9,600	14	3.400	460.04	-	-
华泰证券	202104 120000 3852	沪硅产 业	2021年 4月12 日	2,326,17 6.00	98,400	14	3.400	3,075. 66	-	-
华泰证券	202104 120000 3854	南微医 学	2021年 4月12 日	818,505. 00	4,500	14	3.400	1,082. 20	-	-
华泰证券	202104 120000 3856	传音控 股	2021年 4月12 日	604,800. 00	3,600	14	3.400	799.68	-	-
华泰证券	202104 120000	光峰科 技	2021年 4月12	362,368. 00	15,200	14	3.400	479.08	-	-

	3858		日								
华泰证券	202104 120000 3860	虹软科技	2021年 4月12 日	81,617.0 0	1,700	14	3.400	107.94	-	-	
华泰证券	202104 120000 3862	海尔生物	2021年 4月12 日	325,500. 00	3,500	14	3.400	430.36	-	-	
华泰证券	202104 120000 3864	博瑞医药	2021年 4月12 日	52,520.0 0	1,300	14	3.400	69.44	-	-	
华泰证券	202104 120000 3866	睿创微纳	2021年 4月12 日	105,720. 00	1,200	14	3.400	139.72	-	-	
华泰证券	202104 120000 3868	道通科技	2021年 4月12 日	1,134,34 2.00	15,300	14	3.400	1,499. 82	-	-	
华泰证券	202104 120000 4430	澜起科技	2021年 4月12 日	1,268,12 0.00	19,600	14	3.400	1,676. 78	-	-	
华泰证券	202104 120000 4432	中微公司	2021年 4月12 日	1,746,75 0.00	15,000	14	3.400	2,309. 58	-	-	
华泰证券	202104 120000 4434	西部超导	2021年 4月12 日	1,514,52 8.00	30,400	14	3.400	2,002. 56	-	-	
华泰证券	202104 120000 4436	长阳科技	2021年 4月12 日	373,650. 00	14,100	14	3.400	494.06	-	-	
华泰证券	202104 120000 4438	安集科技	2021年 4月12 日	396,321. 00	1,900	14	3.400	524.02	-	-	
华泰证券	202104 120000 4440	XD 普门科	2021年 4月12 日	287,872. 00	12,800	14	3.400	380.66	-	-	
华泰证券	202104 120000 4442	石头科技	2021年 4月12 日	1,090,62 0.00	1,000	14	3.400	1,442. 00	-	-	
华泰证券	202104 120000 4444	容百科技	2021年 4月12 日	730,075. 00	14,500	14	3.400	965.30	-	-	
华泰证券	202104 120000 4446	天奈科技	2021年 4月12 日	117,277. 00	2,300	14	3.400	155.12	-	-	
华泰证券	202104	华熙生	2021年	2,363,52	13,700	14	3.400	3,125.	-	-	

	120000 4448	物	4月12日	4.00				08		
华泰证券	202104 120000 4450	申联生物	2021年 4月12日	27,678.00	2,100	14	3.400	36.54	-	-
华泰证券	202104 120000 4452	昊海生科	2021年 4月12日	830,354.00	7,400	14	3.400	1,097.88	-	-
华泰证券	202104 120000 4454	三达膜	2021年 4月12日	453,882.00	28,600	14	3.400	600.18	-	-
华泰证券	202103 300000 0372	中芯国际	2021年 3月30日	8,681,292.00	159,700	28	1.800	12,153.68	-	-
华泰证券	202103 310000 0363	中芯国际	2021年 3月31日	21,728,000.00	400,000	28	3.400	57,458.52	-	-
华泰证券	202104 260000 5420	南微医学	2021年 4月26日	967,545.00	4,500	14	3.400	1,279.32	-	-
华泰证券	202104 260000 5422	华熙生物	2021年 4月26日	2,633,140.00	13,700	14	3.400	3,481.66	-	-
华泰证券	202104 260000 5424	石头科技	2021年 4月26日	1,278,000.00	1,000	14	3.400	1,689.80	-	-
华泰证券	202104 260000 5426	光峰科技	2021年 4月26日	375,440.00	15,200	14	3.400	496.44	-	-
华泰证券	202104 260000 5428	安集科技	2021年 4月26日	418,950.00	1,900	14	3.400	553.98	-	-
华泰证券	202104 260000 5430	长阳科技	2021年 4月26日	370,548.00	14,100	14	3.400	490.00	-	-
华泰证券	202104 260000 5432	睿创微纳	2021年 4月26日	103,320.00	1,200	14	3.400	136.64	-	-
华泰证券	202104 260000 5434	西部超导	2021年 4月26日	1,563,776.00	30,400	14	3.400	2,067.66	-	-
华泰证券	202104 260000 5436	申联生物	2021年 4月26日	28,560.00	2,100	14	3.400	37.80	-	-

华泰证券	202104 260000 5438	天奈科 技	2021年 4月26 日	141,427. 00	2,300	14	3.400	187.04	-	-
华泰证券	202104 260000 5440	传音控 股	2021年 4月26 日	646,164. 00	3,600	14	3.400	854.42	-	-
华泰证券	202104 260000 5442	沪硅产 业	2021年 4月26 日	2,398,99 2.00	98,400	14	3.400	3,171. 98	-	-
华泰证券	202104 260000 5444	容百科 技	2021年 4月26 日	909,150. 00	14,500	14	3.400	1,202. 04	-	-
华泰证券	202104 260000 5446	三达膜	2021年 4月26 日	453,596. 00	28,600	14	3.400	599.76	-	-
华泰证券	202104 260000 5448	澜起科 技	2021年 4月26 日	1,329,86 0.00	19,600	14	3.400	1,758. 40	-	-
华泰证券	202104 260000 5450	海尔生 物	2021年 4月26 日	351,260. 00	3,500	14	3.400	464.38	-	-
华泰证券	202104 260000 5452	博瑞医 药	2021年 4月26 日	53,300.0 0	1,300	14	3.400	70.42	-	-
华泰证券	202104 260000 5454	华兴源 创	2021年 4月26 日	341,472. 00	9,600	14	3.400	451.50	-	-
华泰证券	202104 260000 5456	虹软科 技	2021年 4月26 日	76,109.0 0	1,700	14	3.400	100.66	-	-
华泰证券	202104 260000 5458	中微公 司	2021年 4月26 日	1,764,75 0.00	15,000	14	3.400	2,333. 38	-	-
华泰证券	202104 260000 5460	普门科 技	2021年 4月26 日	313,472. 00	12,800	14	3.400	414.54	-	-
华泰证券	202104 260000 5462	道通科 技	2021年 4月26 日	1,026,01 8.00	15,300	14	3.400	1,356. 60	-	-
华泰证券	202104 260000 5464	昊海生 科	2021年 4月26 日	959,484. 00	7,400	14	3.400	1,268. 68	-	-
华泰证券	202104 200000	中芯国 际	2021年 4月20	592,434. 00	10,600	28	3.400	1,566. 60	-	-

	0927		日								
华泰证券	202104 260000 5466	中芯国际	2021年 4月26 日	8,705,24 7.00	159,700	28	1.800	12,187 .28			
华泰证券	202105 100000 5488	光峰科技	2021年 5月10 日	386,992. 00	15,200	14	3.400	511.70			
华泰证券	202105 100000 5490	南微医学	2021年 5月10 日	1,012,05 0.00	4,500	14	3.400	1,338. 12			
华泰证券	202105 100000 5492	沪硅产业	2021年 5月10 日	2,143,15 2.00	98,400	14	3.400	2,833. 74			
华泰证券	202105 100000 5494	容百科技	2021年 5月10 日	959,175. 00	14,500	14	3.400	1,268. 26			
华泰证券	202105 100000 5496	博瑞医药	2021年 5月10 日	47,554.0 0	1,300	14	3.400	62.86			
华泰证券	202105 100000 5498	华兴源创	2021年 5月10 日	335,712. 00	9,600	14	3.400	443.94			
华泰证券	202105 100000 6692	睿创微纳	2021年 5月10 日	111,612. 00	1,200	14	3.400	147.56			
华泰证券	202105 100000 6694	海尔生物	2021年 5月10 日	336,280. 00	3,500	14	3.400	444.64			
华泰证券	202105 100000 6696	三达膜	2021年 5月10 日	429,858. 00	28,600	14	3.400	568.40			
华泰证券	202105 100000 6698	中微公司	2021年 5月10 日	1,609,80 0.00	15,000	14	3.400	2,128. 56			
华泰证券	202105 100000 6700	长阳科技	2021年 5月10 日	355,743. 00	14,100	14	3.400	470.40			
华泰证券	202105 100000 6702	普门科技	2021年 5月10 日	328,064. 00	12,800	14	3.400	433.72			
华泰证券	202105 100000 6704	传音控股	2021年 5月10 日	554,400. 00	3,600	14	3.400	733.04			
华泰证券	202105	石头科	2021年	1,206,69	1,000	14	3.400	1,595.			

	100000 6706	技	5月10日	0.00				58		
华泰证券	202105 100000 6708	虹软科技	2021年 5月10日	69,394.00	1,700	14	3.400	91.70	-	-
华泰证券	202105 100000 6710	天奈科技	2021年 5月10日	154,491.00	2,300	14	3.400	204.26	-	-
华泰证券	202105 100000 6712	道通科技	2021年 5月10日	1,087,065.00	15,300	14	3.400	1,437.38	-	-
华泰证券	202105 100000 6714	华熙生物	2021年 5月10日	2,661,910.00	13,700	14	3.400	3,519.60	-	-
华泰证券	202105 100000 6716	澜起科技	2021年 5月10日	987,644.00	19,600	14	3.400	1,305.92	-	-
华泰证券	202105 100000 6718	申联生物	2021年 5月10日	24,990.00	2,100	14	3.400	33.04	-	-
华泰证券	202105 100000 6720	昊海生科	2021年 5月10日	935,656.00	7,400	14	3.400	1,237.18	-	-
华泰证券	202105 100000 6722	安集科技	2021年 5月10日	327,161.00	1,900	14	3.400	432.60	-	-
华泰证券	202105 100000 6724	西部超导	2021年 5月10日	1,558,000.00	30,400	14	3.400	2,059.96	-	-
华泰证券	202104 270001 1526	中芯国际	2021年 4月27日	8,783,500.00	159,700	28	1.800	12,297.04	-	-
华泰证券	202104 290000 0353	中芯国际	2021年 4月29日	22,196,000.00	400,000	28	2.000	34,527.08	-	-
华泰证券	202105 140000 0190	中芯国际	2021年 5月14日	1,117,200.00	20,000	14	1.800	782.04	-	-
华泰证券	202105 200000 0389	中芯国际	2021年 5月20日	1,086,600.00	20,000	14	2.000	845.18	-	-
华泰证券	202105 210000 0361	石头科技	2021年 5月21日	12,565,200.00	10,000	14	3.400	16,613.94	-	-



华泰证券	202105 240000 5266	西部超 导	2021年 5月24 日	1,722,16 0.00	30,400	14	3.400	2,277. 10	-	-
华泰证券	202105 240000 5268	石头科 技	2021年 5月24 日	1,201,50 0.00	1,000	14	3.400	1,588. 72	-	-
华泰证券	202105 240000 5270	昊海生 科	2021年 5月24 日	1,154,32 6.00	7,400	14	3.400	1,526. 28	-	-
华泰证券	202105 240000 5272	普门科 技	2021年 5月24 日	348,800. 00	12,800	14	3.400	461.16	-	-
华泰证券	202105 240000 5274	华熙生 物	2021年 5月24 日	3,046,88 0.00	13,700	14	3.400	4,028. 64	-	-
华泰证券	202105 240000 5276	道通科 技	2021年 5月24 日	1,100,07 0.00	15,300	14	3.400	1,454. 60	-	-
华泰证券	202105 240000 5278	长阳科 技	2021年 5月24 日	352,641. 00	14,100	14	3.400	466.20	-	-
华泰证券	202105 240000 5280	三达膜	2021年 5月24 日	479,908. 00	28,600	14	3.400	634.48	-	-
华泰证券	202105 240000 5282	光峰科 技	2021年 5月24 日	476,672. 00	15,200	14	3.400	630.28	-	-
华泰证券	202105 240000 5284	澜起科 技	2021年 5月24 日	1,083,88 0.00	19,600	14	3.400	1,433. 18	-	-
华泰证券	202105 240000 5286	容百科 技	2021年 5月24 日	1,135,35 0.00	14,500	14	3.400	1,501. 22	-	-
华泰证券	202105 240000 5288	华兴源 创	2021年 5月24 日	330,720. 00	9,600	14	3.400	437.22	-	-
华泰证券	202105 240000 5290	睿创微 纳	2021年 5月24 日	112,752. 00	1,200	14	3.400	149.10	-	-
华泰证券	202105 240000 5292	虹软科 技	2021年 5月24 日	69,955.0 0	1,700	14	3.400	92.54	-	-
华泰证券	202105 240000	中微公 司	2021年 5月24	1,785,15 0.00	15,000	14	3.400	2,360. 40	-	-

	5294		日								
华泰证券	202105 240000 5296	申联生 物	2021年 5月24 日	25,116.0 0	2,100	14	3.400	33.18	-	-	
华泰证券	202105 240000 5298	安集科 技	2021年 5月24 日	394,953. 00	1,900	14	3.400	522.20	-	-	
华泰证券	202105 240000 5300	传音控 股	2021年 5月24 日	606,528. 00	3,600	14	3.400	801.92	-	-	
华泰证券	202105 240000 5302	南微医 学	2021年 5月24 日	1,191,96 0.00	4,500	14	3.400	1,575. 98	-	-	
华泰证券	202105 240000 5456	海尔生 物	2021年 5月24 日	356,300. 00	3,500	14	3.400	471.10	-	-	
华泰证券	202105 240000 5458	博瑞医 药	2021年 5月24 日	60,255.0 0	1,300	14	3.400	79.66	-	-	
华泰证券	202105 240000 5460	沪硅产 业	2021年 5月24 日	2,253,36 0.00	98,400	14	3.400	2,979. 48	-	-	
华泰证券	202105 240000 5462	天奈科 技	2021年 5月24 日	179,285. 00	2,300	14	3.400	237.02	-	-	
华泰证券	202105 270000 0644	传音控 股	2021年 5月27 日	3,080,52 5.00	17,500	14	3.400	4,073. 16	-	-	
华泰证券	202105 270000 0648	中微公 司	2021年 5月27 日	4,787,69 2.00	36,400	14	3.400	6,330. 38	-	-	
华泰证券	202105 270000 0650	容百科 技	2021年 5月27 日	2,115,30 0.00	27,500	14	3.400	2,796. 92	-	-	
华泰证券	202105 280000 3931	中芯国 际	2021年 5月28 日	1,115,60 0.00	20,000	14	1.800	780.92	-	-	
华泰证券	202105 180000 2570	中芯国 际	2021年 5月18 日	582,894. 00	10,600	28	3.400	1,541. 40	-	-	
华泰证券	202106 030000 0446	西部超 导	2021年 6月3日	2,949,50 0.00	50,000	14	3.400	3,899. 84	-	-	
华泰证券	202106	中芯国	2021年	1,107,20	20,000	14	2.000	861.14	-	-	

	030001 0550	际	6月3日	0.00							
华泰证券	202106 040000 0252	西部超 导	2021年 6月4日	585,300. 00	10,000	14	3.400	773.92		-	-
华泰证券	202105 240000 5620	中芯国 际	2021年 5月24 日	8,804,26 1.00	159,700	28	1.800	12,325 .88		-	-
华泰证券	202106 070000 5445	睿创微 纳	2021年 6月7日	107,400. 00	1,200	14	3.400	141.96		-	-
华泰证券	202106 070000 5447	昊海生 科	2021年 6月7日	1,197,91 2.00	7,400	14	3.400	1,583. 96		-	-
华泰证券	202106 070000 5449	道通科 技	2021年 6月7日	1,327,27 5.00	15,300	14	3.400	1,754. 90		-	-
华泰证券	202106 070000 5451	容百科 技	2021年 6月7日	1,658,80 0.00	14,500	14	3.400	2,193. 24		-	-
华泰证券	202106 070000 5453	传音控 股	2021年 6月7日	574,740. 00	3,600	14	3.400	759.92		-	-
华泰证券	202106 070000 5455	华兴源 创	2021年 6月7日	378,240. 00	9,600	14	3.400	500.08		-	-
华泰证券	202106 070000 5457	石头科 技	2021年 6月7日	1,194,00 0.00	1,000	14	3.400	1,578. 78		-	-
华泰证券	202106 070000 5459	沪硅产 业	2021年 6月7日	2,779,80 0.00	98,400	14	3.400	3,675. 56		-	-
华泰证券	202106 070000 5461	博瑞医 药	2021年 6月7日	61,737.0 0	1,300	14	3.400	81.62		-	-
华泰证券	202106 070000 5463	澜起科 技	2021年 6月7日	1,178,74 4.00	19,600	14	3.400	1,558. 62		-	-
华泰证券	202106 070000 5465	天奈科 技	2021年 6月7日	209,024. 00	2,300	14	3.400	276.36		-	-
华泰证券	202106 070000 5467	普门科 技	2021年 6月7日	360,320. 00	12,800	14	3.400	476.42		-	-

