

**华夏创业板动量成长交易型开放式指数  
证券投资基金  
2023 年中期报告  
2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

## §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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	150
7.1 期末基金资产组合情况.....	150
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	150
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	151
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	153
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	154
7.6 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.....	154
7.7 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.....	154
7.8 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.....	154
7.9 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.....	154
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	154
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	155
7.12 投资组合报告附注.....	155
§8 基金份额持有人信息.....	156
§9 开放式基金份额变动.....	157
§10 重大事件揭示.....	158
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	160
§12 备查文件目录.....	160

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏创成长 ETF
场内简称	创业板成长 ETF
基金主代码	159967
交易代码	159967
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019 年 6 月 21 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,847,705,811.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019 年 7 月 15 日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	主要投资策略包括组合复制策略、替代性策略、存托凭证投资策略、衍生品投资策略、债券投资策略等。
业绩比较基准	创业板动量成长指数收益率。
风险收益特征	本基金为股票基金，其预期风险和预期收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		华夏基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	秦一楠
	联系电话	400-818-6666	010-66060069
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		400-818-6666	95599
传真		010-63136700	010-68121816
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		北京市西城区金融大街33号通泰大厦B座8层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		100033	100031
法定代表人		杨明辉	谷澍

### 2.5 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	《上海证券报》
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.ChinaAMC.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和/或基金托管人的住所/办公地址

## 2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
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 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	-348,145,816.58
本期利润	-148,130,089.83
加权平均基金份额本期利润	-0.0235
本期加权平均净值利润率	-4.22%
本期基金份额净值增长率	-5.07%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023年6月30日)
期末可供分配利润	992,583,902.66
期末可供分配基金份额利润	0.1450
期末基金资产净值	3,652,584,118.01
期末基金份额净值	0.5334
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023年6月30日)
基金份额累计净值增长率	94.07%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	1.33%	1.59%	0.87%	1.59%	0.46%	0.00%
过去三个	-4.48%	1.23%	-5.23%	1.23%	0.75%	0.00%

月						
过去六个月	-5.07%	1.12%	-5.80%	1.12%	0.73%	0.00%
过去一年	-22.65%	1.29%	-23.03%	1.30%	0.38%	-0.01%
过去三年	10.12%	1.92%	8.92%	1.93%	1.20%	-0.01%
自基金合同生效起至今	94.07%	1.86%	95.90%	1.87%	-1.83%	-0.01%

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

华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金

份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年6月21日至2023年6月30日)



## §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

华夏基金管理有限公司成立于1998年4月9日，是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管理公司之一。公司总部设在北京，在北京、上海、深圳、成都、南京、杭州、广州、青岛、武汉、沈阳设有分公司，在香港、深圳、上海设有子公司。公司是首批全国社保基金管理人、首批企业年

金基金管理人、境内首批 QDII 基金管理人、境内首只 ETF 基金管理人、境内首只沪港通 ETF 基金管理人、首批内地与香港基金互认基金管理人、首批基本养老保险基金投资管理人资格、首家加入联合国责任投资原则组织的公募基金公司、首批公募 FOF 基金管理人、首批公募养老目标基金管理人、首批个人养老金基金管理人、境内首批中日互通 ETF 基金管理人、首批商品期货 ETF 基金管理人、首批公募 MOM 基金管理人、首批纳入互联互通 ETF 基金管理人、首批北交所主题基金管理人以及特定客户资产管理人、保险资金投资管理人、公募 REITs 管理人，国内首家承诺“碳中和”具体目标和路径的公募基金公司，香港子公司是首批 RQFII 基金管理人。华夏基金是业务领域最广泛的基金管理公司之一。

华夏基金是境内 ETF 基金资产管理规模最大的基金管理公司之一，在 ETF 基金管理方面积累了丰富的经验，形成了覆盖大盘蓝筹、宽基指数、中小创指数、主题指数、行业指数、SmartBeta 策略、海外市场指数、信用债指数、商品指数等较为完整的产品线。

华夏基金以深入的投资研究为基础，尽力捕捉市场机会，为投资人谋求良好的回报。根据银河证券基金研究中心《中国基金业绩评价报告》，截至 2023 年 6 月 30 日，华夏基金旗下多只产品近 1 年同类排名领先（基金排名不作为产品未来表现的保证），其中：

主动权益产品：在养老目标风险 FOF(权益资产 0-30%)(A 类)中，华夏保守养老一年持有混合 (FOF) (A 类)排名第 1/59；在对冲策略绝对收益目标基金(A 类)中，华夏安泰对冲策略 3 个月定开混合排名第 1/22；在汽车主题行业偏股型基金(A 类)中，华夏新能源车龙头混合发起式(A 类)排名第 1/11；在低碳环保行业股票型基金(A 类)中，华夏节能环保股票(A 类)排名第 2/10；在消费行业偏股型基金(A 类)中，华夏网购精选混合(A 类)排名第 2/66、华夏新兴消费混合(A 类)排名第 9/66；在 QDII 混合基金(A 类)中，华夏全球科技先锋混合 (QDII) 排名第 3/43；在偏债型基金(A 类)中，华夏磐泰混合 (LOF) (A 类)排名前 2%(13/619)、华夏睿磐泰盛混合排名前 3%(19/619)、华夏永利一年持有混合(A 类)排名前 10%(61/619)；在灵活配置型基金(基准股票比例 30%-60%)(A 类)中，华夏稳增混合排名前 3%(14/440)、华夏新锦绣混合(A 类)排名前 4%(18/440)；在标准股票型基金(A 类)中，华夏智胜先锋股票 (LOF) (A 类)排名前 4%(13/317)、华夏智胜价值成长股票(A 类)排名前 6%(20/317)；在偏股型基金(股票上限 95%)(A 类)中，华夏磐利一年定开混合(A 类)排名前 5%(11/214)、华夏磐锐一年定开混合(A 类)排名前 10%(21/214)；在偏股型基金(股票上下限 60%-95%)(A 类)中，华夏核心制造混合(A 类)排名前 9%(126/1403)、华夏价值精选混合排名前 9%(133/1403)。

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第 1/24、华夏收益债券 (QDII) (A 类)排名第 3/24；在短期纯债债券型基金(A 类)中，华夏 30 天滚动短债债券发起式(A 类)排名第 8/108；在长期纯债债券型基金(A 类)中，华夏鼎隆债券(A 类)排名前

6%(71/1228)、华夏鼎航债券(A类)排名前 6%(76/1228)、华夏鼎英债券(A类)排名前 7%(87/1228); 在普通债券型基金(可投转债)(A类)中, 华夏鼎禄三个月定开债券(A类)排名前 9%(32/376); 在普通债券型基金(二级)(A类)中, 华夏恒融债券排名前 8%(30/368)。

指数与量化产品: 在增强规模指数股票型基金(A类)中, 华夏中证 500 指数增强(A类)排名第 1/132、华夏中证 500 指数智选增强(A类)排名第 2/132; 在主题指数股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏中证动漫游戏 ETF 发起式联接(A类)排名第 1/110; 在信用债指数债券型基金(A类)中, 华夏亚债中国指数(A类)排名第 2/16; 在 QDII 跨境股票 ETF 基金中, 华夏纳斯达克 100ETF (QDII) 排名第 2/33、华夏野村日经 225ETF 排名第 7/33; 在 QDII 跨境股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏恒生 ETF 联接(A类)排名第 3/10; 在主题指数股票 ETF 基金中, 华夏中证动漫游戏 ETF 排名第 1/313、华夏中证云计算与大数据主题 ETF 排名第 6/313、华夏中证大数据产业 ETF 排名前 5%(15/313)、华夏中证文化传媒 ETF 排名前 6%(18/313)、华夏中证金融科技主题 ETF 排名前 10%(30/313); 在规模指数股票 ETF 基金中, 华夏沪港通恒生 ETF 排名第 4/136; 在规模指数股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏沪港通恒生 ETF 联接(A类)排名第 4/102; 在行业指数股票 ETF 联接基金(A类)中, 华夏中证银行 ETF 联接(A类)排名第 6/30。

在《中国证券报》第十九届中国基金业金牛奖评选中, 华夏基金荣获“被动投资金牛基金公司”, 成为业内连续 7 年获此殊荣的基金公司。在证券时报主办的第十八届中国基金业明星基金奖评选活动中, 华夏基金凭借卓越的投资实力以及优秀的中长期业绩回报, 将两大奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“三年期海外投资明星基金公司”; 产品层面, 华夏沪深 300ETF 荣获“三年持续回报指数型明星基金奖”。在《上海证券报》主办的第十九届“金基金”奖评选活动中, 华夏基金将三大金基金奖项收入囊中: 公司层面, 华夏基金荣获“金基金·被动投资基金管理公司奖”; 产品层面, 华夏能源革新股票荣获“金基金·投资回报基金奖”, 华夏沪深 300ETF 荣获“金基金·指数基金三年期奖”。

在客户服务方面, 2023 年上半年, 华夏基金继续以客户需求为导向, 努力提高客户使用的便利性和服务体验: (1) 华夏基金直销渠道优化页面显示, 升级搜索及查询功能, 给客户更方便直观的使用体验; (2) 华夏基金管家客户端优化“忘记密码”功能及定投模块, 从客户投资需求出发, 进一步提升操作体验; (3) 与华润银行等代销机构合作, 拓展更加丰富的客户理财渠道; (4) 开展“帮你问了 ChatGPT”、“华夏基金户口本”、“指数攻防值来啦!”、“亲子财商 36 计”等活动, 为客户提供了多样化的投资者教育和关怀服务。

#### 4.1.2 基金经理 (或基金经理小组) 及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限	证券从业年限	说明
----	----	-------------------	--------	----

		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2019-06-21	-	13 年	<p>硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金（LOF）基金经理（2016 年 10 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接</p>

					基金基金经理（2019年6月26日至2022年8月22日期间）、华夏饲料豆粕期货交易所开放式证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020年1月13日至2022年8月22日期间）、华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2020年2月25日至2022年8月22日期间）、华夏粤港澳大湾区创新100交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2020年4月29日至2022年8月22日期间）等。
--	--	--	--	--	---

注：①上述“任职日期”和“离任日期”为根据公司决定确定的聘任日期和解聘日期。首任基金经理的，其“任职日期”为基金合同生效日。

②证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、《基金管理公司开展投资、研究活动防控内幕交易指导意见》等法律法规和基金合同，本着诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在严格控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《华夏基金管理有限公司公平交易制度》的规定。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易共有90次，均为指数量化投资组合因投资策略需要和其他组合发生的反向交易。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为创业板动量成长指数，创业板动量成长指数反映创业板中成长能力良好、动量效应显著的上市公司整体运行情况。截至 2023 年 6 月 30 日，创业板动量成长指数成份股 50 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

上半年，国内先后经历需求释放以及去库存带来的需求回落，流动性充裕。权益市场赚钱难度较大，一方面，去库存阶段使然，另一方面，缺乏能够短期兑现利润的超预期产业趋势。值得一提的是 AI 方向，正在发生长期变革性的产业变化，产业链涉及硬件和软件，并可渗透至社会的各行各业。目前处于发展早期，个股波动较大。商品市场，在上半年整体经历了去库存，在二季度有企稳迹象。稳定性最高是黄金，既有全球央行储备换锚的大趋势，又可以对冲外汇风险。

基金投资运作方面，作为被动指数基金，本基金主要采取复制指数的投资策略，报告期内，本基金在做好跟踪标的指数的基础上，认真应对投资者日常申购、赎回、成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经深圳证券交易所同意，部分证券公司被确认为本基金的流动性服务商。目前，本基金的流动性服务商包括中信证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司等。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 6 月 30 日，本基金份额净值为 0.5334 元，本报告期份额净值增长率为-5.07%，同期业绩比较基准增长率-5.80%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.73%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，国内中性概率的宏观场景是库存周期见底，经济在复苏象限运行，流动性整体充裕。权益资产处于估值较低、胜率有望改善的状态，大概率继续呈现结构性轮动走势，下半年表现好于上半年的概率较大。产业趋势边际变化最大的仍然是 AI 方向，围绕产业链的软硬件均值得持续跟踪；此外，宏观经济相关性高的顺周期方向也需要保持关注。商品方面，美元信用可靠性下降，黄金具备长期配置价值。

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

珍惜基金份额持有人的每一份投资和每一份信任，本基金将继续奉行华夏基金管理有限公司“为信任奉献回报”的经营理念，规范运作，审慎投资，勤勉尽责地为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

## §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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人—华夏基金管理有限公司 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为，华夏基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 中期报告财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	5,384,919.39	13,476,489.31
结算备付金		8,306,274.91	2,732,841.21
存出保证金		1,383,008.11	2,006,696.47
交易性金融资产	6.4.7.2	3,641,575,813.52	3,318,831,670.23
其中：股票投资		3,641,575,813.52	3,318,831,670.23
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		432,132.48	273,382.39
应收股利		25,538.40	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	111,941.75	205,084.84
资产总计		3,657,219,628.56	3,337,526,164.45
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2022 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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		1,531,724.29	1,397,823.72
应付托管费		306,344.87	279,564.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-

应交税费		16,398.54	22,481.18
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	2,781,042.85	2,063,704.59
负债合计		4,635,510.55	3,763,574.23
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	1,882,074,011.27	1,630,698,596.29
未分配利润	6.4.7.8	1,770,510,106.74	1,703,063,993.93
净资产合计		3,652,584,118.01	3,333,762,590.22
负债和净资产总计		3,657,219,628.56	3,337,526,164.45

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.5334 元，基金份额总额 6,847,705,811.00 份。

## 6.2 利润表

会计主体：华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-137,024,981.49	-361,762,447.87
1.利息收入		3,593,987.63	1,976,006.56
其中：存款利息收入	6.4.7.9	126,847.46	130,816.91
债券利息收入		-	-
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		3,467,140.17	1,845,189.65
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-340,547,981.71	-659,783,162.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-361,354,072.23	-668,256,367.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	869,944.55	238,070.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.13	-169,075.71	-1,818,592.48
股利收益	6.4.7.14	20,105,221.68	10,053,725.71
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	200,015,726.75	296,288,853.16
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-86,714.16	-244,144.65

<b>减：二、营业总支出</b>		11,105,108.34	9,795,948.64
1.管理人报酬		8,713,593.26	7,679,530.07
2.托管费		1,742,718.66	1,535,906.04
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	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		12,489.88	6,643.02
8.其他费用	6.4.7.18	636,306.54	573,869.51
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-148,130,089.83	-371,558,396.51
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-148,130,089.83	-371,558,396.51
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-148,130,089.83	-371,558,396.51

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合 收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	1,630,698,596.29	-	1,703,063,993.93	3,333,762,590.22
二、本期期初净资产（基金净值）	1,630,698,596.29	-	1,703,063,993.93	3,333,762,590.22
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	251,375,414.98	-	67,446,112.81	318,821,527.79
（一）、综合收益总额	-	-	-148,130,089.83	-148,130,089.83
（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）	251,375,414.98	-	215,576,202.64	466,951,617.62
其中：1.基金申购	2,034,365,347.51	-	2,047,862,775.93	4,082,228,123.44

款				
2.基金赎回款	-1,782,989,932.53	-	-1,832,286,573.29	-3,615,276,505.82
(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)	1,882,074,011.27	-	1,770,510,106.74	3,652,584,118.01
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	实收基金	其他综合收益(若有)	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,123,275,360.73	-	2,113,942,606.63	3,237,217,967.36
二、本期期初净资产(基金净值)	1,123,275,360.73	-	2,113,942,606.63	3,237,217,967.36
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	234,554,755.92	-	-64,842,389.93	169,712,365.99
(一)、综合收益总额	-	-	-371,558,396.51	-371,558,396.51
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	234,554,755.92	-	306,716,006.58	541,270,762.50
其中：1.基金申购款	1,779,252,010.27	-	2,339,431,785.74	4,118,683,796.01
2.基金赎回款	-1,544,697,254.35	-	-2,032,715,779.16	-3,577,413,033.51
(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)	1,357,830,116.65	-	2,049,100,216.70	3,406,930,333.35

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4，财务报表由下列负责人签署：

基金管理人负责人：杨明辉，主管会计工作负责人：朱威，会计机构负责人：朱威

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）已获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]562号《关于准予华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》，由华夏基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金销售管理办法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规负责公开募集。本基金为交易型开放式，存续期限为不定期。本基金自2019年5月6日至2019年6月14日共募集391,318,552.00元（不含认购资金利息），业经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）安永华明（2019）验字第60739337\_A50号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年6月21日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为391,335,149.00份基金份额，其中认购资金利息折合16,597.00份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《华夏基金管理有限公司关于华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金基金份额拆分结果的公告》，基金管理人以2020年11月5日为权益登记日对本基金基金份额进行了拆分，拆分比例为3.638390940。拆分前基金份额总额为466,335,149份，拆分后基金份额总额为1,696,705,811份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和本基金基金合同的有关规定，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，基金还可投资于非成份股、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、股指期货、股票期权、国债期货、货币市场工具（含同业存单）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金投资范围中的股票包含存托凭证。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部颁布和修订的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、中国证监会发布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》和中国证监会、中国基金业协会允许的如财务报表附注6.4.4所列示的基金行业实务操作的有关规定编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 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本报告期末的财务状况以及本报告期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期无会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 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。

#### 6.4.6 税项

根据财税[2004]78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2005]103 号《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、财税[2008]1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81 号《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2015]101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]125 号《财政部、国家税务总局、证监会关于内地与香港基金互认有关税收政策的通知》、财税[2016]36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46 号《财政部、国家税务总局关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70 号《财政部、国家税务总局关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]140 号《关于明确金融房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2 号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于增值税征收范围，不征收增值税。

(2) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳

增值税。

(3) 基金买卖股票、债券的差价收入免征增值税，暂不征收企业所得税。

(4) 存款利息收入不征收增值税。

(5) 国债、地方政府债利息收入，金融同业往来利息收入免征增值税。

(6) 对基金取得的债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(7) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金等对价暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(8) 对基金在境内取得的股票的股息、红利收入，由上市公司在向基金派发股息、红利收入时代扣代缴 20% 的个人所得税，暂不征收企业所得税。基金在境内从上市公司分配取得的股息红利所得，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，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，减按 50% 计入应纳税所得额，持股期限超过 1 年的，暂免征收个人所得税。对基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称“中国结算”）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通/深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对香港市场投资者取得的股息、红利收入按照 10% 的税率代扣所得税。

(9) 基金在境内卖出股票按 0.1% 的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(10) 基金在境外证券交易所进行交易或取得的源自境外证券市场的收益，其涉及的税收政策，按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

(11) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%、2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	5,384,919.39
等于：本金	5,384,023.51
加：应计利息	895.88

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	5,384,919.39

## 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	3,548,111,424.50	-	3,641,575,813.52	93,464,389.02
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	3,548,111,424.50	-	3,641,575,813.52	93,464,389.02

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	4,731,120.00	-	-	-
其中：股指期货	4,731,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	4,731,120.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2312	沪深 300 期货 IF2312 合约	4	4,616,640.00	-114,480.00
合计	-	-	-	-114,480.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-114,480.00
净额	-	-	-	-

注：衍生金融资产项下的利率/权益/其他衍生工具为国债/股指/商品期货投资，净额为 0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指/商品/国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指/商品/国债期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间抵销后的净额为 0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	111,941.75
待摊费用	-
合计	111,941.75

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 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	1,697,441.49

其中：交易所市场	1,697,441.49
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
应付指数使用费	522,815.62
应退替代款	92,780.30
可退替代款	258,909.50
合计	2,781,042.85

## 6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,933,105,811.00	1,630,698,596.29
本期申购	7,401,800,000.00	2,034,365,347.51
本期赎回（以“-”号填列）	-6,487,200,000.00	-1,782,989,932.53
本期末	6,847,705,811.00	1,882,074,011.27

## 6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,153,608,785.23	549,455,208.70	1,703,063,993.93
本期利润	-348,145,816.58	200,015,726.75	-148,130,089.83
本期基金份额交易产生的变动数	187,120,934.01	28,455,268.63	215,576,202.64
其中：基金申购款	1,349,524,253.55	698,338,522.38	2,047,862,775.93
基金赎回款	-1,162,403,319.54	-669,883,253.75	-1,832,286,573.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	992,583,902.66	777,926,204.08	1,770,510,106.74

## 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	活期存款利息收入	51,748.88
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	68,590.42	
其他	6,508.16	
合计	126,847.46	

## 6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-338,362,864.36
股票投资收益——赎回差价收入	-22,991,207.87
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-361,354,072.23

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出股票成交总额	2,193,350,239.79
减：卖出股票成本总额	2,527,222,366.73
减：交易费用	4,490,737.42
买卖股票差价收入	-338,362,864.36

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
赎回基金份额对价总额	3,615,276,505.82
减：现金支付赎回款总额	58,528,679.82
减：赎回股票成本总额	3,579,739,033.87
减：交易费用	-
赎回差价收入	-22,991,207.87

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
----	----------------------------

债券投资收益——利息收入	394.80
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	869,549.75
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	869,944.55

## 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	3,556,198.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,686,100.00
减：应计利息总额	406.64
减：交易费用	141.98
买卖债券差价收入	869,549.75

## 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

## 6.4.7.13 衍生工具收益

## 6.4.7.13.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.13.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-169,075.71

## 6.4.7.14 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	20,105,221.68
其中：证券出借权益补偿收入	840,383.67
基金投资产生的股利收益	-
合计	20,105,221.68

## 6.4.7.15 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
1.交易性金融资产	199,768,746.75
——股票投资	199,768,746.75
——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	246,980.00
——权证投资	-
——期货投资	246,980.00
4.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	200,015,726.75

#### 6.4.7.16 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
基金赎回费收入	-
替代损益	-86,714.16
合计	-86,714.16

#### 6.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.18 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	4,394.98
指数使用费	522,815.62
合计	636,306.54

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据华夏基金管理有限公司于 2023 年 1 月 6 日发布的公告，华夏基金管理有限公司股权结构变更为中信证券（出资比例 62.2%）、MACKENZIE FINANCIAL CORPORATION（出资比例 27.8%）、天津海鹏科技咨询有限公司（出资比例 10%）。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏创业板动量成长 ETF 发起式联接”）	该基金是本基金的联接基金
中信证券股份有限公司（“中信证券”）	基金管理人的股东
中信中证资本管理有限公司（“中信中证资本”）	基金管理人第一大股东的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
中信证券	3,626,523,321.47	80.51%	-	-

##### 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
中信证券	3,556,198.37	100.00%	-	-

##### 6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30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
中信证券	1,564,131.93	80.51%	1,318,782.09	77.69%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
中信证券	-	-	-	-

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。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	8,713,593.26	7,679,530.07

注：①支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金管理人报酬计算公式为：日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月 30日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30 日
当期发生的基金应支付的托管费	1,742,718.66	1,535,906.04

注：①支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

②基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 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

##### 6.4.10.4.1 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

因 2023 年注册制全面改革，自实施起没有与关联方通过约定方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 6.4.10.4.2 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 2023年1月1日至2023年6月30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
中信证券	2023010300001270	鼎龙股份	2023-01-03	217,600.00	10,000.00	14.00	3.10	262.33	-	-
中信证券	2023010300001277	鹏辉能源	2023-01-03	2,078,720.00	25,600.00	14.00	2.90	2,344.33	-	-
中信证券	2023010300001278	星源材质	2023-01-03	1,602,216.00	74,800.00	14.00	9.80	6,106.22	-	-
中信证券	2023010300001279	乐普医疗	2023-01-03	231,600.00	10,000.00	14.00	3.50	315.23	-	-
中信证券	2023010300001283	天壕能源	2023-01-03	121,800.00	10,000.00	28.00	2.80	265.25	-	-
中信证	2023010300034837	天壕能	2023-01-03	1,988,994.00	163,300.00	14.00	3.20	2,475.19	-	-

券		源									
中信证券	202301030003 6925	蓝晓科技	2023-01 -03	633,600.0 0	9,000.0 0	14.0 0	3.30	813.12	-	-	
中信证券	202301030003 6937	锦浪科技	2023-01 -03	2,325,888. 00	12,800. 00	14.0 0	3.30	2,984.8 9	-	-	
中信证券	202301030003 7253	圣邦股份	2023-01 -03	3,592,260. 00	21,000. 00	7.00	3.30	2,305.0 3	-	-	
中信证券	202301030004 0357	天壕能源	2023-01 -03	121,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	151.57	-	-	
中信证券	202301030004 0367	亿纬锂能	2023-01 -03	1,749,400. 00	20,000. 00	14.0 0	2.30	1,564.7 4	-	-	
中信证券	202301030004 0371	新莱应材	2023-01 -03	1,325,376. 00	19,200. 00	14.0 0	3.60	1,855.5 3	-	-	
中信证券	202301040000 1365	鼎龙股份	2023-01 -04	70,917.00	3,300.0 0	14.0 0	3.10	85.49	-	-	
中信证券	202301040000 1368	江丰电子	2023-01 -04	694,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,269.9 4	-	-	
中信证券	202301040000 1375	乐普医疗	2023-01 -04	228,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	311.01	-	-	
中信证券	202301040000 1390	鹏辉能源	2023-01 -04	329,826.0 0	4,200.0 0	14.0 0	2.90	371.97	-	-	
中信证	202301040001 8128	江丰电	2023-01 -04	972,720.0 0	14,000. 00	14.0 0	3.80	1,437.4 6	-	-	

券		子								
中信证券	202301040001 8218	锦浪科技	2023-01 -04	1,949,250. 00	11,300. 00	14.0 0	3.30	2,501.5 4	-	-
中信证券	202301040001 8242	锦浪科技	2023-01 -04	207,000.0 0	1,200.0 0	14.0 0	3.30	265.65	-	-
中信证券	202301040001 8244	南大光电	2023-01 -04	1,535,490. 00	51,700. 00	14.0 0	3.40	2,030.2 6	-	-
中信证券	202301040001 8252	翰宇药业	2023-01 -04	911,500.0 0	50,000. 00	14.0 0	3.60	1,276.1 0	-	-
中信证券	202301040001 8258	鼎龙股份	2023-01 -04	214,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	275.79	-	-
中信证券	202301040001 8260	乐普医疗	2023-01 -04	228,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	284.36	-	-
中信证券	202301040001 8262	亿纬锂能	2023-01 -04	4,204,000. 00	50,000. 00	14.0 0	2.30	3,760.2 4	-	-
中信证券	202301040002 0854	天壕能源	2023-01 -04	118,600.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	147.59	-	-
中信证券	202301040002 0878	锦浪科技	2023-01 -04	690,000.0 0	4,000.0 0	14.0 0	3.30	885.50	-	-
中信证券	202301040002 1080	翰宇药业	2023-01 -04	1,093,800. 00	60,000. 00	14.0 0	3.60	1,531.3 2	-	-
中信证	202301040002 1242	天壕能	2023-01 -04	118,600.0 0	10,000. 00	7.00	3.30	76.10	-	-

券		源								
中信证券	202301040002 1292	锦浪科技	2023-01 -04	2,363,250. 00	13,700. 00	7.00	3.40	1,562.3 7	-	-
中信证券	202301050000 1831	东方日升	2023-01 -05	257,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	320.44	-	-
中信证券	202301050000 1838	鹏辉能源	2023-01 -05	184,874.0 0	2,300.0 0	14.0 0	2.90	208.50	-	-
中信证券	202301050001 4361	东方日升	2023-01 -05	257,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	320.44	-	-
中信证券	202301050001 5881	星源材质	2023-01 -05	1,703,944. 00	74,800. 00	14.0 0	9.80	6,493.9 2	-	-
中信证券	202301050001 5883	新雷能	2023-01 -05	73,100.00	1,700.0 0	14.0 0	3.10	88.13	-	-
中信证券	202301050001 8885	天壕能源	2023-01 -05	119,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	148.46	-	-
中信证券	202301050001 9357	乐普医疗	2023-01 -05	230,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	286.72	-	-
中信证券	202301050001 9407	翰宇药业	2023-01 -05	840,150.0 0	45,000. 00	14.0 0	3.60	1,176.2 1	-	-
中信证券	202301050001 9415	鹏辉能源	2023-01 -05	2,186,336. 00	27,200. 00	14.0 0	2.60	2,210.6 3	-	-
中信证	202301050001 9427	鼎龙股	2023-01 -05	122,664.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.30	157.42	-	-

