

**华夏中证新能源汽车交易型开放式指数
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.....	12
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	13
6.2 利润表.....	14
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	15
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	154
7.1 期末基金资产组合情况.....	154
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	154
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.....	155
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	158
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	160
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.....	160
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.....	160
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.....	160
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.....	160
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	160
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	160
7.12 投资组合报告附注.....	160
§8 基金份额持有人信息.....	161
§9 开放式基金份额变动.....	163
§10 重大事件揭示.....	163
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	166
§12 备查文件目录.....	166

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证新能源汽车 ETF
场内简称	新汽车（扩位证券简称：新能源车 ETF）
基金主代码	515030
交易代码	515030
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020 年 2 月 20 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	7,584,384,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020 年 3 月 4 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	中证新能源汽车指数收益率。
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	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	李彬	许俊
	联系电话	400-818-6666	010-66596688
	电子邮箱	service@ChinaAMC.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		400-818-6666	95566
传真		010-63136700	010-66594942
注册地址		北京市顺义区安庆大街甲3号院	北京市西城区复兴门内大街1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1号
邮政编码		100033	100818
法定代表人		杨明辉	葛海蛟

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	-793,401,070.50
本期利润	-1,119,337,810.76
加权平均基金份额本期利润	-0.1616
本期加权平均净值利润率	-9.90%
本期基金份额净值增长率	-8.29%
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	4,065,197,685.86
期末可供分配基金份额利润	0.5360
期末基金资产净值	11,649,581,685.86
期末基金份额净值	1.5360
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	53.60%

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

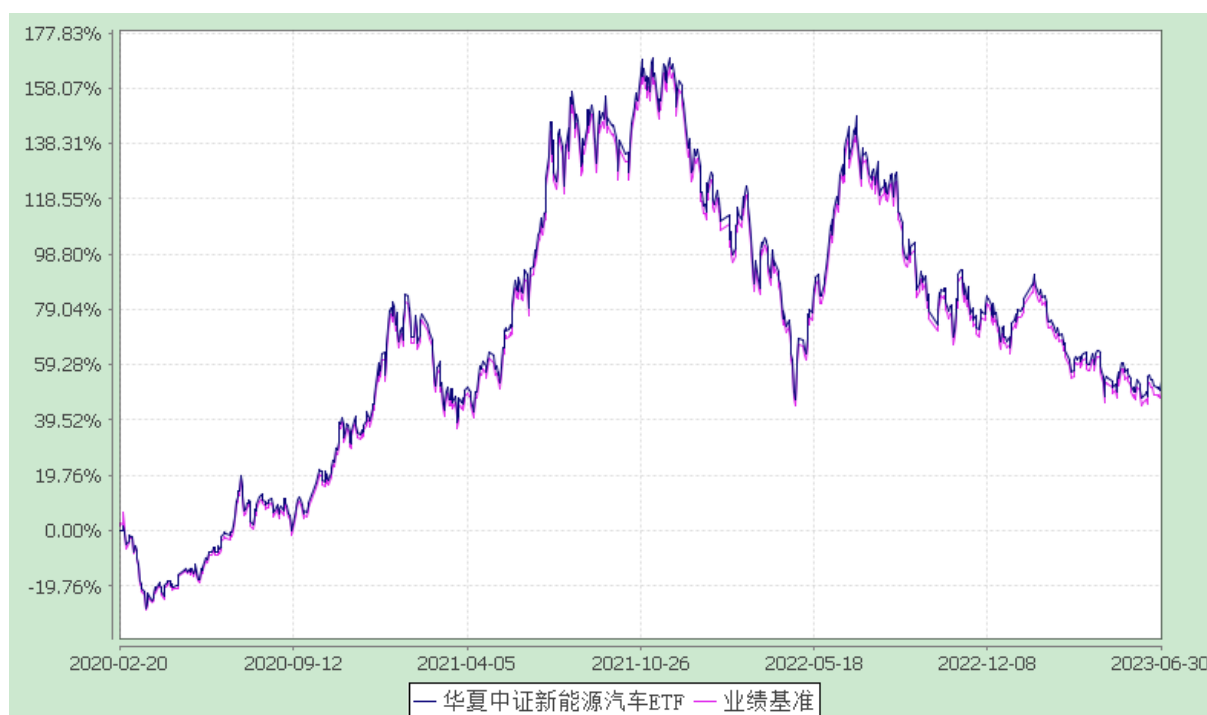
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	2.74%	1.58%	2.27%	1.56%	0.47%	0.02%
过去三个月	-5.82%	1.68%	-6.62%	1.68%	0.80%	0.00%
过去六个月	-8.29%	1.46%	-8.99%	1.46%	0.70%	0.00%

过去一年	-34.88%	1.74%	-35.45%	1.75%	0.57%	-0.01%
过去三年	54.62%	2.26%	53.45%	2.28%	1.17%	-0.02%
自基金合同生效起至今	53.60%	2.26%	50.32%	2.30%	3.28%	-0.04%

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

华夏中证新能源汽车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
 (2020 年 2 月 20 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		
李俊	本基金的 基金经理	2020-02-20	-	15 年	硕士。曾任职于北京市金杜律师事务所证券部。2008 年 12 月加入华夏基金管理有限公司。历任数量投资部研究员、

					<p>基金经理助理、华夏新趋势灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2018 年 1 月 17 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏新锦绣灵活配置混合型证券投资基金基金经理（2019 年 1 月 31 日至 2021 年 5 月 26 日期间）、华夏中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2019 年 9 月 17 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、华夏中证全指证券公司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 3 日至 2021 年 12 月 13 日期间）、上证金融地产交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2017 年 12 月 11 日至 2022 年 3 月 14 日期间）、华夏中证智能汽车主题交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 13 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、上证医药卫生交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2021 年 5 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）等。</p>
--	--	--	--	--	---

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中证新能源汽车指数，该指数选取以中证全指为样本空间，选取涉及锂电池、充电桩、新能源整车等业务的上市公司股票作为成份股，以反映新能源汽车相关上市公司的整体表现，为市场提供多样化的投资标的。本基金主要采取复制法，即按照标的指数成份股及其权重构建基金的股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动对股票投资组合进行相应地调整。

上半年，国际环境的现状，再次让我们真切地认识到，和平与发展的时代主题下，国际环境日趋复杂，不稳定性不确定性明显增加。我国发展仍处于重要战略机遇期，但机遇和挑战都有新的发展变化。当今世界，逆全球化已经成为一个无法回避的话题，其影响也逐渐在经济领域各个方面体现出来。

国内方面，年初市场对疫情政策放开后经济的自然修复有较强的预期，但几个月下来，经济并没有出现预料中的强劲修复，动能较差，投资受制于信心，消费受制于收入，尤其是之前表现较好的出口也面临较大的压力。当下中国经济修复动能较差，主要来自三重压力，内部的房地产政策、外部的美国蓄意与中国脱钩，以及三年疫情的冲击。这三个因素，几乎不留死角地，在不同层面、不同程度上冲击着中国的经济，尤其当这种冲击在很大程度上实现了时间上重叠、事件上共振时，影响之大不言而喻。

从政策基调看，我们前期主要还是着眼长远，强调供给侧，积极而科学地破解科技难题，所以在需求政策方面保持了较强的定力；但我们面临的问题，除了科技领域的卡脖子，还有经济领域的潜在的通缩风险，所以努力扩大内需，仍然是必要的。

面对当前的大环境与小周期，如何避免当年日本在资产价格暴跌和刚性负债诱发的资产负债表衰退，是我们需要认真思考的。经济其实是一个生态，如何让资产负债表较为健康的主体加杠杆，

是非常重要的，除了中央政府加杠杆之外，其实还有资产负债表依然健康的部分居民与企业，这也意味着，当前国内经济的问题，症结还是信心的问题，信心的恢复有赖决策者强有力的信号指引与信用重塑。政策方面，中央经济工作会议要求积极的财政政策要加力提效，稳健的货币政策要精准有力，政策基调维持宽松。

市场方面，经济修复动能不足、政策基调保持定力、美国经济韧性背景下美联储降息预期的一再延后，共同导向之前的强预期与当下的弱现实的错配，并主导了市场基调，去年底以来的增量市场切换为存量乃至缩量市场。报告期内市场整体维持震荡，结构上，由于政策基调倾向于供给侧，也即对于科技的支持，这一政策基调映射在资本市场，人工智能、数字经济为代表的科技板块表现较好。

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、赎回及成份股调整等工作。

为促进本基金的市场流动性提高和平稳运行，经上海证券交易所同意，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为招商证券股份有限公司、中信证券股份有限公司、方正证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、中国国际金融股份有限公司、海通证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、兴业证券股份有限公司、东海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 1.5360 元，本报告期份额净值增长率为-8.29%，同期业绩比较基准增长率-8.99%。本基金本报告期跟踪偏离度为+0.70%，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

展望未来，我们需要重点关注的主要是三个因素，美联储的政策、中国的经济恢复情况、中国的政策基调。

为了应对通胀，美联储采取了激进的加息政策，当前联邦基金利率已达 5.00-5.25%，未来如何走？目前看美联储主要需要关注两个方面的因素：一是金融领域，类似硅谷银行这样的风险，是个例吗？恐怕不是，骤松骤紧的货币政策会给很多经济实体造成冲击，尤其疫情后美国的天量宽松，之后又非常激进地加息，很多资产负债表不是特别健康的实体都很难承受这样的变化，尤其是之前加杠杆，期限配置不合理的实体，这是我们未来关注美联储政策的一个重要的方向，如果出现这样的金融风险的扩散，美联储的货币政策的转向也就不远了。另一个是经济领域，这么高的利率对经济的冲击显然是非常大的，尽管一些数据看上去仍然有韧性，但继续维持这么高的利率，这种韧性

的持续性能有多久是值得怀疑的。但是相比较于金融风险，经济领域的指标，虽然重要，但紧迫性并没有那么强，仅就经济而言，美联储早一点降息或晚一点降息造成的影响相对可控，那么仅从经济领域来看，美联储其实可以选择将利率维持在当前位置观察一段时间。甚至如美联储说的，信用紧缩甚至有利于控制通胀。这是我们观察美联储未来走向的两个重要事项。那么结论就是，如果仅仅是经济增长的指标较差，美联储的转向可能会晚于预期，但如果中间出现其他的风险事件，那么美联储的转向或者给出的转向预期就会提前。此外，除了经济金融方面的因素，美联储的货币政策事实上也受到其他因素的影响，比如欧洲的货币政策怎么走？以及受政治因素的影响，尤其是在美国大选临近，这也是美联储需要关注的因素。

国内方面，毫无疑问，国内经济的修复面临的困难是比较大的，但与此同时，我们也要看到积极的一面，下半年可关注库存变化，观察来自周期的力量；政策方面，前文提及，内部的房地产政策、美国蓄意与中国脱钩、疫情是经济压力的三大来源，疫情业已过去，后续主要是逐渐修复，与美国政府的举措相比，房地产政策及背后的政策脉络毕竟是内政，对于政策的节奏与强度，我们可以掌握主动，也是眼下需要调整，也是能够调整的主要方向。而如何对冲中美脱钩带来的冲击，增强产业链层面的向心力，是信用重塑的范畴。

至于政策调整的时机，当经济增长动能出现进一步衰减，尤其是出口数据回落，三驾马车都呈现疲态时，至少需要输入新的信用，通过财政主动作为接入新的动力，以确保经济机器的正常运转并维持在一个合理的均衡中，尽力避免加速负向螺旋的形成。通过 6 月降息的落地其实可以看到，政策的天平从更为强调供给侧的高质量发展，开始逐渐向兼顾需求侧改变，可继续期待扩大内需的政策。

市场方面，当市场到了一个底部区间时，美联储的降息预期、国内经济的修复、政策的基调，任何一个方面出现利好都会带来市场向上的力量。

我们将继续有效控制基金的跟踪偏离度和跟踪误差，以实现投资者获取指数投资收益及其他模式盈利的投资目标。同时，我们也将积极争取推动产品的进一步创新，充分发挥 ETF 的功能，为各类投资者提供更多、更好的投资机会。

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，本基金管理人为准确、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。会计师事务所在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

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 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：华夏中证新能源汽车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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	76,811,380.49	36,875,241.53
结算备付金		18,440,667.52	17,704,737.56
存出保证金		3,565,151.07	3,322,728.34
交易性金融资产	6.4.7.2	11,562,591,069.07	9,252,852,405.37
其中：股票投资		11,562,591,069.07	9,252,852,405.37
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		79,270,252.35	28,040,526.45
应收股利		974,393.50	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	267,884.86	307,892.22
资产总计		11,741,920,798.86	9,339,103,531.47
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
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		67,121,674.13	24,521,559.64
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		4,609,534.35	4,071,828.05
应付托管费		921,906.87	814,365.62
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		51,043.19	47,151.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-

其他负债	6.4.7.6	19,634,954.46	17,374,646.43
负债合计		92,339,113.00	46,829,550.95
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	7,584,384,000.00	5,548,384,000.00
未分配利润	6.4.7.8	4,065,197,685.86	3,743,889,980.52
净资产合计		11,649,581,685.86	9,292,273,980.52
负债和净资产总计		11,741,920,798.86	9,339,103,531.47

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.5360 元，基金份额总额 7,584,384,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证新能源汽车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
一、营业总收入		-1,083,855,985.63	272,500,512.75
1.利息收入		10,090,059.52	6,358,246.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	271,989.85	328,890.50
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		9,818,069.67	6,029,355.91
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-774,216,389.46	-767,728,230.07
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-876,405,608.99	-796,944,004.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	650,330.11
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	-	-
股利收益	6.4.7.14	102,189,219.53	28,565,444.42
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	-325,936,740.26	1,018,661,762.77
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	6,207,084.57	15,208,733.64
减：二、营业总支出		35,481,825.13	28,802,834.26
1.管理人报酬		28,017,067.26	22,723,101.13
2.托管费		5,603,413.44	4,544,620.21

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		35,345.18	21,709.88
8.其他费用	6.4.7.18	1,825,999.25	1,513,403.04
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-1,119,337,810.76	243,697,678.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-1,119,337,810.76	243,697,678.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-1,119,337,810.76	243,697,678.49

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证新能源汽车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）	5,548,384,000.00	-	3,743,889,980.52	9,292,273,980.52
二、本期期初净资产（基金净值）	5,548,384,000.00	-	3,743,889,980.52	9,292,273,980.52
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	2,036,000,000.00	-	321,307,705.34	2,357,307,705.34
（一）、综合收益总额	-	-	-1,119,337,810.76	-1,119,337,810.76
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	2,036,000,000.00	-	1,440,645,516.10	3,476,645,516.10
其中：1.基金申购款	4,288,000,000.00	-	2,787,113,656.33	7,075,113,656.33
2.基金赎回款	-2,252,000,000.00	-	-1,346,468,140.23	-3,598,468,140.23

(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)	7,584,384,000.00	-	4,065,197,685.86	11,649,581,685.86
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)	4,059,384,000.00	-	5,519,903,616.39	9,579,287,616.39
二、本期期初净资产(基金净值)	4,059,384,000.00	-	5,519,903,616.39	9,579,287,616.39
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	1,149,000,000.00	-	1,558,008,357.41	2,707,008,357.41
(一)、综合收益总额	-	-	243,697,678.49	243,697,678.49
(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,149,000,000.00	-	1,314,310,678.92	2,463,310,678.92
其中: 1.基金申购款	4,934,000,000.00	-	5,023,562,530.86	9,957,562,530.86
2.基金赎回款	-3,785,000,000.00	-	-3,709,251,851.94	-7,494,251,851.94
(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)	5,208,384,000.00	-	7,077,911,973.80	12,286,295,973.80

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

华夏中证新能源汽车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] 1536 号《关于准予华夏中证新能源汽车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》、《华夏中证新能源汽车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 2020 年 2 月 3 日至 2020 年 2 月 14 日共募集 10,762,884,000.00 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（2020）验字第 60739337_A09 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2020 年 2 月 20 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 10,762,884,000.00 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，基金托管人为中国银行股份有限公司。

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（含中小板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票）、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）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具（含同业存单、债券回购等）、银行存款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	76,811,380.49
等于：本金	76,806,084.12
加：应计利息	5,296.37
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	76,811,380.49

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	14,003,519,009.58	-	11,562,591,069.07	-2,440,927,940.51
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	14,003,519,009.58	-	11,562,591,069.07	-2,440,927,940.51

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

无。

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	267,884.86
待摊费用	-
合计	267,884.86

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	3,788,163.06
其中：交易所市场	3,788,163.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	209,095.94
应付指数使用费	865,095.08
应退替代款	14,874,781.27
可退替代款	-102,180.89
合计	19,634,954.46

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	5,548,384,000.00	5,548,384,000.00
本期申购	4,288,000,000.00	4,288,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-2,252,000,000.00	-2,252,000,000.00
本期末	7,584,384,000.00	7,584,384,000.00

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	7,376,694,090.99	-3,632,804,110.47	3,743,889,980.52
本期利润	-793,401,070.50	-325,936,740.26	-1,119,337,810.76
本期基金份额交易产生的变动数	2,665,139,744.37	-1,224,494,228.27	1,440,645,516.10
其中：基金申购款	5,539,933,556.89	-2,752,819,900.56	2,787,113,656.33
基金赎回款	-2,874,793,812.52	1,528,325,672.29	-1,346,468,140.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,248,432,764.86	-5,183,235,079.00	4,065,197,685.86

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	78,931.71
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	167,962.24
其他	25,095.90
合计	271,989.85

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	-683,401,744.27
股票投资收益——赎回差价收入	-193,003,864.72
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	-876,405,608.99

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	3,725,331,020.49
减：卖出股票成本总额	4,399,765,097.05
减：交易费用	8,967,667.71
买卖股票差价收入	-683,401,744.27

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	3,598,468,140.23
减：现金支付赎回款总额	2,903,083,376.40
减：赎回股票成本总额	888,388,628.55
减：交易费用	-
赎回差价收入	-193,003,864.72

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

无。

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

无。

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	102,189,219.53
其中：证券出借权益补偿收入	6,121,261.77
基金投资产生的股利收益	-
合计	102,189,219.53

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	-325,936,740.26
——股票投资	-325,936,740.26
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	-325,936,740.26

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	6,207,084.57
合计	6,207,084.57

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	35,879.28
指数使用费	1,681,024.03
合计	1,825,999.25

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
中国银行股份有限公司（“中国银行”）	基金托管人
华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（“华夏中证新能源汽车 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	1,391,901,163.10	13.55%	1,906,251,116.12	12.20%

6.4.10.1.2 债券回购交易

无。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 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	600,318.69	13.55%	557,952.27	14.73%
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	822,162.06	12.20%	490,883.72	7.37%

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	28,017,067.26	22,723,101.13
其中：支付销售机构的客户维护费	553,637.23	500,482.79

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。

③客户维护费是指基金管理人与基金销售机构约定的用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用按照代销机构所代销基金的份额保有量作为基数进行计算，从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

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	5,603,413.44	4,544,620.21

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

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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	936,261,825.00	650,667.86	-	-
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	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末证券出借业务余额
中信证券	1,495,039,048.40	1,050,187.08	148,556,946.68	28,025.33

注：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	20230103000 01267	瑞泰新材	2023-01-03	2,044,700.00	88,900.00	14	3.20	2,544.52	-	-
中信证券	20230103000 01305	杭可科技	2023-01-03	1,707,375.00	37,500.00	14	2.90	1,925.54	-	-
中信证券	20230104000 01361	天华新能	2023-01-04	56,790.00	1,000.00	14	2.30	50.80	-	-
中信证券	20230104000 15912	星源材质	2023-01-04	7,618,226.00	362,600.00	14	3.00	8,887.93	-	-
中信证券	20230104000 15962	富临精工	2023-01-04	1,208,628.00	83,700.00	14	2.90	1,363.06	-	-
中信证券	20230104000 15968	先导智能	2023-01-04	8,042,000.00	200,000.00	14	3.10	9,695.08	-	-
中信证券	20230104000 21434	嘉元科技	2023-01-04	1,814,000.00	40,000.00	14	3.40	2,398.51	-	-
中信证券	20230105000 01837	富临精工	2023-01-05	1,697,696.00	114,400.00	28	2.60	3,433.12	-	-
中	20230105000	星	2023-01	2,278,000.	100,000	14	3.00	2,657.	-	-

信 证 券	18927	源 材 质	-05	00	.00			67		
中 信 证 券	20230105000 19425	富 临 精 工	2023-01 -05	1,927,716. 00	129,900 .00	14	2.90	2,174. 04	-	-
中 信 证 券	202301100000 1449	中 科 电 气	2023-01 -10	42,940.00	2,000.0 0	14	2.70	64.41	-	-
中 信 证 券	202301100000 1463	瑞 泰 新 材	2023-01 -10	1,986,752. 00	83,900. 00	14	3.40	3,752. 75	-	-
中 信 证 券	202301100000 1497	星 源 材 质	2023-01 -10	1,902,400. 00	80,000. 00	28	1.80	2,663. 36	-	-
中 信 证 券	202301100000 1503	杭 可 科 技	2023-01 -10	933,600.0 0	20,000. 00	28	1.80	1,307. 04	-	-
中 信 证 券	202301100001 5775	星 源 材 质	2023-01 -10	1,778,744. 00	74,800. 00	14	9.80	9,684. 27	-	-
中 信 证 券	202301110000 0861	当 升 科 技	2023-01 -11	99,960.00	1,700.0 0	14	1.90	100.24	-	-
中 信 证 券	202301110002 2327	星 源 材 质	2023-01 -11	2,315,000. 00	100,000 .00	14	9.80	11,973. 69	-	-
中 信 证 券	202301120000 1932	先 导 智 能	2023-01 -12	4,331,000. 00	100,000 .00	14	1.80	3,897. 90	-	-
中 信 证 券	202301120000 1933	星 源 材 质	2023-01 -12	2,383,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,144. 70	-	-
中	202301120000	富	2023-01	1,255,194.	82,200.	14	2.80	1,757.	-	-

信 证 券	1966	临 精 工	-12	00	00			27		
中 信 证 券	202301120000 1969	孚 能 科 技	2023-01 -12	2,511,000. 00	100,000 .00	14	2.20	2,762. 10	-	-
中 信 证 券	202301170003 3297	杭 可 科 技	2023-01 -17	1,767,000. 00	37,500. 00	14	3.40	2,336. 37	-	-
中 信 证 券	202301180001 5071	天 华 新 能	2023-01 -18	61,950.00	1,000.0 0	14	3.20	77.09	-	-
中 信 证 券	202301180001 5097	天 华 新 能	2023-01 -18	1,858,500. 00	30,000. 00	28	3.10	4,481. 05	-	-
中 信 证 券	202301180001 5101	富 临 精 工	2023-01 -18	948,912.0 0	63,600. 00	28	2.70	1,992. 72	-	-
中 信 证 券	202301180001 5187	星 源 材 质	2023-01 -18	8,376,060. 00	362,600 .00	14	5.40	17,589 .73	-	-
中 信 证 券	202301180001 5235	富 临 精 工	2023-01 -18	1,248,804. 00	83,700. 00	14	2.80	1,359. 81	-	-
中 信 证 券	202301180001 5241	先 导 智 能	2023-01 -18	8,732,000. 00	200,000 .00	14	3.30	11,206. 07	-	-
中 信 证 券	202301180001 5943	嘉 元 科 技	2023-01 -18	1,931,600. 00	40,000. 00	14	3.50	2,629. 12	-	-
中 信 证 券	202301190000 1239	中 科 电 气	2023-01 -19	356,220.0 0	18,000. 00	14	3.30	457.15	-	-
中	202301190000	孚	2023-01	1,277,500.	50,000.	14	3.20	1,589.	-	-

信 证 券	1277	能 科 技	-19	00	00			78		
中 信 证 券	202301190001 3918	星 源 材 质	2023-01 -19	2,293,000. 00	100,000 .00	14	5.40	4,815. 30	-	-
中 信 证 券	202301190001 6856	富 临 精 工	2023-01 -19	1,940,706. 00	129,900 .00	14	2.80	2,113.2 1	-	-
中 信 证 券	20230130000 72255	星 源 材 质	2023-01 -30	2,321,000. 00	100,000 .00	14	5.40	4,874. 10	-	-
中 信 证 券	20230130000 75147	星 源 材 质	2023-01 -30	1,736,108. 00	74,800. 00	14	5.40	3,645. 83	-	-
中 信 证 券	20230130000 77905	先 导 智 能	2023-01 -30	4,641,000. 00	100,000 .00	14	1.80	3,248. 70	-	-
中 信 证 券	20230130000 77909	孚 能 科 技	2023-01 -30	2,599,000. 00	100,000 .00	14	3.20	3,234. 31	-	-
中 信 证 券	20230130000 77933	星 源 材 质	2023-01 -30	2,321,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,624. 70	-	-
中 信 证 券	20230131000 32735	杭 可 科 技	2023-01 -31	1,889,250. 00	37,500. 00	14	2.70	1,983. 71	-	-
中 信 证 券	20230201000 01906	星 源 材 质	2023-02 -01	962,000.0 0	40,000. 00	14	3.20	1,197. 16	-	-
中 信 证 券	20230201000 01909	先 导 智 能	2023-02 -01	2,495,175. 00	51,500. 00	14	3.30	3,202. 14	-	-
中	20230201000	星	2023-02	8,720,530.	362,600	14	3.00	10,173	-	-