华泰证券	202106 070000 5469	海尔生 物	2021年 6月7日	334,670. 00	3,500	14	3.400	442.54	-	-
华泰证券	202106 070000 5471	安集科 技	2021年 6月7日	497,857. 00	1,900	14	3.400	658.28	-	-
华泰证券	202106 070000 5473	华熙生 物	2021年 6月7日	3,166,75 5.00	13,700	14	3.400	4,187. 12	-	-
华泰证券	202106 070000 5475	虹软科 技	2021年 6月7日	81,532.0 0	1,700	14	3.400	107.80	-	-
华泰证券	202106 070000 5477	光峰科 技	2021年 6月7日	575,928. 00	15,200	14	3.400	761.46	-	-
华泰证券	202106 070000 5479	西部超 导	2021年 6月7日	1,811,84 0.00	30,400	14	3.400	2,395. 68	-	-
华泰证券	202106 070000 5481	申联生 物	2021年 6月7日	27,594.0 0	2,100	14	3.400	36.54	-	-
华泰证券	202106 070000 5483	南微医 学	2021年 6月7日	1,206,31 5.00	4,500	14	3.400	1,595. 02	-	-
华泰证券	202106 070000 5485	中微公 司	2021年 6月7日	2,096,40 0.00	15,000	14	3.400	2,771. 86	-	-
华泰证券	202105 250000 8934	中芯国 际	2021年 5月25 日	8,872,93 2.00	159,700	28	1.800	12,422 .20	-	-
华泰证券	202106 080000 0558	虹软科 技	2021年 6月8日	957,800. 00	20,000	14	3.400	1,266. 44	-	-
华泰证券	202105 270001 8455	中芯国 际	2021年 5月27 日	22,748,0 00.00	400,000	28	2.000	35,385 .84	-	-
华泰证券	202106 100000 7078	容百科 技	2021年 6月10 日	3,162,50 0.00	27,500	14	3.400	4,181. 52	-	-
华泰证券	202106 100000 7924	中微公 司	2021年 6月10 日	5,008,64 0.00	36,400	14	3.400	6,622. 56	-	-
华泰证券	202106 110000	中芯国 际	2021年 6月11	1,112,40 0.00	20,000	14	1.800	778.68	-	-

	4058		日								
华泰证券	202106 160000 0532	孚能科技	2021年 6月16 日	274,300. 00	10,000	14	3.400	362.74	-	-	
华泰证券	202106 170000 0575	道通科技	2021年 6月17 日	2,472,85 8.00	28,200	14	3.400	3,269. 70	-	-	
华泰证券	202106 170000 0577	优刻得	2021年 6月17 日	7,740,00 0.00	180,000	14	3.400	10,234 .00	-	-	
华泰证券	202106 170001 7107	中芯国际	2021年 6月17 日	1,183,40 0.00	20,000	14	2.000	920.36	-	-	
华泰证券	202106 170001 7109	西部超导	2021年 6月17 日	2,851,50 0.00	50,000	14	3.400	3,770. 34	-	-	
华泰证券	202106 180000 0926	昊海生科	2021年 6月18 日	1,643,00 0.00	10,000	14	3.400	2,172. 38	-	-	
华泰证券	202106 180001 3866	西部超导	2021年 6月18 日	577,800. 00	10,000	14	3.400	763.98	-	-	
华泰证券	202106 210000 0659	芯原股份	2021年 6月21 日	779,800. 00	10,000	14	3.400	1,031. 10	-	-	
华泰证券	202106 210001 1651	石头科技	2021年 6月21 日	1,488,99 0.00	1,000	14	3.400	1,968. 82	-	-	
华泰证券	202106 210001 1653	道通科技	2021年 6月21 日	1,425,50 1.00	15,300	14	3.400	1,884. 82	-	-	
华泰证券	202106 210001 1655	博瑞医药	2021年 6月21 日	58,227.0 0	1,300	14	3.400	77.00	-	-	
华泰证券	202106 210001 1657	西部超导	2021年 6月21 日	1,878,72 0.00	30,400	14	3.400	2,484. 02	-	-	
华泰证券	202106 210001 1659	昊海生科	2021年 6月21 日	1,266,80 6.00	7,400	14	3.400	1,674. 96	-	-	
华泰证券	202106 210001 1663	天奈科技	2021年 6月21 日	225,699. 00	2,300	14	3.400	298.48	-	-	
华泰证券	202106	普门科	2021年	374,400.	12,800	14	3.400	495.04	-	-	

	210001 1665	技	6月21 日	00						
华泰证券	202106 210001 1667	澜起科 技	2021年 6月21 日	1,226,56 8.00	19,600	14	3.400	1,621. 76	-	-
华泰证券	202106 210001 1669	安集科 技	2021年 6月21 日	477,261. 00	1,900	14	3.400	630.98	-	-
华泰证券	202106 210001 1671	华兴源 创	2021年 6月21 日	373,632. 00	9,600	14	3.400	494.06	-	-
华泰证券	202106 210001 1673	容百科 技	2021年 6月21 日	1,602,68 5.00	14,500	14	3.400	2,119. 04	-	-
华泰证券	202106 210001 1675	虹软科 技	2021年 6月21 日	82,365.0 0	1,700	14	3.400	108.92	-	-
华泰证券	202106 210001 1677	申联生 物	2021年 6月21 日	28,833.0 0	2,100	14	3.400	38.08	-	-
华泰证券	202106 210001 1679	南微医 学	2021年 6月21 日	1,213,65 0.00	4,500	14	3.400	1,604. 68	-	-
华泰证券	202106 210001 1681	传音控 股	2021年 6月21 日	655,200. 00	3,600	14	3.400	866.32	-	-
华泰证券	202106 220000 1268	天合光 能	2021年 6月22 日	993,200. 00	40,000	14	3.400	1,313. 20	-	-
华泰证券	202106 220000 1270	航天宏 图	2021年 6月22 日	814,200. 00	20,000	14	3.400	1,076. 60	-	-
华泰证券	202106 250000 5861	中芯国 际	2021年 6月25 日	1,186,20 0.00	20,000	14	1.800	830.34	-	-
华泰证券	202106 300000 6133	孚能科 技	2021年 6月30 日	342,700. 00	10,000	14	3.400	453.18	-	-
华泰证券	202107 010000 0498	海尔生 物	2021年 7月1日	3,423,90 0.00	30,000	14	3.400	4,527. 18	-	-
华泰证券	202107 010001 4714	道通科 技	2021年 7月1日	2,491,75 2.00	28,200	14	3.400	3,294. 62	-	-

华泰证券	202107 010001 4716	中芯国际	2021年 7月1日	1,206,60 0.00	20,000	14	2.000	938.42	-	-
华泰证券	202107 010001 4718	优刻得	2021年 7月1日	6,868,80 0.00	180,000	14	3.400	9,082. 08	-	-
华泰证券	202107 010001 4720	西部超导	2021年 7月1日	3,150,00 0.00	50,000	14	3.400	4,165. 00	-	-
华泰证券	202107 020001 0552	昊海生科	2021年 7月2日	2,368,00 0.00	10,000	14	3.400	3,130. 96	-	-
华泰证券	202106 210001 1661	中芯国际	2021年 6月21 日	9,209,89 9.00	159,700	28	1.800	12,893 .72	-	-
华泰证券	202107 050001 1585	安集科技	2021年 7月5日	551,893. 00	1,900	14	3.400	729.68	-	-
华泰证券	202107 050001 1587	传音控股	2021年 7月5日	699,120. 00	3,600	14	3.400	924.42	-	-
华泰证券	202107 050001 1589	澜起科技	2021年 7月5日	1,195,79 6.00	19,600	14	3.400	1,581. 16	-	-
华泰证券	202107 050001 1591	普门科技	2021年 7月5日	394,496. 00	12,800	14	3.400	521.64	-	-
华泰证券	202107 050001 1593	博瑞医药	2021年 7月5日	52,104.0 0	1,300	14	3.400	68.88	-	-
华泰证券	202107 050001 1595	西部超导	2021年 7月5日	1,848,62 4.00	30,400	14	3.400	2,444. 26	-	-
华泰证券	202107 050001 1597	南微医学	2021年 7月5日	1,442,02 5.00	4,500	14	3.400	1,906. 66	-	-
华泰证券	202107 050001 1599	昊海生科	2021年 7月5日	1,857,32 6.00	7,400	14	3.400	2,455. 74	-	-
华泰证券	202107 050001 2585	华兴源创	2021年 7月5日	364,800. 00	9,600	14	3.400	482.30	-	-
华泰证券	202107 050001	虹软科技	2021年 7月5日	91,290.0 0	1,700	14	3.400	120.68	-	-

	2587										
华泰证券	202107 050001 2589	容百科 技	2021年 7月5日	1,897,03 5.00	14,500	14	3.400	2,508. 24			-
华泰证券	202107 050001 2591	道通科 技	2021年 7月5日	1,392,75 9.00	15,300	14	3.400	1,841. 56			-
华泰证券	202107 050001 2593	石头科 技	2021年 7月5日	1,124,95 0.00	1,000	14	3.400	1,487. 50			-
华泰证券	202107 050001 2595	天奈科 技	2021年 7月5日	302,726. 00	2,300	14	3.400	400.26			-
华泰证券	202107 050001 2597	申联生 物	2021年 7月5日	27,846.0 0	2,100	14	3.400	36.82			-
华泰证券	202106 220001 1664	中芯国 际	2021年 6月22 日	9,115,67 6.00	159,700	28	1.800	12,761 .84			-
华泰证券	202107 060001 1838	航天宏 图	2021年 7月6日	866,000. 00	20,000	14	3.400	1,145. 06			-
华泰证券	202106 230000 0876	奇安信	2021年 6月23 日	942,000. 00	10,000	28	3.400	2,491. 16			-
华泰证券	202106 240000 8875	中芯国 际	2021年 6月24 日	23,080,0 00.00	400,000	28	2.000	35,902 .16			-
华泰证券	202107 090000 6719	中芯国 际	2021年 7月9日	1,138,20 0.00	20,000	14	1.800	796.74			-
华泰证券	202106 280000 0460	孚能科 技	2021年 6月28 日	1,062,00 0.00	30,000	28	3.400	2,808. 40			-
华泰证券	202107 130000 1212	奇安信	2021年 7月13 日	1,189,30 0.00	10,000	14	3.400	1,572. 48			-
华泰证券	202107 140000 0524	安恒信 息	2021年 7月14 日	6,119,40 0.00	20,000	14	3.400	8,091. 16			-
华泰证券	202107 140000 0528	君实生 物	2021年 7月14 日	2,213,40 0.00	30,000	14	3.400	2,926. 56			-
华泰证券	202107	孚能科	2021年	1,126,50	30,000	14	3.400	1,489.			-



	140000 0530	技	7月14 日	0.00				46		
华泰证券	202107 140000 6296	孚能科 技	2021年 7月14 日	375,500. 00	10,000	14	3.400	496.44	-	-
华泰证券	202107 150000 1013	航天宏 图	2021年 7月15 日	1,283,70 0.00	30,000	14	3.400	1,697. 36	-	-
华泰证券	202107 150000 1015	嘉元科 技	2021年 7月15 日	3,200,70 0.00	30,000	14	3.400	4,232. 06	-	-
华泰证券	202107 150000 1017	奇安信	2021年 7月15 日	1,220,00 0.00	10,000	14	3.400	1,613. 08	-	-
华泰证券	202107 150000 1019	芯原股 份	2021年 7月15 日	1,277,60 0.00	20,000	14	3.400	1,689. 24	-	-
华泰证券	202107 150001 5044	中芯国 际	2021年 7月15 日	1,103,40 0.00	20,000	14	2.000	858.20	-	-
华泰证券	202107 150001 6526	海尔生 物	2021年 7月15 日	3,133,50 0.00	30,000	14	3.400	4,143. 16	-	-
华泰证券	202107 150001 6528	道通科 技	2021年 7月15 日	2,382,90 0.00	28,200	14	3.400	3,150. 70	-	-
华泰证券	202107 150001 7012	优刻得	2021年 7月15 日	6,935,40 0.00	180,000	14	3.400	9,170. 14	-	-
华泰证券	202107 160000 0454	传音控 股	2021年 7月16 日	3,481,87 4.00	20,200	14	3.400	4,603. 76	-	-
华泰证券	202107 160001 6220	昊海生 科	2021年 7月16 日	2,619,90 0.00	10,000	14	3.400	3,464. 16	-	-
华泰证券	202107 190001 2863	道通科 技	2021年 7月19 日	1,314,72 9.00	15,300	14	3.400	1,738. 38	-	-
华泰证券	202107 190001 2865	博瑞医 药	2021年 7月19 日	50,401.0 0	1,300	14	3.400	66.64	-	-
华泰证券	202107 190001 2867	西部超 导	2021年 7月19 日	2,049,26 4.00	30,400	14	3.400	2,709. 56	-	-

华泰证券	202107 190001 2869	石头科 技	2021年 7月19 日	1,026,00 0.00	1,000	14	3.400	1,356. 60	-	-
华泰证券	202107 190001 2871	昊海生 科	2021年 7月19 日	1,875,82 6.00	7,400	14	3.400	2,480. 24	-	-
华泰证券	202107 190001 2875	普门科 技	2021年 7月19 日	364,160. 00	12,800	14	3.400	481.46	-	-
华泰证券	202107 190001 2877	澜起科 技	2021年 7月19 日	1,136,80 0.00	19,600	14	3.400	1,503. 04	-	-
华泰证券	202107 190001 2879	天奈科 技	2021年 7月19 日	319,815. 00	2,300	14	3.400	422.80	-	-
华泰证券	202107 190001 2881	华兴源 创	2021年 7月19 日	358,656. 00	9,600	14	3.400	474.18	-	-
华泰证券	202107 190001 2883	容百科 技	2021年 7月19 日	1,820,47 5.00	14,500	14	3.400	2,407. 02	-	-
华泰证券	202107 190001 2885	安集科 技	2021年 7月19 日	531,126. 00	1,900	14	3.400	702.24	-	-
华泰证券	202107 190001 2887	虹软科 技	2021年 7月19 日	86,275.0 0	1,700	14	3.400	114.10	-	-
华泰证券	202107 190001 2889	申联生 物	2021年 7月19 日	28,140.0 0	2,100	14	3.400	37.24	-	-
华泰证券	202107 190001 2891	南微医 学	2021年 7月19 日	1,248,52 5.00	4,500	14	3.400	1,650. 88	-	-
华泰证券	202107 190001 2893	传音控 股	2021年 7月19 日	616,140. 00	3,600	14	3.400	814.66	-	-
华泰证券	202107 200001 1965	航天宏 图	2021年 7月20 日	867,800. 00	20,000	14	3.400	1,147. 44	-	-
华泰证券	202107 220000 0829	微芯生 物	2021年 7月22 日	1,254,58 0.00	29,800	14	3.400	1,658. 86	-	-
华泰证券	202107 220000	乐鑫科 技	2021年 7月22	5,520,00 0.00	20,000	14	3.400	7,298. 62	-	-

	0831		日								
华泰证券	202107 220000 0833	康希诺	2021年 7月22 日	5,949,10 0.00	10,000	14	3.400	7,866. 04			
华泰证券	202107 230000 5973	中芯国 际	2021年 7月23 日	1,037,60 0.00	20,000	14	1.800	726.32			
华泰证券	202107 270002 0193	奇安信	2021年 7月27 日	968,000. 00	10,000	14	3.400	1,279. 88			
华泰证券	202107 280000 8064	孚能科 技	2021年 7月28 日	969,000. 00	30,000	14	3.400	1,281. 28			
华泰证券	202107 280000 8066	孚能科 技	2021年 7月28 日	323,000. 00	10,000	14	3.400	427.14			
华泰证券	202107 280000 8068	安恒信 息	2021年 7月28 日	6,560,00 0.00	20,000	14	3.400	8,673. 84			
华泰证券	202107 290001 3719	中芯国 际	2021年 7月29 日	1,245,40 0.00	20,000	14	2.000	968.66			
华泰证券	202107 290001 3721	奇安信	2021年 7月29 日	965,000. 00	10,000	14	3.400	1,275. 96			
华泰证券	202107 290001 3723	芯原股 份	2021年 7月29 日	1,631,60 0.00	20,000	14	3.400	2,157. 40			
华泰证券	202107 290001 3725	嘉元科 技	2021年 7月29 日	2,598,00 0.00	30,000	14	3.400	3,435. 18			
华泰证券	202107 290001 3727	道通科 技	2021年 7月29 日	2,193,67 8.00	28,200	14	3.400	2,900. 52			
华泰证券	202107 290001 3729	优刻得	2021年 7月29 日	6,948,00 0.00	180,000	14	3.400	9,186. 80			
华泰证券	202107 290001 3731	航天宏 图	2021年 7月29 日	1,312,50 0.00	30,000	14	3.400	1,735. 44			
华泰证券	202107 290001 3733	海尔生 物	2021年 7月29 日	3,256,20 0.00	30,000	14	3.400	4,305. 42			
华泰证券	202107	传音控	2021年	3,290,58	20,200	14	3.400	4,350.			

