

# 中证 800 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：汇添富基金管理股份有限公司

基金托管人：平安银行股份有限公司

送出日期：2023 年 03 月 31 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自 2022 年 01 月 01 日起至 12 月 31 日止。

## 1.2 目录

§ 1 重要提示及目录 .....	2
1.1 重要提示 .....	2
1.2 目录 .....	3
§ 2 基金简介 .....	5
2.1 基金基本情况 .....	5
2.2 基金产品说明 .....	5
2.3 基金管理人和基金托管人 .....	5
2.4 信息披露方式 .....	6
2.5 其他相关资料 .....	6
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 .....	6
3.1 主要会计数据和财务指标 .....	6
3.2 基金净值表现 .....	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 .....	9
§ 4 管理人报告 .....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况 .....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明 .....	18
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 .....	18
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 .....	20
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 .....	21
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 .....	21
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 .....	22
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 .....	22
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 .....	23
§ 5 托管人报告 .....	23
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明 .....	23
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 .....	23
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 .....	23
§ 6 审计报告 .....	23
6.1 审计报告的基本信息 .....	23
6.2 审计报告的基本内容 .....	23
§ 7 年度财务报表 .....	25
7.1 资产负债表 .....	25
7.2 利润表 .....	27
7.3 净资产（基金净值）变动表 .....	28
7.4 报表附注 .....	30
§ 8 投资组合报告 .....	146
8.1 期末基金资产组合情况 .....	146
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 .....	146
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细 .....	147

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	183
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	184
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.....	184
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.....	184
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.....	184
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.....	184
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	185
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	185
8.12 投资组合报告附注.....	185
§ 9 基金份额持有人信息.....	186
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	186
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	186
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	187
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.....	187
§ 10 开放式基金份额变动.....	188
§ 11 重大事件揭示.....	188
11.1 基金份额持有人大会决议.....	188
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.....	188
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	188
11.4 基金投资策略的改变.....	188
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	188
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.....	188
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	189
11.8 其他重大事件.....	191
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息.....	192
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或者超过 20%的情况.....	192
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	193
§ 13 备查文件目录.....	193
13.1 备查文件目录.....	193
13.2 存放地点.....	193
13.3 查阅方式.....	193

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中证 800 交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	添富中证 800ETF
场内简称	800ETF
基金主代码	515800
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 10 月 08 日
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	平安银行股份有限公司
报告期末基金份额总额（份）	1,745,437,198.00
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	2019 年 12 月 16 日

注：扩位证券简称：800ETF。

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，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化进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人将运用其他合理的投资方法构建本基金的实际投资组合，追求尽可能贴近目标指数的表现。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.2%，年跟踪误差不超过 2%。如因标的指数编制规则调整等其他原因，导致基金跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人应采取合理措施，避免跟踪偏离度和跟踪误差的进一步扩大。本基金的投资策略主要包括：资产配置策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、金融衍生工具投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证的投资策略。
业绩比较基准	中证 800 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期的风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。同时本基金为指数基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		汇添富基金管理股份有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李鹏	李帅帅
	联系电话	021-28932888	0755-25878287

电子邮箱	service@99fund.com	LISHUAI SHUAI130@pingan.com.cn
客户服务电话	400-888-9918	95511-3
传真	021-28932998	0755-82080387
注册地址	上海市黄浦区北京东路 666 号 H 区（东座）6 楼 H686 室	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址	上海市黄浦区外马路 728 号	深圳市福田区益田路 5023 号平安金融中心 B 座 26 楼
邮政编码	200010	518001
法定代表人	李文	谢永林

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《中国证券报》
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.99fund.com
基金年度报告备置地点	上海市黄浦区外马路 728 号 汇添富基金管理股份有限公司

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

## § 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2022 年	2021 年	2020 年
本期已实现收益	-18,812,314.48	239,618,415.23	545,433,031.71
本期利润	-423,151,107.97	54,953,581.80	742,724,463.18
加权平均基金份额本期利润	-0.2531	0.0341	0.2407
本期加权平均净值利润率	-22.33%	2.59%	22.85%
本期基金份额净值增长率	-19.33%	2.04%	29.94%

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	129,057,039.83	526,489,465.14	368,660,974.90
期末可供分配基金份额利润	0.0739	0.3312	0.2056
期末基金资产净值	1,874,494,237.83	2,115,926,663.14	2,339,704,986.91
期末基金份额净值	1.0739	1.3312	1.3046
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	7.39%	33.12%	30.46%

注：1、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。

2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.18%	1.18%	1.96%	1.18%	0.22%	0.00%
过去六个月	-11.47%	1.05%	-12.60%	1.06%	1.13%	-0.01%
过去一年	-19.33%	1.26%	-21.32%	1.27%	1.99%	-0.01%
过去三年	6.96%	1.27%	-1.77%	1.28%	8.73%	-0.01%

自基金合同生效日起至今	7.39%	1.23%	5.31%	1.24%	2.08%	-0.01%
-------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------

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

添富中证800ETF累计净值增长率与同期业绩基准收益率对比图

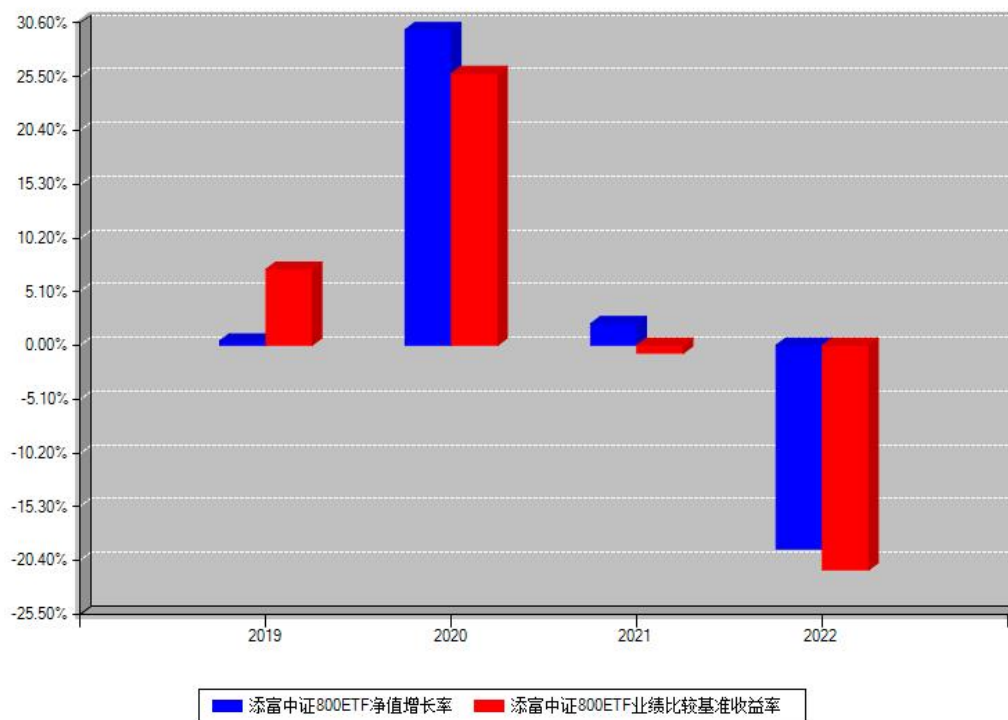


注：本基金建仓期为本《基金合同》生效之日（2019年10月08日）起6个月，建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

### 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



添富中证800ETF每年净值增长率与同期业绩基准收益率对比图



注：本《基金合同》生效之日为 2019 年 10 月 08 日，合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金过去三年均未进行利润分配。

## § 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

汇添富基金成立于 2005 年 2 月，是中国一流的综合性资产管理公司之一。公司总部设立于上海，在北京、上海、广州、成都、南京、深圳等地设有分公司，在香港、上海、美国设有子公司——汇添富资产管理(香港)有限公司、汇添富资本管理有限公司、汇添富资产管理(美国)控股有限公司。公司及旗下子公司业务牌照齐全，拥有全国社保基金境内委托投资管理人、全国社保基金境外配售策略方案投资管理人、基本养老保险基金投资管理人、保险资金投资管理人、专户资产管理人、特定客户资产管理子公司、QDII 基金管理人、RQFII 基金管理人、QFII 基金管理人、基金投资顾问等业务资格。

汇添富现已形成公募业务、私募资管业务、私募股权业务、养老金业务、电商业务、

国际业务、基金投顾业务等七大业务板块，被誉为“选股专家”，赢得广大基金持有人和海内外机构的认可和信赖。

成立以来，公司屡获殊荣，包括“金牛奖”“金基金奖”“明星基金奖”等多项权威荣誉奖项。汇添富始终坚持“客户第一”的价值观和“一切从长期出发”的经营理念，致力于打造中国最受认可的资产管理品牌。

2022 年，汇添富基金新成立 45 只公募基金，包括 18 只混合型基金，17 只股票型基金，10 只债券型基金。2022 年底，公司公募基金产品总数达 270 只，包括主动权益、指数、股债混合、债券、货币基金等覆盖各类风险收益特征的产品。

2022 年，汇添富基金继续坚持重度垂直兼顾开放的互联网金融平台战略，在不断夯实自有平台基础建设、全方位提升平台架构及安全系统的基础上，持续提升自有平台创新能力。从投资的生命周期各阶段出发，通过“渐进式”的创新和打磨，创造差异化的竞争优势。经过半年多的匠心打磨，推出了“指能添富”指数品牌以及对应的多项包括股债宝、指数热力地图、指数雷达等多个指数相关功能。继续深耕基于社区的大社交板块，涵盖视频、直播、资讯等各个维度，为客户架设可链接的投资及资讯服务桥梁。年内致力于基于买方视角，大力进行投顾服务转型，全方面提升客户投资的服务体验。全年自有平台精准营销体系初见成效，实现了平台活跃度的大幅提升，力争形成长期增长的良性循环。对外合作上，进一步加深与多家互联网巨头的深度战略合作，继续大力开拓新型互联网销售及服务模式，实现与平台的合作共赢。

2022 年，汇添富基金持续深化落实机构客户战略，机构业务规模保持较好的增长势头。公司为机构投资者提供综合解决方案，并深受机构投资者信任。与银行及理财子公司合作深入，保险委托管理规模同业领先。养老金业务方面，公司拥有全国社保基金境内投资管理人及基本养老保险基金投资管理人资格，也是全国社保基金境外配售策略管理人。养老金业务继续稳健发展，受托管理组合账户数量持续增加。同时在数字化建设上开展系统平台建设，为客户及团队赋能。

2022 年是渠道业务模式和客户需求发生较大改变的一年，公司始终秉持“客户第一”的价值观，围绕如何提升客户“获得感”，优化客户持有体验开展系列渠道服务和投资者教育工作。积极利用线上化数字营销工具，对客户进行分类经营和分层触达，建立精准的客户画像，提供标准化、体系化、专业化的客户陪伴。同时搭建了一站式投研资讯服务平台，提供紧贴市场的专业投资服务，以及便捷高效的营销辅助工具，赋能渠道客户经理。全年合计开展超 4000 余场“价值投资添富行”线上、线下系列活动。持续大力开展目标收益

定投、走进汇添富、走进上市公司、基金经理面对面等系列客户活动，营销培训活动覆盖至银行和券商的网点、营业部。

2022 年，汇添富基金继续提升客户服务能力，优化客户服务体系，为公司各项销售业务提供全方位支持。同时，持续优化电话服务、在线客服、短信系统等服务通道建设，丰富服务渠道，提升客户体验。

2022 年，香港子公司与母公司两地一体化运营、垂直化管理模式持续深化，并继续发挥显著成效，国际业务总资产管理规模稳步进步。汇添富香港于开曼群岛设立联接基金架构下的两支子母基金，汇添富权益大中华基金（CUAM EQUITY GREATER CHINA FUND 和汇添富权益大中华主基金（CUAM EQUITY GREATER CHINA MASTER FUND）。境外资产投资业绩稳健，为投资者全球资产分散化布局进一步打下基础，“中港策略”保持国际权威基金评级机构晨星五星评级，港币债券基金荣获晨星 5 星评级。客户服务方面，努力克服疫情影响，积极通过线上路演保持与全球央行、主权、养老、校务基金、家族信托等海外客户的持续沟通，进一步完善个性化客户服务体系，继续引导长期资金入市。

2022 年以来，汇添富以爱能改变为任，积极投身公益慈善，履行社会责任。公司积极支持上海疫情防控，支援街道、社区、医院和学校防疫工作；继续为推动中西部欠发达地区教育发展和乡村振兴而不懈努力；发挥公司专业优势，发起“基业上善”慈善资产管理研修营项目并完成第一期培训，助力国内公益基金会慈善资产保值增值和公益行业可持续发展。面对 2022 年上海爆发的疫情，公司在全力保护投资者利益、维护资本市场稳定的基础上，和全上海同呼吸共命运，支持一线抗疫，共同守“沪”。2022 年 3 月至 5 月，公司累计捐赠款物 107.77 万余元，用于“上海基金业致敬白衣天使”专项基金捐赠及瑞金医院、复旦大学、上海交通大学、以及部分街道社区抗疫物资捐赠。公司积极动员公司员工参与社区防疫服务工作，共有 77 人参与社区防疫志愿服务工作，超过员工总数 10%，服务总时长超过 2000 小时。在教育扶贫方面，汇添富持续开展“河流·孩子”公益助学计划：2022 年 1 月，通过“汇爱暖冬”联合捐赠行动，为全国 10 所添富小学筹集并捐赠价值近 400 万元的暖冬物资 20000 余份；2022 年 8 月，以线上形式开展第十五期“河流·孩子”2022 乡村优秀青年教师培训；2022 年 9 月，组织员工回访云南怒江州平安寨添富小学并提供支教等公益志愿服务。在乡村振兴方面，汇添富全年先后向黄浦区 2022 年党建助力对口支援地区乡村振兴项目、内蒙古兴和县产业帮扶和养老助老帮扶等项目、青海玛多县教育扶贫项目捐赠，助力乡村振兴。2022 年 12 月，在中国证券投资基金业协会及中国慈善联合会的指导和支持下，公司旗下上海汇添富公益基金会联合上海第一财经公益基金会发起并举办

首期“基业上善”慈善资产管理研修营。汇添富基金发挥自身资产管理的专业能力，赋能公益事业的可持续发展，践行基金向善，助力共同富裕和社会进步。

2023 年，汇添富基金将继续秉持一贯的经营理念与原则，进一步加强风险管理能力，提升客户服务水平，推动业务稳步发展，为促进实体经济健康发展、提升中国居民财富水平而不懈努力。

#### 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（年）	说明
		任职日期	离任日期		
乐无穹	本基金的基金经理	2019 年 10 月 08 日		8	国籍：中国。学历：复旦大学经济学硕士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：2014 年 7 月加入汇添富基金管理股份有限公司，历任金融工程助理分析师、指数与量化投资部分析师。2019 年 4 月 15 日至今任中证银行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 7 月 26 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2019 年 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 4 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任

					<p>汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 8 日至今任汇添富中证沪港深互联网交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 7 月 27 日至今任汇添富中证芯片产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 27 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金的基金经理。</p> <p>2021 年 10 月 26 日至 2022 年 10 月 30 日任汇添富恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）的基金经理。2021 年 10 月 29 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互</p>
--	--	--	--	--	---

					<p>通交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 12 月 28 日至今任汇添富中证沪港深云计算产业指数型发起式证券投资基金的基金经理。2022 年 1 月 11 日至今任汇添富 MSCI 中国 A50 互联互通交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 3 月 29 日至 2022 年 11 月 21 日任汇添富中证人工智能主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 6 月 13 日至今任中证长三角一体化发展主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 7 月 29 日至今任汇添富中证 1000 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 8 月 31 日至今任汇添富恒生科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 10 月 31 日至今任汇添富恒生科技交</p>
--	--	--	--	--	--

					易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（QDII）的基金经理。2022 年 12 月 7 日至今任汇添富恒生香港上市生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。
过蓓蓓	本基金的基金经理, 指数与量化投资部总监助理	2019 年 10 月 08 日		11	国籍：中国。学历：中国科学技术大学金融工程博士。从业资格：证券投资基金从业资格。从业经历：曾任国泰基金管理有限公司金融工程部助理分析师、量化投资部基金经理助理。2015 年 6 月加入汇添富基金管理股份有限公司，现任指数与量化投资部总监助理。2015 年 8 月 3 日至今任汇添富中证主要消费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 8 月 3 日至今任中证金融地产交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证能源交易型开放式指数证券投资基金的基

				<p>金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证医药卫生交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2015 年 8 月 3 日至今任中证主要消费交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 18 日至今任汇添富深证 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。</p> <p>2015 年 8 月 18 日至今任深证 300 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 22 日至今任汇添富中证生物科技主题指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2016 年 12 月 29 日至 2022 年 12 月 1 日任汇添富中证中药指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2018 年 5 月 23 日至今任汇添富中证新能源汽车产业指数型发起式证券投资基金（LOF）的基金经理。</p> <p>2018 年 10 月 23 日至今任中证银行交易型开放式</p>
--	--	--	--	---



				<p>指数证券投资基金的基金经理。</p> <p>2019 年 3 月 26 日至今任汇添富中证医药卫生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 4 月 15 日至 2022 年 6 月 13 日任中证银行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 10 月 8 日至今任中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 2 月 1 日至今任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 6 月 3 日至今任汇添富中证新能源汽车产业交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2021 年 9 月 29 日至今任汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经理。2022 年 2 月 28 日至 2022 年 10 月 31 日任汇添富国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金联接基金的基金经</p>
--	--	--	--	--

					理。2022 年 8 月 15 日至今任汇添富纳斯达克生物科技交易型开放式指数证券投资基金（QDII）的基金经理。2022 年 9 月 26 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 10 月 20 日至今任汇添富中证 100 交易型开放式指数证券投资基金的基金经理。2022 年 12 月 2 日至今任汇添富中证中药交易型开放式指数证券投资基金联接基金（LOF）的基金经理。
--	--	--	--	--	---

注:1、基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期；

2、非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期；

3、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

#### 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遵规守信情况的说明

本基金管理人在本报告期内遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本基金无重大违法、违规行为，本基金投资运作符合有关法规及基金合同的约定。

#### 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

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《汇添富基金管理股份有限公司公平交易制度》，建立了健全、有效的公平交易制度体系，覆盖了公募基金、资产管理计划、社保组合、基本养老保险组合以及投资顾问业务等各类资产管理业务所涉及的所有投资组合；涵盖了境内外上市股票、债券等所有投资品种的一级市场申购、二级市场交易等投资管理活动；贯穿了授权、研究分析、投资决策、交易执行以及效果评估等投资管理活动的各个环节。具体控制措施包括：（1）在研究分析环节，公司建立了统一、规范和完善的投研平台信息管理系统，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。（2）在投资决策环节，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、分管投资副总、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限，合理确定各投资组合经理的投资权限。投资决策委员会和分管投资副总等管理机构和人员不得对投资组合经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序。另外，公司还建立机制要求公募投资组合经理与资产管理计划投资组合经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。（3）在交易执行环节，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部门，实行了集中交易制度和公平的交易分配机制。对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了相应的交易管理规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；对于银行间市场的现券、回购等场外交易，交易部在交易市场开展独立、公平的询价，确保交易得到公平执行；对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易，各投资组合经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配，确保公平对待各投资组合。（4）在日常监控环节，公司通过日常监控分析、投资交易监控报告、专项稽核等形式，对投资交易全过程实施监督，对包括利益输送在内的各类异常交易行为进行核查。核查的范围包括不同时间窗口下的同向交易、反向交易、交易价差、收益率差异、场外交易分配、场外议价公允性等等。（5）在报告分析环节，公司按季度和年度编制公平交易分析报告，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估，并由投资组合经理、督察长、总经理审核签署。

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

本基金管理人通过建立事前、事中和事后全程嵌入式的管控模式，确保公平交易制度的执行和实现。具体情况如下：

一、本基金管理人建立了内部公平交易管理规范 and 流程，以确保公平交易管控覆盖公司所有业务类型、投资策略、投资品种及投资管理的各个环节。

二、本着“时间优先、价格优先”的原则，对同一证券有相同交易需求的投资组合采用交易系统内的公平交易模块，实现事中交易执行层面的公平管控。

三、对不同投资组合进行同向交易价差分析，具体方法为：在不同时间窗口（日内、3 日内、5 日内）下，对不同组合同一证券同向交易的平均价差率进行 T 检验。对于未通过 T 检验的交易，再根据同向交易占比、交易价格、交易频率、交易数量和交易时间等进行具体分析，进一步判断是否存在重大利益输送的可能性。

四、对于反向交易，根据交易顺序、交易时间窗口跨度、交易价格、交易数量占市场成交量比值、组合规模、市场收益率变化等综合判断交易是否涉及利益输送。

综上，本基金管理人通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本基金未出现异常交易的情况。

本报告期内，本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的情况有 41 次，投资组合因投资策略与其他组合发生反向交易。基金管理人事前严格根据内部规定进行管控，事后对交易时点、交易数量、交易价差等多方面进行综合分析，未发现导致不公平交易和利益输送的异常交易行为。

#### 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，全球主要关注欧洲地缘冲突、全球疫情进展及美联储加息进度。

欧洲地缘冲突二月开始发酵，对全球市场都造成了短期剧烈冲击，并带来对能源供应的担忧。发达经济体通胀上行显著。美联储在一季度开始持续加息来应对通胀压力的意图明确，带来全球流动性冲击。随着四季度通胀数据改善，加息周期预计逐渐接近尾声。区域之间的经济周期出现一定错位，国内复苏预期与海外弱衰退的状态形成鲜明对比。四季度，国内市场在 10 月下跌之后迎来震荡上行，行情以复苏预期升温主导，交易情绪显著改善。12 月 7 日，随着“新十条”出台，各项措施进一步优化调整，相关配套政策也陆续出台。但各地实际情况有所差异，市场对此也存在一定分歧，12 月中下旬整体表现为缩量下

跌行情。

国内来看，10月、11月经济数据略有不及预期。政策优化调整及落实的过程中，难以避免短期冲击，对经济复苏节奏产生一定扰动。12月中央经济工作会议仍然以稳增长为主基调，强调了扩大内需的重要性，其他重点工作还包括加快建设现代化产业体系、切实落实“两个毫不动摇”、大力吸引和利用外资、有效防范化解重大经济金融风险等，表达了较为积极的政策态度。