信 证 券	15210	源 材 质	-01	00	.00			.95		
中 信 证 券	20230201000 18830	天 华 新 能	2023-02 -01	63,710.00	1,000.0 0	14	3.40	84.24	-	-
中 信 证 券	20230201000 18838	富 临 精 工	2023-02 -01	1,336,689. 00	83,700. 00	14	3.30	1,715. 42	-	-
中 信 证 券	20230201000 18872	先 导 智 能	2023-02 -01	9,690,000. 00	200,000 .00	14	3.30	12,435 .50	-	-
中 信 证 券	20230201000 19456	嘉 元 科 技	2023-02 -01	2,031,600. 00	40,000. 00	14	3.60	2,844. 24	-	-
中 信 证 券	20230202000 01545	新 宙 邦	2023-02 -02	49,120.00	1,000.0 0	14	2.10	40.11	-	-
中 信 证 券	20230202000 01547	中 科 电 气	2023-02 -02	819,011.0 0	39,700. 00	14	3.20	1,019. 21	-	-
中 信 证 券	20230202000 15617	孚 能 科 技	2023-02 -02	1,299,000. 00	50,000. 00	14	3.20	1,616. 53	-	-
中 信 证 券	20230202000 15631	富 临 精 工	2023-02 -02	1,806,376. 00	114,400 .00	28	3.20	4,495. 87	-	-
中 信 证 券	20230202000 15771	星 源 材 质	2023-02 -02	2,418,000. 00	100,000 .00	14	3.00	2,821. 00	-	-
中 信 证 券	20230207000 01093	嘉 元 科 技	2023-02 -07	350,840.0 0	7,000.0 0	14	3.50	477.53	-	-
中	20230207000	星	2023-02	1,838,400.	80,000.	28	1.80	2,573.	-	-

信 证 券	03937	源 材 质	-07	00	00			76		
中 信 证 券	20230207000 03939	杭 可 科 技	2023-02 -07	1,096,800. 00	20,000. 00	28	1.80	1,535. 52	-	-
中 信 证 券	20230208000 01522	先 导 智 能	2023-02 -08	2,392,690. 00	51,500. 00	14	3.40	3,163. 67	-	-
中 信 证 券	20230208000 01537	瑞 泰 新 材	2023-02 -08	380,120.0 0	13,000. 00	14	3.50	517.39	-	-
中 信 证 券	20230209000 01496	星 源 材 质	2023-02 -09	501,600.0 0	22,000. 00	14	12.5 0	2,438. 33	-	-
中 信 证 券	20230213000 59738	星 源 材 质	2023-02 -13	2,221,000. 00	100,000 .00	14	3.20	2,763. 91	-	-
中 信 证 券	20230213000 59756	星 源 材 质	2023-02 -13	1,661,308. 00	74,800. 00	14	3.20	2,067. 41	-	-
中 信 证 券	20230213000 63520	孚 能 科 技	2023-02 -13	2,564,000. 00	100,000 .00	14	3.30	3,290. 47	-	-
中 信 证 券	20230213000 71072	星 源 材 质	2023-02 -13	2,221,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,554. 70	-	-
中 信 证 券	20230213000 75504	先 导 智 能	2023-02 -13	4,623,000. 00	100,000 .00	14	1.80	3,236. 10	-	-
中 信 证 券	20230214000 26193	杭 可 科 技	2023-02 -14	2,184,000. 00	37,500. 00	14	3.50	2,972. 67	-	-
中	20230215000	瑞	2023-02	2,044,185.	71,500.	14	3.60	2,861.	-	-

信 证 券	01862	泰 新 材	-15	00	00			86		
中 信 证 券	20230215000 14740	先 导 智 能	2023-02 -15	2,460,670. 00	51,500. 00	14	3.40	3,253. 55	-	-
中 信 证 券	20230215000 14766	先 导 智 能	2023-02 -15	9,556,000. 00	200,000 .00	14	3.40	12,635 .16	-	-
中 信 证 券	20230215000 14976	嘉 元 科 技	2023-02 -15	2,056,800. 00	40,000. 00	14	3.20	2,559. 57	-	-
中 信 证 券	20230215000 15470	星 源 材 质	2023-02 -15	871,200.0 0	40,000. 00	14	12.5 0	4,235. 00	-	-
中 信 证 券	20230215000 15488	天 华 新 能	2023-02 -15	1,788,600. 00	30,000. 00	28	2.90	4,034. 29	-	-
中 信 证 券	20230215000 15620	星 源 材 质	2023-02 -15	7,897,428. 00	362,600 .00	14	12.5 0	38,390 .28	-	-
中 信 证 券	20230215000 17632	天 华 新 能	2023-02 -15	59,620.00	1,000.0 0	14	3.00	69.56	-	-
中 信 证 券	20230216000 15829	中 科 电 气	2023-02 -16	786,854.0 0	39,700. 00	14	3.10	948.60	-	-
中 信 证 券	20230216000 16747	星 源 材 质	2023-02 -16	2,142,000. 00	100,000 .00	14	12.5 0	10,412 .50	-	-
中 信 证 券	20230221000 01106	星 源 材 质	2023-02 -21	21,220.00	1,000.0 0	14	4.40	36.31	-	-
中	20230221000	嘉	2023-02	49,330.00	1,000.0	14	3.60	69.06	-	-

信 证 券	01306	元 科 技	-21		0					
中 信 证 券	20230221000 04499	嘉 元 科 技	2023-02 -21	345,310.0 0	7,000.0 0	14	3.20	429.72	-	-
中 信 证 券	20230222000 01084	腾 远 钻 业	2023-02 -22	672,336.0 0	9,200.0 0	28	3.80	1,987.13	-	-
中 信 证 券	20230222000 04646	先 导 智 能	2023-02 -22	2,309,775.00	51,500.00	14	3.30	2,964.21	-	-
中 信 证 券	20230222000 04686	瑞 泰 新 材	2023-02 -22	345,280.0 0	13,000.00	14	3.60	483.39	-	-
中 信 证 券	20230223000 01181	先 导 智 能	2023-02 -23	444,500.0 0	10,000.00	14	3.30	570.44	-	-
中 信 证 券	20230223000 01190	中 科 电 气	2023-02 -23	461,520.0 0	24,000.00	28	3.10	1,112.78	-	-
中 信 证 券	20230223000 01197	杭 可 科 技	2023-02 -23	331,630.0 0	6,500.0 0	14	3.20	412.70	-	-
中 信 证 券	20230223000 01203	星 源 材 质	2023-02 -23	328,790.0 0	15,400.00	14	4.40	562.60	-	-
中 信 证 券	20230223000 01214	腾 远 钻 业	2023-02 -23	102,564.0 0	1,400.0 0	28	3.80	303.13	-	-
中 信 证 券	20230223000 01219	星 源 材 质	2023-02 -23	619,150.0 0	29,000.00	14	4.40	1,059.43	-	-
中	20230223000	先	2023-02	195,580.0	4,400.0	14	3.30	250.99	-	-

信 证 券	01224	导 智 能	-23	0	0						
中 信 证 券	20230223000 01243	特 锐 德	2023-02 -23	158,850.0 0	9,000.0 0	14	3.40	210.04	-	-	
中 信 证 券	20230223000 01244	特 锐 德	2023-02 -23	95,310.00	5,400.0 0	14	3.40	126.02	-	-	
中 信 证 券	20230223000 05075	星 源 材 质	2023-02 -23	469,700.0 0	22,000. 00	14	3.80	694.11	-	-	
中 信 证 券	20230227000 66766	先 导 智 能	2023-02 -27	4,331,000. 00	100,000 .00	14	1.80	3,031. 70	-	-	
中 信 证 券	20230227000 70602	星 源 材 质	2023-02 -27	2,090,000. 00	100,000 .00	14	4.40	3,576. 22	-	-	
中 信 证 券	20230227000 72632	星 源 材 质	2023-02 -27	1,563,320. 00	74,800. 00	14	4.40	2,675. 01	-	-	
中 信 证 券	20230227000 74152	星 源 材 质	2023-02 -27	2,090,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,463. 00	-	-	
中 信 证 券	20230227000 75202	孚 能 科 技	2023-02 -27	2,422,000. 00	100,000 .00	14	3.30	3,108. 23	-	-	
中 信 证 券	20230228000 01359	中 科 电 气	2023-02 -28	670,250.0 0	35,000. 00	28	3.10	1,616. 05	-	-	
中 信 证 券	20230228000 01372	富 临 精 工	2023-02 -28	33,990.00	2,200.0 0	14	3.00	39.66	-	-	
中	20230228000	腾	2023-02	251,965.0	3,500.0	28	3.40	666.31	-	-	

信 证 券	01388	远 钻 业	-28	0	0						
中 信 证 券	20230228000 19728	杭 可 科 技	2023-02 -28	1,884,375. 00	37,500. 00	14	3.20	2,345. 00	-	-	
中 信 证 券	20230301000 01416	中 科 电 气	2023-03 -01	38,600.00	2,000.0 0	28	3.10	93.07	-	-	
中 信 证 券	20230301000 01417	中 科 电 气	2023-03 -01	1,897,190. 00	98,300. 00	14	3.20	2,360. 95	-	-	
中 信 证 券	20230301000 01428	特 锐 德	2023-03 -01	373,065.0 0	20,900. 00	14	3.50	507.78	-	-	
中 信 证 券	20230301000 14267	嘉 元 科 技	2023-03 -01	1,897,600. 00	40,000. 00	14	3.60	2,656. 64	-	-	
中 信 证 券	20230301000 14399	瑞 泰 新 材	2023-03 -01	1,903,330. 00	71,500. 00	14	3.60	2,664. 66	-	-	
中 信 证 券	20230301000 15663	先 导 智 能	2023-03 -01	8,768,000. 00	200,000 .00	14	3.30	11,252. 27	-	-	
中 信 证 券	20230301000 18303	星 源 材 质	2023-03 -01	7,716,128. 00	362,600 .00	14	4.40	13,203 .15	-	-	
中 信 证 券	20230301000 18305	星 源 材 质	2023-03 -01	851,200.0 0	40,000. 00	14	4.40	1,456. 50	-	-	
中 信 证 券	20230301000 20007	先 导 智 能	2023-03 -01	2,257,760. 00	51,500. 00	14	3.30	2,897. 46	-	-	
中	20230302000	天	2023-03	202,644.0	3,600.0	14	3.40	267.94	-	-	

信 证 券	01454	华 新 能	-02	0	0						
中 信 证 券	20230302000 01466	富 临 精 工	2023-03 -02	15,220.00	1,000.0 0	14	3.00	17.76	-	-	
中 信 证 券	202303020001 1201	富 临 精 工	2023-03 -02	1,741,168. 00	114,400 .00	28	2.90	3,927. 30	-	-	
中 信 证 券	202303020001 1453	中 科 电 气	2023-03 -02	760,255.0 0	39,700. 00	14	3.20	946.10	-	-	
中 信 证 券	20230302000 12015	星 源 材 质	2023-03 -02	2,075,000. 00	100,000 .00	14	4.40	3,550. 56	-	-	
中 信 证 券	20230307000 01949	星 源 材 质	2023-03 -07	1,372,279. 00	67,700. 00	14	3.60	1,921. 19	-	-	
中 信 证 券	20230307000 01974	特 锐 德	2023-03 -07	23,954.00	1,400.0 0	14	2.90	27.01	-	-	
中 信 证 券	20230307000 01980	中 科 电 气	2023-03 -07	1,069,890. 00	57,000. 00	14	3.20	1,331. 42	-	-	
中 信 证 券	20230307000 07266	杭 可 科 技	2023-03 -07	1,078,200. 00	20,000. 00	28	1.80	1,509. 48	-	-	
中 信 证 券	20230307000 08432	星 源 材 质	2023-03 -07	20,270.00	1,000.0 0	14	4.20	33.11	-	-	
中 信 证 券	20230307000 08660	星 源 材 质	2023-03 -07	1,621,600. 00	80,000. 00	28	1.80	2,270. 24	-	-	
中	20230308000	瑞	2023-03	90,828.00	3,600.0	14	3.30	116.56	-	-	

信 证 券	01291	泰 新 材	-08		0					
中 信 证 券	20230308000 07278	先 导 智 能	2023-03 -08	2,161,455. 00	51,500. 00	14	3.40	2,857. 92	-	-
中 信 证 券	20230309000 01250	中 科 电 气	2023-03 -09	299,238.0 0	15,900. 00	14	3.20	372.39	-	-
中 信 证 券	20230309000 01255	瑞 泰 新 材	2023-03 -09	93,573.00	3,700.0 0	14	3.30	120.09	-	-
中 信 证 券	20230309000 01300	中 科 电 气	2023-03 -09	37,640.00	2,000.0 0	14	3.20	46.84	-	-
中 信 证 券	20230309000 01311	富 临 精 工	2023-03 -09	704,224.0 0	47,200. 00	14	3.20	876.37	-	-
中 信 证 券	20230309000 01312	星 源 材 质	2023-03 -09	141,645.0 0	7,100.0 0	14	3.60	198.30	-	-
中 信 证 券	20230309000 01366	振 华 新 材	2023-03 -09	116,480.0 0	2,600.0 0	14	3.20	144.95	-	-
中 信 证 券	20230309000 06870	先 导 智 能	2023-03 -09	184,844.0 0	4,400.0 0	14	3.40	244.40	-	-
中 信 证 券	20230309000 06874	杭 可 科 技	2023-03 -09	337,740.0 0	6,500.0 0	14	3.10	407.16	-	-
中 信 证 券	20230309000 06878	星 源 材 质	2023-03 -09	307,230.0 0	15,400. 00	14	4.20	501.81	-	-
中	20230313000	星	2023-03	1,936,000.	100,000	14	1.80	1,355.	-	-

信 证 券	54438	源 材 质	-13	00	.00			20		
中 信 证 券	20230313000 56926	先 导 智 能	2023-03 -13	4,084,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,858. 80	-	-
中 信 证 券	20230313000 63322	星 源 材 质	2023-03 -13	1,448,128. 00	74,800. 00	14	3.60	2,027. 38	-	-
中 信 证 券	20230313000 65604	星 源 材 质	2023-03 -13	1,936,000. 00	100,000 .00	14	3.60	2,710. 40	-	-
中 信 证 券	20230313000 67806	孚 能 科 技	2023-03 -13	2,301,000. 00	100,000 .00	14	3.30	2,952. 95	-	-
中 信 证 券	20230314000 01752	中 科 电 气	2023-03 -14	283,497.0 0	15,900. 00	14	3.10	341.77	-	-
中 信 证 券	20230314000 01761	德 方 纳 米	2023-03 -14	495,720.0 0	2,400.0 0	14	3.40	655.45	-	-
中 信 证 券	20230314000 24028	杭 可 科 技	2023-03 -14	1,809,000. 00	37,500. 00	14	3.60	2,532. 60	-	-
中 信 证 券	20230315000 17711	瑞 泰 新 材	2023-03 -15	1,743,170. 00	71,500. 00	14	3.30	2,237. 07	-	-
中 信 证 券	20230315000 20315	中 科 电 气	2023-03 -15	1,722,216. 00	98,300. 00	14	3.20	2,143. 20	-	-
中 信 证 券	20230315000 20323	天 华 新 能	2023-03 -15	1,586,700. 00	30,000. 00	28	3.40	4,195. 94	-	-
中	20230315000	特	2023-03	349,657.0	20,900.	14	2.90	394.34	-	-

信 证 券	20327	锐 德	-15	0	00					
中 信 证 券	20230315000 20369	先 导 智 能	2023-03 -15	2,083,175. 00	51,500. 00	14	3.50	2,835. 43	-	-
中 信 证 券	20230315000 20395	星 源 材 质	2023-03 -15	7,106,960. 00	362,600 .00	14	3.60	9,949. 74	-	-
中 信 证 券	20230315000 20397	星 源 材 质	2023-03 -15	784,000.0 0	40,000. 00	14	3.60	1,097. 60	-	-
中 信 证 券	20230315000 20407	嘉 元 科 技	2023-03 -15	1,780,000. 00	40,000. 00	14	3.60	2,492. 00	-	-
中 信 证 券	20230315000 20417	先 导 智 能	2023-03 -15	8,090,000. 00	200,000 .00	14	3.50	11,011. 39	-	-
中 信 证 券	20230316000 01416	腾 远 钴 业	2023-03 -16	60,390.00	1,000.0 0	14	3.40	79.85	-	-
中 信 证 券	20230316000 12210	中 科 电 气	2023-03 -16	662,196.0 0	39,700. 00	14	3.10	798.31	-	-
中 信 证 券	20230316000 14350	星 源 材 质	2023-03 -16	1,900,000. 00	100,000 .00	14	3.60	2,660. 00	-	-
中 信 证 券	20230321000 01830	中 科 电 气	2023-03 -21	907,360.0 0	53,000. 00	28	3.20	2,258. 32	-	-
中 信 证 券	20230321000 01874	瑞 泰 新 材	2023-03 -21	92,611.00	3,700.0 0	14	3.60	129.66	-	-
中	20230321000	嘉	2023-03	45,170.00	1,000.0	14	3.60	63.24	-	-

信 证 券	01906	元 科 技	-21		0						
中 信 证 券	20230321000 07940	星 源 材 质	2023-03 -21	1,331,659. 00	67,700. 00	14	3.30	1,708. 96	-	-	
中 信 证 券	20230321000 08084	特 锐 德	2023-03 -21	24,906.00	1,400.0 0	14	2.90	28.09	-	-	
中 信 证 券	20230321000 08090	中 科 电 气	2023-03 -21	975,840.0 0	57,000. 00	14	3.10	1,176. 43	-	-	
中 信 证 券	20230322000 01418	富 临 精 工	2023-03 -22	129,549.0 0	9,300.0 0	14	3.30	178.13	-	-	
中 信 证 券	20230322000 07425	先 导 智 能	2023-03 -22	2,019,830. 00	51,500. 00	14	3.30	2,777. 27	-	-	
中 信 证 券	20230322000 07931	腾 远 钴 业	2023-03 -22	578,220.0 0	9,200.0 0	28	3.30	1,484. 10	-	-	
中 信 证 券	20230322000 08651	瑞 泰 新 材	2023-03 -22	90,540.00	3,600.0 0	14	3.30	124.49	-	-	
中 信 证 券	20230323000 01407	嘉 元 科 技	2023-03 -23	45,050.00	1,000.0 0	14	3.60	63.07	-	-	
中 信 证 券	20230323000 05798	富 临 精 工	2023-03 -23	653,720.0 0	47,200. 00	14	3.20	813.52	-	-	
中 信 证 券	20230323000 05816	中 科 电 气	2023-03 -23	34,280.00	2,000.0 0	14	3.10	41.33	-	-	
中	20230323000	中	2023-03	411,360.0	24,000.	28	3.00	959.84	-	-	

信 证 券	05826	科 电 气	-23	0	00						
中 信 证 券	20230323000 06316	先 导 智 能	2023-03 -23	173,976.0 0	4,400.0 0	14	3.30	223.27	-	-	
中 信 证 券	20230323000 06324	中 科 电 气	2023-03 -23	272,526.0 0	15,900. 00	14	3.10	328.55	-	-	
中 信 证 券	20230323000 07110	腾 远 钻 业	2023-03 -23	87,500.00	1,400.0 0	28	3.30	224.58	-	-	
中 信 证 券	20230323000 07252	瑞 泰 新 材	2023-03 -23	92,500.00	3,700.0 0	14	3.30	118.71	-	-	
中 信 证 券	20230323000 07272	振 华 新 材	2023-03 -23	106,860.0 0	2,600.0 0	14	3.40	141.29	-	-	
中 信 证 券	20230323000 07484	杭 可 科 技	2023-03 -23	299,000.0 0	6,500.0 0	14	3.70	430.23	-	-	
中 信 证 券	20230327000 51013	星 源 材 质	2023-03 -27	1,966,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,376. 20	-	-	
中 信 证 券	20230327000 51853	星 源 材 质	2023-03 -27	1,966,000. 00	100,000 .00	14	3.30	2,523. 03	-	-	
中 信 证 券	20230327000 55065	先 导 智 能	2023-03 -27	3,967,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,776. 90	-	-	
中 信 证 券	20230327000 57569	孚 能 科 技	2023-03 -27	2,255,000. 00	100,000 .00	14	4.40	3,858. 56	-	-	
中	20230327000	星	2023-03	1,470,568.	74,800.	14	3.30	1,887.	-	-	

信 证 券	67211	源 材 质	-27	00	00			23		
中 信 证 券	20230328000 20427	德 方 纳 米	2023-03 -28	464,616.0 0	2,400.0 0	14	2.90	523.98	-	-
中 信 证 券	20230328000 23447	腾 远 钻 业	2023-03 -28	213,500.0 0	3,500.0 0	28	3.40	564.59	-	-
中 信 证 券	20230328000 25175	中 科 电 气	2023-03 -28	586,600.0 0	35,000. 00	28	3.20	1,459. 98	-	-
中 信 证 券	20230328000 25485	中 科 电 气	2023-03 -28	266,484.0 0	15,900. 00	14	3.30	341.99	-	-
中 信 证 券	20230328000 27799	杭 可 科 技	2023-03 -28	1,705,875. 00	37,500. 00	14	3.40	2,255. 55	-	-
中 信 证 券	20230329000 00946	中 科 电 气	2023-03 -29	36,916.00	2,200.0 0	14	3.00	43.07	-	-
中 信 证 券	20230329000 00978	瑞 泰 新 材	2023-03 -29	89,873.00	3,700.0 0	14	3.40	118.83	-	-
中 信 证 券	20230329000 00989	容 百 科 技	2023-03 -29	679,400.0 0	10,000. 00	14	3.20	845.48	-	-
中 信 证 券	20230329000 00994	嘉 元 科 技	2023-03 -29	73,933.00	1,700.0 0	14	3.40	97.76	-	-
中 信 证 券	20230329000 15478	先 导 智 能	2023-03 -29	2,022,920. 00	51,500. 00	14	3.30	2,596. 08	-	-
中	20230329000	星	2023-03	7,154,098.	362,600	14	3.30	9,181.	-	-

信 证 券	15506	源 材 质	-29	00	.00			09		
中 信 证 券	20230329000 15896	中 科 电 气	2023-03 -29	1,649,474. 00	98,300. 00	14	3.30	2,116.8 2	-	-
中 信 证 券	20230329000 15936	中 科 电 气	2023-03 -29	33,560.00	2,000.0 0	28	3.20	83.53	-	-
中 信 证 券	20230329000 20680	特 锐 德	2023-03 -29	369,303.0 0	20,900. 00	14	2.90	416.49	-	-
中 信 证 券	20230329000 20912	先 导 智 能	2023-03 -29	7,856,000. 00	200,000 .00	14	3.30	10,081 .87	-	-
中 信 证 券	20230329000 20938	星 源 材 质	2023-03 -29	789,200.0 0	40,000. 00	14	3.30	1,012. 81	-	-
中 信 证 券	20230330000 12471	中 科 电 气	2023-03 -30	665,372.0 0	39,700. 00	14	3.30	853.89	-	-
中 信 证 券	20230330000 14251	星 源 材 质	2023-03 -30	1,906,000. 00	100,000 .00	14	3.10	2,297. 79	-	-
中 信 证 券	20230330000 14901	腾 远 钻 业	2023-03 -30	59,830.00	1,000.0 0	14	3.50	81.44	-	-
中 信 证 券	20230404000 01843	星 源 材 质	2023-04 -04	970,840.0 0	52,000. 00	14	3.30	1,245. 91	-	-
中 信 证 券	20230404000 10317	特 锐 德	2023-04 -04	24,500.00	1,400.0 0	14	2.60	24.77	-	-
中	20230404000	嘉	2023-04	43,100.00	1,000.0	14	3.40	56.99	-	-

信 证 券	10773	元 科 技	-04		0					
中 信 证 券	20230404000 10779	瑞 泰 新 材	2023-04 -04	85,951.00	3,700.0 0	14	3.40	113.65	-	-
中 信 证 券	20230404000 10785	星 源 材 质	2023-04 -04	1,263,959. 00	67,700. 00	14	3.10	1,523. 77	-	-
中 信 证 券	20230404000 10797	中 科 电 气	2023-04 -04	940,500.0 0	57,000. 00	14	3.00	1,097. 25	-	-
中 信 证 券	202304040001 1567	杭 可 科 技	2023-04 -04	864,000.0 0	20,000. 00	28	1.80	1,296. 00	-	-
中 信 证 券	20230404000 12081	星 源 材 质	2023-04 -04	1,493,600. 00	80,000. 00	28	1.80	2,240. 40	-	-
中 信 证 券	20230406000 12348	中 科 电 气	2023-04 -06	32,460.00	2,000.0 0	14	3.00	37.87	-	-
中 信 证 券	20230406000 14166	振 华 新 材	2023-04 -06	101,868.0 0	2,600.0 0	14	3.20	126.77	-	-
中 信 证 券	20230406000 14690	先 导 智 能	2023-04 -06	1,990,990. 00	51,500. 00	14	3.30	2,555. 10	-	-
中 信 证 券	20230406000 15000	先 导 智 能	2023-04 -06	170,104.0 0	4,400.0 0	14	3.30	218.30	-	-
中 信 证 券	20230406000 15308	杭 可 科 技	2023-04 -06	285,805.0 0	6,500.0 0	14	3.60	400.13	-	-
中	20230406000	嘉	2023-04	43,480.00	1,000.0	14	3.40	57.49	-	-