	300001 3110	股	7月30 日	0.00				92		
华泰证券	202107 300001 4210	昊海生 科	2021年 7月30 日	2,136,00 0.00	10,000	14	3.400	2,824. 22	-	-
华泰证券	202107 190001 2873	中芯国 际	2021年 7月19 日	8,272,46 0.00	159,700	28	1.800	11,581 .36	-	-
华泰证券	202108 020001 3796	博瑞医 药	2021年 8月2日	45,890.0 0	1,300	14	3.400	60.62	-	-
华泰证券	202108 020001 3798	西部超 导	2021年 8月2日	2,521,98 4.00	30,400	14	3.400	3,334. 66	-	-
华泰证券	202108 020001 3800	天奈科 技	2021年 8月2日	337,180. 00	2,300	14	3.400	445.76	-	-
华泰证券	202108 020001 3802	石头科 技	2021年 8月2日	1,077,00 0.00	1,000	14	3.400	1,424. 08	-	-
华泰证券	202108 020001 3804	普门科 技	2021年 8月2日	330,112. 00	12,800	14	3.400	436.52	-	-
华泰证券	202108 020001 3806	昊海生 科	2021年 8月2日	1,606,31 8.00	7,400	14	3.400	2,123. 94	-	-
华泰证券	202108 020001 3808	道通科 技	2021年 8月2日	1,181,77 2.00	15,300	14	3.400	1,562. 54	-	-
华泰证券	202108 020001 3810	容百科 技	2021年 8月2日	1,856,72 5.00	14,500	14	3.400	2,455. 04	-	-
华泰证券	202108 020001 3812	申联生 物	2021年 8月2日	29,358.0 0	2,100	14	3.400	38.78	-	-
华泰证券	202108 020001 3814	澜起科 技	2021年 8月2日	1,306,73 2.00	19,600	14	3.400	1,727. 74	-	-
华泰证券	202108 020001 3816	安集科 技	2021年 8月2日	623,200. 00	1,900	14	3.400	824.04	-	-
华泰证券	202108 020001 3818	华兴源 创	2021年 8月2日	443,520. 00	9,600	14	3.400	586.46	-	-

华泰证券	202108 020001 3820	虹软科技	2021年 8月2日	87,023.0 0	1,700	14	3.400	115.08	-	-
华泰证券	202108 020001 3822	传音控股	2021年 8月2日	586,548. 00	3,600	14	3.400	775.60	-	-
华泰证券	202108 020001 3824	南微医学	2021年 8月2日	1,225,44 0.00	4,500	14	3.400	1,620. 36	-	-
华泰证券	202107 200000 1097	中国通号	2021年 7月20 日	4,570,50 6.00	855,900	28	3.400	12,086 .48	-	-
华泰证券	202107 200001 1963	中芯国际	2021年 7月20 日	8,285,23 6.00	159,700	28	1.800	11,599 .28	-	-
华泰证券	202108 030001 2764	航天宏图	2021年 8月3日	877,800. 00	20,000	14	3.400	1,160. 60	-	-
华泰证券	202107 210000 0497	天合光能	2021年 7月21 日	945,455. 00	24,500	28	3.400	2,500. 12	-	-
华泰证券	202107 210000 0499	西部超导	2021年 7月21 日	2,238,88 9.00	31,100	28	3.400	5,920. 60	-	-
华泰证券	202107 210000 0501	虹软科技	2021年 7月21 日	878,667. 00	17,300	28	3.400	2,323. 72	-	-
华泰证券	202107 210000 0503	乐鑫科技	2021年 7月21 日	2,753,50 0.00	10,000	28	3.400	7,281. 40	-	-
华泰证券	202107 210000 0505	方邦股份	2021年 7月21 日	916,200. 00	10,000	28	3.400	2,422. 84	-	-
华泰证券	202107 210001 9973	奇安信	2021年 7月21 日	1,005,00 0.00	10,000	28	3.400	2,657. 76	-	-
华泰证券	202107 220000 8014	中芯国际	2021年 7月22 日	21,200,0 00.00	400,000	28	2.000	32,977 .84	-	-
华泰证券	202108 050001 0419	乐鑫科技	2021年 8月5日	5,074,00 0.00	20,000	14	3.400	6,708. 94	-	-
华泰证券	202108 050001	微芯生物	2021年 8月5日	1,204,51 6.00	29,800	14	3.400	1,592. 64	-	-

	0421										
华泰证券	202108 050001 0423	康希诺	2021年 8月5日	6,740,00 0.00	10,000	14	3.400	8,911. 84	-	-	
华泰证券	202108 060000 0676	天合光 能	2021年 8月6日	4,996,00 0.00	100,000	14	3.400	6,605. 76	-	-	
华泰证券	202108 060000 7446	中芯国 际	2021年 8月6日	1,349,20 0.00	20,000	14	1.800	944.44	-	-	
华泰证券	202107 260000 5460	孚能科 技	2021年 7月26 日	1,015,50 0.00	30,000	28	3.400	2,685. 48	-	-	
华泰证券	202107 270000 0765	中国通 号	2021年 7月27 日	1,541,08 4.00	294,100	28	2.000	2,397. 36	-	-	
华泰证券	202108 100002 1611	奇安信	2021年 8月10 日	974,400. 00	10,000	14	3.400	1,288. 42	-	-	
华泰证券	202108 110001 0760	孚能科 技	2021年 8月11 日	1,305,30 0.00	30,000	14	3.400	1,725. 92	-	-	
华泰证券	202108 110001 0762	孚能科 技	2021年 8月11 日	435,100. 00	10,000	14	3.400	575.26	-	-	
华泰证券	202108 110001 0764	安恒信 息	2021年 8月11 日	6,490,00 0.00	20,000	14	3.400	8,581. 16	-	-	
华泰证券	202108 120001 6859	奇安信	2021年 8月12 日	966,800. 00	10,000	14	3.400	1,278. 34	-	-	
华泰证券	202108 120001 6861	嘉元科 技	2021年 8月12 日	3,185,70 0.00	30,000	14	3.400	4,212. 18	-	-	
华泰证券	202108 120001 6863	航天宏 图	2021年 8月12 日	1,406,10 0.00	30,000	14	3.400	1,859. 20	-	-	
华泰证券	202108 120001 6865	海尔生 物	2021年 8月12 日	3,617,10 0.00	30,000	14	3.400	4,782. 68	-	-	
华泰证券	202108 120001 6867	道通科 技	2021年 8月12 日	2,354,98 2.00	28,200	14	3.400	3,113. 74	-	-	
华泰证券	202108	中芯国	2021年	1,241,80	20,000	14	2.000	965.86	-	-	

	120001 8587	际	8月12 日	0.00						
华泰证券	202108 120001 8589	芯原股 份	2021年 8月12 日	1,800,00 0.00	20,000	14	3.400	2,380. 00	-	-
华泰证券	202108 130004 2498	昊海生 科	2021年 8月13 日	1,905,50 0.00	10,000	14	3.400	2,519. 44	-	-
华泰证券	202108 130004 2500	传音控 股	2021年 8月13 日	3,595,19 6.00	20,200	14	3.400	4,753. 70	-	-
华泰证券	202108 160001 4025	容百科 技	2021年 8月16 日	1,873,40 0.00	14,500	14	3.400	2,477. 02	-	-
华泰证券	202108 160001 4027	南微医 学	2021年 8月16 日	1,179,09 0.00	4,500	14	3.400	1,559. 04	-	-
华泰证券	202108 160001 4029	传音控 股	2021年 8月16 日	637,740. 00	3,600	14	3.400	843.22	-	-
华泰证券	202108 160001 4563	博瑞医 药	2021年 8月16 日	44,369.0 0	1,300	14	3.400	58.66	-	-
华泰证券	202108 160001 4565	石头科 技	2021年 8月16 日	1,271,00 0.00	1,000	14	3.400	1,680. 56	-	-
华泰证券	202108 160001 4567	西部超 导	2021年 8月16 日	2,492,49 6.00	30,400	14	3.400	3,295. 60	-	-
华泰证券	202108 160001 4569	天奈科 技	2021年 8月16 日	333,983. 00	2,300	14	3.400	441.56	-	-
华泰证券	202108 160001 4571	普门科 技	2021年 8月16 日	305,408. 00	12,800	14	3.400	403.76	-	-
华泰证券	202108 160001 4575	道通科 技	2021年 8月16 日	1,356,03 9.00	15,300	14	3.400	1,792. 98	-	-
华泰证券	202108 160001 4577	昊海生 科	2021年 8月16 日	1,440,70 6.00	7,400	14	3.400	1,904. 98	-	-
华泰证券	202108 160001 4579	澜起科 技	2021年 8月16 日	1,164,24 0.00	19,600	14	3.400	1,539. 44	-	-

华泰证券	202108 160001 4581	安集科技	2021年 8月16 日	549,537. 00	1,900	14	3.400	726.60	-	-
华泰证券	202108 160001 4583	华兴源创	2021年 8月16 日	403,776. 00	9,600	14	3.400	533.82	-	-
华泰证券	202108 160001 4585	虹软科技	2021年 8月16 日	77,707.0 0	1,700	14	3.400	102.76	-	-
华泰证券	202108 160001 4587	申联生物	2021年 8月16 日	27,930.0 0	2,100	14	3.400	36.96	-	-
华泰证券	202108 170000 0688	寒武纪	2021年 8月17 日	671,840. 00	6,800	14	3.400	888.30	-	-
华泰证券	202108 170001 5224	航天宏图	2021年 8月17 日	1,004,00 0.00	20,000	14	3.400	1,327. 48	-	-
华泰证券	202108 040000 0895	圣湘生物	2021年 8月4日	1,277,92 0.00	14,000	28	3.400	3,379. 32	-	-
华泰证券	202108 180000 0565	柏楚电子	2021年 8月18 日	551,650. 00	1,100	14	3.400	729.40	-	-
华泰证券	202108 180000 0569	寒武纪	2021年 8月18 日	687,120. 00	7,000	14	3.400	908.46	-	-
华泰证券	202108 180000 0573	杭可科技	2021年 8月18 日	4,188,96 0.00	36,000	14	3.400	5,538. 68	-	-
华泰证券	202108 180000 0575	澜起科技	2021年 8月18 日	3,939,55 6.00	69,200	14	3.400	5,208. 98	-	-
华泰证券	202108 190000 0739	容百科技	2021年 8月19 日	139,040. 00	1,100	14	3.400	183.82	-	-
华泰证券	202108 190001 0813	乐鑫科技	2021年 8月19 日	4,562,60 0.00	20,000	14	3.400	6,032. 74	-	-
华泰证券	202108 190001 0815	康希诺	2021年 8月19 日	4,008,80 0.00	10,000	14	3.400	5,300. 54	-	-
华泰证券	202108 190001	微芯生物	2021年 8月19	1,176,50 4.00	29,800	14	3.400	1,555. 54	-	-



	0817		日							
华泰证券	202108 200000 8178	天合光 能	2021年 8月20 日	4,378,00 0.00	100,000	14	3.400	5,788. 72	-	-
华泰证券	202108 200000 8180	中芯国 际	2021年 8月20 日	1,186,20 0.00	20,000	14	1.800	830.34	-	-
华泰证券	202108 240002 1307	奇安信	2021年 8月24 日	977,300. 00	10,000	14	3.400	1,292. 20	-	-
华泰证券	202108 110000 0603	凯赛生 物	2021年 8月11 日	1,167,70 0.00	10,000	28	3.400	3,087. 84	-	-
华泰证券	202108 250000 9723	孚能科 技	2021年 8月25 日	386,800. 00	10,000	14	3.400	511.42	-	-
华泰证券	202108 250000 9725	孚能科 技	2021年 8月25 日	1,160,40 0.00	30,000	14	3.400	1,534. 26	-	-
华泰证券	202108 250000 9727	安恒信 息	2021年 8月25 日	6,695,40 0.00	20,000	14	3.400	8,852. 76	-	-
华泰证券	202108 180000 0563	方邦股 份	2021年 8月18 日	169,140. 00	2,000	28	3.400	351.34	-	-
华泰证券	202108 180002 0176	方邦股 份	2021年 8月18 日	845,700. 00	10,000	28	3.400	1,757. 14	-	-
华泰证券	202108 230000 7669	孚能科 技	2021年 8月23 日	1,116,00 0.00	30,000	28	3.400	1,791. 80	-	-
华泰证券	202108 260001 2961	嘉元科 技	2021年 8月26 日	3,492,30 0.00	30,000	14	3.400	4,617. 62	-	-
华泰证券	202108 260001 2963	道通科 技	2021年 8月26 日	2,445,22 2.00	28,200	14	3.400	3,233. 16	-	-
华泰证券	202108 260001 2965	海尔生 物	2021年 8月26 日	3,855,30 0.00	30,000	14	3.400	5,097. 54	-	-
华泰证券	202108 260001 5735	奇安信	2021年 8月26 日	930,900. 00	10,000	14	3.400	1,230. 88	-	-
华泰证券	202108	芯原股	2021年	1,532,20	20,000	14	3.400	2,025.	-	-

	260001 5737	份	8月26 日	0.00				94		
华泰证券	202108 260001 5739	中芯国 际	2021年 8月26 日	1,178,20 0.00	20,000	14	2.000	916.44	-	-
华泰证券	202108 260001 5741	航天宏 图	2021年 8月26 日	1,576,80 0.00	30,000	14	3.400	2,084. 88	-	-
华泰证券	202108 300001 4401	普门科 技	2021年 8月30 日	248,704. 00	12,800	14	3.400	234.90	-	-
华泰证券	202108 300001 4403	申联生 物	2021年 8月30 日	25,389.0 0	2,100	14	3.400	24.00	-	-
华泰证券	202108 310001 2115	航天宏 图	2021年 8月31 日	995,800. 00	20,000	14	3.400	846.45	-	-
华泰证券	202108 270001 1813	昊海生 科	2021年 8月27 日	1,730,00 0.00	10,000	14	3.400	2,287. 46	-	-
华泰证券	202108 270001 1815	传音控 股	2021年 8月27 日	3,069,99 6.00	20,200	14	3.400	4,059. 16	-	-
华泰证券	202109 090000 2392	方邦股 份	2021年 8月18 日	950,000. 00	10,000	23	3.400	79.87	-	-
华泰证券	202109 090000 2394	方邦股 份	2021年 8月18 日	190,000. 00	2,000	23	3.400	15.97	-	-
华泰证券	202109 090000 2396	航天宏 图	2021年 8月31 日	962,200. 00	20,000	10	3.400	94.05	-	-
华泰证券	202109 090000 2398	申联生 物	2021年 8月30 日	25,452.0 0	2,100	11	3.400	2.40	-	-
华泰证券	202109 090000 2400	普门科 技	2021年 8月30 日	240,128. 00	12,800	11	3.400	23.49	-	-
华泰证券	202108 160001 4573	中芯国 际	2021年 8月16 日	9,382,37 5.00	159,700	28	1.800	13,135 .36	-	-
华泰证券	202108 300001 4389	西部超 导	2021年 8月30 日	2,755,15 2.00	30,400	14	3.400	3,642. 94	-	-

华泰证券	202108 300001 4391	石头科技	2021年 8月30 日	1,119,99 0.00	1,000	14	3.400	1,480. 92	-	-
华泰证券	202108 300001 4393	道通科技	2021年 8月30 日	1,346,40 0.00	15,300	14	3.400	1,780. 24	-	-
华泰证券	202108 300001 4395	博瑞医药	2021年 8月30 日	43,069.0 0	1,300	14	3.400	56.98	-	-
华泰证券	202108 300001 4397	天奈科技	2021年 8月30 日	368,713. 00	2,300	14	3.400	487.48	-	-
华泰证券	202108 300001 4399	昊海生科	2021年 8月30 日	1,287,60 0.00	7,400	14	3.400	1,702. 54	-	-
华泰证券	202108 300001 5497	澜起科技	2021年 8月30 日	1,242,24 8.00	19,600	14	3.400	1,642. 48	-	-
华泰证券	202108 300001 5499	华兴源创	2021年 8月30 日	364,800. 00	9,600	14	3.400	482.30	-	-
华泰证券	202108 300001 5501	容百科技	2021年 8月30 日	1,743,19 0.00	14,500	14	3.400	2,304. 82	-	-
华泰证券	202108 300001 5503	传音控股	2021年 8月30 日	527,652. 00	3,600	14	3.400	697.62	-	-
华泰证券	202108 300001 5505	安集科技	2021年 8月30 日	480,795. 00	1,900	14	3.400	635.74	-	-
华泰证券	202108 300001 5507	虹软科技	2021年 8月30 日	69,853.0 0	1,700	14	3.400	92.40	-	-
华泰证券	202108 300001 5509	南微医学	2021年 8月30 日	958,860. 00	4,500	14	3.400	1,267. 84	-	-
华泰证券	202109 090000 2402	孚能科技	2021年 8月23 日	1,076,40 0.00	30,000	21	3.400	421.60	-	-
华泰证券	202108 170000 0686	西部超导	2021年 8月17 日	88,803.0 0	1,100	28	3.400	234.92	-	-
华泰证券	202108 170001	中芯国际	2021年 8月17	9,117,27 3.00	159,700	28	1.800	12,764 .08	-	-

	2904		日								
华泰证券	202108 310001 1457	寒武纪	2021年 8月31 日	602,888. 00	6,800	14	3.400	797.16	-	-	
华泰证券	202108 180000 0567	南微医学	2021年 8月18 日	1,956,49 3.00	7,700	28	3.400	5,173. 84	-	-	
华泰证券	202108 180000 0571	柏楚电子	2021年 8月18 日	2,306,90 0.00	4,600	28	3.400	6,100. 36	-	-	
华泰证券	202108 180000 0577	杭可科技	2021年 8月18 日	418,896. 00	3,600	28	3.400	1,107. 68	-	-	
华泰证券	202108 180000 0579	安集科技	2021年 8月18 日	1,952,63 1.00	6,900	28	3.400	5,163. 76	-	-	
华泰证券	202108 180000 0705	中国通号	2021年 8月18 日	3,640,32 0.00	711,000	28	2.000	5,662. 72	-	-	
华泰证券	202108 180002 0166	西部超导	2021年 8月18 日	2,636,65 8.00	31,100	28	3.400	6,972. 56	-	-	
华泰证券	202108 180002 0168	天合光能	2021年 8月18 日	1,044,68 0.00	24,500	28	3.400	2,762. 48	-	-	
华泰证券	202108 180002 0170	奇安信	2021年 8月18 日	940,000. 00	10,000	28	3.400	2,485. 84	-	-	
华泰证券	202108 180002 0172	乐鑫科技	2021年 8月18 日	2,275,50 0.00	10,000	28	3.400	6,017. 48	-	-	
华泰证券	202108 180002 0174	虹软科技	2021年 8月18 日	763,622. 00	17,300	28	3.400	2,019. 36	-	-	
华泰证券	202109 010000 0633	传音控股	2021年 9月1日	450,000. 00	3,000	14	3.400	595.00	-	-	
华泰证券	202109 010001 6223	澜起科技	2021年 9月1日	4,295,24 4.00	69,200	14	3.400	5,679. 24	-	-	
华泰证券	202109 010001 9211	寒武纪	2021年 9月1日	627,200. 00	7,000	14	3.400	829.36	-	-	
华泰证券	202109	杭可科	2021年	3,560,40	36,000	14	3.400	4,707.	-	-	