资本市场方面，全年下跌行情在四季度有所扭转，但成交缩量明显。从资金流向观察来看，大量资金流入宽基类产品。行业板块中，消费、医药等前期下跌较多的板块出现底部修复行情，另有信创板块受到市场关注，涨幅较大。周期类板块下跌较多。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金本报告期基金份额净值增长率为-19.33%。同期业绩比较基准收益率为-21.32%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，美联储加息周期接近尾声，但未必能够很快看到降息，需要维持适度的高利率状态来控制通胀水平。但市场对流动性的边际改善预期已经形成，全球资金预计有望转向新兴市场。国内经济复苏与海外弱衰退形成对比，中国资产的全球吸引力进一步提升。2022年全年海外资金流入不显著，但临近年末北上资金流入开始加速。随着互联互通的范围在品种上扩容到ETF、在股票标的范围上也有进一步扩大的规则出台，未来北上资金持续流入的空间打开。政策方面，稳增长基调不变，经济复苏和流动性适度的环境下，企业盈利也有望逐步改善。站在2022年末，资本市场已经经历一年多的冲击，当前已经出现较多积极的改变，使得我们能够对未来一年的资本市场保持乐观积极的态度。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人内部稽核监察工作主要包括以下几个方面：

##### 1、持续提升合规法务管理

公司持续践行“合规、诚信、专业、稳健”的行业文化，坚持“正直”、“客户第一”的公司价值观，完善合规管理体系，提升专业能力，优化合规资源配置，不断提升合规管理工作的有效性。公司坚持广泛开展合规培训、强化从业人员合规意识，不断夯实公司合规文化体系基础；持续完善公司制度流程体系、优化合规管理制度机制，通过统一的合规审核标准、动态调整的合规管理指引，有效把控各类业务的合规关键点，防范潜在风险，保障各项业务规范开展；深入细致开展合规审查工作，为各部门提供有效的合规咨询与法务支持，督促强化一线合规执行效果；独立开展事后合规检查监督，查漏补缺、防微杜渐；

优化从业人员管理机制，加强管理措施，严格执行合规考核问责机制，引导全体员工不断提升合规执业意识，强化公司合规履职保障。

## 2、完善投资合规风险控制工作

本基金管理人持续优化投资运作管理事前、事中、事后全流程的投资合规风险管理措施。

事前，加强新产品、新业务的风险识别、评估。在产品设计环节评估新产品、新业务的投资合规性，为管控新产品、新业务运作中的潜在投资合规风险奠定基础。此外，本基金管理人坚持制度先行，通过制定或修订各项投资管理制度，为业务的开展提供了科学规范的制度依据。

事中，管控措施不断完善。通过配置投资交易系统风控参数、加强事中流程审核等，有效保障投资交易行为合规。同时，通过对基金日常流动性、投资组合风险敞口等进行监控、分析、提示，完善日常投资合规风险监控体系。

事后，风险跟踪提示机制持续优化。通过对投资范围、投资限制、公平交易、异常交易情况等的跟踪、分析和提示，有效落实法律法规、基金合同及公司内部制度的各项要求。

## 3、加强稽核内审工作

通过开展日常风险排查，以及对重点业务开展专项稽核检查，尽早发现业务中存在的合规问题和风险隐患，并采取防范措施，督促责任部门落实整改；对风险事件和差错事件开展稽核审查，加强问责力度，促进业务合法合规开展；实施关键岗位离任审查，督促人员勤勉尽责、合规展业；配合监管检查与会计师事务所审计工作，通过问题反馈、实施整改，进一步完善公司内部控制管理机制。

通过上述工作，本报告期内，本基金管理人所管理的基金能够合法合规开展投资运作。本基金管理人将规范运作基金资产，加强风险控制，持续提高监察稽核工作的科学性和有效性，充分保障基金份额持有人的合法权益。

## 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，并保持估值政策和程序的一贯性。

本基金管理人设有估值委员会，估值委员会负责构建估值决策体系、适时更新估值相关制度、指导并监督各类投资品种的估值程序。估值委员会由投资、研究、集中交易、合规稽核、风险管理、基金营运等部门中具有丰富从业经验和专业胜任能力的员工担任，且

互相不存在直接的重大利益冲突。基金经理可参与估值委员会对于估值方法的讨论，但无最终决策权，从而将其影响程度进行适当限制，保证基金估值的公平、合理。

基金日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由管理人完成估值后，经托管人复核无误后由管理人对外公布。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：本基金的收益分配采用现金分红；本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

本基金本报告期内未进行收益分配。

#### 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

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，平安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。

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

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告的基本信息

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	安永华明（2023）审字第 60466941_B139 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	中证 800 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>我们审计了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表，包括 2022 年 12 月 31 日的资产负债表，2022 年度的利润表、净资产（基金净值）变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中证 800 交易型开放式指数证券投资基金 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年度的经营成果和净值变动情况。</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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中证 800 交易型开放式指数证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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>
强调事项	不适用
其他事项	不适用
其他信息	<p>中证 800 交易型开放式指数证券投资基金管理层对其他信息负责。</p> <p>其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，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，管理层负责评估中证 800 交易型开放式指数证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中证 800 交易型开放式指数证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。</p>



	<p>合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 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>(2) 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>(3) 评价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>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中证 800 交易型开放式指数证券投资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中证 800 交易型开放式指数证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	许培菁 韩云
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层
审计报告日期	2023 年 03 月 31 日

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中证 800 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	48,997,016.89	54,246,161.68
结算备付金		12,872,963.06	37,658,495.56
存出保证金		6,905,655.01	12,601,710.09
交易性金融资产	7.4.7.2	1,806,097,361.02	2,009,986,481.80
其中: 股票投资		1,806,097,361.02	2,007,588,481.80
基金投资		-	-
债券投资		-	2,398,000.00
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		-	-
应收清算款		15,120,161.65	4,863,087.86
应收股利		10,409.12	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	33,615.61	31,931.25
资产总计		1,890,037,182.36	2,119,387,868.24
<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		14,783,502.54	2,443,643.71
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		240,190.34	269,214.55
应付托管费		80,063.42	89,738.20
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		4,092.81	77,629.38
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	435,095.42	580,979.26
负债合计		15,542,944.53	3,461,205.10
<b>净资产:</b>			
实收基金	7.4.7.8	1,745,437,198.00	1,589,437,198.00

未分配利润	7.4.7.9	129,057,039.83	526,489,465.14
净资产合计		1,874,494,237.83	2,115,926,663.14
负债和净资产总计		1,890,037,182.36	2,119,387,868.24

注：报告截止日 2022 年 12 月 31 日，基金份额净值 1.0739 元，基金份额总额

1,745,437,198.00 份。

比较数据已根据本年《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>》中的资产负债表格式的要求进行列示：上年末资产负债表中“应收利息”与“其他资产”项目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表中“其他资产”项目的“上年末”余额，上年末资产负债表中“应付交易费用”、“应付利息”与“其他负债”科目的“本期末”余额合并列示在本期末资产负债表“其他负债”项目的“上年末”余额。

## 7.2 利润表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022 年 01 月 01 日 至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日 至 2021 年 12 月 31 日
<b>一、营业总收入</b>		<b>-418,574,857.45</b>	<b>62,111,843.75</b>
1. 利息收入		2,743,740.68	1,611,653.47
其中：存款利息收入	7.4.7.10	602,409.21	790,651.18
债券利息收入		-	860.48
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		2,141,331.47	820,141.81
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-17,180,872.82	244,940,344.67
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-39,998,174.37	199,232,329.23
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	941,432.65	975,936.72
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-16,777,219.69	11,370,757.29
股利收益	7.4.7.17	38,653,088.59	33,361,321.43
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）	7.4.7.18	-404,338,793.49	-184,664,833.43

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	201,068.18	224,679.04
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>4,576,250.52</b>	<b>7,158,261.95</b>
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	2,842,512.68	3,186,847.78
2. 托管费	7.4.10.2.2	947,504.21	1,062,282.63
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	7.4.7.20	-	-
7. 税金及附加		7,712.56	40,936.43
8. 其他费用	7.4.7.21	778,521.07	2,868,195.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-423,151,107.97</b>	<b>54,953,581.80</b>
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-423,151,107.97</b>	<b>54,953,581.80</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>-423,151,107.97</b>	<b>54,953,581.80</b>

注：比较数据已根据本年《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〉》中的利润表格式的要求进行列示：上年度可比期间利润表中“交易费用”项目与“其他费用”项目的“本期”金额合并列示在本期利润表中“其他费用”项目的“上年度可比期间”金额。

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中证 800 交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	156,000,000.00	-397,432,425.31	-241,432,425.31
（一）、综合收益总额	-	-423,151,107.97	-423,151,107.97
（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）	156,000,000.00	25,718,682.66	181,718,682.66
其中：1. 基金申购款	420,000,000.00	56,237,922.61	476,237,922.61
2. 基金赎回款	-264,000,000.00	-30,519,239.95	-294,519,239.95
（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、本期期末净资产（基金净值）	1,745,437,198.00	129,057,039.83	1,874,494,237.83
项目	上年度可比期间		
	2021年01月01日至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91
加：会计政策变更	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,793,437,198.00	546,267,788.91	2,339,704,986.91
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-204,000,000.00	-19,778,323.77	-223,778,323.77
（一）、综合收益总额	-	54,953,581.80	54,953,581.80
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以	-204,000,000.00	-74,731,905.57	-278,731,905.57

“-”号填列)			
其中：1. 基金申购款	352,000,000.00	111,325,782.75	463,325,782.75
2. 基金赎回款	-556,000,000.00	-186,057,688.32	-742,057,688.32
(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、本期期末净资产(基金净值)	1,589,437,198.00	526,489,465.14	2,115,926,663.14

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：

<u>张晖</u>	<u>李骁</u>	<u>雷青松</u>
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

中证 800 交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”），系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]162 号文《关于准予中证 800 交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册，由汇添富基金管理股份有限公司向社会公开募集。基金合同于 2019 年 10 月 8 日生效。首次设立基金募集规模为 6,601,437,198.00 份基金份额，业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）出具安永华明（2019）验字第 60466941\_A04 号验资报告予以验证。本基金为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为汇添富基金管理股份有限公司，注册登记机构为中国证券登记结算有限责任公司，基金托管人为平安银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。为更好地实现投资目标，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、中小企业私募债券、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工

具（但须符合中国证监会的相关规定）。在条件许可的情况下，基金管理人可在不改变本基金既有投资目标、策略和风险收益特征并在控制风险的前提下，根据相关法律法规，参与融资及转融通证券出借业务，以提高投资效率及进行风险管理。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于标的指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。本基金紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金的业绩比较基准为：中证 800 指数收益率。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第 2 号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第 3 号《会计报表附注的编制及披露》、《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〉》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2022 年 12 月 31 日的财务状况以及 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日的经营成果和净值变动情况。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即每年自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### (1) 金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

#### (2) 金融负债分类

本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

#### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，所有公允价值变动计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期



内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能

够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，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；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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。采用估值技术确定公允价值时，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### **7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销**

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### **7.4.4.7 实收基金**

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所

引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益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利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。

未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或内含票面利率或合同利率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额扣

除适用情况下的相关税费后的净额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。因借入人未能按期归还产生的罚息，实际发生时扣除适用情况下的相关税费后的净额计入转融通证券出借业务利息收入；

(8)其他收入在经济利益很可能流入从而导致资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时确认。

#### 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等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

(1)每一基金份额享有同等分配权；

(2)本基金的收益分配采用现金分红；

(3)本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

(4)若《基金合同》生效不满 3 个月可不进行收益分配；

(5)法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

#### 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

根据《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》、《企业会计准则第 37 号——金融工具列报》（统称“新金融工具准则”）、《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》的规定和相关法律法规的要求，本基金自 2022 年 1 月 1 日开始按照新金融工具准则进行会计处理。此外，本基金亦已执行财政部于 2022 年发布的《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）。

新金融工具准则改变了金融资产的分类和计量方式，确定了三个主要的计量类别：摊余成本；以公允价值计量且其变动计入其他综合收益；以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金考虑自身业务模式，以及金融资产的合同现金流特征进行上述分类。

新金融工具准则要求金融资产减值计量由“已发生损失模型”改为“预期信用损失模

型”，适用于以摊余成本计量的金融资产。金融资产减值计量的变更对于本基金的影响不重大。

本基金将基于实际利率法计提的金融工具的利息包含在相应金融工具的账面余额中，并反映在相关“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等项目中，不单独列示“应收利息”项目或“应付利息”项目。

“信用减值损失”项目，反映本基金计提金融工具信用损失准备所确认的信用损失。本基金将分类为以摊余成本计量的金融资产按照实际利率法计算的利息收入反映在“利息收入”项目中，其他项目的利息收入从“利息收入”项目调整至“投资收益”项目列示。

根据新金融工具准则的衔接规定，对可比期间信息不予调整，首日执行新金融工具准则与原准则的差异追溯调整本报告期初未分配利润。

于首次执行日（2022年1月1日），原金融资产和金融负债账面价值调整为按照修订后金融工具确认和计量准则的规定进行分类和计量的新金融资产和金融负债账面价值的调节如下所述：

以摊余成本计量的金融资产：

银行存款于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币54,246,161.68元，自应收利息转入的重分类金额为人民币5,722.74元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，银行存款于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币54,251,884.42元。

结算备付金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币37,658,495.56元，自应收利息转入的重分类金额为人民币17,079.59元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，结算备付金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币37,675,575.15元。

存出保证金于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币12,601,710.09元，自应收利息转入的重分类金额为人民币61.05元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，存出保证金于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币12,601,771.14元。

其他资产于2021年12月31日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币0.00元，自应收利息转入的重分类金额为人民币9,015.31元，重新计量预期信用损失准备的金额为人民币0.00元。经上述重分类和重新计量后，其他资产于2022年1月1日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币9,015.31元。

应收利息于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 31,931.25 元，转出至银行存款的重分类金额为人民币 5,722.74 元，转出至结算备付金的重分类金额为人民币 17,079.59 元，转出至存出保证金的重分类金额为人民币 61.05 元，转出至交易性金融资产的重分类金额为人民币 52.56 元，转出至其他资产的重分类金额为人民币 9,015.31 元。经上述重分类后，应收利息不再作为财务报表项目单独列报。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产：

交易性金融资产于 2021 年 12 月 31 日按原金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,009,986,481.80 元，自应收利息转入的重分类金额为人民币 52.56 元。经上述重分类后，交易性金融资产于 2022 年 1 月 1 日按新金融工具准则列示的账面价值为人民币 2,009,986,534.36 元。

除上述财务报表项目外，于首次执行日，新金融工具准则的执行对财务报表其他金融资产和金融负债项目无影响。

于首次执行日，新金融工具准则的执行对本基金金融资产计提的减值准备金额无重大影响。

上述会计政策变更未导致本基金本期期初未分配利润的变化。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 7.4.6 税项

##### 1. 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革过程中因非流通股股东向流通股股东支付对价而发生的股权转让，暂免征收印花税。

##### 2. 增值税

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改增值税试点的

通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]46 号文《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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]70 号文《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《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》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税。对证券投资基金在 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，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

### 3. 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例（2011 年修订）》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育费附加。

### 4. 企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的

股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1 号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

#### 5. 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税[2005]103 号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》的规定，股权分置改革中非流通股股东通过对价方式向流通股股东支付的股份、现金等收入，暂免征收流通股股东应缴纳的个人所得税；

根据财政部、国家税务总局财税[2008]132 号文《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2012]85 号文《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》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按 25% 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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2015]101 号文《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》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

### 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	48,997,016.89	54,246,161.68
等于：本金	48,991,784.18	54,246,161.68
加：应计利息	5,232.71	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-



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	-	-
合计	48,997,016.89	54,246,161.68

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	2,010,921,313.17	-	1,806,097,361.02	204,823,952.15
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	2,010,921,313.17	-	1,806,097,361.02	204,823,952.15
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	1,808,239,120.46	-	2,007,588,481.80	199,349,361.34
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	2,398,000.00	2,398,000.00	-
	银行间市场	-	-	-
	其他	-	-	-
	合计	2,398,000.00	-	2,398,000.00
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,810,637,120.46	-	2,009,986,481.80	199,349,361.34

## 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2022 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	56,991,300.00	-	-	-
（权证投资）	-	-	-	-
（股指期货投资）	56,991,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	56,991,300.00	-	-	-
项目	上年度末 2021 年 12 月 31 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
（国债期货投资）	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
（外汇期货投资）	-	-	-	-
权益衍生工具	99,497,500.00	-	-	-

(权证投资)	-	-	-	-
(股指期货投资)	99,497,500.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	99,497,500.00	-	-	-

#### 7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2301	IF2301	48	55,958,400.00	-1,032,900.00
合计				-1,032,900.00
减：可抵销期货暂收款				-1,032,900.00
净额				-

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

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金本报告期末及上年度末均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均未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 债权投资

##### 7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金本报告期末无债权投资。

##### 7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金本报告期内不存在债权投资减值准备计提情况。

#### 7.4.7.6 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	-	31,931.25
其他应收款	33,615.61	-
待摊费用	-	-
合计	33,615.61	31,931.25

## 7.4.7.7 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	84,821.78	223,350.97
其中：交易所市场	84,821.78	223,350.97
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
应付审计费	90,000.00	80,000.00
应付信息披露费	120,000.00	120,000.00
应付指数使用费	140,273.64	157,628.29
应付账户维护费	-	-
应付汇划费	-	-
应付上市费	-	-
应付持有人大会费-公证费	-	-
应付持有人大会费-律师费	-	-
其他	-	-
合计	435,095.42	580,979.26

## 7.4.7.8 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,589,437,198.00	1,589,437,198.00
本期申购	420,000,000.00	420,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-264,000,000.00	-264,000,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-

本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	1,745,437,198.00	1,745,437,198.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 7.4.7.9 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	558,799,616.91	-32,310,151.77	526,489,465.14
本期利润	-18,812,314.48	-404,338,793.49	-423,151,107.97
本期基金份额交易产生的变动数	54,589,772.06	-28,871,089.40	25,718,682.66
其中：基金申购款	146,287,098.12	-90,049,175.51	56,237,922.61
基金赎回款	-91,697,326.06	61,178,086.11	-30,519,239.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	594,577,074.49	-465,520,034.66	129,057,039.83

#### 7.4.7.10 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
活期存款利息收入	212,430.34	266,392.89
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	387,466.67	518,625.50
其他	2,512.20	5,632.79
合计	602,409.21	790,651.18

注：“其他”为结算保证金利息收入。

#### 7.4.7.11 股票投资收益

##### 7.4.7.11.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月31日
股票投资收益— —买卖股票差价收入	-31,568,672.69	139,850,845.94
股票投资收益— —赎回差价收入	-8,429,501.68	59,381,483.29
股票投资收益—	-	-

一申购差价收入		
股票投资收益— —证券出借差价 收入	-	-
合计	-39,998,174.37	199,232,329.23

#### 7.4.7.11.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
卖出股票成交总额	431,397,098.58	783,127,124.73
减：卖出股票成本总额	461,834,234.05	643,276,278.79
减：交易费用	1,131,537.22	-
买卖股票差价收入	-31,568,672.69	139,850,845.94

#### 7.4.7.11.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
赎回基金份额对价总额	294,519,239.95	742,057,688.32
减：现金支付赎回款总额	128,572,822.95	325,304,130.32
减：赎回股票成本总额	174,375,918.68	357,372,074.71
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-8,429,501.68	59,381,483.29

#### 7.4.7.11.4 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比区间均无证券出借差价收入。

#### 7.4.7.12 基金投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无基金投资收益。

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2022年01月01日至2022年12月31日	2021年01月01日至2021年12月31日
债券投资收益— —利息收入	657.24	-
债券投资收益— —买卖债券（债 转股及债券到期	940,775.41	975,936.72

兑付) 差价收入		
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	941,432.65	975,936.72

#### 7.4.7.13.2 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 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券 到期兑付）成交总额	6,367,372.72	7,795,546.08
减：卖出债券（债转股及 债券到期兑付）成本总额	5,425,800.00	6,818,700.00
减：应计利息总额	719.96	909.36
减：交易费用	77.35	-
买卖债券差价收入	940,775.41	975,936.72

#### 7.4.7.14 资产支持证券投资收益

##### 7.4.7.14.1 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均无资产支持证券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖资产支持证券差价收入。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

##### 7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金本报告期及上年度可比期间均无衍生工具买卖权证差价收入。

##### 7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间收益金额 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
国债期货投资收益	-	-
外汇远期投资收益	-	-
股指期货投资收益	-16,777,219.69	11,370,757.29
外汇期货投资收益	-	-

## 7.4.7.17 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至 2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	38,653,088.59	33,361,321.43
其中：证券出借权益补偿收入	2,210,903.69	719,152.87
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	38,653,088.59	33,361,321.43

## 7.4.7.18 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至2022年12 月31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12 月31日
1. 交易性金融资产	-404,173,313.49	-179,990,893.43
——股票投资	-404,173,313.49	-179,990,893.43
——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	-165,480.00	-4,673,940.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-165,480.00	-4,673,940.00
3. 其他	-	-
减：应税金融商品 公允价值变动产生的 预估增值税	-	-
合计	-404,338,793.49	-184,664,833.43

## 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月 31日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年12月 31日
基金赎回费收入	-	-
替代损益	201,068.18	224,679.04
其他	-	-
合计	201,068.18	224,679.04

## 7.4.7.20 信用减值损失

注：本基金本报告期无信用减值损失。



## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
审计费用	90,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
账户维护费	-	-
银行费用	-	-
指数使用费	568,502.59	637,369.46
持有人大会- 公证费	-	-
持有人大会- 律师费	-	-
开户费	-	-
上市费	-	-
其他	18.48	2,030,825.65
合计	778,521.07	2,868,195.11

## 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，本基金无需要披露的重大或有事项。

## 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无需要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
汇添富基金管理股份有限公司	基金管理人, 基金销售机构
平安银行股份有限公司 (“平安银行”)	基金托管人
东方证券股份有限公司 (“东方证券”)	基金管理人的股东
上海上报资产管理有限公司	基金管理人的股东
上海菁聚金投资管理合伙企业 (有限合伙)	基金管理人的股东
东航金控有限责任公司	基金管理人的股东
汇添富资本管理有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (美国) 控股有限公司	基金管理人的全资子公司
汇添富资产管理 (香港) 有限公司	基金管理人的全资子公司
东方证券承销保荐有限公司	基金管理人的股东的全资子公司
上海汇添富公益基金会	与基金管理人同一批关键管理人员
汇添富投资管理有限公司	基金管理人的全资子公司的全资子公司

汇添富中证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金	该基金是本基金的联接基金
------------------------------	--------------

注：以下关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)
东方证券	218,866,676.44	22.59	620,827,814.34	42.50

##### 7.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)
东方证券	1,469,970.11	23.09	3,292,006.01	42.23

##### 7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

##### 7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行基金交易。

##### 7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

##### 7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例

				(%)
东方证券	157,724.18	30.60	2,608.27	3.08
关联方名称	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例 (%)
东方证券	570,091.97	56.94	-	-

注：上述佣金按市场佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取证管费、经手费和由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,842,512.68	3,186,847.78
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.15% 年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.15\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

##### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	947,504.21	1,062,282.63

注：本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.05\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 5 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

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

#### 7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	38,945,545.00	27,412.31	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
东方证券	-	-	-	-

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

单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量 (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
东方	20220111000006 83	晶盛	2022	338,700.0 0	6,000.00	14	3.6 0	474.18	-	-

证券		机电	年 01 月 11 日							
东方 证券	20220111000006 89	天合 光能	202 2 年 01 月 11 日	502,320.0 0	8,000.00	14	3.6 0	703.25	-	-
东方 证券	20220125000118 76	晶盛 机电	202 2 年 01 月 25 日	364,620.0 0	6,000.00	14	3.6 0	510.47	-	-
东方 证券	20220125000118 84	天合 光能	202 2 年 01 月 25 日	553,360.0 0	8,000.00	14	3.6 0	774.70	-	-
东方 证券	20220208000152 68	天合 光能	202 2 年 02 月 08 日	480,240.0 0	8,000.00	14	3.6 0	672.34	-	-
东方 证券	20220208000152 80	晶盛 机电	202 2 年 02 月 08 日	334,860.0 0	6,000.00	14	3.6 0	468.80	-	-
东方 证券	20220222000137 01	晶盛 机电	202 2 年 02	360,600.0 0	6,000.00	14	3.6 0	504.84	-	-

			月 22 日							
东方 证券	20220222000137 09	天合 光能	202 2年 02月 22日	507,200.0 0	8,000.00	14	3.6 0	710.08	-	-
东方 证券	20220308000131 86	晶盛 机电	202 2年 03月 08日	362,640.0 0	6,000.00	14	3.6 0	507.70	-	-
东方 证券	20220308000134 30	天合 光能	202 2年 03月 08日	585,520.0 0	8,000.00	14	3.6 0	819.73	-	-
东方 证券	20220321000008 41	三环 集团	202 2年 03月 21日	29,550.00	1,000.00	14	3.4 0	44.65	-	-
东方 证券	20220321000008 43	卓胜 微	202 2年 03月 21日	237,000.0 0	1,000.00	14	3.4 0	358.13	-	-
东方 证券	20220321000008 45	宋城 演艺	202 2年 03月 21日	14,040.00	1,000.00	14	3.4 0	21.22	-	-

			日							
东方证券	2022032100000846	亿联网络	2022年03月21日	78,390.00	1,000.00	14	3.40	118.46	-	-
东方证券	2022032200014209	晶盛机电	2022年03月22日	372,000.00	6,000.00	14	3.60	558.00	-	-
东方证券	2022040600052265	宋城演艺	2022年04月06日	13,900.00	1,000.00	14	3.40	18.38	-	-
东方证券	2022040600052271	亿联网络	2022年04月06日	75,940.00	1,000.00	14	3.40	100.41	-	-
东方证券	2022040600052279	晶盛机电	2022年04月06日	341,940.00	6,000.00	14	3.60	478.72	-	-
东方证券	2022040600060303	三环集团	2022年04月06日	27,670.00	1,000.00	14	3.40	36.59	-	-
东	20220406000603	卓	202	204,960.0	1,000.00	14	3.4	271.00	-	-

方证券	13	胜微	2 年 04 月 06 日	0			0			
东方证券	2022042000043100	三环集团	202 2 年 04 月 20 日	28,150.00	1,000.00	14	3.4 0	39.88	-	-
东方证券	2022042000043104	亿联网络	202 2 年 04 月 20 日	77,640.00	1,000.00	14	3.4 0	109.99	-	-
东方证券	2022042000044998	宋城演艺	202 2 年 04 月 20 日	14,360.00	1,000.00	14	3.4 0	20.34	-	-
东方证券	2022042000045038	卓胜微	202 2 年 04 月 20 日	201,900.0 0	1,000.00	14	3.4 0	286.03	-	-
东方证券	2022042000045042	晶盛机电	202 2 年 04 月 20 日	317,400.0 0	6,000.00	14	3.6 0	476.10	-	-
东方证	2022050500063213	三环集	202 2 年	28,610.00	1,000.00	14	3.4 0	37.83	-	-



券		团	05 月 05 日							
东方 证 券	20220505000632 33	亿 联 网 络	202 2 年 05 月 05 日	75,720.00	1,000.00	14	3.4 0	100.12	-	-
东方 证 券	20220505000644 73	卓 胜 微	202 2 年 05 月 05 日	182,820.0 0	1,000.00	14	3.4 0	241.73	-	-
东方 证 券	20220505000644 77	宋 城 演 艺	202 2 年 05 月 05 日	12,280.00	1,000.00	14	3.4 0	16.24	-	-
东方 证 券	20220505000644 89	晶 盛 机 电	202 2 年 05 月 05 日	308,100.0 0	6,000.00	14	3.6 0	431.34	-	-
东方 证 券	20220509000007 02	宋 城 演 艺	202 2 年 05 月 09 日	22,580.00	2,000.00	14	3.4 0	29.86	-	-
东方 证 券	20220509000007 04	阳 光 电 源	202 2 年 05 月	127,620.0 0	2,000.00	14	3.4 0	168.74	-	-

			09 日							
东方证 券	20220509000007 06	同花 顺	202 2年 05月 09日	133,450.0 0	1,700.00	14	3.4 0	176.45	-	-
东方证 券	20220509000007 08	三环集 团	202 2年 05月 09日	54,560.00	2,000.00	14	3.4 0	72.14	-	-
东方证 券	20220509000007 14	芒果超 媒	202 2年 05月 09日	68,360.00	2,000.00	14	3.4 0	90.39	-	-
东方证 券	20220509000007 16	亿联网 络	202 2年 05月 09日	147,920.0 0	2,000.00	14	3.4 0	195.58	-	-
东方证 券	20220519000415 47	晶盛机 电	202 2年 05月 19日	337,200.0 0	6,000.00	14	3.6 0	472.08	-	-
东方证 券	20220519000415 59	宋城演 艺	202 2年 05月 19日	11,590.00	1,000.00	14	3.4 0	15.32	-	-

东方证券	2022051900043673	卓胜微	2022年05月19日	199,500.00	1,000.00	14	3.40	263.78	-	-
东方证券	2022051900043685	三环集团	2022年05月19日	30,370.00	1,000.00	14	3.40	40.16	-	-
东方证券	2022051900043693	亿联网络	2022年05月19日	72,900.00	1,000.00	14	3.40	96.39	-	-
东方证券	2022052300006787	阳光电源	2022年05月23日	164,700.00	2,000.00	14	3.40	217.77	-	-
东方证券	2022052300006807	芒果超媒	2022年05月23日	71,000.00	2,000.00	14	3.40	93.88	-	-
东方证券	2022052300006935	同花顺	2022年05月23日	143,174.00	1,700.00	14	3.40	189.31	-	-
东方	2022052300006957	宋城	2022	23,840.00	2,000.00	14	3.40	31.52	-	-

证券		演艺	年 05 月 23 日							
东方证券	20220523000069 63	亿联网络	202 2 年 05 月 23 日	146,400.0 0	2,000.00	14	3.4 0	193.57	-	-
东方证券	20220523000069 67	三环集团	202 2 年 05 月 23 日	59,620.00	2,000.00	14	3.4 0	78.83	-	-
东方证券	20220620000014 20	卓胜微	202 2 年 06 月 20 日	419,440.0 0	2,000.00	14	3.4 0	554.59	-	-
东方证券	20220620000014 38	蓝思科技	202 2 年 06 月 20 日	21,820.00	2,000.00	14	3.4 0	28.85	-	-
东方证券	20220620000014 40	中科创达	202 2 年 06 月 20 日	253,240.0 0	2,000.00	14	3.4 0	334.84	-	-
东方证券	20220627000011 82	中科创达	202 2 年 06 月 06 日	276,900.0 0	2,000.00	14	3.4 0	366.12	-	-

			月 27 日							
东方 证券	20220627000011 88	蓝 思 科 技	202 2 年 06 月 27 日	21,420.00	2,000.00	14	3.4 0	28.32	-	-
东方 证券	20220704000008 25	芒 果 超 媒	202 2 年 07 月 04 日	33,000.00	1,000.00	14	3.4 0	43.63	-	-
东方 证券	20220704000008 27	蓝 思 科 技	202 2 年 07 月 04 日	10,960.00	1,000.00	14	3.4 0	14.49	-	-
东方 证券	20220704000008 29	三 环 集 团	202 2 年 07 月 04 日	28,670.00	1,000.00	14	3.4 0	37.91	-	-
东方 证券	20220704000008 31	阳 光 电 源	202 2 年 07 月 04 日	93,340.00	1,000.00	14	3.4 0	123.42	-	-
东方 证券	20220704000008 33	晶 盛 机 电	202 2 年 07 月 04 日	68,750.00	1,000.00	14	3.4 0	90.90	-	-

			日							
东方证券	2022070400000841	亿联网络	2022年07月04日	72,690.00	1,000.00	14	3.40	96.11	-	-
东方证券	2022070400014144	蓝思科技	2022年07月04日	21,920.00	2,000.00	14	3.40	28.98	-	-
东方证券	2022070400014150	中科创达	2022年07月04日	267,220.00	2,000.00	14	3.40	353.32	-	-
东方证券	2022070400016496	卓胜微	2022年07月04日	267,100.00	2,000.00	14	3.40	353.17	-	-
东方证券	2022071100016916	中科创达	2022年07月11日	258,780.00	2,000.00	14	3.40	342.16	-	-
东方证券	2022071100016928	蓝思科技	2022年07月11日	22,440.00	2,000.00	14	3.40	29.67	-	-
东	20220718000144	亿	202	72,500.00	1,000.00	14	3.4	95.86	-	-

方证券	43	联网络	2 年 07 月 18 日				0			
东方证券	20220718000158 59	晶盛机电	202 2 年 07 月 18 日	67,790.00	1,000.00	14	3.4 0	89.63	-	-
东方证券	20220718000158 61	阳光电源	202 2 年 07 月 18 日	126,560.0 0	1,000.00	14	3.4 0	167.34	-	-
东方证券	20220718000158 63	三环集团	202 2 年 07 月 18 日	26,270.00	1,000.00	14	3.4 0	34.73	-	-
东方证券	20220718000158 79	芒果超媒	202 2 年 07 月 18 日	29,900.00	1,000.00	14	3.4 0	39.53	-	-
东方证券	20220718000171 01	蓝思科技	202 2 年 07 月 18 日	10,870.00	1,000.00	14	3.4 0	14.37	-	-
东方证	20220718000171 41	卓胜微	202 2 年	209,360.0 0	2,000.00	14	3.4 0	276.82	-	-

券			07 月 18 日							
东方证 券	20220718000171 49	中 科 创 达	202 2 年 07 月 18 日	276,420.0 0	2,000.00	14	3.4 0	365.49	-	-
东方证 券	20220718000172 37	蓝 思 科 技	202 2 年 07 月 18 日	21,740.00	2,000.00	14	3.4 0	28.75	-	-
东方证 券	20220725000009 53	同 花 顺	202 2 年 07 月 25 日	85,660.00	1,000.00	14	3.4 0	113.26	-	-
东方证 券	20220725000009 68	芒 果 超 媒	202 2 年 07 月 25 日	30,790.00	1,000.00	14	3.4 0	40.71	-	-
东方证 券	20220725000151 46	中 科 创 达	202 2 年 07 月 25 日	272,940.0 0	2,000.00	14	3.4 0	360.89	-	-
东方证 券	20220725000151 70	蓝 思 科 技	202 2 年 07 月	20,640.00	2,000.00	14	3.4 0	27.29	-	-



			25 日							
东方证 券	20220801000125 11	晶盛 机电	202 2年 08月 01日	71,550.00	1,000.00	14	3.4 0	94.61	-	-
东方证 券	20220801000125 49	蓝思 科技	202 2年 08月 01日	11,250.00	1,000.00	14	3.4 0	14.88	-	-
东方证 券	20220801000125 51	蓝思 科技	202 2年 08月 01日	22,500.00	2,000.00	14	3.4 0	29.75	-	-
东方证 券	20220801000125 83	卓胜 微	202 2年 08月 01日	193,580.0 0	2,000.00	14	3.4 0	255.96	-	-
东方证 券	20220801000126 09	芒果 超媒	202 2年 08月 01日	31,630.00	1,000.00	14	3.4 0	41.82	-	-
东方证 券	20220801000126 25	中科 创达	202 2年 08月 01日	297,340.0 0	2,000.00	14	3.4 0	393.15	-	-

东方 证 券	20220801000132 45	阳光 电 源	202 2 年 08 月 01 日	128,040.0 0	1,000.00	14	3.4 0	169.30	-	-
东方 证 券	20220801000132 53	亿 联 网 络	202 2 年 08 月 01 日	75,200.00	1,000.00	14	3.4 0	99.43	-	-
东方 证 券	20220801000132 69	三 环 集 团	202 2 年 08 月 01 日	27,950.00	1,000.00	14	3.4 0	36.96	-	-
东方 证 券	20220808000196 75	芒 果 超 媒	202 2 年 08 月 08 日	31,700.00	1,000.00	14	3.4 0	41.91	-	-
东方 证 券	20220808000196 87	同 花 顺	202 2 年 08 月 08 日	86,440.00	1,000.00	14	3.4 0	114.29	-	-
东方 证 券	20220808000197 27	中 科 创 达	202 2 年 08 月 08 日	288,360.0 0	2,000.00	14	3.4 0	381.28	-	-
东 方	20220808000221 21	蓝 思	202 2	22,120.00	2,000.00	14	3.4 0	29.25	-	-

证券		科技	年 08 月 08 日							
东方 证券	20220815000012 56	卓 胜 微	202 2 年 08 月 15 日	107,800.0 0	1,100.00	14	3.4 0	142.54	-	-
东方 证券	20220815000012 58	欣 旺 达	202 2 年 08 月 15 日	34,254.00	1,100.00	14	3.4 0	45.29	-	-
东方 证券	20220815000181 15	卓 胜 微	202 2 年 08 月 15 日	196,000.0 0	2,000.00	14	3.4 0	259.16	-	-
东方 证券	20220815000193 41	晶 盛 机 电	202 2 年 08 月 15 日	75,720.00	1,000.00	14	3.4 0	100.12	-	-
东方 证券	20220815000193 53	亿 联 网 络	202 2 年 08 月 15 日	74,560.00	1,000.00	14	3.4 0	98.58	-	-
东方 证券	20220815000193 59	中 科 创 达	202 2 年 08 月 08 日	265,580.0 0	2,000.00	14	3.4 0	351.16	-	-

			月 15 日							
东方 证 券	20220815000194 51	阳光 电 源	202 2 年 08 月 15 日	130,980.0 0	1,000.00	14	3.4 0	173.18	-	-
东方 证 券	20220815000194 67	芒 果 超 媒	202 2 年 08 月 15 日	32,010.00	1,000.00	14	3.4 0	42.32	-	-
东方 证 券	20220815000194 69	三 环 集 团	202 2 年 08 月 15 日	28,020.00	1,000.00	14	3.4 0	37.05	-	-
东方 证 券	20220815000194 75	蓝 思 科 技	202 2 年 08 月 15 日	11,390.00	1,000.00	14	3.4 0	15.06	-	-
东方 证 券	20220815000194 77	蓝 思 科 技	202 2 年 08 月 15 日	22,780.00	2,000.00	14	3.4 0	30.12	-	-
东方 证 券	20220822000182 71	同 花 顺	202 2 年 08 月 22	85,100.00	1,000.00	14	3.4 0	112.52	-	-

			日							
东方证券	2022082200018353	中科创达	2022年08月22日	263,780.00	2,000.00	14	3.40	348.78	-	-
东方证券	2022082200018383	芒果超媒	2022年08月22日	29,600.00	1,000.00	14	3.40	39.14	-	-
东方证券	2022082200018389	蓝思科技	2022年08月22日	24,700.00	2,000.00	14	3.40	32.66	-	-
东方证券	2022082900015447	欣旺达	2022年08月29日	32,098.00	1,100.00	14	3.40	45.47	-	-
东方证券	2022082900015735	卓胜微	2022年08月29日	184,560.00	2,000.00	14	3.40	261.46	-	-
东方证券	2022082900017331	卓胜微	2022年08月29日	101,508.00	1,100.00	14	3.40	143.80	-	-
东	20220829000186	阳	202	132,150.0	1,000.00	14	3.4	187.21	-	-

方证券	13	光电源	2 年 08 月 29 日	0			0			
东方证券	20220829000186 43	蓝思科技	202 2 年 08 月 29 日	11,000.00	1,000.00	14	3.4 0	15.58	-	-
东方证券	20220829000186 45	蓝思科技	202 2 年 08 月 29 日	22,000.00	2,000.00	14	3.4 0	31.17	-	-
东方证券	20220829000188 65	中科创达	202 2 年 08 月 29 日	250,260.0 0	2,000.00	14	3.4 0	354.54	-	-
东方证券	20220829000189 05	晶盛机电	202 2 年 08 月 29 日	80,160.00	1,000.00	14	3.4 0	113.56	-	-
东方证券	20220829000189 09	亿联网络	202 2 年 08 月 29 日	70,160.00	1,000.00	14	3.4 0	99.39	-	-
东方证	20220829000189 29	芒果超	202 2 年	27,840.00	1,000.00	14	3.4 0	39.44	-	-

券		媒	08 月 29 日							
东方证 券	20220829000189 31	三环集 团	202 2年 08月 29日	28,790.00	1,000.00	14	3.4 0	40.79	-	-
东方证 券	20220905000210 23	中科创 达	202 2年 09月 05日	240,220.0 0	2,000.00	14	3.4 0	317.62	-	-
东方证 券	20220905000210 91	芒果超 媒	202 2年 09月 05日	27,520.00	1,000.00	14	3.4 0	36.39	-	-
东方证 券	20220905000210 95	蓝思科 技	202 2年 09月 05日	22,040.00	2,000.00	14	3.4 0	29.14	-	-
东方证 券	20220905000211 09	同花顺	202 2年 09月 05日	82,780.00	1,000.00	14	3.4 0	109.45	-	-
东方证 券	20220913000218 91	卓胜微	202 2年 09月	190,200.0 0	2,000.00	14	3.4 0	251.49	-	-

			13 日							
东方证 券	20220913000218 93	蓝思科技	202 2 年 09 月 13 日	10,950.00	1,000.00	14	3.4 0	14.48	-	-
东方证 券	20220913000218 95	蓝思科技	202 2 年 09 月 13 日	21,900.00	2,000.00	14	3.4 0	28.96	-	-
东方证 券	20220913000219 05	中科创 达	202 2 年 09 月 13 日	244,800.0 0	2,000.00	14	3.4 0	323.68	-	-
东方证 券	20220913000219 11	欣旺达	202 2 年 09 月 13 日	29,722.00	1,100.00	14	3.4 0	39.30	-	-
东方证 券	20220913000242 21	卓胜微	202 2 年 09 月 13 日	104,610.0 0	1,100.00	14	3.4 0	138.32	-	-
东方证 券	20220913000288 09	阳光电 源	202 2 年 09 月 13 日	118,360.0 0	1,000.00	14	3.4 0	156.50	-	-



东方 证 券	20220913000288 39	晶 盛 机 电	202 2 年 09 月 13 日	80,590.00	1,000.00	14	3.4 0	106.56	-	-
东方 证 券	20220913000288 43	亿 联 网 络	202 2 年 09 月 13 日	72,930.00	1,000.00	14	3.4 0	96.43	-	-
东方 证 券	20220913000288 67	三 环 集 团	202 2 年 09 月 13 日	27,200.00	1,000.00	14	3.4 0	35.96	-	-
东方 证 券	20220913000288 69	芒 果 超 媒	202 2 年 09 月 13 日	27,400.00	1,000.00	14	3.4 0	36.23	-	-
东方 证 券	20220927000225 85	阳 光 电 源	202 2 年 09 月 27 日	119,000.0 0	1,000.00	14	3.4 0	157.34	-	-
东方 证 券	20220927000225 91	晶 盛 机 电	202 2 年 09 月 27 日	71,160.00	1,000.00	14	3.4 0	94.09	-	-
东方 证 券	20220927000245 63	亿 联	202 2	64,640.00	1,000.00	14	3.4 0	85.47	-	-

证券		网络	年 09 月 27 日							
东方 证券	20220927000246 33	卓 胜 微	202 2 年 09 月 27 日	106,315.0 0	1,100.00	14	3.4 0	140.57	-	-
东方 证券	20220927000246 39	卓 胜 微	202 2 年 09 月 27 日	193,300.0 0	2,000.00	14	3.4 0	255.59	-	-
东方 证券	20220927000246 43	欣 旺 达	202 2 年 09 月 27 日	27,742.00	1,100.00	14	3.4 0	36.68	-	-
东方 证券	20220927000247 09	蓝 思 科 技	202 2 年 09 月 27 日	9,630.00	1,000.00	14	3.4 0	12.73	-	-
东方 证券	20220927000247 11	蓝 思 科 技	202 2 年 09 月 27 日	19,260.00	2,000.00	14	3.4 0	25.47	-	-
东方 证券	20220927000247 17	中 科 创 达	202 2 年 09 月 27 日	224,440.0 0	2,000.00	14	3.4 0	296.76	-	-

			月 27 日							
东方 证券	20220927000288 87	三 环 集 团	202 2 年 09 月 27 日	24,890.00	1,000.00	14	3.4 0	32.91	-	-
东方 证券	20220927000290 55	芒 果 超 媒	202 2 年 09 月 27 日	25,820.00	1,000.00	14	3.4 0	34.14	-	-
东方 证券	20221011000235 39	晶 盛 机 电	202 2 年 10 月 11 日	65,060.00	1,000.00	14	3.4 0	86.02	-	-
东方 证券	20221011000258 23	欣 旺 达	202 2 年 10 月 11 日	25,630.00	1,100.00	14	3.6 0	35.88	-	-
东方 证券	20221011000264 31	阳 光 电 源	202 2 年 10 月 11 日	116,600.0 0	1,000.00	14	3.4 0	154.17	-	-
东方 证券	20221011000264 43	亿 联 网 络	202 2 年 10 月 11 日	61,560.00	1,000.00	14	3.4 0	81.40	-	-

			日							
东方证券	2022101100027567	卓胜微	2022年10月11日	158,800.00	2,000.00	14	3.40	209.97	-	-
东方证券	2022101100027569	卓胜微	2022年10月11日	87,340.00	1,100.00	14	3.40	115.48	-	-
东方证券	2022101100027609	三环集团	2022年10月11日	25,420.00	1,000.00	14	3.40	33.61	-	-
东方证券	2022101100027611	芒果超媒	2022年10月11日	23,680.00	1,000.00	14	3.40	31.31	-	-
东方证券	2022101100027613	蓝思科技	2022年10月11日	18,320.00	2,000.00	14	3.40	24.22	-	-
东方证券	2022101100027615	蓝思科技	2022年10月11日	9,160.00	1,000.00	14	3.40	12.11	-	-
东	20221011000276	中	202	210,100.0	2,000.00	14	3.4	277.80	-	-