券		份									
中信证券	202301050001 9447	中科 创达	2023-01 -05	3,204,300. 00	30,000. 00	14.0 0	2.70	3,364.5 2	-	-	
中信证券	202301050001 9453	中科 创达	2023-01 -05	1,196,272. 00	11,200. 00	14.0 0	2.70	1,256.0 9	-	-	
中信证券	202301050001 9465	天壕 能源	2023-01 -05	119,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	148.46	-	-	
中信证券	202301050001 9469	鹏 辉 能 源	2023-01 -05	803,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	2.60	812.73	-	-	
中信证券	202301050001 9487	锦 浪 科 技	2023-01 -05	547,212.0 0	3,100.0 0	14.0 0	3.30	702.26	-	-	
中信证券	202301050001 9491	锦 浪 科 技	2023-01 -05	547,212.0 0	3,100.0 0	14.0 0	3.30	702.26	-	-	
中信证券	202301100000 1392	鹏 辉 能 源	2023-01 -10	191,682.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.70	394.01	-	-	
中信证券	202301100000 1432	南 大 光 电	2023-01 -10	1,615,037. 00	52,900. 00	14.0 0	3.30	2,960.9 0	-	-	
中信证券	202301100001 2749	圣 邦 股 份	2023-01 -10	3,486,000. 00	21,000. 00	7.00	3.40	2,304.6 3	-	-	
中信证券	202301100001 5767	鹏 辉 能 源	2023-01 -10	833,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	2.90	1,342.7 0	-	-	
中信证	202301100001 5769	宋 城 演	2023-01 -10	429,807.0 0	29,100. 00	14.0 0	3.20	764.10	-	-	

券		艺									
中信证券	2023011000015771	天壕能源	2023-01-10	120,900.00	10,000.00	14.00	2.90	194.78	-	-	
中信证券	2023011000015773	乐普医疗	2023-01-10	233,400.00	10,000.00	14.00	3.50	453.83	-	-	
中信证券	2023011100000817	长川科技	2023-01-11	1,339,600.00	34,000.00	14.00	2.80	1,979.63	-	-	
中信证券	2023011100000844	江丰电子	2023-01-11	745,600.00	10,000.00	14.00	4.60	1,810.15	-	-	
中信证券	2023011100000849	乐普医疗	2023-01-11	228,800.00	10,000.00	14.00	3.30	398.49	-	-	
中信证券	2023011100002329	鹏辉能源	2023-01-11	825,600.00	10,000.00	14.00	2.90	1,263.63	-	-	
中信证券	2023011100002397	天壕能源	2023-01-11	121,200.00	10,000.00	7.00	3.00	70.70	-	-	
中信证券	2023011100002405	锦浪科技	2023-01-11	2,385,444.00	13,700.00	7.00	4.20	1,948.11	-	-	
中信证券	2023011200002003	鹏辉能源	2023-01-12	813,500.00	10,000.00	14.00	3.70	1,504.98	-	-	
中信证券	2023011200002859	乐普医疗	2023-01-12	227,300.00	10,000.00	14.00	3.50	397.78	-	-	
中信证	2023011200004837	宁德时代	2023-01-12	14,305,500.00	33,000.00	14.00	1.80	12,874.95	-	-	

券		代									
中信证券	202301170000 1139	钢研高纳	2023-01 -17	41,390.00	1,000.0 0	28.0 0	3.10	99.80	-	-	
中信证券	202301170000 1143	江丰电子	2023-01 -17	756,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,382.3 5	-	-	
中信证券	202301170000 1158	新雷能	2023-01 -17	1,162,500. 00	31,000. 00	28.0 0	3.10	2,802.9 2	-	-	
中信证券	202301170002 4987	蓝晓科技	2023-01 -17	720,810.0 0	9,000.0 0	14.0 0	2.90	812.91	-	-	
中信证券	202301170002 6395	圣邦股份	2023-01 -17	3,799,530. 00	21,000. 00	7.00	3.20	4,390.5 7	-	-	
中信证券	202301170002 7361	天壕能源	2023-01 -17	1,974,297. 00	163,300 .00	14.0 0	3.00	2,303.3 5	-	-	
中信证券	202301170002 7375	鼎龙股份	2023-01 -17	226,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.30	377.92	-	-	
中信证券	202301170002 7379	星源材质	2023-01 -17	1,743,588. 00	74,800. 00	14.0 0	5.40	3,661.5 3	-	-	
中信证券	202301170002 7381	乐普医疗	2023-01 -17	236,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	303.51	-	-	
中信证券	202301170002 7389	鹏辉能源	2023-01 -17	1,949,696. 00	25,600. 00	14.0 0	3.70	2,805.4 0	-	-	
中信证	202301170003 1055	新莱应	2023-01 -17	1,284,864. 00	19,200. 00	14.0 0	2.10	1,049.3 1	-	-	

券		材								
中信证券	202301170003 1421	天壕能源	2023-01 -17	120,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.00	141.05	-	-
中信证券	202301170003 1519	锦浪科技	2023-01 -17	2,238,336. 00	12,800. 00	14.0 0	4.30	3,743.0 0	-	-
中信证券	202301180001 5703	天壕能源	2023-01 -18	123,600.0 0	10,000. 00	7.00	3.10	127.72	-	-
中信证券	202301180001 5817	锦浪科技	2023-01 -18	207,600.0 0	1,200.0 0	14.0 0	4.30	347.15	-	-
中信证券	202301180001 5819	锦浪科技	2023-01 -18	1,954,900. 00	11,300. 00	14.0 0	4.30	3,269.0 3	-	-
中信证券	202301180001 6679	乐普医疗	2023-01 -18	235,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	302.23	-	-
中信证券	202301180001 6687	鹏辉能源	2023-01 -18	319,998.0 0	4,200.0 0	14.0 0	3.70	460.44	-	-
中信证券	202301180001 6689	鼎龙股份	2023-01 -18	74,250.00	3,300.0 0	14.0 0	4.30	124.16	-	-
中信证券	202301180001 6691	江丰电子	2023-01 -18	751,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.60	1,343.9 9	-	-
中信证券	202301180001 6705	江丰电子	2023-01 -18	1,051,820. 00	14,000. 00	14.0 0	4.60	1,881.5 9	-	-
中信证	202301180001 6735	天壕能	2023-01 -18	123,600.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.00	144.20	-	-

券		源									
中信证券	202301180001 6795	乐普医疗	2023-01 -18	235,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	302.23	-	-	
中信证券	202301180001 6867	亿纬锂能	2023-01 -18	4,214,000. 00	50,000. 00	14.0 0	2.00	3,277.5 6	-	-	
中信证券	202301180001 6869	鼎龙股份	2023-01 -18	225,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.30	376.25	-	-	
中信证券	202301190001 4018	星源材质	2023-01 -19	1,715,164. 00	74,800. 00	14.0 0	5.40	3,601.8 4	-	-	
中信证券	202301190001 5390	鹏辉能源	2023-01 -19	169,671.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.70	244.14	-	-	
中信证券	202301190001 5392	东方日升	2023-01 -19	339,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	448.23	-	-	
中信证券	202301190001 5446	天壕能源	2023-01 -19	126,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.00	147.35	-	-	
中信证券	202301190001 5448	乐普医疗	2023-01 -19	240,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	308.51	-	-	
中信证券	202301190001 5456	天壕能源	2023-01 -19	126,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.00	147.35	-	-	
中信证券	202301190001 5462	东方日升	2023-01 -19	339,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	448.23	-	-	
中信证	202301190001 5500	鹏辉能	2023-01 -19	2,006,544. 00	27,200. 00	14.0 0	3.70	2,887.1 9	-	-	

券		源									
中信证券	2023011900015502	鼎龙股份	2023-01-19	131,100.00	5,700.00	14.00	4.30	219.23	-	-	
中信证券	2023011900015554	鹏辉能源	2023-01-19	737,700.00	10,000.00	14.00	3.70	1,061.47	-	-	
中信证券	2023013000069617	长川科技	2023-01-30	1,485,120.00	34,000.00	14.00	2.80	1,617.13	-	-	
中信证券	2023013000070827	江丰电子	2023-01-30	740,800.00	10,000.00	14.00	4.60	1,325.21	-	-	
中信证券	2023013000072299	鹏辉能源	2023-01-30	753,300.00	10,000.00	14.00	3.70	1,083.92	-	-	
中信证券	2023013000073807	鹏辉能源	2023-01-30	173,259.00	2,300.00	14.00	3.70	249.30	-	-	
中信证券	2023013000073815	南大光电	2023-01-30	1,649,951.00	52,900.00	14.00	3.30	2,117.44	-	-	
中信证券	2023013000073971	鹏辉能源	2023-01-30	753,300.00	10,000.00	14.00	3.70	1,083.92	-	-	
中信证券	2023013000075287	天壕能源	2023-01-30	124,700.00	10,000.00	14.00	3.00	145.48	-	-	
中信证券	2023013000075295	乐普医疗	2023-01-30	221,800.00	10,000.00	14.00	3.30	284.64	-	-	
中信证	2023013000075539	天壕能	2023-01-30	124,700.00	10,000.00	7.00	3.20	77.59	-	-	

券		源								
中信证券	202301300007 7949	鹏辉能源	2023-01 -30	753,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	996.03	-	-
中信证券	202301300007 9349	乐普医疗	2023-01 -30	221,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	284.64	-	-
中信证券	202301300008 2387	宁德时代	2023-01 -30	15,531,45 0.00	33,000. 00	14.0 0	1.80	10,872. 02	-	-
中信证券	202301300010 0891	乐普医疗	2023-01 -30	221,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	5.80	500.28	-	-
中信证券	202301300010 1353	宋城演艺	2023-01 -30	433,590.0 0	29,100. 00	14.0 0	2.70	455.27	-	-
中信证券	202301310002 2597	鹏辉能源	2023-01 -31	1,946,624. 00	25,600. 00	14.0 0	3.40	2,573.8 7	-	-
中信证券	202301310002 2613	乐普医疗	2023-01 -31	223,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	5.80	503.44	-	-
中信证券	202301310002 2621	星源材质	2023-01 -31	1,739,100. 00	74,800. 00	14.0 0	3.00	2,028.9 5	-	-
中信证券	202301310002 5809	江丰电子	2023-01 -31	716,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,308.6 9	-	-
中信证券	202301310002 5815	天壕能源	2023-01 -31	125,500.0 0	10,000. 00	28.0 0	3.00	292.83	-	-
中信证	202301310002 5921	天壕能	2023-01 -31	125,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.10	151.30	-	-

券		源								
中信证券	2023013100029711	蓝晓科技	2023-01-31	785,700.00	9,000.00	14.00	3.30	1,008.32	-	-
中信证券	2023013100030647	天壕能源	2023-01-31	2,049,415.00	163,300.00	14.00	3.10	2,470.68	-	-
中信证券	2023013100030669	新莱应材	2023-01-31	1,269,312.00	19,200.00	14.00	2.20	1,085.97	-	-
中信证券	2023013100031435	锦浪科技	2023-01-31	2,343,808.00	12,800.00	14.00	4.10	3,737.07	-	-
中信证券	2023020100001923	开立医疗	2023-02-01	1,033,695.00	19,500.00	14.00	3.40	1,366.77	-	-
中信证券	2023020100001933	翰宇药业	2023-02-01	622,502.00	43,900.00	14.00	3.50	847.29	-	-
中信证券	2023020100015136	鼎龙股份	2023-02-01	76,230.00	3,300.00	14.00	3.40	100.79	-	-
中信证券	2023020100015316	乐普医疗	2023-02-01	226,500.00	10,000.00	14.00	5.80	510.88	-	-
中信证券	2023020100015318	乐普医疗	2023-02-01	226,500.00	10,000.00	14.00	5.80	510.88	-	-
中信证券	2023020100015996	鹏辉能源	2023-02-01	321,048.00	4,200.00	14.00	3.40	424.50	-	-
中信证	2023020100016002	锦浪科	2023-02-01	205,620.00	1,200.00	14.00	4.10	327.85	-	-

券		技								
中信证 券	202302010001 8620	鼎 龙 股 份	2023-02 -01	231,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	305.43	-	-
中信证 券	202302010001 8628	锦 浪 科 技	2023-02 -01	1,936,255. 00	11,300. 00	14.0 0	4.10	3,087.2 5	-	-
中信证 券	202302010001 8902	亿 纬 锂 能	2023-02 -01	4,502,500. 00	50,000. 00	14.0 0	1.20	2,101.1 7	-	-
中信证 券	202302010001 9608	天 壕 能 源	2023-02 -01	124,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.10	149.73	-	-
中信证 券	202302010001 9620	江 丰 电 子	2023-02 -01	748,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,367.1 8	-	-
中信证 券	202302010001 9622	江 丰 电 子	2023-02 -01	1,047,200. 00	14,000. 00	14.0 0	4.70	1,914.0 5	-	-
中信证 券	202302020000 1553	亿 联 网 络	2023-02 -02	617,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	768.07	-	-
中信证 券	202302020000 1555	锦 浪 科 技	2023-02 -02	2,292,165. 00	13,500. 00	14.0 0	4.00	3,565.5 9	-	-
中信证 券	202302020001 4175	鼎 龙 股 份	2023-02 -02	133,608.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.40	176.66	-	-
中信证 券	202302020001 4249	天 壕 能 源	2023-02 -02	123,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.10	148.28	-	-
中信证 券	202302020001 4251	天 壕 能 源	2023-02 -02	123,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.10	148.28	-	-

券		源									
中信证券	202302020001 4259	鹏辉能源	2023-02 -02	745,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	985.06	-	-	
中信证券	202302020001 4261	鹏辉能源	2023-02 -02	2,026,400. 00	27,200. 00	14.0 0	3.40	2,679.3 5	-	-	
中信证券	202302020001 4263	鹏辉能源	2023-02 -02	171,350.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.40	226.56	-	-	
中信证券	202302020001 4915	乐普医疗	2023-02 -02	233,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	5.80	526.45	-	-	
中信证券	202302020001 5031	东方日升	2023-02 -02	339,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	462.10	-	-	
中信证券	202302020001 5033	东方日升	2023-02 -02	339,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	462.10	-	-	
中信证券	202302020001 6017	星源材质	2023-02 -02	1,808,664. 00	74,800. 00	14.0 0	3.00	2,110.1 1	-	-	
中信证券	202302060001 7540	天壕能源	2023-02 -06	121,100.0 0	10,000. 00	7.00	3.60	84.77	-	-	
中信证券	202302080000 1410	新产业	2023-02 -08	308,210.0 0	4,900.0 0	14.0 0	3.00	359.58	-	-	
中信证券	202302080000 1434	新莱应材	2023-02 -08	998,700.0 0	15,000. 00	14.0 0	2.10	815.61	-	-	
中信证	202302090000 1401	汇川技	2023-02 -09	875,880.0 0	12,000. 00	14.0 0	2.70	919.67	-	-	

券		术									
中信证券	2023020900001403	汇川技术	2023-02-09	1,094,850.00	15,000.00	14.00	2.70	1,149.59	-	-	
中信证券	2023020900001433	钢研高纳	2023-02-09	44,300.00	1,000.00	14.00	3.30	56.85	-	-	
中信证券	2023020900001435	蓝晓科技	2023-02-09	320,832.00	3,600.00	14.00	3.30	411.73	-	-	
中信证券	2023021300058864	乐普医疗	2023-02-13	240,600.00	10,000.00	14.00	1.70	159.06	-	-	
中信证券	2023021300059264	鹏辉能源	2023-02-13	747,800.00	10,000.00	14.00	1.70	494.38	-	-	
中信证券	2023021300059408	鹏辉能源	2023-02-13	747,800.00	10,000.00	14.00	1.70	494.38	-	-	
中信证券	2023021300059720	江丰电子	2023-02-13	793,100.00	10,000.00	14.00	1.70	524.33	-	-	
中信证券	2023021300060478	宋城演艺	2023-02-13	462,690.00	29,100.00	14.00	1.70	305.89	-	-	
中信证券	2023021300060508	长川科技	2023-02-13	1,572,500.00	34,000.00	14.00	1.70	1,039.60	-	-	
中信证券	2023021300060576	鹏辉能源	2023-02-13	747,800.00	10,000.00	14.00	1.70	494.38	-	-	
中信证	2023021300060642	乐普医	2023-02-13	240,600.00	10,000.00	14.00	1.70	159.06	-	-	

券		疗									
中信证券	2023021300060656	鹏辉能源	2023-02-13	171,994.00	2,300.00	14.00	1.70	113.71	-	-	
中信证券	2023021300061066	南大光电	2023-02-13	1,767,389.00	52,900.00	14.00	1.70	1,168.44	-	-	
中信证券	2023021300061114	天壕能源	2023-02-13	122,300.00	10,000.00	14.00	1.70	80.85	-	-	
中信证券	2023021300061124	乐普医疗	2023-02-13	240,600.00	10,000.00	14.00	1.70	159.06	-	-	
中信证券	2023021300084212	天壕能源	2023-02-13	122,300.00	10,000.00	7.00	3.50	83.23	-	-	
中信证券	2023021400001700	新易盛	2023-02-14	1,918,948.00	59,300.00	14.00	3.60	2,686.53	-	-	
中信证券	2023021400001731	钢研高纳	2023-02-14	130,230.00	3,000.00	28.00	3.00	260.46	-	-	
中信证券	2023021400020085	钢研高纳	2023-02-14	43,410.00	1,000.00	28.00	3.00	86.82	-	-	
中信证券	2023021400020087	新雷能	2023-02-14	1,135,220.00	31,000.00	28.00	3.50	2,648.85	-	-	
中信证券	2023021400023075	星源材质	2023-02-14	1,679,260.00	74,800.00	14.00	12.50	8,163.07	-	-	
中信证	2023021400023125	天壕能	2023-02-14	124,000.00	10,000.00	14.00	3.40	163.96	-	-	

券		源									
中信证券	202302140002 3127	天壕能源	2023-02 -14	2,024,920. 00	163,300 .00	14.0 0	3.40	2,677.3 9	-	-	
中信证券	202302140002 3133	蓝晓科技	2023-02 -14	954,000.0 0	9,000.0 0	14.0 0	3.30	1,224.3 0	-	-	
中信证券	202302140002 5461	江丰电子	2023-02 -14	787,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,439.0 1	-	-	
中信证券	202302140002 5505	锦浪科技	2023-02 -14	2,159,360. 00	12,800. 00	14.0 0	3.80	3,191.0 5	-	-	
中信证券	202302140002 7855	新莱应材	2023-02 -14	1,298,496. 00	19,200. 00	14.0 0	2.10	1,060.4 4	-	-	
中信证券	202302140002 7857	鹏辉能源	2023-02 -14	1,891,840. 00	25,600. 00	14.0 0	4.50	3,310.7 2	-	-	
中信证券	202302150000 1817	钢研高纳	2023-02 -15	817,570.0 0	19,000. 00	14.0 0	3.10	985.63	-	-	
中信证券	202302150001 6674	开立医疗	2023-02 -15	975,000.0 0	19,500. 00	14.0 0	3.40	1,289.1 7	-	-	
中信证券	202302150001 6678	翰宇药业	2023-02 -15	568,944.0 0	43,900. 00	14.0 0	3.90	862.90	-	-	
中信证券	202302150001 6704	鹏辉能源	2023-02 -15	304,248.0 0	4,200.0 0	14.0 0	4.50	532.43	-	-	
中信证	202302150001 6706	锦浪科	2023-02 -15	199,224.0 0	1,200.0 0	14.0 0	3.80	294.41	-	-	

券		技								
中信证券	202302150001 6708	锦浪科技	2023-02 -15	1,876,026. 00	11,300. 00	14.0 0	3.80	2,772.3 5	-	-
中信证券	202302150001 6772	江丰电子	2023-02 -15	803,100.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.70	1,467.8 9	-	-
中信证券	202302150001 6774	江丰电子	2023-02 -15	1,124,340. 00	14,000. 00	14.0 0	4.70	2,055.0 4	-	-
中信证券	202302150001 9324	天壕能源	2023-02 -15	122,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	162.50	-	-
中信证券	202302150001 9840	亿纬锂能	2023-02 -15	4,141,500. 00	50,000. 00	14.0 0	3.00	4,831.7 5	-	-
中信证券	202302160000 1328	东方日升	2023-02 -16	180,953.0 0	5,900.0 0	14.0 0	3.60	253.33	-	-
中信证券	202302160000 1496	迈为股份	2023-02 -16	7,597,400. 00	20,000. 00	14.0 0	1.80	5,318.1 8	-	-
中信证券	202302160001 2453	星源材质	2023-02 -16	1,602,216. 00	74,800. 00	14.0 0	3.80	2,367.7 2	-	-
中信证券	202302160001 5239	亿联网络	2023-02 -16	704,100.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.60	985.74	-	-
中信证券	202302160001 5255	锦浪科技	2023-02 -16	2,188,755. 00	13,500. 00	14.0 0	3.80	3,234.4 9	-	-
中信证	202302160001 5347	鼎龙股	2023-02 -16	131,784.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.00	153.75	-	-

券		份								
中信证券	202302160001 5371	天壕能源	2023-02 -16	120,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	159.33	-	-
中信证券	202302160001 5373	天壕能源	2023-02 -16	120,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	159.33	-	-
中信证券	202302160001 5375	鹏辉能源	2023-02 -16	706,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.50	1,236.9 0	-	-
中信证券	202302160001 5377	鹏辉能源	2023-02 -16	1,922,496. 00	27,200. 00	14.0 0	4.50	3,364.3 7	-	-
中信证券	202302160001 5379	鹏辉能源	2023-02 -16	162,564.0 0	2,300.0 0	14.0 0	4.50	284.49	-	-
中信证券	202302160001 5411	东方日升	2023-02 -16	306,700.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	381.67	-	-
中信证券	202302160001 5413	东方日升	2023-02 -16	306,700.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.20	381.67	-	-
中信证券	202302200000 7474	天壕能源	2023-02 -20	119,000.0 0	10,000. 00	7.00	3.40	78.67	-	-
中信证券	202302210000 1111	汇川技术	2023-02 -21	511,700.0 0	7,000.0 0	14.0 0	3.20	636.78	-	-
中信证券	202302210000 1129	新产业	2023-02 -21	557,102.0 0	9,100.0 0	14.0 0	3.00	649.95	-	-
中信证	202302210000 1138	开立医	2023-02 -21	588,480.0 0	12,000. 00	28.0 0	3.40	1,556.2 0	-	-

券		疗									
中信证券	202302210000 1141	三 诺 生 物	2023-02 -21	397,741.0 0	10,900. 00	14.0 0	3.40	525.90	-	-	
中信证券	202302210000 1143	宋 城 演 艺	2023-02 -21	15,750.00	1,000.0 0	14.0 0	3.60	22.05	-	-	
中信证券	202302220000 1237	鹏 辉 能 源	2023-02 -22	1,002,000. 00	15,000. 00	14.0 0	4.60	1,792.4 7	-	-	
中信证券	202302220000 1240	三 角 防 务	2023-02 -22	69,930.00	1,800.0 0	14.0 0	3.30	89.74	-	-	
中信证券	202302220000 4834	新 产 业	2023-02 -22	301,987.0 0	4,900.0 0	14.0 0	3.20	375.81	-	-	
中信证券	202302220000 5060	新 莱 应 材	2023-02 -22	1,115,250. 00	15,000. 00	14.0 0	2.20	954.16	-	-	
中信证券	202302230000 1180	江 丰 电 子	2023-02 -23	286,380.0 0	3,700.0 0	14.0 0	3.50	389.80	-	-	
中信证券	202302230000 1200	泰 格 医 药	2023-02 -23	843,600.0 0	7,400.0 0	14.0 0	3.30	1,082.6 2	-	-	
中信证券	202302230000 1202	翰 宇 药 业	2023-02 -23	108,240.0 0	8,000.0 0	14.0 0	5.10	214.68	-	-	
中信证券	202302230000 1225	新 易 盛	2023-02 -23	337,260.0 0	11,000. 00	14.0 0	3.60	472.16	-	-	
中信证	202302230000 4851	蓝 晓 科	2023-02 -23	343,440.0 0	3,600.0 0	14.0 0	3.20	427.39	-	-	

券		技									
中信证券	202302230000 4855	汇川技术	2023-02 -23	1,099,350.00	15,000.00	14.00	2.10	897.80	-	-	
中信证券	202302270005 8018	鹏辉能源	2023-02 -27	663,300.00	10,000.00	14.00	4.60	1,186.57	-	-	
中信证券	202302270005 8622	鹏辉能源	2023-02 -27	663,300.00	10,000.00	14.00	4.60	1,186.57	-	-	
中信证券	202302270005 9674	天壕能源	2023-02 -27	119,600.00	10,000.00	14.00	3.30	153.49	-	-	
中信证券	202302270005 9686	长川科技	2023-02 -27	1,503,480.00	34,000.00	14.00	3.40	1,987.93	-	-	
中信证券	202302270006 0170	南大光电	2023-02 -27	1,626,675.00	52,900.00	14.00	3.50	2,214.09	-	-	
中信证券	202302270006 0590	天壕能源	2023-02 -27	119,600.00	10,000.00	7.00	3.40	79.07	-	-	
中信证券	202302270006 1080	鹏辉能源	2023-02 -27	152,559.00	2,300.00	14.00	4.60	272.91	-	-	
中信证券	202302270007 8796	江丰电子	2023-02 -27	785,500.00	10,000.00	14.00	3.50	1,069.15	-	-	
中信证券	202302270007 8940	鹏辉能源	2023-02 -27	663,300.00	10,000.00	14.00	4.60	1,186.57	-	-	
中信证	202302280000 1295	振芯科	2023-02 -28	766,976.00	25,600.00	7.00	2.90	432.49	-	-	

券		技								
中信证券	2023022800001357	蓝晓科技	2023-02-28	287,400.00	3,000.00	7.00	2.30	128.53	-	-
中信证券	2023022800019474	星源材质	2023-02-28	1,589,500.00	74,800.00	14.00	4.40	2,719.81	-	-
中信证券	2023022800019546	鹏辉能源	2023-02-28	1,716,480.00	25,600.00	14.00	4.60	3,070.59	-	-
中信证券	2023022800019552	锦浪科技	2023-02-28	2,032,384.00	12,800.00	14.00	4.40	3,477.63	-	-
中信证券	2023022800019560	天壕能源	2023-02-28	120,100.00	10,000.00	14.00	3.30	154.13	-	-
中信证券	2023022800019562	天壕能源	2023-02-28	1,961,233.00	163,300.00	14.00	3.30	2,516.92	-	-
中信证券	2023022800019602	江丰电子	2023-02-28	780,000.00	10,000.00	14.00	3.50	1,061.67	-	-
中信证券	2023022800021604	天壕能源	2023-02-28	120,100.00	10,000.00	28.00	3.20	298.92	-	-
中信证券	2023022800021628	蓝晓科技	2023-02-28	862,200.00	9,000.00	14.00	4.00	1,341.20	-	-
中信证券	2023022800021634	新易盛	2023-02-28	1,908,867.00	59,300.00	14.00	3.60	2,672.41	-	-
中信证	2023022800021652	新莱应	2023-02-28	1,355,712.00	19,200.00	14.00	3.60	1,898.00	-	-