	010001 9213	技	9月1日	0.00				64		
华泰证券	202108 190001 0811	中芯国际	2021年 8月19 日	23,668,0 00.00	400,000	28	2.000	36,816 .92	-	-
华泰证券	202109 020000 0612	杭可科技	2021年 9月2日	315,520. 00	3,400	14	3.400	417.20	-	-
华泰证券	202109 020001 2590	微芯生物	2021年 9月2日	1,105,58 0.00	29,800	14	3.400	1,461. 88	-	-
华泰证券	202109 020001 2592	乐鑫科技	2021年 9月2日	4,202,40 0.00	20,000	14	3.400	5,556. 46	-	-
华泰证券	202109 020001 2594	容百科技	2021年 9月2日	119,295. 00	1,100	14	3.400	157.78	-	-
华泰证券	202109 020001 2596	康希诺	2021年 9月2日	3,716,90 0.00	10,000	14	3.400	4,914. 56	-	-
华泰证券	202109 030000 9139	天合光能	2021年 9月3日	5,916,00 0.00	100,000	14	3.400	7,822. 22	-	-
华泰证券	202109 030000 9455	中芯国际	2021年 9月3日	1,135,40 0.00	20,000	14	1.800	794.78	-	-
华泰证券	202108 240001 9329	中国通号	2021年 8月24 日	1,505,79 2.00	294,100	28	2.000	2,426. 14	-	-
华泰证券	202109 060000 0521	圣湘生物	2021年 9月6日	68,680.0 0	1,000	14	3.400	103.84	-	-
华泰证券	202109 070001 8939	奇安信	2021年 9月7日	902,700. 00	10,000	14	3.400	1,278. 90	-	-
华泰证券	202109 080001 1411	安恒信息	2021年 9月8日	6,407,20 0.00	20,000	14	3.400	8,471. 68	-	-
华泰证券	202109 090000 0389	天合光能	2021年 9月9日	334,620. 00	6,000	14	3.400	442.40	-	-
华泰证券	202109 090001 6895	芯原股份	2021年 9月9日	1,490,00 0.00	20,000	14	3.400	1,970. 08	-	-

华泰证券	202109 090001 6897	海尔生 物	2021年 9月9日	3,592,80 0.00	30,000	14	3.400	4,750. 48	-	-
华泰证券	202109 090001 6899	奇安信	2021年 9月9日	890,500. 00	10,000	14	3.400	1,177. 40	-	-
华泰证券	202109 090001 6901	道通科 技	2021年 9月9日	2,346,52 2.00	28,200	14	3.400	3,102. 68	-	-
华泰证券	202109 090001 6903	中芯国 际	2021年 9月9日	1,131,80 0.00	20,000	14	2.000	880.32	-	-
华泰证券	202109 090001 6905	嘉元科 技	2021年 9月9日	3,551,70 0.00	30,000	14	3.400	4,696. 16	-	-
华泰证券	202109 100001 6245	传音控 股	2021年 9月10 日	2,989,60 0.00	20,200	14	3.400	3,952. 90	-	-
华泰证券	202109 100001 6247	昊海生 科	2021年 9月10 日	1,761,10 0.00	10,000	14	3.400	2,328. 62	-	-
华泰证券	202109 130001 5758	西部超 导	2021年 9月13 日	2,401,60 0.00	30,400	14	3.400	3,175. 48	-	-
华泰证券	202109 130001 5760	天奈科 技	2021年 9月13 日	360,640. 00	2,300	14	3.400	476.84	-	-
华泰证券	202109 130001 5762	昊海生 科	2021年 9月13 日	1,258,07 4.00	7,400	14	3.400	1,663. 48	-	-
华泰证券	202109 130001 5764	道通科 技	2021年 9月13 日	1,184,22 0.00	15,300	14	3.400	1,565. 76	-	-
华泰证券	202109 130001 5766	博瑞医 药	2021年 9月13 日	43,602.0 0	1,300	14	3.400	57.68	-	-
华泰证券	202109 130001 5768	石头科 技	2021年 9月13 日	785,000. 00	1,000	14	3.400	1,037. 96	-	-
华泰证券	202109 130001 5770	虹软科 技	2021年 9月13 日	71,519.0 0	1,700	14	3.400	94.50	-	-
华泰证券	202109 130001	澜起科 技	2021年 9月13	1,113,28 0.00	19,600	14	3.400	1,471. 96	-	-

	5772		日								
华泰证券	202109 130001 5774	华兴源 创	2021年 9月13 日	361,536. 00	9,600	14	3.400	478.10		-	-
华泰证券	202109 130001 5776	容百科 科技	2021年 9月13 日	1,763,05 5.00	14,500	14	3.400	2,331. 14		-	-
华泰证券	202109 130001 5778	传音控 股	2021年 9月13 日	507,060. 00	3,600	14	3.400	670.46		-	-
华泰证券	202109 130001 5780	南微医 学	2021年 9月13 日	921,960. 00	4,500	14	3.400	1,218. 98		-	-
华泰证券	202109 130001 5782	安集科 技	2021年 9月13 日	492,100. 00	1,900	14	3.400	650.72		-	-
华泰证券	202108 310000 0301	金山办 公	2021年 8月31 日	923,150. 00	3,700	28	3.400	2,441. 32		-	-
华泰证券	202109 140000 0644	天合光 能	2021年 9月14 日	51,700.0 0	1,000	14	3.400	68.32		-	-
华泰证券	202109 140001 3512	寒武纪	2021年 9月14 日	601,800. 00	6,800	14	3.400	795.76		-	-
华泰证券	202109 010001 9209	圣湘生 物	2021年 9月1日	974,820. 00	14,000	28	3.400	2,577. 96		-	-
华泰证券	202109 150001 9064	寒武纪	2021年 9月15 日	603,120. 00	7,000	14	3.400	797.44		-	-
华泰证券	202109 150001 9074	澜起科 技	2021年 9月15 日	3,920,87 2.00	69,200	14	3.400	5,184. 20		-	-
华泰证券	202109 150001 9076	传音控 股	2021年 9月15 日	413,130. 00	3,000	14	3.400	546.28		-	-
华泰证券	202109 150002 1374	杭可科 技	2021年 9月15 日	3,486,60 0.00	36,000	14	3.400	4,610. 06		-	-
华泰证券	202109 160000 0565	澜起科 技	2021年 9月16 日	226,771. 00	4,100	14	3.400	299.88		-	-
华泰证券	202109	睿创微	2021年	390,540.	4,600	14	3.400	516.32		-	-

	160000 0567	纳	9月16日	00						
华泰证券	202109 160001 1193	康希诺	2021年 9月16日	3,322,50 0.00	10,000	14	3.400	4,393. 06	-	-
华泰证券	202109 160001 4329	乐鑫科技	2021年 9月16日	3,963,00 0.00	20,000	14	3.400	5,239. 92	-	-
华泰证券	202109 160001 4331	微芯生物	2021年 9月16日	1,134,18 8.00	29,800	14	3.400	1,499. 68	-	-
华泰证券	202109 160001 4335	杭可科技	2021年 9月16日	307,020. 00	3,400	14	3.400	406.00	-	-
华泰证券	202109 160001 4337	容百科技	2021年 9月16日	122,639. 00	1,100	14	3.400	162.12	-	-
华泰证券	202109 030000 0549	西部超导	2021年 9月3日	110,936. 00	1,400	28	3.400	366.80	-	-
华泰证券	202109 060000 0523	西部超导	2021年 9月6日	113,806. 00	1,400	28	3.400	344.00	-	-
华泰证券	202109 080001 1409	凯赛生物	2021年 9月8日	1,665,00 0.00	10,000	28	3.400	4,717. 50	-	-
华泰证券	202109 170000 8023	中芯国际	2021年 9月17日	1,113,00 0.00	20,000	14	1.800	1,168. 65	-	-
华泰证券	202109 170000 8025	天合光能	2021年 9月17日	4,902,00 0.00	100,000	14	3.400	9,722. 37	-	-
华泰证券	202109 220003 0801	奇安信	2021年 9月22日	754,500. 00	10,000	14	3.400	1,140. 16	-	-
华泰证券	202109 220003 0803	圣湘生物	2021年 9月22日	57,110.0 0	1,000	14	3.400	86.24	-	-
华泰证券	202109 220003 0807	安恒信息	2021年 9月22日	6,220,00 0.00	20,000	14	3.400	9,399. 04	-	-
华泰证券	202109 230001 4531	海尔生物	2021年 9月23日	3,300,00 0.00	30,000	14	3.400	4,675. 05	-	-



华泰证券	202109 230001 5427	奇安信	2021年 9月23 日	770,000. 00	10,000	14	3.400	1,090. 80	-	-
华泰证券	202109 230001 5429	芯原股 份	2021年 9月23 日	1,491,60 0.00	20,000	14	3.400	2,113. 05	-	-
华泰证券	202109 230001 6987	天合光 能	2021年 9月23 日	306,600. 00	6,000	14	3.400	434.40	-	-
华泰证券	202109 230001 6989	中芯国 际	2021年 9月23 日	1,106,60 0.00	20,000	14	2.000	922.20	-	-
华泰证券	202109 230001 6991	道通科 技	2021年 9月23 日	2,315,22 0.00	28,200	14	3.400	3,279. 90	-	-
华泰证券	202109 230001 6993	嘉元科 技	2021年 9月23 日	4,047,90 0.00	30,000	14	3.400	5,734. 50	-	-
华泰证券	202109 240001 3313	昊海生 科	2021年 9月24 日	1,896,50 0.00	10,000	14	3.400	2,507. 54	-	-
华泰证券	202109 240001 3315	传音控 股	2021年 9月24 日	3,013,63 8.00	20,200	14	3.400	3,984. 68	-	-
华泰证券	202109 140001 3628	西部超 导	2021年 9月14 日	85,360.0 0	1,100	28	3.400	225.68	-	-
华泰证券	202109 280001 2400	天合光 能	2021年 9月28 日	48,700.0 0	1,000	14	3.400	64.40	-	-
华泰证券	202109 280001 3442	寒武纪	2021年 9月28 日	544,884. 00	6,800	14	3.400	720.44	-	-
华泰证券	202109 150000 0877	杭可科 技	2021年 9月15 日	590,785. 00	6,100	28	3.400	1,562. 40	-	-
华泰证券	202109 150000 0879	南微医 学	2021年 9月15 日	426,321. 00	2,100	28	3.400	1,127. 28	-	-
华泰证券	202109 150000 0881	澜起科 技	2021年 9月15 日	1,983,10 0.00	35,000	28	3.400	5,244. 12	-	-
华泰证券	202109 150000	九号公 司	2021年 9月15	1,848,36 3.00	23,700	28	3.400	4,887. 96	-	-

	0883		日								
华泰证券	202109 150000 0885	凯赛生物	2021年 9月15 日	1,034,93 1.00	6,900	28	3.400	2,736. 72	-	-	
华泰证券	202109 150000 0887	道通科技	2021年 9月15 日	1,670,27 0.00	21,400	28	3.400	4,417. 00	-	-	
华泰证券	202109 150000 0889	威胜信息	2021年 9月15 日	72,974.0 0	3,100	28	3.400	192.92	-	-	
华泰证券	202109 150000 0891	虹软科技	2021年 9月15 日	835,990. 00	20,500	28	3.400	2,210. 60	-	-	
华泰证券	202109 150000 0893	优刻得	2021年 9月15 日	64,062.0 0	1,800	28	3.400	169.40	-	-	
华泰证券	202109 150000 0895	金山办公	2021年 9月15 日	506,000. 00	2,000	28	3.400	1,338. 12	-	-	
华泰证券	202109 150000 0897	君实生物	2021年 9月15 日	146,950. 00	2,500	28	3.400	388.64	-	-	
华泰证券	202109 150000 0899	容百科技	2021年 9月15 日	2,061,94 9.00	16,700	28	3.400	5,452. 72	-	-	
华泰证券	202109 150000 0901	晶晨股份	2021年 9月15 日	2,136,32 8.00	19,400	28	3.400	5,649. 28	-	-	
华泰证券	202109 150000 0903	晶丰明源	2021年 9月15 日	415,000. 00	1,000	28	3.400	1,097. 32	-	-	
华泰证券	202109 150001 9058	西部超导	2021年 9月15 日	2,446,32 6.00	31,100	28	3.400	6,469. 12	-	-	
华泰证券	202109 150001 9060	天合光能	2021年 9月15 日	1,341,37 5.00	24,500	28	3.400	3,547. 32	-	-	
华泰证券	202109 150001 9062	柏楚电子	2021年 9月15 日	2,177,18 0.00	4,600	28	3.400	5,757. 36	-	-	
华泰证券	202109 150001 9066	虹软科技	2021年 9月15 日	705,494. 00	17,300	28	3.400	1,865. 64	-	-	
华泰证券	202109	乐鑫科	2021年	2,046,50	10,000	28	3.400	5,411.	-	-	

	150001 9068	技	9月15 日	0.00				84		
华泰证券	202109 150001 9070	奇安信	2021年 9月15 日	834,000. 00	10,000	28	3.400	2,205. 56	-	-
华泰证券	202109 150001 9072	中国通 号	2021年 9月15 日	3,775,41 0.00	711,000	28	2.000	5,873. 00	-	-
华泰证券	202109 150001 9078	安集科 技	2021年 9月15 日	1,838,71 2.00	6,900	28	3.400	4,862. 48	-	-
华泰证券	202109 150001 9080	南微医 学	2021年 9月15 日	1,563,17 7.00	7,700	28	3.400	4,133. 64	-	-
华泰证券	202109 150002 1376	杭可科 技	2021年 9月15 日	348,660. 00	3,600	28	3.400	922.04	-	-
华泰证券	202109 290001 6291	寒武纪	2021年 9月29 日	547,050. 00	7,000	14	3.400	723.38	-	-
华泰证券	202109 290001 6295	杭可科 技	2021年 9月29 日	2,937,96 0.00	36,000	14	3.400	3,884. 58	-	-
华泰证券	202109 290001 6297	澜起科 技	2021年 9月29 日	4,171,37 6.00	69,200	14	3.400	5,515. 44	-	-
华泰证券	202109 290001 6299	传音控 股	2021年 9月29 日	438,210. 00	3,000	14	3.400	579.46	-	-
华泰证券	202109 160000 0569	中国通 号	2021年 9月16 日	165,540. 00	31,000	28	1.800	231.84	-	-
华泰证券	202109 160001 4333	中芯国 际	2021年 9月16 日	22,044,0 00.00	400,000	28	2.000	34,290 .76	-	-
华泰证券	202109 300001 2549	微芯生 物	2021年 9月30 日	1,119,88 4.00	29,800	14	3.400	1,480. 78	-	-
华泰证券	202109 300001 2551	乐鑫科 技	2021年 9月30 日	4,186,20 0.00	20,000	14	3.400	5,535. 04	-	-
华泰证券	202109 300001 2553	康希诺	2021年 9月30 日	3,387,90 0.00	10,000	14	3.400	4,479. 58	-	-

华泰证券	202109 300001 2555	杭可科 技	2021年 9月30 日	281,350. 00	3,400	14	3.400	371.98	-	-
华泰证券	202109 300001 2557	容百科 技	2021年 9月30 日	118,888. 00	1,100	14	3.400	157.22	-	-
华泰证券	202109 300001 2559	澜起科 技	2021年 9月30 日	243,581. 00	4,100	14	3.400	322.00	-	-
华泰证券	202109 220000 0652	中国通 号	2021年 9月22 日	132,750. 00	25,000	28	2.000	206.64	-	-
华泰证券	202109 220000 0654	西部超 导	2021年 9月22 日	170,940. 00	2,200	28	3.400	451.92	-	-
华泰证券	202109 220000 0656	金山办 公	2021年 9月22 日	1,167,57 2.00	4,900	28	3.400	3,087. 56	-	-
华泰证券	202109 220003 0805	中国通 号	2021年 9月22 日	1,561,67 1.00	294,100	28	2.000	2,429. 28	-	-
华泰证券	202109 230000 0706	澜起科 技	2021年 9月23 日	1,449,36 4.00	25,900	28	3.400	3,832. 64	-	-
华泰证券	202109 230000 0708	西部超 导	2021年 9月23 日	555,840. 00	7,200	28	3.400	1,470. 00	-	-
华泰证券	202109 240000 0298	中国通 号	2021年 9月24 日	398,112. 00	75,400	28	3.400	1,052. 80	-	-
华泰证券	202109 240000 0300	君实生 物	2021年 9月24 日	56,070.0 0	1,000	28	3.400	148.40	-	-
华泰证券	202110 080005 9915	传音控 股	2021年 10月8 日	2,794,87 2.00	20,200	14	3.400	3,695. 44	-	-
华泰证券	202110 080005 9925	昊海生 科	2021年 10月8 日	1,919,80 0.00	10,000	14	3.400	2,538. 34	-	-
华泰证券	202110 080005 9927	奇安信	2021年 10月8 日	850,000. 00	10,000	14	3.400	1,123. 92	-	-
华泰证券	202110 080007	道通科 技	2021年 10月8	2,028,99 0.00	28,200	14	3.400	2,682. 82	-	-