方证券	97	科创达	2 年 10 月 11 日	0			0			
东方证券	2022102500022538	欣旺达	202 2 年 10 月 25 日	26,961.00	1,100.00	14	3.6 0	37.75	-	-
东方证券	2022102500023194	卓胜微	202 2 年 10 月 25 日	91,212.00	1,100.00	14	3.4 0	120.60	-	-
东方证券	2022102500023232	三环集团	202 2 年 10 月 25 日	26,890.00	1,000.00	14	3.4 0	35.55	-	-
东方证券	2022102500023866	晶盛机电	202 2 年 10 月 25 日	70,180.00	1,000.00	14	3.4 0	92.79	-	-
东方证券	2022102500026454	卓胜微	202 2 年 10 月 25 日	165,840.0 0	2,000.00	14	3.4 0	219.28	-	-
东方证	2022102500026600	亿联网	202 2 年	65,550.00	1,000.00	14	3.4 0	86.67	-	-

券		络	10 月 25 日							
东方证 券	20221025000290 44	芒果超 媒	202 2 年 10 月 25 日	20,840.00	1,000.00	14	3.4 0	27.56	-	-
东方证 券	20221025000293 12	阳光电 源	202 2 年 10 月 25 日	129,660.0 0	1,000.00	14	3.4 0	171.44	-	-
东方证 券	20221025000293 58	中科创 达	202 2 年 10 月 25 日	198,700.0 0	2,000.00	14	3.4 0	262.73	-	-
东方证 券	20221025000293 98	蓝思科 技	202 2 年 10 月 25 日	18,740.00	2,000.00	14	3.4 0	24.78	-	-
东方证 券	20221025000294 14	蓝思科 技	202 2 年 10 月 25 日	9,370.00	1,000.00	14	3.4 0	12.39	-	-
东方证 券	20221108000225 61	欣旺达	202 2 年 11 月	28,413.00	1,100.00	14	3.7 0	40.88	-	-

			08 日							
东方证 券	20221108000238 89	卓胜 微	202 2年 11月 08日	204,600.0 0	2,000.00	14	3.4 0	270.53	-	-
东方证 券	20221108000239 21	亿联 网络	202 2年 11月 08日	68,150.00	1,000.00	14	3.4 0	90.11	-	-
东方证 券	20221108000240 03	阳光 电源	202 2年 11月 08日	128,900.0 0	1,000.00	14	3.4 0	170.43	-	-
东方证 券	20221108000257 15	芒果 超媒	202 2年 11月 08日	25,080.00	1,000.00	14	3.4 0	33.16	-	-
东方证 券	20221108000297 73	卓胜 微	202 2年 11月 08日	112,530.0 0	1,100.00	14	3.4 0	148.79	-	-
东方证 券	20221108000298 19	中科 创达	202 2年 11月 08日	236,000.0 0	2,000.00	14	3.4 0	312.04	-	-

东方 证券	20221108000303 07	晶 盛 机 电	202 2 年 11 月 08 日	75,480.00	1,000.00	14	3.4 0	99.80	-	-
东方 证券	20221108000305 53	三 环 集 团	202 2 年 11 月 08 日	29,310.00	1,000.00	14	3.4 0	38.75	-	-
东方 证券	20221108000306 31	蓝 思 科 技	202 2 年 11 月 08 日	20,400.00	2,000.00	14	3.4 0	26.97	-	-
东方 证券	20221108000306 33	蓝 思 科 技	202 2 年 11 月 08 日	10,200.00	1,000.00	14	3.4 0	13.49	-	-
东方 证券	20221114000009 37	中 国 通 号	202 2 年 11 月 14 日	69,616.00	15,200.0 0	14	3.4 0	92.05	-	-
东方 证券	20221114000009 41	沪 硅 产 业 - U	202 2 年 11 月 14 日	88,660.00	4,400.00	14	3.4 0	117.23	-	-
东方	20221122000169 89	卓 胜	202 2	234,700.0 0	2,000.00	14	3.4 0	310.33	-	-



证券		微	年 11 月 22 日							
东方证券	20221122000170 23	晶盛机电	202 2 年 11 月 22 日	66,400.00	1,000.00	14	3.4 0	87.80	-	-
东方证券	20221122000170 81	欣旺达	202 2 年 11 月 22 日	26,664.00	1,100.00	14	3.7 0	38.37	-	-
东方证券	20221122000183 51	蓝思科技	202 2 年 11 月 22 日	10,510.00	1,000.00	14	3.4 0	13.90	-	-
东方证券	20221122000183 53	蓝思科技	202 2 年 11 月 22 日	21,020.00	2,000.00	14	3.4 0	27.79	-	-
东方证券	20221122000183 77	阳光电源	202 2 年 11 月 22 日	110,880.0 0	1,000.00	14	3.4 0	146.61	-	-
东方证券	20221122000193 59	亿联网络	202 2 年 11	66,960.00	1,000.00	14	3.4 0	88.54	-	-

			月 22 日							
东方 证券	20221122000193 91	三环 集团	202 2 年 11 月 22 日	29,920.00	1,000.00	14	3.4 0	39.56	-	-
东方 证券	20221122000194 89	芒果 超媒	202 2 年 11 月 22 日	25,280.00	1,000.00	14	3.4 0	33.43	-	-
东方 证券	20221122000210 63	卓胜 微	202 2 年 11 月 22 日	129,085.0 0	1,100.00	14	3.4 0	170.68	-	-
东方 证券	20221122000210 85	中科 创达	202 2 年 11 月 22 日	243,800.0 0	2,000.00	14	3.4 0	322.36	-	-
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日										
关联 方名 称	合约 编号	证券 名称	成 交 时 间	交 易 金 额	交 易 数 量 (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
东 方	20210119000003 90	蓝 思	202 1	623,714.0 0	16,100.0 0	14	5.0 0	1,212.7 8	-	-

证券		科技	年 01 月 19 日							
东方证 券	20210119000003 94	晶盛 机电	202 1年 01 月 19 日	311,840.0 0	8,000.00	14	5.0 0	606.36	-	-
东方证 券	20210202000090 95	晶盛 机电	202 1年 02 月 02 日	340,800.0 0	8,000.00	28	5.0 0	757.33	-	-
东方证 券	20210218000424 50	晶盛 机电	202 1年 02 月 18 日	346,800.0 0	8,000.00	42	5.0 0	674.33	-	-

#### 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： 本基金的基金管理人本报告期及上年度可比期间均未运用自有资金投资本基金。

##### 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 (%)
东方证券 股份有限 公司	4,421,869.00	0.25	5,560,700.00	0.35
汇添富中	48,610,000.00	2.78	3,085,000.00	0.19

证 800 交易型开放式指数证券投资基金联接基金				
--------------------------	--	--	--	--

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用符合基金招募说明书和相关公告的规定。

#### 7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
平安银行	48,997,016.89	212,430.34	54,246,161.68	266,392.89

#### 7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	600958	东方证券	原股东优先配售	79,744.00	674,634.24
上年度可比期间 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股）	总金额
东方证券承销保荐有限公司	002142	宁波银行	原股东优先配售	26,070.00	520,617.90

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金根据基金合同和招募说明书约定的投资策略，按照标的指数的成份股及其权重，构建基金的股票投资组合。经基金管理人董事会和基金托管人审核同意，投资于基金管理

人的股东东方证券发行的股票东方证券，和基金托管人平安银行发行的股票平安银行。于本报告期末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 375,544.00 股，持有平安银行 696,867.00 股。（于上年度末，本基金按照指数权重比例持有东方证券 289,200.00 股，持有平安银行 671,767.00 股。）

#### 7.4.11 利润分配情况

注：本基金本报告期末进行利润分配。于资产负债表日之后、财务报表批准日之前批准、公告或实施的利润分配情况详见资产负债表日后事项章节。

#### 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
301139	元道通信	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	38.46	25.31	566	21,768.36	14,325.46	
301165	锐捷网络	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	32.38	31.61	1,077	34,873.26	34,043.97	
301175	中科环保	2022年06月30日	6个月	新股流通受限	3.82	6.01	6,370	24,333.40	38,283.70	
301197	工大科雅	2022年07月	6个月	新股流通	25.50	20.08	380	9,690.00	7,630.40	

		29日		受限						
301227	森鹰窗业	2022年09月16日	6个月	新股流通受限	38.25	29.49	284	10,863.00	8,375.16	
301231	荣信文化	2022年08月31日	6个月	新股流通受限	25.49	20.38	275	7,009.75	5,604.50	
301265	华新环保	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	13.28	11.40	819	10,876.32	9,336.60	
301267	华夏眼科	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	50.88	66.20	1,006	51,185.28	66,597.20	
301277	新天地	2022年11月09日	6个月	新股流通受限	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	
301280	珠城科技	2022年12月19日	6个月	新股流通受限	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	
301283	聚胶股份	2022年08月26日	6个月	新股流通受限	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	

301285	鸿日达	2022年09月21日	6个月	新股流通受限	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00
301290	东星医疗	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90
301300	远翔新材	2022年08月09日	6个月	新股流通受限	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07
301301	川宁生物	2022年12月20日	6个月	新股流通受限	5.00	7.53	3,574	17,870.00	26,912.22
301306	西测测试	2022年07月19日	6个月	新股流通受限	43.23	42.29	255	11,023.65	10,783.95
301309	万得凯	2022年09月08日	6个月	新股流通受限	39.00	24.46	228	8,892.00	5,576.88
301311	昆船智能	2022年11月23日	6个月	新股流通受限	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52
301313	凡拓	2022年	6个月	新股	25.25	29.14	247	6,236.75	7,197.58

	数创	09月22日	月	流通受限						
301316	慧博云通	2022年09月29日	6个月	新股流通受限	7.60	14.32	359	2,728.40	5,140.88	
301319	唯特偶	2022年09月22日	6个月	新股流通受限	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	
301327	华宝新能	2022年09月08日	6个月	新股流通受限	237.50	176.97	242	57,475.00	42,826.74	
301335	天元宠物	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	
301338	凯格精机	2022年08月08日	6个月	新股流通受限	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	
301339	通行宝	2022年09月02日	6个月	新股流通受限	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	
301349	信德新材	2022年08月	6个月	新股流通	138.88	103.52	180	24,998.40	18,633.60	



		30日		受限						
301356	天振股份	2022年11月03日	6个月	新股流通受限	63.00	43.33	614	38,682.00	26,604.62	
301363	美好医疗	2022年09月28日	6个月	新股流通受限	30.66	37.85	445	13,643.70	16,843.25	
301365	矩阵股份	2022年11月14日	6个月	新股流通受限	34.72	23.87	516	17,915.52	12,316.92	
301366	一博科技	2022年09月19日	6个月	新股流通受限	65.35	45.09	268	17,513.80	12,084.12	
301367	怡和嘉业	2022年10月21日	6个月	新股流通受限	119.88	175.78	223	26,733.24	39,198.94	
301368	丰立智能	2022年12月07日	6个月	新股流通受限	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	
301377	鼎泰高科	2022年11月11日	6个月	新股流通受限	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	

301379	天山电子	2022年10月19日	6个月	新股流通受限	31.51	24.63	449	14,147.99	11,058.87
301388	欣灵电气	2022年10月26日	6个月	新股流通受限	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20
301389	隆扬电子	2022年10月18日	6个月	新股流通受限	22.50	17.16	1,269	28,552.50	21,776.04
301391	卡莱特	2022年11月24日	6个月	新股流通受限	96.00	80.97	247	23,712.00	19,999.59
301396	宏景科技	2022年11月04日	6个月	新股流通受限	40.13	31.90	396	15,891.48	12,632.40
301398	星源卓镁	2022年12月08日	6个月	新股流通受限	34.40	28.94	255	8,772.00	7,379.70
688084	晶品特装	2022年12月01日	6个月	新股流通受限	60.98	74.73	1,875	114,337.50	140,118.75
688137	近岸	2022年	6个月	新股	106.19	69.50	2,588	274,819.72	179,866.00

	蛋白	09月22日	月	流通受限						
688292	浩瀚深度信息技术	2022年08月09日	6个月	新股流通受限	16.56	14.67	4,503	74,569.68	66,059.01	
688506	百利天恒	2022年12月28日	6个交易日	新股流通受限	24.70	24.70	15,622	385,863.40	385,863.40	

## 7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

## 7.4.12.1.3 受限证券类别：资产支持证券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
					-	-	-	-	-	

## 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300850	新强	2022年	重大	53.28	2023年	56.88	14,800	890,077.00	788,544.00	

	联	12月30日	事项停牌		01月10日					
600038	中直股份	2022年12月26日	重大事项停牌	46.41	2023年01月10日	51.05	21,500	1,047,410.22	997,815.00	

#### 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：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事银行间市场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

注：截至本报告期末 2022 年 12 月 31 日止，本基金无因从事交易所市场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：张）	期末估值总额
1	002180	纳思达	2023年01月09日	- 2023年01月09日	51.89	10,000	518,900.00
2	000063	中兴通讯	2023年01月03日	- 2023年01月09日	25.86	20,000	517,200.00
3	601615	明阳智能	2023年01月03日	- 2023年01月09日	25.26	20,000	505,200.00
4	600111	北方稀土	2023年01月03日	- 2023年01月09日	25.05	20,000	501,000.00
5	601601	中国	2023	- 2023	24.52	20,000	490,400.00

		太保	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
6	600690	海尔 智家	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	24.46	20,000	489,200.00
7	600406	国电 南瑞	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	24.40	20,000	488,000.00
8	600588	用友 网络	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	24.17	20,000	483,400.00
9	000792	盐湖 股份	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	22.69	20,000	453,800.00
10	600150	中国 船舶	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	22.28	20,000	445,600.00
11	002050	三花 智控	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.22	20,000	424,400.00
12	600900	长江 电力	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.00	20,000	420,000.00
13	600233	圆通 速递	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	20.09	20,000	401,800.00
14	600089	特变 电工	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	20.08	20,000	401,600.00
15	000938	紫光 股份	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	19.51	20,000	390,200.00
16	600547	山东	2023	- 2023	19.16	20,000	383,200.00

		黄金	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
17	002001	新和成	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	18.75	20,000	375,000.00
18	601225	陕西煤业	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	18.58	20,000	371,600.00
19	000002	万科 A	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	18.20	20,000	364,000.00
20	601166	兴业银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	17.59	20,000	351,800.00
21	300498	温氏股份	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	19.63	17,800	349,414.00
22	600741	华域汽车	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	17.33	20,000	346,600.00
23	600011	华能国际	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.61	45,200	343,972.00
24	002625	光启技术	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	17.02	20,000	340,400.00
25	002241	歌尔股份	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	16.83	20,000	336,600.00
26	600795	国电电力	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.27	78,600	335,622.00
27	300012	华测	2023	- 2023	22.30	15,000	334,500.00

		检测	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
28	600885	宏发 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	33.41	10,000	334,100.00
29	601658	邮储 银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.62	72,200	333,564.00
30	002407	多氟 多	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	33.32	10,000	333,200.00
31	600886	国投 电力	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.83	30,600	331,398.00
32	601838	成都 银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.30	21,600	330,480.00
33	600029	南方 航空	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.60	43,400	329,840.00
34	601058	赛轮 轮胎	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.02	32,800	328,656.00
35	002648	卫星 化学	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.50	21,200	328,600.00
36	002966	苏州 银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.78	42,200	328,316.00
37	601398	工商 银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.34	75,600	328,104.00
38	002027	分众	2023	- 2023	6.68	49,000	327,320.00

		传媒	年 01 月 03 日		年 01 月 09 日			
39	601009	南京 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.42	31,400	327,188.00
40	300003	乐普 医疗	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	22.97	14,200	326,174.00
41	601288	农业 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.91	112,000	325,920.00
42	601939	建设 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.63	57,800	325,414.00
43	601988	中国 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.16	102,800	324,848.00
44	600905	三峡 能源	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.65	57,400	324,310.00
45	601328	交通 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.74	68,000	322,320.00
46	601818	光大 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.07	104,600	321,122.00
47	000001	平安 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.16	24,400	321,104.00
48	600115	中国 东航	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.53	58,000	320,740.00
49	600000	浦发	2023	-	2023	7.28	44,000	320,320.00



		银行	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
50	600031	三一重工	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.80	20,200	319,160.00
51	600926	杭州银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	13.08	24,400	319,152.00
52	601169	北京银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.31	74,000	318,940.00
53	601816	京沪高铁	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.92	64,800	318,816.00
54	600489	中金黄金	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.19	38,900	318,591.00
55	601138	工业富联	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	9.18	34,600	317,628.00
56	601006	大秦铁路	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.68	47,400	316,632.00
57	600958	东方证券	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.94	35,400	316,476.00
58	600919	江苏银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.29	43,400	316,386.00
59	688063	派能科技	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	315.65	1,000	315,650.00
60	002385	大北	2023	- 2023	8.90	35,400	315,060.00

		农	年 01 月 03 日	-	年 01 月 09 日			
61	600352	浙江 龙盛	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.90	31,800	314,820.00
62	600016	民生 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.45	91,200	314,640.00
63	601229	上海 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.91	53,200	314,412.00
64	300059	东方 财富	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	19.40	16,200	314,280.00
65	601857	中国 石油	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.97	63,200	314,104.00
66	601899	紫金 矿业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.00	31,400	314,000.00
67	600999	招商 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.30	23,600	313,880.00
68	601111	中国 国航	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.60	29,600	313,760.00
69	600015	华夏 银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.19	60,400	313,476.00
70	601688	华泰 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.74	24,600	313,404.00
71	600028	中国	2023	-	2023	4.36	71,800	313,048.00

		石化	年 01 月 03 日		年 01 月 09 日			
72	600019	宝钢 股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.59	56,000	313,040.00
73	002736	国信 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.88	35,200	312,576.00
74	601728	中国 电信	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.19	74,600	312,574.00
75	002202	金风 科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.00	28,400	312,400.00
76	600010	包钢 股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.92	162,600	312,192.00
77	000166	申万 宏源	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.98	78,400	312,032.00
78	601766	中国 中车	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.11	61,000	311,710.00
79	600837	海通 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.69	35,800	311,102.00
80	600765	中航 重机	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	31.09	10,000	310,900.00
81	600346	恒力 石化	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.53	20,000	310,600.00
82	300146	汤臣	2023	-	2023	22.82	13,600	310,352.00

		倍健	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日				
83	601211	国泰君安	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.59	22,800	309,852.00
84	000876	新希望	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.91	24,000	309,840.00
85	000776	广发证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.49	20,000	309,800.00
86	601985	中国核电	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.00	51,600	309,600.00
87	601555	东吴证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.53	47,400	309,522.00
88	601233	桐昆股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.45	21,400	309,230.00
89	000807	云铝股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.12	27,800	309,136.00
90	600048	保利发展	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.13	20,400	308,652.00
91	603993	洛阳钼业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.55	67,800	308,490.00
92	600104	上汽集团	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.41	21,400	308,374.00
93	000425	徐工	2023	-	2023	5.07	60,800	308,256.00

		机械	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
94	600487	亨通 光电	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.06	20,400	307,224.00
95	600157	永泰 能源	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	1.53	200,600	306,918.00
96	300144	宋城 演艺	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	14.60	21,000	306,600.00
97	601108	财通 证券	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.12	43,000	306,160.00
98	000100	TCL 科技	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.72	82,200	305,784.00
99	601989	中国 重工	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.49	87,600	305,724.00
100	000338	潍柴 动力	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.18	30,000	305,400.00
101	601377	兴业 证券	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.74	53,200	305,368.00
102	000301	东方 盛虹	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	13.04	23,400	305,136.00
103	601901	方正 证券	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.38	47,800	304,964.00
104	000725	京东	2023	- 2023	3.38	90,200	304,876.00

		方 A	年 01 月 03 日	-	年 01 月 09 日			
105	002340	格林美	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.43	41,000	304,630.00
106	600176	中国巨石	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.71	22,200	304,362.00
107	601788	光大证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.87	20,400	303,348.00
108	601600	中国铝业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.47	67,800	303,066.00
109	601669	中国电建	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.08	42,800	303,024.00
110	002493	荣盛石化	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.30	24,600	302,580.00
111	600399	抚顺特钢	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.31	21,100	301,941.00
112	000723	美锦能源	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.02	33,400	301,268.00
113	000157	中联重科	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.44	55,200	300,288.00
114	601868	中国能建	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.29	131,000	299,990.00
115	002603	以岭	2023	-	2023	29.96	10,000	299,600.00

		药业	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
116	601668	中国建筑	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.43	55,000	298,650.00
117	600418	江淮汽车	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	13.13	22,600	296,738.00
118	600219	南山铝业	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.27	90,300	295,281.00
119	300285	国瓷材料	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	27.57	10,700	294,999.00
120	601238	广汽集团	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.03	26,600	293,398.00
121	601077	渝农商行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.53	82,900	292,637.00
122	600383	金地集团	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.23	28,600	292,578.00
123	601390	中国中铁	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.56	52,600	292,456.00
124	601117	中国化学	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.94	36,800	292,192.00
125	601618	中国中冶	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.18	91,800	291,924.00
126	600873	梅花	2023	- 2023	10.18	28,500	290,130.00

		生物	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日			
127	600141	兴发集团	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	29.00	10,000	290,000.00
128	000625	长安汽车	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.31	23,400	288,054.00
129	000009	中国宝安	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.09	23,800	287,742.00
130	600050	中国联通	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.48	63,800	285,824.00
131	002185	华天科技	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.29	34,300	284,347.00
132	601186	中国铁建	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.73	36,600	282,918.00
133	601800	中国交建	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.05	35,000	281,750.00
134	600859	王府井	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	28.14	10,000	281,400.00
135	000069	华侨城 A	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.33	52,700	280,891.00
136	300568	星源材质	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.26	13,200	280,632.00
137	600989	宝丰	2023	- 2023	12.07	23,200	280,024.00



		能源	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日				
138	300207	欣旺达	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.15	13,200	279,180.00
139	601128	常熟银行	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.55	36,700	277,085.00
140	000783	长江证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.33	51,800	276,094.00
141	000629	钒钛股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.73	57,600	272,448.00
142	003816	中国广核	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.69	101,200	272,228.00
143	300433	蓝思科技	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.53	25,600	269,568.00
144	601162	天风证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.87	92,900	266,623.00
145	000683	远兴能源	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.84	34,000	266,560.00
146	002422	科伦药业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	26.61	10,000	266,100.00
147	002236	大华股份	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.31	23,400	264,654.00
148	002138	顺络	2023	-	2023	26.18	10,000	261,800.00