信 证 券	15340	元 科 技	-06		0						
中 信 证 券	20230406000 16280	瑞 泰 新 材	2023-04 -06	84,312.00	3,600.0 0	14	3.40	111.48	-	-	
中 信 证 券	20230406000 16306	瑞 泰 新 材	2023-04 -06	86,654.00	3,700.0 0	14	3.40	114.58	-	-	
中 信 证 券	20230410000 07975	盛 新 锂 能	2023-04 -10	375,180.0 0	11,100. 00	14	1.70	248.04	-	-	
中 信 证 券	202304100001 1221	西 藏 矿 业	2023-04 -10	359,400.0 0	10,000. 00	14	1.70	237.60	-	-	
中 信 证 券	20230410000 14227	天 齐 锂 业	2023-04 -10	23,445,00 0.00	300,000 .00	14	1.70	15,499 .75	-	-	
中 信 证 券	20230410000 37037	法 拉 电 子	2023-04 -10	1,451,000. 00	10,000. 00	14	1.70	959.27	-	-	
中 信 证 券	20230410000 49313	星 源 材 质	2023-04 -10	1,930,000. 00	100,000 .00	14	3.10	2,326. 72	-	-	
中 信 证 券	20230410000 49335	先 导 智 能	2023-04 -10	3,941,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,758. 70	-	-	
中 信 证 券	20230410000 49367	星 源 材 质	2023-04 -10	1,443,640. 00	74,800. 00	14	3.10	1,740. 39	-	-	
中 信 证 券	20230410000 62505	星 源 材 质	2023-04 -10	1,930,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,351. 00	-	-	
中	20230410000	孚	2023-04	2,324,000.	100,000	14	3.40	3,072.	-	-	

信 证 券	63433	能 科 技	-10	00	.00			84		
中 信 证 券	202304110000 4347	容 百 科 技	2023-04 -11	713,500.0 0	10,000. 00	14	2.70	749.18	-	-
中 信 证 券	202304110000 4407	盛 新 锂 能	2023-04 -11	35,360.00	1,000.0 0	14	3.20	44.00	-	-
中 信 证 券	202304110000 4457	龙 蟠 科 技	2023-04 -11	1,306,800. 00	60,000. 00	14	3.20	1,626. 24	-	-
中 信 证 券	202304110000 4566	三 花 智 控	2023-04 -11	351,504.0 0	14,400. 00	14	3.20	437.43	-	-
中 信 证 券	202304110000 4568	华 友 钻 业	2023-04 -11	559,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	695.64	-	-
中 信 证 券	202304110000 4609	多 氟 多	2023-04 -11	1,029,040. 00	30,400. 00	14	3.20	1,280. 58	-	-
中 信 证 券	202304110000 4625	多 氟 多	2023-04 -11	1,032,425. 00	30,500. 00	14	3.20	1,284. 80	-	-
中 信 证 券	202304110000 4642	多 氟 多	2023-04 -11	3,385,000. 00	100,000 .00	14	3.20	4,212. 44	-	-
中 信 证 券	202304110000 5666	西 藏 矿 业	2023-04 -11	362,600.0 0	10,000. 00	14	1.70	239.72	-	-
中 信 证 券	202304110000 9218	天 齐 锂 业	2023-04 -11	799,700.0 0	10,000. 00	14	1.70	528.69	-	-
中	202304110000	雅	2023-04	212,300.0	10,000.	14	1.70	140.35	-	-

信 证 券	9228	化 集 团	-11	0	00						
中 信 证 券	202304110001 0134	三 花 智 控	2023-04 -11	466,231.0 0	19,100. 00	14	1.70	308.23	-	-	
中 信 证 券	202304110001 6896	中 国 宝 安	2023-04 -11	295,001.0 0	25,900. 00	14	1.70	195.03	-	-	
中 信 证 券	202304110001 7108	赣 锋 锂 业	2023-04 -11	917,078.0 0	13,700. 00	14	1.70	606.29	-	-	
中 信 证 券	202304110002 0532	中 科 电 气	2023-04 -11	261,237.0 0	15,900. 00	14	2.70	274.30	-	-	
中 信 证 券	202304110002 2092	杭 可 科 技	2023-04 -11	1,701,000. 00	37,500. 00	14	3.20	2,116.8 0	-	-	
中 信 证 券	202304110002 2114	德 方 纳 米	2023-04 -11	494,160.0 0	2,400.0 0	14	3.20	614.95	-	-	
中 信 证 券	202304120001 1126	诺 德 股 份	2023-04 -12	7,800.00	1,000.0 0	14	3.20	9.71	-	-	
中 信 证 券	202304120001 1137	璞 泰 来	2023-04 -12	1,533,000. 00	30,000. 00	14	3.20	1,907. 73	-	-	
中 信 证 券	202304120001 1142	龙 蟠 科 技	2023-04 -12	79,439.00	3,700.0 0	14	3.20	98.86	-	-	
中 信 证 券	202304120001 1430	多 氟 多	2023-04 -12	887,220.0 0	26,500. 00	14	3.20	1,104. 10	-	-	
中	202304120001	三	2023-04	348,912.0	14,400.	14	3.20	434.20	-	-	

信 证 券	1434	花 智 控	-12	0	00						
中 信 证 券	202304120001 1451	天 赐 材 料	2023-04 -12	42,090.00	1,000.0 0	14	3.20	52.38	-	-	
中 信 证 券	202304120001 1501	星 源 材 质	2023-04 -12	439,176.0 0	23,200. 00	14	3.00	512.37	-	-	
中 信 证 券	20230412000 18164	西 藏 矿 业	2023-04 -12	357,300.0 0	10,000. 00	14	1.70	236.22	-	-	
中 信 证 券	20230412000 20072	国 轩 高 科	2023-04 -12	282,100.0 0	10,000. 00	28	1.80	394.94	-	-	
中 信 证 券	20230412000 20304	厦 门 钨 业	2023-04 -12	469,890.0 0	23,000. 00	14	1.70	310.65	-	-	
中 信 证 券	20230412000 20350	华 友 钴 业	2023-04 -12	549,800.0 0	10,000. 00	14	1.70	363.48	-	-	
中 信 证 券	20230412000 20352	盛 新 锂 能	2023-04 -12	345,300.0 0	10,000. 00	14	1.70	228.28	-	-	
中 信 证 券	20230412000 21666	国 轩 高 科	2023-04 -12	282,100.0 0	10,000. 00	28	1.80	394.94	-	-	
中 信 证 券	20230412000 21672	恩 捷 股 份	2023-04 -12	3,467,100. 00	30,000. 00	28	1.80	4,853. 94	-	-	
中 信 证 券	20230412000 22582	赣 锋 锂 业	2023-04 -12	659,400.0 0	10,000. 00	14	1.70	435.94	-	-	
中	20230412000	天	2023-04	7,849,000.	100,000	14	1.70	5,189.	-	-	

信 证 券	22630	齐 锂 业	-12	00	.00			06		
中 信 证 券	20230412000 23116	盛 新 锂 能	2023-04 -12	1,933,680. 00	56,000. 00	14	1.70	1,278. 38	-	-
中 信 证 券	20230412000 23156	三 花 智 控	2023-04 -12	348,912.0 0	14,400. 00	14	1.70	230.67	-	-
中 信 证 券	20230412000 26018	特 锐 德	2023-04 -12	367,422.0 0	20,900. 00	14	3.10	442.95	-	-
中 信 证 券	20230412000 26022	中 科 电 气	2023-04 -12	1,599,341. 00	98,300. 00	14	2.70	1,679. 31	-	-
中 信 证 券	20230412000 26042	先 导 智 能	2023-04 -12	7,512,000. 00	200,000 .00	14	5.90	17,235 .87	-	-
中 信 证 券	20230412000 26050	星 源 材 质	2023-04 -12	757,200.0 0	40,000. 00	14	3.30	971.74	-	-
中 信 证 券	20230412000 26080	中 科 电 气	2023-04 -12	35,794.00	2,200.0 0	14	2.70	37.58	-	-
中 信 证 券	20230412000 26094	容 百 科 技	2023-04 -12	701,000.0 0	10,000. 00	14	3.10	845.09	-	-
中 信 证 券	20230412000 26100	嘉 元 科 技	2023-04 -12	73,491.00	1,700.0 0	14	3.60	102.89	-	-
中 信 证 券	20230412000 26110	先 导 智 能	2023-04 -12	1,934,340. 00	51,500. 00	14	5.90	4,438. 24	-	-
中	20230412000	星	2023-04	6,864,018.	362,600	14	3.30	8,808.	-	-

信 证 券	26118	源 材 质	-12	00	.00			82		
中 信 证 券	20230412000 29426	瑞 泰 新 材	2023-04 -12	87,357.00	3,700.0 0	14	3.40	115.51	-	-
中 信 证 券	20230413000 04195	孚 能 科 技	2023-04 -13	695,020.0 0	31,000. 00	14	3.20	864.91	-	-
中 信 证 券	20230413000 04198	天 赐 材 料	2023-04 -13	41,790.00	1,000.0 0	14	3.20	52.01	-	-
中 信 证 券	20230413000 04199	天 齐 锂 业	2023-04 -13	76,910.00	1,000.0 0	14	3.20	95.71	-	-
中 信 证 券	20230413000 04203	星 源 材 质	2023-04 -13	989,691.0 0	53,700. 00	14	3.00	1,154. 64	-	-
中 信 证 券	20230413000 04238	诺 德 股 份	2023-04 -13	75,175.00	9,700.0 0	14	3.20	93.55	-	-
中 信 证 券	20230413000 04249	多 氟 多	2023-04 -13	422,604.0 0	12,900. 00	14	3.20	525.91	-	-
中 信 证 券	20230413000 04260	赣 锋 锂 业	2023-04 -13	97,785.00	1,500.0 0	14	3.20	121.69	-	-
中 信 证 券	20230413000 04261	多 氟 多	2023-04 -13	429,156.0 0	13,100. 00	14	3.20	534.06	-	-
中 信 证 券	20230413000 04276	瑞 泰 新 材	2023-04 -13	649,040.0 0	28,000. 00	14	3.50	883.42	-	-
中	20230413000	雅	2023-04	305,520.0	15,200.	14	3.20	380.20	-	-

信 证 券	04278	化 集 团	-13	0	00					
中 信 证 券	20230413000 04279	容 百 科 技	2023-04 -13	137,700.0 0	2,000.0 0	14	2.70	144.59	-	-
中 信 证 券	20230413000 04343	杭 可 科 技	2023-04 -13	176,040.0 0	4,000.0 0	14	3.20	219.07	-	-
中 信 证 券	20230413000 04375	三 花 智 控	2023-04 -13	342,720.0 0	14,400. 00	14	3.20	426.50	-	-
中 信 证 券	20230413000 04468	华 友 钴 业	2023-04 -13	539,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	670.76	-	-
中 信 证 券	20230413000 07315	龙 蟠 科 技	2023-04 -13	208,700.0 0	10,000. 00	14	1.70	137.97	-	-
中 信 证 券	20230413000 08419	格 林 美	2023-04 -13	370,000.0 0	50,000. 00	14	1.70	244.61	-	-
中 信 证 券	20230413000 09571	盛 新 锂 能	2023-04 -13	337,200.0 0	10,000. 00	14	1.70	222.93	-	-
中 信 证 券	20230413000 10175	赣 锋 锂 业	2023-04 -13	651,900.0 0	10,000. 00	14	1.70	430.98	-	-
中 信 证 券	20230413000 15597	星 源 材 质	2023-04 -13	1,843,000. 00	100,000 .00	14	3.00	2,150. 17	-	-
中 信 证 券	20230413000 15971	中 科 电 气	2023-04 -13	623,687.0 0	39,700. 00	14	2.70	654.87	-	-
中	20230418000	西	2023-04	188,190.0	5,100.0	14	3.30	276.01	-	-

信 证 券	05974	藏 矿 业	-18	0	0						
中 信 证 券	20230418000 06146	天 齐 锂 业	2023-04 -18	133,200.0 0	1,600.0 0	14	3.20	189.44	-	-	
中 信 证 券	20230418000 06222	恩 捷 股 份	2023-04 -18	11,820,00 0.00	100,000 .00	14	3.60	18,912 .00	-	-	
中 信 证 券	20230418000 06299	天 齐 锂 业	2023-04 -18	83,250.00	1,000.0 0	14	3.20	118.40	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07311	嘉 元 科 技	2023-04 -18	44,320.00	1,000.0 0	14	3.50	68.94	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07313	星 源 材 质	2023-04 -18	1,278,176. 00	67,700. 00	14	3.00	1,704. 23	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07331	中 科 电 气	2023-04 -18	924,540.0 0	57,000. 00	14	2.70	1,109. 45	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07363	赣 锋 锂 业	2023-04 -18	701,100.0 0	10,000. 00	14	3.20	997.12	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07367	三 花 智 控	2023-04 -18	351,072.0 0	14,400. 00	14	3.20	499.30	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07401	星 源 材 质	2023-04 -18	981,760.0 0	52,000. 00	14	3.00	1,309. 01	-	-	
中 信 证 券	20230418000 07421	天 赐 材 料	2023-04 -18	2,230,500. 00	50,000. 00	14	3.20	3,172. 27	-	-	
中	20230418000	特	2023-04	27,594.00	1,400.0	14	3.30	40.47	-	-	

信 证 券	07495	锐 德	-18		0						
中 信 证 券	20230418000 08009	盛 新 锂 能	2023-04 -18	357,800.0 0	10,000. 00	14	3.20	508.87	-	-	
中 信 证 券	20230418000 09053	龙 蟠 科 技	2023-04 -18	214,500.0 0	10,000. 00	14	3.20	305.07	-	-	
中 信 证 券	20230418000 09749	盛 新 锂 能	2023-04 -18	787,160.0 0	22,000. 00	14	2.90	1,014. 56	-	-	
中 信 证 券	20230418000 10333	华 友 钴 业	2023-04 -18	560,600.0 0	10,000. 00	14	3.20	797.30	-	-	
中 信 证 券	202304180001 1531	华 友 钴 业	2023-04 -18	2,769,364. 00	49,400. 00	14	3.20	3,938. 65	-	-	
中 信 证 券	20230418000 12043	雅 化 集 团	2023-04 -18	1,282,800. 00	60,000. 00	14	2.80	1,596. 37	-	-	
中 信 证 券	20230418000 12103	恩 捷 股 份	2023-04 -18	1,182,000. 00	10,000. 00	14	3.60	1,891. 20	-	-	
中 信 证 券	20230419000 04962	腾 远 钴 业	2023-04 -19	546,940.0 0	9,200.0 0	28	3.10	1,318. 73	-	-	
中 信 证 券	20230420000 03689	天 华 新 能	2023-04 -20	83,216.00	1,600.0 0	14	3.10	100.32	-	-	
中 信 证 券	20230420000 03710	雅 化 集 团	2023-04 -20	397,118.0 0	19,400. 00	14	2.80	432.42	-	-	
中	20230420000	寒	2023-04	543,650.0	13,100.	14	2.50	528.55	-	-	

信 证 券	03719	锐 钻 业	-20	0	00						
中 信 证 券	20230420000 03786	容 百 科 技	2023-04 -20	20,223,00 0.00	300,000 .00	28	3.10	48,759 .90	-	-	
中 信 证 券	20230420000 06869	三 花 智 控	2023-04 -20	1,174,500. 00	50,000. 00	14	3.20	1,461. 60	-	-	
中 信 证 券	20230420000 06871	三 花 智 控	2023-04 -20	338,256.0 0	14,400. 00	14	3.20	420.94	-	-	
中 信 证 券	20230420000 06879	雅 化 集 团	2023-04 -20	204,700.0 0	10,000. 00	14	3.20	254.74	-	-	
中 信 证 券	20230420000 06943	杭 可 科 技	2023-04 -20	289,315.0 0	6,500.0 0	14	3.20	360.04	-	-	
中 信 证 券	20230420000 06991	天 赐 材 料	2023-04 -20	4,215,000. 00	100,000 .00	14	3.20	5,245. 33	-	-	
中 信 证 券	20230420000 09929	西 藏 矿 业	2023-04 -20	354,600.0 0	10,000. 00	14	3.20	441.28	-	-	
中 信 证 券	20230420000 09941	恩 捷 股 份	2023-04 -20	4,759,103. 00	43,300. 00	14	3.20	5,922. 44	-	-	
中 信 证 券	20230420000 09965	先 导 智 能	2023-04 -20	164,516.0 0	4,400.0 0	14	3.50	223.92	-	-	
中 信 证 券	20230420000 09999	盛 新 锂 能	2023-04 -20	847,210.0 0	24,500. 00	14	3.20	1,054. 31	-	-	
中	20230420000	振	2023-04	95,914.00	2,600.0	14	4.00	149.20	-	-	

信 证 券	10037	华 新 材	-20		0					
中 信 证 券	20230420000 10073	瑞 泰 新 材	2023-04 -20	84,492.00	3,600.0 0	14	3.50	115.00	-	-
中 信 证 券	20230420000 10515	三 花 智 控	2023-04 -20	338,256.0 0	14,400. 00	14	3.20	420.94	-	-
中 信 证 券	20230420000 10543	盛 新 锂 能	2023-04 -20	345,800.0 0	10,000. 00	14	3.20	430.33	-	-
中 信 证 券	20230420000 10677	天 齐 锂 业	2023-04 -20	800,200.0 0	10,000. 00	14	3.20	995.80	-	-
中 信 证 券	20230420000 10679	天 齐 锂 业	2023-04 -20	800,200.0 0	10,000. 00	14	3.20	995.80	-	-
中 信 证 券	20230420000 10707	中 科 电 气	2023-04 -20	31,240.00	2,000.0 0	14	2.70	32.80	-	-
中 信 证 券	20230420000 10713	先 导 智 能	2023-04 -20	1,925,585. 00	51,500. 00	14	3.50	2,620. 94	-	-
中 信 证 券	20230420000 10787	璞 泰 来	2023-04 -20	2,930,182. 00	56,600. 00	14	3.20	3,646. 45	-	-
中 信 证 券	20230420000 10789	华 友 钴 业	2023-04 -20	549,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	683.20	-	-
中 信 证 券	20230420000 10821	格 林 美	2023-04 -20	73,200.00	10,000. 00	14	3.20	91.09	-	-
中	202304200001	西	2023-04	354,600.0	10,000.	14	3.20	441.28	-	-

信 证 券	1273	藏 矿 业	-20	0	00						
中 信 证 券	202304200001 1499	格 林 美	2023-04 -20	125,172.0 0	17,100. 00	14	3.20	155.77	-	-	
中 信 证 券	20230420000 12093	嘉 元 科 技	2023-04 -20	41,460.00	1,000.0 0	14	3.70	59.66	-	-	
中 信 证 券	20230420000 13173	盛 新 锂 能	2023-04 -20	1,013,194. 00	29,300. 00	14	3.20	1,260. 86	-	-	
中 信 证 券	20230420000 13719	瑞 泰 新 材	2023-04 -20	86,839.00	3,700.0 0	14	3.50	118.20	-	-	
中 信 证 券	20230420000 13745	诺 德 股 份	2023-04 -20	74,100.00	10,000. 00	14	3.20	92.21	-	-	
中 信 证 券	20230420000 13781	华 友 钴 业	2023-04 -20	549,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	683.20	-	-	
中 信 证 券	20230421000 02439	多 氟 多	2023-04 -21	3,298,000. 00	100,000 .00	28	2.90	7,438. 82	-	-	
中 信 证 券	20230424000 07991	盛 新 锂 能	2023-04 -24	379,287.0 0	11,100. 00	14	2.90	427.75	-	-	
中 信 证 券	20230424000 25125	西 藏 矿 业	2023-04 -24	351,800.0 0	10,000. 00	14	3.30	451.48	-	-	
中 信 证 券	20230424000 30671	法 拉 电 子	2023-04 -24	1,372,000. 00	10,000. 00	14	1.20	640.27	-	-	
中	20230424000	星	2023-04	1,731,000.	100,000	14	2.80	1,884.	-	-	

信 证 券	40501	源 材 质	-24	00	.00			87		
中 信 证 券	20230424000 44733	星 源 材 质	2023-04 -24	1,731,000. 00	100,000 .00	14	1.80	1,211.7 0	-	-
中 信 证 券	20230424000 45213	天 齐 锂 业	2023-04 -24	22,806,00 0.00	300,000 .00	14	3.20	28,380 .80	-	-
中 信 证 券	20230424000 50693	孚 能 科 技	2023-04 -24	2,070,000. 00	100,000 .00	14	3.00	2,415. 00	-	-
中 信 证 券	20230424000 55157	星 源 材 质	2023-04 -24	1,294,788. 00	74,800. 00	14	2.80	1,409. 88	-	-
中 信 证 券	20230424000 57563	先 导 智 能	2023-04 -24	3,592,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,514. 40	-	-
中 信 证 券	20230425000 04467	天 齐 锂 业	2023-04 -25	70,070.00	1,000.0 0	14	3.00	81.75	-	-
中 信 证 券	20230425000 04482	寒 锐 钻 业	2023-04 -25	1,535,460. 00	47,100. 00	14	2.50	1,492. 81	-	-
中 信 证 券	20230425000 48979	多 氟 多	2023-04 -25	646,912.0 0	30,400. 00	14	3.00	754.73	-	-
中 信 证 券	20230425000 49361	中 国 宝 安	2023-04 -25	268,842.0 0	25,900. 00	14	2.10	219.55	-	-
中 信 证 券	20230425000 50961	天 齐 锂 业	2023-04 -25	700,700.0 0	10,000. 00	14	3.20	871.98	-	-
中	20230425000	三	2023-04	423,256.0	19,100.	14	3.10	510.26	-	-

信 证 券	53641	花 智 控	-25	0	00					
中 信 证 券	20230425000 53805	西 藏 矿 业	2023-04 -25	330,200.0 0	10,000. 00	14	3.30	423.76	-	-
中 信 证 券	20230425000 55451	华 友 钴 业	2023-04 -25	468,700.0 0	10,000. 00	14	4.20	765.54	-	-
中 信 证 券	20230425000 55935	德 方 纳 米	2023-04 -25	402,168.0 0	2,400.0 0	14	3.20	500.48	-	-
中 信 证 券	20230425000 60147	杭 可 科 技	2023-04 -25	1,488,750. 00	37,500. 00	14	3.40	1,968. 46	-	-
中 信 证 券	20230425000 63501	三 花 智 控	2023-04 -25	319,104.0 0	14,400. 00	14	3.10	384.70	-	-
中 信 证 券	20230425000 66043	雅 化 集 团	2023-04 -25	183,500.0 0	10,000. 00	14	2.80	199.81	-	-
中 信 证 券	20230425000 66097	中 科 电 气	2023-04 -25	193,185.0 0	15,900. 00	14	3.10	232.90	-	-
中 信 证 券	20230425000 67615	容 百 科 技	2023-04 -25	620,400.0 0	10,000. 00	14	3.20	772.05	-	-
中 信 证 券	20230426000 07352	诺 德 股 份	2023-04 -26	7,180.00	1,000.0 0	14	3.30	9.21	-	-
中 信 证 券	20230426000 12498	西 藏 矿 业	2023-04 -26	341,000.0 0	10,000. 00	14	3.10	411.09	-	-
中	20230426000	嘉	2023-04	65,433.00	1,700.0	14	3.70	94.15	-	-

信 证 券	14828	元 科 技	-26		0					
中 信 证 券	20230426000 14858	盛 新 锂 能	2023-04 -26	325,100.0 0	10,000. 00	14	2.90	366.64	-	-
中 信 证 券	20230426000 14908	华 友 钴 业	2023-04 -26	503,000.0 0	10,000. 00	14	4.20	821.57	-	-
中 信 证 券	20230426000 14912	容 百 科 技	2023-04 -26	647,100.0 0	10,000. 00	14	3.20	805.28	-	-
中 信 证 券	20230426000 15004	天 赐 材 料	2023-04 -26	42,000.00	1,000.0 0	14	3.20	52.27	-	-
中 信 证 券	20230426000 17434	瑞 泰 新 材	2023-04 -26	80,623.00	3,700.0 0	14	3.40	106.60	-	-
中 信 证 券	20230426000 20068	赣 锋 锂 业	2023-04 -26	638,600.0 0	10,000. 00	14	3.10	769.87	-	-
中 信 证 券	20230426000 20232	盛 新 锂 能	2023-04 -26	1,820,560. 00	56,000. 00	14	2.90	2,053. 19	-	-
中 信 证 券	20230426000 21994	特 锐 德	2023-04 -26	387,695.0 0	20,900. 00	14	1.30	196.00	-	-
中 信 证 券	20230426000 24716	璞 泰 来	2023-04 -26	1,521,000. 00	30,000. 00	14	3.30	1,951. 95	-	-
中 信 证 券	20230426000 24882	先 导 智 能	2023-04 -26	7,300,000. 00	200,000 .00	14	3.30	9,368. 33	-	-
中	20230426000	中	2023-04	1,218,920.	98,300.	14	3.10	1,469.	-	-

信 证 券	24906	科 电 气	-26	00	00			48		
中 信 证 券	20230426000 24908	中 科 电 气	2023-04 -26	27,280.00	2,200.0 0	14	3.10	32.89	-	-
中 信 证 券	20230426000 25394	厦 门 钨 业	2023-04 -26	445,510.0 0	23,000. 00	14	1.60	277.21	-	-
中 信 证 券	20230426000 25640	三 花 智 控	2023-04 -26	337,968.0 0	14,400. 00	14	3.10	407.44	-	-
中 信 证 券	20230426000 28906	天 齐 锂 业	2023-04 -26	713,000.0 0	10,000. 00	28	3.10	1,719. 12	-	-
中 信 证 券	20230426000 28914	天 齐 锂 业	2023-04 -26	7,130,000. 00	100,000 .00	14	3.20	8,872. 89	-	-
中 信 证 券	20230426000 28930	三 花 智 控	2023-04 -26	337,968.0 0	14,400. 00	14	3.10	407.44	-	-
中 信 证 券	20230427000 07946	多 氟 多	2023-04 -27	278,769.0 0	12,900. 00	14	2.80	303.55	-	-
中 信 证 券	20230427000 10942	华 友 钴 业	2023-04 -27	497,200.0 0	10,000. 00	14	4.20	812.09	-	-
中 信 证 券	202304270001 1036	中 科 电 气	2023-04 -27	486,325.0 0	39,700. 00	14	3.10	586.29	-	-
中 信 证 券	202304270001 1750	天 齐 锂 业	2023-04 -27	70,860.00	1,000.0 0	14	3.20	88.18	-	-
中	20230427000	星	2023-04	944,046.0	53,700.	14	2.80	1,027.	-	-