	1253		日							
华泰证券	202110 080007 4193	安恒信息	2021年 10月8 日	6,793,60 0.00	20,000	14	3.400	8,982. 68	-	-
华泰证券	202110 080007 5855	天合光能	2021年 10月8 日	4,966,00 0.00	100,000	14	3.400	6,566. 14	-	-
华泰证券	202110 080007 5857	奇安信	2021年 10月8 日	850,000. 00	10,000	14	3.400	1,123. 92	-	-
华泰证券	202110 080007 5859	芯原股份	2021年 10月8 日	1,353,20 0.00	20,000	14	3.400	1,789. 20	-	-
华泰证券	202110 080007 5861	中芯国际	2021年 10月8 日	1,115,40 0.00	20,000	14	1.800	780.78	-	-
华泰证券	202110 080007 5863	中芯国际	2021年 10月8 日	1,115,40 0.00	20,000	14	2.000	867.58	-	-
华泰证券	202110 080007 5865	天合光能	2021年 10月8 日	297,960. 00	6,000	14	3.400	393.96	-	-
华泰证券	202110 080007 5867	嘉元科技	2021年 10月8 日	4,404,30 0.00	30,000	14	3.400	5,823. 44	-	-
华泰证券	202110 080007 5869	海尔生物	2021年 10月8 日	3,243,00 0.00	30,000	14	3.400	4,287. 92	-	-
华泰证券	202110 080007 5875	圣湘生物	2021年 10月8 日	54,840.0 0	1,000	14	3.400	72.52	-	-
华泰证券	202109 280000 0395	芯原股份	2021年 9月28 日	138,120. 00	2,000	28	3.400	365.12	-	-
华泰证券	202109 280000 0397	华兴源创	2021年 9月28 日	253,820. 00	7,000	28	3.400	671.16	-	-
华泰证券	202109 290001 6293	圣湘生物	2021年 9月29 日	768,320. 00	14,000	28	3.400	2,031. 68	-	-
华泰证券	202110 130001 7701	传音控股	2021年 10月13 日	435,600. 00	3,000	14	3.400	575.96	-	-
华泰证券	202110	澜起科	2021年	4,157,53	69,200	14	3.400	5,497.	-	-

	130001 7705	技	10月13 日	6.00				24		
华泰证券	202110 130002 1577	杭可科 技	2021年 10月13 日	3,016,44 0.00	36,000	14	3.400	3,988. 46	-	-
华泰证券	202110 140001 0774	杭可科 技	2021年 10月14 日	299,030. 00	3,400	14	3.400	395.36	-	-
华泰证券	202110 140001 2998	康希诺	2021年 10月14 日	2,979,80 0.00	10,000	14	3.400	3,940. 02	-	-
华泰证券	202110 140001 4588	乐鑫科 技	2021年 10月14 日	3,792,60 0.00	20,000	14	3.400	5,014. 66	-	-
华泰证券	202110 140001 4590	微芯生 物	2021年 10月14 日	1,159,81 6.00	29,800	14	3.400	1,533. 56	-	-
华泰证券	202110 140001 4592	容百科 技	2021年 10月14 日	122,320. 00	1,100	14	3.400	161.70	-	-
华泰证券	202110 140001 4594	澜起科 技	2021年 10月14 日	243,171. 00	4,100	14	3.400	321.58	-	-
华泰证券	202110 080007 5871	西部超 导	2021年 10月8 日	99,092.0 0	1,400	28	3.400	262.08	-	-
华泰证券	202110 080007 5873	西部超 导	2021年 10月8 日	99,092.0 0	1,400	28	3.400	262.08	-	-
华泰证券	202110 220004 5224	奇安信	2021年 10月22 日	886,100. 00	10,000	14	3.400	1,171. 66	-	-
华泰证券	202110 220004 5226	奇安信	2021年 10月22 日	886,100. 00	10,000	14	3.400	1,171. 66	-	-
华泰证券	202110 220004 5228	天合光 能	2021年 10月22 日	6,266,00 0.00	100,000	14	3.400	8,285. 06	-	-
华泰证券	202110 220004 5230	中芯国 际	2021年 10月22 日	1,115,80 0.00	20,000	14	2.000	867.86	-	-
华泰证券	202110 220004 5232	中芯国 际	2021年 10月22 日	1,115,80 0.00	20,000	14	1.800	781.06	-	-

华泰证券	202110 220004 5234	道通科技	2021年 10月22 日	1,915,34 4.00	28,200	14	3.400	2,532. 46	-	-
华泰证券	202110 220004 5236	海尔生物	2021年 10月22 日	3,105,30 0.00	30,000	14	3.400	4,105. 92	-	-
华泰证券	202110 220004 5238	昊海生科	2021年 10月22 日	1,592,10 0.00	10,000	14	3.400	2,105. 18	-	-
华泰证券	202110 220004 5240	芯原股份	2021年 10月22 日	1,328,00 0.00	20,000	14	3.400	1,755. 88	-	-
华泰证券	202110 220004 5242	嘉元科技	2021年 10月22 日	4,720,80 0.00	30,000	14	3.400	6,241. 90	-	-
华泰证券	202110 220004 9266	圣湘生物	2021年 10月22 日	56,190.0 0	1,000	14	3.400	74.34	-	-
华泰证券	202110 220005 4096	天合光能	2021年 10月22 日	375,960. 00	6,000	14	3.400	497.14	-	-
华泰证券	202110 220005 4098	传音控股	2021年 10月22 日	2,899,10 4.00	20,200	14	3.400	3,833. 20	-	-
华泰证券	202110 220005 4102	安恒信息	2021年 10月22 日	6,300,40 0.00	20,000	14	3.400	8,330. 56	-	-
华泰证券	202110 120001 6999	西部超导	2021年 10月12 日	76,670.0 0	1,100	28	3.400	202.72	-	-
华泰证券	202110 130002 1751	君实生物	2021年 10月13 日	136,475. 00	2,500	28	3.400	360.92	-	-
华泰证券	202110 130002 1753	优刻得	2021年 10月13 日	60,930.0 0	1,800	28	3.400	161.00	-	-
华泰证券	202110 130002 1755	威胜信息	2021年 10月13 日	70,742.0 0	3,100	28	3.400	187.04	-	-
华泰证券	202110 130002 1757	西部超导	2021年 10月13 日	2,247,90 8.00	31,100	28	3.400	5,944. 40	-	-
华泰证券	202110 130002	晶晨股份	2021年 10月13	1,921,95 8.00	19,400	28	3.400	5,082. 56	-	-

	1759		日							
华泰证券	202110 130002 1761	奇安信	2021年 10月13 日	836,000. 00	10,000	28	3.400	2,210. 88	-	-
华泰证券	202110 130002 1763	天合光 能	2021年 10月13 日	1,396,50 0.00	24,500	28	3.400	3,692. 92	-	-
华泰证券	202110 130002 1765	九号公 司	2021年 10月13 日	2,051,23 5.00	23,700	28	3.400	5,424. 44	-	-
华泰证券	202110 130002 1767	柏楚电 子	2021年 10月13 日	1,946,72 0.00	4,600	28	3.400	5,148. 08	-	-
华泰证券	202110 130002 1769	道通科 技	2021年 10月13 日	1,573,54 2.00	21,400	28	3.400	4,161. 08	-	-
华泰证券	202110 130002 1771	晶丰明 源	2021年 10月13 日	384,010. 00	1,000	28	3.400	1,015. 56	-	-
华泰证券	202110 130002 1773	澜起科 技	2021年 10月13 日	2,102,80 0.00	35,000	28	3.400	5,560. 80	-	-
华泰证券	202110 130002 1775	中国通 号	2021年 10月13 日	3,668,76 0.00	711,000	28	2.000	5,706. 96	-	-
华泰证券	202110 130002 1777	容百科 技	2021年 10月13 日	1,800,26 0.00	16,700	28	3.400	4,760. 56	-	-
华泰证券	202110 130002 1779	乐鑫科 技	2021年 10月13 日	1,903,80 0.00	10,000	28	3.400	5,034. 40	-	-
华泰证券	202110 130002 1781	凯赛生 物	2021年 10月13 日	1,011,47 1.00	6,900	28	3.400	2,674. 84	-	-
华泰证券	202110 130002 1783	杭可科 技	2021年 10月13 日	301,644. 00	3,600	28	3.400	797.72	-	-
华泰证券	202110 130002 1785	杭可科 技	2021年 10月13 日	511,119. 00	6,100	28	3.400	1,351. 56	-	-
华泰证券	202110 130002 1787	虹软科 技	2021年 10月13 日	689,578. 00	17,300	28	3.400	1,823. 64	-	-
华泰证券	202110	安集科	2021年	1,579,41	6,900	28	3.400	4,176.	-	-



	130002 1789	技	10月13 日	0.00				76		
华泰证券	202110 130002 1791	虹软科 技	2021年 10月13 日	817,130. 00	20,500	28	3.400	2,160. 76	-	-
华泰证券	202110 130002 1793	南微医 学	2021年 10月13 日	2,034,26 3.00	7,700	28	3.400	5,379. 36	-	-
华泰证券	202110 130002 1795	南微医 学	2021年 10月13 日	554,799. 00	2,100	28	3.400	1,467. 20	-	-
华泰证券	202110 270001 8557	传音控 股	2021年 10月27 日	477,810. 00	3,000	14	3.400	631.82	-	-
华泰证券	202110 270001 8561	澜起科 技	2021年 10月27 日	3,916,72 0.00	69,200	14	3.400	5,178. 74	-	-
华泰证券	202110 270001 8563	杭可科 技	2021年 10月27 日	3,348,00 0.00	36,000	14	3.400	4,426. 80	-	-
华泰证券	202110 140001 0776	中国通 号	2021年 10月14 日	159,650. 00	31,000	28	1.800	223.44	-	-
华泰证券	202110 280000 0671	君实生 物	2021年 10月28 日	402,360. 00	8,400	14	3.400	532.00	-	-
华泰证券	202110 280000 0673	石头科 技	2021年 10月28 日	3,168,07 2.00	3,600	14	3.400	4,188. 94	-	-
华泰证券	202110 280001 1229	乐鑫科 技	2021年 10月28 日	3,345,00 0.00	20,000	14	3.400	4,422. 88	-	-
华泰证券	202110 280001 2549	康希诺	2021年 10月28 日	3,162,60 0.00	10,000	14	3.400	4,181. 66	-	-
华泰证券	202110 280001 2551	微芯生 物	2021年 10月28 日	1,099,62 0.00	29,800	14	3.400	1,453. 90	-	-
华泰证券	202110 280001 2553	杭可科 技	2021年 10月28 日	332,078. 00	3,400	14	3.400	439.04	-	-
华泰证券	202110 280001 2555	容百科 技	2021年 10月28 日	122,980. 00	1,100	14	3.400	162.54	-	-

华泰证券	202110 280001 2557	澜起科 技	2021年 10月28 日	239,030. 00	4,100	14	3.400	316.12	-	-
华泰证券	202110 290000 0502	博瑞医 药	2021年 10月29 日	402,610. 00	13,000	14	3.400	532.28	-	-
华泰证券	202110 180000 0706	中芯国 际	2021年 10月18 日	21,660,0 00.00	400,000	28	2.000	33,693 .24	-	-
华泰证券	202111 010000 0613	天合光 能	2021年 11月1 日	1,864,80 0.00	25,200	14	3.400	2,465. 68	-	-
华泰证券	202111 020000 0264	柏楚电 子	2021年 11月2 日	479,297. 00	1,300	14	3.400	633.78	-	-
华泰证券	202110 200000 4799	金山办 公	2021年 10月20 日	1,342,84 5.00	4,900	28	3.400	3,550. 96	-	-
华泰证券	202110 200000 4801	中国通 号	2021年 10月20 日	1,505,79 2.00	294,100	28	2.000	2,342. 48	-	-
华泰证券	202110 200000 4803	中国通 号	2021年 10月20 日	128,000. 00	25,000	28	2.000	199.08	-	-
华泰证券	202110 210000 4430	澜起科 技	2021年 10月21 日	1,434,86 0.00	25,900	28	3.400	3,794. 28	-	-
华泰证券	202110 210000 4432	西部超 导	2021年 10月21 日	530,712. 00	7,200	28	3.400	1,403. 36	-	-
华泰证券	202111 040000 0478	凯赛生 物	2021年 11月4 日	423,780. 00	2,800	14	3.400	560.28	-	-
华泰证券	202110 220004 9268	中国通 号	2021年 10月22 日	383,032. 00	75,400	28	3.400	1,013. 04	-	-
华泰证券	202111 050005 5571	芯原股 份	2021年 11月5 日	1,430,00 0.00	20,000	14	3.400	1,890. 84	-	-
华泰证券	202111 050005 5573	嘉元科 技	2021年 11月5 日	4,200,00 0.00	30,000	14	3.400	5,553. 38	-	-
华泰证券	202111 050005	天合光 能	2021年 11月5	417,600. 00	6,000	14	3.400	552.16	-	-

	5577		日							
华泰证券	202111 050005 5579	奇安信	2021年 11月5 日	900,000. 00	10,000	14	3.400	1,190. 00	-	-
华泰证券	202111 050005 5581	天合光 能	2021年 11月5 日	6,960,00 0.00	100,000	14	3.400	9,202. 62	-	-
华泰证券	202111 050005 5583	奇安信	2021年 11月5 日	900,000. 00	10,000	14	3.400	1,190. 00	-	-
华泰证券	202111 050005 5585	传音控 股	2021年 11月5 日	3,003,13 4.00	20,200	14	3.400	3,970. 82	-	-
华泰证券	202111 050005 5589	安恒信 息	2021年 11月5 日	6,044,20 0.00	20,000	14	3.400	7,991. 76	-	-
华泰证券	202111 050005 5591	昊海生 科	2021年 11月5 日	1,410,40 0.00	10,000	14	3.400	1,864. 80	-	-
华泰证券	202111 050005 5593	道通科 技	2021年 11月5 日	1,854,43 2.00	28,200	14	3.400	2,451. 96	-	-
华泰证券	202111 050005 5595	海尔生 物	2021年 11月5 日	2,613,60 0.00	30,000	14	3.400	3,455. 76	-	-
华泰证券	202111 080000 0754	金山办 公	2021年 11月8 日	14,006,9 18.00	47,900	14	3.400	18,520 .32	-	-
华泰证券	202110 260001 4122	芯原股 份	2021年 10月26 日	130,220. 00	2,000	28	3.400	344.40	-	-
华泰证券	202110 260001 4124	华兴源 创	2021年 10月26 日	250,040. 00	7,000	28	3.400	661.08	-	-
华泰证券	202111 090000 0591	华润微	2021年 11月9 日	1,151,24 0.00	17,000	14	3.400	1,522. 22	-	-
华泰证券	202111 090000 0593	金山办 公	2021年 11月9 日	6,484,57 6.00	22,400	14	3.400	8,574. 02	-	-
华泰证券	202110 270000 0510	中芯国 际	2021年 10月27 日	3,842,52 0.00	71,000	28	2.000	5,977. 16	-	-
华泰证券	202110	圣湘生	2021年	761,880.	14,000	28	3.400	2,014.	-	-

	270001 8559	物	10月27 日	00				88		
华泰证券	202111 100000 0865	优刻得	2021年 11月10 日	106,400. 00	3,800	14	3.400	140.70	-	-
华泰证券	202111 100000 0867	威胜信 息	2021年 11月10 日	179,949. 00	7,700	14	3.400	238.00	-	-
华泰证券	202111 100000 0869	海尔生 物	2021年 11月10 日	1,034,56 0.00	12,200	14	3.400	1,367. 94	-	-
华泰证券	202111 100000 0871	昊海生 科	2021年 11月10 日	281,883. 00	2,100	14	3.400	372.68	-	-
华泰证券	202111 100000 0873	道通科 技	2021年 11月10 日	192,270. 00	2,900	14	3.400	254.24	-	-
华泰证券	202111 100000 0875	虹软科 技	2021年 11月10 日	107,822. 00	2,600	14	3.400	142.52	-	-
华泰证券	202111 100000 0877	君实生 物	2021年 11月10 日	300,487. 00	5,900	14	3.400	397.32	-	-
华泰证券	202111 100000 0879	容百科 技	2021年 11月10 日	1,667,25 0.00	13,500	14	3.400	2,204. 44	-	-
华泰证券	202111 100000 0881	华兴源 创	2021年 11月10 日	371,800. 00	10,000	14	3.400	491.54	-	-
华泰证券	202111 100000 0883	光峰科 技	2021年 11月10 日	1,537,32 0.00	46,000	14	3.400	2,032. 66	-	-
华泰证券	202111 100000 0885	传音控 股	2021年 11月10 日	1,987,22 0.00	13,400	14	3.400	2,627. 52	-	-
华泰证券	202111 100000 0887	凯赛生 物	2021年 11月10 日	982,689. 00	6,700	14	3.400	1,299. 34	-	-
华泰证券	202111 100000 0889	安集科 技	2021年 11月10 日	910,800. 00	3,300	14	3.400	1,204. 28	-	-
华泰证券	202111 100001 6971	澜起科 技	2021年 11月10 日	5,300,72 0.00	69,200	14	3.400	7,008. 68	-	-

华泰证券	202111 100001 6975	杭可科技	2021年 11月10 日	3,898,08 0.00	36,000	14	3.400	5,154. 10	-	-
华泰证券	202111 100001 6981	传音控股	2021年 11月10 日	444,900. 00	3,000	14	3.400	588.28	-	-
华泰证券	202110 280000 0667	晶丰明源	2021年 10月28 日	2,239,44 0.00	7,000	28	3.400	5,922. 00	-	-
华泰证券	202111 110000 0453	九号公司	2021年 11月11 日	140,932. 00	2,200	14	3.400	186.34	-	-
华泰证券	202111 110001 4628	石头科技	2021年 11月11 日	3,340,80 0.00	3,600	14	3.400	4,417. 28	-	-
华泰证券	202111 110001 4630	君实生物	2021年 11月11 日	421,680. 00	8,400	14	3.400	557.62	-	-
华泰证券	202111 110001 4632	微芯生物	2021年 11月11 日	1,102,00 4.00	29,800	14	3.400	1,457. 12	-	-
华泰证券	202111 110001 4634	康希诺	2021年 11月11 日	2,499,00 0.00	10,000	14	3.400	3,304. 28	-	-
华泰证券	202111 110001 4636	杭可科技	2021年 11月11 日	375,122. 00	3,400	14	3.400	496.02	-	-
华泰证券	202111 110001 4638	澜起科技	2021年 11月11 日	322,670. 00	4,100	14	3.400	426.58	-	-
华泰证券	202111 110001 4640	容百科技	2021年 11月11 日	134,706. 00	1,100	14	3.400	178.08	-	-
华泰证券	202111 110001 4642	乐鑫科技	2021年 11月11 日	3,499,00 0.00	20,000	14	3.400	4,626. 44	-	-
华泰证券	202111 120000 3945	博瑞医药	2021年 11月12 日	464,620. 00	13,000	14	3.400	614.32	-	-
华泰证券	202111 150000 1253	君实生物	2021年 11月15 日	532,620. 00	9,900	14	3.400	704.20	-	-
华泰证券	202111 150000	天合光能	2021年 11月15	1,784,16 0.00	25,200	14	3.400	2,359. 00	-	-