		电子	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
149	000932	华菱 钢铁	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.70	55,500	260,850.00
150	600109	国金 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.70	29,900	260,130.00
151	601168	西部 矿业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.20	25,500	260,100.00
152	000895	双汇 发展	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	25.93	10,000	259,300.00
153	000786	北新 建材	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	25.88	10,000	258,800.00
154	600027	华电 国际	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.88	43,700	256,956.00
155	002008	大族 激光	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	25.65	10,000	256,500.00
156	002602	世纪 华通	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.81	67,100	255,651.00
157	000768	中航 西飞	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	25.45	10,000	254,500.00
158	002797	第一 创业	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.63	45,000	253,350.00
159	601919	中远	2023	-	2023	10.29	24,600	253,134.00

		海控	年 01 月 03 日	年 01 月 09 日				
160	603077	和邦 生物	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.04	82,800	251,712.00	
161	002384	东山 精密	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	24.73	10,000	247,300.00	
162	601872	招商 轮船	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.59	43,500	243,165.00	
163	600497	驰宏 锌锗	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.06	47,700	241,362.00	
164	002532	天山 铝业	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.72	31,100	240,092.00	
165	601360	三六 零	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.54	36,700	240,018.00	
166	600079	人福 医药	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	23.89	10,000	238,900.00	
167	600161	天坛 生物	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	23.73	10,000	237,300.00	
168	300253	卫宁 健康	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.28	23,000	236,440.00	
169	600177	雅戈 尔	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.33	37,200	235,476.00	
170	601990	南京	2023	- 2023	7.93	29,600	234,728.00	

		证券	年 01 月 03 日		年 01 月 09 日			
171	600705	中航 产融	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.28	71,000	232,880.00
172	002497	雅化 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	23.25	10,000	232,500.00
173	600584	长电 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	23.05	10,000	230,500.00
174	300769	德方 纳米	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	229.59	1,000	229,590.00
175	600918	中泰 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.41	35,800	229,478.00
176	002007	华兰 生物	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	22.63	10,000	226,300.00
177	600862	中航 高科	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	22.29	10,000	222,900.00
178	000728	国元 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.33	35,000	221,550.00
179	603019	中科 曙光	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	22.14	10,000	221,400.00
180	002673	西部 证券	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.09	35,900	218,631.00
181	600521	华海	2023	-	2023	21.86	10,000	218,600.00

		药业	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
182	601997	贵阳 银行	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.49	39,200	215,208.00
183	000977	浪潮 信息	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.52	10,000	215,200.00
184	601319	中国 人保	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.22	41,100	214,542.00
185	600096	云天 化	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.04	10,000	210,400.00
186	601155	新城 控股	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	20.50	10,000	205,000.00
187	600704	物产 中大	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.81	41,800	201,058.00
188	300088	长信 科技	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.97	32,900	196,413.00
189	000519	中兵 红箭	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	19.64	10,000	196,400.00
190	600549	厦门 钨业	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	19.55	10,000	195,500.00
191	002601	龙佰 集团	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	18.92	10,000	189,200.00
192	002056	横店	2023	- 2023	18.74	10,000	187,400.00

		东磁	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
193	600170	上海 建工	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.60	71,600	186,160.00
194	300413	芒果 超媒	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	30.02	6,100	183,122.00
195	600884	杉杉 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	18.20	10,000	182,000.00
196	002555	三七 互娱	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	18.10	10,000	181,000.00
197	600988	赤峰 黄金	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	18.05	10,000	180,500.00
198	002252	上海 莱士	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.34	28,400	180,056.00
199	601636	旗滨 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.39	15,800	179,962.00
200	601607	上海 医药	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	17.83	10,000	178,300.00
201	300357	我武 生物	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	55.10	3,200	176,320.00
202	300832	新产 业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	50.14	3,500	175,490.00
203	600362	江西	2023	-	2023	17.43	10,000	174,300.00

		铜业	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
204	002092	中泰 化学	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.46	23,200	173,072.00
205	000708	中信 特钢	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	17.16	10,000	171,600.00
206	600674	川投 能源	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.23	13,900	169,997.00
207	002078	太阳 纸业	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.52	14,700	169,344.00
208	601699	潞安 环能	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	16.85	10,000	168,500.00
209	002531	天顺 风能	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.13	11,000	166,430.00
210	300699	光威 复材	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	72.25	2,300	166,175.00
211	300017	网宿 科技	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.58	29,600	165,168.00
212	000960	锡业 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	14.10	11,700	164,970.00
213	002156	通富 微电	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	16.48	10,000	164,800.00
214	600879	航天	2023	- 2023	6.80	24,200	164,560.00

		电子	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
215	600166	福田 汽车	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.81	58,500	164,385.00
216	688009	中国 通号	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.79	34,300	164,297.00
217	300418	昆仑 万维	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.41	11,400	164,274.00
218	000988	华工 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	16.41	10,000	164,100.00
219	000970	中科 三环	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.64	12,000	163,680.00
220	688777	中控 技术	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	90.83	1,800	163,494.00
221	002152	广电 运通	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.94	16,400	163,016.00
222	000027	深圳 能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.36	25,600	162,816.00
223	000998	隆平 高科	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	16.07	10,100	162,307.00
224	000591	太阳 能	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.33	22,100	161,993.00
225	600803	新奥	2023	-	2023	16.10	10,000	161,000.00



		股份	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
226	688122	西部 超导	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	94.69	1,700	160,973.00
227	600637	东方 明珠	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.65	24,200	160,930.00
228	300037	新宙 邦	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	43.47	3,700	160,839.00
229	000729	燕京 啤酒	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.62	15,100	160,362.00
230	600039	四川 路桥	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.12	14,400	160,128.00
231	600183	生益 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.41	11,100	159,951.00
232	601998	中信 银行	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.98	32,100	159,858.00
233	600372	中航 电子	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.97	10,000	159,700.00
234	300724	捷佳 伟创	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	114.02	1,400	159,628.00
235	002120	韵达 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.38	11,100	159,618.00
236	300363	博腾	2023	-	2023	40.85	3,900	159,315.00

		股份	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
237	002273	水晶 光电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.79	13,500	159,165.00
238	600655	豫园 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.61	20,900	159,049.00
239	600867	通化 东宝	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.18	17,300	158,814.00
240	000636	风华 高科	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.83	10,700	158,681.00
241	600642	申能 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.49	28,900	158,661.00
242	601880	辽港 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.62	97,900	158,598.00
243	300244	迪安 诊断	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	25.13	6,300	158,319.00
244	600008	首创 环保	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.83	55,800	157,914.00
245	300373	扬杰 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	52.60	3,000	157,800.00
246	300558	贝达 药业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	49.27	3,200	157,664.00
247	002183	怡亚	2023	-	2023	6.43	24,500	157,535.00

		通	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
248	601577	长沙 银行	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.76	23,300	157,508.00
249	300136	信维 通信	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	16.51	9,500	156,845.00
250	300308	中际 旭创	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	27.03	5,800	156,774.00
251	600820	隧道 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.27	29,700	156,519.00
252	600673	东阳 光	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.69	18,000	156,420.00
253	002414	高德 红外	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.00	14,200	156,200.00
254	688002	睿创 微纳	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	37.19	4,200	156,198.00
255	600699	均胜 电子	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	14.05	11,100	155,955.00
256	002212	天融 信	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	9.99	15,600	155,844.00
257	002030	达安 基因	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.56	10,000	155,600.00
258	000039	中集	2023	- 2023	7.04	22,100	155,584.00

		集团	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
259	000750	国海 证券	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.33	46,700	155,511.00	
260	600018	上港 集团	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.34	29,100	155,394.00	
261	000703	恒逸 石化	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.03	22,100	155,363.00	
262	002195	二三 四五	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.01	77,200	155,172.00	
263	600160	巨化 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.51	10,000	155,100.00	
264	000878	云南 铜业	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.75	13,200	155,100.00	
265	002465	海格 通信	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.12	19,100	155,092.00	
266	300058	蓝色 光标	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.05	30,700	155,035.00	
267	002408	齐翔 腾达	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.04	22,000	154,880.00	
268	300296	利亚 德	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.66	27,300	154,518.00	
269	601456	国联	2023	- 2023	11.25	13,700	154,125.00	

		证券	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
270	600392	盛和 资源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.00	11,000	154,000.00
271	002936	郑州 银行	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.35	65,500	153,925.00
272	002131	利欧 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.77	86,900	153,813.00
273	600025	华能 水电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.60	23,300	153,780.00
274	600848	上海 临港	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.92	12,900	153,768.00
275	002500	山西 证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.30	29,000	153,700.00
276	601198	东兴 证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.72	19,900	153,628.00
277	688385	复旦 微电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	69.81	2,200	153,582.00
278	600863	内蒙 华电	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.49	44,000	153,560.00
279	000887	中鼎 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.47	10,600	153,382.00
280	300070	碧水	2023	-	2023	4.73	32,400	153,252.00

		源	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
281	600516	方大炭素	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.12	25,000	153,000.00
282	600482	中国动力	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.29	10,000	152,900.00
283	688187	时代电气	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	54.57	2,800	152,796.00
284	300474	景嘉微	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	54.57	2,800	152,796.00
285	601016	节能风电	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	3.81	40,100	152,781.00
286	002739	万达电影	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.00	10,900	152,600.00
287	002600	领益智造	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.54	33,600	152,544.00
288	600380	健康元	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.29	13,500	152,415.00
289	601696	中银证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.57	14,400	152,208.00
290	600021	上海电力	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.01	15,200	152,152.00
291	600061	国投	2023	-	2023	6.39	23,800	152,082.00

		资本	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
292	601878	浙商 证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.93	15,300	151,929.00
293	601216	君正 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.99	38,000	151,620.00
294	600909	华安 证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.59	33,000	151,470.00
295	002958	青农 商行	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.89	52,400	151,436.00
296	002203	海亮 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.30	13,400	151,420.00
297	600390	五矿 资本	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.08	29,800	151,384.00
298	600369	西南 证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.75	40,300	151,125.00
299	600739	辽宁 成大	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.59	12,000	151,080.00
300	600985	淮北 矿业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.80	11,800	151,040.00
301	002064	华峰 化学	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.80	22,200	150,960.00
302	600499	科达	2023	-	2023	14.21	10,600	150,626.00

		制造	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
303	688538	和辉 光电	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.68	56,200	150,616.00
304	601881	中国 银河	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	9.29	16,200	150,498.00
305	601958	金铂 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.55	13,000	150,150.00
306	600153	建发 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	13.65	11,000	150,150.00
307	300383	光环 新网	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.16	18,400	150,144.00
308	002624	完美 世界	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.72	11,800	150,096.00
309	601898	中煤 能源	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.62	17,400	149,988.00
310	300024	机器 人	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.98	16,700	149,966.00
311	000830	鲁西 化工	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.39	12,100	149,919.00
312	600271	航天 信息	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.41	14,400	149,904.00
313	300676	华大	2023	- 2023	51.69	2,900	149,901.00



		基因	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
314	000623	吉林敖东	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.99	10,000	149,900.00
315	002926	华西证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.53	19,900	149,847.00
316	300001	特锐德	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	15.21	9,800	149,058.00
317	002065	东华软件	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.66	26,300	148,858.00
318	600998	九州通	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.04	11,400	148,656.00
319	002506	协鑫集成	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.91	50,900	148,119.00
320	688099	晶晨半导体	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	70.51	2,100	148,071.00
321	300009	安科生物	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.36	15,800	147,888.00
322	000547	航天发展	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.39	15,700	147,423.00
323	600208	新湖中宝	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.54	58,000	147,320.00
324	600435	北方	2023	-	2023	11.60	12,700	147,320.00

		导航	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
325	600580	卧龙 电驱	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.46	11,800	147,028.00
326	600026	中远 海能	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.05	12,200	147,010.00
327	600606	绿地 控股	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.98	49,200	146,616.00
328	002155	湖南 黄金	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	12.95	11,300	146,335.00
329	600143	金发 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.69	15,100	146,319.00
330	688567	孚能 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	27.03	5,400	145,962.00
331	002511	中顺 洁柔	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.74	10,600	145,644.00
332	688521	芯原 电子	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	44.07	3,300	145,431.00
333	300390	天华 超净	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	55.88	2,600	145,288.00
334	600415	小商 品城	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.24	27,700	145,148.00
335	600325	华发	2023	-	2023	9.06	16,000	144,960.00

		股份	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
336	600546	山煤 国际	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.49	10,000	144,900.00
337	601666	平煤 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.81	13,400	144,854.00
338	000060	中金 岭南	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.10	35,300	144,730.00
339	000997	新大 陆	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.01	11,100	144,411.00
340	688126	上海 硅产 业集 团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	17.61	8,200	144,402.00
341	002244	滨江 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.83	16,200	143,046.00
342	688303	大全 能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	47.68	3,000	143,040.00
343	601005	重庆 钢铁	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.58	90,500	142,990.00
344	000050	深天 马 A	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.66	16,500	142,890.00
345	300595	欧普 康视	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	35.70	4,000	142,800.00
346	600755	厦门	2023	-	2023	7.14	20,000	142,800.00

		国贸	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
347	601992	金隅集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.54	56,200	142,748.00
348	300604	长川科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	44.58	3,200	142,656.00
349	600348	华阳股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.25	10,000	142,500.00
350	600060	海信视像	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	13.54	10,500	142,170.00
351	688779	长远锂科	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	14.59	9,700	141,523.00
352	300073	当升科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	56.40	2,500	141,000.00
353	300026	红日药业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.68	24,700	140,296.00
354	001979	招商蛇口	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	12.63	11,100	140,193.00
355	300850	新强联	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	53.28	2,600	138,528.00
356	601717	郑煤机	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	11.16	12,400	138,384.00
357	600528	中铁	2023	-	2023	7.63	18,000	137,340.00

		工业	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
358	000975	银泰黄金	2023 年 01 月 03 日	-	2023 年 01 月 03 日	11.04	12,400	136,896.00
359	300251	光线传媒	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.66	15,800	136,828.00
360	688256	寒武纪科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	54.56	2,500	136,400.00
361	300682	朗新科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.98	6,200	136,276.00
362	600201	生物股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.01	15,100	136,051.00
363	002939	长城证券	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.28	16,300	134,964.00
364	300168	万达信息	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.43	16,000	134,880.00
365	000021	深科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.69	12,600	134,694.00
366	600066	宇通客车	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.51	17,900	134,429.00
367	000825	太钢不锈	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.32	30,900	133,488.00
368	002373	千方	2023	-	2023	8.92	14,900	132,908.00

		科技	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
369	600906	财达 证券	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.57	17,500	132,475.00
370	600839	四川 长虹	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.64	49,800	131,472.00
371	600827	百联 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.12	10,800	130,896.00
372	600282	南钢 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.15	41,500	130,725.00
373	300677	英科 医疗	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	21.03	6,200	130,386.00
374	600970	中材 国际	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.52	15,300	130,356.00
375	600535	天士 力	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.76	12,100	130,196.00
376	601866	中远 海发	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.42	53,500	129,470.00
377	601665	齐鲁 银行	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.17	30,900	128,853.00
378	601778	晶科 科技	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.50	23,400	128,700.00
379	002127	南极	2023	- 2023	4.81	26,500	127,465.00

		电商	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
380	601179	中国西电	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.61	27,600	127,236.00
381	002128	电投能源	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	12.34	10,300	127,102.00
382	000930	中粮科技	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.36	15,100	126,236.00
383	000709	河钢股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.26	55,800	126,108.00
384	300182	捷成股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.47	27,800	124,266.00
385	000012	南玻 A	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.71	18,500	124,135.00
386	600398	海澜之家	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.30	23,300	123,490.00
387	688116	天奈科技	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	77.14	1,600	123,424.00
388	600500	中化国际	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.61	18,600	122,946.00
389	300861	美畅股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	49.16	2,500	122,900.00
390	002701	奥瑞	2023	- 2023	5.05	24,300	122,715.00

		金	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
391	000987	越秀 资本	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.99	20,300	121,597.00
392	002124	天邦 食品	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.11	19,800	120,978.00
393	600959	江苏 有线	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.97	40,500	120,285.00
394	600895	张江 高科	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	11.34	10,400	117,936.00
395	000778	新兴 铸管	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.65	32,300	117,895.00
396	000598	兴蓉 环境	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.89	24,100	117,849.00
397	000401	冀东 水泥	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.23	14,300	117,689.00
398	600663	陆家 嘴	2023 年 01 月 03 日	- 2023 年 01 月 03 日	9.74	12,000	116,880.00
399	300115	长盈 精密	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	10.33	11,300	116,729.00
400	300618	寒锐 钴业	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	40.05	2,900	116,145.00
401	600582	天地	2023	- 2023	5.20	22,300	115,960.00



		科技	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
402	002670	国盛 金控	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.41	15,600	115,596.00
403	600297	广汇 汽车	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.10	54,700	114,870.00
404	002249	大洋 电机	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.12	22,400	114,688.00
405	600718	东软 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	9.95	11,500	114,425.00
406	688208	道通 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	31.55	3,600	113,580.00
407	600507	方大 特钢	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.02	18,800	113,176.00
408	002266	浙富 控股	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.91	28,900	112,999.00
409	603225	新风 鸣	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.88	10,300	112,064.00
410	600517	国网 英大	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.84	23,100	111,804.00
411	000883	湖北 能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.20	26,600	111,720.00
412	300482	万孚	2023	-	2023	31.87	3,500	111,545.00

		生物	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
413	002505	鹏都 农牧	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.58	43,000	110,940.00
414	600409	三友 化工	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.61	16,700	110,387.00
415	000656	金科 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.91	57,600	110,016.00
416	601000	唐山 港	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.74	39,900	109,326.00
417	600022	山东 钢铁	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.48	73,800	109,224.00
418	002002	鸿达 兴业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.24	33,700	109,188.00
419	600871	石化 油服	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.98	54,900	108,702.00
420	000089	深圳 机场	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.86	13,800	108,468.00
421	601106	中国 一重	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.93	37,000	108,410.00
422	300212	易华 录	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	20.41	5,300	108,173.00
423	600567	山鹰	2023	-	2023	2.48	43,600	108,128.00

		国际	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
424	600064	南京 高科	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.61	16,300	107,743.00
425	300376	易事 特	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.83	15,600	106,548.00
426	002429	兆驰 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.49	30,500	106,445.00
427	002468	申通 快递	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	10.33	10,300	106,399.00
428	600782	新钢 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.09	25,800	105,522.00
429	000877	天山 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.52	12,300	104,796.00
430	002081	金螳 螂	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.85	21,500	104,275.00
431	601333	广深 铁路	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.27	45,700	103,739.00
432	601718	际华 集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.91	35,500	103,305.00
433	600667	太极 实业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.16	19,900	102,684.00
434	601118	海南	2023	-	2023	4.38	23,100	101,178.00

		橡胶	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
435	002010	传化 智联	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.34	18,900	100,926.00
436	600737	中粮 糖业	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.94	14,400	99,936.00
437	000540	中天 金融	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.51	66,100	99,811.00
438	600728	佳都 科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.28	18,900	99,792.00
439	002191	劲嘉 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.23	13,800	99,774.00
440	600376	首开 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.69	17,400	99,006.00
441	600155	华创 阳安	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.50	15,200	98,800.00
442	300463	迈克 生物	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	17.30	5,700	98,610.00
443	002745	木林 森	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.11	12,000	97,320.00
444	002221	东华 能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.63	12,700	96,901.00
445	300072	海新	2023	-	2023	4.36	22,200	96,792.00

		能科	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
446	600967	内蒙 一机	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	8.26	11,500	94,990.00
447	600126	杭钢 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.13	22,700	93,751.00
448	000156	华数 传媒	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.49	12,500	93,625.00
449	601991	大唐 发电	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.79	33,400	93,186.00
450	000800	一汽 解放	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.73	12,000	92,760.00
451	600808	马钢 股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.81	32,600	91,606.00
452	000937	冀中 能源	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.36	14,300	90,948.00
453	601568	北元 集团	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.67	16,000	90,720.00
454	601236	红塔 证券	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.40	12,200	90,280.00
455	600901	江苏 租赁	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	5.48	16,100	88,228.00
456	600095	湘财	2023	- 2023	7.56	11,500	86,940.00

		股份	年 01 月 09 日	-	年 01 月 09 日			
457	003035	南网 能源	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.67	15,300	86,751.00
458	000559	万向 钱潮	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.87	17,800	86,686.00
459	300630	普利 制药	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	24.66	3,500	86,310.00
460	000898	鞍钢 股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.67	32,300	86,241.00
461	688289	圣湘 生物	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	21.95	3,900	85,605.00
462	002434	万里 扬	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	8.05	10,600	85,330.00
463	000402	金融 街	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.25	16,100	84,525.00
464	600556	天下 秀	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.74	12,200	82,228.00
465	601608	中信 重工	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.49	23,400	81,666.00
466	601928	凤凰 传媒	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	7.92	10,300	81,576.00
467	601598	中国	2023	-	2023	3.84	21,200	81,408.00

		外运	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日			
468	601611	中国核建	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	7.60	10,700	81,320.00
469	000563	陕国投 A	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.03	26,700	80,901.00
470	002948	青岛银行	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.36	23,800	79,968.00
471	600707	彩虹股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.14	19,300	79,902.00
472	000959	首钢股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	3.77	21,100	79,547.00
473	300257	开山股份	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	15.00	5,300	79,500.00
474	600968	海油发展	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	2.88	27,400	78,912.00
475	600167	联美控股	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	6.32	12,300	77,736.00
476	000967	盈峰环境	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.54	17,100	77,634.00
477	002110	三钢闽光	2023 年 01 月 09 日	- 2023 年 01 月 09 日	4.70	16,500	77,550.00
478	000415	渤海	2023	- 2023	2.21	33,300	73,593.00

		租赁	年 01 月 09 日		年 01 月 09 日			
479	600307	酒钢宏兴	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	1.65	42,200	69,630.00
480	601828	美凯龙	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.69	14,600	68,474.00
481	600339	中油工程	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.98	22,600	67,348.00
482	000031	大悦城	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.76	17,300	65,048.00
483	600623	华谊集团	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	6.32	10,100	63,832.00
484	002146	荣盛发展	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.17	29,300	63,581.00
485	600928	西安银行	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.52	18,000	63,360.00
486	688088	虹软科技	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	22.51	2,700	60,777.00
487	600006	东风汽车	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	5.58	10,800	60,264.00
488	600787	中储股份	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	4.97	11,800	58,646.00
489	002563	森马	2023	-	2023	5.24	10,900	57,116.00



		服饰	年 01 月 09 日	年 01 月 09 日				
490	000961	中南 建设	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	2.19	25,800	56,502.00
491	601228	广州 港	2023 年 01 月 09 日	-	2023 年 01 月 09 日	3.15	14,200	44,730.00
合计	-	-	-	-	-	-	13,224,900	97,808,747.00