券		材								
中信证券	2023030100001493	振芯科技	2023-03-01	762,880.00	25,600.00	7.00	2.90	430.18	-	-
中信证券	2023030100014863	钢研高纳	2023-03-01	828,780.00	19,000.00	14.00	3.10	642.30	-	-
中信证券	2023030100015049	开立医疗	2023-03-01	919,230.00	19,500.00	14.00	3.50	1,251.17	-	-
中信证券	2023030100016547	江丰电子	2023-03-01	782,200.00	10,000.00	14.00	3.50	1,064.66	-	-
中信证券	2023030100016549	江丰电子	2023-03-01	1,095,080.00	14,000.00	14.00	3.50	1,490.53	-	-
中信证券	2023030100016559	锦浪科技	2023-03-01	186,000.00	1,200.00	14.00	4.40	318.27	-	-
中信证券	2023030100016561	锦浪科技	2023-03-01	1,751,500.00	11,300.00	14.00	4.40	2,997.01	-	-
中信证券	2023030100016581	天壕能源	2023-03-01	120,500.00	10,000.00	14.00	3.30	154.64	-	-
中信证券	2023030100016583	鹏辉能源	2023-03-01	276,360.00	4,200.00	14.00	4.60	494.38	-	-
中信证券	2023030100016641	翰宇药业	2023-03-01	592,650.00	43,900.00	14.00	5.10	1,175.42	-	-
中信证	2023030100016667	亿纬锂	2023-03-01	3,633,500.00	50,000.00	14.00	1.40	1,978.24	-	-

券		能								
中信证券	202303020000 1412	蓝 晓 科 技	2023-03 -02	405,080.0 0	4,100.0 0	7.00	2.30	181.16	-	-
中信证券	202303020000 1448	振 芯 科 技	2023-03 -02	754,035.0 0	25,500. 00	7.00	2.90	425.19	-	-
中信证券	202303020001 1475	迈 为 股 份	2023-03 -02	7,100,000. 00	20,000. 00	14.0 0	1.80	4,970.0 0	-	-
中信证券	202303020001 4111	鹏 辉 能 源	2023-03 -02	1,754,400. 00	27,200. 00	14.0 0	4.60	3,138.4 3	-	-
中信证券	202303020001 4113	鹏 辉 能 源	2023-03 -02	148,350.0 0	2,300.0 0	14.0 0	4.60	265.38	-	-
中信证券	202303020001 4147	星 源 材 质	2023-03 -02	1,552,100. 00	74,800. 00	14.0 0	4.40	2,655.8 2	-	-
中信证券	202303020001 4169	东 方 日 升	2023-03 -02	173,696.0 0	5,900.0 0	14.0 0	3.60	208.44	-	-
中信证券	202303020001 4171	东 方 日 升	2023-03 -02	294,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.60	353.28	-	-
中信证券	202303020001 4173	东 方 日 升	2023-03 -02	294,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.60	353.28	-	-
中信证券	202303020001 4187	鹏 辉 能 源	2023-03 -02	645,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.60	1,153.8 3	-	-
中信证	202303020001 4189	亿 联 网	2023-03 -02	705,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	532.67	-	-

券		络									
中信证券	202303020001 4205	锦浪科技	2023-03 -02	2,056,725. 00	13,500. 00	14.0 0	4.40	3,016.5 3	-	-	
中信证券	202303020001 4843	天壕能源	2023-03 -02	120,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	154.26	-	-	
中信证券	202303020001 4861	天壕能源	2023-03 -02	120,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	154.26	-	-	
中信证券	202303020001 5193	鼎龙股份	2023-03 -02	130,017.0 0	5,700.0 0	14.0 0	2.70	136.52	-	-	
中信证券	202303060001 7119	天壕能源	2023-03 -06	120,200.0 0	10,000. 00	7.00	2.70	63.11	-	-	
中信证券	202303070000 7254	宋城演艺	2023-03 -07	16,130.00	1,000.0 0	7.00	3.40	4.57	-	-	
中信证券	202303070000 8756	振芯科技	2023-03 -07	763,648.0 0	25,600. 00	7.00	2.90	430.61	-	-	
中信证券	202303070000 8768	蓝晓科技	2023-03 -07	295,200.0 0	3,000.0 0	7.00	2.30	132.02	-	-	
中信证券	202303080000 1193	泰格医药	2023-03 -08	265,776.0 0	2,400.0 0	14.0 0	2.90	299.74	-	-	
中信证券	202303080000 1224	南大光电	2023-03 -08	1,042,392. 00	31,200. 00	14.0 0	3.50	1,418.8 1	-	-	
中信证	202303080000 1231	蓝晓科	2023-03 -08	314,624.0 0	3,200.0 0	14.0 0	3.40	416.00	-	-	

券		技								
中信证券	202303080000 6110	振 芯 科 技	2023-03 -08	821,248.0 0	25,600. 00	7.00	2.90	463.09	-	-
中信证券	202303080000 7272	三 角 防 务	2023-03 -08	67,662.00	1,800.0 0	7.00	3.10	11.65	-	-
中信证券	202303090000 1292	瑞 丰 新 材	2023-03 -09	376,380.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.60	526.93	-	-
中信证券	202303090000 3153	亿 联 网 络	2023-03 -02	705,000.0 0	10,000. 00	8.00	3.40	532.67	-	-
中信证券	202303090000 3159	新 雷 能	2023-02 -14	1,135,220. 00	31,000. 00	24.0 0	3.50	2,648.8 5	-	-
中信证券	202303090000 3191	宋 城 演 艺	2023-03 -07	16,130.00	1,000.0 0	3.00	3.40	4.57	-	-
中信证券	202303090000 3211	钢 研 高 纳	2023-02 -14	43,410.00	1,000.0 0	24.0 0	3.00	86.82	-	-
中信证券	202303090000 3219	钢 研 高 纳	2023-02 -14	130,230.0 0	3,000.0 0	24.0 0	3.00	260.46	-	-
中信证券	202303090000 3223	钢 研 高 纳	2023-03 -01	828,780.0 0	19,000. 00	9.00	3.10	642.30	-	-
中信证券	202303090000 3233	三 角 防 务	2023-03 -08	67,662.00	1,800.0 0	2.00	3.10	11.65	-	-
中信证	202303090000 5736	蓝 晓 科	2023-03 -09	406,720.0 0	4,100.0 0	7.00	2.30	181.89	-	-

券		技								
中信证券	202303090000 5870	振 芯 科 技	2023-03 -09	805,290.0 0	25,500.0 00	7.00	2.90	454.09	-	-
中信证券	202303090000 5956	汇 川 技 术	2023-03 -09	1,091,400.0 00	15,000.0 00	7.00	3.00	636.65	-	-
中信证券	202303090000 5962	蓝 晓 科 技	2023-03 -09	357,120.0 0	3,600.0 0	7.00	2.30	159.71	-	-
中信证券	202303090000 5998	江 丰 电 子	2023-03 -09	289,599.0 0	3,700.0 0	7.00	4.60	74.01	-	-
中信证券	202303090000 6000	翰 宇 药 业	2023-03 -09	100,000.0 0	8,000.0 0	7.00	5.30	29.44	-	-
中信证券	202303100000 3002	翰 宇 药 业	2023-03 -09	100,000.0 0	8,000.0 0	4.00	5.30	58.89	-	-
中信证券	202303100000 3004	江 丰 电 子	2023-03 -09	289,599.0 0	3,700.0 0	4.00	4.60	148.02	-	-
中信证券	202303130000 3157	锦 浪 科 技	2023-03 -02	2,056,725.0 00	13,500.0 00	12.0 0	4.40	3,016.5 3	-	-
中信证券	202303130000 3159	东 方 日 升	2023-03 -02	294,400.0 0	10,000.0 00	12.0 0	3.60	353.28	-	-
中信证券	202303130000 3161	东 方 日 升	2023-03 -02	173,696.0 0	5,900.0 0	12.0 0	3.60	208.44	-	-
中信证	202303130000 3163	东 方 日	2023-03 -02	294,400.0 0	10,000.0 00	12.0 0	3.60	353.28	-	-

券		升								
中信证券	202303130007 1806	江丰电子	2023-03 -13	773,000.0 0	10,000.00	7.00	5.00	751.53	-	-
中信证券	202303130007 2160	鹏辉能源	2023-03 -13	613,900.0 0	10,000.00	7.00	4.70	561.04	-	-
中信证券	202303130007 2338	南大光电	2023-03 -13	1,836,159.00	52,900.00	14.00	3.50	357.03	-	-
中信证券	202303130007 2422	鹏辉能源	2023-03 -13	141,197.0 0	2,300.00	14.00	4.60	252.59	-	-
中信证券	202303130007 2458	鹏辉能源	2023-03 -13	613,900.0 0	10,000.00	14.00	4.60	1,098.20	-	-
中信证券	202303130007 2526	鹏辉能源	2023-03 -13	613,900.0 0	10,000.00	14.00	4.60	1,098.20	-	-
中信证券	202303140000 1684	富临精工	2023-03 -14	666,464.0 0	47,200.00	14.00	3.20	829.38	-	-
中信证券	202303140000 1688	爱尔眼科	2023-03 -14	132,827.0 0	4,300.00	14.00	3.30	170.46	-	-
中信证券	202303140000 5093	南大光电	2023-03 -13	1,836,159.00	52,900.00	2.00	3.50	357.03	-	-
中信证券	202303140001 9956	蓝晓科技	2023-03 -14	297,570.0 0	3,000.00	7.00	3.50	202.51	-	-
中信证	202303140002 1040	锦浪科	2023-03 -14	1,877,504.00	12,800.00	7.00	3.50	1,277.75	-	-

券		技								
中信证券	202303140002 1154	江丰电子	2023-03 -14	795,200.0 0	10,000. 00	7.00	5.00	773.11	-	-
中信证券	202303140002 3044	鹏辉能源	2023-03 -14	1,534,464. 00	25,600. 00	14.0 0	4.60	2,744.9 9	-	-
中信证券	202303140002 4868	蓝晓科技	2023-03 -14	892,710.0 0	9,000.0 0	7.00	3.50	607.54	-	-
中信证券	202303140002 6730	振芯科技	2023-03 -14	807,936.0 0	25,600. 00	7.00	3.20	502.72	-	-
中信证券	202303150000 2004	盛弘股份	2023-03 -15	120,060.0 0	2,000.0 0	14.0 0	3.60	168.08	-	-
中信证券	202303150000 2007	上能电气	2023-03 -15	283,645.0 0	4,700.0 0	14.0 0	5.80	639.78	-	-
中信证券	202303150001 6565	锦浪科技	2023-03 -15	177,924.0 0	1,200.0 0	7.00	3.50	121.09	-	-
中信证券	202303150001 6571	鹏辉能源	2023-03 -15	249,102.0 0	4,200.0 0	7.00	4.70	227.65	-	-
中信证券	202303150001 6573	江丰电子	2023-03 -15	800,000.0 0	10,000. 00	7.00	5.00	777.78	-	-
中信证券	202303150001 6575	江丰电子	2023-03 -15	1,120,000. 00	14,000. 00	7.00	5.00	1,088.8 9	-	-
中信证	202303150001 7705	开立医	2023-03 -15	1,034,085. 00	19,500. 00	7.00	3.70	743.97	-	-

券		疗									
中信证券	202303150001 8845	亿纬锂能	2023-03 -15	3,280,500. 00	50,000. 00	14.0 0	2.80	3,572.1 0	-	-	
中信证券	202303150002 0325	振芯科技	2023-03 -15	798,720.0 0	25,600. 00	7.00	3.20	496.98	-	-	
中信证券	202303160000 1420	南大光电	2023-03 -16	389,510.0 0	11,000. 00	14.0 0	3.40	515.02	-	-	
中信证券	202303160000 1421	精测电子	2023-03 -16	104,144.0 0	1,600.0 0	28.0 0	2.70	218.70	-	-	
中信证券	202303160000 1428	江丰电子	2023-03 -16	118,860.0 0	1,500.0 0	28.0 0	3.20	295.83	-	-	
中信证券	202303160000 1434	神州泰岳	2023-03 -16	381,915.0 0	61,500. 00	14.0 0	3.50	519.83	-	-	
中信证券	202303160000 1444	苏试试验	2023-03 -16	1,915,959. 00	69,900. 00	14.0 0	3.40	2,533.3 2	-	-	
中信证券	202303160001 1174	鼎龙股份	2023-03 -16	140,790.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.60	197.11	-	-	
中信证券	202303160001 1302	鹏辉能源	2023-03 -16	1,549,040. 00	27,200. 00	14.0 0	4.60	2,771.0 6	-	-	
中信证券	202303160001 1304	鹏辉能源	2023-03 -16	130,985.0 0	2,300.0 0	14.0 0	4.60	234.32	-	-	
中信证	202303160001 1306	鹏辉能	2023-03 -16	569,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.60	1,018.7 7	-	-	

券		源									
中信证券	202303160001 4256	天壕能源	2023-03 -16	114,100.0 0	10,000.00	14.0 0	2.80	124.24	-	-	
中信证券	202303160001 4258	天壕能源	2023-03 -16	114,100.0 0	10,000.00	14.0 0	2.80	124.24	-	-	
中信证券	202303160001 5382	汇川技术	2023-03 -16	1,048,350.00	15,000.00	7.00	2.20	448.46	-	-	
中信证券	202303160001 5384	蓝晓科技	2023-03 -16	336,384.0 0	3,600.0 0	7.00	3.20	209.31	-	-	
中信证券	202303160001 5400	星源材质	2023-03 -16	1,421,200.00	74,800.00	14.0 0	3.30	1,823.87	-	-	
中信证券	202303160001 6112	蓝晓科技	2023-03 -16	383,104.0 0	4,100.0 0	7.00	3.20	238.38	-	-	
中信证券	202303160001 6114	振芯科技	2023-03 -16	773,925.0 0	25,500.00	7.00	3.50	526.70	-	-	
中信证券	202303200000 8424	鹏辉能源	2023-03 -20	568,300.0 0	10,000.00	7.00	5.10	563.56	-	-	
中信证券	202303200000 8540	江丰电子	2023-03 -20	816,600.0 0	10,000.00	7.00	3.40	539.86	-	-	
中信证券	202303210000 1722	上能电气	2023-03 -21	210,630.0 0	3,500.0 0	14.0 0	5.80	475.09	-	-	
中信证	202303210000 1723	江丰电	2023-03 -21	120,225.0 0	1,500.0 0	28.0 0	4.20	392.74	-	-	

券		子									
中信证券	202303210000 1727	盛弘股份	2023-03 -21	159,200.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	229.07	-	-	
中信证券	202303210000 1729	星源材质	2023-03 -21	137,690.0 0	7,000.0 0	14.0 0	3.30	176.70	-	-	
中信证券	202303210000 1748	江丰电子	2023-03 -21	120,225.0 0	1,500.0 0	14.0 0	4.30	201.04	-	-	
中信证券	202303210000 1774	神州泰岳	2023-03 -21	23,229.00	2,900.0 0	14.0 0	3.60	32.52	-	-	
中信证券	202303210000 1775	东方财富	2023-03 -21	100,900.0 0	5,000.0 0	14.0 0	3.50	137.34	-	-	
中信证券	202303210000 8058	蓝晓科技	2023-03 -21	854,460.0 0	9,000.0 0	7.00	3.20	531.66	-	-	
中信证券	202303210000 8334	开立医疗	2023-03 -21	600,360.0 0	12,000.0 00	28.0 0	3.10	1,447.5 3	-	-	
中信证券	202303210000 8346	振芯科技	2023-03 -21	765,696.0 0	25,600.0 00	7.00	3.50	521.10	-	-	
中信证券	202303210000 8354	江丰电子	2023-03 -21	801,500.0 0	10,000.0 00	7.00	3.40	529.88	-	-	
中信证券	202303210000 8360	蓝晓科技	2023-03 -21	284,820.0 0	3,000.0 0	7.00	3.20	177.22	-	-	
中信证	202303210001 0106	锦浪科	2023-03 -21	1,777,280.0 00	12,800.0 00	7.00	5.30	1,831.5 9	-	-	

券		技									
中信证券	202303220000 1368	天壕能源	2023-03 -22	1,558,275. 00	131,500 .00	14.0 0	3.20	2,077.7 0	-	-	
中信证券	202303220000 1372	同花顺	2023-03 -22	383,940.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.50	559.91	-	-	
中信证券	202303220000 1373	神州泰岳	2023-03 -22	158,692.0 0	19,400. 00	14.0 0	3.60	238.04	-	-	
中信证券	202303220000 1375	同花顺	2023-03 -22	4,266,000. 00	30,000. 00	14.0 0	3.50	6,221.2 5	-	-	
中信证券	202303220000 7063	鹏辉能源	2023-03 -22	242,256.0 0	4,200.0 0	14.0 0	5.00	504.70	-	-	
中信证券	202303220000 7073	开立医疗	2023-03 -22	989,235.0 0	19,500. 00	14.0 0	3.20	1,318.9 8	-	-	
中信证券	202303220000 7075	江丰电子	2023-03 -22	781,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	1,074.5 6	-	-	
中信证券	202303220000 7077	江丰电子	2023-03 -22	1,094,100. 00	14,000. 00	14.0 0	3.30	1,504.3 9	-	-	
中信证券	202303220000 7083	锦浪科技	2023-03 -22	164,628.0 0	1,200.0 0	14.0 0	5.20	356.69	-	-	
中信证券	202303220000 7239	振芯科技	2023-03 -22	747,776.0 0	25,600. 00	14.0 0	3.40	1,059.3 5	-	-	
中信证	202303220000 8675	南大光	2023-03 -22	1,092,312. 00	31,200. 00	14.0 0	3.40	1,547.4 4	-	-	

券		电									
中信证 券	202303220000 9321	蓝 晓 科 技	2023-03 -22	302,976.0 0	3,200.0 0	14.0 0	3.10	391.34	-	-	
中信证 券	202303220000 9417	泰 格 医 药	2023-03 -22	257,832.0 0	2,400.0 0	14.0 0	3.10	333.03	-	-	
中信证 券	202303230000 1353	爱 美 客	2023-03 -23	514,710.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	640.53	-	-	
中信证 券	202303230000 1359	南 大 光 电	2023-03 -23	180,467.0 0	4,900.0 0	14.0 0	3.40	238.62	-	-	
中信证 券	202303230000 1376	瑞 丰 新 材	2023-03 -23	727,870.0 0	6,500.0 0	14.0 0	3.20	905.79	-	-	
中信证 券	202303230000 1378	天 壕 能 源	2023-03 -23	11,720.00	1,000.0 0	14.0 0	3.20	14.58	-	-	
中信证 券	202303230000 1379	天 壕 能 源	2023-03 -23	11,720.00	1,000.0 0	28.0 0	3.10	28.26	-	-	
中信证 券	202303230000 1382	江 丰 电 子	2023-03 -23	118,845.0 0	1,500.0 0	14.0 0	4.30	198.74	-	-	
中信证 券	202303230000 1396	精 测 电 子	2023-03 -23	84,045.00	1,300.0 0	28.0 0	3.30	215.72	-	-	
中信证 券	202303230000 5740	瑞 丰 新 材	2023-03 -23	302,346.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.40	399.77	-	-	
中信证 券	202303230000 6416	蓝 晓 科	2023-03 -23	376,708.0 0	4,100.0 0	7.00	3.20	234.40	-	-	

券		技								
中信证券	202303230000 6502	汇川技术	2023-03 -23	1,020,000.00	15,000.00	7.00	2.20	436.33	-	-
中信证券	202303230000 6510	振芯科技	2023-03 -23	755,055.00	25,500.00	7.00	3.50	513.86	-	-
中信证券	202303230000 6514	蓝晓科技	2023-03 -23	330,768.00	3,600.00	7.00	3.20	205.81	-	-
中信证券	202303270005 1969	鹏辉能源	2023-03 -27	584,000.00	10,000.00	14.00	3.50	794.89	-	-
中信证券	202303270005 3459	鹏辉能源	2023-03 -27	584,000.00	10,000.00	14.00	3.50	794.89	-	-
中信证券	202303270005 4599	鹏辉能源	2023-03 -27	134,320.00	2,300.00	14.00	3.50	182.82	-	-
中信证券	202303270006 2561	鹏辉能源	2023-03 -27	584,000.00	10,000.00	7.00	3.60	408.80	-	-
中信证券	202303270006 5287	江丰电子	2023-03 -27	756,000.00	10,000.00	7.00	4.40	646.80	-	-
中信证券	202303280000 2259	天壕能源	2023-03 -28	2,016,666.00	168,900.00	14.00	3.30	2,588.05	-	-
中信证券	202303280000 2260	精测电子	2023-03 -28	116,565.00	1,900.00	28.00	3.20	290.12	-	-
中信证	202303280000 2303	中际旭	2023-03 -28	339,003.00	6,300.00	14.00	3.50	461.42	-	-

券		创									
中信证 券	202303280000 2304	振 芯 科 技	2023-03 -28	1,244,796. 00	43,800. 00	14.0 0	3.50	1,694.3 1	-	-	
中信证 券	202303280001 9859	富 临 精 工	2023-03 -28	650,416.0 0	47,200. 00	14.0 0	3.30	834.70	-	-	
中信证 券	202303280002 1099	鹏 辉 能 源	2023-03 -28	1,447,680. 00	25,600. 00	14.0 0	3.50	1,970.4 5	-	-	
中信证 券	202303280002 1923	振 芯 科 技	2023-03 -28	727,552.0 0	25,600. 00	7.00	3.60	509.29	-	-	
中信证 券	202303280002 1925	江 丰 电 子	2023-03 -28	698,000.0 0	10,000. 00	7.00	4.40	597.18	-	-	
中信证 券	202303280002 3453	爱 尔 眼 科	2023-03 -28	134,676.0 0	4,300.0 0	14.0 0	3.00	157.12	-	-	
中信证 券	202303280002 4925	天 壕 能 源	2023-03 -28	119,400.0 0	10,000. 00	28.0 0	3.10	287.89	-	-	
中信证 券	202303290000 0866	南 大 光 电	2023-03 -29	99,848.00	2,800.0 0	14.0 0	4.60	178.62	-	-	
中信证 券	202303290000 0867	泰 格 医 药	2023-03 -29	461,970.0 0	4,500.0 0	14.0 0	2.70	485.07	-	-	
中信证 券	202303290000 0876	江 丰 电 子	2023-03 -29	99,260.00	1,400.0 0	14.0 0	3.70	142.82	-	-	
中信证 券	202303290000 0881	温 氏 股	2023-03 -29	660,955.0 0	33,500. 00	14.0 0	2.10	539.78	-	-	

券		份									
中信证券	202303290000 0883	同花顺	2023-03 -29	493,724.0 0	2,800.0 0	14.0 0	3.50	672.01	-	-	
中信证券	202303290000 0888	中际旭创	2023-03 -29	2,099,790. 00	37,800. 00	14.0 0	3.50	2,858.0 5	-	-	
中信证券	202303290000 0890	汇川技术	2023-03 -29	948,872.0 0	13,600. 00	14.0 0	1.30	479.71	-	-	
中信证券	202303290000 0896	宁德时代	2023-03 -29	1,920,864. 00	4,800.0 0	14.0 0	3.10	2,315.7 1	-	-	
中信证券	202303290000 0906	迈瑞医疗	2023-03 -29	1,909,600. 00	6,200.0 0	14.0 0	2.10	1,559.5 1	-	-	
中信证券	202303290000 0909	德方纳米	2023-03 -29	191,270.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.70	200.83	-	-	
中信证券	202303290000 0911	南大光电	2023-03 -29	142,640.0 0	4,000.0 0	14.0 0	4.60	255.17	-	-	
中信证券	202303290000 0928	康龙化成	2023-03 -29	347,334.0 0	6,100.0 0	14.0 0	3.20	432.24	-	-	
中信证券	202303290000 0929	瑞丰新材	2023-03 -29	2,115,516. 00	19,100. 00	14.0 0	3.30	2,714.9 1	-	-	
中信证券	202303290000 0932	天壕能源	2023-03 -29	11,680.00	1,000.0 0	14.0 0	3.30	14.99	-	-	
中信证	202303290001 5746	上能电	2023-03 -29	276,689.0 0	4,700.0 0	14.0 0	5.80	624.09	-	-	

券		气								
中信证券	202303290001 7064	亿纬锂能	2023-03 -29	3,423,000.00	50,000.00	14.00	1.70	2,262.98	-	-
中信证券	202303290001 7366	盛弘股份	2023-03 -29	117,120.00	2,000.00	14.00	3.70	168.52	-	-
中信证券	202303300000 2501	精测电子	2023-03 -30	166,868.00	2,600.00	28.00	3.20	415.32	-	-
中信证券	202303300000 2507	天华新能	2023-03 -30	348,840.00	6,800.00	14.00	3.30	447.68	-	-
中信证券	202303300001 2923	鹏辉能源	2023-03 -30	562,200.00	10,000.00	14.00	3.50	765.22	-	-
中信证券	202303300001 2931	星源材质	2023-03 -30	1,425,688.00	74,800.00	14.00	3.30	1,829.63	-	-
中信证券	202303300001 3909	鼎龙股份	2023-03 -30	138,909.00	5,700.00	14.00	3.50	189.07	-	-
中信证券	202303300001 4213	天壕能源	2023-03 -30	116,800.00	10,000.00	14.00	3.20	145.35	-	-
中信证券	202303300001 4605	天壕能源	2023-03 -30	116,800.00	10,000.00	14.00	3.20	145.35	-	-
中信证券	202303300001 4711	鹏辉能源	2023-03 -30	1,529,184.00	27,200.00	14.00	3.50	2,081.39	-	-
中信证	202303300001 4713	鹏辉能	2023-03 -30	129,306.00	2,300.00	14.00	3.50	176.00	-	-

券		源									
中信证券	202303300001 5069	神州泰岳	2023-03 -30	509,835.0 0	61,500. 00	14.0 0	3.60	713.77	-	-	
中信证券	202303300001 6695	振芯科技	2023-03 -30	749,190.0 0	25,500. 00	7.00	3.60	524.43	-	-	
中信证券	202303300001 7173	苏试试验	2023-03 -30	1,953,006. 00	69,900. 00	14.0 0	3.50	2,658.2 6	-	-	
中信证券	202303300001 7177	南大光电	2023-03 -30	388,080.0 0	11,000. 00	14.0 0	3.40	513.13	-	-	
中信证券	202304030001 7803	鹏辉能源	2023-04 -03	561,800.0 0	10,000. 00	7.00	3.00	327.72	-	-	
中信证券	202304030001 7807	江丰电子	2023-04 -03	724,900.0 0	10,000. 00	7.00	3.80	535.62	-	-	
中信证券	202304040000 1819	锦浪科技	2023-04 -04	1,785,110. 00	13,700. 00	14.0 0	3.40	2,360.3 1	-	-	
中信证券	202304040000 1828	南大光电	2023-04 -04	425,260.0 0	11,000. 00	14.0 0	4.90	810.36	-	-	
中信证券	202304040000 1839	天华新能	2023-04 -04	340,340.0 0	6,800.0 0	14.0 0	3.10	410.30	-	-	
中信证券	202304040000 1841	开立医疗	2023-04 -04	1,327,440. 00	24,000. 00	14.0 0	3.20	1,651.9 3	-	-	
中信证	202304040000 9131	江丰电	2023-04 -04	756,100.0 0	10,000. 00	7.00	3.80	558.67	-	-	