	6853		日								
华泰证券	202111 160000 4826	柏楚电 子	2021年 11月16 日	506,948. 00	1,300	14	3.400	670.32	-	-	
华泰证券	202111 180000 6321	凯赛生 物	2021年 11月18 日	376,740. 00	2,800	14	3.400	498.12	-	-	
华泰证券	202111 050005 5587	西部超 导	2021年 11月5 日	109,186. 00	1,400	28	3.400	288.68	-	-	
华泰证券	202111 050006 5573	西部超 导	2021年 11月5 日	109,186. 00	1,400	28	3.400	288.68	-	-	
华泰证券	202111 190003 8649	天合光 能	2021年 11月19 日	490,800. 00	6,000	14	3.400	648.90	-	-	
华泰证券	202111 190004 2299	芯原股 份	2021年 11月19 日	1,497,60 0.00	20,000	14	3.400	1,980. 16	-	-	
华泰证券	202111 190004 2301	天合光 能	2021年 11月19 日	8,180,00 0.00	100,000	14	3.400	10,815 .84	-	-	
华泰证券	202111 190004 2303	奇安信	2021年 11月19 日	943,100. 00	10,000	14	3.400	1,246. 98	-	-	
华泰证券	202111 190004 2305	嘉元科 技	2021年 11月19 日	4,386,30 0.00	30,000	14	3.400	5,799. 64	-	-	
华泰证券	202111 190004 2307	奇安信	2021年 11月19 日	943,100. 00	10,000	14	3.400	1,246. 98	-	-	
华泰证券	202111 190004 2309	昊海生 科	2021年 11月19 日	1,258,40 0.00	10,000	14	3.400	1,663. 90	-	-	
华泰证券	202111 190004 2311	安恒信 息	2021年 11月19 日	5,903,80 0.00	20,000	14	3.400	7,806. 12	-	-	
华泰证券	202111 190004 2313	道通科 技	2021年 11月19 日	1,998,53 4.00	28,200	14	3.400	2,642. 50	-	-	
华泰证券	202111 190004 2315	海尔生 物	2021年 11月19 日	2,642,70 0.00	30,000	14	3.400	3,494. 26	-	-	
华泰证券	202111	金山办	2021年	12,874,5	47,900	14	3.400	17,023	-	-	

	220001 4976	公	11月22 日	62.00				.02		
华泰证券	202111 090001 7428	西部超 导	2021年 11月9 日	93,995.0 0	1,100	28	3.400	248.64	-	-
华泰证券	202111 230001 2738	华润微	2021年 11月23 日	1,236,58 0.00	17,000	14	3.400	1,635. 06	-	-
华泰证券	202111 230001 4398	金山办 公	2021年 11月23 日	6,071,07 2.00	22,400	14	3.400	8,027. 32	-	-
华泰证券	202111 100001 6947	君实生 物	2021年 11月10 日	127,325. 00	2,500	28	3.400	336.84	-	-
华泰证券	202111 100001 6949	优刻得	2021年 11月10 日	50,400.0 0	1,800	28	3.400	133.28	-	-
华泰证券	202111 100001 6951	威胜信 息	2021年 11月10 日	72,447.0 0	3,100	28	3.400	191.52	-	-
华泰证券	202111 100001 6953	西部超 导	2021年 11月10 日	2,655,94 0.00	31,100	28	3.400	7,023. 52	-	-
华泰证券	202111 100001 6955	奇安信	2021年 11月10 日	900,000. 00	10,000	28	3.400	2,380. 00	-	-
华泰证券	202111 100001 6957	晶丰明 源	2021年 11月10 日	327,580. 00	1,000	28	3.400	866.32	-	-
华泰证券	202111 100001 6959	九号公 司	2021年 11月10 日	1,504,71 3.00	23,700	28	3.400	3,979. 08	-	-
华泰证券	202111 100001 6961	天合光 能	2021年 11月10 日	1,662,57 0.00	24,500	28	3.400	4,396. 56	-	-
华泰证券	202111 100001 6963	柏楚电 子	2021年 11月10 日	1,702,69 0.00	4,600	28	3.400	4,502. 68	-	-
华泰证券	202111 100001 6965	道通科 技	2021年 11月10 日	1,418,82 0.00	21,400	28	3.400	3,752. 00	-	-
华泰证券	202111 100001 6967	晶晨股 份	2021年 11月10 日	2,171,05 4.00	19,400	28	3.400	5,741. 12	-	-

华泰证券	202111 100001 6969	澜起科 技	2021年 11月10 日	2,681,00 0.00	35,000	28	3.400	7,089. 88	-	-
华泰证券	202111 100001 6973	容百科 技	2021年 11月10 日	2,062,45 0.00	16,700	28	3.400	5,454. 12	-	-
华泰证券	202111 100001 6977	杭可科 技	2021年 11月10 日	389,808. 00	3,600	28	3.400	1,030. 96	-	-
华泰证券	202111 100001 6979	凯赛生 物	2021年 11月10 日	1,012,02 3.00	6,900	28	3.400	2,676. 24	-	-
华泰证券	202111 100001 6983	虹软科 技	2021年 11月10 日	717,431. 00	17,300	28	3.400	1,897. 28	-	-
华泰证券	202111 100001 6985	虹软科 技	2021年 11月10 日	850,135. 00	20,500	28	3.400	2,248. 12	-	-
华泰证券	202111 100001 6987	乐鑫科 技	2021年 11月10 日	1,730,00 0.00	10,000	28	3.400	4,574. 92	-	-
华泰证券	202111 100001 6989	南微医 学	2021年 11月10 日	2,053,35 9.00	7,700	28	3.400	5,430. 04	-	-
华泰证券	202111 100001 6991	安集科 技	2021年 11月10 日	1,904,40 0.00	6,900	28	3.400	5,036. 08	-	-
华泰证券	202111 100001 8735	南微医 学	2021年 11月10 日	560,007. 00	2,100	28	3.400	1,480. 92	-	-
华泰证券	202111 100001 8737	杭可科 技	2021年 11月10 日	660,508. 00	6,100	28	3.400	1,746. 64	-	-
华泰证券	202111 240000 0439	中微公 司	2021年 11月24 日	3,248,40 0.00	20,000	14	3.400	4,295. 06	-	-
华泰证券	202111 240001 5761	传音控 股	2021年 11月24 日	522,000. 00	3,000	14	3.400	690.20	-	-
华泰证券	202111 240001 5763	传音控 股	2021年 11月24 日	2,331,60 0.00	13,400	14	3.400	3,082. 94	-	-
华泰证券	202111 240001	海尔生 物	2021年 11月24	1,124,35 2.00	12,200	14	3.400	1,486. 66	-	-



	7071		日								
华泰证券	202111 240001 7073	威胜信 息	2021年 11月24 日	240,086. 00	7,700	14	3.400	317.38	-	-	
华泰证券	202111 240001 7075	昊海生 科	2021年 11月24 日	285,369. 00	2,100	14	3.400	377.30	-	-	
华泰证券	202111 240001 7077	君实生 物	2021年 11月24 日	346,802. 00	5,900	14	3.400	458.50	-	-	
华泰证券	202111 240001 7079	容百科 技	2021年 11月24 日	1,761,75 0.00	13,500	14	3.400	2,329. 46	-	-	
华泰证券	202111 240001 7081	华兴源 创	2021年 11月24 日	392,500. 00	10,000	14	3.400	518.98	-	-	
华泰证券	202111 240001 7083	杭可科 技	2021年 11月24 日	4,408,56 0.00	36,000	14	3.400	5,829. 04	-	-	
华泰证券	202111 240001 7085	道通科 技	2021年 11月24 日	225,301. 00	2,900	14	3.400	297.92	-	-	
华泰证券	202111 240001 7087	虹软科 技	2021年 11月24 日	133,692. 00	2,600	14	3.400	176.82	-	-	
华泰证券	202111 240001 7089	安集科 技	2021年 11月24 日	1,005,77 4.00	3,300	14	3.400	1,329. 86	-	-	
华泰证券	202111 250000 0636	道通科 技	2021年 11月25 日	321,006. 00	4,200	14	3.400	424.48	-	-	
华泰证券	202111 250000 0638	圣湘生 物	2021年 11月25 日	574,500. 00	10,000	14	3.400	759.64	-	-	
华泰证券	202111 250000 0640	威胜信 息	2021年 11月25 日	712,931. 00	22,300	14	3.400	942.62	-	-	
华泰证券	202111 250000 0642	西部超 导	2021年 11月25 日	444,400. 00	5,000	14	3.400	587.58	-	-	
华泰证券	202111 250000 7144	康希诺	2021年 11月25 日	2,690,00 0.00	10,000	14	3.400	3,556. 84	-	-	
华泰证券	202111	微芯生	2021年	1,107,96	29,800	14	3.400	1,464.	-	-	

	250000 7146	物	11月25 日	4.00				96		
华泰证券	202111 250000 7150	九号公 司	2021年 11月25 日	136,686. 00	2,200	14	3.400	180.74	-	-
华泰证券	202111 250000 7152	君实生 物	2021年 11月25 日	502,488. 00	8,400	14	3.400	664.44	-	-
华泰证券	202111 250000 9500	乐鑫科 技	2021年 11月25 日	4,045,60 0.00	20,000	14	3.400	5,349. 12	-	-
华泰证券	202111 250000 9502	杭可科 技	2021年 11月25 日	417,860. 00	3,400	14	3.400	552.44	-	-
华泰证券	202111 250000 9504	容百科 技	2021年 11月25 日	139,150. 00	1,100	14	3.400	183.96	-	-
华泰证券	202111 260000 0683	晶丰明 源	2021年 11月26 日	1,672,50 0.00	5,000	14	3.400	2,211. 44	-	-
华泰证券	202111 260000 0687	圣湘生 物	2021年 11月26 日	224,760. 00	4,000	14	3.400	297.22	-	-
华泰证券	202111 260000 3648	博瑞医 药	2021年 11月26 日	481,130. 00	13,000	14	3.400	636.16	-	-
华泰证券	202111 290000 0540	晶丰明 源	2021年 11月29 日	655,200. 00	2,000	14	3.400	866.32	-	-
华泰证券	202111 290000 5025	天合光 能	2021年 11月29 日	1,833,80 4.00	25,200	14	3.400	2,424. 66	-	-
华泰证券	202111 290000 5027	君实生 物	2021年 11月29 日	605,880. 00	9,900	14	3.400	801.08	-	-
华泰证券	202111 300000 0797	传音控 股	2021年 11月30 日	3,345,60 0.00	20,000	14	3.400	4,423. 58	-	-
华泰证券	202111 300000 0799	博瑞医 药	2021年 11月30 日	2,898,00 0.00	72,000	14	3.400	3,831. 80	-	-
华泰证券	202111 300000 0801	容百科 技	2021年 11月30 日	2,756,00 0.00	20,000	14	3.400	3,644. 06	-	-

华泰证券	202112 010000 0756	中芯国际	2021年 12月1 日	5,450,00 0.00	100,000	14	2.000	4,238. 92	-	-
华泰证券	202112 010000 0758	传音控股	2021年 12月1 日	3,888,14 0.00	24,400	14	3.400	5,140. 94	-	-
华泰证券	202112 010000 0760	容百科技	2021年 12月1 日	7,618,80 0.00	56,000	14	3.400	10,073 .70	-	-
华泰证券	202112 020000 0594	中芯国际	2021年 12月2 日	2,740,00 0.00	50,000	14	2.000	2,131. 08	-	-
华泰证券	202112 020000 0596	西部超导	2021年 12月2 日	1,643,04 1.00	17,900	14	3.400	2,172. 52	-	-
华泰证券	202112 020000 4999	凯赛生物	2021年 12月2 日	453,600. 00	2,800	14	3.400	599.76	-	-
华泰证券	202112 030001 6167	芯原股份	2021年 12月3 日	1,543,00 0.00	20,000	14	3.400	2,040. 22	-	-
华泰证券	202112 030001 6173	海尔生物	2021年 12月3 日	2,545,80 0.00	30,000	14	3.400	3,366. 16	-	-
华泰证券	202112 030001 6179	天合光能	2021年 12月3 日	7,155,00 0.00	100,000	14	3.400	9,460. 50	-	-
华泰证券	202112 030001 6185	昊海生科	2021年 12月3 日	1,428,10 0.00	10,000	14	3.400	1,888. 32	-	-
华泰证券	202112 030002 3733	天合光能	2021年 12月3 日	429,300. 00	6,000	14	3.400	567.70	-	-
华泰证券	202112 030002 3747	嘉元科技	2021年 12月3 日	4,746,60 0.00	30,000	14	3.400	6,276. 06	-	-
华泰证券	202112 030002 3765	奇安信	2021年 12月3 日	930,000. 00	10,000	14	3.400	1,229. 62	-	-
华泰证券	202112 030002 3769	安恒信息	2021年 12月3 日	5,500,00 0.00	20,000	14	3.400	7,272. 16	-	-
华泰证券	202112 060000	中微公司	2021年 12月6	3,060,60 0.00	20,000	14	3.400	4,046. 84	-	-

	0735		日							
华泰证券	202112 060000 0737	康希诺	2021年 12月6 日	1,003,20 0.00	4,000	14	3.400	1,326. 50	-	-
华泰证券	202112 060000 0739	道通科 技	2021年 12月6 日	1,989,51 0.00	28,200	14	3.400	2,630. 60	-	-
华泰证券	202112 060000 8766	金山办 公	2021年 12月6 日	11,974,0 42.00	47,900	14	3.400	15,832 .32	-	-
华泰证券	202111 230001 2736	芯原股 份	2021年 11月23 日	155,220. 00	2,000	28	3.400	410.48	-	-
华泰证券	202111 230001 2740	华兴源 创	2021年 11月23 日	274,190. 00	7,000	28	3.400	725.20	-	-
华泰证券	202112 070000 0903	容百科 技	2021年 12月7 日	334,773. 00	2,700	14	3.400	442.68	-	-
华泰证券	202112 070000 0905	传音控 股	2021年 12月7 日	422,820. 00	2,700	14	3.400	559.02	-	-
华泰证券	202112 070000 8247	金山办 公	2021年 12月7 日	5,600,00 0.00	22,400	14	3.400	7,404. 46	-	-
华泰证券	202112 080000 0901	道通科 技	2021年 12月8 日	442,250. 00	6,100	14	3.400	584.78	-	-
华泰证券	202112 080000 0903	昊海生 科	2021年 12月8 日	241,038. 00	1,800	14	3.400	318.64	-	-
华泰证券	202112 080000 0905	南微医 学	2021年 12月8 日	238,200. 00	1,000	14	3.400	315.00	-	-
华泰证券	202112 080000 0907	优刻得	2021年 12月8 日	72,462.0 0	2,600	14	3.400	95.76	-	-
华泰证券	202112 080000 6960	中微公 司	2021年 12月8 日	3,010,80 0.00	20,000	14	3.400	3,980. 90	-	-
华泰证券	202112 080000 7250	道通科 技	2021年 12月8 日	210,250. 00	2,900	14	3.400	278.04	-	-
华泰证券	202112	君实生	2021年	340,253.	5,900	14	3.400	449.96	-	-

	080000 7354	物	12月8日	00						
华泰证券	202112 080000 7434	传音控 股	2021年 12月8日	480,810. 00	3,000	14	3.400	635.74	-	-
华泰证券	202112 080000 7442	昊海生 科	2021年 12月8日	281,211. 00	2,100	14	3.400	371.84	-	-
华泰证券	202112 080000 7444	华兴源 创	2021年 12月8日	351,600. 00	10,000	14	3.400	464.94	-	-
华泰证券	202112 080000 7448	海尔生 物	2021年 12月8日	1,014,06 4.00	12,200	14	3.400	1,340. 78	-	-
华泰证券	202112 080000 7450	传音控 股	2021年 12月8日	2,147,61 8.00	13,400	14	3.400	2,839. 62	-	-
华泰证券	202112 090000 8149	圣湘生 物	2021年 12月9日	551,000. 00	10,000	14	3.400	728.56	-	-
华泰证券	202112 090000 8225	康希诺	2021年 12月9日	2,674,50 0.00	10,000	14	3.400	3,536. 26	-	-
华泰证券	202112 090000 8229	君实生 物	2021年 12月9日	503,076. 00	8,400	14	3.400	665.14	-	-
华泰证券	202112 090000 8787	容百科 技	2021年 12月9日	137,951. 00	1,100	14	3.400	182.42	-	-
华泰证券	202112 090000 8789	微芯生 物	2021年 12月9日	1,080,25 0.00	29,800	14	3.400	1,428. 28	-	-
华泰证券	202112 090000 8797	九号公 司	2021年 12月9日	127,160. 00	2,200	14	3.400	168.14	-	-
华泰证券	202112 100000 6115	晶丰明 源	2021年 12月10日	1,812,40 0.00	5,000	14	3.400	2,396. 38	-	-
华泰证券	202112 100000 6117	圣湘生 物	2021年 12月10日	225,600. 00	4,000	14	3.400	298.34	-	-
华泰证券	202112 130000 1016	嘉元科 技	2021年 12月13日	3,013,60 0.00	20,000	14	3.400	3,984. 68	-	-