注：出借证券中如有其它流通受限的情况详见本报告“本基金持有的流通受限证券”部分内容。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的财务风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人建立了董事会、经营管理层、风险管理部门、各职能部门四级风险管理组织架构，并明确了相应的风险管理职能。

##### 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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家上市公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金的银行存款均存放于信用良好的银行，申购交易均通过具有基金销售资格的金融机构进行。另外，在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

##### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。本基金的流动性风险一方面来自

于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难。

#### 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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。本基金的基金管理人采用监控基金组合资产持仓集中度指标、逆回购交易的到期日与交易对手的集中度、流动性受限资产比例、基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值以及压力测试等方式防范流动性风险。并于开放日对本基金的申购赎回情况进行监控，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配，确保本基金资产的变现能力与投资者赎回需求的匹配与平衡。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

除本报告“期末本基金持有的流通受限证券”章节中所列示券种流通暂时受限制不能自由转让外，本基金本报告期末的其他资产均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金管理人每日预测本基金的流动性需求，并同时通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析。

本报告期内，本基金未发生重大流动性风险事件。

#### 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

利率风险是指基金的财务状况和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 202 2 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	48,997,016.8 9	-	-	-	-	-	48,997,016.89
结 算 备 付 金	12,872,963.0 6	-	-	-	-	-	12,872,963.06
存 出 保 证 金	190,647.01	-	-	-	-	6,715,008.00	6,905,655.01
交 易 性 金 融 资 产	-	-	-	-	-	1,806,097,361.0 2	1,806,097,361.0 2
衍 生 金 融 资 产	-	-	-	-	-	-	-
买	-	-	-	-	-	-	-

入返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	15,120,161.65	15,120,161.65
应收股利	-	-	-	-	-	10,409.12	10,409.12
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	33,615.61	33,615.61
资产总计	62,060,626.96	-	-	-	-	1,827,976,555.40	1,890,037,182.36
负债							
短期	-	-	-	-	-	-	-

借款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	14,783,502.54	14,783,502.54
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	240,190.34	240,190.34
应付托	-	-	-	-	-	80,063.42	80,063.42

管费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	4,092.81	4,092.81
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	435,095.42	435,095.42
负债总计	-	-	-	-	-	15,542,944.53	15,542,944.53
利率敏感度	62,060,626.96	-	-	-	-	1,812,433,610.87	1,874,494,237.83

缺口							
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	54,246,161.68	-	-	-	-	-	54,246,161.68
结算备付金	37,658,495.56	-	-	-	-	-	37,658,495.56
存出保证金	123,190.09	-	-	-	-	12,478,520.00	12,601,710.09
交易性金融资产	-	-	2,398,000.00	-	-	2,007,588,481.80	2,009,986,481.80
衍生金融资产	-	-	-	-	-	-	-
买入	-	-	-	-	-	-	-

返售金融资产							
债权投资	-	-	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-	4,863,087.86	4,863,087.86
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-	31,931.25	31,931.25
资产总计	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,024,962,020.91	2,119,387,868.24
负债							
短期借	-	-	-	-	-	-	-



款							
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	-	-	2,443,643.71	2,443,643.71
应付赎回款	-	-	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	269,214.55	269,214.55
应付托管	-	-	-	-	-	89,738.20	89,738.20

费							
应付销售服务费	-	-	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-	77,629.38	77,629.38
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	580,979.26	580,979.26
负债总计	-	-	-	-	-	3,461,205.10	3,461,205.10
利率敏感度缺	92,027,847.33	-	2,398,000.00	-	-	2,021,500,815.81	2,115,926,663.14

□							
---	--	--	--	--	--	--	--

表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末均未持有债券资产及资产支持证券（不含可转换债券及可交换债券），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

本基金所有资产及负债以人民币计价，因此无外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险。本基金的金融资产以公允价值计量，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。

本基金管理人通过标准差、跟踪误差、beta 值等指标监控投资组合面临的市场价格波动风险。

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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	1,806,097,361.02	96.35	2,007,588,481.80	94.88
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	2,398,000.00	0.11
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	1,806,097,361.02	96.35	2,009,986,481.80	94.99

##### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	<p>1. 本基金的市场价格风险主要源于证券市场的系统性风险，即从长期来看，本基金所投资的证券与业绩比较基准的变动呈线性相关，且报告期内的相关系数在资产负债表日后短期内保持不变；</p> <p>2. 以下分析中，除市场基准发生变动，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。</p>
----	--

分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2022 年 12 月 31 日	上年度末 2021 年 12 月 31 日
	中证 800 指数 上涨 5%	93,235,484.43	105,096,262.51
中证 800 指数 下跌 5%	-93,235,484.43	-105,096,262.51	

注：本基金管理人运用资本—资产定价模型方法对本基金的市场价格风险进行分析。上表为市场价格风险的敏感性分析，反映了在其他变量不变的假设下，证券市场组合的价格发生合理、可能的变动时，将对基金资产净值产生的影响。

#### 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	1,802,910,651.02	1,999,458,424.79
第二层次	2,172,222.40	3,696,889.35
第三层次	1,014,487.60	6,831,167.66
合计	1,806,097,361.02	2,009,986,481.80

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金政策为以报告期初作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

###### 7.4.14.3 第三层次公允价值余额及变动情况

## 7.4.14.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022 年 01 月 01 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	6,831,167.66	6,831,167.66
当期购买	-	1,142,364.53	1,142,364.53
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	6,831,167.66	6,831,167.66
当期利得或损失总额	-	-127,876.93	-127,876.93
其中：计入损益的利得或损失	-	-127,876.93	-127,876.93
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,014,487.60	1,014,487.60
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	-	-127,876.93	-127,876.93
项目	上年度可比同期 2021 年 01 月 01 日至 2021 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	4,278,067.59	4,278,067.59
当期购买	-	4,066,274.05	4,066,274.05
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	4,278,067.59	4,278,067.59
当期利得或损失总额	-	2,764,893.61	2,764,893.61
其中：计入损益的利得或	-	2,764,893.61	2,764,893.61

损失			2,764,893.61
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	6,831,167.66	6,831,167.66
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	-	2,764,893.61	2,764,893.61

#### 7.4.14.3.2 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
限售股票	1,014,487.60	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1891-2.4756	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
限售股票	6,831,167.66	平均价格 亚式期权 模型	波动率	0.1717-2.7417	负相关

#### 7.4.14.4 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 7.4.14.5 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

### § 8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	1,806,097,361.02	95.56
	其中：股票	1,806,097,361.02	95.56
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	61,869,979.95	3.27
8	其他各项资产	22,069,841.39	1.17
9	合计	1,890,037,182.36	100.00

注：本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为人民币 97,808,747.00 元，占期末基金资产净值比例 5.22%。

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	21,295,601.90	1.14
B	采矿业	59,439,371.20	3.17
C	制造业	1,043,257,021.88	55.66
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	53,151,242.50	2.84
E	建筑业	33,193,008.35	1.77
F	批发和零售业	22,834,707.25	1.22
G	交通运输、仓储和邮政业	55,452,528.04	2.96
H	住宿和餐饮业	1,244,960.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	85,043,180.69	4.54
J	金融业	319,539,443.64	17.05
K	房地产业	34,552,769.82	1.84

L	租赁和商务服务业	25,636,844.26	1.37
M	科学研究和技术服务业	23,585,638.60	1.26
N	水利、环境和公共设施管理业	2,662,448.75	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	12,976,965.30	0.69
R	文化、体育和娱乐业	7,912,327.00	0.42
S	综合	2,844,850.00	0.15
	合计	1,804,622,909.18	96.27

### 8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,033,780.17	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	127,219.40	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	202,966.87	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	38,283.70	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	66,597.20	0.00
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,474,451.84	0.08

### 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股票投资明细

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

金额单位：人民币元



序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	45,115	77,913,605.00	4.16
2	300750	宁德时代	105,900	41,663,178.00	2.22
3	601318	中国平安	779,956	36,657,932.00	1.96
4	600036	招商银行	890,700	33,187,482.00	1.77
5	000858	五粮液	139,461	25,199,208.09	1.34
6	601166	兴业银行	1,047,000	18,416,730.00	0.98
7	601012	隆基绿能	435,632	18,409,808.32	0.98
8	000333	美的集团	351,761	18,221,219.80	0.97
9	600900	长江电力	819,240	17,204,040.00	0.92
10	002594	比亚迪	65,600	16,857,232.00	0.90
11	601888	中国中免	70,542	15,239,188.26	0.81
12	300059	东方财富	761,289	14,769,006.60	0.79
13	600887	伊利股份	459,600	14,247,600.00	0.76
14	600030	中信证券	700,950	13,955,914.50	0.74
15	600309	万华化学	135,300	12,535,545.00	0.67
16	600276	恒瑞医药	321,842	12,400,572.26	0.66
17	603259	药明康德	148,081	11,994,561.00	0.64
18	000568	泸州老窖	52,900	11,864,412.00	0.63
19	002415	海康威视	338,800	11,749,584.00	0.63
20	002475	立讯精密	358,084	11,369,167.00	0.61
21	300760	迈瑞医疗	35,000	11,058,950.00	0.59

22	601398	工商银行	2,517,400	10,925,516.00	0.58
23	000651	格力电器	324,740	10,495,596.80	0.56
24	601899	紫金矿业	1,035,300	10,353,000.00	0.55
25	002352	顺丰控股	175,844	10,156,749.44	0.54
26	600809	山西汾酒	35,260	10,048,747.40	0.54
27	601328	交通银行	1,973,400	9,353,916.00	0.50
28	002714	牧原股份	191,758	9,348,202.50	0.50
29	300124	汇川技术	133,650	9,288,675.00	0.50
30	002142	宁波银行	284,570	9,234,296.50	0.49
31	000001	平安银行	696,867	9,170,769.72	0.49
32	000725	京东方 A	2,693,600	9,104,368.00	0.49
33	000002	万科 A	490,600	8,928,920.00	0.48
34	000792	盐湖股份	390,200	8,853,638.00	0.47
35	601816	京沪高铁	1,763,500	8,676,420.00	0.46
36	300274	阳光电源	75,100	8,396,180.00	0.45
37	601668	中国建筑	1,505,900	8,177,037.00	0.44
38	300015	爱尔眼科	257,690	8,006,428.30	0.43
39	603288	海天味业	99,863	7,949,094.80	0.42
40	600048	保利发展	515,900	7,805,567.00	0.42
41	300014	亿纬锂能	87,983	7,733,705.70	0.41
42	600438	通威股份	194,000	7,484,520.00	0.40
43	300498	温氏股份	376,540	7,391,480.20	0.39
44	002129	TCL 中环	185,700	6,993,462.00	0.37

45	002304	洋河股份	43,300	6,949,650.00	0.37
46	600031	三一重工	427,000	6,746,600.00	0.36
47	600690	海尔智家	272,400	6,662,904.00	0.36
48	601288	农业银行	2,287,400	6,656,334.00	0.36
49	601088	中国神华	236,840	6,541,520.80	0.35
50	002049	紫光国微	48,880	6,443,361.60	0.34
51	600436	片仔癀	22,100	6,374,966.00	0.34
52	600919	江苏银行	848,650	6,186,658.50	0.33
53	600016	民生银行	1,782,800	6,150,660.00	0.33
54	600050	中国联通	1,370,500	6,139,840.00	0.33
55	600000	浦发银行	843,300	6,139,224.00	0.33
56	601601	中国太保	245,800	6,027,016.00	0.32
57	600837	海通证券	693,400	6,025,646.00	0.32
58	000063	中兴通讯	228,750	5,915,475.00	0.32
59	600406	国电南瑞	240,345	5,864,418.00	0.31
60	002466	天齐锂业	74,200	5,861,058.00	0.31
61	688981	中芯国际	140,602	5,784,366.28	0.31
62	002460	赣锋锂业	81,080	5,635,870.80	0.30
63	600089	特变电工	278,100	5,584,248.00	0.30
64	601225	陕西煤业	278,500	5,174,530.00	0.28
65	603799	华友钴业	91,870	5,110,728.10	0.27
66	300122	智飞生物	57,500	5,050,225.00	0.27

67	002812	恩捷股份	38,400	5,041,536.00	0.27
68	688599	天合光能	77,900	4,966,904.00	0.26
69	603986	兆易创新	47,968	4,915,280.96	0.26
70	002271	东方雨虹	144,800	4,860,936.00	0.26
71	002027	分众传媒	726,100	4,850,348.00	0.26
72	600104	上汽集团	335,700	4,837,437.00	0.26
73	601988	中国银行	1,513,800	4,783,608.00	0.26
74	600585	海螺水泥	172,400	4,720,312.00	0.25
75	601688	华泰证券	369,800	4,711,252.00	0.25
76	601919	中远海控	457,460	4,707,263.40	0.25
77	601728	中国电信	1,115,111	4,672,315.09	0.25
78	300142	沃森生物	115,000	4,621,850.00	0.25
79	601169	北京银行	1,063,000	4,581,530.00	0.24
80	601766	中国中车	873,600	4,464,096.00	0.24
81	601628	中国人寿	119,613	4,440,034.56	0.24
82	600570	恒生电子	109,110	4,414,590.60	0.24
83	601211	国泰君安	323,800	4,400,442.00	0.23
84	000625	长安汽车	356,792	4,392,109.52	0.23
85	002371	北方华创	19,476	4,387,942.80	0.23
86	002230	科大讯飞	133,500	4,382,805.00	0.23
87	300896	爱美客	7,600	4,304,260.00	0.23
88	601229	上海银行	714,300	4,221,513.00	0.23

89	600028	中国石化	960,800	4,189,088.00	0.22
90	002410	广联达	68,993	4,136,130.35	0.22
91	600009	上海机场	71,500	4,126,265.00	0.22
92	601390	中国中铁	737,800	4,102,168.00	0.22
93	002459	晶澳科技	68,240	4,100,541.60	0.22
94	601985	中国核电	677,000	4,062,000.00	0.22
95	600893	航发动力	95,778	4,049,493.84	0.22
96	600660	福耀玻璃	115,100	4,036,557.00	0.22
97	000338	潍柴动力	389,800	3,968,164.00	0.21
98	300347	泰格医药	37,700	3,950,960.00	0.21
99	000661	长春高新	23,700	3,944,865.00	0.21
100	603501	韦尔股份	51,042	3,934,827.78	0.21
101	600111	北方稀土	156,500	3,920,325.00	0.21
102	601009	南京银行	370,100	3,856,442.00	0.21
103	601669	中国电建	543,900	3,850,812.00	0.21
104	002311	海大集团	59,700	3,685,281.00	0.20
105	000100	TCL 科技	984,400	3,661,968.00	0.20
106	601818	光大银行	1,188,100	3,647,467.00	0.19
107	002709	天赐材料	83,060	3,643,011.60	0.19
108	688008	澜起科技	57,700	3,612,020.00	0.19
109	601658	邮储银行	781,378	3,609,966.36	0.19
110	600019	宝钢股份	639,800	3,576,482.00	0.19
111	600588	用友网	147,950	3,575,951.50	0.19

		络			
112	600999	招商证 券	266,610	3,545,913.00	0.19
113	600426	华鲁恒 升	106,660	3,535,779.00	0.19
114	600905	三峡能 源	616,600	3,483,790.00	0.19
115	601857	中国石 油	697,700	3,467,569.00	0.18
116	688111	金山办 公	13,000	3,438,370.00	0.18
117	600958	东方证 券	375,544	3,357,363.36	0.18
118	600760	中航沈 飞	56,400	3,306,732.00	0.18
119	002179	中航光 电	57,120	3,299,251.20	0.18
120	000776	广发证 券	212,600	3,293,174.00	0.18
121	002050	三花智 控	154,680	3,282,309.60	0.18
122	600196	复星医 药	91,300	3,217,412.00	0.17
123	300661	圣邦股 份	18,450	3,184,470.00	0.17
124	002180	纳思达	61,100	3,170,479.00	0.17
125	300450	先导智 能	78,700	3,167,675.00	0.17
126	600010	包钢股 份	1,637,000	3,143,040.00	0.17
127	000596	古井贡 酒	11,500	3,069,350.00	0.16
128	000733	振华科 技	26,500	3,027,095.00	0.16
129	688012	中微半 导体设 备	30,500	2,989,305.00	0.16
130	300316	晶盛机 电	47,000	2,987,320.00	0.16
131	300408	三环集 团	96,400	2,960,444.00	0.16
132	000963	华东医 药	62,900	2,943,720.00	0.16

133	600029	南方航空	387,200	2,942,720.00	0.16
134	002241	歌尔股份	171,800	2,891,394.00	0.15
135	601615	明阳智能	114,200	2,884,692.00	0.15
136	600150	中国船舶	128,468	2,862,267.04	0.15
137	601989	中国重工	818,800	2,857,612.00	0.15
138	002340	格林美	384,200	2,854,606.00	0.15
139	601006	大秦铁路	427,140	2,853,295.20	0.15
140	601377	兴业证券	496,240	2,848,417.60	0.15
141	600745	闻泰科技	53,700	2,823,546.00	0.15
142	000538	云南白药	51,660	2,808,237.60	0.15
143	000938	紫光股份	143,860	2,806,708.60	0.15
144	001979	招商蛇口	222,100	2,805,123.00	0.15
145	300012	华测检测	125,700	2,803,110.00	0.15
146	600926	杭州银行	212,960	2,785,516.80	0.15
147	600600	青岛啤酒	25,800	2,773,500.00	0.15
148	600795	国电电力	640,500	2,734,935.00	0.15
149	601939	建设银行	482,400	2,715,912.00	0.14
150	002493	荣盛石化	218,150	2,683,245.00	0.14
151	300782	卓胜微	23,460	2,681,478.00	0.14
152	600941	中国移动	38,900	2,632,363.00	0.14
153	601633	长城汽车	88,562	2,623,206.44	0.14
154	601138	工业富联	285,300	2,619,054.00	0.14
155	603659	璞泰来	50,000	2,594,500.00	0.14

156	000166	申万宏源	648,300	2,580,234.00	0.14
157	601186	中国铁建	330,500	2,554,765.00	0.14
158	600157	永泰能源	1,662,400	2,543,472.00	0.14
159	601600	中国铝业	568,400	2,540,748.00	0.14
160	603806	福斯特	38,202	2,538,140.88	0.14
161	002384	东山精密	102,400	2,532,352.00	0.14
162	000768	中航西飞	99,500	2,532,275.00	0.14
163	002001	新和成	133,188	2,497,275.00	0.13
164	300751	迈为股份	6,060	2,495,750.40	0.13
165	600547	山东黄金	129,800	2,486,968.00	0.13
166	600233	圆通速递	123,600	2,483,124.00	0.13
167	300724	捷佳伟创	21,400	2,440,028.00	0.13
168	601838	成都银行	158,800	2,429,640.00	0.13
169	600763	通策医疗	15,800	2,417,242.00	0.13
170	300759	康龙化成	35,500	2,414,000.00	0.13
171	300763	锦浪科技	13,400	2,412,670.00	0.13
172	600011	华能国际	315,900	2,403,999.00	0.13
173	601995	中金公司	62,900	2,398,377.00	0.13
174	600015	华夏银行	456,800	2,370,792.00	0.13
175	600176	中国巨石	172,523	2,365,290.33	0.13
176	601100	恒立液压	37,448	2,364,841.20	0.13
177	600584	长电科技	102,300	2,358,015.00	0.13
178	600346	恒力石	151,600	2,354,348.00	0.13



		化			
179	300496	中科创达	23,400	2,347,020.00	0.13
180	688777	中控技术	25,600	2,325,248.00	0.12
181	600383	金地集团	227,000	2,322,210.00	0.12
182	600886	国投电力	214,200	2,319,786.00	0.12
183	603613	国联股份	26,115	2,309,610.60	0.12
184	603993	洛阳钼业	507,500	2,309,125.00	0.12
185	603369	今世缘	45,057	2,293,401.30	0.12
186	600132	重庆啤酒	17,900	2,280,102.00	0.12
187	601111	中国国航	214,700	2,275,820.00	0.12
188	300003	乐普医疗	98,488	2,262,269.36	0.12
189	688122	西部超导	23,854	2,258,735.26	0.12
190	002422	科伦药业	84,800	2,256,528.00	0.12
191	605117	德业股份	6,800	2,252,160.00	0.12
192	600487	亨通光电	147,700	2,224,362.00	0.12
193	601066	中信建投	93,300	2,215,875.00	0.12
194	002074	国轩高科	76,600	2,208,378.00	0.12
195	002385	大北农	247,900	2,206,310.00	0.12
196	600188	兖矿能源	65,600	2,202,848.00	0.12
197	600085	同仁堂	49,300	2,202,724.00	0.12
198	002202	金风科技	198,300	2,181,300.00	0.12
199	600115	中国东航	393,600	2,176,608.00	0.12
200	000425	徐工机械	424,300	2,151,201.00	0.11
201	002920	德赛西	20,400	2,148,936.00	0.11

		威			
202	002252	上海莱士	338,900	2,148,626.00	0.11
203	688063	派能科技	6,800	2,146,420.00	0.11
204	002821	凯莱英	14,500	2,146,000.00	0.11
205	601877	正泰电器	77,151	2,137,082.70	0.11
206	002966	苏州银行	274,370	2,134,598.60	0.11
207	601868	中国能建	929,465	2,128,474.85	0.11
208	603345	安井食品	13,000	2,104,440.00	0.11
209	000876	新希望	163,000	2,104,330.00	0.11
210	601117	中国化学	263,300	2,090,602.00	0.11
211	603606	东方电缆	30,800	2,089,164.00	0.11
212	601788	光大证券	140,300	2,086,261.00	0.11
213	600885	宏发股份	62,430	2,085,786.30	0.11
214	300454	深信服	18,400	2,070,920.00	0.11
215	600765	中航重机	66,060	2,053,805.40	0.11
216	688396	华润微电子	38,900	2,048,085.00	0.11
217	600079	人福医药	85,500	2,042,595.00	0.11
218	601800	中国交建	253,100	2,037,455.00	0.11
219	600096	云天化	96,200	2,024,048.00	0.11
220	002497	雅化集团	86,200	2,004,150.00	0.11
221	600460	士兰微	61,100	2,003,469.00	0.11
222	300207	欣旺达	93,700	1,981,755.00	0.11
223	300769	德方纳米	8,600	1,974,474.00	0.11
224	600741	华域汽车	113,200	1,961,756.00	0.10
225	601555	东吴证券	299,702	1,957,054.06	0.10