券		子									
中信证券	202304040001 0763	上能电气	2023-04 -04	197,400.0 0	3,500.0 0	14.0 0	5.90	452.92	-	-	
中信证券	202304040001 0765	东方财富	2023-04 -04	113,500.0 0	5,000.0 0	14.0 0	2.20	97.11	-	-	
中信证券	202304040001 1133	盛弘股份	2023-04 -04	142,175.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	204.57	-	-	
中信证券	202304040001 1155	神州泰岳	2023-04 -04	30,885.00	2,900.0 0	14.0 0	3.30	39.64	-	-	
中信证券	202304040001 1157	江丰电子	2023-04 -04	113,415.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.70	163.19	-	-	
中信证券	202304060000 2042	锦浪科技	2023-04 -06	1,497,070. 00	11,500. 00	14.0 0	3.40	1,979.4 6	-	-	
中信证券	202304060000 2043	爱美客	2023-04 -06	559,600.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.90	631.10	-	-	
中信证券	202304060000 2047	上能电气	2023-04 -06	265,550.0 0	4,700.0 0	14.0 0	5.20	537.00	-	-	
中信证券	202304060000 2048	盛弘股份	2023-04 -06	142,300.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	204.75	-	-	
中信证券	202304060000 2049	江丰电子	2023-04 -06	121,755.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.50	165.72	-	-	
中信证	202304060000 2054	天华新	2023-04 -06	404,400.0 0	8,000.0 0	14.0 0	3.10	487.53	-	-	

券		能									
中信证券	202304060001 2174	江丰电子	2023-04 -06	1,136,380. 00	14,000. 00	14.0 0	3.70	1,635.1 2	-	-	
中信证券	202304060001 2176	锦浪科技	2023-04 -06	156,216.0 0	1,200.0 0	14.0 0	3.40	206.55	-	-	
中信证券	202304060001 2294	天壕能源	2023-04 -06	1,504,360. 00	131,500. 00	14.0 0	3.30	1,930.6 0	-	-	
中信证券	202304060001 2334	爱美客	2023-04 -06	559,600.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.50	544.06	-	-	
中信证券	202304060001 2338	天壕能源	2023-04 -06	11,440.00	1,000.0 0	14.0 0	3.30	14.68	-	-	
中信证券	202304060001 2414	振芯科技	2023-04 -06	733,125.0 0	25,500. 00	7.00	3.60	513.19	-	-	
中信证券	202304060001 5168	瑞丰新材	2023-04 -06	292,221.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.30	375.02	-	-	
中信证券	202304060001 5218	开立医疗	2023-04 -06	1,079,520. 00	19,500. 00	14.0 0	3.00	1,259.4 4	-	-	
中信证券	202304060001 5220	江丰电子	2023-04 -06	811,700.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.70	1,167.9 5	-	-	
中信证券	202304060001 5238	南大光电	2023-04 -06	1,251,120. 00	31,200. 00	14.0 0	4.60	2,238.1 1	-	-	
中信证	202304060001 5318	瑞丰新	2023-04 -06	703,495.0 0	6,500.0 0	14.0 0	3.30	902.82	-	-	

券		材									
中信证券	202304060001 5338	江丰电子	2023-04 -06	121,755.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.70	175.19	-	-	
中信证券	202304060001 6346	鹏辉能源	2023-04 -06	231,168.0 0	4,200.0 0	14.0 0	2.90	260.71	-	-	
中信证券	202304060001 6434	南大光电	2023-04 -06	196,490.0 0	4,900.0 0	14.0 0	4.60	351.50	-	-	
中信证券	202304060001 6604	神州泰岳	2023-04 -06	194,582.0 0	19,400. 00	14.0 0	3.30	249.71	-	-	
中信证券	202304060001 6738	同花顺	2023-04 -06	581,310.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.50	791.23	-	-	
中信证券	202304060001 6744	振芯科技	2023-04 -06	736,000.0 0	25,600. 00	14.0 0	3.50	1,001.7 8	-	-	
中信证券	202304100000 2859	天华新能	2023-04 -10	1,538,400. 00	30,000. 00	14.0 0	3.30	1,974.2 8	-	-	
中信证券	202304100005 4679	江丰电子	2023-04 -10	785,500.0 0	10,000. 00	7.00	3.60	549.85	-	-	
中信证券	202304100005 9575	鹏辉能源	2023-04 -10	129,697.0 0	2,300.0 0	14.0 0	2.90	146.27	-	-	
中信证券	202304100005 9621	鹏辉能源	2023-04 -10	563,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	2.90	635.95	-	-	
中信证	202304100005 9791	鹏辉能	2023-04 -10	563,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	2.90	635.95	-	-	

券		源								
中信证券	202304110000 4774	精 测 电 子	2023-04 -11	1,512,800. 00	20,000. 00	28.0 0	4.10	4,824.1 5	-	-
中信证券	202304110000 4785	精 测 电 子	2023-04 -11	1,369,084. 00	18,100. 00	14.0 0	4.20	2,236.1 7	-	-
中信证券	202304110000 4795	温 氏 股 份	2023-04 -11	21,420.00	1,000.0 0	14.0 0	2.20	18.33	-	-
中信证券	202304110000 4801	盛 弘 股 份	2023-04 -11	137,000.0 0	2,500.0 0	28.0 0	3.40	362.29	-	-
中信证券	202304110000 4810	星 源 材 质	2023-04 -11	444,976.0 0	23,200. 00	14.0 0	3.00	519.14	-	-
中信证券	202304110000 4812	德 方 纳 米	2023-04 -11	205,900.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.30	264.24	-	-
中信证券	202304110000 4838	同 花 顺	2023-04 -11	3,874,000. 00	20,000. 00	14.0 0	3.40	5,122.2 9	-	-
中信证券	202304110000 4924	中 际 旭 创	2023-04 -11	225,390.0 0	3,300.0 0	14.0 0	4.10	359.37	-	-
中信证券	202304110000 4926	汇 川 技 术	2023-04 -11	838,800.0 0	12,000. 00	14.0 0	1.30	424.06	-	-
中信证券	202304110001 9434	振 芯 科 技	2023-04 -11	1,230,342. 00	43,800. 00	14.0 0	3.50	1,674.6 3	-	-
中信证	202304110001 9446	天 壕 能	2023-04 -11	1,991,331. 00	168,900 .00	14.0 0	3.40	2,632.9 8	-	-

券		源									
中信 证券	202304110001 9484	富 临 精 工	2023-04 -11	635,312.0 0	47,200. 00	14.0 0	3.00	741.20	-	-	
中信 证券	202304110001 9588	爱 尔 眼 科	2023-04 -11	133,515.0 0	4,300.0 0	14.0 0	3.20	166.15	-	-	
中信 证券	202304110002 2538	鹏 辉 能 源	2023-04 -11	1,411,072. 00	25,600. 00	14.0 0	5.10	2,798.6 3	-	-	
中信 证券	202304110002 5594	江 丰 电 子	2023-04 -11	799,000.0 0	10,000. 00	7.00	3.60	559.30	-	-	
中信 证券	202304120001 1298	振 芯 科 技	2023-04 -12	969,570.0 0	34,200. 00	14.0 0	3.60	1,357.4 0	-	-	
中信 证券	202304120001 1315	精 测 电 子	2023-04 -12	907,700.0 0	10,000. 00	28.0 0	4.10	2,894.5 5	-	-	
中信 证券	202304120002 6062	盛 弘 股 份	2023-04 -12	107,700.0 0	2,000.0 0	14.0 0	3.50	146.59	-	-	
中信 证券	202304120002 6706	温 氏 股 份	2023-04 -12	703,500.0 0	33,500. 00	14.0 0	2.30	629.24	-	-	
中信 证券	202304120002 7240	德 方 纳 米	2023-04 -12	198,520.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	247.05	-	-	
中信 证券	202304120002 7740	上 能 电 气	2023-04 -12	257,419.0 0	4,700.0 0	14.0 0	5.20	520.56	-	-	
中信 证	202304120002 7814	天 壕 能	2023-04 -12	11,700.00	1,000.0 0	14.0 0	3.40	15.47	-	-	

券		源									
中信证券	202304120002 8380	亿纬锂能	2023-04 -12	3,340,000. 00	50,000. 00	14.0 0	2.30	2,987.4 4	-	-	
中信证券	202304120002 8438	中际旭创	2023-04 -12	2,591,946. 00	37,800. 00	14.0 0	3.60	3,628.7 2	-	-	
中信证券	202304120002 8456	南大光电	2023-04 -12	109,116.0 0	2,800.0 0	14.0 0	4.90	207.93	-	-	
中信证券	202304120002 8462	南大光电	2023-04 -12	155,880.0 0	4,000.0 0	14.0 0	4.90	297.04	-	-	
中信证券	202304120002 8694	江丰电子	2023-04 -12	117,320.0 0	1,400.0 0	14.0 0	3.50	159.69	-	-	
中信证券	202304120002 8704	瑞丰新材	2023-04 -12	2,043,700. 00	19,100. 00	14.0 0	3.40	2,702.2 3	-	-	
中信证券	202304120003 0688	汇川技术	2023-04 -12	958,528.0 0	13,600. 00	14.0 0	1.60	596.42	-	-	
中信证券	202304120003 1294	泰格医药	2023-04 -12	453,465.0 0	4,500.0 0	14.0 0	2.40	423.23	-	-	
中信证券	202304120003 1316	同花顺	2023-04 -12	560,000.0 0	2,800.0 0	14.0 0	3.50	762.22	-	-	
中信证券	202304120003 1908	康龙化成	2023-04 -12	312,137.0 0	6,100.0 0	14.0 0	1.40	169.94	-	-	
中信证	202304130000 4054	同花顺	2023-04 -13	226,728.0 0	1,200.0 0	28.0 0	3.30	581.94	-	-	

券											
中信证券	2023041300004059	爱美客	2023-04-13	563,000.00	1,000.00	14.00	3.40	744.41	-	-	
中信证券	2023041300013827	振芯科技	2023-04-13	716,295.00	25,500.00	7.00	3.70	515.33	-	-	
中信证券	2023041300015333	南大光电	2023-04-13	409,090.00	11,000.00	14.00	4.10	652.27	-	-	
中信证券	2023041300015385	鹏辉能源	2023-04-13	529,300.00	10,000.00	14.00	4.40	905.69	-	-	
中信证券	2023041300016179	神州泰岳	2023-04-13	698,640.00	61,500.00	14.00	4.10	1,113.94	-	-	
中信证券	2023041300016449	苏试试验	2023-04-13	2,006,829.00	69,900.00	14.00	3.40	2,653.47	-	-	
中信证券	2023041300016509	天壕能源	2023-04-13	117,900.00	10,000.00	14.00	3.40	155.89	-	-	
中信证券	2023041300016511	天壕能源	2023-04-13	117,900.00	10,000.00	14.00	3.40	155.89	-	-	
中信证券	2023041300016577	星源材质	2023-04-13	1,378,564.00	74,800.00	14.00	3.30	1,769.16	-	-	
中信证券	2023041300017309	精测电子	2023-04-13	150,528.00	1,600.00	28.00	3.10	362.94	-	-	
中信证	2023041300017319	江丰电	2023-04-13	122,175.00	1,500.00	28.00	3.40	323.09	-	-	

券		子									
中信证券	202304130001 7331	鹏辉能源	2023-04 -13	121,739.0 0	2,300.0 0	14.0 0	5.10	241.45	-	-	
中信证券	202304130001 7393	鼎龙股份	2023-04 -13	144,837.0 0	5,700.0 0	14.0 0	2.90	163.34	-	-	
中信证券	202304170001 2782	江丰电子	2023-04 -17	854,800.0 0	10,000.00	7.00	4.50	747.95	-	-	
中信证券	202304180000 6125	三诺生物	2023-04 -18	30,160.00	1,000.0 0	14.0 0	3.20	42.89	-	-	
中信证券	202304180000 9043	南大光电	2023-04 -18	418,000.0 0	11,000.00	14.0 0	4.10	761.69	-	-	
中信证券	202304180000 9143	江丰电子	2023-04 -18	821,600.0 0	10,000.00	7.00	4.50	718.90	-	-	
中信证券	202304180000 9259	江丰电子	2023-04 -18	123,240.0 0	1,500.0 0	28.0 0	4.30	412.17	-	-	
中信证券	202304180001 1309	天华新能	2023-04 -18	364,480.0 0	6,800.0 0	14.0 0	3.30	534.57	-	-	
中信证券	202304180001 1437	神州泰岳	2023-04 -18	32,654.00	2,900.0 0	14.0 0	3.60	52.25	-	-	
中信证券	202304180001 1801	上能电气	2023-04 -18	195,860.0 0	3,500.0 0	14.0 0	5.30	461.36	-	-	
中信证	202304180001 1831	锦浪科	2023-04 -18	1,752,230.00	13,700.00	14.0 0	3.90	3,037.20	-	-	

券		技									
中信证券	202304180001 1949	盛弘股份	2023-04 -18	140,675.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.50	218.83	-	-	
中信证券	202304180001 1983	江丰电子	2023-04 -18	123,240.0 0	1,500.0 0	14.0 0	4.40	241.00	-	-	
中信证券	202304200000 3650	温氏股份	2023-04 -20	239,673.0 0	11,300.0 00	14.0 0	2.80	260.98	-	-	
中信证券	202304200000 5567	鹏辉能源	2023-04 -20	219,660.0 0	4,200.0 0	14.0 0	4.40	375.86	-	-	
中信证券	202304200000 5579	开立医疗	2023-04 -20	1,043,640.0 00	19,500.0 00	14.0 0	3.30	1,339.3 4	-	-	
中信证券	202304200000 5693	神州泰岳	2023-04 -20	255,110.0 0	19,400.0 00	14.0 0	3.60	357.15	-	-	
中信证券	202304200000 5797	南大光电	2023-04 -20	1,194,336.0 00	31,200.0 00	14.0 0	4.10	1,904.3 0	-	-	
中信证券	202304200000 5833	江丰电子	2023-04 -20	837,100.0 0	10,000.0 00	14.0 0	4.40	1,432.3 7	-	-	
中信证券	202304200000 5871	天壕能源	2023-04 -20	12,290.00	1,000.0 0	28.0 0	3.40	32.50	-	-	
中信证券	202304200000 5905	精测电子	2023-04 -20	145,158.0 0	1,300.0 0	28.0 0	4.10	462.89	-	-	
中信证	202304200000 7887	同花顺	2023-04 -20	567,000.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.40	749.70	-	-	

券										
中信证券	2023042000008243	振芯科技	2023-04-20	607,410.00	25,500.00	7.00	3.70	437.00	-	-
中信证券	2023042000011865	振芯科技	2023-04-20	609,792.00	25,600.00	14.00	3.60	853.71	-	-
中信证券	2023042000011891	天壕能源	2023-04-20	1,616,135.00	131,500.00	14.00	3.50	2,199.74	-	-
中信证券	2023042000011893	锦浪科技	2023-04-20	146,460.00	1,200.00	14.00	3.90	222.13	-	-
中信证券	2023042000011913	南大光电	2023-04-20	187,572.00	4,900.00	14.00	4.10	299.07	-	-
中信证券	2023042000011917	爱美客	2023-04-20	533,050.00	1,000.00	14.00	3.40	704.81	-	-
中信证券	2023042000011923	江丰电子	2023-04-20	1,171,940.00	14,000.00	14.00	4.40	2,005.32	-	-
中信证券	2023042000011925	江丰电子	2023-04-20	125,565.00	1,500.00	14.00	4.40	214.86	-	-
中信证券	2023042000011935	上能电气	2023-04-20	253,095.00	4,700.00	14.00	5.30	521.66	-	-
中信证券	2023042000011939	江丰电子	2023-04-20	125,565.00	1,500.00	14.00	4.40	214.86	-	-
中信证	2023042000011943	天华新	2023-04-20	416,080.00	8,000.00	14.00	3.30	533.97	-	-

券		能									
中信证券	202304200001 1953	锦浪科技	2023-04 -20	1,403,575. 00	11,500. 00	14.0 0	3.90	2,128.7 6	-	-	
中信证券	202304200001 2191	盛弘股份	2023-04 -20	138,250.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.60	193.55	-	-	
中信证券	202304200001 5069	爱美客	2023-04 -20	533,050.0 0	1,000.0 0	14.0 0	1.80	373.14	-	-	
中信证券	202304240000 9583	鹏辉能源	2023-04 -24	501,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.60	702.10	-	-	
中信证券	202304240001 3423	天华新能	2023-04 -24	1,533,900. 00	30,000. 00	14.0 0	3.10	1,849.2 0	-	-	
中信证券	202304240002 5123	江丰电子	2023-04 -24	740,300.0 0	10,000. 00	7.00	3.50	719.74	-	-	
中信证券	202304250004 8893	星源材质	2023-04 -25	384,656.0 0	23,200. 00	14.0 0	2.80	418.85	-	-	
中信证券	202304250005 3065	精测电子	2023-04 -25	2,006,928. 00	18,100. 00	14.0 0	4.20	3,277.9 8	-	-	
中信证券	202304250005 3339	中际旭创	2023-04 -25	266,937.0 0	3,300.0 0	14.0 0	2.70	280.28	-	-	
中信证券	202304250005 3729	温氏股份	2023-04 -25	20,690.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	22.53	-	-	
中信证	202304250005 5891	天壕能	2023-04 -25	114,500.0 0	10,000. 00	28.0 0	3.30	293.88	-	-	

券		源									
中信证 券	202304250005 9759	德 方 纳 米	2023-04 -25	167,570.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	208.53	-	-	
中信证 券	202304250006 1363	同 花 顺	2023-04 -25	3,900,200. 00	20,000. 00	14.0 0	3.40	5,156.9 3	-	-	
中信证 券	202304250006 1653	精 测 电 子	2023-04 -25	210,672.0 0	1,900.0 0	28.0 0	4.10	671.81	-	-	
中信证 券	202304250006 2609	富 临 精 工	2023-04 -25	471,056.0 0	47,200. 00	14.0 0	2.60	476.29	-	-	
中信证 券	202304250006 2977	天 壕 能 源	2023-04 -25	1,933,905. 00	168,900 .00	14.0 0	3.40	2,557.0 5	-	-	
中信证 券	202304250006 3493	江 丰 电 子	2023-04 -25	722,600.0 0	10,000. 00	7.00	3.50	632.28	-	-	
中信证 券	202304250006 4623	振 芯 科 技	2023-04 -25	959,220.0 0	43,800. 00	14.0 0	3.60	1,342.9 1	-	-	
中信证 券	202304260000 4948	蓝 晓 科 技	2023-04 -26	89,000.00	1,000.0 0	14.0 0	1.80	62.30	-	-	
中信证 券	202304260000 4957	三 诺 生 物	2023-04 -26	30,060.00	1,000.0 0	14.0 0	3.30	38.58	-	-	
中信证 券	202304260000 6066	盛 弘 股 份	2023-04 -26	115,840.0 0	2,000.0 0	14.0 0	3.70	166.68	-	-	
中信证 券	202304260000 7276	康 龙 化	2023-04 -26	283,345.0 0	6,100.0 0	14.0 0	2.50	275.47	-	-	

券		成								
中信证券	2023042600008576	温氏股份	2023-04-26	676,700.00	33,500.00	14.00	2.80	736.85	-	-
中信证券	2023042600010784	亿纬锂能	2023-04-26	3,339,500.00	50,000.00	14.00	2.30	2,987.00	-	-
中信证券	2023042600018742	中际旭创	2023-04-26	3,003,210.00	37,800.00	14.00	3.20	3,737.33	-	-
中信证券	2023042600028928	德方纳米	2023-04-26	178,370.00	1,000.00	14.00	3.20	221.97	-	-
中信证券	2023042600028954	泰格医药	2023-04-26	417,330.00	4,500.00	14.00	2.20	357.05	-	-
中信证券	2023042600029482	江丰电子	2023-04-26	100,618.00	1,400.00	14.00	3.40	133.04	-	-
中信证券	2023042600029524	上能电气	2023-04-26	272,882.00	4,700.00	14.00	5.10	541.22	-	-
中信证券	2023042600029560	天壕能源	2023-04-26	11,640.00	1,000.00	14.00	3.40	15.39	-	-
中信证券	2023042600031614	振芯科技	2023-04-26	766,080.00	34,200.00	14.00	3.60	1,072.51	-	-
中信证券	2023042600031658	南大光电	2023-04-26	94,080.00	2,800.00	14.00	5.70	208.54	-	-
中信证	2023042600032496	汇川技	2023-04-26	830,416.00	13,600.00	14.00	2.10	678.17	-	-

券		术									
中信证券	202304260003 2518	瑞丰新材	2023-04 -26	1,833,791.00	19,100.00	14.00	3.40	2,424.68	-	-	
中信证券	202304270000 6087	蓝晓科技	2023-04 -27	92,520.00	1,000.00	14.00	1.80	64.76	-	-	
中信证券	202304270000 6114	中熔电气	2023-04 -27	1,993,200.00	15,000.00	14.00	2.80	2,170.37	-	-	
中信证券	202304270001 2178	神州泰岳	2023-04 -27	759,525.00	61,500.00	14.00	3.60	1,063.34	-	-	
中信证券	202304270001 4640	振芯科技	2023-04 -27	593,130.00	25,500.00	14.00	2.60	599.72	-	-	
中信证券	202304270001 4950	鼎龙股份	2023-04 -27	143,070.00	5,700.00	14.00	3.50	194.73	-	-	
中信证券	202304270001 5004	鹏辉能源	2023-04 -27	530,200.00	10,000.00	14.00	3.60	742.28	-	-	
中信证券	202304270001 5014	鹏辉能源	2023-04 -27	121,946.00	2,300.00	14.00	3.60	170.72	-	-	
中信证券	202304270002 0414	天壕能源	2023-04 -27	119,600.00	10,000.00	14.00	3.40	158.14	-	-	
中信证券	202304270002 0522	精测电子	2023-04 -27	269,152.00	2,600.00	28.00	4.10	858.30	-	-	
中信证	202304270002 0640	天壕能	2023-04 -27	119,600.00	10,000.00	14.00	3.40	158.14	-	-	

券		源									
中信证券	202304270002 2266	苏试试验	2023-04 -27	2,034,789. 00	69,900. 00	14.0 0	3.70	2,927.8 4	-	-	
中信证券	202305040001 4145	南大光电	2023-05 -04	171,157.0 0	4,900.0 0	14.0 0	4.30	286.21	-	-	
中信证券	202305040001 4153	天壕能源	2023-05 -04	1,601,670. 00	131,500 .00	14.0 0	3.90	2,429.2 0	-	-	
中信证券	202305040001 4231	鹏辉能源	2023-05 -04	224,028.0 0	4,200.0 0	14.0 0	3.50	304.93	-	-	
中信证券	202305040001 4255	盛弘股份	2023-05 -04	146,225.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	210.40	-	-	
中信证券	202305040001 4821	江丰电子	2023-05 -04	107,595.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.70	154.82	-	-	
中信证券	202305040001 4851	江丰电子	2023-05 -04	107,595.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.70	154.82	-	-	
中信证券	202305040001 4951	江丰电子	2023-05 -04	717,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.70	1,032.1 2	-	-	
中信证券	202305040001 5653	上能电气	2023-05 -04	197,435.0 0	3,500.0 0	14.0 0	2.80	214.98	-	-	
中信证券	202305040001 6175	江丰电子	2023-05 -04	717,300.0 0	10,000. 00	7.00	3.80	530.01	-	-	
中信证	202305040001 8631	神州泰	2023-05 -04	283,240.0 0	19,400. 00	14.0 0	3.90	429.58	-	-	

券		岳									
中信证 券	202305040001 8643	振 芯 科 技	2023-05 -04	583,936.0 0	25,600. 00	14.0 0	2.60	590.42	-	-	
中信证 券	202305040001 8675	锦 浪 科 技	2023-05 -04	1,570,157. 00	13,700. 00	14.0 0	3.70	2,259.2 8	-	-	
中信证 券	202305040001 8739	爱 美 客	2023-05 -04	531,290.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.30	681.82	-	-	
中信证 券	202305040001 8741	锦 浪 科 技	2023-05 -04	137,532.0 0	1,200.0 0	14.0 0	3.70	197.89	-	-	
中信证 券	202305040001 8821	江 丰 电 子	2023-05 -04	1,004,220. 00	14,000. 00	14.0 0	3.70	1,444.9 6	-	-	
中信证 券	202305040001 8829	江 丰 电 子	2023-05 -04	107,595.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.70	154.82	-	-	
中信证 券	202305040001 9207	盛 弘 股 份	2023-05 -04	146,225.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	210.40	-	-	
中信证 券	202305040001 9215	江 丰 电 子	2023-05 -04	717,300.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.70	1,032.1 2	-	-	
中信证 券	202305040002 2287	上 能 电 气	2023-05 -04	265,127.0 0	4,700.0 0	14.0 0	2.80	288.69	-	-	
中信证 券	202305040002 2293	开 立 医 疗	2023-05 -04	1,052,220. 00	19,500. 00	14.0 0	3.30	1,350.3 5	-	-	
中信证 券	202305040002 2367	锦 浪 科 技	2023-05 -04	1,318,015. 00	11,500. 00	14.0 0	3.70	1,896.4 8	-	-	

券		技									
中信证券	202305040002 2371	同花顺	2023-05 -04	473,148.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.40	625.61	-	-	
中信证券	202305040002 2403	神州泰岳	2023-05 -04	42,340.00	2,900.0 0	14.0 0	3.90	64.22	-	-	
中信证券	202305040002 2421	南大光电	2023-05 -04	1,089,816. 00	31,200. 00	14.0 0	4.30	1,822.4 1	-	-	
中信证券	202305040003 8677	天华新能	2023-05 -04	389,440.0 0	8,000.0 0	14.0 0	3.00	454.35	-	-	
中信证券	202305040003 9711	天华新能	2023-05 -04	331,024.0 0	6,800.0 0	14.0 0	3.00	386.19	-	-	
中信证券	202305040003 9825	温氏股份	2023-05 -04	220,237.0 0	11,300. 00	14.0 0	2.70	231.25	-	-	
中信证券	202305040004 1265	爱美客	2023-05 -04	531,290.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.30	681.82	-	-	
中信证券	202305080001 8339	天华新能	2023-05 -08	1,024,200. 00	30,000. 00	14.0 0	3.00	1,194.9 0	-	-	
中信证券	202305080001 9379	鹏辉能源	2023-05 -08	508,600.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	692.26	-	-	
中信证券	202305090000 6424	蓝晓科技	2023-05 -09	89,550.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	94.03	-	-	
中信证	202305090001 2607	天壕能	2023-05 -09	1,969,374. 00	168,900 .00	14.0 0	3.90	2,986.8 8	-	-	

券		源								
中信证券	202305090001 6871	精测电子	2023-05 -09	1,942,400. 00	20,000. 00	28.0 0	3.40	5,136.5 7	-	-
中信证券	202305090001 6957	振芯科技	2023-05 -09	966,666.0 0	43,800. 00	14.0 0	2.60	977.41	-	-
中信证券	202305090002 2929	富临精工	2023-05 -09	463,032.0 0	47,200. 00	14.0 0	3.10	558.21	-	-
中信证券	202305090002 3083	同花顺	2023-05 -09	3,561,200. 00	20,000. 00	14.0 0	3.50	4,847.1 9	-	-
中信证券	202305090002 3249	德方纳米	2023-05 -09	153,610.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	191.16	-	-
中信证券	202305090002 3391	中际旭创	2023-05 -09	270,402.0 0	3,300.0 0	14.0 0	3.20	336.50	-	-
中信证券	202305090002 3457	精测电子	2023-05 -09	1,757,872. 00	18,100. 00	14.0 0	3.50	2,392.6 6	-	-
中信证券	202305090002 4575	盛弘股份	2023-05 -09	145,550.0 0	2,500.0 0	28.0 0	3.60	407.54	-	-
中信证券	202305100000 6428	汇川技术	2023-05 -10	782,000.0 0	13,600. 00	14.0 0	1.70	516.99	-	-
中信证券	202305100000 7548	中际旭创	2023-05 -10	2,865,240. 00	37,800. 00	14.0 0	3.20	3,565.6 3	-	-
中信证	202305100000 9200	蓝晓科	2023-05 -10	90,400.00	1,000.0 0	14.0 0	1.80	63.28	-	-