华泰证券	202112 130000 1018	圣湘生物	2021年 12月13 日	1,027,44 0.00	18,000	14	3.400	1,358. 56	-	-
华泰证券	202112 130000 1020	传音控股	2021年 12月13 日	1,613,32 5.00	10,500	14	3.400	2,133. 18	-	-
华泰证券	202112 130000 1022	天奈科技	2021年 12月13 日	409,668. 00	2,800	14	3.400	541.66	-	-
华泰证券	202112 130000 1024	固德威	2021年 12月13 日	2,774,28 0.00	6,000	14	3.400	3,668. 28	-	-
华泰证券	202112 130000 1026	天合光能	2021年 12月13 日	851,400. 00	10,000	14	3.400	1,125. 74	-	-
华泰证券	202112 130000 9567	晶丰明源	2021年 12月13 日	730,280. 00	2,000	14	3.400	965.58	-	-
华泰证券	202112 140000 1087	圣湘生物	2021年 12月14 日	180,150. 00	3,000	14	3.400	238.14	-	-
华泰证券	202112 140000 1089	华润微	2021年 12月14 日	153,824. 00	2,200	14	3.400	203.42	-	-
华泰证券	202112 140001 1404	容百科技	2021年 12月14 日	2,485,80 0.00	20,000	14	3.400	3,286. 78	-	-
华泰证券	202112 140001 2762	传音控股	2021年 12月14 日	3,064,20 0.00	20,000	14	3.400	4,051. 60	-	-
华泰证券	202112 150000 1927	西部超导	2021年 12月15 日	2,926,40 0.00	32,000	14	3.400	3,869. 32	-	-
华泰证券	202112 150000 1929	优刻得	2021年 12月15 日	1,532,42 4.00	53,600	14	3.400	2,026. 22	-	-
华泰证券	202112 150000 1931	博瑞医药	2021年 12月15 日	2,580,48 0.00	72,000	14	3.400	3,411. 94	-	-
华泰证券	202112 150000 1933	海尔生物	2021年 12月15 日	2,785,80 0.00	30,000	14	3.400	3,683. 40	-	-
华泰证券	202112 150001	中芯国际	2021年 12月15	5,413,00 0.00	100,000	14	2.000	4,210. 08	-	-

	5547		日							
华泰证券	202112160000902	固德威	2021年12月16日	3,296,300.00	7,000	14	3.400	4,358.48	-	-
华泰证券	202112160000904	金山办公	2021年12月16日	7,634,400.00	30,000	14	3.400	10,094.42	-	-
华泰证券	202112160000906	康希诺	2021年12月16日	507,790.00	1,700	14	3.400	671.44	-	-
华泰证券	202112160000908	道通科技	2021年12月16日	346,764.00	4,400	14	3.400	458.50	-	-
华泰证券	2021121600007389	凯赛生物	2021年12月16日	516,320.00	2,800	14	3.400	682.64	-	-
华泰证券	2021121600007391	中芯国际	2021年12月16日	2,672,000.00	50,000	14	2.000	2,078.16	-	-
华泰证券	2021121600008323	西部超导	2021年12月16日	1,654,855.00	17,900	14	3.400	2,188.06	-	-
华泰证券	2021121700001488	芯原股份	2021年12月17日	3,825,920.00	49,000	14	3.400	5,058.76	-	-
华泰证券	2021121700001490	虹软科技	2021年12月17日	258,180.00	6,000	14	3.400	341.32	-	-
华泰证券	2021121700004230	安恒信息	2021年12月17日	5,040,000.00	20,000	14	3.400	6,664.00	-	-
华泰证券	2021121700004232	嘉元科技	2021年12月17日	4,114,500.00	30,000	14	3.400	5,440.26	-	-
华泰证券	2021121700005636	天合光能	2021年12月17日	8,050,000.00	100,000	14	3.400	10,643.92	-	-
华泰证券	2021121700005640	奇安信	2021年12月17日	930,000.00	10,000	14	3.400	1,229.62	-	-
华泰证券	2021121700006104	天合光能	2021年12月17日	483,000.00	6,000	14	3.400	638.68	-	-
华泰证券	202112	芯原股	2021年	1,561,60	20,000	14	3.400	2,064.	-	-

	170002 7154	份	12月17 日	0.00				72		
华泰证券	202112 200000 9183	道通科 技	2021年 12月20 日	2,086,80 0.00	28,200	14	3.400	2,167. 99	2,239, 080.00	2,167.9 9
华泰证券	202112 200000 9189	康希诺	2021年 12月20 日	1,291,12 0.00	4,000	14	3.400	1,341. 34	1,198, 200.00	1,341.3 4
华泰证券	202112 200000 9325	中微公 司	2021年 12月20 日	2,661,00 0.00	20,000	14	3.400	2,764. 52	2,532, 000.00	2,764.5 2
华泰证券	202112 200000 9329	金山办 公	2021年 12月20 日	11,623,4 14.00	47,900	14	3.400	12,075 .47	12,693 ,500.0 0	12,075. 47
华泰证券	202112 210000 1099	恒玄科 技	2021年 12月21 日	689,568. 00	2,400	14	3.400	651.30	732,00 0.00	651.30
华泰证券	202112 210000 1101	康希诺	2021年 12月21 日	1,677,45 0.00	5,300	14	3.400	1,584. 30	1,587, 615.00	1,584.3 0
华泰证券	202112 210001 9439	传音控 股	2021年 12月21 日	419,310. 00	2,700	14	3.400	396.00	423,63 0.00	396.00
华泰证券	202112 080000 6962	君实生 物	2021年 12月8 日	144,175. 00	2,500	28	3.400	313.26	167,45 0.00	313.26
华泰证券	202112 080000 7240	九号公 司	2021年 12月8 日	1,352,32 2.00	23,700	28	3.400	2,937. 56	1,660, 659.00	2,937.5 6
华泰证券	202112 080000 7244	晶晨股 份	2021年 12月8 日	2,355,54 8.00	19,400	28	3.400	5,116. 81	2,525, 880.00	5,116.8 1
华泰证券	202112 080000 7254	凯赛生 物	2021年 12月8 日	1,121,04 3.00	6,900	28	3.400	2,435. 24	1,271, 532.00	2,435.2 4
华泰证券	202112 080000 7256	道通科 技	2021年 12月8 日	1,551,50 0.00	21,400	28	3.400	3,370. 19	1,699, 160.00	3,370.1 9
华泰证券	202112 080000 7260	西部超 导	2021年 12月8 日	2,787,80 4.00	31,100	28	3.400	6,055. 67	3,014, 834.00	6,055.6 7
华泰证券	202112 080000 7436	柏楚电 子	2021年 12月8 日	1,809,54 8.00	4,600	28	3.400	3,930. 70	1,773, 116.00	3,930.7 0



华泰证券	202112 080000 7446	优刻得	2021年 12月8 日	50,166.0 0	1,800	28	3.400	109.02	47,736 .00	109.02
华泰证券	202112 080000 7452	澜起科 技	2021年 12月8 日	2,633,75 0.00	35,000	28	3.400	5,721. 02	2,935, 450.00	5,721.0 2
华泰证券	202112 080000 7456	南微医 学	2021年 12月8 日	1,834,14 0.00	7,700	28	3.400	3,984. 06	1,637, 559.00	3,984.0 6
华泰证券	202112 080000 7458	南微医 学	2021年 12月8 日	500,220. 00	2,100	28	3.400	1,086. 52	446,60 7.00	1,086.5 2
华泰证券	202112 080000 7464	晶丰明 源	2021年 12月8 日	330,800. 00	1,000	28	3.400	718.52	320,10 0.00	718.52
华泰证券	202112 220000 1219	西部超 导	2021年 12月22 日	87,530.0 0	1,000	14	3.400	74.43	96,940 .00	74.43
华泰证券	202112 220000 1221	道通科 技	2021年 12月22 日	491,846. 00	6,200	14	3.400	418.05	492,28 0.00	418.05
华泰证券	202112 220001 1774	君实生 物	2021年 12月22 日	342,495. 00	5,900	14	3.400	291.15	395,18 2.00	291.15
华泰证券	202112 220001 1776	海尔生 物	2021年 12月22 日	1,139,11 4.00	12,200	14	3.400	968.22	1,108, 004.00	968.22
华泰证券	202112 220001 1778	昊海生 科	2021年 12月22 日	236,358. 00	1,800	14	3.400	200.88	226,60 2.00	200.88
华泰证券	202112 220001 1780	昊海生 科	2021年 12月22 日	275,751. 00	2,100	14	3.400	234.36	264,36 9.00	234.36
华泰证券	202112 220001 1782	中微公 司	2021年 12月22 日	2,606,00 0.00	20,000	14	3.400	2,215. 08	2,532, 000.00	2,215.0 8
华泰证券	202112 220001 1784	传音控 股	2021年 12月22 日	483,390. 00	3,000	14	3.400	410.85	470,70 0.00	410.85
华泰证券	202112 220001 1786	华兴源 创	2021年 12月22 日	360,000. 00	10,000	14	3.400	306.00	358,70 0.00	306.00
华泰证券	202112 220001	传音控 股	2021年 12月22	2,159,14 2.00	13,400	14	3.400	1,835. 28	2,102, 460.00	1,835.2 8

	1788		日							
华泰证券	202112 230001 1345	微芯生 物	2021年 12月23 日	1,023,03 4.00	29,800	14	3.400	772.96	1,043, 298.00	772.96
华泰证券	202112 230001 1347	九号公 司	2021年 12月23 日	145,222. 00	2,200	14	3.400	109.76	154,15 4.00	109.76
华泰证券	202112 230001 1349	康希诺	2021年 12月23 日	3,021,60 0.00	10,000	14	3.400	2,282. 96	2,995, 500.00	2,282.9 6
华泰证券	202112 230001 1351	圣湘生 物	2021年 12月23 日	568,800. 00	10,000	14	3.400	429.76	590,00 0.00	429.76
华泰证券	202112 230001 1353	君实生 物	2021年 12月23 日	491,484. 00	8,400	14	3.400	371.36	562,63 2.00	371.36
华泰证券	202112 240001 1140	晶丰明 源	2021年 12月24 日	1,573,00 0.00	5,000	14	3.400	1,039. 92	1,600, 500.00	1,039.9 2
华泰证券	202112 240001 1142	圣湘生 物	2021年 12月24 日	228,480. 00	4,000	14	3.400	151.06	236,00 0.00	151.06
华泰证券	202112 270000 8002	天合光 能	2021年 12月27 日	738,800. 00	10,000	14	3.400	279.12	789,00 0.00	279.12
华泰证券	202112 270000 8004	传音控 股	2021年 12月27 日	1,677,90 0.00	10,500	14	3.400	633.88	1,647, 450.00	633.88
华泰证券	202112 270000 8006	天奈科 技	2021年 12月27 日	388,080. 00	2,800	14	3.400	146.60	418,01 2.00	146.60
华泰证券	202112 270000 8164	晶丰明 源	2021年 12月27 日	636,340. 00	2,000	14	3.400	240.40	640,20 0.00	240.40
华泰证券	202112 270000 8166	固德威	2021年 12月27 日	2,304,12 0.00	6,000	14	3.400	870.44	2,757, 480.00	870.44
华泰证券	202112 270000 8168	嘉元科 技	2021年 12月27 日	2,440,60 0.00	20,000	14	3.400	922.00	2,511, 000.00	922.00
华泰证券	202112 280000 1193	恒玄科 技	2021年 12月28 日	293,490. 00	1,000	14	3.400	83.16	305,00 0.00	83.16
华泰证券	202112	寒武纪	2021年	1,749,90	19,000	14	3.400	495.81	1,806,	495.81

	280000 1195		12月28 日	0.00					900.00	
华泰证券	202112 280001 4020	圣湘生 物	2021年 12月28 日	174,690. 00	3,000	14	3.400	49.50	177,00 0.00	49.50
华泰证券	202112 280001 4216	传音控 股	2021年 12月28 日	3,178,00 0.00	20,000	14	3.400	900.42	3,138, 000.00	900.42
华泰证券	202112 290000 0844	极米科 技	2021年 12月29 日	1,300,80 0.00	2,400	14	3.400	245.70	1,324, 800.00	245.70
华泰证券	202112 290001 0914	中芯国 际	2021年 12月29 日	5,273,00 0.00	100,000	14	2.000	585.88	5,299, 000.00	585.88
华泰证券	202112 290001 0982	博瑞医 药	2021年 12月29 日	2,524,32 0.00	72,000	14	3.400	476.82	2,643, 120.00	476.82
华泰证券	202112 290001 0986	海尔生 物	2021年 12月29 日	2,649,00 0.00	30,000	14	3.400	500.36	2,724, 600.00	500.36
华泰证券	202112 290001 0990	西部超 导	2021年 12月29 日	2,912,32 0.00	32,000	14	3.400	550.10	3,102, 080.00	550.10
华泰证券	202112 200000 1211	中芯国 际	2021年 12月20 日	15,453,9 01.00	292,300	28	3.400	16,054 .94	15,488 ,977.0 0	16,054. 94
华泰证券	202112 210001 9441	华兴源 创	2021年 12月21 日	251,580. 00	7,000	28	3.400	237.60	251,09 0.00	237.60
华泰证券	202112 300000 0730	中控技 术	2021年 12月30 日	1,057,70 0.00	14,000	14	3.400	99.89	1,062, 320.00	99.89
华泰证券	202112 300000 9040	固德威	2021年 12月30 日	3,087,00 0.00	7,000	14	3.400	291.55	3,217, 060.00	291.55
华泰证券	202112 300000 9042	凯赛生 物	2021年 12月30 日	532,756. 00	2,800	14	3.400	50.32	515,98 4.00	50.32
华泰证券	202112 300000 9044	中芯国 际	2021年 12月30 日	2,644,50 0.00	50,000	14	2.000	146.92	2,649, 500.00	146.92
华泰证券	202112 300000 9046	金山办 公	2021年 12月30 日	7,890,00 0.00	30,000	14	3.400	745.17	7,950, 000.00	745.17

华泰证券	202112 300000 9110	道通科技	2021年 12月30 日	346,984. 00	4,400	14	3.400	32.77	349,36 0.00	32.77
华泰证券	202112 300000 9542	西部超导	2021年 12月30 日	1,718,40 0.00	17,900	14	3.400	162.29	1,735, 226.00	162.29
华泰证券	202112 310000 0913	康希诺	2021年 12月31 日	509,235. 00	1,700	14	3.400	-	509,23 5.00	-
华泰证券	202112 310000 0919	中望软件	2021年 12月31 日	349,830. 00	1,000	14	3.400	-	349,83 0.00	-
华泰证券	202112 310002 3492	虹软科技	2021年 12月31 日	264,360. 00	6,000	14	3.400	-	264,36 0.00	-
华泰证券	202112 310002 3494	天合光能	2021年 12月31 日	7,890,00 0.00	100,000	14	3.400	-	7,890, 000.00	-
华泰证券	202112 310002 7208	天合光能	2021年 12月31 日	473,400. 00	6,000	14	3.400	-	473,40 0.00	-

#### 7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用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(%)
华泰柏瑞上证科创板50成份交易型开放式指数证券投资基金	819,397,373.00	22.9416	489,398,739.00	24.0482
华泰证券股份有限公司	2,833,740.00	0.0793	4,047,499.00	0.1989

#### 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
中国建设银行	18,208,559.64	45,438.79	15,953,240.31	45,088.45

注：本基金的银行存款由基金托管人中国建设银行保管，按银行同业存款利率计息。

#### 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	688353	华盛锂电	网下申购	4,358	428,609.30
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	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
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	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	601728	中国电信	网上配售	30,000	135,900.00
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	32,000	84,800.00
华泰联合证券	600941	中国移动	网上配售	1,000	57,580.00
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	688613	奥精医疗	网下申购	2,617	42,997.31
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	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

#### 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
688247	宣泰医药	2022 年 8 月 18 日	6 个月	新股锁定期内	9.37	15.06	7,155	67,042.35	107,754.30	-
688252	天德钰	2022 年 9 月 20 日	6 个月	新股锁定期内	21.68	15.78	5,201	112,757.68	82,071.78	-
688351	微电生理	2022 年 8 月 23 日	6 个月	新股锁定期内	16.51	24.76	10,946	180,718.46	271,022.96	-
688381	帝奥微	2022 年 8 月 15 日	6 个月	新股锁定期内	41.68	37.98	7,362	306,848.16	279,608.76	-
688498	源杰科技	2022 年 12 月 14 日	6 个月	新股锁定期内	100.66	113.13	1,582	159,244.12	178,971.66	-

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

##### 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	688005	容百科技	2023年1月25日	68.75	180,000	12,375,000.00
2	688116	天奈科技	2023年1月9日	77.14	3,400	262,276.00
3	688139	海尔生物	2023年1月2日	63.30	18,000	1,139,400.00
4	688169	石头科技	2023年1月5日	247.75	10,000	2,477,500.00
5	688180	君实生物	2023年1月9日	62.60	178,600	11,180,360.00
6	688185	康希诺	2023年1月9日	146.02	65,000	9,491,300.00
7	688187	时代电气	2023年1月9日	54.57	1,700	92,769.00
8	688188	柏楚电子	2023年1月9日	217.08	2,000	434,160.00
9	688202	美迪西	2023年1月9日	213.89	8,200	1,753,898.00
10	688256	寒武纪	2023年1月9日	54.56	3,300	180,048.00
11	688276	百克生物	2023年1月9日	69.11	20,600	1,423,666.00
12	688008	澜起科技	2023年1月2日-2023年1月13日	62.60	340,000	21,284,000.00
13	688301	奕瑞科技	2023年1月9日	457.88	2,700	1,236,276.00
14	688303	大全能源	2023年1月3日-2023年1月13日	47.68	170,000	8,105,600.00
15	688363	华熙生物	2023年1月4日	135.28	100,000	13,528,000.00
16	688390	固德威	2023年1月2日-2023年1月9日	323.09	54,000	17,446,860.00
17	688396	华润微	2023年1月3日-2023年1月12日	52.65	10,400	547,560.00
18	688521	芯原股份	2023年1月9日-2023年1月12日	44.07	17,400	766,818.00
19	688536	思瑞浦	2023年1月9日	275.41	4,100	1,129,181.00
20	688599	天合光	2023年1月2日	63.76	100,000	6,376,000.00