226	002601	龙佰集团	103,000	1,948,760.00	0.10
227	000157	中联重科	357,100	1,942,624.00	0.10
228	000895	双汇发展	74,602	1,934,429.86	0.10
229	600352	浙江龙盛	194,800	1,928,520.00	0.10
230	002625	光启技术	112,800	1,919,856.00	0.10
231	002407	多氟多	57,300	1,909,236.00	0.10
232	600989	宝丰能源	158,000	1,907,060.00	0.10
233	600845	宝信软件	42,301	1,895,084.80	0.10
234	000786	北新建材	72,800	1,884,064.00	0.10
235	601901	方正证券	294,900	1,881,462.00	0.10
236	002648	卫星化学	120,940	1,874,570.00	0.10
237	002603	以岭药业	62,520	1,873,099.20	0.10
238	000009	中国宝安	154,300	1,865,487.00	0.10
239	300999	金龙鱼	42,800	1,864,368.00	0.10
240	603019	中科曙光	84,120	1,862,416.80	0.10
241	601689	拓普集团	31,600	1,851,128.00	0.10
242	002736	国信证券	207,100	1,839,048.00	0.10
243	601058	赛轮轮胎	183,400	1,837,668.00	0.10
244	002738	中矿资源	27,400	1,826,484.00	0.10
245	601233	桐昆股份	126,300	1,825,035.00	0.10
246	601021	春秋航空	28,100	1,805,425.00	0.10
247	688036	传音控股	22,700	1,805,104.00	0.10
248	601336	新华保	59,965	1,803,747.20	0.10

		险			
249	600988	赤峰黄金	99,600	1,797,780.00	0.10
250	688390	固德威电源	5,560	1,796,380.40	0.10
251	600489	中金黄金	217,600	1,782,144.00	0.10
252	002007	华兰生物	78,620	1,779,170.60	0.09
253	603605	珀莱雅	10,600	1,775,288.00	0.09
254	603688	石英股份	13,500	1,772,820.00	0.09
255	600298	安琪酵母	39,000	1,763,580.00	0.09
256	002028	思源电气	45,900	1,754,298.00	0.09
257	601238	广汽集团	158,700	1,750,461.00	0.09
258	000301	东方盛虹	133,900	1,746,056.00	0.09
259	300146	汤臣倍健	76,300	1,741,166.00	0.09
260	601108	财通证券	243,180	1,731,441.60	0.09
261	002555	三七互娱	95,600	1,730,360.00	0.09
262	000807	云铝股份	155,600	1,730,272.00	0.09
263	603939	益丰药房	27,000	1,723,680.00	0.09
264	600536	中国软件	29,550	1,723,651.50	0.09
265	000630	铜陵有色	551,300	1,720,056.00	0.09
266	600418	江淮汽车	130,700	1,716,091.00	0.09
267	300144	宋城演艺	117,320	1,712,872.00	0.09
268	300699	光威复材	23,700	1,712,325.00	0.09
269	300073	当升科技	30,300	1,708,920.00	0.09
270	300037	新宙邦	38,900	1,690,983.00	0.09

271	600141	兴发集团	58,300	1,690,700.00	0.09
272	600399	抚顺特钢	118,000	1,688,580.00	0.09
273	000723	美锦能源	186,500	1,682,230.00	0.09
274	600859	王府井	59,500	1,674,330.00	0.09
275	603517	绝味食品	27,300	1,667,757.00	0.09
276	300285	国瓷材料	60,100	1,656,957.00	0.09
277	600219	南山铝业	504,600	1,650,042.00	0.09
278	601077	渝农商行	463,200	1,635,096.00	0.09
279	601618	中国中冶	512,900	1,631,022.00	0.09
280	300568	星源材质	76,600	1,628,516.00	0.09
281	600873	梅花生物	159,300	1,621,674.00	0.09
282	300390	天华超净	29,000	1,620,520.00	0.09
283	603392	万泰生物	12,770	1,617,959.00	0.09
284	300413	芒果超媒	53,800	1,615,076.00	0.09
285	603882	金域医学	20,600	1,610,920.00	0.09
286	002185	华天科技	191,900	1,590,851.00	0.08
287	603456	九洲药业	37,400	1,586,882.00	0.08
288	000977	浪潮信息	73,600	1,583,872.00	0.08
289	600563	法拉电子	9,900	1,582,812.00	0.08
290	002138	顺络电子	60,400	1,581,272.00	0.08
291	603290	斯达半导	4,800	1,580,640.00	0.08
292	603816	顾家家居	36,900	1,575,999.00	0.08

293	000069	华侨城 A	294,500	1,569,685.00	0.08
294	300628	亿联网络	25,900	1,569,281.00	0.08
295	600160	巨化股份	101,000	1,566,510.00	0.08
296	600674	川投能源	127,800	1,562,994.00	0.08
297	603185	上机数控	14,760	1,562,346.00	0.08
298	603833	欧派家居	12,820	1,558,014.60	0.08
299	002008	大族激光	60,500	1,551,825.00	0.08
300	603589	口子窖	26,900	1,551,323.00	0.08
301	601128	常熟银行	205,000	1,547,750.00	0.08
302	000783	长江证券	289,600	1,543,568.00	0.08
303	600153	建发股份	112,400	1,534,260.00	0.08
304	688099	晶晨半导体	21,700	1,530,067.00	0.08
305	300033	同花顺	15,500	1,528,455.00	0.08
306	002192	融捷股份	15,600	1,527,240.00	0.08
307	300601	康泰生物	48,320	1,523,529.60	0.08
308	000629	钒钛股份	321,900	1,522,587.00	0.08
309	003816	中国广核	564,400	1,518,236.00	0.08
310	300357	我武生物	27,400	1,509,740.00	0.08
311	603596	伯特利	18,900	1,508,220.00	0.08
312	601699	潞安环能	89,500	1,508,075.00	0.08
313	605358	立昂微	35,400	1,508,040.00	0.08
314	300433	蓝思科技	142,900	1,504,737.00	0.08
315	600332	白云山	50,500	1,504,395.00	0.08
316	600039	四川路桥	134,200	1,492,304.00	0.08
317	002120	韵达股	103,770	1,492,212.60	0.08

		份			
318	601162	天风证 券	518,660	1,488,554.20	0.08
319	000683	远兴能 源	189,700	1,487,248.00	0.08
320	601607	上海医 药	83,100	1,481,673.00	0.08
321	002236	大华股 份	130,700	1,478,217.00	0.08
322	002841	视源股 份	25,000	1,476,000.00	0.08
323	002568	百润股 份	39,400	1,471,984.00	0.08
324	600884	杉杉股 份	80,800	1,470,560.00	0.08
325	600392	盛和资 源	105,000	1,470,000.00	0.08
326	688567	孚能科 技	54,300	1,467,729.00	0.08
327	600161	天坛生 物	61,832	1,467,273.36	0.08
328	603899	晨光股 份	26,600	1,462,468.00	0.08
329	000932	华菱钢 铁	310,200	1,457,940.00	0.08
330	600521	华海药 业	66,600	1,455,876.00	0.08
331	601168	西部矿 业	142,700	1,455,540.00	0.08
332	600109	国金证 券	167,200	1,454,640.00	0.08
333	600499	科达制 造	102,100	1,450,841.00	0.08
334	000831	中国稀 土	44,000	1,446,720.00	0.08
335	600486	扬农化 工	13,900	1,444,210.00	0.08
336	600027	华电国 际	244,000	1,434,720.00	0.08
337	002223	鱼跃医 疗	45,000	1,433,700.00	0.08
338	002602	世纪华 通	374,720	1,427,683.20	0.08

339	002797	第一创业	251,500	1,415,945.00	0.08
340	603077	和邦生物	461,400	1,402,656.00	0.07
341	600862	中航高科	62,600	1,395,354.00	0.07
342	002078	太阳纸业	120,600	1,389,312.00	0.07
343	601878	浙商证券	139,300	1,383,249.00	0.07
344	688126	上海硅产业集团	78,500	1,382,385.00	0.07
345	000999	华润三九	29,500	1,380,895.00	0.07
346	002025	航天电器	20,800	1,378,000.00	0.07
347	000975	银泰黄金	124,460	1,374,038.40	0.07
348	002756	永兴材料	14,900	1,373,333.00	0.07
349	002938	鹏鼎控股	50,000	1,372,000.00	0.07
350	601636	旗滨集团	120,400	1,371,356.00	0.07
351	002294	信立泰	41,700	1,369,845.00	0.07
352	601872	招商轮船	243,160	1,359,264.40	0.07
353	300957	贝泰妮	9,100	1,358,084.00	0.07
354	688385	复旦微电	19,400	1,354,314.00	0.07
355	002268	卫士通	44,300	1,352,479.00	0.07
356	600497	驰宏锌锗	266,700	1,349,502.00	0.07
357	600143	金发科技	138,900	1,345,941.00	0.07
358	002532	天山铝业	174,000	1,343,280.00	0.07
359	601360	三六零	205,300	1,342,662.00	0.07
360	688005	容百科技	19,500	1,340,625.00	0.07
361	601155	新城控股	64,900	1,330,450.00	0.07



362	002299	圣农发展	55,900	1,324,271.00	0.07
363	300253	卫宁健康	128,600	1,322,008.00	0.07
364	601696	中银证券	124,700	1,318,079.00	0.07
365	600177	雅戈尔	207,800	1,315,374.00	0.07
366	601990	南京证券	165,500	1,312,415.00	0.07
367	601799	星宇股份	10,300	1,311,911.00	0.07
368	002439	启明星辰	49,900	1,301,392.00	0.07
369	600705	中航产融	396,400	1,300,192.00	0.07
370	600362	江西铜业	74,500	1,298,535.00	0.07
371	002624	完美世界	101,650	1,292,988.00	0.07
372	688561	奇安信集团	19,600	1,289,092.00	0.07
373	000591	太阳能	175,500	1,286,415.00	0.07
374	603737	三棵树	11,300	1,286,279.00	0.07
375	603260	合盛硅业	15,500	1,285,570.00	0.07
376	600918	中泰证券	200,200	1,283,282.00	0.07
377	600348	华阳股份	90,000	1,282,500.00	0.07
378	000998	隆平高科	78,800	1,266,316.00	0.07
379	000738	航发控制	49,200	1,261,488.00	0.07
380	300223	北京君正	17,800	1,253,832.00	0.07
381	600026	中远海能	104,000	1,253,200.00	0.07
382	002850	科达利	10,500	1,247,505.00	0.07
383	600549	厦门钨业	63,700	1,245,335.00	0.07
384	600258	首旅酒店	50,200	1,244,960.00	0.07
385	000708	中信特	72,500	1,244,100.00	0.07

		钢			
386	000728	国元证 券	196,530	1,244,034.90	0.07
387	688301	奕瑞科 技股份	2,700	1,236,276.00	0.07
388	600482	中国动 力	80,800	1,235,432.00	0.07
389	000988	华工科 技	75,200	1,234,032.00	0.07
390	000519	中兵红 箭	62,600	1,229,464.00	0.07
391	002273	水晶光 电	104,100	1,227,339.00	0.07
392	002673	西部证 券	200,604	1,221,678.36	0.07
393	601865	福莱特	36,500	1,215,815.00	0.06
394	300604	长川科 技	27,100	1,208,118.00	0.06
395	600183	生益科 技	83,520	1,203,523.20	0.06
396	601997	贵阳银 行	218,838	1,201,420.62	0.06
397	002507	涪陵榨 菜	46,500	1,198,305.00	0.06
398	601319	中国人 保	229,378	1,197,353.16	0.06
399	603486	科沃斯	16,400	1,196,216.00	0.06
400	300136	信维通 信	72,400	1,195,324.00	0.06
401	600061	国投资 本	184,596	1,179,568.44	0.06
402	000408	藏格矿 业	45,400	1,179,038.00	0.06
403	300832	新产业	23,500	1,178,290.00	0.06
404	300363	博腾股 份	28,500	1,164,225.00	0.06
405	600018	上港集 团	217,400	1,160,916.00	0.06
406	002092	中泰化 学	155,600	1,160,776.00	0.06
407	000703	恒逸石 化	164,610	1,157,208.30	0.06
408	002430	杭氧股	29,400	1,157,184.00	0.06

		份			
409	300595	欧普康视	32,160	1,148,112.00	0.06
410	600325	华发股份	126,700	1,147,902.00	0.06
411	002030	达安基因	73,432	1,142,601.92	0.06
412	002056	横店东磁	60,900	1,141,266.00	0.06
413	002739	万达电影	81,500	1,141,000.00	0.06
414	002557	洽洽食品	22,700	1,135,000.00	0.06
415	601898	中煤能源	131,500	1,133,530.00	0.06
416	300308	中际旭创	41,900	1,132,557.00	0.06
417	600529	山东药玻	39,700	1,127,480.00	0.06
418	603233	大参林	28,400	1,124,640.00	0.06
419	601666	平煤股份	104,000	1,124,240.00	0.06
420	603658	安图生物	18,150	1,122,577.50	0.06
421	600704	物产中大	233,300	1,122,173.00	0.06
422	002465	海格通信	138,000	1,120,560.00	0.06
423	000729	燕京啤酒	105,500	1,120,410.00	0.06
424	601198	东兴证券	145,100	1,120,172.00	0.06
425	002156	通富微电	67,900	1,118,992.00	0.06
426	601016	节能风电	292,550	1,114,615.50	0.06
427	600655	豫园股份	145,900	1,110,299.00	0.06
428	600879	航天电子	162,700	1,106,360.00	0.06
429	300088	长信科技	183,700	1,096,689.00	0.06
430	601998	中信银	220,100	1,096,098.00	0.06

		行			
431	300529	健帆生物	34,800	1,077,756.00	0.06
432	002080	中材科技	50,200	1,075,786.00	0.06
433	600415	小商品城	205,200	1,075,248.00	0.06
434	600803	新奥股份	66,700	1,073,870.00	0.06
435	600546	山煤国际	74,100	1,073,709.00	0.06
436	002409	雅克科技	21,300	1,072,881.00	0.06
437	688116	天奈科技	13,900	1,072,246.00	0.06
438	002353	杰瑞股份	38,400	1,071,744.00	0.06
439	000830	鲁西化工	86,200	1,068,018.00	0.06
440	002916	深南电路	14,800	1,067,820.00	0.06
441	603267	鸿远电子	10,500	1,062,180.00	0.06
442	000878	云南铜业	90,000	1,057,500.00	0.06
443	002683	广东宏大	39,200	1,056,832.00	0.06
444	000960	锡业股份	74,900	1,056,090.00	0.06
445	000400	许继电气	52,800	1,054,416.00	0.06
446	600516	方大炭素	170,820	1,045,418.40	0.06
447	000623	吉林敖东	69,600	1,043,304.00	0.06
448	300373	扬杰科技	19,800	1,041,480.00	0.06
449	600170	上海建工	399,800	1,039,480.00	0.06
450	002414	高德红外	94,432	1,038,752.00	0.06
451	603160	汇顶科技	20,500	1,029,100.00	0.05

452	688187	时代电气	18,800	1,025,916.00	0.05
453	688303	大全能源	21,500	1,025,120.00	0.05
454	002444	巨星科技	54,000	1,024,920.00	0.05
455	688169	石头科技	4,120	1,020,730.00	0.05
456	002531	天顺风能	67,400	1,019,762.00	0.05
457	300418	昆仑万维	70,700	1,018,787.00	0.05
458	300017	网宿科技	182,500	1,018,350.00	0.05
459	002372	伟星新材	47,700	1,017,918.00	0.05
460	601577	长沙银行	150,500	1,017,380.00	0.05
461	600637	东方明珠	152,430	1,013,659.50	0.05
462	600642	申能股份	183,800	1,009,062.00	0.05
463	600739	辽宁成大	80,100	1,008,459.00	0.05
464	600166	福田汽车	358,500	1,007,385.00	0.05
465	600699	均胜电子	71,600	1,005,980.00	0.05
466	601456	国联证券	89,400	1,005,750.00	0.05
467	603712	七一二	28,800	1,005,696.00	0.05
468	002326	永太科技	45,900	1,001,997.00	0.05
469	603444	吉比特	3,200	1,001,088.00	0.05
470	600038	中直股份	21,500	997,815.00	0.05
471	002203	海亮股份	88,300	997,790.00	0.05
472	688002	睿创微纳	26,783	996,059.77	0.05
473	000970	中科三环	72,710	991,764.40	0.05
474	002508	老板电	35,500	985,480.00	0.05

		器			
475	603127	昭衍新 药	16,860	984,792.60	0.05
476	000155	川能动 力	55,200	984,768.00	0.05
477	600673	东阳光	112,700	979,363.00	0.05
478	689009	九号公 司	32,100	978,729.00	0.05
479	603026	胜华新 材	10,600	978,380.00	0.05
480	600380	健康元	86,500	976,585.00	0.05
481	000039	中集集 团	137,900	970,816.00	0.05
482	002064	华峰化 学	142,600	969,680.00	0.05
483	601216	君正集 团	242,200	966,378.00	0.05
484	600909	华安证 券	210,370	965,598.30	0.05
485	600056	中国医 药	55,967	964,311.41	0.05
486	600867	通化东 宝	104,304	957,510.72	0.05
487	300676	华大基 因	18,500	956,265.00	0.05
488	600118	中国卫 星	44,200	952,510.00	0.05
489	300919	中伟股 份	14,500	951,345.00	0.05
490	002065	东华软 件	167,900	950,314.00	0.05
491	000739	普洛药 业	44,100	949,914.00	0.05
492	600985	淮北矿 业	74,200	949,760.00	0.05
493	000750	国海证 券	285,190	949,682.70	0.05
494	300244	迪安诊 断	37,500	942,375.00	0.05
495	300058	蓝色光 标	186,400	941,320.00	0.05
496	600008	首创环 保	329,490	932,456.70	0.05

497	600369	西南证 券	248,600	932,250.00	0.05
498	688009	中国通 号	193,596	927,324.84	0.05
499	002152	广电运 通	92,900	923,426.00	0.05
500	300474	景嘉微	16,900	922,233.00	0.05
501	600372	中航电 子	57,700	921,469.00	0.05
502	002831	裕同科 技	27,800	919,346.00	0.05
503	002600	领益智 造	202,200	917,988.00	0.05
504	300558	贝达药 业	18,600	916,422.00	0.05
505	600998	九州通	70,018	913,034.72	0.05
506	601880	辽港股 份	563,500	912,870.00	0.05
507	000513	丽珠集 团	28,000	909,440.00	0.05
508	000027	深圳能 源	142,400	905,664.00	0.05
509	600435	北方导 航	78,000	904,800.00	0.05
510	002936	郑州银 行	384,843	904,381.05	0.05
511	600606	绿地控 股	302,875	902,567.50	0.05
512	000547	航天发 展	96,000	901,440.00	0.05
513	300866	安克创 新	15,200	900,904.00	0.05
514	000636	风华高 科	60,596	898,638.68	0.05
515	300070	碧水源	189,900	898,227.00	0.05
516	002408	齐翔腾 达	127,580	898,163.20	0.05
517	002131	利欧股 份	505,700	895,089.00	0.05
518	300026	红日药 业	157,300	893,464.00	0.05
519	002506	协鑫集 成	306,400	891,624.00	0.05

520	002926	华西证 券	117,800	887,034.00	0.05
521	002212	天融信	88,700	886,113.00	0.05
522	603883	老百姓	21,796	882,084.12	0.05
523	300383	光环新 网	107,600	878,016.00	0.05
524	600378	昊华科 技	20,400	875,364.00	0.05
525	002183	怡亚通	136,000	874,480.00	0.05
526	300682	朗新科 技	39,700	872,606.00	0.05
527	603858	步长制 药	41,400	869,814.00	0.05
528	601966	玲珑轮 胎	42,400	868,352.00	0.05
529	002572	索菲亚	47,800	868,048.00	0.05
530	600820	隧道股 份	164,700	867,969.00	0.05
531	600271	航天信 息	83,200	866,112.00	0.05
532	002195	二三四 五	428,300	860,883.00	0.05
533	601881	中国银 河	92,600	860,254.00	0.05
534	600580	卧龙电 驱	68,800	857,248.00	0.05
535	002250	联化科 技	55,300	857,150.00	0.05
536	300296	利亚德	151,300	856,358.00	0.05
537	000887	中鼎股 份	59,100	855,177.00	0.05
538	600390	五矿资 本	168,300	854,964.00	0.05
539	002500	山西证 券	161,080	853,724.00	0.05
540	600848	上海临 港	71,600	853,472.00	0.05
541	600025	华能水 电	129,300	853,380.00	0.05
542	002368	太极股 份	30,299	852,310.87	0.05
543	600863	内蒙华 电	244,100	851,909.00	0.05



544	600021	上海电力	84,330	844,143.30	0.05
545	603156	养元饮品	37,832	842,518.64	0.04
546	688779	长远锂科	57,700	841,843.00	0.04
547	002958	青农商行	290,900	840,701.00	0.04
548	601958	金铂股份	72,400	836,220.00	0.04
549	688538	和辉光电	311,800	835,624.00	0.04
550	300024	机器人	92,800	833,344.00	0.04
551	300001	特锐德	54,500	828,945.00	0.04
552	688521	芯原微电子	18,700	824,109.00	0.04
553	600755	厦门国贸	115,200	822,528.00	0.04
554	002244	滨江集团	93,100	822,073.00	0.04
555	300009	安科生物	87,640	820,310.40	0.04
556	688256	寒武纪科技	15,000	818,400.00	0.04
557	002155	湖南黄金	63,000	815,850.00	0.04
558	600208	新湖中宝	321,000	815,340.00	0.04
559	600316	洪都航空	32,200	811,118.00	0.04
560	002511	中顺洁柔	59,000	810,660.00	0.04
561	600315	上海家化	25,400	808,990.00	0.04
562	603885	吉祥航空	49,700	804,146.00	0.04
563	000997	新大陆	61,800	804,018.00	0.04
564	601231	环旭电子	49,500	803,385.00	0.04
565	000060	中金岭南	195,800	802,780.00	0.04
566	000050	深天马 A	92,000	796,720.00	0.04
567	600060	海信视	58,700	794,798.00	0.04

		像			
568	601992	金隅集团	312,020	792,530.80	0.04
569	601005	重庆钢铁	501,300	792,054.00	0.04
570	300850	新强联	14,800	788,544.00	0.04
571	603927	中科软	26,600	787,626.00	0.04
572	600511	国药股份	28,200	786,780.00	0.04
573	603218	日月股份	38,600	783,580.00	0.04
574	688065	凯赛生物	12,560	769,802.40	0.04
575	601717	郑煤机	68,900	768,924.00	0.04
576	300251	光线传媒	87,800	760,348.00	0.04
577	600528	中铁工业	99,600	759,948.00	0.04
578	600801	华新水泥	51,000	755,820.00	0.04
579	600201	生物股份	83,800	755,038.00	0.04
580	002939	长城证券	90,600	750,168.00	0.04
581	300168	万达信息	88,900	749,427.00	0.04
582	000021	深科技	70,036	748,684.84	0.04
583	600066	宇通客车	99,459	746,937.09	0.04
584	600566	济川药业	27,407	746,018.54	0.04
585	600171	上海贝岭	42,600	742,518.00	0.04
586	000825	太钢不锈	171,600	741,312.00	0.04
587	002373	千方科技	82,800	738,576.00	0.04
588	600906	财达证券	97,100	735,047.00	0.04
589	600598	北大荒	53,200	732,032.00	0.04
590	600839	四川长虹	276,400	729,696.00	0.04
591	600827	百联股	60,100	728,412.00	0.04