信 证 券	12300	源 材 质	-27	0	00			96		
中 信 证 券	20230427000 12464	赣 锋 锂 业	2023-04 -27	656,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	791.81	-	-
中 信 证 券	20230427000 15040	格 林 美	2023-04 -27	344,500.0 0	50,000. 00	14	1.10	147.37	-	-
中 信 证 券	20230427000 19470	赣 锋 锂 业	2023-04 -27	98,520.00	1,500.0 0	14	3.10	118.77	-	-
中 信 证 券	20230427000 20404	容 百 科 技	2023-04 -27	133,200.0 0	2,000.0 0	14	3.20	165.76	-	-
中 信 证 券	20230427000 20452	诺 德 股 份	2023-04 -27	69,646.00	9,700.0 0	14	3.30	89.38	-	-
中 信 证 券	20230427000 20500	雅 化 集 团	2023-04 -27	292,448.0 0	15,200. 00	14	2.80	318.44	-	-
中 信 证 券	20230427000 20540	三 花 智 控	2023-04 -27	335,808.0 0	14,400. 00	14	3.10	404.84	-	-
中 信 证 券	20230427000 20624	龙 蟠 科 技	2023-04 -27	194,200.0 0	10,000. 00	14	2.80	211.46	-	-
中 信 证 券	20230427000 20694	杭 可 科 技	2023-04 -27	200,680.0 0	4,000.0 0	14	3.40	265.34	-	-
中 信 证 券	20230504000 07043	西 藏 矿 业	2023-05 -04	401,624.0 0	12,200. 00	28	3.00	937.12	-	-
中	20230504000	西	2023-05	138,264.0	4,200.0	28	3.00	322.62	-	-

信 证 券	07048	藏 矿 业	-04	0	0						
中 信 证 券	20230504000 07051	三 花 智 控	2023-05 -04	2,383,000. 00	100,000 .00	14	3.10	2,872. 84	-	-	
中 信 证 券	20230504000 07095	西 藏 矿 业	2023-05 -04	395,040.0 0	12,000. 00	28	3.00	921.76	-	-	
中 信 证 券	20230504000 07106	多 氟 多	2023-05 -04	1,999,000. 00	100,000 .00	14	2.80	2,176. 69	-	-	
中 信 证 券	20230504000 13325	盛 新 锂 能	2023-05 -04	314,500.0 0	10,000. 00	14	2.60	317.99	-	-	
中 信 证 券	20230504000 14017	星 源 材 质	2023-05 -04	1,379,200. 00	80,000. 00	28	1.80	1,930. 88	-	-	
中 信 证 券	20230504000 14113	盛 新 锂 能	2023-05 -04	921,485.0 0	29,300. 00	14	2.60	931.72	-	-	
中 信 证 券	20230504000 14115	盛 新 锂 能	2023-05 -04	770,525.0 0	24,500. 00	14	2.60	779.09	-	-	
中 信 证 券	20230504000 15283	恩 捷 股 份	2023-05 -04	4,416,600. 00	43,300. 00	14	3.60	6,183. 24	-	-	
中 信 证 券	20230504000 15309	三 花 智 控	2023-05 -04	343,152.0 0	14,400. 00	14	3.10	413.69	-	-	
中 信 证 券	20230504000 15323	华 友 钴 业	2023-05 -04	2,549,040. 00	49,400. 00	14	4.30	4,262. 56	-	-	
中	20230504000	华	2023-05	516,000.0	10,000.	14	4.30	862.87	-	-	

信 证 券	15325	友 钴 业	-04	0	00						
中 信 证 券	20230504000 15587	恩 捷 股 份	2023-05 -04	10,200.00 0.00	100,000 .00	14	3.60	14,280 .00	-	-	
中 信 证 券	20230504000 17461	嘉 元 科 技	2023-05 -04	37,590.00	1,000.0 0	14	3.50	51.16	-	-	
中 信 证 券	20230504000 17533	诺 德 股 份	2023-05 -04	72,100.00	10,000. 00	14	3.10	86.92	-	-	
中 信 证 券	20230504000 20125	赣 锋 锂 业	2023-05 -04	647,300.0 0	10,000. 00	14	3.10	780.36	-	-	
中 信 证 券	20230504000 20243	西 藏 矿 业	2023-05 -04	329,200.0 0	10,000. 00	14	3.10	396.87	-	-	
中 信 证 券	20230504000 20267	三 花 智 控	2023-05 -04	1,191,500. 00	50,000. 00	14	3.10	1,436. 42	-	-	
中 信 证 券	20230504000 20269	三 花 智 控	2023-05 -04	343,152.0 0	14,400. 00	14	3.10	413.69	-	-	
中 信 证 券	20230504000 22351	盛 新 锂 能	2023-05 -04	314,500.0 0	10,000. 00	14	2.60	317.99	-	-	
中 信 证 券	20230504000 23347	瑞 泰 新 材	2023-05 -04	76,644.00	3,600.0 0	14	2.80	83.46	-	-	
中 信 证 券	20230504000 23349	瑞 泰 新 材	2023-05 -04	78,773.00	3,700.0 0	14	2.80	85.78	-	-	
中	20230504000	格	2023-05	68,200.00	10,000.	14	1.10	29.17	-	-	

信 证 券	24099	林 美	-04		00					
中 信 证 券	20230504000 24101	格 林 美	2023-05 -04	116,622.0 0	17,100. 00	14	1.10	49.89	-	-
中 信 证 券	20230504000 24263	西 藏 矿 业	2023-05 -04	167,892.0 0	5,100.0 0	14	3.10	202.40	-	-
中 信 证 券	20230504000 26973	天 赐 材 料	2023-05 -04	2,125,000. 00	50,000. 00	14	3.10	2,561. 81	-	-
中 信 证 券	20230504000 27131	西 藏 矿 业	2023-05 -04	329,200.0 0	10,000. 00	14	3.10	396.87	-	-
中 信 证 券	20230504000 29191	杭 可 科 技	2023-05 -04	982,800.0 0	20,000. 00	28	1.80	1,375. 92	-	-
中 信 证 券	20230504000 31663	振 华 新 材	2023-05 -04	88,348.00	2,600.0 0	14	3.10	106.51	-	-
中 信 证 券	20230504000 31745	杭 可 科 技	2023-05 -04	319,410.0 0	6,500.0 0	14	4.10	509.28	-	-
中 信 证 券	20230504000 31763	特 锐 德	2023-05 -04	28,392.00	1,400.0 0	14	2.10	23.19	-	-
中 信 证 券	20230504000 31809	华 友 钴 业	2023-05 -04	516,000.0 0	10,000. 00	14	4.30	862.87	-	-
中 信 证 券	20230504000 34047	华 友 钴 业	2023-05 -04	516,000.0 0	10,000. 00	14	4.30	862.87	-	-
中	20230504000	雅	2023-05	1,124,400.	60,000.	14	2.50	1,093.	-	-

信 证 券	34111	化 集 团	-04	00	00			17		
中 信 证 券	20230504000 34113	星 源 材 质	2023-05 -04	896,480.0 0	52,000. 00	14	2.70	941.30	-	-
中 信 证 券	20230504000 39947	三 花 智 控	2023-05 -04	343,152.0 0	14,400. 00	14	3.10	413.69	-	-
中 信 证 券	20230504000 39973	天 赐 材 料	2023-05 -04	4,250,000. 00	100,000 .00	14	3.10	5,123. 61	-	-
中 信 证 券	20230504000 41183	天 华 新 能	2023-05 -04	77,888.00	1,600.0 0	14	3.00	90.87	-	-
中 信 证 券	20230504000 42639	雅 化 集 团	2023-05 -04	187,400.0 0	10,000. 00	14	2.50	182.19	-	-
中 信 证 券	20230504000 44995	璞 泰 来	2023-05 -04	2,886,600. 00	56,600. 00	14	3.20	3,592. 21	-	-
中 信 证 券	20230504000 48607	盛 新 锂 能	2023-05 -04	691,900.0 0	22,000. 00	14	2.60	699.59	-	-
中 信 证 券	20230504000 51657	恩 捷 股 份	2023-05 -04	1,020,000. 00	10,000. 00	14	3.60	1,428. 00	-	-
中 信 证 券	20230508000 08829	先 导 智 能	2023-05 -08	3,735,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,614. 50	-	-
中 信 证 券	20230508000 16665	孚 能 科 技	2023-05 -08	2,137,000. 00	100,000 .00	14	1.50	1,246. 58	-	-
中	20230508000	星	2023-05	1,718,000.	100,000	14	1.80	1,202.	-	-

信 证 券	22375	源 材 质	-08	00	.00			60		
中 信 证 券	20230508000 24827	法 拉 电 子	2023-05 -08	1,309,300. 00	10,000. 00	14	2.30	1,171. 10	-	-
中 信 证 券	20230508000 35697	西 藏 矿 业	2023-05 -08	323,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	390.36	-	-
中 信 证 券	20230509000 06586	杭 可 科 技	2023-05 -09	2,325,500. 00	50,000. 00	14	3.70	3,346. 14	-	-
中 信 证 券	20230509000 12615	华 友 钴 业	2023-05 -09	515,900.0 0	10,000. 00	14	4.30	862.70	-	-
中 信 证 券	20230509000 12647	德 方 纳 米	2023-05 -09	368,664.0 0	2,400.0 0	14	3.20	458.78	-	-
中 信 证 券	20230509000 12721	中 国 宝 安	2023-05 -09	273,245.0 0	25,900. 00	14	1.70	180.65	-	-
中 信 证 券	20230509000 14095	雅 化 集 团	2023-05 -09	180,600.0 0	10,000. 00	14	2.50	175.58	-	-
中 信 证 券	20230509000 15335	西 藏 矿 业	2023-05 -09	318,900.0 0	10,000. 00	14	3.10	384.45	-	-
中 信 证 券	20230509000 16961	多 氟 多	2023-05 -09	577,904.0 0	30,400. 00	14	2.80	629.27	-	-
中 信 证 券	20230509000 19377	三 花 智 控	2023-05 -09	325,872.0 0	14,400. 00	14	3.10	392.86	-	-
中	20230509000	天	2023-05	71,170.00	1,000.0	14	3.00	83.03	-	-

信 证 券	22473	齐 锂 业	-09		0						
中 信 证 券	20230509000 22843	三 花 智 控	2023-05 -09	432,233.0 0	19,100. 00	14	3.10	521.08	-	-	
中 信 证 券	20230509000 23117	中 科 电 气	2023-05 -09	196,047.0 0	15,900. 00	14	3.10	236.35	-	-	
中 信 证 券	20230509000 23301	容 百 科 技	2023-05 -09	646,800.0 0	10,000. 00	14	3.20	804.91	-	-	
中 信 证 券	20230509000 23363	杭 可 科 技	2023-05 -09	1,744,125. 00	37,500. 00	14	4.10	2,780. 91	-	-	
中 信 证 券	20230509000 26975	寒 锐 钻 业	2023-05 -09	1,560,894. 00	47,100. 00	14	2.50	1,517. 54	-	-	
中 信 证 券	20230510000 05062	先 导 智 能	2023-05 -10	3,721,000. 00	100,000 .00	28	3.50	10,129 .39	-	-	
中 信 证 券	20230510000 07842	赣 锋 锂 业	2023-05 -10	647,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	780.96	-	-	
中 信 证 券	20230510000 09126	中 科 电 气	2023-05 -10	1,233,665. 00	98,300. 00	14	3.10	1,487. 25	-	-	
中 信 证 券	20230510000 09128	中 科 电 气	2023-05 -10	27,610.00	2,200.0 0	14	3.10	33.29	-	-	
中 信 证 券	20230510000 12544	恩 捷 股 份	2023-05 -10	3,055,500. 00	30,000. 00	28	3.50	8,317. 75	-	-	
中	20230510000	国	2023-05	275,000.0	10,000.	28	2.30	491.94	-	-	

信 证 券	12858	轩 高 科	-10	0	00						
中 信 证 券	20230510000 15394	先 导 智 能	2023-05 -10	7,442,000. 00	200,000 .00	14	3.40	9,839. 98	-	-	
中 信 证 券	20230510000 15466	容 百 科 技	2023-05 -10	652,700.0 0	10,000. 00	14	3.20	812.25	-	-	
中 信 证 券	20230510000 16178	三 花 智 控	2023-05 -10	332,352.0 0	14,400. 00	14	3.10	400.67	-	-	
中 信 证 券	20230510000 18104	特 锐 德	2023-05 -10	464,607.0 0	20,900. 00	14	2.10	379.43	-	-	
中 信 证 券	20230510000 18118	盛 新 锂 能	2023-05 -10	309,700.0 0	10,000. 00	14	2.60	313.14	-	-	
中 信 证 券	20230510000 18166	天 齐 锂 业	2023-05 -10	7,491,000. 00	100,000 .00	14	3.00	8,739. 50	-	-	
中 信 证 券	20230510000 18212	国 轩 高 科	2023-05 -10	275,000.0 0	10,000. 00	28	2.30	491.94	-	-	
中 信 证 券	20230510000 19056	厦 门 钨 业	2023-05 -10	447,120.0 0	23,000. 00	14	1.20	208.66	-	-	
中 信 证 券	20230510000 20688	盛 新 锂 能	2023-05 -10	1,734,320. 00	56,000. 00	14	2.60	1,753. 59	-	-	
中 信 证 券	20230510000 23978	三 花 智 控	2023-05 -10	332,352.0 0	14,400. 00	14	3.10	400.67	-	-	
中	20230510000	华	2023-05	522,400.0	10,000.	14	4.30	873.57	-	-	

信 证 券	25456	友 钴 业	-10	0	00						
中 信 证 券	20230510000 26260	璞 泰 来	2023-05 -10	1,091,400. 00	30,000. 00	14	3.20	1,358. 19	-	-	
中 信 证 券	20230510000 29250	瑞 泰 新 材	2023-05 -10	78,144.00	3,700.0 0	14	2.80	85.09	-	-	
中 信 证 券	20230510000 29326	嘉 元 科 技	2023-05 -10	64,855.00	1,700.0 0	14	3.50	88.27	-	-	
中 信 证 券	202305110000 5376	璞 泰 来	2023-05 -11	371,700.0 0	10,000. 00	14	3.20	462.56	-	-	
中 信 证 券	202305110001 2897	龙 蟠 科 技	2023-05 -11	188,500.0 0	10,000. 00	14	2.90	212.59	-	-	
中 信 证 券	202305110001 2957	三 花 智 控	2023-05 -11	337,248.0 0	14,400. 00	14	3.10	406.57	-	-	
中 信 证 券	202305110001 4129	星 源 材 质	2023-05 -11	951,027.0 0	53,700. 00	14	3.10	1,146. 52	-	-	
中 信 证 券	202305110001 4701	赣 锋 锂 业	2023-05 -11	657,600.0 0	10,000. 00	14	3.10	792.77	-	-	
中 信 证 券	202305110001 4717	格 林 美	2023-05 -11	342,500.0 0	50,000. 00	14	1.10	146.51	-	-	
中 信 证 券	202305110001 4739	华 友 钴 业	2023-05 -11	532,500.0 0	10,000. 00	14	4.30	890.46	-	-	
中	202305110001	诺	2023-05	71,198.00	9,700.0	14	2.70	74.76	-	-	

信 证 券	5057	德 股 份	-11		0						
中 信 证 券	202305110001 6531	中 科 电 气	2023-05 -11	506,572.0 0	39,700. 00	14	3.10	610.70	-	-	
中 信 证 券	202305110001 8505	容 百 科 技	2023-05 -11	132,960.0 0	2,000.0 0	14	3.20	165.46	-	-	
中 信 证 券	202305110001 8507	多 氟 多	2023-05 -11	261,225.0 0	12,900. 00	14	2.80	284.45	-	-	
中 信 证 券	202305110002 0891	雅 化 集 团	2023-05 -11	283,480.0 0	15,200. 00	14	2.50	275.61	-	-	
中 信 证 券	20230516000 02567	特 锐 德	2023-05 -16	23,300.00	1,000.0 0	14	2.80	25.37	-	-	
中 信 证 券	20230516000 02593	天 齐 锂 业	2023-05 -16	82,610.00	1,000.0 0	14	3.10	99.59	-	-	
中 信 证 券	20230516000 02595	当 升 科 技	2023-05 -16	54,740.00	1,000.0 0	14	2.60	55.35	-	-	
中 信 证 券	20230517000 03348	特 锐 德	2023-05 -17	579,328.0 0	24,800. 00	14	2.80	630.82	-	-	
中 信 证 券	20230517000 03354	天 华 新 能	2023-05 -17	308,568.0 0	8,600.0 0	14	3.40	408.00	-	-	
中 信 证 券	20230517000 03371	天 华 新 能	2023-05 -17	86,112.00	2,400.0 0	14	3.40	113.86	-	-	
中	20230517000	厦	2023-05	25,727.00	1,300.0	14	1.10	11.01	-	-	

信 证 券	03493	门 钨 业	-17		0					
中 信 证 券	20230518000 03775	特 锐 德	2023-05 -18	583,575.0 0	25,100. 00	14	2.80	635.45	-	-
中 信 证 券	20230518000 03799	汇 川 技 术	2023-05 -18	20,709,50 0.00	350,000 .00	14	1.90	15,302 .02	-	-
中 信 证 券	20230518000 08178	三 花 智 控	2023-05 -18	1,281,500. 00	50,000. 00	14	3.10	1,544. 92	-	-
中 信 证 券	20230518000 08202	三 花 智 控	2023-05 -18	369,072.0 0	14,400. 00	14	3.10	444.94	-	-
中 信 证 券	20230518000 17268	三 花 智 控	2023-05 -18	2,563,000. 00	100,000 .00	14	3.10	3,089. 84	-	-
中 信 证 券	20230518000 17866	振 华 新 材	2023-05 -18	84,240.00	2,600.0 0	14	3.40	111.38	-	-
中 信 证 券	20230518000 18968	赣 锋 锂 业	2023-05 -18	679,400.0 0	10,000. 00	14	3.10	819.05	-	-
中 信 证 券	20230518000 19166	恩 捷 股 份	2023-05 -18	1,040,000. 00	10,000. 00	14	3.70	1,496. 44	-	-
中 信 证 券	20230518000 20310	璞 泰 来	2023-05 -18	2,112,878. 00	56,600. 00	14	3.20	2,629. 36	-	-
中 信 证 券	20230518000 20350	西 藏 矿 业	2023-05 -18	335,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	404.83	-	-
中	20230518000	三	2023-05	369,072.0	14,400.	14	3.10	444.94	-	-

信 证 券	20370	花 智 控	-18	0	00					
中 信 证 券	20230518000 20390	盛 新 锂 能	2023-05 -18	995,907.0 0	29,300. 00	14	3.20	1,239. 35	-	-
中 信 证 券	20230518000 20392	盛 新 锂 能	2023-05 -18	832,755.0 0	24,500. 00	14	3.20	1,036. 32	-	-
中 信 证 券	20230518000 27340	格 林 美	2023-05 -18	68,600.00	10,000. 00	14	2.20	58.69	-	-
中 信 证 券	20230518000 27342	格 林 美	2023-05 -18	117,306.0 0	17,100. 00	14	2.20	100.36	-	-
中 信 证 券	20230518000 27356	特 锐 德	2023-05 -18	32,550.00	1,400.0 0	14	3.10	39.24	-	-
中 信 证 券	20230518000 27512	容 百 科 技	2023-05 -18	18,927.00 0.00	300,000 .00	28	3.20	47,107 .20	-	-
中 信 证 券	20230518000 29054	华 友 钴 业	2023-05 -18	519,500.0 0	10,000. 00	14	3.80	767.71	-	-
中 信 证 券	20230518000 29100	恩 捷 股 份	2023-05 -18	10,400.00 0.00	100,000 .00	14	3.70	14,964 .44	-	-
中 信 证 券	20230518000 29134	多 氟 多	2023-05 -18	2,089,000. 00	100,000 .00	14	3.00	2,437. 17	-	-
中 信 证 券	20230518000 29192	华 友 钴 业	2023-05 -18	2,566,330. 00	49,400. 00	14	3.80	3,792. 47	-	-
中	20230518000	华	2023-05	519,500.0	10,000.	14	3.80	767.71	-	-

信 证 券	29194	友 钴 业	-18	0	00						
中 信 证 券	20230518000 29226	盛 新 锂 能	2023-05 -18	339,900.0 0	10,000. 00	14	3.20	422.99	-	-	
中 信 证 券	20230518000 30706	杭 可 科 技	2023-05 -18	279,695.0 0	6,500.0 0	14	3.70	402.45	-	-	
中 信 证 券	20230518000 30716	雅 化 集 团	2023-05 -18	1,143,600. 00	60,000. 00	14	2.60	1,156. 31	-	-	
中 信 证 券	20230518000 30746	三 花 智 控	2023-05 -18	369,072.0 0	14,400. 00	14	3.10	444.94	-	-	
中 信 证 券	20230518000 30770	天 赐 材 料	2023-05 -18	2,242,500. 00	50,000. 00	14	3.10	2,703. 46	-	-	
中 信 证 券	20230518000 30800	西 藏 矿 业	2023-05 -18	171,258.0 0	5,100.0 0	14	3.10	206.46	-	-	
中 信 证 券	20230518000 31664	天 赐 材 料	2023-05 -18	4,485,000. 00	100,000 .00	14	3.10	5,406. 92	-	-	
中 信 证 券	20230518000 32578	西 藏 矿 业	2023-05 -18	335,800.0 0	10,000. 00	14	3.10	404.83	-	-	
中 信 证 券	20230518000 32820	盛 新 锂 能	2023-05 -18	339,900.0 0	10,000. 00	14	3.20	422.99	-	-	
中 信 证 券	20230518000 32922	恩 捷 股 份	2023-05 -18	4,503,200. 00	43,300. 00	14	3.70	6,479. 60	-	-	
中	20230518000	嘉	2023-05	37,770.00	1,000.0	14	3.20	47.00	-	-	

信 证 券	32946	元 科 技	-18		0					
中 信 证 券	20230518000 33572	天 华 新 能	2023-05 -18	59,056.00	1,600.0 0	14	3.40	78.09	-	-
中 信 证 券	20230518000 35738	华 友 钴 业	2023-05 -18	519,500.0 0	10,000. 00	14	3.80	767.71	-	-
中 信 证 券	20230518000 35764	雅 化 集 团	2023-05 -18	190,600.0 0	10,000. 00	14	2.60	192.72	-	-
中 信 证 券	20230518000 37598	盛 新 锂 能	2023-05 -18	747,780.0 0	22,000. 00	14	3.20	930.57	-	-
中 信 证 券	20230522000 14974	先 导 智 能	2023-05 -22	3,630,000. 00	100,000 .00	14	1.80	2,541. 00	-	-
中 信 证 券	20230522000 24294	孚 能 科 技	2023-05 -22	2,181,000. 00	100,000 .00	14	2.40	2,035. 60	-	-
中 信 证 券	20230522000 34460	西 藏 矿 业	2023-05 -22	334,500.0 0	10,000. 00	14	3.10	403.26	-	-
中 信 证 券	20230523000 05166	中 科 电 气	2023-05 -23	351,540.0 0	27,000. 00	14	2.70	369.12	-	-
中 信 证 券	20230523000 05174	科 达 利	2023-05 -23	2,922,638. 00	22,300. 00	14	3.00	3,409. 74	-	-
中 信 证 券	20230523000 05205	科 达 利	2023-05 -23	1,467,872. 00	11,200. 00	14	3.00	1,712. 52	-	-
中	20230523000	天	2023-05	68,530.00	1,400.0	14	3.00	79.95	-	-

信 证 券	05334	奈 科 技	-23		0						
中 信 证 券	20230523000 10602	三 花 智 控	2023-05 -23	367,344.0 0	14,400. 00	14	3.10	442.85	-	-	
中 信 证 券	20230523000 10612	德 方 纳 米	2023-05 -23	410,400.0 0	2,400.0 0	14	3.10	494.76	-	-	
中 信 证 券	20230523000 13894	西 藏 矿 业	2023-05 -23	335,500.0 0	10,000. 00	14	3.10	404.46	-	-	
中 信 证 券	20230523000 15548	三 花 智 控	2023-05 -23	487,241.0 0	19,100. 00	14	3.10	587.40	-	-	
中 信 证 券	20230523000 18900	寒 锐 钻 业	2023-05 -23	1,620,240. 00	47,100. 00	14	2.80	1,764. 26	-	-	
中 信 证 券	20230523000 18924	中 国 宝 安	2023-05 -23	291,375.0 0	25,900. 00	14	2.20	249.29	-	-	
中 信 证 券	20230523000 21036	中 科 电 气	2023-05 -23	207,018.0 0	15,900. 00	14	2.80	225.42	-	-	
中 信 证 券	20230523000 21040	杭 可 科 技	2023-05 -23	2,130,000. 00	50,000. 00	14	3.50	2,899. 17	-	-	
中 信 证 券	20230523000 21088	杭 可 科 技	2023-05 -23	1,597,500. 00	37,500. 00	14	3.50	2,174. 38	-	-	
中 信 证 券	20230523000 21534	雅 化 集 团	2023-05 -23	190,400.0 0	10,000. 00	14	2.60	192.52	-	-	
中	20230523000	容	2023-05	617,400.0	10,000.	14	3.20	768.32	-	-	