		能				.00
21	688690	纳微科技	2023年1月9日-2023年1月13日	51.77	20,700	1,071,639.00
22	688728	格科微	2023年1月9日	17.54	2,300	40,342.00
23	688009	中国通号	2023年1月12日	4.79	38,500	184,415.00
24	688772	珠海冠宇	2023年1月9日	18.64	15,800	294,512.00
25	688777	中控技术	2023年1月2日	90.83	25,000	2,270,750.00
26	688779	长远锂科	2023年1月9日	14.59	5,900	86,081.00
27	688819	天能股份	2023年1月9日	36.74	7,500	275,550.00
28	689009	九号公司	2023年1月9日	30.49	9,400	286,606.00
29	688032	禾迈股份	2023年1月9日-2023年1月19日	937.15	11,300	10,589,795.00
30	688063	派能科技	2023年1月19日	315.65	10,000	3,156,500.00
31	688082	盛美上海	2023年1月9日	79.90	8,700	695,130.00
32	688099	晶晨股份	2023年1月9日	70.51	3,500	246,785.00
33	688105	诺唯赞	2023年1月3日-2023年1月9日	53.14	23,500	1,248,790.00
34	688111	金山办公	2023年1月2日	264.49	40,000	10,579,600.00
合计	-	-	-	-	1,511,500	142,257,167.00

#### 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建设银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近 1 年的分类结果为 A 类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

#### 7.4.13.3 流动性风险

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

于 2022 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不

计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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	18,208,559.64	-	-	-	-	-	18,208,559.64
结算备付金	1,134,273.81	-	-	-	-	-	1,134,273.81
存出保证金	13,974.20	-	-	-	-	-	13,974.20
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-3,529,224,926.48	-3,529,224,926.48
应收清算款	-	-	-	-	-	987,908.31	987,908.31
其他资产	-	-	-	-	-	99,539.25	99,539.25
资产总计	19,356,807.65	-	-	-	-	-3,530,312,374.04	3,549,669,181.69
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,511,384.54	1,511,384.54
应付托管费	-	-	-	-	-	302,276.91	302,276.91
应交税费	-	-	-	-	-	0.21	0.21
其他负债	-	-	-	-	-	1,256,849.96	1,256,849.96
负债总计	-	-	-	-	-	3,070,511.62	3,070,511.62
利率敏感度缺口	19,356,807.65	-	-	-	-	-3,527,241,862.42	3,546,598,670.07
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	15,953,240.31	-	-	-	-	-	15,953,240.31
结算备付金	1,202,947.99	-	-	-	-	-	1,202,947.99
存出保证金	31,061.12	-	-	-	-	-	31,061.12
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-2,937,813,770.32	-2,937,813,770.32
应收清算款	-	-	-	-	-	370,675.50	370,675.50
其他资产	-	-	-	-	-	177,151.97	177,151.97
资产总计	17,187,249.42	-	-	-	-	-2,938,361,597.79	2,955,548,847.21
负债							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	1,250,110.51	1,250,110.51
应付托管费	-	-	-	-	-	250,022.09	250,022.09
应付清算款	-	-	-	-	-	4.25	4.25
其他负债	-	-	-	-	-	1,560,653.93	1,560,653.93
负债总计	-	-	-	-	-	3,060,790.78	3,060,790.78
利率敏感度缺口	17,187,249.42	-	-	-	-	-2,935,300,807.01	2,952,488,056.43

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	3,529,224,926.48	99.51	2,937,813,770.32	99.50
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,529,224,926.48	99.51	2,937,813,770.32	99.50

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除上证科创板 50 成份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）
	上证科创板50成份指数上升5%	175,559,543.88	146,552,455.79
	上证科创板50成份指数下降5%	-175,559,543.88	-146,552,455.79

#### 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	3,528,305,497.02	2,935,817,861.72
第二层次	-	1,995,908.60
第三层次	919,429.46	-
合计	3,529,224,926.48	2,937,813,770.32

###### 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	-	4,469,814.26	4,469,814.26
转出第三层次	-	6,424,473.10	6,424,473.10
当期利得或损失总额	-	2,874,088.30	2,874,088.30
其中：计入损益的利得或损失	-	2,874,088.30	2,874,088.30
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	919,429.46	919,429.46
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	-	92,818.69	92,818.69
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	919,429.46	平均价格亚式期权模型	预期波动率	0.3422~1.1406	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 3,551,051,289.07 元(2021 年度：3,293,762,426.15 元)，其中包括以股票支付的申购款 3,472,110,740.29 元和以现金支付的申购款 78,940,548.78 元(2021 年度：其中包括以股票支付的申购款 3,152,707,111.30 元和以现金支付的申购款 141,055,314.85 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	3,529,224,926.48	99.42
	其中：股票	3,529,224,926.48	99.42
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	19,342,833.45	0.54
8	其他各项资产	1,101,421.76	0.03
9	合计	3,549,669,181.69	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 142,257,167.00 元，占本基金期末资产净值的 4.01%。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 180,967 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 97,445,798.00 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	2,787,868,908.64	78.61
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	695,745,921.10	19.62



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	44,690,667.28	1.26
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	3,528,305,497.02	99.48

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	837,357.68	0.02
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	82,071.78	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
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	919,429.46	0.03

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	688981	中芯国际	7,743,372	318,562,324.08	8.98
2	688599	天合光能	4,293,893	273,778,617.68	7.72
3	688008	澜起科技	3,128,539	195,846,541.40	5.52
4	688111	金山办公	729,483	192,940,958.67	5.44
5	688012	中微公司	1,698,477	166,467,730.77	4.69
6	688777	中控技术	1,369,739	124,413,393.37	3.51
7	688122	西部超导	1,285,307	121,705,719.83	3.43
8	688063	派能科技	367,609	116,035,780.85	3.27
9	688396	华润微	2,089,474	110,010,806.10	3.10
10	688036	传音控股	1,264,241	100,532,444.32	2.83
11	688180	君实生物	1,510,184	94,537,518.40	2.67
12	688390	固德威	290,118	93,734,224.62	2.64
13	688223	晶科能源	5,542,064	81,191,237.60	2.29
14	688099	晶晨股份	1,132,896	79,880,496.96	2.25
15	688126	沪硅产业	4,318,147	76,042,568.67	2.14
16	688005	容百科技	1,071,089	73,637,368.75	2.08
17	688561	奇安信	1,080,065	71,035,875.05	2.00
18	688301	奕瑞科技	146,807	67,219,989.16	1.90
19	688536	思瑞浦	237,650	65,451,186.50	1.85
20	688032	禾迈股份	64,807	60,733,880.05	1.71
21	688116	天奈科技	734,478	56,657,632.92	1.60
22	688303	大全能源	1,176,140	56,078,355.20	1.58
23	688187	时代电气	1,023,612	55,858,506.84	1.57
24	688169	石头科技	221,578	54,895,949.50	1.55
25	688363	华熙生物	381,666	51,631,776.48	1.46
26	689009	九号公司	1,672,958	51,008,489.42	1.44
27	688009	中国通号	10,233,615	49,019,015.85	1.38
28	688139	海尔生物	756,193	47,867,016.90	1.35
29	688779	长远锂科	2,998,802	43,752,521.18	1.23
30	688538	和辉光电	16,319,330	43,735,804.40	1.23

31	688521	芯原股份	982,761	43,310,277.27	1.22
32	688256	寒武纪	793,491	43,292,868.96	1.22
33	688065	凯赛生物	692,316	42,432,047.64	1.20
34	688185	康希诺	272,662	39,814,105.24	1.12
35	688188	柏楚电子	175,684	38,137,482.72	1.08
36	688202	美迪西	174,708	37,368,294.12	1.05
37	688052	纳芯微	117,391	37,283,381.60	1.05
38	688271	联影医疗	192,769	34,116,257.62	0.96
39	688276	百克生物	477,441	32,995,947.51	0.93
40	688690	纳微科技	630,079	32,619,189.83	0.92
41	688041	海光信息	806,008	32,337,040.96	0.91
42	688006	杭可科技	482,852	21,134,432.04	0.60
43	688728	格科微	1,174,545	20,601,519.30	0.58
44	688819	天能股份	538,996	19,802,713.04	0.56
45	688082	盛美上海	145,353	11,613,704.70	0.33
46	688295	中复神鹰	267,149	11,532,822.33	0.33
47	688234	天岳先进	146,671	11,440,338.00	0.32
48	688220	翱捷科技	142,138	8,626,355.22	0.24
49	688772	珠海冠宇	443,166	8,260,614.24	0.23
50	688105	诺唯赞	137,794	7,322,373.16	0.21

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	688381	帝奥微	7,362	279,608.76	0.01
2	688351	微电生理	10,946	271,022.96	0.01
3	688498	源杰科技	1,582	178,971.66	0.01
4	688247	宣泰医药	7,155	107,754.30	0.00
5	688252	天德钰	5,201	82,071.78	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	688008	澜起科技	78,722,849.20	2.67
2	688223	晶科能源	76,936,087.07	2.61
3	688032	禾迈股份	75,112,110.75	2.54
4	688777	中控技术	73,383,884.19	2.49
5	688301	奕瑞科技	62,422,900.06	2.11
6	689009	九号公司	56,203,956.38	1.90
7	688187	时代电气	51,140,710.89	1.73

8	688779	长远锂科	47,993,505.47	1.63
9	688202	美迪西	45,271,431.68	1.53
10	688052	纳芯微	42,703,514.02	1.45
11	688396	华润微	41,933,305.32	1.42
12	688538	和辉光电	41,208,307.52	1.40
13	688690	纳微科技	38,722,224.07	1.31
14	688012	中微公司	38,287,200.57	1.30
15	688041	海光信息	37,669,831.91	1.28
16	688271	联影医疗	34,183,778.36	1.16
17	688276	百克生物	31,144,287.46	1.05
18	688608	恒玄科技	30,390,011.78	1.03
19	688063	派能科技	28,231,353.14	0.96
20	688696	极米科技	26,584,798.29	0.90

注：不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值 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	688981	中芯国际	64,298,023.44	2.18
2	688002	睿创微纳	57,016,922.08	1.93
3	688111	金山办公	52,439,888.85	1.78
4	688208	道通科技	50,300,300.57	1.70
5	688388	嘉元科技	49,580,728.39	1.68
6	688696	极米科技	39,922,013.50	1.35
7	688608	恒玄科技	39,536,180.63	1.34
8	688005	容百科技	35,712,185.71	1.21
9	688029	南微医学	35,275,271.59	1.19
10	688016	心脉医疗	33,793,945.99	1.14
11	688599	天合光能	30,416,979.96	1.03
12	688116	天奈科技	29,439,613.41	1.00
13	688083	中望软件	28,283,227.73	0.96
14	688289	圣湘生物	27,397,307.62	0.93
15	688023	安恒信息	27,297,534.04	0.92
16	688008	澜起科技	26,933,854.22	0.91
17	688686	奥普特	25,642,326.91	0.87
18	688180	君实生物	25,575,723.33	0.87
19	688536	思瑞浦	24,013,676.25	0.81
20	688099	晶晨股份	23,713,058.77	0.80

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	1,267,177,256.37
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	1,199,383,944.70
--------------	------------------

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	13,974.20
2	应收清算款	987,908.31

3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	99,539.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,101,421.76

#### 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	688008	澜起科技	21,284,000.00	0.60	转融通证券出借
2	688111	金山办公	10,579,600.00	0.30	转融通证券出借
3	688599	天合光能	6,376,000.00	0.18	转融通证券出借
4	688063	派能科技	3,156,500.00	0.09	转融通证券出借
5	688777	中控技术	2,270,750.00	0.06	转融通证券出借
6	688396	华润微	547,560.00	0.02	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	688381	帝奥微	279,608.76	0.01	新股锁定期内
2	688351	微电生理	271,022.96	0.01	新股锁定期内
3	688498	源杰科技	178,971.66	0.01	新股锁定期内
4	688247	宣泰医药	107,754.30	0.00	新股锁定期内
5	688252	天德钰	82,071.78	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	
		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 (%)
112,837	31,653.38	389,048,180.00	10.89	2,363,227,205.00	66.17	819,397,373.00	22.94

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份额比例 (%)
1	国新投资有限公司	47,015,100.00	1.32
2	中国石油天然气集团公司企业年金计划—中国工商银行	31,060,768.00	0.87
3	王旭林	28,300,000.00	0.79
4	北京九鼎房地产开发有限责任公司	24,802,161.00	0.69
5	中国建设银行股份有限公司企业年金计划—工行	24,012,986.00	0.67
6	招商证券资管—国新投资有限公司—招证资管国新2号单一资产管理计划	21,799,963.00	0.61
7	上海铂绅投资中心(有限合伙)—铂绅六号证券投资私募基金	15,587,839.00	0.44
8	周良芳	15,000,000.00	0.42
9	招商证券股份有限公司	14,683,163.00	0.41
10	华夏银行股份有限公司—华夏聚盛优选一年持有期混合型基金中基金 (FOF)	13,857,000.00	0.39

## 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	70,000.00	0.0020

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
----	--------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2020年9月28日） 基金份额总额	5,498,735,457.00
本报告期期初基金份额总额	2,035,072,758.00
本报告期基金总申购份额	3,213,600,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,677,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	3,571,672,758.00

## § 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，陆楨女士、李晗女士、田中荣治先生、孙茂竹先生担任公司第七届董事会独立董事，刘晓冰先生、卞时珍女士、柳军先生、刘声先生担任公司第七届监事会监事。文光伟先生、李亦宜女士不再担任公司独立董事。

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

上述人事变动已按相关规定备案、报告。

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 100,000.00 元人民币，该事务所已向本基金提供了 3 年的审计服务。

#### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

##### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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 (%)	
海通证券	2	1,613,148,063.23	65.95	1,180,712.79	60.35	-
中泰证券	2	695,159,339.71	28.42	647,485.77	33.09	-
安信证券	1	110,374,808.53	4.51	102,800.59	5.25	-
东方财富证券	2	27,455,274.15	1.12	25,588.67	1.31	-
爱建证券	1	-	-	-	-	-
财达证券	2	-	-	-	-	-
长江证券	2	-	-	-	-	-
德邦证券	2	-	-	-	-	-
东北证券	2	-	-	-	-	-
东吴证券	2	-	-	-	-	-
东亚前海证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国信证券	2	-	-	-	-	-

国元证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
宏信证券	2	-	-	-	-	-
华宝证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	5	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	4	-	-	-	-	-
摩根大通 证券	2	-	-	-	-	-
南京证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
太平洋证 券	2	-	-	-	-	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
万联证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	2	-	-	-	-	-
西南证券	1	-	-	-	-	-
新时代证 券	1	-	-	-	-	-
信达证券	2	-	-	-	-	-
野村证券	1	-	-	-	-	-
粤开证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	4	-	-	-	-	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中信建投	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(%)
海通证券	7,204,759.70	50.76	-	-	-	-
中泰证券	5,892,422.88	41.52	-	-	-	-
安信证券	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	1,095,680.00	7.72	-	-	-	-
爱建证券	-	-	-	-	-	-
财达证券	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
东亚前海证券	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
国元证券	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-
宏信证	-	-	-	-	-	-

券						
华宝证 券	-	-	-	-	-	-
华创证 券	-	-	-	-	-	-
华金证 券	-	-	-	-	-	-
华泰证 券	-	-	-	-	-	-
华西证 券	-	-	-	-	-	-
开源证 券	-	-	-	-	-	-
民生证 券	-	-	-	-	-	-
摩根大 通证券	-	-	-	-	-	-
南京证 券	-	-	-	-	-	-
首创证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
天风证 券	-	-	-	-	-	-
万联证 券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
西南证 券	-	-	-	-	-	-
新时代 证券	-	-	-	-	-	-
信达证 券	-	-	-	-	-	-
野村证 券	-	-	-	-	-	-
粤开证 券	-	-	-	-	-	-
招商证 券	-	-	-	-	-	-
浙商证 券	-	-	-	-	-	-
中信建	-	-	-	-	-	-

投						
---	--	--	--	--	--	--

### 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
4	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
5	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
6	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
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7月22日
8	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
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7月7日
10	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
11	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
12	华泰柏瑞基金管理有限公司关于参加工商银行基金申购及定期定额投资手续费率优惠活动的公告	证监会规定报刊和网站	2022年1月4日

## § 12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
联接基金	1	20220101-20221231;	489,398,739.00	918,891,400.00	588,892,766.00	819,397,373.00	22.94
产品特有风险							
<p>本基金报告期内有本基金联接基金持有基金份额超过 20%的情形。如果这些份额持有比例较大的投资者赎回，可能导致巨额赎回，从而引发流动性风险，可能对基金产生如下影响：（1）延期办理赎回申请或暂停赎回的风险。当发生巨额赎回时，投资者可能面临赎回申请延期办理、延缓支付或暂停赎回的风险。（2）基金净值大幅波动的风险。基金管理人为了应对大额赎回可能短时间内进行资产变现，这将对基金资产净值产生不利影响，同时可能发生大额赎回费用归入基金资产、基金份额净值保留位数四舍五入等问题，这些都可能会造成基金资产净值的较大波动。（3）基金投资目标偏离的风险。单一投资者大额赎回后可能导致基金规模缩小，基金将面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形，从而使得实现基金投资目标存在一定的不确定性。（4）基金合同提前终止的风险。如果投资者大额赎回可能导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。本基金管理人将密切关注申赎动向，审慎评估大额申赎对基金持有集中度的影响，同时将完善流动性风险管控机制，最大限度的保护基金份额持有人的合法权益。</p>							

### 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](http://www.huatai-pb.com)

华泰柏瑞基金管理有限公司

2023年3月31日