		份			
592	600282	南钢股份	230,600	726,390.00	0.04
593	300677	英科医疗	34,540	726,376.20	0.04
594	600535	天士力	67,300	724,148.00	0.04
595	600970	中材国际	84,800	722,496.00	0.04
596	601866	中远海发	296,600	717,772.00	0.04
597	601665	齐鲁银行	171,400	714,738.00	0.04
598	601778	晶科科技	129,900	714,450.00	0.04
599	002128	电投能源	57,500	709,550.00	0.04
600	300861	美畅股份	14,400	707,904.00	0.04
601	601179	中国西电	153,500	707,635.00	0.04
602	002127	南极电商	147,000	707,070.00	0.04
603	002153	石基信息	47,152	706,808.48	0.04
604	601808	中海油服	42,500	704,650.00	0.04
605	603568	伟明环保	37,975	703,676.75	0.04
606	600498	烽火通信	53,300	700,362.00	0.04
607	000930	中粮科技	83,700	699,732.00	0.04
608	000709	河钢股份	309,400	699,244.00	0.04
609	603000	人民网	41,400	698,418.00	0.04
610	002595	豪迈科技	29,900	692,185.00	0.04
611	000012	南玻 A	102,800	689,788.00	0.04
612	300182	捷成股份	154,100	688,827.00	0.04
613	600398	海澜之家	129,300	685,290.00	0.04
614	600500	中化国	103,444	683,764.84	0.04

		际			
615	002701	奥瑞金	134,800	680,740.00	0.04
616	002019	亿帆医药	55,100	674,975.00	0.04
617	000987	越秀资本	112,605	674,503.95	0.04
618	002985	北摩高科	14,910	672,441.00	0.04
619	002124	天邦食品	110,020	672,222.20	0.04
620	002396	星网锐捷	34,900	668,684.00	0.04
621	600959	江苏有线	224,500	666,765.00	0.04
622	000581	威孚高科	37,500	664,875.00	0.04
623	600895	张江高科	57,923	656,846.82	0.04
624	000598	兴蓉环境	134,100	655,749.00	0.03
625	000401	冀东水泥	79,500	654,285.00	0.03
626	603707	健友股份	36,252	653,986.08	0.03
627	000778	新兴铸管	179,100	653,715.00	0.03
628	300618	寒锐钴业	16,300	652,815.00	0.03
629	300115	长盈精密	62,940	650,170.20	0.03
630	600663	陆家嘴	66,300	645,762.00	0.03
631	002670	国盛金控	86,900	643,929.00	0.03
632	600582	天地科技	123,800	643,760.00	0.03
633	688208	道通科技	20,300	640,465.00	0.03
634	002249	大洋电机	124,600	637,952.00	0.03
635	600718	东软集团	64,100	637,795.00	0.03
636	600297	广汇汽车	303,400	637,140.00	0.03

637	300482	万孚生物	19,870	633,256.90	0.03
638	600507	方大特钢	104,762	630,667.24	0.03
639	002690	美亚光电	26,362	630,051.80	0.03
640	002266	浙富控股	160,700	628,337.00	0.03
641	603225	新凤鸣	57,300	623,424.00	0.03
642	600329	达仁堂	21,400	622,740.00	0.03
643	600517	国网英大	128,100	620,004.00	0.03
644	000883	湖北能源	147,500	619,500.00	0.03
645	002505	鹏都农牧	239,100	616,878.00	0.03
646	603866	桃李面包	39,840	613,536.00	0.03
647	600409	三友化工	92,700	612,747.00	0.03
648	000656	金科股份	319,700	610,627.00	0.03
649	300212	易华录	29,820	608,626.20	0.03
650	601000	唐山港	221,700	607,458.00	0.03
651	600259	广晟有色	15,100	607,020.00	0.03
652	600022	山东钢铁	409,600	606,208.00	0.03
653	002002	鸿达兴业	186,900	605,556.00	0.03
654	600871	石化油服	304,600	603,108.00	0.03
655	000089	深圳机场	76,700	602,862.00	0.03
656	601106	中国一重	204,694	599,753.42	0.03
657	000785	居然之家	146,600	599,594.00	0.03
658	600567	山鹰国际	241,300	598,424.00	0.03
659	600064	南京高科	90,400	597,544.00	0.03
660	300376	易事特	86,900	593,527.00	0.03

661	002468	申通快递	57,300	591,909.00	0.03
662	002429	兆驰股份	169,300	590,857.00	0.03
663	600216	浙江医药	50,500	590,345.00	0.03
664	600782	新钢股份	143,200	585,688.00	0.03
665	000877	天山股份	68,400	582,768.00	0.03
666	002081	金螳螂	119,200	578,120.00	0.03
667	601333	广深铁路	253,700	575,899.00	0.03
668	601718	际华集团	196,600	572,106.00	0.03
669	601187	厦门银行	98,800	566,124.00	0.03
670	600667	太极实业	109,600	565,536.00	0.03
671	601118	海南橡胶	128,100	561,078.00	0.03
672	002010	传化智联	104,900	560,166.00	0.03
673	600062	华润双鹤	31,200	558,168.00	0.03
674	002191	劲嘉股份	77,000	556,710.00	0.03
675	600728	佳都科技	105,300	555,984.00	0.03
676	300463	迈克生物	32,100	555,330.00	0.03
677	600597	光明乳业	51,600	555,216.00	0.03
678	600737	中粮糖业	80,000	555,200.00	0.03
679	000540	中天金融	366,600	553,566.00	0.03
680	000537	广宇发展	41,800	553,014.00	0.03
681	600155	华创阳安	84,600	549,900.00	0.03
682	600376	首开股份	96,500	549,085.00	0.03

683	601156	东航物流	35,600	543,256.00	0.03
684	002745	木林森	66,600	540,126.00	0.03
685	002221	东华能源	70,700	539,441.00	0.03
686	600131	国网信通	36,000	538,560.00	0.03
687	601098	中南传媒	53,800	536,924.00	0.03
688	300072	海新能科	123,100	536,716.00	0.03
689	002416	爱施德	55,700	528,036.00	0.03
690	600967	内蒙一机	63,800	526,988.00	0.03
691	600126	杭钢股份	126,300	521,619.00	0.03
692	000156	华数传媒	69,300	519,057.00	0.03
693	603379	三美股份	18,200	517,972.00	0.03
694	601991	大唐发电	185,500	517,545.00	0.03
695	000800	一汽解放	66,800	516,364.00	0.03
696	603228	景旺电子	25,280	511,667.20	0.03
697	600808	马钢股份	180,900	508,329.00	0.03
698	002048	宁波华翔	36,500	507,350.00	0.03
699	000937	冀中能源	79,300	504,348.00	0.03
700	601568	北元集团	88,940	504,289.80	0.03
701	601236	红塔证券	67,760	501,424.00	0.03
702	002281	光迅科技	31,400	493,608.00	0.03
703	002423	中粮资本	68,900	493,324.00	0.03
704	600901	江苏租赁	89,400	489,912.00	0.03
705	001914	招商积	31,700	487,546.00	0.03

		余			
706	600373	中文传媒	50,700	485,199.00	0.03
707	688289	圣湘生物	22,100	485,095.00	0.03
708	600095	湘财股份	64,100	484,596.00	0.03
709	300630	普利制药	19,552	482,152.32	0.03
710	003035	南网能源	85,000	481,950.00	0.03
711	000559	万向钱潮	98,900	481,643.00	0.03
712	603056	德邦股份	23,000	479,090.00	0.03
713	000898	鞍钢股份	179,400	478,998.00	0.03
714	002434	万里扬	59,000	474,950.00	0.03
715	000402	金融街	89,500	469,875.00	0.03
716	002867	周大生	32,800	460,184.00	0.02
717	603317	天味食品	16,600	456,168.00	0.02
718	600556	天下秀	67,600	455,624.00	0.02
719	601608	中信重工	129,900	453,351.00	0.02
720	601928	凤凰传媒	57,200	453,024.00	0.02
721	601598	中国外运	117,900	452,736.00	0.02
722	601611	中国核建	59,500	452,200.00	0.02
723	000563	陕国投 A	149,100	451,773.00	0.02
724	300257	开山股份	29,700	445,500.00	0.02
725	600707	彩虹股份	107,400	444,636.00	0.02
726	002948	青岛银行	132,000	443,520.00	0.02
727	600195	中牧股份	38,152	443,326.24	0.02
728	000959	首钢股份	117,000	441,090.00	0.02
729	001203	大中矿	33,800	437,034.00	0.02



		业			
730	600968	海油发展	151,500	436,320.00	0.02
731	600167	联美控股	68,400	432,288.00	0.02
732	000967	盈峰环境	95,200	432,208.00	0.02
733	002110	三钢闽光	91,700	430,990.00	0.02
734	603650	彤程新材	13,400	413,122.00	0.02
735	002705	新宝股份	24,700	411,255.00	0.02
736	000415	渤海租赁	185,100	409,071.00	0.02
737	000990	诚志股份	45,500	400,400.00	0.02
738	600307	酒钢宏兴	234,400	386,760.00	0.02
739	002925	盈趣科技	23,390	386,402.80	0.02
740	601828	美凯龙	81,100	380,359.00	0.02
741	002242	九阳股份	22,900	377,392.00	0.02
742	603638	艾迪精密	25,140	375,088.80	0.02
743	600339	中油工程	125,300	373,394.00	0.02
744	600764	中国海防	16,000	367,360.00	0.02
745	000031	大悦城	96,200	361,712.00	0.02
746	002399	海普瑞	28,000	359,800.00	0.02
747	002653	海思科	16,100	358,225.00	0.02
748	600623	华谊集团	56,401	356,454.32	0.02
749	002146	荣盛发展	162,600	352,842.00	0.02
750	600928	西安银行	99,800	351,296.00	0.02
751	601969	海南矿业	46,700	346,047.00	0.02
752	601698	中国卫通	30,300	346,026.00	0.02

753	688088	虹软科技	15,200	342,152.00	0.02
754	600006	东风汽车	59,800	333,684.00	0.02
755	600648	外高桥	27,900	333,405.00	0.02
756	600787	中储股份	64,800	322,056.00	0.02
757	002563	森马服饰	60,500	317,020.00	0.02
758	000961	中南建设	143,200	313,608.00	0.02
759	600377	宁沪高速	37,100	304,962.00	0.02
760	000553	安道麦 A	32,600	295,030.00	0.02
761	601298	青岛港	52,500	294,525.00	0.02
762	600350	山东高速	50,600	287,914.00	0.02
763	000062	深圳华强	23,400	285,714.00	0.02
764	601139	深圳燃气	43,000	281,220.00	0.02
765	002945	华林证券	20,100	264,918.00	0.01
766	601228	广州港	79,000	248,850.00	0.01
767	600299	安迪苏	30,100	248,626.00	0.01
768	001872	招商港口	16,500	236,940.00	0.01
769	601158	重庆水务	43,100	221,103.00	0.01
770	600956	新天绿能	22,700	218,828.00	0.01
771	600917	重庆燃气	23,500	187,060.00	0.01
772	600032	浙江新能	15,600	179,244.00	0.01
773	001227	兰州银行	46,900	176,813.00	0.01

### 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	688506	百利天恒	15,622	385,863.40	0.02
2	688137	近岸蛋白	2,588	179,866.00	0.01
3	688084	晶品特装	1,875	140,118.75	0.01
4	688525	佰维存储	4,614	74,100.84	0.00
5	301267	华夏眼科	1,006	66,597.20	0.00
6	688292	浩瀚深度 信息技术	4,503	66,059.01	0.00
7	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
8	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
9	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
10	301165	锐捷网络	1,077	34,043.97	0.00
11	301301	川宁生物	3,574	26,912.22	0.00
12	301356	天振股份	614	26,604.62	0.00
13	301389	隆扬电子	1,269	21,776.04	0.00
14	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
15	301349	信德新材	180	18,633.60	0.00
16	301363	美好医疗	445	16,843.25	0.00
17	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
18	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
19	301335	天元宠物	420	14,204.40	0.00
20	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
21	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
22	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
23	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
24	301280	珠城科技	279	12,499.20	0.00
25	301365	矩阵股份	516	12,316.92	0.00
26	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
27	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
28	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
29	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
30	301379	天山电子	449	11,058.87	0.00
31	301306	西测测试	255	10,783.95	0.00
32	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
33	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
34	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
35	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
36	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
37	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
38	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
39	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
40	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00

41	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
42	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
43	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
44	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	16,284,787.00	0.77
2	000792	盐湖股份	12,792,168.37	0.60
3	000858	五粮液	7,288,796.00	0.34
4	600089	特变电工	6,660,596.00	0.31
5	002594	比亚迪	6,490,289.00	0.31
6	000333	美的集团	5,724,430.04	0.27
7	300059	东方财富	5,683,879.20	0.27
8	000725	京东方 A	4,411,287.00	0.21
9	002920	德赛西威	3,949,175.89	0.19
10	002074	国轩高科	3,826,581.31	0.18
11	002352	顺丰控股	3,818,448.00	0.18
12	300496	中科创达	3,694,002.00	0.17
13	300661	圣邦股份	3,623,763.00	0.17
14	002475	立讯精密	3,596,326.00	0.17
15	300760	迈瑞医疗	3,462,044.00	0.16
16	002415	海康威视	3,455,113.00	0.16
17	000733	振华科技	3,423,773.00	0.16
18	002340	格林美	3,405,268.20	0.16
19	601728	中国电信	3,356,245.00	0.16
20	000651	格力电器	3,301,921.25	0.16

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	11,715,666.00	0.55
2	600519	贵州茅台	7,090,310.00	0.34
3	000858	五粮液	6,256,436.89	0.30

4	002594	比亚迪	5,577,598.00	0.26
5	000333	美的集团	4,858,544.00	0.23
6	300059	东方财富	4,152,987.60	0.20
7	600256	广汇能源	3,963,903.00	0.19
8	600522	中天科技	3,725,164.00	0.18
9	000733	振华科技	3,551,931.00	0.17
10	601318	中国平安	3,385,471.00	0.16
11	000651	格力电器	3,384,897.00	0.16
12	600036	招商银行	3,257,861.00	0.15
13	300760	迈瑞医疗	3,065,767.00	0.14
14	002475	立讯精密	2,990,037.17	0.14
15	002340	格林美	2,927,797.00	0.14
16	002415	海康威视	2,869,985.00	0.14
17	002371	北方华创	2,748,169.00	0.13
18	600732	爱旭股份	2,686,011.00	0.13
19	002460	赣锋锂业	2,559,964.00	0.12
20	002714	牧原股份	2,514,627.00	0.12

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	573,447,420.00
卖出股票收入（成交）总额	431,397,098.58

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，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投资。

## 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投资。

## 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则,以套期保值为目的,主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约,以降低交易成本,提高投资效率,从而更好地跟踪标的指数。

## 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

注:本基金本报告期末未投资国债期货。

## 8.12 投资组合报告附注

### 8.12.1

本基金投资的前十名证券的发行主体中,招商银行股份有限公司、兴业银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

### 8.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

### 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	6,905,655.01
2	应收清算款	15,120,161.65
3	应收股利	10,409.12
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	33,615.61
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	22,069,841.39

### 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	占基金资产	流通受限
----	------	------	----------	-------	------

			允价值	净值比例 (%)	情况说明
1	600900	长江电力	420,000.00	0.02	转融通出借流通受限
2	601166	兴业银行	351,800.00	0.02	转融通出借流通受限

### 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	688506	百利天恒	385,863.40	0.02	新股流通受限
2	688137	近岸蛋白	179,866.00	0.01	新股流通受限
3	688084	晶品特装	140,118.75	0.01	新股流通受限
4	301267	华夏眼科	66,597.20	0.00	新股流通受限

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		平安银行股份有限公司—汇添富中证 800 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 (%)
3,743	466,320.38	1,571,643,633.00	90.04	173,793,565.00	9.96	48,610,000.00	2.78

注：机构投资者“持有份额”和“占总份额比例”数据中包含“汇添富中证 800 交易型开

放式指数证券投资基金联接基金”的“持有份额”和“占总份额比例”数据。

## 9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例（%）
1	中央汇金资产管理 有限责任公司	1,307,627,911.00	74.92
2	光大理财有限责 任公司—阳光橙增盈 绝对收益策略	77,757,200.00	4.45
3	张虹	75,136,019.00	4.30
4	太平养老金溢鑫混 合型养老金产品— 招商银行股份有限公司	26,751,400.00	1.53
5	香港中央结算有限 公司	25,050,500.00	1.44
6	国泰君安证券股份 有限公司	11,075,800.00	0.63
7	华泰证券股份有限 公司	6,713,086.00	0.38
8	广发证券股份有限 公司	6,675,090.00	0.38
9	招商银行股份有限公司—广发养老目 标日期 2040 三年持 有期混合型发起式 基金中基金（FOF）	6,251,700.00	0.36
10	中信建投证券股份 有限公司	6,174,857.00	0.35
11	平安银行股份有限 公司—汇添富中证 800 交易型开放式指 数证券投资基金联 接基金	48,610,000.00	2.78

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

注：期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

## 9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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



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

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019年10月08日） 基金份额总额	6,601,437,198.00
本报告期期初基金份额总额	1,589,437,198.00
本报告期基金总申购份额	420,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	264,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	1,745,437,198.00

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内无基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产的重大诉讼事项。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）自本基金合同生效日（2019年10月08日）起至本报告期末，为本基金进行审计。本报告期内应付未付的审计费用为人民币90,000.00元。

### 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人及相关高级管理人员
受到稽查或处罚等措施的时间	2022 年 08 月 04 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会上海监管局
受到的具体措施类型	警示函行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	对某单一资管计划投资者，未及时提供信息披露文件
管理人采取整改措施的情况	公司已完成整改并通过监管验收
其他	无

注：报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查、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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
中泰证券	1	326,326,437.00	33.68	104,288.74	20.23	
海通证券	2	260,300,442.21	26.86	135,549.38	26.30	
东方证券	2	218,866,676.44	22.59	157,724.18	30.60	
兴业证券	3	163,428,012.97	16.87	117,888.30	22.87	
广发证券	2	-	-	-	-	
华泰	2	-	-	-	-	

证券						
中信 证券	1	-	-	-	-	

注:此处的佣金指通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该券商的佣金合计,不单指股票交易佣金。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位:人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期基金成交总额的比例 (%)
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	528,358.24	8.30	-	-	-	-	-	-
东方证券	1,469,970.11	23.09	-	-	-	-	-	-
兴业证券	4,369,044.37	68.62	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

注:1、专用交易单元的选择标准和程序:

- (1) 基金交易单元选择和成交量的分配工作由投资研究部统一负责组织、协调和监督。
- (2) 交易单元分配的目标是按照证监会的有关规定和对券商服务的评价控制交易单元的分配比例。
- (3) 投资研究部根据评分的结果决定本月的交易单元分配比例。其标准是按照上个月券商评分决定本月的交易单元拟分配比例,并在综合考察年度券商的综合排名及累计的交易分配量的基础上进行调整,使得总的交易量的分配符合综合排名,同时每个交易单元的分配量不超过总成交量的 30%。

(4) 每半年综合考虑近半年及最新的评分情况，作为增加或更换券商交易单元的依据。

(5) 调整租用交易单元的选择及决定交易单元成交量的分布情况由投资研究部决定，投资总监审批。

(6) 成交量分布的决定应于每月第一个工作日完成；更换券商交易单元的决定于合同到期前一个月完成。

(7) 调整和更换交易单元所涉及到的交易单元运行费及其他相关费用，基金会计应负责协助及时催缴。

(8) 按照《关于基金管理公司向会员租用交易单元有关事项的通知》规定，同一基金管理公司托管在同一托管银行的基金可以共用同一交易单元进行交易。

## 2、报告期内租用证券公司交易单元的变更情况：

本基金本报告期内新增 1 家证券公司的 1 个交易单元：兴业证券（上交所单元）。

## 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	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 01 日
2	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年第 4 季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 01 月 24 日
3	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加开源证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 08 日
4	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2021 年年度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 03 月 31 日
5	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 01 日
6	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第一季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 04 月 22 日
7	汇添富基金管理股份有限公司关	上交所, 上证报, 公司	2022 年 06 月 20 日

	于旗下的上海证券交易所 ETF 实施申赎业务多码合一的公告	网站, 中国证监会基金电子披露网站	
8	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加东吴证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 06 月 27 日
9	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第二季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 07 月 21 日
10	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年中期报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 08 月 31 日
11	关于防范不法分子冒用汇添富基金名义进行非法活动的重要提示	公司网站	2022 年 09 月 21 日
12	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加国信证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 09 月 30 日
13	汇添富基金管理股份有限公司旗下部分基金更新招募说明书及基金产品资料概要	上交所, 公司网站, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 21 日
14	汇添富基金管理股份有限公司旗下基金 2022 年第三季度报告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 10 月 26 日
15	汇添富基金管理股份有限公司关于旗下部分基金增加平安证券为申购赎回代理券商的公告	上交所, 上证报, 公司网站, 深交所, 中国证监会基金电子披露网站	2022 年 12 月 30 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者超过 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)

		或者 超过 20%的 时间 区间					
机构	1	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	1,307,627,911.00	-	-	1,307,627,911.00	74.92
产品特有风险							
<p>1、持有人大会投票权集中的风险 当基金份额集中度较高时，少数基金份额持有人所持有的基金份额占比较高，其在召开持有人大会并对审议事项进行投票表决时可能拥有较大话语权。</p> <p>2、基金规模较小导致的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致基金规模较小，基金持续稳定运作可能面临一定困难。本基金管理人将继续勤勉尽责，执行相关投资策略，力争实现投资目标。</p> <p>3、提前终止基金合同的风险 持有基金份额比例较高的投资者集中赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模长期低于 5000 万元，进而可能导致本基金终止、转换运作方式或其他基金合并。</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、中国证监会批准中证 800 交易型开放式指数证券投资基金募集的文件；
- 2、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《中证 800 交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内中证 800 交易型开放式指数证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告；
- 6、中国证监会要求的其他文件。

### 13.2 存放地点

上海市黄浦区外马路 728 号

汇添富基金管理股份有限公司

### 13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 [www.99fund.com](http://www.99fund.com) 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-888-9918 查询相关信息。

汇添富基金管理股份有限公司

2023 年 03 月 31 日