信 证 券	21542	百 科 技	-23	0	00						
中 信 证 券	20230523000 21588	多 氟 多	2023-05 -23	634,448.0 0	30,400. 00	14	2.90	715.52	-	-	
中 信 证 券	20230523000 24630	华 友 钴 业	2023-05 -23	498,900.0 0	10,000. 00	14	3.70	717.86	-	-	
中 信 证 券	20230524000 03290	中 科 电 气	2023-05 -24	351,152.0 0	27,200. 00	14	2.70	368.71	-	-	
中 信 证 券	20230524000 03307	利 元 亨	2023-05 -24	236,912.0 0	2,600.0 0	14	5.30	488.30	-	-	
中 信 证 券	20230524000 03326	多 氟 多	2023-05 -24	1,067,040. 00	51,300. 00	14	3.00	1,244. 88	-	-	
中 信 证 券	20230524000 03384	利 元 亨	2023-05 -24	346,256.0 0	3,800.0 0	14	5.30	713.67	-	-	
中 信 证 券	20230524000 03419	胜 华 新 材	2023-05 -24	294,096.0 0	4,400.0 0	14	2.10	240.18	-	-	
中 信 证 券	20230524000 05230	瑞 泰 新 材	2023-05 -24	80,401.00	3,700.0 0	14	3.10	96.93	-	-	
中 信 证 券	20230524000 05268	天 齐 锂 业	2023-05 -24	7,818,000. 00	100,000 .00	14	3.10	9,425. 03	-	-	
中 信 证 券	20230524000 08092	中 科 电 气	2023-05 -24	1,269,053. 00	98,300. 00	14	2.70	1,332. 51	-	-	
中	20230524000	中	2023-05	28,402.00	2,200.0	14	2.70	29.82	-	-	

信 证 券	08094	科 电 气	-24		0					
中 信 证 券	20230524000 08110	三 花 智 控	2023-05 -24	360,864.0 0	14,400. 00	14	3.10	435.04	-	-
中 信 证 券	20230524000 08146	三 花 智 控	2023-05 -24	360,864.0 0	14,400. 00	14	3.10	435.04	-	-
中 信 证 券	20230524000 08582	盛 新 锂 能	2023-05 -24	1,879,360. 00	56,000. 00	14	2.60	1,900. 24	-	-
中 信 证 券	20230524000 09770	赣 锋 锂 业	2023-05 -24	641,100.0 0	10,000. 00	14	3.10	772.88	-	-
中 信 证 券	20230524000 16694	特 锐 德	2023-05 -24	451,858.0 0	20,900. 00	14	2.80	492.02	-	-
中 信 证 券	20230524000 18642	盛 新 锂 能	2023-05 -24	335,600.0 0	10,000. 00	14	2.60	339.33	-	-
中 信 证 券	20230524000 21820	容 百 科 技	2023-05 -24	613,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	762.84	-	-
中 信 证 券	20230524000 23832	厦 门 钨 业	2023-05 -24	436,310.0 0	23,000. 00	14	1.10	186.64	-	-
中 信 证 券	20230524000 23918	华 友 钴 业	2023-05 -24	492,000.0 0	10,000. 00	14	3.70	707.93	-	-
中 信 证 券	20230524000 28994	嘉 元 科 技	2023-05 -24	64,226.00	1,700.0 0	14	3.30	82.42	-	-
中	20230525000	科	2023-05	13,401.00	100,000	14	3.00	15,634	-	-

信 证 券	04649	达 利	-25	0.00	.00			.50		
中 信 证 券	20230525000 04653	科 达 利	2023-05 -25	5,360,400. 00	40,000. 00	14	3.00	6,253. 80	-	-
中 信 证 券	20230525000 05824	三 花 智 控	2023-05 -25	371,088.0 0	14,400. 00	14	3.10	447.37	-	-
中 信 证 券	20230525000 08468	多 氟 多	2023-05 -25	264,579.0 0	12,900. 00	14	2.90	298.39	-	-
中 信 证 券	20230525000 16138	雅 化 集 团	2023-05 -25	283,176.0 0	15,200. 00	14	2.60	286.32	-	-
中 信 证 券	20230525000 17004	诺 德 股 份	2023-05 -25	69,064.00	9,700.0 0	14	3.20	85.95	-	-
中 信 证 券	20230525000 18124	星 源 材 质	2023-05 -25	916,659.0 0	53,700. 00	14	3.00	1,069. 44	-	-
中 信 证 券	20230525000 19466	龙 蟠 科 技	2023-05 -25	199,400.0 0	10,000. 00	14	3.00	232.63	-	-
中 信 证 券	20230525000 19506	格 林 美	2023-05 -25	334,500.0 0	50,000. 00	14	1.80	234.15	-	-
中 信 证 券	20230525000 22320	华 友 钴 业	2023-05 -25	486,700.0 0	10,000. 00	14	3.70	700.31	-	-
中 信 证 券	20230526000 03539	赣 锋 锂 业	2023-05 -26	30,775.00 0.00	500,000 .00	7	3.10	18,550 .49	-	-
中	20230530000	多	2023-05	2,935,674.	144,900	14	3.00	3,424.	-	-

信 证 券	17784	氟多	-30	00	.00			95		
中 信 证 券	20230530000 17793	天 奈 科 技	2023-05 -30	2,879,628. 00	63,400. 00	14	3.30	3,695. 52	-	-
中 信 证 券	20230530000 17877	天 奈 科 技	2023-05 -30	2,879,628. 00	63,400. 00	14	3.30	3,695. 52	-	-
中 信 证 券	20230531000 04234	三 花 智 控	2023-05 -31	25,990.00	1,000.0 0	14	3.10	31.33	-	-
中 信 证 券	20230531000 04308	天 华 新 能	2023-05 -31	481,824.0 0	14,400. 00	14	3.40	637.08	-	-
中 信 证 券	20230531000 04332	天 华 新 能	2023-05 -31	6,692,000. 00	200,000 .00	14	3.40	8,848. 31	-	-
中 信 证 券	20230531000 04339	天 奈 科 技	2023-05 -31	2,839,686. 00	63,400. 00	14	3.30	3,644. 26	-	-
中 信 证 券	20230531000 07755	天 华 新 能	2023-05 -31	287,756.0 0	8,600.0 0	7	3.40	190.24	-	-
中 信 证 券	20230531000 08754	天 华 新 能	2023-05 -31	80,304.00	2,400.0 0	7	3.50	54.65	-	-
中 信 证 券	20230601000 05095	华 友 钴 业	2023-06 -01	461,000.0 0	10,000. 00	14	3.20	573.69	-	-
中 信 证 券	20230601000 24987	振 华 新 材	2023-06 -01	78,936.00	2,600.0 0	7	3.60	55.26	-	-
中	20230601000	星	2023-06	1,292,000.	80,000.	7	1.80	452.20	-	-

信 证 券	25123	源 材 质	-01	00	00						
中 信 证 券	20230601000 25437	西 藏 矿 业	2023-06 -01	314,000.0 0	10,000. 00	7	3.20	195.38	-	-	
中 信 证 券	20230601000 27191	西 藏 矿 业	2023-06 -01	131,880.0 0	4,200.0 0	14	3.30	169.25	-	-	
中 信 证 券	20230601000 27245	三 花 智 控	2023-06 -01	2,512,000. 00	100,000 .00	7	3.10	1,514. 18	-	-	
中 信 证 券	20230601000 27570	杭 可 科 技	2023-06 -01	849,200.0 0	20,000. 00	7	1.80	297.22	-	-	
中 信 证 券	20230601000 28072	天 赐 材 料	2023-06 -01	4,210,000. 00	100,000 .00	7	3.10	2,537. 69	-	-	
中 信 证 券	20230601000 28156	西 藏 矿 业	2023-06 -01	383,080.0 0	12,200. 00	14	3.30	491.62	-	-	
中 信 证 券	20230601000 28157	西 藏 矿 业	2023-06 -01	376,800.0 0	12,000. 00	14	3.30	483.56	-	-	
中 信 证 券	20230601000 28685	汇 川 技 术	2023-06 -01	20,786,50 0.00	350,000 .00	7	2.50	10,104 .55	-	-	
中 信 证 券	20230601000 29069	璞 泰 来	2023-06 -01	1,991,754. 00	56,600. 00	7	3.20	1,239. 31	-	-	
中 信 证 券	20230601000 29285	盛 新 锂 能	2023-06 -01	304,900.0 0	10,000. 00	7	3.10	183.79	-	-	
中	20230601000	华	2023-06	461,000.0	10,000.	7	3.50	313.74	-	-	

信 证 券	29493	友 钴 业	-01	0	00						
中 信 证 券	20230601000 30008	盛 新 锂 能	2023-06 -01	893,357.0 0	29,300. 00	7	3.00	521.12	-	-	
中 信 证 券	20230601000 30205	恩 捷 股 份	2023-06 -01	915,800.0 0	10,000. 00	7	3.60	641.06	-	-	
中 信 证 券	20230601000 30794	盛 新 锂 能	2023-06 -01	670,780.0 0	22,000. 00	7	3.10	404.33	-	-	
中 信 证 券	20230601000 31009	三 花 智 控	2023-06 -01	361,728.0 0	14,400. 00	7	3.20	225.08	-	-	
中 信 证 券	20230601000 31150	三 花 智 控	2023-06 -01	1,256,000. 00	50,000. 00	7	3.20	781.51	-	-	
中 信 证 券	20230601000 31440	盛 新 锂 能	2023-06 -01	304,900.0 0	10,000. 00	7	3.10	183.79	-	-	
中 信 证 券	20230601000 31544	华 友 钴 业	2023-06 -01	461,000.0 0	10,000. 00	7	3.50	313.74	-	-	
中 信 证 券	20230601000 31915	盛 新 锂 能	2023-06 -01	747,005.0 0	24,500. 00	7	3.10	450.28	-	-	
中 信 证 券	20230601000 32102	雅 化 集 团	2023-06 -01	1,081,200. 00	60,000. 00	7	2.70	567.63	-	-	
中 信 证 券	20230601000 32560	三 花 智 控	2023-06 -01	361,728.0 0	14,400. 00	7	3.20	225.08	-	-	
中	20230601000	天	2023-06	2,105,000.	50,000.	7	3.10	1,268.	-	-	

信 证 券	33244	赐 材 料	-01	00	00			85		
中 信 证 券	20230601000 33292	恩 捷 股 份	2023-06 -01	3,965,414. 00	43,300. 00	7	3.70	2,852. 90	-	-
中 信 证 券	20230601000 33420	西 藏 矿 业	2023-06 -01	160,140.0 0	5,100.0 0	7	3.40	105.87	-	-
中 信 证 券	20230601000 33662	赣 锋 锂 业	2023-06 -01	621,000.0 0	10,000. 00	7	3.10	374.33	-	-
中 信 证 券	20230601000 34262	雅 化 集 团	2023-06 -01	180,200.0 0	10,000. 00	7	2.70	94.61	-	-
中 信 证 券	20230601000 34665	嘉 元 科 技	2023-06 -01	25,640.00	1,000.0 0	7	3.40	16.95	-	-
中 信 证 券	20230601000 35031	杭 可 科 技	2023-06 -01	275,990.0 0	6,500.0 0	7	3.90	209.29	-	-
中 信 证 券	20230601000 35234	三 花 智 控	2023-06 -01	361,728.0 0	14,400. 00	7	3.20	225.08	-	-
中 信 证 券	20230601000 35529	格 林 美	2023-06 -01	67,600.00	10,000. 00	7	2.50	32.86	-	-
中 信 证 券	20230601000 35679	多 氟 多	2023-06 -01	1,992,000. 00	100,000 .00	7	3.10	1,200. 73	-	-
中 信 证 券	20230601000 36853	天 华 新 能	2023-06 -01	54,528.00	1,600.0 0	7	3.50	37.11	-	-
中	20230601000	华	2023-06	461,000.0	10,000.	7	3.50	313.74	-	-

信 证 券	37020	友 钴 业	-01	0	00						
中 信 证 券	20230601000 37163	华 友 钴 业	2023-06 -01	2,277,340. 00	49,400. 00	7	3.50	1,549. 86	-	-	
中 信 证 券	20230601000 37228	格 林 美	2023-06 -01	115,596.0 0	17,100. 00	7	2.50	56.19	-	-	
中 信 证 券	20230601000 37426	恩 捷 股 份	2023-06 -01	9,158,000. 00	100,000 .00	7	3.70	6,588. 67	-	-	
中 信 证 券	20230605000 19344	先 导 智 能	2023-06 -05	3,309,000. 00	100,000 .00	7	1.80	1,158. 15	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04927	天 齐 锂 业	2023-06 -06	74,480.00	1,000.0 0	14	3.10	89.79	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04929	盛 新 锂 能	2023-06 -06	218,460.0 0	6,600.0 0	14	2.80	237.88	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04936	中 伟 股 份	2023-06 -06	549,648.0 0	8,800.0 0	14	3.30	705.38	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04946	德 方 纳 米	2023-06 -06	832,500.0 0	7,400.0 0	14	2.90	938.88	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04957	三 花 智 控	2023-06 -06	24,870.00	1,000.0 0	14	3.10	29.98	-	-	
中 信 证 券	20230606000 04970	国 轩 高 科	2023-06 -06	160,491.0 0	6,100.0 0	14	2.90	181.00	-	-	
中	20230606000	三	2023-06	358,128.0	14,400.	7	3.10	215.87	-	-	

信 证 券	13944	花 智 控	-06	0	00						
中 信 证 券	20230606000 13949	德 方 纳 米	2023-06 -06	270,000.0 0	2,400.0 0	7	3.10	162.75	-	-	
中 信 证 券	20230606000 14368	雅 化 集 团	2023-06 -06	186,500.0 0	10,000. 00	7	2.50	90.66	-	-	
中 信 证 券	20230606000 14774	天 奈 科 技	2023-06 -06	64,064.00	1,400.0 0	7	3.30	41.11	-	-	
中 信 证 券	20230606000 15344	西 藏 矿 业	2023-06 -06	311,300.0 0	10,000. 00	7	3.20	193.70	-	-	
中 信 证 券	20230606000 15689	华 友 钻 业	2023-06 -06	476,000.0 0	10,000. 00	7	3.20	296.18	-	-	
中 信 证 券	20230606000 16211	三 花 智 控	2023-06 -06	475,017.0 0	19,100. 00	7	3.10	286.33	-	-	
中 信 证 券	20230606000 16484	中 科 电 气	2023-06 -06	328,860.0 0	27,000. 00	7	2.90	185.44	-	-	
中 信 证 券	20230606000 16521	中 国 宝 安	2023-06 -06	306,138.0 0	25,900. 00	7	2.60	154.77	-	-	
中 信 证 券	20230606000 16937	中 科 电 气	2023-06 -06	193,662.0 0	15,900. 00	7	2.80	105.44	-	-	
中 信 证 券	20230606000 17625	杭 可 科 技	2023-06 -06	2,103,500. 00	50,000. 00	7	3.80	1,554. 25	-	-	
中	20230606000	科	2023-06	1,404,480.	11,200.	7	3.20	873.90	-	-	

信 证 券	17644	达 利	-06	00	00						
中 信 证 券	20230606000 20364	多 氟 多	2023-06 -06	605,568.0 0	30,400. 00	7	3.00	353.25	-	-	
中 信 证 券	20230606000 21173	科 达 利	2023-06 -06	2,796,420. 00	22,300. 00	7	3.20	1,739. 99	-	-	
中 信 证 券	20230606000 21650	杭 可 科 技	2023-06 -06	1,577,625. 00	37,500. 00	7	3.90	1,196. 37	-	-	
中 信 证 券	20230607000 04921	特 锐 德	2023-06 -07	20,990.00	1,000.0 0	14	3.10	25.30	-	-	
中 信 证 券	20230607000 04932	特 锐 德	2023-06 -07	382,018.0 0	18,200. 00	14	3.10	460.54	-	-	
中 信 证 券	20230607000 04965	腾 远 钴 业	2023-06 -07	497,900.0 0	13,000. 00	14	3.20	619.61	-	-	
中 信 证 券	20230607000 04994	腾 远 钴 业	2023-06 -07	137,880.0 0	3,600.0 0	14	3.20	171.58	-	-	
中 信 证 券	20230607000 05389	华 友 钴 业	2023-06 -07	943,200.0 0	20,000. 00	14	3.30	1,210. 44	-	-	
中 信 证 券	20230607000 05423	均 胜 电 子	2023-06 -07	380,640.0 0	24,000. 00	14	2.00	296.05	-	-	
中 信 证 券	20230607000 16193	中 科 电 气	2023-06 -07	326,672.0 0	27,200. 00	7	2.90	184.21	-	-	
中	20230607000	瑞	2023-06	76,701.00	3,700.0	7	3.30	49.22	-	-	

信 证 券	16630	泰 新 材	-07		0					
中 信 证 券	20230607000 17540	多 氟 多	2023-06 -07	1,005,993. 00	51,300. 00	7	3.00	586.83	-	-
中 信 证 券	20230607000 20005	容 百 科 技	2023-06 -07	560,200.0 0	10,000. 00	7	3.50	381.25	-	-
中 信 证 券	20230607000 20017	三 花 智 控	2023-06 -07	354,816.0 0	14,400. 00	7	3.10	213.88	-	-
中 信 证 券	20230607000 20221	三 花 智 控	2023-06 -07	354,816.0 0	14,400. 00	7	3.10	213.88	-	-
中 信 证 券	20230607000 20308	华 友 钻 业	2023-06 -07	471,600.0 0	10,000. 00	7	3.30	302.61	-	-
中 信 证 券	20230607000 21303	特 锐 德	2023-06 -07	438,691.0 0	20,900. 00	7	3.20	272.96	-	-
中 信 证 券	20230607000 22705	中 科 电 气	2023-06 -07	26,422.00	2,200.0 0	7	2.90	14.90	-	-
中 信 证 券	20230607000 22990	厦 门 钨 业	2023-06 -07	426,650.0 0	23,000. 00	7	2.50	207.40	-	-
中 信 证 券	20230607000 23220	天 华 新 能	2023-06 -07	83,040.00	2,400.0 0	7	3.40	54.90	-	-
中 信 证 券	20230607000 23235	中 科 电 气	2023-06 -07	1,180,583. 00	98,300. 00	7	2.90	665.72	-	-
中	20230607000	恩	2023-06	2,751,000.	30,000.	7	3.70	1,979.	-	-

信 证 券	23257	捷 股 份	-07	00	00			19		
中 信 证 券	20230607000 24061	赣 锋 锂 业	2023-06 -07	623,000.0 0	10,000. 00	7	3.10	375.53	-	-
中 信 证 券	20230607000 24188	盛 新 锂 能	2023-06 -07	1,820,000. 00	56,000. 00	7	3.00	1,061. 67	-	-
中 信 证 券	20230607000 24294	天 齐 锂 业	2023-06 -07	7,341,000. 00	100,000 .00	7	3.10	4,424. 99	-	-
中 信 证 券	20230607000 24405	盛 新 锂 能	2023-06 -07	325,000.0 0	10,000. 00	7	3.10	195.90	-	-
中 信 证 券	20230607000 24600	国 轩 高 科	2023-06 -07	255,500.0 0	10,000. 00	7	3.00	149.04	-	-
中 信 证 券	20230607000 25165	先 导 智 能	2023-06 -07	3,140,000. 00	100,000 .00	7	3.40	2,075. 89	-	-
中 信 证 券	20230608000 04253	永 兴 材 料	2023-06 -08	440,300.0 0	6,800.0 0	14	3.20	704.48	-	-
中 信 证 券	20230608000 04271	雅 化 集 团	2023-06 -08	18,520.00	1,000.0 0	14	2.40	22.22	-	-
中 信 证 券	20230608000 04611	均 胜 电 子	2023-06 -08	73,179.00	4,700.0 0	14	2.00	73.18	-	-
中 信 证 券	20230608000 16540	杭 可 科 技	2023-06 -08	575,000.0 0	20,000. 00	7	1.80	201.25	-	-
中	20230608000	汇	2023-06	20,083.00	350,000	7	2.60	10,153	-	-

信 证 券	16757	川 技 术	-08	0.00	.00			.07		
中 信 证 券	20230608000 17411	西 藏 矿 业	2023-06 -08	156,927.0 0	5,100.0 0	7	3.30	100.69	-	-
中 信 证 券	20230608000 17585	华 友 钴 业	2023-06 -08	471,200.0 0	10,000. 00	7	3.20	293.19	-	-
中 信 证 券	20230608000 17640	盛 新 锂 能	2023-06 -08	337,300.0 0	10,000. 00	7	2.90	190.20	-	-
中 信 证 券	20230608000 17947	西 藏 矿 业	2023-06 -08	307,700.0 0	10,000. 00	7	3.30	197.44	-	-
中 信 证 券	20230608000 18037	振 华 新 材	2023-06 -08	75,400.00	2,600.0 0	7	3.70	54.25	-	-
中 信 证 券	20230608000 18472	多 氟 多	2023-06 -08	1,937,000. 00	100,000 .00	7	3.10	1,167. 58	-	-
中 信 证 券	20230608000 19971	盛 新 锂 能	2023-06 -08	742,060.0 0	22,000. 00	7	2.90	418.44	-	-
中 信 证 券	20230608000 20122	三 花 智 控	2023-06 -08	351,360.0 0	14,400. 00	7	3.10	211.79	-	-
中 信 证 券	20230608000 20499	科 达 利	2023-06 -08	11,990,00 0.00	100,000 .00	7	3.20	7,460. 44	-	-
中 信 证 券	20230608000 20786	华 友 钴 业	2023-06 -08	471,200.0 0	10,000. 00	7	3.40	311.52	-	-
中	20230608000	格	2023-06	349,000.0	50,000.	7	2.60	176.44	-	-

信 证 券	21669	林 美	-08	0	00					
中 信 证 券	20230608000 22261	恩 捷 股 份	2023-06 -08	3,944,630. 00	43,300. 00	7	3.70	2,837. 94	-	-
中 信 证 券	20230608000 22657	华 友 钴 业	2023-06 -08	471,200.0 0	10,000. 00	7	3.40	311.52	-	-
中 信 证 券	20230608000 22877	天 华 新 能	2023-06 -08	57,280.00	1,600.0 0	7	3.40	37.87	-	-
中 信 证 券	20230608000 22951	多 氟 多	2023-06 -08	249,873.0 0	12,900. 00	7	3.10	150.62	-	-
中 信 证 券	20230608000 23289	诺 德 股 份	2023-06 -08	64,796.00	9,700.0 0	7	3.20	40.32	-	-
中 信 证 券	20230608000 23865	盛 新 锂 能	2023-06 -08	337,300.0 0	10,000. 00	7	2.90	190.20	-	-
中 信 证 券	20230608000 23940	华 友 钴 业	2023-06 -08	471,200.0 0	10,000. 00	7	3.40	311.52	-	-
中 信 证 券	20230608000 24727	盛 新 锂 能	2023-06 -08	826,385.0 0	24,500. 00	7	2.90	465.99	-	-
中 信 证 券	20230608000 25199	星 源 材 质	2023-06 -08	859,200.0 0	53,700. 00	7	3.40	568.03	-	-
中 信 证 券	20230608000 25273	科 达 利	2023-06 -08	4,796,000. 00	40,000. 00	7	2.90	2,704. 41	-	-
中	20230608000	盛	2023-06	988,289.0	29,300.	7	2.90	557.29	-	-

信 证 券	25629	新 锂 能	-08	0	00						
中 信 证 券	20230608000 25679	华 友 钴 业	2023-06 -08	2,327,728. 00	49,400. 00	7	3.40	1,538. 89	-	-	
中 信 证 券	20230609000 02116	杭 可 科 技	2023-06 -09	594,000.0 0	20,000. 00	14	3.90	1,093. 95	-	-	
中 信 证 券	20230612000 40851	先 导 智 能	2023-06 -12	3,056,000. 00	100,000 .00	7	1.80	1,069. 60	-	-	
中 信 证 券	20230613000 18227	杭 可 科 技	2023-06 -13	1,134,000. 00	37,500. 00	7	4.00	882.00	-	-	
中 信 证 券	20230613000 18468	天 奈 科 技	2023-06 -13	2,835,248. 00	63,400. 00	7	3.40	1,874. 41	-	-	
中 信 证 券	20230613000 18710	华 友 钴 业	2023-06 -13	477,400.0 0	10,000. 00	7	3.40	315.61	-	-	
中 信 证 券	20230613000 18945	中 科 电 气	2023-06 -13	324,810.0 0	27,000. 00	7	3.00	189.47	-	-	
中 信 证 券	20230613000 19276	杭 可 科 技	2023-06 -13	1,512,000. 00	50,000. 00	7	4.00	1,176. 00	-	-	
中 信 证 券	20230613000 19338	天 奈 科 技	2023-06 -13	2,835,248. 00	63,400. 00	7	3.40	1,874. 41	-	-	
中 信 证 券	20230613000 19341	科 达 利	2023-06 -13	2,658,160. 00	22,300. 00	7	3.00	1,550. 59	-	-	
中	20230613000	德	2023-06	240,000.0	2,400.0	7	3.00	140.00	-	-	