券		技									
中信证券	202305100001 2818	泰格医药	2023-05 -10	398,385.0 0	4,500.0 0	14.0 0	2.50	387.32	-	-	
中信证券	202305100001 4218	亿纬锂能	2023-05 -10	3,248,000. 00	50,000. 00	14.0 0	1.60	2,020.9 8	-	-	
中信证券	202305100001 6598	南大光电	2023-05 -10	93,884.00	2,800.0 0	14.0 0	4.30	156.99	-	-	
中信证券	202305100002 0096	上能电气	2023-05 -10	241,674.0 0	4,700.0 0	14.0 0	2.80	263.16	-	-	
中信证券	202305100002 0600	振芯科技	2023-05 -10	750,006.0 0	34,200. 00	14.0 0	2.60	758.34	-	-	
中信证券	202305100002 0750	瑞丰新材	2023-05 -10	2,093,360. 00	19,100. 00	14.0 0	2.80	2,279.4 4	-	-	
中信证券	202305100002 2318	精测电子	2023-05 -10	981,000.0 0	10,000. 00	28.0 0	3.40	2,594.2 0	-	-	
中信证券	202305100002 2378	天壕能源	2023-05 -10	11,630.00	1,000.0 0	14.0 0	3.90	17.64	-	-	
中信证券	202305100002 5078	康龙化成	2023-05 -10	282,735.0 0	6,100.0 0	14.0 0	3.00	329.86	-	-	
中信证券	202305100002 5378	温氏股份	2023-05 -10	632,480.0 0	33,500. 00	14.0 0	2.80	688.70	-	-	
中信证	202305100003 0486	江丰电	2023-05 -10	88,102.00	1,400.0 0	14.0 0	3.30	113.06	-	-	

券		子									
中信证券	202305100003 1768	盛弘股份	2023-05 -10	129,200.0 0	2,000.0 0	14.0 0	3.70	185.90	-	-	
中信证券	202305110000 6137	精测电子	2023-05 -11	155,072.0 0	1,600.0 0	28.0 0	3.40	410.08	-	-	
中信证券	202305110000 6425	鹏辉能源	2023-05 -11	531,200.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	723.02	-	-	
中信证券	202305110000 6427	鹏辉能源	2023-05 -11	122,176.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.50	166.30	-	-	
中信证券	202305110000 9209	天壕能源	2023-05 -11	116,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.90	177.30	-	-	
中信证券	202305110001 0329	苏试试验	2023-05 -11	1,832,778. 00	69,900. 00	14.0 0	2.40	1,710.5 9	-	-	
中信证券	202305110001 0415	中熔电气	2023-05 -11	1,888,650. 00	15,000. 00	14.0 0	2.80	2,056.5 3	-	-	
中信证券	202305110001 0455	鼎龙股份	2023-05 -11	137,940.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.20	171.66	-	-	
中信证券	202305110001 0461	江丰电子	2023-05 -11	93,750.00	1,500.0 0	28.0 0	3.60	262.50	-	-	
中信证券	202305110001 2983	江丰电子	2023-05 -11	625,000.0 0	10,000. 00	7.00	3.40	413.19	-	-	
中信证	202305110001 4453	蓝晓科	2023-05 -11	91,280.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	95.84	-	-	

券		技								
中信证券	2023051100020849	神州泰岳	2023-05-11	727,545.00	61,500.00	14.00	3.90	1,103.44	-	-
中信证券	2023051100020877	振芯科技	2023-05-11	554,880.00	25,500.00	14.00	2.60	561.05	-	-
中信证券	2023051700003447	瑞丰新材	2023-05-17	1,952,569.00	33,100.00	14.00	3.10	2,353.93	-	-
中信证券	2023051700003508	神州泰岳	2023-05-17	114,904.00	10,600.00	14.00	4.10	183.21	-	-
中信证券	2023051700003518	神州泰岳	2023-05-17	210,296.00	19,400.00	28.00	4.00	654.25	-	-
中信证券	2023051800003850	鹏辉能源	2023-05-18	97,242.00	1,900.00	14.00	3.40	128.58	-	-
中信证券	2023051800003864	蓝晓科技	2023-05-18	94,110.00	1,000.00	14.00	2.50	91.50	-	-
中信证券	2023051800007778	精测电子	2023-05-18	139,568.00	1,300.00	28.00	2.50	271.38	-	-
中信证券	2023051800010942	同花顺	2023-05-18	507,438.00	2,700.00	14.00	3.50	690.68	-	-
中信证券	2023051800016038	开立医疗	2023-05-18	1,107,600.00	19,500.00	14.00	2.70	1,162.98	-	-
中信证	2023051800016112	天华新	2023-05-18	250,988.00	6,800.00	14.00	3.50	341.62	-	-

券		能								
中信证券	202305180001 7428	温氏股份	2023-05 -18	207,355.0 0	11,300.0 00	14.0 0	2.80	225.79	-	-
中信证券	202305180001 7900	天华新能	2023-05 -18	295,280.0 0	8,000.0 0	14.0 0	3.50	401.91	-	-
中信证券	202305180001 8146	上能电气	2023-05 -18	181,790.0 0	3,500.0 0	14.0 0	3.20	226.23	-	-
中信证券	202305180001 8212	振芯科技	2023-05 -18	577,536.0 0	25,600.0 00	14.0 0	2.70	606.41	-	-
中信证券	202305180001 8228	南大光电	2023-05 -18	163,121.0 0	4,900.0 0	14.0 0	3.60	228.37	-	-
中信证券	202305180002 5188	盛弘股份	2023-05 -18	105,050.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	151.16	-	-
中信证券	202305180002 5610	盛弘股份	2023-05 -18	105,050.0 0	2,500.0 0	14.0 0	3.70	151.16	-	-
中信证券	202305180002 5862	锦浪科技	2023-05 -18	1,244,070.0 00	11,500.0 00	14.0 0	3.40	1,644.9 4	-	-
中信证券	202305180003 3114	锦浪科技	2023-05 -18	1,482,066.0 00	13,700.0 00	14.0 0	3.40	1,959.6 2	-	-
中信证券	202305180003 3130	上能电气	2023-05 -18	244,118.0 0	4,700.0 0	14.0 0	3.20	303.79	-	-
中信证	202305180003 3152	神州泰	2023-05 -18	33,698.00	2,900.0 0	14.0 0	3.90	51.11	-	-

券		岳									
中信证券	202305180003 5868	天壕能源	2023-05 -18	11,910.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	12.04	-	-	
中信证券	202305180003 5872	南大光电	2023-05 -18	1,038,648. 00	31,200. 00	14.0 0	3.60	1,454.1 1	-	-	
中信证券	202305180003 5944	锦浪科技	2023-05 -18	129,816.0 0	1,200.0 0	14.0 0	3.40	171.65	-	-	
中信证券	202305180003 6032	天壕能源	2023-05 -18	1,566,165. 00	131,500. .00	14.0 0	2.60	1,583.5 7	-	-	
中信证券	202305180003 6182	江丰电子	2023-05 -18	675,600.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	867.02	-	-	
中信证券	202305180003 6396	神州泰岳	2023-05 -18	225,428.0 0	19,400. 00	14.0 0	3.90	341.90	-	-	
中信证券	202305220001 4552	天华新能	2023-05 -22	1,087,200. 00	30,000. 00	14.0 0	3.40	1,437.5 2	-	-	
中信证券	202305220001 6378	鹏辉能源	2023-05 -22	505,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	668.91	-	-	
中信证券	202305230000 5119	江丰电子	2023-05 -23	101,430.0 0	1,500.0 0	14.0 0	3.50	138.06	-	-	
中信证券	202305230000 5138	鹏辉能源	2023-05 -23	94,031.00	1,900.0 0	14.0 0	3.40	124.33	-	-	
中信证	202305230000 5148	鹏辉能	2023-05 -23	494,900.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	654.37	-	-	

券		源									
中信证券	202305230000 6716	中际旭创	2023-05 -23	287,760.0 0	3,300.0 0	14.0 0	3.50	391.67	-	-	
中信证券	202305230000 7008	天壕能源	2023-05 -23	122,200.0 0	10,000.00	14.0 0	3.70	175.83	-	-	
中信证券	202305230000 7010	精测电子	2023-05 -23	182,932.0 0	1,900.0 0	14.0 0	2.60	184.96	-	-	
中信证券	202305230000 8308	振芯科技	2023-05 -23	982,434.0 0	43,800.00	14.0 0	2.70	1,031.56	-	-	
中信证券	202305230000 8546	蓝晓科技	2023-05 -23	94,300.00	1,000.0 0	14.0 0	2.50	91.68	-	-	
中信证券	202305230000 9538	天壕能源	2023-05 -23	2,063,958.00	168,900.00	14.0 0	3.70	2,969.81	-	-	
中信证券	202305230001 2628	富临精工	2023-05 -23	499,376.0 0	47,200.00	14.0 0	3.00	582.61	-	-	
中信证券	202305230002 2690	精测电子	2023-05 -23	1,742,668.00	18,100.00	14.0 0	2.60	1,762.03	-	-	
中信证券	202305230002 3920	德方纳米	2023-05 -23	171,000.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.10	206.15	-	-	
中信证券	202305240000 3150	盛弘股份	2023-05 -24	129,248.0 0	3,200.0 0	14.0 0	3.70	185.97	-	-	
中信证	202305240000 3151	鹏辉能	2023-05 -24	94,164.00	1,900.0 0	14.0 0	3.40	124.51	-	-	

券		源								
中信证券	202305240000 3152	精测电子	2023-05 -24	1,060,640.00	11,200.00	14.00	2.60	1,072.42	-	-
中信证券	202305240000 3153	盛弘股份	2023-05 -24	100,975.00	2,500.00	14.00	3.70	145.29	-	-
中信证券	202305240000 3154	开立医疗	2023-05 -24	60,400.00	1,000.00	14.00	3.00	70.47	-	-
中信证券	202305240000 3158	天壕能源	2023-05 -24	12,280.00	1,000.00	14.00	2.40	11.46	-	-
中信证券	202305240000 3178	蓝晓科技	2023-05 -24	94,870.00	1,000.00	14.00	2.60	95.92	-	-
中信证券	202305240000 3180	阳光电源	2023-05 -24	117,300.00	1,000.00	14.00	2.30	104.92	-	-
中信证券	202305240000 3182	亿纬锂能	2023-05 -24	94,318.00	1,400.00	14.00	2.10	77.03	-	-
中信证券	202305240000 3188	天壕能源	2023-05 -24	12,280.00	1,000.00	14.00	2.40	11.46	-	-
中信证券	202305240000 3189	江丰电子	2023-05 -24	578,676.00	8,400.00	14.00	3.50	787.64	-	-
中信证券	202305240000 3190	图南股份	2023-05 -24	84,960.00	1,800.00	14.00	3.10	102.42	-	-
中信证	202305240000 3210	江丰电	2023-05 -24	179,114.00	2,600.00	14.00	3.50	243.79	-	-

券		子									
中信证券	202305240000 3212	图南股份	2023-05 -24	132,160.0 0	2,800.0 0	14.0 0	3.10	159.33	-	-	
中信证券	202305240000 3228	神州泰岳	2023-05 -24	11,420.00	1,000.0 0	14.0 0	4.10	18.21	-	-	
中信证券	202305240000 3230	亿纬锂能	2023-05 -24	107,792.0 0	1,600.0 0	14.0 0	2.10	88.03	-	-	
中信证券	202305240000 4954	盛弘股份	2023-05 -24	80,780.00	2,000.0 0	14.0 0	3.70	116.23	-	-	
中信证券	202305240000 6442	康龙化成	2023-05 -24	288,713.0 0	6,100.0 0	14.0 0	2.10	235.78	-	-	
中信证券	202305240000 6686	温氏股份	2023-05 -24	588,930.0 0	33,500. 00	14.0 0	3.00	687.09	-	-	
中信证券	202305240001 1056	泰格医药	2023-05 -24	396,000.0 0	4,500.0 0	14.0 0	3.10	477.40	-	-	
中信证券	202305240001 1104	中际旭创	2023-05 -24	3,313,926. 00	37,800. 00	14.0 0	3.50	4,510.6 2	-	-	
中信证券	202305240001 1140	瑞丰新材	2023-05 -24	1,120,788. 00	19,100. 00	14.0 0	3.10	1,351.1 7	-	-	
中信证券	202305240001 1236	南大光电	2023-05 -24	101,024.0 0	2,800.0 0	14.0 0	3.80	149.29	-	-	
中信证	202305240001 1768	亿纬锂	2023-05 -24	3,368,500. 00	50,000. 00	14.0 0	2.10	2,750.9 4	-	-	

券		能									
中信证券	202305240001 3852	汇川技术	2023-05 -24	818,720.0 0	13,600. 00	14.0 0	1.90	604.94	-	-	
中信证券	202305240001 3860	上能电气	2023-05 -24	233,308.0 0	4,700.0 0	14.0 0	2.60	235.90	-	-	
中信证券	202305240001 3928	天壕能源	2023-05 -24	12,280.00	1,000.0 0	14.0 0	3.70	17.67	-	-	
中信证券	202305240001 3932	振芯科技	2023-05 -24	771,210.0 0	34,200. 00	14.0 0	2.70	809.77	-	-	
中信证券	202305240001 5964	江丰电子	2023-05 -24	96,446.00	1,400.0 0	14.0 0	3.50	131.27	-	-	
中信证券	202305240002 2244	蓝晓科技	2023-05 -24	94,870.00	1,000.0 0	14.0 0	2.50	92.23	-	-	
中信证券	202305250000 4754	开立医疗	2023-05 -25	179,400.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.00	209.30	-	-	
中信证券	202305250000 4760	开立医疗	2023-05 -25	179,400.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.00	209.30	-	-	
中信证券	202305250000 4769	阳光电源	2023-05 -25	120,030.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.30	107.36	-	-	
中信证券	202305250000 4771	盛弘股份	2023-05 -25	144,772.0 0	3,400.0 0	14.0 0	3.70	208.31	-	-	
中信证	202305250000 4773	盛弘股	2023-05 -25	246,964.0 0	5,800.0 0	14.0 0	3.70	355.35	-	-	

券		份									
中信证券	202305250000 4774	泰格医药	2023-05 -25	208,344.0 0	2,400.0 0	14.0 0	2.60	210.66	-	-	
中信证券	202305250000 4775	天壕能源	2023-05 -25	12,410.00	1,000.0 0	14.0 0	2.40	11.58	-	-	
中信证券	202305250000 4776	天壕能源	2023-05 -25	12,410.00	1,000.0 0	14.0 0	2.40	11.58	-	-	
中信证券	202305250000 4778	泰格医药	2023-05 -25	399,326.0 0	4,600.0 0	14.0 0	2.60	403.76	-	-	
中信证券	202305250001 2316	中熔电气	2023-05 -25	1,987,500. 00	15,000. 00	14.0 0	2.80	2,164.1 7	-	-	
中信证券	202305250001 6326	精测电子	2023-05 -25	245,622.0 0	2,600.0 0	14.0 0	2.60	248.35	-	-	
中信证券	202305250001 8110	鹏辉能源	2023-05 -25	115,437.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.40	152.63	-	-	
中信证券	202305250001 8116	蓝晓科技	2023-05 -25	93,880.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	94.92	-	-	
中信证券	202305250001 8382	神州泰岳	2023-05 -25	668,505.0 0	61,500. 00	14.0 0	4.10	1,065.8 9	-	-	
中信证券	202305250001 9880	鼎龙股份	2023-05 -25	154,755.0 0	5,700.0 0	14.0 0	3.00	180.55	-	-	
中信证	202305250002 0008	苏试试	2023-05 -25	1,520,325. 00	69,900. 00	14.0 0	2.40	1,418.9 7	-	-	

券		验									
中信证券	202305250002 2288	振芯科技	2023-05 -25	574,515.0 0	25,500.00	14.0 0	2.70	603.24	-	-	
中信证券	202305310000 7157	瑞丰新材	2023-05 -31	1,920,131.00	33,100.00	7.00	3.30	1,232.08	-	-	
中信证券	202305310000 7890	神州泰岳	2023-05 -31	143,842.00	10,600.00	7.00	4.20	117.47	-	-	
中信证券	202306010003 0442	蓝晓科技	2023-06 -01	91,300.00	1,000.00	7.00	2.70	47.93	-	-	
中信证券	202306010003 0460	上能电气	2023-06 -01	165,480.00	3,500.00	7.00	2.70	86.88	-	-	
中信证券	202306010003 0883	神州泰岳	2023-06 -01	38,628.00	2,900.00	7.00	4.20	31.55	-	-	
中信证券	202306010003 0960	天华新能	2023-06 -01	272,640.00	8,000.00	7.00	3.50	185.55	-	-	
中信证券	202306010003 1196	温氏股份	2023-06 -01	188,371.00	11,300.00	7.00	3.10	113.55	-	-	
中信证券	202306010003 2334	同花顺	2023-06 -01	475,956.00	2,700.00	7.00	3.50	323.91	-	-	
中信证券	202306010003 2498	天华新能	2023-06 -01	231,744.00	6,800.00	7.00	3.50	157.71	-	-	
中信证	202306010003 2664	上能电	2023-06 -01	222,216.00	4,700.00	7.00	2.70	116.66	-	-	

券		气								
中信证券	202306010003 2830	天壕能源	2023-06 -01	12,030.00	1,000.0 0	7.00	2.70	6.32	-	-
中信证券	202306010003 3331	锦浪科技	2023-06 -01	119,592.0 0	1,200.0 0	7.00	3.50	81.39	-	-
中信证券	202306010003 3582	锦浪科技	2023-06 -01	1,365,342. 00	13,700. 00	7.00	3.50	929.19	-	-
中信证券	202306010003 3858	振芯科技	2023-06 -01	567,808.0 0	25,600. 00	7.00	2.80	309.14	-	-
中信证券	202306010003 4478	开立医疗	2023-06 -01	1,130,610. 00	19,500. 00	7.00	3.10	681.51	-	-
中信证券	202306010003 4555	神州泰岳	2023-06 -01	258,408.0 0	19,400. 00	7.00	4.20	211.03	-	-
中信证券	202306010003 5465	盛弘股份	2023-06 -01	96,950.00	2,500.0 0	7.00	3.80	71.64	-	-
中信证券	202306010003 5576	锦浪科技	2023-06 -01	1,146,090. 00	11,500. 00	7.00	3.50	779.98	-	-
中信证券	202306010003 5912	南大光电	2023-06 -01	1,120,392. 00	31,200. 00	7.00	3.70	806.06	-	-
中信证券	202306010003 5924	盛弘股份	2023-06 -01	96,950.00	2,500.0 0	7.00	3.80	71.64	-	-
中信证	202306010003 6987	南大光	2023-06 -01	175,959.0 0	4,900.0 0	7.00	3.70	126.59	-	-

券		电								
中信证 券	202306010003 7006	鹏 辉 能 源	2023-06 -01	89,395.00	1,900.0 0	7.00	3.50	60.84	-	-
中信证 券	202306010003 7615	天 壕 能 源	2023-06 -01	1,581,945. 00	131,500 .00	7.00	2.50	769.00	-	-
中信证 券	202306050002 2847	鹏 辉 能 源	2023-06 -05	478,600.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	651.43	-	-
中信证 券	202306060001 4005	鹏 辉 能 源	2023-06 -06	89,452.00	1,900.0 0	14.0 0	3.50	121.75	-	-
中信证 券	202306060001 4436	鹏 辉 能 源	2023-06 -06	470,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.50	640.81	-	-
中信证 券	202306060001 5570	天 壕 能 源	2023-06 -06	1,959,240. 00	168,900 .00	14.0 0	2.60	1,981.0 1	-	-
中信证 券	202306060001 5692	盛 弘 股 份	2023-06 -06	97,625.00	2,500.0 0	14.0 0	3.70	140.47	-	-
中信证 券	202306060001 7418	蓝 晓 科 技	2023-06 -06	95,050.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	99.80	-	-
中信证 券	202306060002 0610	中 际 旭 创	2023-06 -06	354,123.0 0	3,300.0 0	14.0 0	3.70	509.54	-	-
中信证 券	202306060002 0688	天 壕 能 源	2023-06 -06	116,000.0 0	10,000. 00	14.0 0	2.60	117.29	-	-
中信证 券	202306070000 4909	掌 趣 科	2023-06 -07	5,410.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	5.47	-	-

券		技									
中信证券	202306070000 4931	蓝色 光标	2023-06 -07	11,410.00	1,000.0 0	28.0 0	3.00	21.87	11,410.00	21.87	
中信证券	202306070000 4948	爱尔 眼科	2023-06 -07	33,865.00	1,300.0 0	14.0 0	3.00	39.51	-	-	
中信证券	202306070000 4950	神州 泰岳	2023-06 -07	167,400.0 0	12,400. 00	14.0 0	4.60	299.46	-	-	
中信证券	202306070000 4989	蓝色 光标	2023-06 -07	11,410.00	1,000.0 0	14.0 0	3.10	13.76	-	-	
中信证券	202306070000 4998	天壕 能源	2023-06 -07	11,520.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	18.82	-	-	
中信证券	202306070000 5025	网宿 科技	2023-06 -07	7,930.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	8.63	-	-	
中信证券	202306070001 6837	瑞丰 新材	2023-06 -07	2,007,846. 00	33,100. 00	7.00	3.30	1,288.3 7	-	-	
中信证券	202306070002 0828	中际 旭创	2023-06 -07	4,086,558. 00	37,800. 00	14.0 0	3.70	5,880.1 0	-	-	
中信证券	202306070002 1030	盛弘 股份	2023-06 -07	75,260.00	2,000.0 0	14.0 0	3.70	108.29	-	-	
中信证券	202306070002 1135	开立 医疗	2023-06 -07	57,980.00	1,000.0 0	14.0 0	3.00	67.64	-	-	
中信证	202306070002 1363	盛弘 股	2023-06 -07	120,416.0 0	3,200.0 0	14.0 0	3.70	173.27	-	-	

券		份									
中信证券	202306070002 1455	温氏股份	2023-06 -07	543,705.0 0	33,500.0 00	14.0 0	3.10	655.47	-	-	
中信证券	202306070002 1471	盛弘股份	2023-06 -07	94,075.00	2,500.0 0	14.0 0	3.70	135.36	-	-	
中信证券	202306070002 1780	天壕能源	2023-06 -07	11,520.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	11.65	-	-	
中信证券	202306070002 1905	蓝晓科技	2023-06 -07	92,910.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	97.56	-	-	
中信证券	202306070002 2961	蓝晓科技	2023-06 -07	92,910.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	97.56	-	-	
中信证券	202306070002 3085	阳光电源	2023-06 -07	102,160.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.00	79.46	-	-	
中信证券	202306070002 3176	鹏辉能源	2023-06 -07	87,723.00	1,900.0 0	14.0 0	3.50	119.40	-	-	
中信证券	202306070002 3192	亿纬锂能	2023-06 -07	3,001,000.0 00	50,000.0 00	14.0 0	2.50	2,917.6 4	-	-	
中信证券	202306070002 3722	天壕能源	2023-06 -07	11,520.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	11.65	-	-	
中信证券	202306070002 4245	亿纬锂能	2023-06 -07	84,028.00	1,400.0 0	14.0 0	2.50	81.69	-	-	
中信证	202306070002 4246	亿纬锂	2023-06 -07	96,032.00	1,600.0 0	14.0 0	2.50	93.36	-	-	

券		能									
中信证券	202306070002 4457	天壕能源	2023-06 -07	11,520.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	11.65	-	-	
中信证券	202306070002 5600	神州泰岳	2023-06 -07	13,500.00	1,000.0 0	14.0 0	4.50	23.63	-	-	
中信证券	202306070002 5762	瑞丰新材	2023-06 -07	1,158,606. 00	19,100. 00	14.0 0	3.20	1,441.8 2	-	-	
中信证券	202306080000 4302	爱美客	2023-06 -08	433,290.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	693.26	-	-	
中信证券	202306080000 4303	神州泰岳	2023-06 -08	197,120.0 0	15,400. 00	14.0 0	4.60	453.38	-	-	
中信证券	202306080000 4313	开立医疗	2023-06 -08	158,328.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.00	237.49	-	-	
中信证券	202306080000 4327	阳光电源	2023-06 -08	102,910.0 0	1,000.0 0	14.0 0	1.60	82.33	-	-	
中信证券	202306080001 6977	盛弘股份	2023-06 -08	214,368.0 0	5,800.0 0	14.0 0	3.70	396.58	-	-	
中信证券	202306080001 7417	开立医疗	2023-06 -08	175,920.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.00	263.88	-	-	
中信证券	202306080001 9846	开立医疗	2023-06 -08	175,920.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.00	263.88	-	-	
中信证	202306080001 9918	盛弘股	2023-06 -08	92,400.00	2,500.0 0	7.00	4.00	71.87	-	-	

券		份								
中信证券	2023060800020182	盛弘股份	2023-06-08	92,400.00	2,500.00	7.00	4.00	71.87	-	-
中信证券	2023060800020399	同花顺	2023-06-08	449,280.00	2,700.00	7.00	3.50	305.76	-	-
中信证券	2023060800020406	天壕能源	2023-06-08	11,500.00	1,000.00	14.00	2.60	14.95	-	-
中信证券	2023060800020615	盛弘股份	2023-06-08	125,664.00	3,400.00	14.00	3.70	232.48	-	-
中信证券	2023060800021014	温氏股份	2023-06-08	194,586.00	11,300.00	7.00	2.90	109.72	-	-
中信证券	2023060800021377	开立医疗	2023-06-08	1,143,480.00	19,500.00	7.00	3.10	689.26	-	-
中信证券	2023060800022363	鹏辉能源	2023-06-08	87,457.00	1,900.00	7.00	3.60	61.22	-	-
中信证券	2023060800022663	天壕能源	2023-06-08	1,512,250.00	131,500.00	7.00	4.30	1,264.41	-	-
中信证券	2023060800022688	天壕能源	2023-06-08	11,500.00	1,000.00	7.00	4.30	9.62	-	-
中信证券	2023060800023751	蓝晓科技	2023-06-08	92,990.00	1,000.00	7.00	2.80	50.63	-	-
中信证	2023060800025319	神州泰	2023-06-08	787,200.00	61,500.00	14.00	4.50	1,771.20	-	-

券		岳									
中信证 券	202306080002 5641	天壕 能源	2023-06 -08	11,500.00	1,000.0 0	14.0 0	2.60	14.95	-	-	
中信证 券	202306080002 5642	蓝晓 科技	2023-06 -08	92,990.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	125.54	-	-	
中信证 券	202306080002 5894	阳光 电源	2023-06 -08	102,910.0 0	1,000.0 0	14.0 0	2.00	102.91	-	-	
中信证 券	202306080002 6347	鹏辉 能源	2023-06 -08	105,869.0 0	2,300.0 0	14.0 0	3.50	185.27	-	-	
中信证 券	202306140000 0777	南大 光电	2023-06 -14	166,012.0 0	4,900.0 0	14.0 0	4.10	415.95	-	-	
中信证 券	202306140000 0794	拓尔 思	2023-06 -14	2,315,844. 00	73,800. 00	14.0 0	3.30	2,972.0 0	-	-	
中信证 券	202306140000 0796	数字 政通	2023-06 -14	455,360.0 0	16,000. 00	14.0 0	3.10	548.96	-	-	
中信证 券	202306140000 0817	拓尔 思	2023-06 -14	3,087,792. 00	98,400. 00	14.0 0	3.30	3,962.6 7	-	-	
中信证 券	202306140000 0848	机器 人	2023-06 -14	114,270.0 0	7,800.0 0	14.0 0	3.00	133.32	-	-	
中信证 券	202306140000 0850	宝通 科技	2023-06 -14	3,013,280. 00	101,800 .00	14.0 0	2.40	2,812.3 9	-	-	
中信证 券	202306140000 0854	宝通 科	2023-06 -14	1,480,000. 00	50,000. 00	14.0 0	2.40	1,381.3 3	-	-	