信 证 券	19676	方 纳 米	-13	0	0						
中 信 证 券	20230613000 20605	科 达 利	2023-06 -13	1,335,040. 00	11,200. 00	7	3.00	778.77	-	-	
中 信 证 券	20230613000 20622	多 氟 多	2023-06 -13	2,829,897. 00	144,900 .00	7	3.10	1,705. 80	-	-	
中 信 证 券	20230613000 20926	中 科 电 气	2023-06 -13	191,277.0 0	15,900. 00	7	3.00	111.58	-	-	
中 信 证 券	20230613000 21433	中 国 宝 安	2023-06 -13	316,239.0 0	25,900. 00	7	1.20	73.79	-	-	
中 信 证 券	20230613000 21608	雅 化 集 团	2023-06 -13	187,200.0 0	10,000. 00	7	2.50	91.00	-	-	
中 信 证 券	20230614000 00913	雅 化 集 团	2023-06 -14	1,111,964. 00	60,400. 00	14	2.60	1,124. 32	-	-	
中 信 证 券	20230614000 00920	雅 化 集 团	2023-06 -14	20,251.00	1,100.0 0	14	2.60	20.48	-	-	
中 信 证 券	20230614000 00950	融 捷 股 份	2023-06 -14	1,846,455. 00	25,500. 00	14	2.80	2,010. 58	-	-	
中 信 证 券	20230614000 00955	融 捷 股 份	2023-06 -14	1,969,552. 00	27,200. 00	14	2.80	2,144. 62	-	-	
中 信 证 券	20230614000 00975	盛 新 锂 能	2023-06 -14	1,952,478. 00	59,400. 00	14	2.50	1,898. 24	-	-	
中	20230614000	恩	2023-06	1,946,825.	21,500.	14	4.80	3,634.	-	-	

信 证 券	01024	捷 股 份	-14	00	00			07		
中 信 证 券	20230614000 01246	腾 远 钻 业	2023-06 -14	75,560.00	2,000.0 0	14	3.30	96.97	-	-
中 信 证 券	20230614000 49087	华 友 钻 业	2023-06 -14	473,300.0 0	10,000. 00	7	3.40	312.90	-	-
中 信 证 券	20230614000 49200	先 导 智 能	2023-06 -14	2,995,000. 00	100,000 .00	7	3.30	1,921. 79	-	-
中 信 证 券	20230614000 49312	盛 新 锂 能	2023-06 -14	1,840,720. 00	56,000. 00	7	2.90	1,037. 96	-	-
中 信 证 券	20230614000 49466	盛 新 锂 能	2023-06 -14	328,700.0 0	10,000. 00	7	2.90	185.35	-	-
中 信 证 券	20230614000 49880	赣 锋 锂 业	2023-06 -14	628,600.0 0	10,000. 00	7	3.20	391.13	-	-
中 信 证 券	20230614000 49905	三 花 智 控	2023-06 -14	392,832.0 0	14,400. 00	14	3.00	458.30	-	-
中 信 证 券	20230614000 49935	三 花 智 控	2023-06 -14	27,280.00	1,000.0 0	7	3.20	16.97	-	-
中 信 证 券	20230614000 49986	恩 捷 股 份	2023-06 -14	2,716,500. 00	30,000. 00	7	4.90	2,588. 22	-	-
中 信 证 券	20230614000 50316	天 奈 科 技	2023-06 -14	2,778,822. 00	63,400. 00	7	3.40	1,837.1 1	-	-
中	20230614000	天	2023-06	526,752.0	14,400.	7	3.40	348.24	-	-

信 证 券	50319	华 新 能	-14	0	00						
中 信 证 券	20230614000 50552	天 华 新 能	2023-06 -14	87,792.00	2,400.0 0	7	3.40	58.04	-	-	
中 信 证 券	20230614000 50732	天 华 新 能	2023-06 -14	7,316,000. 00	200,000 .00	7	3.40	4,836. 69	-	-	
中 信 证 券	20230614000 50755	瑞 泰 新 材	2023-06 -14	77,404.00	3,700.0 0	14	3.40	102.35	-	-	
中 信 证 券	20230614000 50834	多 氟 多	2023-06 -14	986,499.0 0	51,300. 00	14	3.00	1,150. 92	-	-	
中 信 证 券	20230614000 51021	三 花 智 控	2023-06 -14	392,832.0 0	14,400. 00	14	3.00	458.30	-	-	
中 信 证 券	20230614000 51335	国 轩 高 科	2023-06 -14	254,600.0 0	10,000. 00	7	3.00	148.52	-	-	
中 信 证 券	20230614000 52098	厦 门 钨 业	2023-06 -14	439,530.0 0	23,000. 00	7	2.20	188.02	-	-	
中 信 证 券	20230615000 12838	瑞 泰 新 材	2023-06 -15	603,639.0 0	28,300. 00	14	3.40	798.14	-	-	
中 信 证 券	20230615000 12905	天 华 新 能	2023-06 -15	1,977,960. 00	53,000. 00	14	3.20	2,461. 46	-	-	
中 信 证 券	20230615000 12918	雅 化 集 团	2023-06 -15	20,757.00	1,100.0 0	14	2.60	20.99	-	-	
中	20230615000	永	2023-06	65,410.00	1,000.0	14	3.30	83.94	-	-	

信 证 券	12936	兴 材 料	-15		0					
中 信 证 券	20230615000 12976	融 捷 股 份	2023-06 -15	2,011,440. 00	27,200. 00	14	2.80	2,190. 23	-	-
中 信 证 券	20230615000 12984	华 友 钴 业	2023-06 -15	2,417,500. 00	50,000. 00	14	3.30	3,102. 46	-	-
中 信 证 券	20230615000 12986	融 捷 股 份	2023-06 -15	1,885,725. 00	25,500. 00	14	2.80	2,053. 35	-	-
中 信 证 券	20230615000 12991	雅 化 集 团	2023-06 -15	1,139,748. 00	60,400. 00	14	2.60	1,152. 41	-	-
中 信 证 券	20230615000 13258	天 奈 科 技	2023-06 -15	256,032.0 0	5,600.0 0	14	3.30	328.57	-	-
中 信 证 券	20230615000 13574	杭 可 科 技	2023-06 -15	2,097,310. 00	65,500. 00	14	1.60	1,304. 99	-	-
中 信 证 券	20230615000 27090	格 林 美	2023-06 -15	347,000.0 0	50,000. 00	7	2.20	233.26	-	-
中 信 证 券	20230615000 27932	盛 新 锂 能	2023-06 -15	749,540.0 0	22,000. 00	7	2.90	664.18	-	-
中 信 证 券	20230615000 29177	汇 川 技 术	2023-06 -15	22,025,50 0.00	350,000 .00	7	2.20	14,806 .03	-	-
中 信 证 券	20230615000 29646	西 藏 矿 业	2023-06 -15	155,805.0 0	5,100.0 0	14	3.20	193.89	-	-
中	20230615000	盛	2023-06	340,700.0	10,000.	7	2.90	301.90	-	-

信 证 券	29747	新 锂 能	-15	0	00					
中 信 证 券	20230615000 29867	多 氟 多	2023-06 -15	255,807.0 0	12,900. 00	14	3.00	298.44	-	-
中 信 证 券	20230615000 30426	科 达 利	2023-06 -15	12,800,00 0.00	100,000 .00	7	3.00	11,733. 33	-	-
中 信 证 券	20230615000 30563	容 百 科 技	2023-06 -15	16,254,00 0.00	300,000 .00	7	3.60	17,879 .40	-	-
中 信 证 券	20230615000 30745	盛 新 锂 能	2023-06 -15	340,700.0 0	10,000. 00	14	2.50	331.24	-	-
中 信 证 券	20230615000 30950	三 花 智 控	2023-06 -15	417,600.0 0	14,400. 00	14	3.00	487.20	-	-
中 信 证 券	20230615000 31204	华 友 钴 业	2023-06 -15	483,500.0 0	10,000. 00	7	3.40	502.30	-	-
中 信 证 券	20230615000 32552	振 华 新 材	2023-06 -15	77,532.00	2,600.0 0	14	4.00	120.61	-	-
中 信 证 券	20230615000 32594	杭 可 科 技	2023-06 -15	640,400.0 0	20,000. 00	14	1.80	448.28	-	-
中 信 证 券	20230615000 33710	多 氟 多	2023-06 -15	1,983,000. 00	100,000 .00	7	3.10	1,878. 34	-	-
中 信 证 券	20230615000 34033	华 友 钴 业	2023-06 -15	2,388,490. 00	49,400. 00	7	3.40	2,481. 38	-	-
中	20230615000	西	2023-06	366,600.0	12,000.	7	3.30	369.66	-	-

信 证 券	34678	藏 矿 业	-15	0	00						
中 信 证 券	20230615000 34842	华 友 钴 业	2023-06 -15	483,500.0 0	10,000. 00	7	3.40	502.30	-	-	
中 信 证 券	20230615000 34995	西 藏 矿 业	2023-06 -15	372,710.0 0	12,200. 00	7	3.30	375.82	-	-	
中 信 证 券	20230615000 35104	西 藏 矿 业	2023-06 -15	128,310.0 0	4,200.0 0	7	3.30	129.38	-	-	
中 信 证 券	20230615000 35247	华 友 钴 业	2023-06 -15	483,500.0 0	10,000. 00	7	3.40	502.30	-	-	
中 信 证 券	20230615000 36559	科 达 利	2023-06 -15	5,120,000. 00	40,000. 00	7	3.00	4,693. 33	-	-	
中 信 证 券	20230615000 37193	盛 新 锂 能	2023-06 -15	998,251.0 0	29,300. 00	7	2.90	884.56	-	-	
中 信 证 券	20230615000 38332	盛 新 锂 能	2023-06 -15	834,715.0 0	24,500. 00	7	2.90	739.65	-	-	
中 信 证 券	20230615000 38340	华 友 钴 业	2023-06 -15	483,500.0 0	10,000. 00	7	3.40	502.30	-	-	
中 信 证 券	20230615000 38357	诺 德 股 份	2023-06 -15	66,833.00	9,700.0 0	14	3.10	80.57	-	-	
中 信 证 券	20230615000 39044	恩 捷 股 份	2023-06 -15	4,141,212. 00	43,300. 00	7	3.70	4,681. 87	-	-	
中	20230615000	华	2023-06	483,500.0	10,000.	7	3.40	502.30	-	-	

信 证 券	39374	友 钴 业	-15	0	00					
中 信 证 券	20230619000 24397	先 导 智 能	2023-06 -19	3,415,000. 00	100,000 .00	14	1.80	55,578 .25	3,415,000. 00	55,578 .25
中 信 证 券	20230620000 21977	天 华 新 能	2023-06 -20	1,948,064. 00	54,400. 00	28	2.60	1,406. 94	1,948,064. 00	1,406. 94
中 信 证 券	20230620000 22060	恩 捷 股 份	2023-06 -20	2,751,300. 00	30,000. 00	14	4.80	3,668. 40	2,751,300. 00	3,668. 40
中 信 证 券	20230620000 22073	恩 捷 股 份	2023-06 -20	1,916,739. 00	20,900. 00	14	4.80	2,555. 65	1,916,739. 00	2,555. 65
中 信 证 券	20230620000 22201	天 奈 科 技	2023-06 -20	1,748,555. 00	38,900. 00	14	3.30	1,602. 84	1,748,555. 00	1,602. 84
中 信 证 券	20230620000 22376	容 百 科 技	2023-06 -20	5,268,000. 00	100,000 .00	14	3.30	4,829. 00	5,268,000. 00	4,829. 00
中 信 证 券	20230620000 22609	永 兴 材 料	2023-06 -20	523,098.0 0	8,100.0 0	14	3.30	479.51	523,098.0 0	479.51
中 信 证 券	20230620000 31185	杭 可 科 技	2023-06 -20	1,670,000. 00	50,000. 00	14	1.60	742.22	1,670,000. 00	742.22
中 信 证 券	20230620000 31958	盛 新 锂 能	2023-06 -20	216,414.0 0	6,600.0 0	14	2.50	150.29	216,414.0 0	150.29
中 信 证 券	20230620000 33030	德 方 纳 米	2023-06 -20	729,788.0 0	7,400.0 0	14	2.60	527.07	729,788.0 0	527.07
中	20230620000	三	2023-06	31,490.00	1,000.0	14	3.00	26.24	31,490.00	26.24

信 证 券	33135	花 智 控	-20		0					
中 信 证 券	20230620000 33328	华 友 钻 业	2023-06 -20	468,900.0 0	10,000. 00	14	3.30	429.83	468,900.0 0	429.83
中 信 证 券	20230620000 33773	中 伟 股 份	2023-06 -20	526,944.0 0	8,800.0 0	14	3.10	453.76	526,944.0 0	453.76
中 信 证 券	20230620000 34543	天 奈 科 技	2023-06 -20	2,849,830. 00	63,400. 00	14	3.30	2,612. 34	2,849,830. 00	2,612. 34
中 信 证 券	20230620000 35000	杭 可 科 技	2023-06 -20	1,252,500. 00	37,500. 00	14	1.60	556.66	1,252,500. 00	556.66
中 信 证 券	20230620000 35352	多 氟 多	2023-06 -20	2,834,244. 00	144,900 .00	14	3.00	2,361. 87	2,834,244. 00	2,361. 87
中 信 证 券	20230620000 35726	国 轩 高 科	2023-06 -20	169,458.0 0	6,100.0 0	14	2.30	108.26	169,458.0 0	108.26
中 信 证 券	20230620000 35789	天 奈 科 技	2023-06 -20	2,849,830. 00	63,400. 00	14	3.30	2,612. 34	2,849,830. 00	2,612. 34
中 信 证 券	20230620000 36038	中 科 电 气	2023-06 -20	321,030.0 0	27,000. 00	14	3.20	285.36	321,030.0 0	285.36
中 信 证 券	20230620000 36099	中 科 电 气	2023-06 -20	189,051.0 0	15,900. 00	14	3.20	168.04	189,051.0 0	168.04
中 信 证 券	20230620000 36184	中 国 宝 安	2023-06 -20	318,311.0 0	25,900. 00	14	1.60	141.47	318,311.0 0	141.47
中	20230620000	科	2023-06	2,832,100.	22,300.	14	2.90	2,281.	2,832,100.	2,281.

信 证 券	36498	达 利	-20	00	00			41	00	41
中 信 证 券	20230620000 36660	科 达 利	2023-06 -20	1,422,400. 00	11,200. 00	14	2.90	1,145. 82	1,422,400. 00	1,145. 82
中 信 证 券	20230621000 06246	瑞 泰 新 材	2023-06 -21	371,850.0 0	18,500. 00	14	3.10	288.19	371,850.0 0	288.19
中 信 证 券	20230621000 13062	先 导 智 能	2023-06 -21	3,402,000. 00	100,000 .00	14	3.20	56,421 .60	3,402,000. 00	56,421 .60
中 信 证 券	20230621000 13701	天 华 新 能	2023-06 -21	83,112.00	2,400.0 0	14	3.20	66.49	83,112.00	66.49
中 信 证 券	20230621000 14007	华 友 钻 业	2023-06 -21	923,600.0 0	20,000. 00	14	3.30	761.97	923,600.0 0	761.97
中 信 证 券	20230621000 14788	厦 门 钨 业	2023-06 -21	432,860.0 0	23,000. 00	14	2.30	8,298. 90	432,860.0 0	8,298. 90
中 信 证 券	20230621000 14882	均 胜 电 子	2023-06 -21	420,480.0 0	24,000. 00	14	2.00	210.24	420,480.0 0	210.24
中 信 证 券	20230621000 14896	天 奈 科 技	2023-06 -21	2,757,900. 00	63,400. 00	14	3.30	2,275. 27	2,757,900. 00	2,275. 27
中 信 证 券	20230621000 15103	华 友 钻 业	2023-06 -21	461,800.0 0	10,000. 00	14	3.30	380.98	461,800.0 0	380.98
中 信 证 券	20230621000 15316	天 华 新 能	2023-06 -21	498,672.0 0	14,400. 00	14	2.70	336.61	498,672.0 0	336.61
中	20230621000	特	2023-06	379,834.0	18,200.	14	3.10	294.37	379,834.0	294.37

信 证 券	16544	锐 德	-21	0	00				0	
中 信 证 券	20230621000 16572	腾 远 钻 业	2023-06 -21	474,630.0 0	13,000. 00	14	2.90	344.11	474,630.0 0	344.11
中 信 证 券	20230621000 16605	腾 远 钻 业	2023-06 -21	131,436.0 0	3,600.0 0	14	2.90	95.29	131,436.0 0	95.29
中 信 证 券	20230621000 18069	天 华 新 能	2023-06 -21	6,926,000. 00	200,000 .00	14	3.20	5,540. 80	6,926,000. 00	5,540. 80
中 信 证 券	20230621000 18360	特 锐 德	2023-06 -21	20,870.00	1,000.0 0	14	3.10	16.17	20,870.00	16.17
中 信 证 券	20230626000 32365	雅 化 集 团	2023-06 -26	17,800.00	1,000.0 0	14	1.90	473.76	17,800.00	473.76
中 信 证 券	20230626000 33880	杭 可 科 技	2023-06 -26	649,200.0 0	20,000. 00	14	1.60	115.41	649,200.0 0	115.41
中 信 证 券	20230626000 36264	永 兴 材 料	2023-06 -26	419,696.0 0	6,800.0 0	14	3.30	153.89	419,696.0 0	153.89
中 信 证 券	20230626000 40669	均 胜 电 子	2023-06 -26	81,169.00	4,700.0 0	14	1.20	10.82	81,169.00	10.82
中 信 证 券	20230626000 43129	科 达 利	2023-06 -26	12,579,00 0.00	100,000 .00	14	2.80	3,913. 47	12,579,00 0.00	3,913. 47
中 信 证 券	20230626000 45696	科 达 利	2023-06 -26	5,031,600. 00	40,000. 00	14	2.90	1,621. 29	5,031,600. 00	1,621. 29
中	20230626000	华	2023-06	457,000.0	10,000.	14	3.30	167.57	457,000.0	167.57

信 证 券	46873	友 钴 业	-26	0	00				0	
中 信 证 券	20230626000 48260	华 友 钴 业	2023-06 -26	457,000.0 0	10,000. 00	14	3.30	167.57	457,000.0 0	167.57
中 信 证 券	20230626000 49265	容 百 科 技	2023-06 -26	15,669,00 0.00	300,000 .00	14	3.30	5,745. 30	15,669,00 0.00	5,745. 30
中 信 证 券	20230626000 50140	华 友 钴 业	2023-06 -26	457,000.0 0	10,000. 00	14	3.30	167.57	457,000.0 0	167.57
中 信 证 券	20230626000 50856	华 友 钴 业	2023-06 -26	457,000.0 0	10,000. 00	14	3.30	167.57	457,000.0 0	167.57
中 信 证 券	20230626000 51913	汇 川 技 术	2023-06 -26	22,260,00 0.00	350,000 .00	14	2.10	5,194. 00	22,260,00 0.00	5,194. 00
中 信 证 券	20230626000 51916	格 林 美	2023-06 -26	342,000.0 0	50,000. 00	14	2.20	83.60	342,000.0 0	83.60
中 信 证 券	20230626000 51917	华 友 钴 业	2023-06 -26	2,257,580. 00	49,400. 00	14	3.30	827.78	2,257,580. 00	827.78
中 信 证 券	20230626000 52320	华 友 钴 业	2023-06 -26	457,000.0 0	10,000. 00	14	3.30	167.57	457,000.0 0	167.57
中 信 证 券	20230626000 52472	多 氟 多	2023-06 -26	1,907,000. 00	100,000 .00	14	3.00	635.67	1,907,000. 00	635.67
中 信 证 券	20230626000 52945	恩 捷 股 份	2023-06 -26	4,211,791. 00	43,300. 00	14	4.80	2,246. 29	4,211,791. 00	2,246. 29
中	20230627000	三	2023-06	1,925,080.	64,600.	14	2.90	465.23	1,925,080.	465.23

信 证 券	08932	花 智 控	-27	00	00				00	
中 信 证 券	20230627000 08945	恩 捷 股 份	2023-06 -27	8,325,900. 00	87,000. 00	14	4.80	3,330. 36	8,325,900. 00	3,330. 36
中 信 证 券	20230627000 09035	容 百 科 技	2023-06 -27	716,100.0 0	14,000. 00	14	3.30	196.93	716,100.0 0	196.93
中 信 证 券	20230628000 09994	多 氟 多	2023-06 -28	1,344,700. 00	70,000. 00	14	2.70	201.71	1,344,700. 00	201.71
中 信 证 券	20230628000 10005	璞 泰 来	2023-06 -28	7,422,600. 00	208,500 .00	14	3.00	1,237. 10	7,422,600. 00	1,237. 10
中 信 证 券	20230628000 10039	当 升 科 技	2023-06 -28	603,880.0 0	12,400. 00	14	1.20	8,323. 46	603,880.0 0	8,323. 46
中 信 证 券	20230628000 10069	天 齐 锂 业	2023-06 -28	309,815.0 0	4,300.0 0	14	2.90	12,949 .91	309,815.0 0	12,949 .91
中 信 证 券	20230628000 33272	恩 捷 股 份	2023-06 -28	2,125,490. 00	21,500. 00	14	4.80	566.80	2,125,490. 00	566.80
中 信 证 券	20230628000 35656	腾 远 钴 业	2023-06 -28	73,680.00	2,000.0 0	14	2.90	11.87	73,680.00	11.87
中 信 证 券	20230628000 43761	三 花 智 控	2023-06 -28	429,120.0 0	14,400. 00	14	2.90	69.14	429,120.0 0	69.14
中 信 证 券	20230628000 44145	三 花 智 控	2023-06 -28	429,120.0 0	14,400. 00	14	2.90	69.14	429,120.0 0	69.14
中	20230628000	多	2023-06	985,473.0	51,300.	14	2.70	147.82	985,473.0	147.82

信 证 券	44567	氟多	-28	0	00				0	
中 信 证 券	20230629000 09495	三 花 智 控	2023-06 -29	1,525,790. 00	49,700. 00	14	2.90	122.91	1,525,790. 00	122.91
中 信 证 券	20230629000 30770	雅 化 集 团	2023-06 -29	19,118.00	1,100.0 0	14	1.90	1.01	19,118.00	1.01
中 信 证 券	20230629000 30948	振 华 新 材	2023-06 -29	77,090.00	2,600.0 0	14	3.10	6.64	77,090.00	6.64
中 信 证 券	20230629000 31944	雅 化 集 团	2023-06 -29	1,049,752. 00	60,400. 00	14	1.90	55.40	1,049,752. 00	55.40
中 信 证 券	20230629000 33420	诺 德 股 份	2023-06 -29	67,609.00	9,700.0 0	14	2.40	4.51	67,609.00	4.51
中 信 证 券	20230629000 34808	永 兴 材 料	2023-06 -29	61,600.00	1,000.0 0	14	3.20	5.48	61,600.00	5.48
中 信 证 券	20230629000 35540	杭 可 科 技	2023-06 -29	1,974,825. 00	65,500. 00	14	1.60	87.77	1,974,825. 00	87.77
中 信 证 券	20230629000 36520	天 华 新 能	2023-06 -29	1,793,520. 00	53,000. 00	14	2.60	129.53	1,793,520. 00	129.53
中 信 证 券	20230629000 37298	三 花 智 控	2023-06 -29	442,080.0 0	14,400. 00	14	2.90	35.61	442,080.0 0	35.61
中 信 证 券	20230629000 37537	西 藏 矿 业	2023-06 -29	148,563.0 0	5,100.0 0	14	2.70	11.14	148,563.0 0	11.14
中	20230629000	天	2023-06	239,512.0	5,600.0	14	3.40	22.62	239,512.0	22.62

信 证 券	39520	奈 科 技	-29	0	0				0	
中 信 证 券	20230629000 42534	多 氟 多	2023-06 -29	244,584.0 0	12,900. 00	14	2.70	18.34	244,584.0 0	18.34
中 信 证 券	20230629000 43928	华 友 钴 业	2023-06 -29	2,247,000. 00	50,000. 00	14	3.20	199.73	2,247,000. 00	199.73
中 信 证 券	20230630000 04294	三 花 智 控	2023-06 -30	3,201,508. 00	105,800 .00	14	2.90	-	3,201,508. 00	-
中 信 证 券	20230630000 04434	天 齐 锂 业	2023-06 -30	405,478.0 0	5,800.0 0	14	2.90	-	405,478.0 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	20220106000 00399	寒 锐 钴 业	2022-01 -06	895,735.0 0	11,500. 00	14	1.80	627.01	-	-
中 信 证 券	20220106000 00405	新 宙 邦	2022-01 -06	1,130,688. 00	10,400. 00	14	1.80	791.48	-	-
中 信 证 券	20220106000 00408	先 导 智 能	2022-01 -06	1,468,656. 00	21,700. 00	14	1.80	1,028. 06	-	-
中 信	20220106000 00413	当 升	2022-01 -06	1,158,234. 00	13,800. 00	14	1.80	810.76	-	-

证券		科技								
中信证券	2022010600010047	中伟股份	2022-01-06	490,910.00	3,500.00	14	3.30	630.00	-	-
中信证券	2022010600011511	新宙邦	2022-01-06	195,696.00	1,800.00	14	3.60	273.97	-	-
中信证券	2022010600011513	翔丰华	2022-01-06	57,000.00	1,000.00	14	3.20	70.93	-	-
中信证券	2022010600011523	特锐德	2022-01-06	89,172.00	3,600.00	14	3.50	121.37	-	-
中信证券	2022011000012721	中伟股份	2022-01-10	1,598,289.00	11,900.00	14	2.90	1,802.51	-	-
中信证券	2022011200018041	天奈科技	2022-01-12	5,915,200.00	40,000.00	28	1.80	8,281.28	-	-
中信证券	2022011300009816	嘉元科技	2022-01-13	6,637,140.00	51,000.00	28	2.90	14,970.44	-	-
中信证券	2022011300009818	当升科技	2022-01-13	2,593,344.00	31,200.00	14	2.70	2,723.01	-	-
中信证券	2022011400020842	当升科技	2022-01-14	3,668,330.00	43,000.00	14	2.70	3,851.75	-	-
中信证券	2022011400021506	中伟股份	2022-01-14	1,381,000.00	10,000.00	14	1.70	912.99	-	-
中信	2022011400023522	宁德时代	2022-01-14	750,620.00	1,300.00	14	1.80	525.43	-	-

证券		时代								
中信证券	20220120000 01264	亿纬锂能	2022-01 -20	1,933,140. 00	20,200. 00	14	3.20	3,093. 03	-	-
中信证券	20220120000 09796	翔丰华	2022-01 -20	49,250.00	1,000.0 0	14	3.30	81.26	-	-
中信证券	20220120000 10890	中伟股份	2022-01 -20	475,720.0 0	3,500.0 0	14	3.20	761.15	-	-
中信证券	20220120000 10894	新宙邦	2022-01 -20	171,720.0 0	1,800.0 0	14	2.80	240.40	-	-
中信证券	20220120000 10896	特锐德	2022-01 -20	82,044.00	3,600.0 0	14	3.00	123.07	-	-
中信证券	202201200001 1194	新宙邦	2022-01 -20	992,160.0 0	10,400. 00	14	1.80	892.94	-	-
中信证券	202201200001 1196	当升科技	2022-01 -20	1,137,948. 00	13,800. 00	14	1.80	1,024. 15	-	-
中信证券	202201200001 1198	先导智能	2022-01 -20	1,584,751. 00	21,700. 00	14	1.80	1,426. 28	-	-
中信证券	202201200001 1208	寒锐钴业	2022-01 -20	869,745.0 0	11,500. 00	14	1.80	782.77	-	-
中信证券	20220124000 09788	中伟股份	2022-01 -24	1,621,613. 00	11,900. 00	14	2.90	1,828. 82	-	-
中信	202201270001 1465	当升	2022-01 -27	2,649,192. 00	31,200. 00	14	2.50	2,575. 60	-	-

证券		科技								
中信证券	20220128000 20874	中伟股份	2022-01 -28	1,307,400. 00	10,000. 00	14	1.70	864.34	-	-
中信证券	20220128000 22184	宁德时代	2022-01 -28	770,380.0 0	1,300.0 0	14	1.80	539.27	-	-
中信证券	20220207000 47153	中伟股份	2022-02 -07	1,474,410. 00	11,900. 00	14	2.90	1,662. 81	-	-
中信证券	20220207000 47155	寒锐钴业	2022-02 -07	840,190.0 0	11,500. 00	14	1.80	588.13	-	-
中信证券	20220207000 47163	先导智能	2022-02 -07	1,567,608. 00	21,700. 00	14	1.80	1,097. 33	-	-
中信证券	20220207000 47169	当升科技	2022-02 -07	1,150,920. 00	13,800. 00	14	1.80	805.64	-	-
中信证券	20220207000 47171	新宙邦	2022-02 -07	987,896.0 0	10,400. 00	14	1.80	691.53	-	-
中信证券	20220207000 55409	翔丰华	2022-02 -07	57,050.00	1,000.0 0	14	3.20	71.00	-	-
中信证券	20220207000 55411	特锐德	2022-02 -07	75,456.00	3,600.0 0	14	3.20	93.90	-	-
中信证券	20220207000 55413	新宙邦	2022-02 -07	170,982.0 0	1,800.0 0	14	2.90	192.83	-	-
中信	20220207000 55415	中伟	2022-02 -07	433,650.0 0	3,500.0 0	14	3.60	607.11	-	-

证券		股份								
中信证券	20220207000 55417	亿纬锂能	2022-02 -07	1,904,860. 00	20,200. 00	14	2.90	2,148. 26	-	-
中信证券	20220209000 17124	天奈科技	2022-02 -09	5,368,000. 00	40,000. 00	28	1.80	7,515. 20	-	-
中信证券	20220210000 12814	嘉元科技	2022-02 -10	5,607,960. 00	51,000. 00	28	3.20	13,957 .59	-	-
中信证券	20220210000 12982	当升科技	2022-02 -10	2,324,400. 00	31,200. 00	14	2.80	2,531. 01	-	-
中信证券	202202110002 0196	宁德时代	2022-02 -11	636,987.0 0	1,300.0 0	14	1.80	445.89	-	-
中信证券	20220215000 00929	寒锐钴业	2022-02 -15	309,000.0 0	4,000.0 0	14	3.30	396.55	-	-
中信证券	20220215000 00934	新宙邦	2022-02 -15	2,608,320. 00	28,600. 00	14	3.10	3,144. 47	-	-
中信证券	20220217000 01189	当升科技	2022-02 -17	690,312.0 0	8,400.0 0	14	3.30	885.90	-	-
中信证券	20220217000 01203	亿纬锂能	2022-02 -17	2,060,856. 00	23,200. 00	14	2.90	2,324. 19	-	-
中信证券	20220221000 38029	新宙邦	2022-02 -21	938,600.0 0	10,400. 00	14	1.80	657.02	-	-
中信	20220221000 38037	寒锐	2022-02 -21	871,815.0 0	11,500. 00	14	1.80	610.27	-	-

证券		钴业								
中信证券	20220221000 43097	中伟股份	2022-02 -21	1,467,151. 00	11,900. 00	14	2.90	1,654. 62	-	-
中信证券	20220221000 45417	新宙邦	2022-02 -21	162,450.0 0	1,800.0 0	14	2.20	138.99	-	-
中信证券	20220221000 45419	中伟股份	2022-02 -21	431,515.0 0	3,500.0 0	14	2.50	419.53	-	-
中信证券	20220221000 45421	翔丰华	2022-02 -21	56,990.00	1,000.0 0	14	1.90	42.11	-	-
中信证券	20220221000 45423	特锐德	2022-02 -21	76,068.00	3,600.0 0	14	3.00	88.75	-	-
中信证券	20220221000 45437	亿纬锂能	2022-02 -21	1,734,170. 00	20,200. 00	14	2.00	1,348. 80	-	-
中信证券	20220221000 45465	当升科技	2022-02 -21	1,111,314. 00	13,800. 00	14	1.80	777.92	-	-
中信证券	20220221000 45469	先导智能	2022-02 -21	1,348,655. 00	21,700. 00	14	1.80	944.06	-	-
中信证券	20220224000 00788	亿纬锂能	2022-02 -24	85,990.00	1,000.0 0	28	2.10	140.45	-	-
中信证券	20220224000 10381	当升科技	2022-02 -24	2,593,968. 00	31,200. 00	14	3.30	3,328. 93	-	-
中信	20220225000 17913	宁德时代	2022-02 -25	687,440.0 0	1,300.0 0	14	1.80	481.21	-	-

证 券		时 代								
中 信 证 券	20220301000 01238	寒 锐 钻 业	2022-03 -01	1,576,845. 00	20,100. 00	14	3.30	2,023. 62	-	-
中 信 证 券	20220301000 04472	新 宙 邦	2022-03 -01	2,704,988. 00	28,600. 00	14	2.80	2,945. 43	-	-
中 信 证 券	20220301000 04660	天 奈 科 技	2022-01 -12	51,998.84	-	28	1.80	-	-	-
中 信 证 券	20220303000 01576	中 伟 股 份	2022-03 -03	494,680.0 0	4,000.0 0	14	2.30	442.46	-	-
中 信 证 券	20220303000 01624	亿 纬 锂 能	2022-03 -03	238,530.0 0	3,000.0 0	14	2.70	250.46	-	-
中 信 证 券	20220303000 04334	亿 纬 锂 能	2022-03 -03	1,844,632. 00	23,200. 00	14	2.20	1,578. 19	-	-
中 信 证 券	20220303000 04336	当 升 科 技	2022-03 -03	668,640.0 0	8,400.0 0	14	2.80	728.07	-	-
中 信 证 券	20220307000 33546	中 伟 股 份	2022-03 -07	406,700.0 0	3,500.0 0	14	2.30	363.77	-	-
中 信 证 券	20220307000 33550	亿 纬 锂 能	2022-03 -07	1,510,758. 00	20,200. 00	14	2.70	1,586. 30	-	-
中 信 证 券	20220307000 33572	特 锐 德	2022-03 -07	71,280.00	3,600.0 0	14	3.30	91.48	-	-
中 信	20220307000 33574	新 宙	2022-03 -07	151,722.0 0	1,800.0 0	14	3.00	177.01	-	-

证券		邦								
中信证券	20220307000 35246	当升科技	2022-03 -07	1,020,096. 00	13,800. 00	14	1.80	714.07	-	-
中信证券	20220307000 35248	新宙邦	2022-03 -07	876,616.0 0	10,400. 00	14	1.80	613.63	-	-
中信证券	20220307000 35256	先导智能	2022-03 -07	1,238,853. 00	21,700. 00	14	1.80	867.20	-	-
中信证券	20220307000 35936	翔丰华	2022-03 -07	51,990.00	1,000.0 0	14	3.60	72.79	-	-
中信证券	20220308000 01390	寒锐钴业	2022-03 -08	209,730.0 0	3,000.0 0	14	3.50	285.47	-	-
中信证券	20220309000 16541	天奈科技	2022-03 -09	5,303,200. 00	40,000. 00	28	1.80	7,424. 48	-	-
中信证券	20220310000 00753	中伟股份	2022-03 -10	2,146,000. 00	18,500. 00	28	4.30	7,177. 18	-	-
中信证券	20220310000 00757	寒锐钴业	2022-03 -10	481,880.0 0	7,000.0 0	28	3.40	1,274. 30	-	-
中信证券	202203100001 1794	嘉元科技	2022-03 -10	4,832,760. 00	51,000. 00	28	2.90	10,900 .56	-	-
中信证券	202203100001 1832	当升科技	2022-03 -10	2,427,984. 00	31,200. 00	14	3.10	2,927. 07	-	-
中信	202203110001 7352	宁德时代	2022-03 -11	641,615.0 0	1,300.0 0	14	1.80	449.13	-	-

证券		时代								
中信证券	202203150001 1431	新宙邦	2022-03 -15	2,308,878. 00	28,600. 00	14	3.10	2,783. 48	-	-
中信证券	202203150001 1443	寒锐钴业	2022-03 -15	1,296,249. 00	20,100. 00	14	3.50	1,764. 34	-	-
中信证券	20220317000 01098	亿纬锂能	2022-03 -17	2,070,862. 00	25,400. 00	28	2.10	3,382. 41	-	-
中信证券	20220317000 01099	亿纬锂能	2022-03 -17	326,120.0 0	4,000.0 0	28	2.10	532.66	-	-
中信证券	20220317000 01101	当升科技	2022-03 -17	936,770.0 0	11,300. 00	28	3.20	2,331. 52	-	-
中信证券	20220317000 05212	亿纬锂能	2022-03 -17	244,590.0 0	3,000.0 0	14	3.10	294.87	-	-
中信证券	20220317000 05216	当升科技	2022-03 -17	696,360.0 0	8,400.0 0	14	3.30	893.66	-	-
中信证券	20220317000 05222	中伟股份	2022-03 -17	514,400.0 0	4,000.0 0	14	4.40	880.20	-	-
中信证券	20220321000 30565	先导智能	2022-03 -21	1,318,492. 00	21,700. 00	14	1.80	1,054. 79	-	-
中信证券	20220321000 30569	新宙邦	2022-03 -21	887,952.0 0	10,400. 00	14	1.80	710.37	-	-
中信	20220321000 34913	当升	2022-03 -21	1,162,788. 00	13,800. 00	14	1.80	930.23	-	-

证券		科技								
中信证券	20220321000 36711	翔丰华	2022-03 -21	55,620.00	1,000.0 0	14	3.50	86.53	-	-
中信证券	20220321000 36715	新宙邦	2022-03 -21	153,684.0 0	1,800.0 0	14	2.50	170.77	-	-
中信证券	20220321000 36717	特锐德	2022-03 -21	69,804.00	3,600.0 0	14	3.10	96.17	-	-
中信证券	20220321000 36719	中伟股份	2022-03 -21	464,450.0 0	3,500.0 0	14	6.40	1,321. 10	-	-
中信证券	20220321000 36739	亿纬锂能	2022-03 -21	1,725,080. 00	20,200. 00	14	2.20	1,686. 74	-	-
中信证券	20220322000 00907	当升科技	2022-03 -22	667,520.0 0	8,000.0 0	14	3.40	945.65	-	-
中信证券	20220322000 00923	新宙邦	2022-03 -22	340,960.0 0	4,000.0 0	14	2.10	298.34	-	-
中信证券	20220322000 13305	寒锐钴业	2022-03 -22	199,560.0 0	3,000.0 0	14	3.20	266.08	-	-
中信证券	20220324000 10593	当升科技	2022-03 -24	2,542,800. 00	31,200. 00	14	3.30	3,263. 26	-	-
中信证券	20220324000 10597	亿纬锂能	2022-03 -24	81,450.00	1,000.0 0	28	2.10	133.04	-	-
中信	20220325000 15816	宁德时代	2022-03 -25	652,691.0 0	1,300.0 0	14	1.80	456.88	-	-

证券		时代								
中信证券	20220329000 05052	新宙邦	2022-03 -29	2,361,216. 00	28,600. 00	14	2.10	1,928. 33	-	-
中信证券	20220329000 05058	寒锐钴业	2022-03 -29	1,267,908. 00	20,100. 00	14	3.40	1,676. 46	-	-
中信证券	20220331000 00903	当升科技	2022-03 -31	255,680.0 0	3,400.0 0	28	1.80	357.95	-	-
中信证券	20220331000 00905	新宙邦	2022-03 -31	220,185.0 0	2,700.0 0	28	1.80	308.26	-	-
中信证券	20220331000 00908	翔丰华	2022-03 -31	49,300.00	1,000.0 0	28	1.80	69.02	-	-
中信证券	20220331000 00915	亿纬锂能	2022-03 -31	451,752.0 0	5,600.0 0	28	1.80	632.45	-	-
中信证券	20220331000 00921	特锐德	2022-03 -31	104,608.0 0	5,600.0 0	28	1.80	146.45	-	-
中信证券	20220331000 00926	寒锐钴业	2022-03 -31	126,680.0 0	2,000.0 0	28	1.80	177.35	-	-
中信证券	20220331000 00932	宁德时代	2022-03 -31	1,075,830. 00	2,100.0 0	28	1.80	1,506. 16	-	-
中信证券	20220331000 00984	汇川技术	2022-03 -31	1,476,300. 00	25,900. 00	28	1.80	2,066. 82	-	-
中信	20220331000 05870	中伟	2022-03 -31	471,000.0 0	4,000.0 0	14	3.30	604.45	-	-

证券		股份								
中信证券	20220406000 50743	中伟股份	2022-04 -06	403,655.0 0	3,500.0 0	14	3.40	533.72	-	-
中信证券	20220406000 50745	特锐德	2022-04 -06	66,600.00	3,600.0 0	14	3.20	82.88	-	-
中信证券	20220406000 50747	亿纬锂能	2022-04 -06	1,601,860. 00	20,200. 00	14	3.10	1,931. 13	-	-
中信证券	20220406000 50749	寒锐钴业	2022-04 -06	187,740.0 0	3,000.0 0	14	3.10	226.33	-	-
中信证券	20220406000 56319	先导智能	2022-04 -06	1,174,404. 00	21,700. 00	14	1.80	822.08	-	-
中信证券	20220406000 56333	新宙邦	2022-04 -06	863,512.0 0	10,400. 00	14	1.80	604.46	-	-
中信证券	20220406000 60935	新宙邦	2022-04 -06	149,454.0 0	1,800.0 0	14	2.90	168.55	-	-
中信证券	20220406000 60937	翔丰华	2022-04 -06	48,170.00	1,000.0 0	14	3.70	69.31	-	-
中信证券	20220407000 13966	中伟股份	2022-04 -07	2,081,435. 00	18,500. 00	28	3.30	5,342. 35	-	-
中信证券	20220407000 13968	当升科技	2022-04 -07	2,296,944. 00	31,200. 00	14	3.10	2,769. 09	-	-
中信	20220407000 13970	寒锐	2022-04 -07	427,350.0 0	7,000.0 0	28	3.00	997.15	-	-

证券		钴业								
中信证券	20220408000 14877	宁德时代	2022-04 -08	643,500.0 0	1,300.0 0	14	1.80	450.45	-	-
中信证券	202204120001 1129	新宙邦	2022-04 -12	2,168,452. 00	28,600. 00	14	2.90	2,445. 53	-	-
中信证券	202204120001 1135	寒锐钴业	2022-04 -12	1,175,247. 00	20,100. 00	14	3.10	1,416. 83	-	-
中信证券	20220414000 05529	亿纬锂能	2022-04 -14	290,680.0 0	4,000.0 0	28	2.50	565.21	-	-
中信证券	20220414000 05531	当升科技	2022-04 -14	808,063.0 0	11,300. 00	28	3.10	1,948. 33	-	-
中信证券	20220414000 05533	亿纬锂能	2022-04 -14	1,845,818. 00	25,400. 00	28	2.50	3,589. 09	-	-
中信证券	20220415000 05799	特锐德	2022-03 -31	112.00	-	28	1.80	-	-	-
中信证券	20220415000 05820	特锐德	2022-04 -06	72.00	-	14	3.20	-	-	-
中信证券	20220420000 43882	特锐德	2022-04 -20	57,744.00	3,600.0 0	14	3.30	79.39	-	-
中信证券	20220420000 43884	翔丰华	2022-04 -20	39,810.00	1,000.0 0	14	3.70	61.37	-	-
中信	20220420000 43886	新宙	2022-04 -20	126,000.0 0	1,800.0 0	14	2.60	136.50	-	-

证券		邦									
中信证券	20220420000 44880	先导智能	2022-04 -20	1,017,730. 00	21,700. 00	14	1.80	763.30	-	-	
中信证券	20220420000 48134	亿纬锂能	2022-04 -20	1,365,520. 00	20,200. 00	14	3.00	1,706. 90	-	-	
中信证券	20220420000 48164	寒锐钴业	2022-04 -20	173,490.0 0	3,000.0 0	14	2.10	151.80	-	-	
中信证券	20220420000 49884	新宙邦	2022-04 -20	728,000.0 0	10,400. 00	14	1.80	546.00	-	-	
中信证券	20220421000 12733	亿纬锂能	2022-04 -21	64,510.00	1,000.0 0	28	2.90	145.51	-	-	
中信证券	20220421000 12739	当升科技	2022-04 -21	2,067,312. 00	31,200. 00	14	3.40	2,733. 45	-	-	
中信证券	20220422000 15182	宁德时代	2022-04 -22	539,942.0 0	1,300.0 0	14	1.80	377.96	-	-	
中信证券	20220426000 07399	寒锐钴业	2022-04 -26	935,655.0 0	20,100. 00	14	3.20	1,164. 37	-	-	
中信证券	20220426000 07401	新宙邦	2022-04 -26	1,688,830. 00	28,600. 00	14	3.40	2,233. 01	-	-	
中信证券	20220428000 01142	亿纬锂能	2022-04 -28	4,009,830. 00	63,800. 00	28	1.90	5,925. 64	-	-	
中信	20220428000 01143	宁德	2022-04 -28	9,958,750. 00	25,700. 00	28	1.90	14,716 .82	-	-	

证券		时代								
中信证券	20220428000 08714	翔丰华	2022-04 -28	34,840.00	1,000.0 0	28	1.80	48.78	-	-
中信证券	20220428000 08950	当升科技	2022-04 -28	222,054.0 0	3,400.0 0	28	1.80	310.88	-	-
中信证券	20220428000 08954	新宙邦	2022-04 -28	174,960.0 0	2,700.0 0	28	1.80	244.94	-	-
中信证券	20220428000 08958	汇川技术	2022-04 -28	1,448,328. 00	25,900. 00	28	1.80	2,027. 66	-	-
中信证券	20220428000 08966	亿纬锂能	2022-04 -28	351,960.0 0	5,600.0 0	28	1.80	492.74	-	-
中信证券	20220428000 08974	特锐德	2022-04 -28	74,704.00	5,600.0 0	28	1.80	104.59	-	-
中信证券	20220428000 08980	寒锐钴业	2022-04 -28	100,140.0 0	2,000.0 0	28	1.80	140.20	-	-
中信证券	20220428000 08982	宁德时代	2022-04 -28	813,750.0 0	2,100.0 0	28	1.80	1,139. 25	-	-
中信证券	20220505000 01668	当升科技	2022-05 -05	1,997,619. 00	29,900. 00	14	3.40	2,641. 30	-	-
中信证券	20220505000 59447	新宙邦	2022-05 -05	701,480.0 0	10,400. 00	14	1.80	491.04	-	-
中信	20220505000 59449	先导	2022-05 -05	969,556.0 0	21,700. 00	14	1.80	678.69	-	-

证券		智能								
中信证券	20220505000 72233	中伟股份	2022-05 -05	1,520,700. 00	18,500. 00	28	2.70	3,193. 47	-	-
中信证券	20220505000 72343	翔丰华	2022-05 -05	36,600.00	1,000.0 0	14	4.20	59.78	-	-
中信证券	20220505000 72349	特锐德	2022-05 -05	49,680.00	3,600.0 0	14	3.20	61.82	-	-
中信证券	20220505000 72351	新宙邦	2022-05 -05	121,410.0 0	1,800.0 0	14	2.30	108.59	-	-
中信证券	20220505000 72735	当升科技	2022-05 -05	2,084,472. 00	31,200. 00	14	2.30	1,864. 44	-	-
中信证券	20220505000 72737	寒锐钴业	2022-05 -05	360,570.0 0	7,000.0 0	28	2.90	813.29	-	-
中信证券	20220505000 72743	寒锐钴业	2022-05 -05	154,530.0 0	3,000.0 0	14	3.00	180.29	-	-
中信证券	20220506000 14643	宁德时代	2022-05 -06	488,787.0 0	1,300.0 0	14	1.80	342.15	-	-
中信证券	20220510000 15021	寒锐钴业	2022-05 -10	1,039,170. 00	20,100. 00	14	3.00	1,212. 37	-	-
中信证券	20220510000 15027	新宙邦	2022-05 -10	2,029,456. 00	28,600. 00	14	2.30	1,815. 24	-	-
中信	202205110001 1740	新宙	2022-04 -28	1,836.00	-	28	1.80	-	-	-

证券		邦								
中信证券	202205110001 1770	新宙邦	2022-05 -05	7,072.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	202205110001 1872	新宙邦	2022-05 -05	1,224.00	-	14	2.30	-	-	-
中信证券	202205110001 1946	新宙邦	2022-05 -10	19,448.00	-	14	2.30	-	-	-
中信证券	202205110001 1984	新宙邦	2022-04 -28	-	2,160.0 0	28	1.80	-	-	-
中信证券	202205110001 2014	新宙邦	2022-05 -05	-	8,320.0 0	14	1.80	-	-	-
中信证券	202205110001 2116	新宙邦	2022-05 -05	-	1,440.0 0	14	2.30	-	-	-
中信证券	202205110001 2190	新宙邦	2022-05 -10	-	22,880. 00	14	2.30	-	-	-
中信证券	20220512000 00921	亿纬锂能	2022-05 -12	2,027,575. 00	27,500. 00	14	3.40	2,680. 90	-	-
中信证券	20220512000 09960	亿纬锂能	2022-05 -12	294,920.0 0	4,000.0 0	28	1.80	412.89	-	-
中信证券	20220512000 09964	亿纬锂能	2022-05 -12	1,872,742. 00	25,400. 00	28	1.80	2,621. 84	-	-
中信	20220512000 09968	当升	2022-05 -12	796,424.0 0	11,300. 00	28	3.30	2,044. 15	-	-

证券		科技								
中信证券	20220517000 00848	先导智能	2022-05 -17	1,042,902. 00	21,700. 00	14	1.80	730.03	-	-
中信证券	20220517000 00856	当升科技	2022-05 -17	970,554.0 0	13,800. 00	14	1.80	679.39	-	-
中信证券	20220517000 00867	寒锐钴业	2022-05 -17	625,370.0 0	11,500. 00	14	1.80	437.76	-	-
中信证券	20220518000 00832	寒锐钴业	2022-05 -18	1,986,096. 00	36,800. 00	14	3.10	2,394. 35	-	-
中信证券	20220518000 00844	当升科技	2022-05 -18	1,970,960. 00	28,400. 00	14	3.50	2,682. 70	-	-
中信证券	20220519000 47939	翔丰华	2022-05 -19	42,370.00	1,000.0 0	14	3.70	60.97	-	-
中信证券	20220519000 52299	特锐德	2022-05 -19	53,748.00	3,600.0 0	14	3.30	68.98	-	-
中信证券	20220519000 52321	亿纬锂能	2022-05 -19	79,700.00	1,000.0 0	28	3.30	204.56	-	-
中信证券	20220519000 52361	新宙邦	2022-05 -19	76,896.00	1,800.0 0	14	2.20	65.79	-	-
中信证券	20220519000 52383	当升科技	2022-05 -19	2,146,820. 00	29,900. 00	14	3.20	2,671. 60	-	-
中信	20220520000 15874	宁德时代	2022-05 -20	554,970.0 0	1,300.0 0	14	1.80	471.73	-	-

证 券		时 代								
中 信 证 券	20220524000 00899	新 宙 邦	2022-05 -24	1,913,960. 00	47,200. 00	14	2.90	2,158. 52	-	-
中 信 证 券	20220524000 07464	寒 锐 钻 业	2022-05 -24	1,059,069. 00	20,100. 00	14	3.10	1,276. 77	-	-
中 信 证 券	20220524000 07470	新 宙 邦	2022-05 -24	1,159,730. 00	28,600. 00	14	2.70	1,217. 72	-	-
中 信 证 券	20220525000 10051	当 升 科 技	2022-04 -28	1,441.60	-	28	1.80	-	-	-
中 信 证 券	20220525000 10079	当 升 科 技	2022-05 -12	4,791.20	-	28	3.30	-	-	-
中 信 证 券	20220525000 10092	当 升 科 技	2022-05 -17	5,851.20	-	14	1.80	-	-	-
中 信 证 券	20220525000 10102	当 升 科 技	2022-05 -18	12,041.60	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	20220525000 10209	当 升 科 技	2022-05 -19	12,677.60	-	14	3.20	-	-	-
中 信 证 券	20220526000 06906	亿 纬 锂 能	2022-05 -26	428,176.0 0	5,600.0 0	14	1.80	299.72	-	-
中 信 证 券	20220526000 06914	宁 德 时 代	2022-05 -26	10,023,25 7.00	25,700. 00	14	1.90	7,406. 07	-	-
中 信	20220526000 10534	汇 川	2022-05 -26	1,530,431. 00	25,900. 00	14	1.80	1,071. 30	-	-