券		技								
中信证券	2023061400000855	数字政通	2023-06-14	1,707,600.00	60,000.00	14.00	3.10	2,058.61	-	-
中信证券	2023061400000882	网宿科技	2023-06-14	1,692,000.00	200,000.00	14.00	2.40	1,579.20	-	-
中信证券	2023061400000884	机器人	2023-06-14	732,500.00	50,000.00	14.00	3.00	854.58	-	-
中信证券	2023061400000903	网宿科技	2023-06-14	384,930.00	45,500.00	14.00	2.40	359.27	-	-
中信证券	2023061400000969	上海新阳	2023-06-14	646,536.00	15,800.00	14.00	3.50	880.01	-	-
中信证券	2023061400000984	掌趣科技	2023-06-14	81,270.00	12,600.00	14.00	2.70	85.33	-	-
中信证券	2023061400001035	蓝色光标	2023-06-14	3,528,000.00	300,000.00	14.00	1.10	1,509.20	-	-
中信证券	2023061400001226	晶盛机电	2023-06-14	122,892.00	1,900.00	14.00	3.20	152.93	-	-
中信证券	2023061400001235	安克创新	2023-06-14	88,490.00	1,000.00	14.00	2.60	89.47	-	-
中信证券	2023061400001259	昆仑万维	2023-06-14	55,630.00	1,000.00	14.00	3.10	67.07	-	-
中信证	2023061400001277	天孚通	2023-06-14	105,890.00	1,000.00	14.00	3.30	135.89	-	-

券		信									
中信证 券	202306140000 1286	盛 弘 股 份	2023-06 -14	90,125.00	2,500.0 0	14.0 0	3.90	136.69	-	-	
中信证 券	202306140004 9516	瑞 丰 新 材	2023-06 -14	1,765,885. 00	33,100. 00	14.0 0	3.20	2,197.5 5	-	-	
中信证 券	202306140004 9964	神 州 泰 岳	2023-06 -14	275,480.0 0	19,400. 00	14.0 0	4.60	492.80	-	-	
中信证 券	202306150001 2404	机 器 人	2023-06 -15	777,000.0 0	50,000. 00	14.0 0	3.00	906.50	-	-	
中信证 券	202306150001 2407	南 大 光 电	2023-06 -15	166,110.0 0	4,900.0 0	14.0 0	4.10	397.28	-	-	
中信证 券	202306150001 2416	网 宿 科 技	2023-06 -15	375,830.0 0	45,500. 00	14.0 0	2.40	350.77	-	-	
中信证 券	202306150001 2427	网 宿 科 技	2023-06 -15	1,652,000. 00	200,000 .00	14.0 0	2.40	1,541.8 7	-	-	
中信证 券	202306150001 2449	数 字 政 通	2023-06 -15	438,880.0 0	16,000. 00	28.0 0	3.00	548.60	438,880.0 0	548.6 0	
中信证 券	202306150001 2450	机 器 人	2023-06 -15	121,212.0 0	7,800.0 0	14.0 0	3.00	141.41	-	-	
中信证 券	202306150001 2501	蓝 色 光 标	2023-06 -15	1,983,456. 00	174,600 .00	14.0 0	1.10	848.48	-	-	
中信证 券	202306150001 2507	蓝 色 光	2023-06 -15	2,272,000. 00	200,000 .00	14.0 0	1.10	971.91	-	-	

券		标									
中信证券	202306150001 2565	宇信科技	2023-06 -15	87,032.00	4,300.0 0	14.0 0	1.90	64.31	-	-	
中信证券	202306150001 2624	机器人	2023-06 -15	777,000.0 0	50,000. 00	14.0 0	3.00	906.50	-	-	
中信证券	202306150001 2629	机器人	2023-06 -15	621,600.0 0	40,000. 00	14.0 0	3.00	725.20	-	-	
中信证券	202306150001 2632	拓尔思	2023-06 -15	304,800.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.30	391.16	-	-	
中信证券	202306150001 2637	拓尔思	2023-06 -15	762,000.0 0	25,000. 00	14.0 0	3.30	977.90	-	-	
中信证券	202306150001 2644	拓尔思	2023-06 -15	609,600.0 0	20,000. 00	14.0 0	3.30	782.32	-	-	
中信证券	202306150001 2704	国科微	2023-06 -15	1,740,725. 00	20,300. 00	14.0 0	4.00	2,707.7 9	-	-	
中信证券	202306150001 2713	上海新阳	2023-06 -15	108,675.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.50	147.92	-	-	
中信证券	202306150002 7967	盛弘股份	2023-06 -15	95,950.00	2,500.0 0	14.0 0	3.90	145.52	-	-	
中信证券	202306150003 0723	天壕能源	2023-06 -15	1,509,620. 00	131,500 .00	14.0 0	4.20	2,465.7 1	-	-	
中信证	202306150003 2431	开立医	2023-06 -15	1,091,025. 00	19,500. 00	14.0 0	3.10	1,315.2 9	-	-	

券		疗									
中信证 券	202306150003 4327	蓝 晓 科 技	2023-06 -15	97,620.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	106.30	-	-	
中信证 券	202306150003 5255	天 壕 能 源	2023-06 -15	11,480.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	18.75	-	-	
中信证 券	202306150003 7519	盛 弘 股 份	2023-06 -15	95,950.00	2,500.0 0	14.0 0	3.90	145.52	-	-	
中信证 券	202306150003 9330	鹏 辉 能 源	2023-06 -15	89,072.00	1,900.0 0	14.0 0	5.40	187.05	-	-	
中信证 券	202306200002 2241	掌 趣 科 技	2023-06 -20	965,133.0 0	146,900 .00	14.0 0	2.50	670.23	965,133.0 0	670.2 3	
中信证 券	202306200002 2263	新 易 盛	2023-06 -20	1,600,000. 00	20,000. 00	14.0 0	3.90	1,733.3 4	1,600,000 .00	1,733. 34	
中信证 券	202306200003 0894	中 际 旭 创	2023-06 -20	561,000.0 0	3,300.0 0	14.0 0	4.50	701.25	561,000.0 0	701.2 5	
中信证 券	202306200003 0911	盛 弘 股 份	2023-06 -20	96,075.00	2,500.0 0	14.0 0	3.90	104.08	96,075.00	104.0 8	
中信证 券	202306200003 1310	天 壕 能 源	2023-06 -20	113,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	4.20	132.30	113,400.0 0	132.3 0	
中信证 券	202306200003 1320	鹏 辉 能 源	2023-06 -20	482,500.0 0	10,000. 00	14.0 0	5.40	723.75	482,500.0 0	723.7 5	
中信证 券	202306200003 4424	蓝 晓 科 技	2023-06 -20	94,090.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	73.18	94,090.00	73.18	

券		技								
中信证券	202306200003 5827	天壕能源	2023-06 -20	1,915,326. 00	168,900 .00	14.0 0	4.20	2,234.5 5	1,915,326 .00	2,234. 55
中信证券	202306210000 6079	昆仑万维	2023-06 -21	201,360.0 0	4,000.0 0	14.0 0	2.70	135.92	201,360.0 0	135.9 2
中信证券	202306210001 3314	神州泰岳	2023-06 -21	14,150.00	1,000.0 0	14.0 0	4.60	16.27	14,150.00	16.27
中信证券	202306210001 3352	盛弘股份	2023-06 -21	119,328.0 0	3,200.0 0	14.0 0	3.90	116.34	119,328.0 0	116.3 4
中信证券	202306210001 3940	神州泰岳	2023-06 -21	175,460.0 0	12,400. 00	14.0 0	4.60	201.78	175,460.0 0	201.7 8
中信证券	202306210001 3968	鹏辉能源	2023-06 -21	88,996.00	1,900.0 0	14.0 0	5.40	120.14	88,996.00	120.1 4
中信证券	202306210001 4062	天壕能源	2023-06 -21	11,240.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	11.80	11,240.00	11.80
中信证券	202306210001 4181	亿纬锂能	2023-06 -21	94,384.00	1,600.0 0	14.0 0	3.30	77.87	94,384.00	77.87
中信证券	202306210001 5392	中际旭创	2023-06 -21	6,044,220. 00	37,800. 00	14.0 0	4.50	6,799.7 5	6,044,220 .00	6,799. 75
中信证券	202306210001 5482	蓝晓科技	2023-06 -21	93,100.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	65.17	93,100.00	65.17
中信证	202306210001 5604	温氏股	2023-06 -21	580,555.0 0	33,500. 00	14.0 0	2.90	420.90	580,555.0 0	420.9 0

券		份									
中信证券	202306210001 5607	盛弘股份	2023-06 -21	93,225.00	2,500.0 0	14.0 0	3.90	90.89	93,225.00	90.89	
中信证券	202306210001 5804	开立医疗	2023-06 -21	54,100.00	1,000.0 0	14.0 0	2.20	29.76	54,100.00	29.76	
中信证券	202306210001 5998	爱尔眼科	2023-06 -21	25,441.00	1,300.0 0	14.0 0	3.10	19.72	25,441.00	19.72	
中信证券	202306210001 6032	亿纬锂能	2023-06 -21	82,586.00	1,400.0 0	14.0 0	3.30	68.14	82,586.00	68.14	
中信证券	202306210001 6434	瑞丰新材	2023-06 -21	941,821.0 0	19,100. 00	14.0 0	3.20	753.45	941,821.0 0	753.4 5	
中信证券	202306210001 6482	蓝色光标	2023-06 -21	10,970.00	1,000.0 0	14.0 0	1.10	3.02	10,970.00	3.02	
中信证券	202306210001 7000	阳光电源	2023-06 -21	113,150.0 0	1,000.0 0	14.0 0	1.80	50.92	113,150.0 0	50.92	
中信证券	202306210001 7022	网宿科技	2023-06 -21	7,890.00	1,000.0 0	14.0 0	2.40	4.73	7,890.00	4.73	
中信证券	202306210001 7845	盛弘股份	2023-06 -21	74,580.00	2,000.0 0	14.0 0	3.90	72.71	74,580.00	72.71	
中信证券	202306210001 7883	天壕能源	2023-06 -21	11,240.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	11.80	11,240.00	11.80	
中信证	202306210001 8161	天壕能	2023-06 -21	11,240.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	11.80	11,240.00	11.80	

券		源									
中信证券	202306210001 8211	天壕能源	2023-06 -21	11,240.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	11.80	11,240.00	11.80	
中信证券	202306260003 3222	爱美客	2023-06 -26	441,530.0 0	1,000.0 0	14.0 0	3.20	156.99	441,530.0 0	156.9 9	
中信证券	202306260003 6864	开立医疗	2023-06 -26	163,050.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.10	56.16	163,050.0 0	56.16	
中信证券	202306260003 7198	开立医疗	2023-06 -26	163,050.0 0	3,000.0 0	14.0 0	3.10	56.16	163,050.0 0	56.16	
中信证券	202306260004 1725	盛弘股份	2023-06 -26	213,846.0 0	5,800.0 0	14.0 0	3.90	92.67	213,846.0 0	92.67	
中信证券	202306260004 2258	天壕能源	2023-06 -26	11,280.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	5.26	11,280.00	5.26	
中信证券	202306260004 4859	盛弘股份	2023-06 -26	125,358.0 0	3,400.0 0	14.0 0	3.90	54.32	125,358.0 0	54.32	
中信证券	202306260004 7838	神州泰岳	2023-06 -26	202,818.0 0	15,400. 00	14.0 0	4.60	103.66	202,818.0 0	103.6 6	
中信证券	202306260004 8112	阳光电源	2023-06 -26	115,230.0 0	1,000.0 0	14.0 0	1.80	23.05	115,230.0 0	23.05	
中信证券	202306260005 1220	神州泰岳	2023-06 -26	809,955.0 0	61,500. 00	14.0 0	4.60	413.98	809,955.0 0	413.9 8	
中信证	202306260005 1516	天壕能	2023-06 -26	11,280.00	1,000.0 0	14.0 0	4.20	5.26	11,280.00	5.26	

券		源									
中信证券	202306270000 8664	上海新阳	2023-06 -27	331,296.0 0	8,400.0 0	14.0 0	3.20	88.35	331,296.0 0	88.35	
中信证券	202306270000 8820	晶盛机电	2023-06 -27	67,650.00	1,000.0 0	14.0 0	2.80	15.78	67,650.00	15.78	
中信证券	202306280000 9875	盛弘股份	2023-06 -28	1,947,400. 00	53,500. 00	14.0 0	3.10	335.39	1,947,400 .00	335.3 9	
中信证券	202306280003 3168	蓝色光标	2023-06 -28	2,877,000. 00	300,000 .00	14.0 0	1.20	191.80	2,877,000 .00	191.8 0	
中信证券	202306280003 3723	天孚通信	2023-06 -28	97,530.00	1,000.0 0	14.0 0	3.10	16.80	97,530.00	16.80	
中信证券	202306280003 4233	掌趣科技	2023-06 -28	101,052.0 0	12,600. 00	14.0 0	2.60	14.60	101,052.0 0	14.60	
中信证券	202306280003 4452	安克创新	2023-06 -28	85,520.00	1,000.0 0	14.0 0	2.20	10.45	85,520.00	10.45	
中信证券	202306280003 5614	上海新阳	2023-06 -28	609,248.0 0	15,800. 00	14.0 0	3.10	104.93	609,248.0 0	104.9 3	
中信证券	202306280003 6304	盛弘股份	2023-06 -28	91,000.00	2,500.0 0	14.0 0	3.10	15.67	91,000.00	15.67	
中信证券	202306280003 6930	晶盛机电	2023-06 -28	131,670.0 0	1,900.0 0	14.0 0	2.90	21.21	131,670.0 0	21.21	
中信证	202306280003 8311	昆仑万	2023-06 -28	40,820.00	1,000.0 0	14.0 0	2.70	6.12	40,820.00	6.12	

券		维								
中信证券	202306280004 2782	拓尔思	2023-06 -28	2,609,568. 00	98,400. 00	14.0 0	3.40	492.92	2,609,568 .00	492.9 2
中信证券	202306280004 2788	数字政通	2023-06 -28	1,448,400. 00	60,000. 00	14.0 0	2.90	233.35	1,448,400 .00	233.3 5
中信证券	202306280004 3314	数字政通	2023-06 -28	386,240.0 0	16,000. 00	14.0 0	2.90	62.23	386,240.0 0	62.23
中信证券	202306280004 3418	宝通科技	2023-06 -28	2,462,542. 00	101,800 .00	14.0 0	1.90	259.93	2,462,542 .00	259.9 3
中信证券	202306280004 4131	网宿科技	2023-06 -28	1,410,000. 00	200,000 .00	14.0 0	1.20	94.00	1,410,000 .00	94.00
中信证券	202306280004 4228	拓尔思	2023-06 -28	1,957,176. 00	73,800. 00	14.0 0	3.40	369.69	1,957,176 .00	369.6 9
中信证券	202306280004 4909	机器人	2023-06 -28	125,814.0 0	7,800.0 0	14.0 0	2.40	16.78	125,814.0 0	16.78
中信证券	202306280005 0650	机器人	2023-06 -28	806,500.0 0	50,000. 00	14.0 0	2.40	107.53	806,500.0 0	107.5 3
中信证券	202306280005 3425	瑞丰新材	2023-06 -28	1,704,319. 00	33,100. 00	14.0 0	2.50	236.71	1,704,319 .00	236.7 1
中信证券	202306280005 4633	神州泰岳	2023-06 -28	254,334.0 0	19,400. 00	14.0 0	4.30	60.76	254,334.0 0	60.76
中信证	202306290000 9559	神州泰	2023-06 -29	3,374,680. 00	239,000 .00	14.0 0	3.90	365.59	3,374,680 .00	365.5 9

券		岳									
中信证 券	202306290003 0083	盛 弘 股 份	2023-06 -29	90,250.00	2,500.0 0	14.0 0	3.10	7.77	90,250.00	7.77	
中信证 券	202306290003 2732	天 壕 能 源	2023-06 -29	11,380.00	1,000.0 0	14.0 0	1.60	0.51	11,380.00	0.51	
中信证 券	202306290003 4582	国 科 微	2023-06 -29	1,702,155. 00	20,300. 00	14.0 0	4.10	193.86	1,702,155 .00	193.8 6	
中信证 券	202306290003 4801	拓 尔 思	2023-06 -29	530,800.0 0	20,000. 00	14.0 0	1.10	16.22	530,800.0 0	16.22	
中信证 券	202306290003 5226	宇 信 科 技	2023-06 -29	76,196.00	4,300.0 0	14.0 0	1.80	3.81	76,196.00	3.81	
中信证 券	202306290003 5296	蓝 色 光 标	2023-06 -29	1,934,000. 00	200,000 .00	14.0 0	1.20	64.47	1,934,000 .00	64.47	
中信证 券	202306290003 5753	上 海 新 阳	2023-06 -29	104,517.0 0	2,700.0 0	14.0 0	3.10	9.00	104,517.0 0	9.00	
中信证 券	202306290003 5971	机 器 人	2023-06 -29	832,500.0 0	50,000. 00	14.0 0	2.40	55.50	832,500.0 0	55.50	
中信证 券	202306290003 6092	机 器 人	2023-06 -29	666,000.0 0	40,000. 00	14.0 0	1.20	22.20	666,000.0 0	22.20	
中信证 券	202306290003 6305	拓 尔 思	2023-06 -29	265,400.0 0	10,000. 00	14.0 0	3.40	25.07	265,400.0 0	25.07	
中信证 券	202306290003 6689	机 器 人	2023-06 -29	129,870.0 0	7,800.0 0	14.0 0	2.40	8.66	129,870.0 0	8.66	

券											
中信证券	202306290003 8073	蓝色 光标	2023-06 -29	1,688,382. 00	174,600 .00	14.0 0	1.20	56.28	1,688,382 .00	56.28	
中信证券	202306290003 8645	拓尔思	2023-06 -29	663,500.0 0	25,000. 00	14.0 0	1.10	20.27	663,500.0 0	20.27	
中信证券	202306290003 8924	天壕能源	2023-06 -29	1,496,470. 00	131,500 .00	14.0 0	1.60	66.51	1,496,470 .00	66.51	
中信证券	202306290003 8950	开立医疗	2023-06 -29	1,072,890. 00	19,500. 00	14.0 0	1.90	56.63	1,072,890 .00	56.63	
中信证券	202306290004 0908	盛弘股份	2023-06 -29	90,250.00	2,500.0 0	14.0 0	3.10	7.77	90,250.00	7.77	
中信证券	202306290004 0944	蓝晓科技	2023-06 -29	61,600.00	1,000.0 0	14.0 0	1.10	1.88	61,600.00	1.88	
中信证券	202306290004 2058	鹏辉能源	2023-06 -29	87,324.00	1,900.0 0	14.0 0	5.20	12.61	87,324.00	12.61	
中信证券	202306300000 4437	新易盛	2023-06 -30	985,565.0 0	14,500. 00	14.0 0	3.80	-	985,565.0 0	-	
中信证券	202306300000 4438	温氏股份	2023-06 -30	1,972,625. 00	107,500 .00	14.0 0	2.40	-	1,972,625 .00	-	
中信证券	202306300000 4441	开立医疗	2023-06 -30	790,250.0 0	14,500. 00	14.0 0	1.90	-	790,250.0 0	-	
中信证	202306300000 4442	宇信科	2023-06 -30	463,216.0 0	26,200. 00	14.0 0	1.90	-	463,216.0 0	-	

券		技									
中信证券	202306300000 4443	昆仑万维	2023-06 -30	149,036.0 0	3,700.0 0	14.0 0	2.70	-	149,036.0 0	-	
中信证券	202306300000 4445	国科微	2023-06 -30	200,040.0 0	2,400.0 0	14.0 0	4.30	-	200,040.0 0	-	
中信证券	202306300000 4446	菲利华	2023-06 -30	856,080.0 0	17,400. 00	14.0 0	1.20	-	856,080.0 0	-	
中信证券	202306300000 4447	深信服	2023-06 -30	656,850.0 0	5,800.0 0	14.0 0	1.90	-	656,850.0 0	-	
中信证券	202306300000 4448	蓝思科技	2023-06 -30	444,528.0 0	37,800. 00	14.0 0	2.50	-	444,528.0 0	-	
中信证券	202306300000 4450	蓝晓科技	2023-06 -30	724,072.0 0	11,600. 00	14.0 0	1.10	-	724,072.0 0	-	
中信证券	202306300000 4451	安克创新	2023-06 -30	507,500.0 0	5,800.0 0	14.0 0	2.10	-	507,500.0 0	-	
中信证券	202306300000 4452	爱美客	2023-06 -30	1,290,355. 00	2,900.0 0	14.0 0	2.20	-	1,290,355 .00	-	
中信证券	202306300000 4453	华大九天	2023-06 -30	356,236.0 0	2,900.0 0	14.0 0	4.70	-	356,236.0 0	-	
中信证券	202306300000 4454	瑞丰新材	2023-06 -30	291,740.0 0	5,800.0 0	14.0 0	2.50	-	291,740.0 0	-	
中信证	202306300000 4455	图南股	2023-06 -30	307,284.0 0	8,700.0 0	14.0 0	2.30	-	307,284.0 0	-	

券		份								
中信证券	202306300000 4457	盛弘股份	2023-06 -30	428,272.0 0	11,600. 00	14.0 0	3.10	-	428,272.0 0	-
中信证券	202306300000 4461	宁德时代	2023-06 -30	7,984,771. 00	34,900. 00	14.0 0	2.10	-	7,984,771 .00	-
中信证券	202306300000 4462	新产业	2023-06 -30	513,300.0 0	8,700.0 0	14.0 0	3.30	-	513,300.0 0	-
中信证券	202306300000 4463	中简科技	2023-06 -30	685,270.0 0	14,500. 00	14.0 0	1.60	-	685,270.0 0	-
中信证券	202306300000 4466	迈瑞医疗	2023-06 -30	2,608,260. 00	8,700.0 0	14.0 0	1.90	-	2,608,260 .00	-
中信证券	202306300000 4467	天孚通信	2023-06 -30	929,421.0 0	8,700.0 0	14.0 0	3.10	-	929,421.0 0	-
中信证券	202306300000 4468	捷佳伟创	2023-06 -30	977,445.0 0	8,700.0 0	14.0 0	1.20	-	977,445.0 0	-
中信证券	202306300000 4477	同花顺	2023-06 -30	1,016,624. 00	5,800.0 0	14.0 0	3.30	-	1,016,624 .00	-
中信证券	202306300000 4479	宝通科技	2023-06 -30	358,440.0 0	14,500. 00	14.0 0	1.90	-	358,440.0 0	-
中信证券	202306300000 4483	蓝色光标	2023-06 -30	843,224.0 0	87,200. 00	14.0 0	1.20	-	843,224.0 0	-
中信证	202306300000 4498	顺网科	2023-06 -30	450,902.0 0	26,200. 00	14.0 0	3.30	-	450,902.0 0	-

券		技								
中信证券	202306300000 4503	数字政通	2023-06 -30	505,064.0 0	20,300.00	14.0 0	3.00	-	505,064.0 0	-
中信证券	202306300000 4504	亿纬锂能	2023-06 -30	701,800.0 0	11,600.00	14.0 0	3.10	-	701,800.0 0	-
中信证券	202306300000 4509	乐普医疗	2023-06 -30	723,520.0 0	32,000.00	14.0 0	1.10	-	723,520.0 0	-
中信证券	202306300000 4510	爱尔眼科	2023-06 -30	1,402,380.00	75,600.00	14.0 0	2.90	-	1,402,380.00	-
中信证券	202306300000 4512	机器人	2023-06 -30	823,498.0 0	49,400.00	14.0 0	1.20	-	823,498.0 0	-
中信证券	202306300000 4513	网宿科技	2023-06 -30	640,611.0 0	90,100.00	14.0 0	1.20	-	640,611.0 0	-
中信证券	202306300000 4514	新国都	2023-06 -30	410,785.0 0	14,500.00	14.0 0	2.70	-	410,785.0 0	-
中信证券	202306300000 4517	中际旭创	2023-06 -30	1,621,950.00	11,000.00	14.0 0	3.80	-	1,621,950.00	-
中信证券	202306300000 4518	博雅生物	2023-06 -30	420,848.0 0	11,600.00	14.0 0	2.00	-	420,848.0 0	-
中信证券	202306300000 4519	掌趣科技	2023-06 -30	634,920.0 0	81,400.00	14.0 0	2.60	-	634,920.0 0	-
中信证	202306300000 4521	中文在	2023-06 -30	361,746.0 0	20,300.00	14.0 0	3.40	-	361,746.0 0	-

券		线								
中信证券	202306300000 4522	晶盛机电	2023-06 -30	1,857,580. 00	26,200. 00	14.0 0	2.80	-	1,857,580 .00	-
中信证券	202306300000 4524	拓尔思	2023-06 -30	90,895.00	3,500.0 0	14.0 0	1.10	-	90,895.00	-
中信证券	202306300000 4525	汤臣倍健	2023-06 -30	1,045,528. 00	43,600. 00	14.0 0	1.10	-	1,045,528 .00	-
中信证券	202306300000 4526	洲明科技	2023-06 -30	371,998.0 0	40,700. 00	14.0 0	3.30	-	371,998.0 0	-
中信证券	202306300000 4527	阳光电源	2023-06 -30	6,776,203. 00	58,100. 00	14.0 0	1.90	-	6,776,203 .00	-
中信证券	202306300000 4528	上海新阳	2023-06 -30	459,940.0 0	11,600. 00	14.0 0	3.20	-	459,940.0 0	-
上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30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
中信证券	202201040000 0926	中颖电子	2022-01 -04	371,672.0 0	5,600.0 0	14	2.30	332.44	-	-
中信证券	202201040002 1315	东方通	2022-01 -04	368,280.0 0	12,000. 00	14	3.50	501.27	-	-

中信证券	202201040002 1319	金力永磁	2022-01 -04	1,771,557. 00	44,300. 00	14	3.50	2,411.2 9	-	-
中信证券	202201040002 1323	利亚德	2022-01 -04	2,621,500. 00	245,000 .00	14	3.50	3,568.1 5	-	-
中信证券	202201040002 1325	南大光电	2022-01 -04	4,031,734. 00	85,400. 00	14	3.70	5,801.2 2	-	-
中信证券	202201060000 9961	万邦达	2022-01 -06	679,066.0 0	52,600. 00	14	4.00	1,056.3 2	-	-
中信证券	202201060000 9963	当升科技	2022-01 -06	3,315,235. 00	39,500. 00	14	3.30	4,254.5 5	-	-
中信证券	202201060000 9965	利亚德	2022-01 -06	1,534,491. 00	144,900 .00	14	3.50	2,088.6 1	-	-
中信证券	202201060000 9967	昆仑万维	2022-01 -06	1,485,680. 00	56,000. 00	14	3.60	2,079.9 5	-	-
中信证券	202201060000 9969	当升科技	2022-01 -06	83,930.00	1,000.0 0	14	3.30	107.71	-	-
中信证券	202201060001 1461	全志科技	2022-01 -06	1,645,370. 00	27,400. 00	14	1.90	1,215.7 5	-	-
中信证券	202201100001 0667	利亚德	2022-01 -10	980,226.0 0	92,300. 00	14	3.40	1,296.0 8	-	-
中信证券	202201100001 1441	智飞生物	2022-01 -10	1,067,703. 00	9,100.0 0	14	1.90	788.91	-	-

中信证券	202201100001 1443	宁德时代	2022-01 -10	8,506,720. 00	15,800. 00	14	1.90	6,285.5 2	-	-
中信证券	202201100001 2783	东方财富	2022-01 -10	1,475,320. 00	44,000. 00	14	1.90	1,090.1 0	-	-
中信证券	202201100001 2957	胜宏科技	2022-01 -10	1,833,055. 00	63,100. 00	14	3.40	2,423.7 1	-	-
中信证券	202201110001 1873	万邦达	2022-01 -11	705,162.0 0	55,700. 00	14	3.60	987.23	-	-
中信证券	202201110001 1875	万邦达	2022-01 -11	1,271,064. 00	100,400 .00	14	3.60	1,779.4 9	-	-
中信证券	202201110001 4015	昆仑万维	2022-01 -11	1,301,800. 00	57,500. 00	14	3.50	1,771.8 9	-	-
中信证券	202201120001 5461	金力永磁	2022-01 -12	1,761,427. 00	44,900. 00	14	3.20	2,192.0 0	-	-
中信证券	202201130000 9774	中颖电子	2022-01 -13	2,561,760. 00	43,200. 00	14	3.20	3,187.9 7	-	-
中信证券	202201130000 9776	万邦达	2022-01 -13	696,514.0 0	55,900. 00	14	3.60	975.12	-	-
中信证券	202201130001 1978	昆仑万维	2022-01 -13	817,700.0 0	37,000. 00	14	3.50	1,112.9 8	-	-
中信证券	202201140001 9912	爱美客	2022-01 -14	473,420.0 0	1,000.0 0	14	3.00	552.32	-	-

中信证券	202201180000 1291	万邦达	2022-01 -18	240,340.0 0	19,700. 00	14	3.30	440.63	-	-
中信证券	202201180002 5498	东方通	2022-01 -18	421,200.0 0	12,000. 00	14	1.80	421.20	-	-
中信证券	202201180002 5804	利亚德	2022-01 -18	2,682,750. 00	245,000 .00	14	3.00	4,471.2 6	-	-
中信证券	202201180002 5810	中颖电子	2022-01 -18	349,496.0 0	5,600.0 0	14	3.20	621.33	-	-
中信证券	202201180002 5812	南大光电	2022-01 -18	3,977,078. 00	85,400. 00	14	3.50	7,733.2 1	-	-
中信证券	202201180002 5846	金力永磁	2022-01 -18	1,661,250. 00	44,300. 00	14	3.20	2,953.3 3	-	-
中信证券	202201200000 9824	全志科技	2022-01 -20	1,608,654. 00	27,400. 00	14	1.90	1,528.2 2	-	-
中信证券	202201200001 0784	昆仑万维	2022-01 -20	1,215,760. 00	56,000. 00	14	3.20	1,945.2 2	-	-
中信证券	202201200001 0786	万邦达	2022-01 -20	602,796.0 0	52,600. 00	14	3.60	1,085.0 3	-	-
中信证券	202201200001 0788	利亚德	2022-01 -20	1,530,144. 00	144,900 .00	14	3.00	2,295.2 2	-	-
中信证券	202201200001 0802	当升科技	2022-01 -20	82,460.00	1,000.0 0	14	2.70	111.32	-	-

中信证券	2022012000010810	当升科技	2022-01-20	3,257,170.00	39,500.00	14	2.70	4,397.18	-	-
中信证券	2022012400008826	东方财富	2022-01-24	1,433,960.00	44,000.00	14	1.90	1,059.54	-	-
中信证券	2022012400009512	智飞生物	2022-01-24	960,505.00	9,100.00	14	1.90	709.71	-	-
中信证券	2022012400010550	胜宏科技	2022-01-24	1,779,420.00	63,100.00	14	3.30	2,283.59	-	-
中信证券	2022012400010552	利亚德	2022-01-24	874,081.00	92,300.00	14	3.00	1,019.76	-	-
中信证券	2022012400010982	宁德时代	2022-01-24	9,179,642.00	15,800.00	14	1.90	6,782.74	-	-
中信证券	2022012500010242	万邦达	2022-01-25	1,094,360.00	100,400.00	14	3.30	1,404.43	-	-
中信证券	2022012500010244	万邦达	2022-01-25	607,130.00	55,700.00	14	3.30	779.15	-	-
中信证券	2022012500011490	昆仑万维	2022-01-25	1,148,850.00	57,500.00	14	3.20	1,429.68	-	-
中信证券	2022012600011662	金力永磁	2022-01-26	1,616,400.00	44,900.00	14	3.00	1,885.80	-	-
中信证券	2022012700000925	南大光电	2022-01-27	1,535,200.00	38,000.00	14	3.50	2,089.58	-	-

中信证券	202201270000 0933	利亚德	2022-01 -27	931,875.0 0	106,500 .00	14	2.50	905.99	-	-
中信证券	202201270001 1413	中颖电子	2022-01 -27	2,371,248. 00	43,200. 00	14	3.60	3,319.7 5	-	-
中信证券	202201270001 1419	万邦达	2022-01 -27	591,981.0 0	55,900. 00	14	3.30	759.71	-	-
中信证券	202201270001 1421	昆仑万维	2022-01 -27	707,070.0 0	37,000. 00	14	3.20	879.91	-	-
中信证券	202201280002 2068	爱美客	2022-01 -28	442,500.0 0	1,000.0 0	14	4.30	739.96	-	-
中信证券	202202070004 6467	宁德时代	2022-02 -07	9,155,152. 00	15,800. 00	14	1.90	6,764.6 4	-	-
中信证券	202202070004 6469	全志科技	2022-02 -07	1,443,980. 00	27,400. 00	14	1.90	1,066.9 4	-	-
中信证券	202202070004 7101	东方财富	2022-02 -07	1,417,680. 00	44,000. 00	14	1.90	1,047.5 1	-	-
中信证券	202202070004 7103	智飞生物	2022-02 -07	1,005,277. 00	9,100.0 0	14	1.90	742.79	-	-
中信证券	202202070005 0513	万邦达	2022-02 -07	228,717.0 0	19,700. 00	14	3.40	302.41	-	-
中信证券	202202070005 0515	东方通	2022-02 -07	325,200.0 0	12,000. 00	14	2.60	328.81	-	-

中信证券	202202070005 0517	昆仑万维	2022-02 -07	1,022,000. 00	56,000. 00	14	3.20	1,271.8 2	-	-
中信证券	202202070005 0519	利亚德	2022-02 -07	842,699.0 0	92,300. 00	14	2.50	819.29	-	-
中信证券	202202070005 5757	万邦达	2022-02 -07	610,686.0 0	52,600. 00	14	3.40	807.46	-	-
中信证券	202202070005 5759	中颖电子	2022-02 -07	304,976.0 0	5,600.0 0	14	3.50	415.11	-	-
中信证券	202202070005 5761	利亚德	2022-02 -07	1,322,937. 00	144,900 .00	14	2.50	1,286.1 9	-	-
中信证券	202202070005 5763	胜宏科技	2022-02 -07	1,692,342. 00	63,100. 00	14	2.40	1,579.5 2	-	-
中信证券	202202070005 5793	金力永磁	2022-02 -07	1,611,634. 00	44,300. 00	14	3.00	1,880.2 4	-	-
中信证券	202202070005 5795	南大光电	2022-02 -07	3,532,144. 00	85,400. 00	14	3.50	4,807.6 4	-	-
中信证券	202202070005 5797	利亚德	2022-02 -07	2,236,850. 00	245,000 .00	14	2.50	2,174.7 2	-	-
中信证券	202202070005 5799	当升科技	2022-02 -07	3,294,300. 00	39,500. 00	14	2.80	3,587.1 3	-	-
中信证券	202202070005 5801	当升科技	2022-02 -07	83,400.00	1,000.0 0	14	2.80	90.81	-	-

中信证券	202202080001 3716	昆仑万维	2022-02 -08	1,076,400. 00	57,500. 00	14	3.20	1,339.5 2	-	-
中信证券	202202080001 3720	万邦达	2022-02 -08	657,817.0 0	55,700. 00	14	3.40	869.78	-	-
中信证券	202202080001 3722	万邦达	2022-02 -08	1,185,724. 00	100,400 .00	14	3.40	1,567.7 9	-	-
中信证券	202202090001 6616	金力永磁	2022-02 -09	1,636,605. 00	44,900. 00	14	3.00	1,909.3 7	-	-
中信证券	202202100000 1505	欣旺达	2022-02 -10	803,390.0 0	23,000. 00	14	3.00	937.29	-	-
中信证券	202202100000 1513	利亚德	2022-02 -10	628,810.0 0	69,100. 00	14	3.20	782.52	-	-
中信证券	202202100001 3296	昆仑万维	2022-02 -10	708,180.0 0	37,000. 00	14	3.20	881.29	-	-
中信证券	202202100001 3298	南大光电	2022-02 -10	1,603,600. 00	38,000. 00	14	3.50	2,182.6 8	-	-
中信证券	202202100001 3342	万邦达	2022-02 -10	655,148.0 0	55,900. 00	14	3.40	866.25	-	-
中信证券	202202100001 3344	中颖电子	2022-02 -10	2,336,256. 00	43,200. 00	14	3.50	3,179.9 0	-	-
中信证券	202202100001 3348	利亚德	2022-02 -10	969,150.0 0	106,500 .00	14	2.50	942.23	-	-

中信证券	202202150000909	东方财富	2022-02-15	5,088,960.00	186,000.00	14	2.50	4,947.60	-	-
中信证券	2022022100038063	东方财富	2022-02-21	1,150,600.00	44,000.00	14	1.90	850.17	-	-
中信证券	2022022100038199	昆仑万维	2022-02-21	1,053,920.00	56,000.00	14	3.40	1,393.52	-	-
中信证券	2022022100038203	东方通	2022-02-21	333,600.00	12,000.00	14	3.50	454.07	-	-
中信证券	2022022100038205	南大光电	2022-02-21	3,516,772.00	85,400.00	14	3.10	4,239.66	-	-
中信证券	2022022100038207	万邦达	2022-02-21	646,454.00	52,600.00	14	3.70	930.18	-	-
中信证券	2022022100038209	利亚德	2022-02-21	1,315,692.00	144,900.00	14	3.20	1,637.31	-	-
中信证券	2022022100038211	胜宏科技	2022-02-21	1,667,733.00	63,100.00	14	3.30	2,140.26	-	-
中信证券	2022022100038213	当升科技	2022-02-21	80,530.00	1,000.00	14	3.20	100.22	-	-
中信证券	2022022100038215	利亚德	2022-02-21	2,224,600.00	245,000.00	14	3.20	2,768.39	-	-
中信证券	2022022100038217	金力永磁	2022-02-21	1,690,045.00	44,300.00	14	3.40	2,234.62	-	-

中信证券	202202210003 8219	中颖电子	2022-02 -21	294,056.0 0	5,600.0 0	14	3.70	423.11	-	-
中信证券	202202210003 8221	利亚德	2022-02 -21	838,084.0 0	92,300. 00	14	3.20	1,042.9 5	-	-
中信证券	202202210003 8225	万邦达	2022-02 -21	242,113.0 0	19,700. 00	14	3.70	348.37	-	-
中信证券	202202210003 8231	当升科技	2022-02 -21	3,180,935. 00	39,500. 00	14	3.20	3,958.5 0	-	-
中信证券	202202210004 5483	全志科技	2022-02 -21	1,466,722. 00	27,400. 00	14	1.90	1,083.7 4	-	-
中信证券	202202210004 5487	智飞生物	2022-02 -21	1,143,051. 00	9,100.0 0	14	1.90	844.59	-	-
中信证券	202202210004 5491	宁德时代	2022-02 -21	8,058,000. 00	15,800. 00	14	1.90	5,953.9 7	-	-
中信证券	202202220001 1295	昆仑万维	2022-02 -22	1,009,700. 00	57,500. 00	14	3.40	1,335.0 5	-	-
中信证券	202202220001 1297	万邦达	2022-02 -22	1,224,880. 00	100,400 .00	14	3.70	1,762.4 7	-	-
中信证券	202202220001 1299	万邦达	2022-02 -22	679,540.0 0	55,700. 00	14	3.70	977.78	-	-
中信证券	202202230001 1450	金力永磁	2022-02 -23	1,755,590. 00	44,900. 00	14	3.40	2,321.2 8	-	-

中信证券	2022022400010303	中颖电子	2022-02-24	2,456,352.00	43,200.00	14	3.60	3,438.89	-	-
中信证券	2022022400010307	利亚德	2022-02-24	583,204.00	69,100.00	14	3.00	680.40	-	-
中信证券	2022022400010309	利亚德	2022-02-24	898,860.00	106,500.00	14	3.00	1,048.67	-	-
中信证券	2022022400010313	万邦达	2022-02-24	664,092.00	55,900.00	14	3.70	955.55	-	-
中信证券	2022022400010315	南大光电	2022-02-24	1,672,380.00	38,000.00	14	3.50	2,276.30	-	-
中信证券	2022022400010319	昆仑万维	2022-02-24	637,510.00	37,000.00	14	3.10	768.55	-	-
中信证券	2022022400010321	欣旺达	2022-02-24	800,170.00	23,000.00	14	3.10	895.75	-	-
中信证券	2022030100004216	东方财富	2022-03-01	5,103,840.00	186,000.00	14	2.90	5,756.00	-	-
中信证券	2022030700041910	东方通	2022-03-07	273,720.00	12,000.00	14	3.60	54.74	-	-
中信证券	2022030700041914	金力永磁	2022-03-07	1,580,624.00	44,300.00	14	3.40	2,089.94	-	-
中信证券	2022030700041916	昆仑万维	2022-03-07	958,160.00	56,000.00	14	2.20	292.77	-	-

中信证券	202203070004 1918	当升科技	2022-03 -07	73,920.00	1,000.0 0	14	3.10	89.11	-	-
中信证券	202203070004 1920	南大光电	2022-03 -07	3,492,860. 00	85,400. 00	14	3.50	4,754.1 7	-	-
中信证券	202203070004 1922	当升科技	2022-03 -07	2,919,840. 00	39,500. 00	14	3.10	3,520.0 3	-	-
中信证券	202203070004 1924	利亚德	2022-03 -07	723,632.0 0	92,300. 00	14	2.90	816.10	-	-
中信证券	202203070004 1926	利亚德	2022-03 -07	1,920,800. 00	245,000 .00	14	2.90	2,166.2 4	-	-
中信证券	202203070004 1928	中颖电子	2022-03 -07	293,664.0 0	5,600.0 0	14	3.50	399.71	-	-
中信证券	202203070004 1930	万邦达	2022-03 -07	233,051.0 0	19,700. 00	14	3.50	317.21	-	-
中信证券	202203070004 3562	宁德时代	2022-03 -07	7,187,262. 00	15,800. 00	14	1.90	5,310.5 9	-	-
中信证券	202203070004 4312	全志科技	2022-03 -07	1,398,770. 00	27,400. 00	14	1.90	1,033.5 4	-	-
中信证券	202203070004 4382	万邦达	2022-03 -07	622,258.0 0	52,600. 00	14	3.50	846.96	-	-
中信证券	202203080000 3003	东方通	2022-03 -07	273,720.0 0	12,000. 00	2	3.60	54.74	-	-

中信证券	2022030800003005	欣旺达	2022-02-24	800,170.00	23,000.00	13	3.10	895.75	-	-
中信证券	2022030800013394	万邦达	2022-03-08	1,149,580.00	100,400.00	14	3.50	1,564.71	-	-
中信证券	2022030800013396	昆仑万维	2022-03-08	954,500.00	57,500.00	14	2.20	233.32	-	-
中信证券	2022030800013398	万邦达	2022-03-08	637,765.00	55,700.00	14	3.50	868.07	-	-
中信证券	2022030900018739	金力永磁	2022-03-09	1,536,029.00	44,900.00	14	3.40	2,030.97	-	-
中信证券	2022031000011712	利亚德	2022-03-10	816,855.00	106,500.00	14	2.90	921.23	-	-
中信证券	2022031000011718	利亚德	2022-03-10	529,997.00	69,100.00	14	2.90	597.72	-	-
中信证券	2022031000011750	万邦达	2022-03-10	661,856.00	55,900.00	14	3.50	900.86	-	-
中信证券	2022031000011764	昆仑万维	2022-03-10	611,980.00	37,000.00	14	2.20	74.80	-	-
中信证券	2022031000012314	南大光电	2022-03-10	1,625,640.00	38,000.00	14	3.50	2,212.68	-	-
中信证券	2022031100002497	昆仑万维	2022-03-10	611,980.00	37,000.00	4	2.20	149.60	-	-

中信证券	202203110000 2499	昆仑万维	2022-03 -07	958,160.0 0	56,000. 00	7	2.20	409.88	-	-
中信证券	202203110000 2501	昆仑万维	2022-03 -08	954,500.0 0	57,500. 00	6	2.20	349.98	-	-
中信证券	202203210002 8629	全志科技	2022-03 -21	1,346,710. 00	27,400. 00	14	1.90	1,137.2 2	-	-
中信证券	202203210003 0009	宁德时代	2022-03 -21	8,216,000. 00	15,800. 00	14	1.90	6,937.9 5	-	-
中信证券	202203210003 5971	当升科技	2022-03 -21	3,328,270. 00	39,500. 00	14	3.30	4,881.4 6	-	-
中信证券	202203210003 5977	金力永磁	2022-03 -21	1,500,441. 00	44,300. 00	14	3.20	2,133.9 7	-	-
中信证券	202203210003 6611	利亚德	2022-03 -21	695,942.0 0	92,300. 00	14	3.60	1,113.5 1	-	-
中信证券	202203210003 6613	利亚德	2022-03 -21	1,847,300. 00	245,000 .00	14	3.60	2,955.6 8	-	-
中信证券	202203210003 6627	当升科技	2022-03 -21	84,260.00	1,000.0 0	14	3.30	123.58	-	-
中信证券	202203210003 6635	南大光电	2022-03 -21	3,771,264. 00	85,400. 00	14	4.00	6,704.4 7	-	-
中信证券	202203210003 6637	中颖电子	2022-03 -21	341,656.0 0	5,600.0 0	14	3.50	531.46	-	-

中信证券	202203210003 6639	万邦达	2022-03 -21	599,114.0 0	52,600. 00	14	3.70	985.21	-	-
中信证券	202203210003 6641	万邦达	2022-03 -21	224,383.0 0	19,700. 00	14	3.70	368.98	-	-
中信证券	202203220001 1697	万邦达	2022-03 -22	1,132,512. 00	100,400 .00	14	3.70	1,745.9 6	-	-
中信证券	202203220001 1699	万邦达	2022-03 -22	628,296.0 0	55,700. 00	14	3.70	968.62	-	-
中信证券	202203230001 2695	金力永磁	2022-03 -23	1,512,232. 00	44,900. 00	14	3.20	1,881.8 9	-	-
中信证券	202203240001 0469	利亚德	2022-03 -24	785,970.0 0	106,500 .00	14	3.60	1,100.3 6	-	-
中信证券	202203240001 0475	万邦达	2022-03 -24	617,695.0 0	55,900. 00	14	3.70	888.79	-	-
中信证券	202203240001 0479	南大光电	2022-03 -24	1,618,040. 00	38,000. 00	14	4.00	2,516.9 5	-	-
中信证券	202203310000 1062	中颖电子	2022-03 -31	2,176,218. 00	37,900. 00	14	3.50	2,962.0 7	-	-
中信证券	202204060005 2489	万邦达	2022-04 -06	628,296.0 0	55,700. 00	14	3.70	904.05	-	-
中信证券	202204060005 2491	当升科技	2022-04 -06	2,894,955. 00	39,500. 00	14	3.10	3,490.0 3	-	-

中信证券	202204060005 2493	万邦达	2022-04 -06	1,132,512. 00	100,400 .00	14	3.70	1,629.5 6	-	-
中信证券	202204060005 2495	利亚德	2022-04 -06	1,751,750. 00	245,000 .00	14	2.80	1,907.4 6	-	-
中信证券	202204060005 2497	万邦达	2022-04 -06	222,216.0 0	19,700. 00	14	3.70	319.74	-	-
中信证券	202204060005 6309	全志科技	2022-04 -06	1,409,730. 00	27,400. 00	14	1.90	1,041.6 3	-	-
中信证券	202204060005 6315	宁德时代	2022-04 -06	8,029,086. 00	15,800. 00	14	1.90	5,932.6 0	-	-
中信证券	202204060006 4257	中颖电子	2022-04 -06	315,840.0 0	5,600.0 0	14	3.50	429.89	-	-
中信证券	202204060006 4259	当升科技	2022-04 -06	73,290.00	1,000.0 0	14	3.10	88.36	-	-
中信证券	202204060006 4261	南大光电	2022-04 -06	3,381,840. 00	85,400. 00	14	4.10	5,392.1 6	-	-
中信证券	202204060006 4263	万邦达	2022-04 -06	593,328.0 0	52,600. 00	14	3.70	853.73	-	-
中信证券	202204070001 4116	万邦达	2022-04 -07	616,018.0 0	55,900. 00	14	3.70	886.38	-	-
中信证券	202204070001 4118	南大光电	2022-04 -07	1,457,300. 00	38,000. 00	14	4.10	2,323.5 8	-	-

中信证券	2022041400005517	中颖电子	2022-04-14	2,039,020.00	37,900.00	14	3.50	2,775.33	-	-
中信证券	2022042000039088	全志科技	2022-04-20	1,271,086.00	27,400.00	14	1.90	1,006.28	-	-
中信证券	2022042000039102	宁德时代	2022-04-20	6,430,600.00	15,800.00	14	1.90	5,090.89	-	-
中信证券	2022042000048176	万邦达	2022-04-20	497,596.00	52,600.00	14	3.70	767.13	-	-
中信证券	2022042000048178	万邦达	2022-04-20	526,922.00	55,700.00	14	3.70	812.34	-	-
中信证券	2022042000048182	南大光电	2022-04-20	3,330,600.00	85,400.00	14	2.00	2,775.50	-	-
中信证券	2022042000048184	万邦达	2022-04-20	949,784.00	100,400.00	14	3.70	1,464.25	-	-
中信证券	2022042000048186	万邦达	2022-04-20	186,362.00	19,700.00	14	3.70	287.30	-	-
中信证券	2022042000048202	当升科技	2022-04-20	69,450.00	1,000.00	14	3.40	98.39	-	-
中信证券	2022042000048218	中颖电子	2022-04-20	328,160.00	5,600.00	14	3.70	505.92	-	-
中信证券	2022042000048232	当升科技	2022-04-20	2,743,275.00	39,500.00	14	3.40	3,886.31	-	-

中信证券	202204210001 0863	南大光电	2022-04 -21	1,454,260. 00	38,000. 00	14	2.00	1,131.0 9	-	-
中信证券	202204210001 1079	万邦达	2022-04 -21	496,951.0 0	55,900. 00	14	3.70	715.06	-	-
中信证券	202204260000 1183	东方国信	2022-04 -26	584,825.0 0	74,500. 00	14	4.20	955.21	-	-
中信证券	202204270001 1997	全志科技	2022-04 -20	13,700.00	-	14	1.90	-	-	-
中信证券	202204270001 2139	全志科技	2022-04 -20	-	24,660. 00	14	1.90	-	-	-
中信证券	202204280000 7602	中颖电子	2022-04 -28	2,054,180. 00	37,900. 00	14	3.60	2,875.8 5	-	-
中信证券	202205050000 1719	中颖电子	2022-05 -05	875,708.0 0	14,600. 00	14	3.40	1,157.8 8	-	-
中信证券	202205050000 1722	迈为股份	2022-05 -05	2,027,820. 00	6,000.0 0	14	3.20	2,523.5 1	-	-
中信证券	202205050005 8571	南大光电	2022-05 -05	2,918,972. 00	85,400. 00	14	3.10	3,518.9 8	-	-
中信证券	202205050005 9439	全志科技	2022-05 -05	504,708.0 0	27,400. 00	14	1.90	372.92	-	-
中信证券	202205050007 2245	中颖电子	2022-05 -05	335,888.0 0	5,600.0 0	14	3.40	444.12	-	-

中信证券	202205050007 2365	万邦达	2022-05 -05	839,344.0 0	100,400 .00	14	1.90	620.18	-	-
中信证券	202205050007 2367	万邦达	2022-05 -05	465,652.0 0	55,700. 00	14	1.90	344.07	-	-
中信证券	202205050007 2369	万邦达	2022-05 -05	439,736.0 0	52,600. 00	14	1.90	324.92	-	-
中信证券	202205050007 2371	万邦达	2022-05 -05	467,324.0 0	55,900. 00	14	1.90	345.30	-	-
中信证券	202205050007 2375	万邦达	2022-05 -05	164,692.0 0	19,700. 00	14	1.90	121.69	-	-
中信证券	202205050007 3041	当升科技	2022-05 -05	66,810.00	1,000.0 0	14	2.30	59.76	-	-
中信证券	202205050007 3043	南大光电	2022-05 -05	1,298,840. 00	38,000. 00	14	3.10	1,565.8 2	-	-
中信证券	202205090001 1415	南大光电	2022-05 -05	1,900.00	-	14	3.10	-	-	-
中信证券	202205090001 1481	南大光电	2022-05 -05	4,270.00	-	14	3.10	-	-	-
中信证券	202205090001 1591	南大光电	2022-05 -05	-	11,400. 00	14	3.10	-	-	-
中信证券	202205090001 1657	南大光电	2022-05 -05	-	25,620. 00	14	3.10	-	-	-

中信证券	202205100000 1024	扬杰科技	2022-05 -10	1,169,600. 00	16,000. 00	28	3.40	3,092.9 4	-	-
中信证券	202205100000 1030	当升科技	2022-05 -10	403,200.0 0	6,000.0 0	14	3.20	501.76	-	-
中信证券	202205100000 1039	扬杰科技	2022-05 -10	2,777,800. 00	38,000. 00	14	3.50	3,780.8 9	-	-
中信证券	202205100001 5009	东方国信	2022-05 -10	639,955.0 0	74,500. 00	14	4.20	1,045.2 6	-	-
中信证券	202205110000 0660	钢研高纳	2022-05 -11	174,550.0 0	5,000.0 0	14	3.10	210.43	-	-
中信证券	202205110000 0662	智飞生物	2022-05 -11	101,980.0 0	1,000.0 0	14	2.30	91.22	-	-
中信证券	202205120000 9942	中颖电子	2022-05 -12	2,263,388. 00	37,900. 00	14	3.40	2,992.7 0	-	-
中信证券	202205190003 8805	南大光电	2022-05 -19	2,514,176. 00	85,400. 00	14	3.50	3,422.0 7	-	-
中信证券	202205190003 8821	南大光电	2022-05 -19	1,118,720. 00	38,000. 00	14	3.50	1,522.7 0	-	-
中信证券	202205190003 8883	万邦达	2022-05 -19	169,026.0 0	19,700. 00	14	2.40	157.76	-	-
中信证券	202205190003 8891	中颖电子	2022-05 -19	869,430.0 0	14,600. 00	14	3.50	1,183.3 9	-	-

中信证券	202205190003 8893	中颖电子	2022-05 -19	333,480.0 0	5,600.0 0	14	3.50	453.90	-	-
中信证券	202205190004 1383	当升科技	2022-05 -19	71,800.00	1,000.0 0	14	3.20	89.35	-	-
中信证券	202205190004 3117	全志科技	2022-05 -19	560,878.0 0	27,400. 00	14	1.90	414.43	-	-
中信证券	202205190004 7305	万邦达	2022-05 -19	861,432.0 0	100,400 .00	14	2.40	804.00	-	-
中信证券	202205190004 7307	万邦达	2022-05 -19	451,308.0 0	52,600. 00	14	2.40	421.22	-	-
中信证券	202205190004 7309	万邦达	2022-05 -19	479,622.0 0	55,900. 00	14	2.40	447.65	-	-
中信证券	202205190004 7311	万邦达	2022-05 -19	477,906.0 0	55,700. 00	14	2.40	446.05	-	-
中信证券	202205190005 3625	迈为股份	2022-05 -19	2,211,000. 00	6,000.0 0	14	3.30	2,837.4 5	-	-
中信证券	202205240000 0905	南大光电	2022-05 -24	1,915,902. 00	65,300. 00	14	3.80	2,831.2 8	-	-
中信证券	202205240000 6994	扬杰科技	2022-05 -24	2,807,060. 00	38,000. 00	14	3.50	3,820.7 2	-	-
中信证券	202205240000 7040	东方国信	2022-05 -24	610,155.0 0	74,500. 00	14	3.80	901.67	-	-

中信证券	202205250000 7777	智飞生物	2022-05 -25	89,650.00	1,000.0 0	14	3.20	111.56	-	-
中信证券	202205250000 7779	钢研高纳	2022-05 -25	177,800.0 0	5,000.0 0	14	3.40	235.09	-	-
中信证券	202205250001 0137	当升科技	2022-05 -19	424.00	-	14	3.20	-	-	-
中信证券	202205250001 0504	扬杰科技	2022-05 -10	3,520.00	-	28	3.40	-	-	-
中信证券	202205250001 0693	扬杰科技	2022-05 -24	8,360.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	202205260000 7272	中颖电子	2022-05 -26	2,391,111. 00	37,900. 00	14	3.30	3,068.5 9	-	-
中信证券	202205300000 5404	中颖电子	2022-05 -19	7,008.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	202205300000 5406	中颖电子	2022-05 -19	2,688.00	-	14	3.50	-	-	-
中信证券	202205300000 5478	中颖电子	2022-05 -26	18,192.00	-	14	3.30	-	-	-
中信证券	202205300000 5496	中颖电子	2022-05 -19	-	1,460.0 0	14	3.50	-	-	-
中信证券	202205300000 5498	中颖电子	2022-05 -19	-	560.00	14	3.50	-	-	-

中信证券	202205300000 5570	中颖电子	2022-05 -26	-	3,790.0 0	14	3.30	-	-	-
中信证券	202205310000 1358	当升科技	2022-05 -31	146,580.0 0	2,100.0 0	14	3.40	193.81	-	-
中信证券	202205310000 1388	利亚德	2022-05 -31	1,122,710. 00	180,500 .00	14	3.30	823.32	-	-
中信证券	202205310000 1393	当升科技	2022-05 -31	2,017,220. 00	28,900. 00	14	3.40	2,667.2 1	-	-
中信证券	202206010000 1161	普利制药	2022-06 -01	2,297,232. 00	84,800. 00	14	3.50	1,563.3 9	-	-
中信证券	202206010000 1461	当升科技	2022-06 -01	972,762.0 0	13,800. 00	14	1.80	680.93	-	-
中信证券	202206020000 1024	迈为股份	2022-06 -02	1,996,775. 00	5,300.0 0	14	3.40	2,640.1 8	-	-
中信证券	202206070000 1443	中颖电子	2022-06 -07	1,960,140. 00	35,900. 00	14	3.50	2,667.9 7	-	-
中信证券	202206070000 3259	利亚德	2022-05 -31	1,122,710. 00	180,500 .00	8	3.30	823.32	-	-
中信证券	202206070000 3261	普利制药	2022-06 -01	2,297,232. 00	84,800. 00	7	3.50	1,563.3 9	-	-
中信证券	202206070000 8806	南大光电	2022-06 -07	2,016,464. 00	65,300. 00	14	3.80	2,979.8 9	-	-

中信证券	202206070000 8832	扬杰科技	2022-06 -07	2,888,380. 00	38,000. 00	14	3.40	3,819.0 8	-	-
中信证券	202206080000 7473	智飞生物	2022-06 -08	90,500.00	1,000.0 0	14	1.80	63.35	-	-
中信证券	202206080000 7475	钢研高纳	2022-06 -08	188,350.0 0	5,000.0 0	14	3.50	256.37	-	-
中信证券	202206090001 1159	中颖电子	2022-06 -09	2,010,216. 00	37,900. 00	14	3.50	2,736.1 3	-	-
中信证券	202206140000 7778	当升科技	2022-06 -14	2,407,081. 00	28,900. 00	14	3.40	3,182.7 0	-	-
中信证券	202206140000 7850	当升科技	2022-06 -14	174,909.0 0	2,100.0 0	14	3.40	231.27	-	-
中信证券	202206150002 3777	当升科技	2022-06 -15	1,128,840. 00	13,800. 00	14	1.80	790.19	-	-
中信证券	202206160001 2219	迈为股份	2022-06 -16	2,086,504. 00	5,300.0 0	14	3.40	2,758.8 2	-	-
中信证券	202206210000 8138	南大光电	2022-06 -21	2,120,944. 00	65,300. 00	14	3.40	1,802.8 0	2,349,494 .00	1,802. 80
中信证券	202206210000 8146	扬杰科技	2022-06 -21	2,517,500. 00	38,000. 00	14	3.50	2,202.8 1	2,707,500 .00	2,202. 81
中信证券	202206210000 8162	中颖电子	2022-06 -21	1,785,666. 00	35,900. 00	14	3.60	1,607.1 0	1,788,179 .00	1,607. 10

中信证券	202206220001 3379	智飞生物	2022-06 -22	99,750.00	1,000.0 0	14	2.40	53.20	111,010.0 0	53.20
中信证券	202206220001 4023	钢研高纳	2022-06 -22	178,900.0 0	5,000.0 0	14	3.50	139.14	210,900.0 0	139.1 4
中信证券	202206230000 1766	爱美客	2022-06 -23	2,633,551. 00	4,700.0 0	28	1.80	921.74	2,820,047 .00	921.7 4
中信证券	202206230000 1778	康龙化成	2022-06 -23	1,662,846. 00	19,100. 00	28	1.80	582.00	1,818,702 .00	582.0 0
中信证券	202206230000 1782	博腾股份	2022-06 -23	926,610.0 0	13,400. 00	28	1.80	324.31	1,045,066 .00	324.3 1
中信证券	202206230000 1911	温氏股份	2022-06 -23	6,615,000. 00	300,000 .00	14	2.90	3,730.1 3	6,387,000 .00	3,730. 13
中信证券	202206230000 9437	中颖电子	2022-06 -23	1,826,022. 00	37,900. 00	14	3.60	1,278.2 2	1,887,799 .00	1,278. 22
中信证券	202206240000 1488	迈为股份	2022-06 -24	1,772,300. 00	3,700.0 0	28	1.80	531.69	1,816,330 .00	531.6 9
中信证券	202206280000 1369	圣邦股份	2022-06 -28	218,496.0 0	1,200.0 0	14	1.80	21.85	218,784.9 8	21.85
中信证券	202206290000 1918	温氏股份	2022-06 -29	869,600.0 0	40,000. 00	28	3.10	74.88	851,600.0 0	74.88
中信证券	202206290000 1925	金力永磁	2022-06 -29	720,400.0 0	20,000. 00	14	3.20	64.04	736,000.0 0	64.04

中信 证 券	202206300002 1595	迈 为 股 份	2022-06 -30	2,601,770. 00	5,300.0 0	14	3.60	3,642.4 8	2,601,770 .00	-
--------------	----------------------	------------------	----------------	------------------	--------------	----	------	--------------	------------------	---

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.5.2 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 2023 年 6 月 30 日		上年度末 2022 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
华夏创业板动量成长ETF发起式联接	2,238,380,896.00	32.69%	1,879,346,040.00	31.68%
中信证券	6,627,838.00	0.10%	7,587,398.00	0.13%
中信中证资本	1,892,700.00	0.03%	-	-

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的相关费用符合基金招募说明书、交易所、登记结算机构的有关规定。

6.4.10.6 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 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	5,384,919.39	51,748.88	7,485,022.89	42,003.38

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 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 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额

中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 股/张）	总金额
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

##### 6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新发流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
001286	陕西能源	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
001287	中电港	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-

301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	新发 流通 受限	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新发 流通 受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	含 证 券 送 配
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新发 流通 受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新发 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新发 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新发 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新发 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	新发 流通 受限	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	含 证 券 送 配
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	新发 流通 受限	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301203	国泰环保	2023-03-28	6个月	新发 流通 受限	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新发 流通 受限	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新发 流通 受限	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新发 流通 受限	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-

注：①根据中国证监会《上市公司证券发行注册管理办法》，基金参与上市公司向特定对象发

行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

②基金还可作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

③根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后 6 个月内不得转让。

④基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的设定限售期的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 6.4.12.2 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
300346	南大光电	2023-06-26	重大事项	34.39	2023-07-06	35.60	694,746	23,160,633.24	23,892,314.94	-

#### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 6.4.12.4 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(股)	期末估值总额
1	300308	中际旭创	2023年7月4日 -2023年7月14日	147.45	309,400.00	45,621,030.00
2	300274	阳光电源	2023年7月4日 -2023年7月14日	116.63	200,200.00	23,349,326.00
3	300002	神州泰岳	2023年7月4日 -2023年7月13日	14.00	1,505,600.00	21,078,400.00
4	300024	机器人	2023年7月4日 -2023年7月14日	16.67	697,200.00	11,622,324.00
5	300502	新易盛	2023年7月4日 -2023年7月14日	67.97	170,700.00	11,602,479.00

6	300058	蓝色光标	2023年7月4日 -2023年7月18日	9.67	1,054,400.00	10,196,048.00
7	300033	同花顺	2023年7月4日 -2023年7月18日	175.28	53,800.00	9,430,064.00
8	300418	昆仑万维	2023年7月4日 -2023年7月14日	40.28	221,800.00	8,934,104.00
9	300394	天孚通信	2023年7月5日 -2023年7月14日	106.83	78,200.00	8,354,106.00
10	300017	网宿科技	2023年7月5日 -2023年7月14日	7.11	1,159,500.00	8,244,045.00
11	300229	拓尔思	2023年7月11日 -2023年7月14日	25.97	315,300.00	8,188,341.00
12	300750	宁德时代	2023年7月14日 -2023年7月14日	228.79	34,900.00	7,984,771.00
13	300315	掌趣科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	7.80	950,300.00	7,412,340.00
14	300438	鹏辉能源	2023年7月4日 -2023年7月13日	48.04	140,300.00	6,740,012.00
15	300832	新产业	2023年7月4日 -2023年7月14日	59.00	105,700.00	6,236,300.00
16	300113	顺网科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	17.21	359,500.00	6,186,995.00
17	300693	盛弘股份	2023年7月4日 -2023年7月14日	36.92	154,300.00	5,696,756.00
18	300332	天壕能源	2023年7月4日 -2023年7月13日	11.47	470,900.00	5,401,223.00
19	300236	上海新阳	2023年7月4日 -2023年7月14日	39.65	132,700.00	5,261,555.00
20	300346	南大光电	2023年6月26日 -2023年7月6日	34.39	149,900.00	5,155,061.00
21	300075	数字政通	2023年7月12日 -2023年7月14日	24.88	197,900.00	4,923,752.00
22	300130	新国都	2023年7月5日 -2023年7月14日	28.33	170,500.00	4,830,265.00
23	300910	瑞丰新材	2023年7月4日 -2023年7月14日	50.30	95,400.00	4,798,620.00
24	300724	捷佳伟创	2023年7月10日 -2023年7月14日	112.35	41,200.00	4,628,820.00
25	300672	国科微	2023年7月11日 -2023年7月14日	83.35	53,800.00	4,484,230.00
26	300364	中文在线	2023年7月4日 -2023年7月14日	17.82	247,300.00	4,406,886.00
27	300674	宇信科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	17.68	238,100.00	4,209,608.00

28	300031	宝通科技	2023年7月12日 -2023年7月14日	24.72	166,900.00	4,125,768.00
29	300633	开立医疗	2023年7月5日 -2023年7月14日	54.50	73,100.00	3,983,950.00
30	300487	蓝晓科技	2023年7月4日 -2023年7月14日	62.42	59,500.00	3,713,990.00
31	300395	菲利华	2023年7月5日 -2023年7月14日	49.20	60,200.00	2,961,840.00
32	300454	深信服	2023年7月10日 -2023年7月14日	113.25	25,500.00	2,887,875.00
33	300760	迈瑞医疗	2023年7月14日 -2023年7月14日	299.80	8,700.00	2,608,260.00
34	300498	温氏股份	2023年7月5日 -2023年7月14日	18.35	141,000.00	2,587,350.00
35	300316	晶盛机电	2023年7月11日 -2023年7月14日	70.90	29,100.00	2,063,190.00
36	300896	爱美客	2023年7月10日 -2023年7月14日	444.95	3,900.00	1,735,305.00
37	300015	爱尔眼科	2023年7月5日 -2023年7月14日	18.55	76,900.00	1,426,495.00
38	300146	汤臣倍健	2023年7月14日 -2023年7月14日	23.98	43,600.00	1,045,528.00
39	300014	亿纬锂能	2023年7月5日 -2023年7月14日	60.50	14,600.00	883,300.00
40	300003	乐普医疗	2023年7月14日 -2023年7月14日	22.61	32,000.00	723,520.00
41	300777	中简科技	2023年7月14日 -2023年7月14日	47.26	14,500.00	685,270.00
42	300866	安克创新	2023年7月12日 -2023年7月14日	87.50	6,800.00	595,000.00
43	300433	蓝思科技	2023年7月14日 -2023年7月14日	11.76	37,800.00	444,528.00
44	300294	博雅生物	2023年7月14日 -2023年7月14日	36.28	11,600.00	420,848.00
45	300232	洲明科技	2023年7月14日 -2023年7月14日	9.14	40,700.00	371,998.00
46	301269	华大九天	2023年7月14日 -2023年7月14日	122.84	2,900.00	356,236.00
47	300855	图南股份	2023年7月14日 -2023年7月14日	35.32	8,700.00	307,284.00
合计	-	-	-	-	10,166,800.00	288,904,996.00

注：出借证券中如有其他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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的风险管理政策是使基金投资风险可测、可控、可承担。本基金管理人建立了由风险管理委员会、督察长、法律部、合规部、稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。风险管理团队在识别、衡量投资风险后，通过正式报告的方式，将分析结果及时传达给基金经理、投资总监、投资决策委员会和风险管理委员会，协助制定风险控制决策，实现风险管理目标。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型和日常的量化报告，参考压力测试结果，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指由于基金所投资债券的发行人出现违约、拒绝支付到期本息，债券发行人信用评级降低导致债券价格下降，或基金在交易过程中发生交收违约，而造成基金资产损失的可能性。

本基金管理人通过信用分析团队建立了内部评级体系和交易对手库，对发行人及债券投资进行内部评级，对交易对手的资信状况进行充分评估、设定授信额度，以控制可能出现的信用风险。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是在市场或持有资产流动性不足的情况下，基金管理人可能无法迅速、低成本地调整基金投资组合，从而对基金收益造成不利影响。

除在“6.4.12 期末本基金持有的流通受限证券”中列示的部分基金资产流通暂时受限制的情况外，本基金所投资的证券均能及时变现。

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

在日常运作中，本基金的流动性安排能够与基金合同约定的申购赎回安排以及投资者的申购赎回规律相匹配。

在资产端，本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股，如需对组合进行调整时，由于投资标的流动性较好，市场冲击成本较小，基金投资组合收益偏离投资目标收益的风险较小。基金管理人持续监测本基金持有资产的市场交易量、交易集中度等涉及资产流动性水平的风险指标，并定期开展压力测试，详细评估在不同的压力情景下资产变现情况的变化。

在负债端，基金管理人持续监测本基金投资者历史申赎、投资者类型和结构变化等数据，审慎

评估不同市场环境可能带来的投资者潜在赎回需求，当市场环境或投资者结构发生变化时，及时调整组合资产结构，预留充足现金头寸，保持基金资产可变现规模和期限与负债赎回规模和期限的匹配。

如遭遇极端市场情形或投资者非预期巨额赎回情形，基金管理人将采用本基金合同约定的赎回申请处理方式及其他各类流动性风险管理工具，控制极端情况下的潜在流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指由于市场变化或波动所引起的资产损失的可能性，本基金管理人通过监测组合敏感性指标来衡量市场风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率变动引起组合中资产特别是债券投资的市场价格变动，从而影响基金投资收益的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。因此，利率风险不是本基金的主要风险。

##### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金持有的金融工具以人民币计价，因此无重大外汇风险。

##### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素（单个证券发行主体自身经营情况或证券市场整体波动）发生变动时导致基金资产发生损失的风险。

本基金为指数型基金，采用完全复制策略。本基金主要投资于标的指数成份股、备选成份股。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	3,641,575,813.52	99.70	3,318,831,670.23	99.55
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	3,641,575,813.52	99.70	3,318,831,670.23	99.55

注：①本表中交易性金融资产-债券投资科目仅包含可转换公司债券和可交换公司债券等。

②由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除创业板动量成长指数以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023年6月30日	上年度末 2022年12月31日
	-5%	-164,499,442.13	-161,585,830.14
	+5%	164,499,442.13	161,585,830.14

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 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。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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 2023年6月30日
第一层次	3,617,285,904.68
第二层次	23,892,314.94
第三层次	397,593.90
合计	3,641,575,813.52

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内证券涨停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于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。本基金政策以导致各层次之间转换的事项发生日作为确定金融工具公允价值层次之间转换的时点。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

截至 2023 年 6 月 30 日止，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

#### 6.4.14.4 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，其账面价值与公允价值差异很小。

#### 6.4.15 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。

## §7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	3,641,575,813.52	99.57
	其中：股票	3,641,575,813.52	99.57
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	13,691,194.30	0.37
8	其他各项资产	1,952,620.74	0.05
9	合计	3,657,219,628.56	100.00

注：①股票投资的公允价值包含可退替代款的估值增值。

②报告期末,本基金参与转融通证券出借业务借出股票的公允价值为 288,904,996.00 元，占本基金期末资产净值的 7.91%。

### 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	137,540,002.80	3.77
B	采矿业	-	-

C	制造业	2,647,316,964.35	72.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	26,185,338.44	0.72
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	29,133.72	0.00
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	562,807,958.36	15.41
J	金融业	85,190,462.00	2.33
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	59,180,400.00	1.62
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	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	98,482,079.85	2.70
R	文化、体育和娱乐业	24,835,734.00	0.68
S	综合	-	-
	合计	3,641,575,813.52	99.70

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,416,117	552,783,408.43	15.13
2	300274	阳光电源	4,095,954	477,711,115.02	13.08
3	300308	中际旭创	1,539,276	226,966,246.20	6.21
4	300760	迈瑞医疗	703,117	210,794,476.60	5.77
5	300498	温氏股份	7,495,368	137,540,002.80	3.77
6	300316	晶盛机电	1,878,201	133,164,450.90	3.65
7	300002	神州泰岳	7,088,700	99,241,800.00	2.72
8	300015	爱尔眼科	5,309,007	98,482,079.85	2.70
9	300033	同花顺	486,025	85,190,462.00	2.33
10	300146	汤臣倍健	3,063,400	73,460,332.00	2.01
11	300502	新易盛	1,039,200	70,634,424.00	1.93
12	300724	捷佳伟创	564,294	63,398,430.90	1.74
13	300395	菲利华	1,210,115	59,537,658.00	1.63
14	300058	蓝色光标	6,120,000	59,180,400.00	1.62
15	300024	机器人	3,478,300	57,983,261.00	1.59
16	300487	蓝晓科技	901,114	56,247,535.88	1.54
17	300394	天孚通信	513,435	54,850,261.05	1.50
18	300633	开立医疗	977,477	53,272,496.50	1.46
19	300003	乐普医疗	2,150,389	48,620,295.29	1.33
20	300896	爱美客	104,911	46,680,149.45	1.28

21	300777	中简科技	968,336	45,763,559.36	1.25
22	300315	掌趣科技	5,718,000	44,600,400.00	1.22
23	300418	昆仑万维	1,102,200	44,396,616.00	1.22
24	300017	网宿科技	6,189,200	44,005,212.00	1.20
25	300014	亿纬锂能	717,373	43,401,066.50	1.19
26	300229	拓尔思	1,566,768	40,688,964.96	1.11
27	300454	深信服	336,656	38,126,292.00	1.04
28	300866	安克创新	423,406	37,048,025.00	1.01
29	300832	新产业	614,811	36,273,849.00	0.99
30	300624	万兴科技	295,000	34,559,250.00	0.95
31	300678	中科信息	680,620	34,024,193.80	0.93
32	300075	数字政通	1,336,700	33,257,096.00	0.91
33	300438	鹏辉能源	673,126	32,336,973.04	0.89
34	300674	宇信科技	1,824,300	32,253,624.00	0.88
35	300494	盛天网络	1,282,740	31,799,124.60	0.87
36	300113	顺网科技	1,811,300	31,172,473.00	0.85
37	300693	盛弘股份	820,450	30,291,014.00	0.83
38	300433	蓝思科技	2,532,500	29,782,200.00	0.82
39	300294	博雅生物	796,434	28,894,625.52	0.79
40	301269	华大九天	231,200	28,400,608.00	0.78
41	300236	上海新阳	713,700	28,298,205.00	0.77
42	300130	新国都	986,400	27,944,712.00	0.77
43	300031	宝通科技	1,063,200	26,282,304.00	0.72
44	300332	天壕环境	2,279,851	26,149,890.97	0.72
45	300232	洲明科技	2,818,400	25,760,176.00	0.71
46	300364	中文在线	1,393,700	24,835,734.00	0.68
47	300910	瑞丰新材	492,409	24,768,172.70	0.68
48	300855	图南股份	682,648	24,111,127.36	0.66
49	300346	南大光电	694,746	23,892,314.94	0.65
50	300672	国科微	267,800	22,321,130.00	0.61
51	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
52	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
53	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
54	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
55	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
56	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
57	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
58	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
59	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
60	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
61	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
62	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
63	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00

64	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
65	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
66	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
67	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
68	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300274	阳光电源	253,951,261.30	7.62
2	300308	中际旭创	97,350,356.03	2.92
3	300347	泰格医药	89,258,410.71	2.68
4	300015	爱尔眼科	82,808,543.13	2.48
5	300146	汤臣倍健	75,418,592.81	2.26
6	300058	蓝色光标	71,777,023.00	2.15
7	300002	神州泰岳	69,292,738.68	2.08
8	300033	同花顺	67,384,206.23	2.02
9	300502	新易盛	65,981,760.80	1.98
10	300418	昆仑万维	64,429,506.04	1.93
11	300896	爱美客	60,386,858.54	1.81
12	300024	机器人	55,190,117.50	1.66
13	300017	网宿科技	54,687,251.46	1.64
14	300229	拓尔思	50,914,934.75	1.53
15	300394	天孚通信	44,390,293.38	1.33
16	300624	万兴科技	42,224,434.80	1.27
17	300454	深信服	40,720,357.96	1.22
18	300075	数字政通	39,700,120.12	1.19
19	300113	顺网科技	38,812,895.25	1.16
20	300866	安克创新	37,985,654.16	1.14

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

##### 7.4.2 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	300124	汇川技术	233,995,157.92	7.02
2	300347	泰格医药	127,426,742.75	3.82
3	300896	爱美客	116,018,155.55	3.48
4	300014	亿纬锂能	84,847,443.06	2.55
5	300763	锦浪科技	76,590,336.04	2.30

6	300498	温氏股份	65,813,841.36	1.97
7	300567	精测电子	62,828,733.38	1.88
8	300015	爱尔眼科	60,367,822.79	1.81
9	300012	华测检测	58,418,216.03	1.75
10	300496	中科创达	58,060,528.38	1.74
11	300751	迈为股份	56,322,205.48	1.69
12	300769	德方纳米	55,369,971.54	1.66
13	300750	宁德时代	51,774,638.59	1.55
14	300666	江丰电子	48,158,077.90	1.44
15	300450	先导智能	47,129,017.00	1.41
16	300144	宋城演艺	43,044,617.50	1.29
17	300390	天华新能	41,970,447.42	1.26
18	300054	鼎龙股份	39,208,863.21	1.18
19	300628	亿联网络	38,336,143.96	1.15
20	300059	东方财富	36,621,456.04	1.10

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 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	2,315,379,601.89
卖出股票收入（成交）总额	2,193,350,239.79

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在

配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体本期出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

##### 7.12.3 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	1,383,008.11
2	应收清算款	432,132.48
3	应收股利	25,538.40
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	111,941.75
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,952,620.74

##### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

##### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	300308	中际旭创	45,621,030.00	1.25	转融通出借证券受限
2	300274	阳光电源	23,349,326.00	0.64	转融通出借证券受限
3	300002	神州泰岳	21,078,400.00	0.58	转融通出借证券受限
4	300033	同花顺	9,430,064.00	0.26	转融通出借证券受

					限
5	300750	宁德时代	7,984,771.00	0.22	转融通出借证券受限
6	300760	迈瑞医疗	2,608,260.00	0.07	转融通出借证券受限
7	300498	温氏股份	2,587,350.00	0.07	转融通出借证券受限
8	300316	晶盛机电	2,063,190.00	0.06	转融通出借证券受限
9	300015	爱尔眼科	1,426,495.00	0.04	转融通出借证券受限
10	300146	汤臣倍健	1,045,528.00	0.03	转融通出借证券受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		华夏创业板动量成长 ETF 发起式联接	
		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
61,065	112,137.98	923,219,031.00	13.48%	3,686,105,884.00	53.83%	2,238,380,896.00	32.69%

8.2 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	香港中央结算有限公司	99,206,700.00	1.45%
2	申万宏源证券—工商银行—申万宏源万利增享 1 号集合资产管理计划	66,690,300.00	0.97%
3	中国银河证券股份有限公司	65,323,700.00	0.95%

4	中国农业银行股份有限公司企业年金计划—中国银行股份有限公司	41,987,627.00	0.61%
5	中信证券股份有限公司融券专用证券账户	36,122,500.00	0.53%
6	国网河南省电力公司企业年金计划—中国建设银行股份有限公司	32,435,500.00	0.47%
7	国寿养老策略 9 号股票型养老金产品—中国工商银行股份有限公司	32,109,800.00	0.47%
8	华润深国投信托有限公司—华润信托·惠盈 3 号集合资金信托计划	28,910,000.00	0.42%
9	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	28,897,500.00	0.42%
10	陈良	24,756,300.00	0.36%
11	中国农业银行股份有限公司—华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	2,238,380,896.00	32.69%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	45,120.00	0.00%

### 8.4 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的情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日（2019 年 6 月 21 日）基金份额总额	391,335,149.00
本报告期期初基金份额总额	5,933,105,811.00
本报告期基金总申购份额	7,401,800,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	6,487,200,000.00

本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,847,705,811.00

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

### 10.2 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，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 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	
中信证券	11	3,626,523,321.47	80.51%	1,564,131.93	80.51%	-
招商证券	2	877,938,287.99	19.49%	378,659.40	19.49%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

iv 有较强的全方位金融服务能力和水平：能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

② 券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③ 除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、东方证券、方正证券、高华证券、广发证券、国泰君安证券、华泰证券、西部证券、中金公司的交易单元作为本基金交易单元，本报告期无股票交易及应付佣金。

④ 本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

#### 10.7.2 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
中信证券	3,556,198.37	100.00%	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金变更场内简称的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
3	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-03
4	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关	中国证监会指定报刊及	2023-03-11

	关联方承销证券的公告	网站	
5	华夏基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-04-01

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
华夏创业板动量成长 ETF 发起式联接	1	2023-01-01 至 2023-06-30	1,879,346,040.00	474,585,096.00	115,550,240.00	2,238,380,896.00	32.69%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏创业板动量成长交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 12.2 存放地点

备查文件存放于基金管理人和/或基金托管人的住所。

## 12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人和/或基金托管人的住所免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

华夏基金管理有限公司

二〇二三年八月三十日