证券		技术								
中信证券	2022052600010542	当升科技	2022-05-26	225,284.00	3,400.00	14	1.80	157.70	-	-
中信证券	2022052600010576	宁德时代	2022-05-26	819,021.00	2,100.00	14	1.80	573.31	-	-
中信证券	2022052600011516	特锐德	2022-05-26	88,648.00	5,600.00	14	1.80	62.05	-	-
中信证券	2022052600011528	新宙邦	2022-05-26	106,596.00	2,700.00	14	1.80	74.62	-	-
中信证券	2022052600011534	亿纬锂能	2022-05-26	4,878,148.00	63,800.00	14	1.90	3,604.41	-	-
中信证券	2022052600011542	翔丰华	2022-05-26	42,000.00	1,000.00	14	1.80	29.40	-	-
中信证券	2022052600011544	寒锐钴业	2022-05-26	106,000.00	2,000.00	14	1.80	74.20	-	-
中信证券	2022052600012708	中伟股份	2022-05-05	3,087.64	-	28	2.70	-	-	-
中信证券	2022053100001359	新宙邦	2022-05-31	72,360.00	1,800.00	14	3.30	92.86	-	-
中信证券	2022053100001387	先导智能	2022-05-31	276,678.00	5,700.00	14	2.10	225.95	-	-
中信	2022053100001397	亿纬	2022-05-31	554,967.00	6,900.00	14	2.80	604.30	-	-

证券		锂能								
中信证券	20220531000 01402	特锐德	2022-05 -31	58,716.00	3,600.0 0	14	3.40	77.64	-	-
中信证券	20220531000 08641	先导智能	2022-05 -31	1,053,318. 00	21,700. 00	14	1.80	737.32	-	-
中信证券	20220531000 08643	当升科技	2022-05 -31	963,240.0 0	13,800. 00	14	1.80	674.27	-	-
中信证券	20220531000 09653	寒锐钴业	2022-05 -31	619,390.0 0	11,500. 00	14	1.80	433.57	-	-
中信证券	20220601000 04526	当升科技	2022-06 -01	2,001,916. 00	28,400. 00	14	3.20	2,491. 27	-	-
中信证券	20220601000 04528	寒锐钴业	2022-06 -01	1,993,088. 00	36,800. 00	14	3.10	2,402. 78	-	-
中信证券	20220602000 01033	特锐德	2022-06 -02	854,782.0 0	51,400. 00	14	3.40	1,130. 21	-	-
中信证券	20220602000 13440	当升科技	2022-06 -02	2,239,510. 00	29,900. 00	14	3.20	2,786. 95	-	-
中信证券	20220602000 13446	中伟股份	2022-06 -02	2,016,500. 00	18,500. 00	14	3.50	2,744. 68	-	-
中信证券	20220602000 13454	寒锐钴业	2022-06 -02	386,120.0 0	7,000.0 0	14	3.10	465.49	-	-
中信	20220606000 10310	宁德时代	2022-06 -06	605,787.0 0	1,300.0 0	14	1.80	424.05	-	-

证券		时代								
中信证券	20220607000 07568	寒锐钴业	2022-06 -07	1,134,243. 00	20,100. 00	14	3.60	1,587. 94	-	-
中信证券	20220607000 09068	新宙邦	2022-06 -07	2,041,400. 00	47,200. 00	14	3.30	2,619. 80	-	-
中信证券	20220608000 01128	寒锐钴业	2022-06 -08	667,602.0 0	11,700. 00	14	3.40	882.72	-	-
中信证券	20220608000 01131	寒锐钴业	2022-06 -08	656,190.0 0	11,500. 00	14	2.10	535.89	-	-
中信证券	20220609000 06957	宁德时代	2022-06 -09	905,835.0 0	2,100.0 0	14	1.80	634.08	-	-
中信证券	20220609000 06961	宁德时代	2022-06 -09	11,085,69 5.00	25,700. 00	14	1.90	8,191. 10	-	-
中信证券	20220609000 07021	寒锐钴业	2022-06 -09	111,120.0 0	2,000.0 0	14	1.80	77.78	-	-
中信证券	20220609000 07037	亿纬锂能	2022-06 -09	5,831,958. 00	63,800. 00	14	1.90	4,309. 17	-	-
中信证券	20220609000 07041	亿纬锂能	2022-06 -09	511,896.0 0	5,600.0 0	14	1.80	358.33	-	-
中信证券	20220609000 07045	新宙邦	2022-06 -09	114,858.0 0	2,700.0 0	14	1.80	80.40	-	-
中信	20220609000 07047	特锐	2022-06 -09	90,328.00	5,600.0 0	14	1.80	63.23	-	-

证券		德								
中信证券	20220609000 07055	汇川技术	2022-06 -09	1,670,809. 00	25,900. 00	14	1.80	1,169. 57	-	-
中信证券	20220609000 07063	当升科技	2022-06 -09	259,080.0 0	3,400.0 0	14	1.80	181.36	-	-
中信证券	20220609000 07965	当升科技	2022-06 -09	861,060.0 0	11,300. 00	14	3.40	1,138. 51	-	-
中信证券	20220614000 06446	当升科技	2022-06 -14	1,149,402. 00	13,800. 00	14	1.80	804.58	-	-
中信证券	20220614000 06448	先导智能	2022-06 -14	1,366,449. 00	21,700. 00	14	1.80	956.51	-	-
中信证券	20220614000 06480	寒锐钴业	2022-06 -14	671,140.0 0	11,500. 00	14	1.80	469.80	-	-
中信证券	20220614000 07708	特锐德	2022-06 -14	62,244.00	3,600.0 0	14	3.40	82.30	-	-
中信证券	20220614000 07732	新宙邦	2022-06 -14	85,608.00	1,800.0 0	14	3.40	113.19	-	-
中信证券	20220614000 07772	先导智能	2022-06 -14	358,929.0 0	5,700.0 0	14	1.60	223.33	-	-
中信证券	20220614000 07858	亿纬锂能	2022-06 -14	695,589.0 0	6,900.0 0	14	3.20	865.62	-	-
中信	20220614000 08242	寒锐	2022-06 -01	15,824.00	-	14	3.10	-	-	-

证券		钴业								
中信证券	20220614000 08256	寒锐钴业	2022-06 -02	3,010.00	-	14	3.10	-	-	-
中信证券	20220614000 08302	寒锐钴业	2022-06 -07	8,643.00	-	14	3.60	-	-	-
中信证券	20220614000 08313	寒锐钴业	2022-06 -08	5,031.00	-	14	3.40	-	-	-
中信证券	20220614000 08315	寒锐钴业	2022-06 -08	4,945.00	-	14	2.10	-	-	-
中信证券	20220614000 08334	寒锐钴业	2022-06 -09	860.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	20220614000 08424	寒锐钴业	2022-06 -14	4,945.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	20220615000 23151	当升科技	2022-06 -15	2,323,120.00	28,400.00	14	3.40	3,071.68	-	-
中信证券	20220615000 23591	寒锐钴业	2022-06 -15	2,098,704.00	36,800.00	14	3.40	2,774.95	-	-
中信证券	20220616000 14035	特锐德	2022-06 -16	873,286.00	51,400.00	14	3.40	1,154.68	-	-
中信证券	20220616000 14043	寒锐钴业	2022-06 -16	399,700.00	7,000.00	14	3.40	528.49	-	-
中信	20220616000 16575	亿纬	2022-06 -16	95,500.00	1,000.00	14	3.20	118.84	-	-

证券		锂能								
中信证券	20220622000 02647	宁德时代	2022-06 -22	25,350,00 0.00	50,000. 00	14	3.20	18,026 .67	26,700,00 0.00	18,026 .67
中信证券	20220622000 02704	特锐德	2022-06 -22	1,993,572. 00	117,200 .00	14	3.30	1,461. 95	2,028,732. 00	1,461. 95
中信证券	20220622000 13335	寒锐钴业	2022-06 -22	650,555.0 0	11,500. 00	14	2.10	303.59	666,080.0 0	303.59
中信证券	20220623000 01754	震裕科技	2022-06 -23	154,590.0 0	1,000.0 0	28	1.80	54.11	136,990.0 0	54.11
中信证券	20220623000 01756	中伟股份	2022-06 -23	138,985.0 0	1,100.0 0	28	1.80	48.65	136,290.0 0	48.65
中信证券	20220623000 01758	亿纬锂能	2022-06 -23	235,400.0 0	2,200.0 0	28	1.80	82.39	214,500.0 0	82.39
中信证券	20220623000 01759	亿纬锂能	2022-06 -23	181,900.0 0	1,700.0 0	28	1.80	63.67	165,750.0 0	63.67
中信证券	20220623000 01760	先导智能	2022-06 -23	2,290,848. 00	33,600. 00	28	1.80	801.80	2,124,886. 49	801.80
中信证券	20220623000 01779	赢合科技	2022-06 -23	125,028.0 0	4,600.0 0	28	1.80	43.76	130,686.0 0	43.76
中信证券	20220623000 01826	容百科技	2022-06 -23	520,495.0 0	4,100.0 0	28	1.80	182.17	530,704.0 0	182.17
中信	20220623000 01828	嘉元	2022-06 -23	262,170.0 0	3,000.0 0	28	1.80	91.76	254,610.0 0	91.76

证券		科技								
中信证券	20220623000 01830	亿华通	2022-06 -23	100,530.0 0	1,000.0 0	28	1.80	35.19	98,380.00	35.19
中信证券	20220623000 01832	联赢激光	2022-06 -23	131,364.0 0	3,600.0 0	28	1.80	45.98	122,580.6 0	45.98
中信证券	20220623000 01834	天奈科技	2022-06 -23	488,768.0 0	3,200.0 0	28	1.80	171.07	542,336.0 0	171.07
中信证券	20220623000 07777	亿纬锂能	2022-06 -23	6,826,600. 00	63,800. 00	14	1.90	2,522. 05	6,220,500. 00	2,522. 05
中信证券	20220623000 07785	亿纬锂能	2022-06 -23	599,200.0 0	5,600.0 0	14	1.80	209.72	546,000.0 0	209.72
中信证券	20220623000 07813	当升科技	2022-06 -23	319,770.0 0	3,400.0 0	14	1.80	111.92	307,156.0 0	111.92
中信证券	20220623000 07817	汇川技术	2022-06 -23	1,762,495. 00	25,900. 00	14	1.80	616.88	1,713,354. 68	616.88
中信证券	20220623000 07819	新宙邦	2022-06 -23	126,981.0 0	2,700.0 0	14	1.80	44.45	141,912.0 0	44.45
中信证券	20220623000 07889	宁德时代	2022-06 -23	1,127,637. 00	2,100.0 0	14	1.80	394.68	1,121,400. 00	394.68
中信证券	20220623000 07895	寒锐钴业	2022-06 -23	116,180.0 0	2,000.0 0	14	1.80	40.67	115,840.0 0	40.67
中信	20220623000 08165	特锐	2022-06 -23	99,848.00	5,600.0 0	14	1.80	34.95	96,936.00	34.95

证券		德								
中信证券	20220623000 08419	宁德时代	2022-06 -23	13,800,12 9.00	25,700. 00	14	1.90	5,098. 38	13,723,80 0.00	5,098. 38
中信证券	20220623000 09069	当升科技	2022-06 -23	1,062,765. 00	11,300. 00	14	3.20	661.28	1,020,842. 00	661.28
中信证券	20220624000 09674	先导智能	2022-06 -14	10,850.00	-	14	1.80	-	-	-
中信证券	20220624000 09684	先导智能	2022-06 -14	2,850.00	-	14	1.60	-	-	-
中信证券	20220624000 09935	先导智能	2022-06 -23	16,800.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中信证券	20220628000 01361	震裕科技	2022-06 -28	144,700.0 0	1,000.0 0	14	3.40	27.33	136,990.0 0	27.33
中信证券	20220628000 01362	特锐德	2022-06 -28	344,660.0 0	19,000. 00	14	3.30	63.19	328,890.0 0	63.19
中信证券	20220628000 01375	寒锐钴业	2022-06 -28	241,520.0 0	4,000.0 0	14	3.30	44.28	231,680.0 0	44.28
中信证券	20220628000 08658	先导智能	2022-06 -28	386,745.0 0	5,700.0 0	14	2.60	55.86	360,471.8 2	55.86
中信证券	20220628000 08660	亿纬锂能	2022-06 -28	719,877.0 0	6,900.0 0	14	2.60	103.98	672,750.0 0	103.98
中信	20220628000 08662	特锐	2022-06 -28	65,304.00	3,600.0 0	14	3.30	11.97	62,316.00	11.97

证券		德								
中信证券	20220628000 08664	新宙邦	2022-06 -28	101,052.0 0	1,800.0 0	14	3.30	18.53	94,608.00	18.53
中信证券	20220628000 10826	当升科技	2022-06 -28	1,298,580. 00	13,800. 00	14	1.80	129.86	1,246,692. 00	129.86
中信证券	20220628000 10842	寒锐钴业	2022-06 -28	694,370.0 0	11,500. 00	14	1.80	69.44	666,080.0 0	69.44
中信证券	20220628000 10844	先导智能	2022-06 -28	1,472,345. 00	21,700. 00	14	1.80	147.23	1,372,322. 53	147.23
中信证券	20220628000 12598	汇川技术	2022-06 -23	7,770.00	-	14	1.80	-	0.00	-
中信证券	20220628000 13603	联赢激光	2022-06 -23	432.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中信证券	20220629000 23324	当升科技	2022-06 -29	2,561,112. 00	28,400. 00	14	3.20	227.65	2,565,656. 00	227.65
中信证券	20220629000 23326	寒锐钴业	2022-06 -29	2,120,784. 00	36,800. 00	14	3.30	194.41	2,131,456. 00	194.41
中信证券	20220630000 21507	寒锐钴业	2022-06 -30	405,440.0 0	7,000.0 0	14	3.30	520.31	405,440.0 0	-
中信证券	20220630000 21533	特锐德	2022-06 -30	889,734.0 0	51,400. 00	14	3.30	1,141. 83	889,734.0 0	-
中信	20220704000 17601	天奈	2022-06 -23	220.80	-	28	1.80	-	0.00	-

证券		科技								
中信证券	202207070001 1296	亿纬锂能	2022-06 -23	352.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中信证券	202207070001 1297	亿纬锂能	2022-06 -23	272.00	-	28	1.80	-	0.00	-
中信证券	202207070001 1355	亿纬锂能	2022-06 -28	1,104.00	-	14	2.60	-	0.00	-

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
华夏中证新能源汽车ETF发起式联接	139,479,995.00	1.84%	104,850,100.00	1.89%
中信中证资本	15,728,100.00	0.21%	7,514,900.00	0.14%
中信证券	14,667,633.00	0.19%	4,104,610.00	0.07%

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
中国银行活期存款	76,811,380.49	78,931.71	59,341,267.90	81,350.25

注：本基金的活期银行存款由基金托管人中国银行保管，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	688343	云天励飞	新股发行	24,961	1,096,287.12
中信证券	688146	中船特气	新股发行	10,101	365,151.15
中信证券	001286	陕西能源	新股发行	37,667	361,603.20
中信证券	688581	安杰思	新股发行	1,629	204,928.20
中信证券	688539	高华科技	新股发行	5,334	203,865.48
中信证券	688522	纳睿雷达	新股发行	4,299	200,677.32
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	688523	航天环宇	新股发行	4,717	103,113.62
中信证券	301293	三博脑科	新股发行	3,324	98,390.40
中信证券	301323	新莱福	新股发行	2,277	88,939.62
中信证券	688631	莱斯信息	新股发行	3,357	84,864.96
中信证券	301170	锡南科技	新股发行	2,496	84,864.00
中信证券	301157	华塑科技	新股发行	1,498	84,637.00
中信证券	601133	柏诚股份	新股发行	6,632	77,329.12
中信证券	301261	恒工精密	新股发行	1,973	72,803.70
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17
中信证券	001367	海森药业	新股发行	549	24,419.52
中信证券	001324	长青科技	新股发行	1,131	21,353.28
中信证券	603162	海通发展	新股发行	523	19,481.75
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	600938	中国海油	新股发行	120,005	1,296,054.00
中信证券	688223	晶科能源	新股发行	213,000	1,065,000.00
中信证券	688326	经纬恒润	新股发行	6,832	826,672.00
中信证券	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	688302	海创药业	新股发行	13,082	561,479.44
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	688150	莱特光电	新股发行	5,626	124,053.30
中信证券	688290	景业智能	新股发行	3,040	103,025.60
中信证券	603132	金徽股份	新股发行	1,342	14,493.60

中信证券	603191	望变电气	新股发行	1,149	13,627.14
中信证券	603209	兴通股份	新股发行	595	12,804.40
中信证券	001266	宏英智能	新股发行	247	9,536.67
中信证券	603215	比依股份	新股发行	575	7,187.50
中信证券	603051	鹿山新材	新股发行	272	7,014.88

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
301486	致尚科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	57.66	57.66	4,338	250,129.08	250,129.08	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6 个月	新发流通受限	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1 个月内(含)	新发流通受限	26.68	26.68	4,676	124,755.68	124,755.68	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6 个月	新发	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-

				流通受限						
301292	海科新源	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	19.99	19.99	5,241	104,767.59	104,767.59	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1 个月内(含)	新发流通受限	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
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	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
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	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1 个月内(含)	新发流通	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-

				受限						
688603	天承科技	2023-06-30	1 个月内(含)	新发流通受限	55.00	55.00	1,251	68,805.00	68,805.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1 个月内(含)	新发流通受限	36.90	36.90	1,775	65,497.50	65,497.50	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6 个月	新发流通受限	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6 个月	新发流通受限	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-
301291	明阳电气	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	38.13	31.03	1,206	45,984.78	37,422.18	-

688484	南芯科技	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	39.99	36.71	1,008	40,309.92	37,003.68	-
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	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	57.66	57.66	482	27,792.12	27,792.12	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	含 证 券 送 配
301310	鑫宏业	2023-05-26	6 个月	新发	67.28	65.43	409	27,517.52	26,760.87	-

				流通受限						
688582	芯动联科	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6 个月	新发流通受限	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
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	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6 个月	新发流通受限	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6 个月	新发流通	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-

				受限						
301322	绿通科技	2023-02-27	6 个月	新发流通受限	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	含证券送配
688458	美芯晟	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
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	-
301262	海看股份	2023-06-13	6 个月	新发流通受限	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
301383	天键股份	2023-05-31	6 个月	新发流通受限	46.16	35.72	493	22,756.88	17,609.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-

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	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	溯联股份	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301387	光大同创	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	58.32	45.36	307	17,904.24	13,925.52	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6 个月	新发流通受限	26.68	26.68	520	13,873.60	13,873.60	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6 个月	新发	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-

				流通受限						
688512	慧智微	2023-05-08	6 个月	新发流通受限	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
688433	华曙高科	2023-04-07	6 个月	新发流通受限	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6 个月	新发流通受限	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
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	-
301292	海科新源	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	19.99	19.99	583	11,654.17	11,654.17	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6 个月	新发流通	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-

				受限						
603135	中重科技	2023-03-29	6 个月	新发流通受限	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
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	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6 个月	新发流通受限	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6 个月	新发流通受限	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	莱斯信息	2023-06-19	6 个月	新发流通受限	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-

688479	友车科技	2023-05-04	6 个月	新发流通受限	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6 个月	新发流通受限	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6 个月	新发流通受限	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6 个月	新发流通受限	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6 个月	新发流通受限	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
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	-
301323	新莱福	2023-05-29	6 个月	新发流通受限	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023-06-20	6 个月	新发	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-

				流通受限						
301170	锡南科技	2023-06-16	6 个月	新发流通受限	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
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
688535	华海诚科	2023-03-28	6 个月	新发流通受限	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6 个月	新发流通受限	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
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	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6 个月	新发流通受限	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
301295	美硕科技	2023-06-19	6 个月	新发流通	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

				受限						
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	-
688603	天承科技	2023-06-30	6 个月	新发流通受限	55.00	55.00	140	7,700.00	7,700.00	-
300804	广康生化	2023-06-15	6 个月	新发流通受限	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6 个月	新发流通受限	36.90	36.90	198	7,306.20	7,306.20	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6 个月	新发流通受限	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6 个月	新发流通受限	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6 个月	新发流通受限	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-

603125	常青科技	2023-03-30	6 个月	新发流通受限	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
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	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6 个月	新发流通受限	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-
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	-
001324	长青科技	2023-05-12	6 个月	新发流通受限	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
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	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6 个月	新发流通受限	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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

无。

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	002050	三花智控	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 18 日	30.26	2,967,000.00	89,781,420.00
2	603799	华友钴业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 18 日	45.91	1,655,600.00	76,008,596.00
3	002812	恩捷股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 18 日	96.35	668,200.00	64,381,070.00
4	603659	璞泰来	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	38.22	1,322,600.00	50,549,772.00
5	300124	汇川技术	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	64.21	582,500.00	37,402,325.00
6	002738	中矿资源	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	50.94	620,900.00	31,628,646.00
7	002407	多氟多	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	19.86	1,534,400.00	30,473,184.00
8	300450	先导智能	2023 年 7 月 3 日	36.17	841,600.00	30,440,672.00

			-2023 年 7 月 14 日			
9	300390	天华新能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 18 日	35.80	718,400.00	25,718,720.00
10	688005	容百科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	54.02	454,400.00	24,546,688.00
11	002850	科达利	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	132.25	179,000.00	23,672,750.00
12	002240	盛新锂能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	31.87	627,200.00	19,988,864.00
13	002497	雅化集团	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 24 日	17.78	787,200.00	13,996,416.00
14	688116	天奈科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	45.75	298,700.00	13,665,525.00
15	688707	振华新材	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.79	341,100.00	10,502,469.00
16	688006	杭可科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.47	280,100.00	8,534,647.00
17	300037	新宙邦	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	51.89	142,800.00	7,409,892.00
18	300432	富临精工	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	11.62	623,900.00	7,249,718.00
19	300750	宁德时代	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	228.79	31,600.00	7,229,764.00
20	688567	孚能科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	21.59	312,000.00	6,736,080.00
21	002594	比亚迪	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	258.27	19,500.00	5,036,265.00
22	002192	融捷股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	66.83	75,300.00	5,032,299.00
23	300769	德方纳米	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	110.23	38,000.00	4,188,740.00
24	002709	天赐材料	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	41.19	101,100.00	4,164,309.00
25	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	60.96	67,500.00	4,114,800.00
26	002340	格林美	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	6.91	592,800.00	4,096,248.00
27	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	69.91	57,700.00	4,033,807.00
28	600563	法拉电子	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	137.30	28,100.00	3,858,130.00
29	600549	厦门钨业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	19.03	181,800.00	3,459,654.00
30	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 12 日	60.50	51,500.00	3,115,750.00

			-2023 年 7 月 14 日			
31	300568	星源材质	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	17.19	160,900.00	2,765,871.00
32	000009	中国宝安	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	12.07	209,800.00	2,532,286.00
33	000762	西藏矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	29.63	82,400.00	2,441,512.00
34	300073	当升科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	50.33	48,300.00	2,430,939.00
35	300919	中伟股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	60.25	40,100.00	2,416,025.00
36	002756	永兴材料	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	62.61	32,800.00	2,053,608.00
37	300001	特锐德	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	20.78	91,700.00	1,905,526.00
38	688499	利元亨	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	63.52	23,600.00	1,499,072.00
39	600885	宏发股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	31.85	46,000.00	1,465,100.00
40	603026	胜华新材	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	59.25	22,400.00	1,327,200.00
41	600884	杉杉股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	15.14	85,400.00	1,292,956.00
42	301219	腾远钴业	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 14 日	37.36	32,500.00	1,214,200.00
43	300035	中科电气	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	12.02	99,000.00	1,189,980.00
44	002074	国轩高科	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	27.62	40,300.00	1,113,086.00
45	600699	均胜电子	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 14 日	17.64	58,600.00	1,033,704.00
46	301238	瑞泰新材	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	20.34	42,300.00	860,382.00
47	688778	厦钨新能	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	49.50	10,400.00	514,800.00
48	600110	诺德股份	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 14 日	7.24	54,400.00	393,856.00
49	688779	长远锂科	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	11.27	31,900.00	359,513.00
合计	-	-	-	-	17,415,300.00	649,826,836.00

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	11,562,591,069.07	99.25	9,252,852,405.37	99.58
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	11,562,591,069.07	99.25	9,252,852,405.37	99.58
----	-------------------	-------	------------------	-------

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	除中证新能源汽车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%	-582,738,347.86	-455,560,357.50
	+5%	582,738,347.86	455,560,357.50

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	11,560,017,357.58
第二层次	865,434.18
第三层次	1,708,277.31
合计	11,562,591,069.07

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、境内证券涨跌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	11,562,591,069.07	98.47
	其中：股票	11,562,591,069.07	98.47
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	95,252,048.01	0.81
8	其他各项资产	84,077,681.78	0.72
9	合计	11,741,920,798.86	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 649,826,836.00 元，占本基金期末资产净值的 5.58%。

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	-	-
B	采矿业	191,508,819.13	1.64
C	制造业	11,189,041,337.46	96.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00

E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	38,587.92	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	108,230.44	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	22,566.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	181,803,650.80	1.56
	合计	11,562,590,563.29	99.25

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	5,217,101	1,193,620,537.79	10.25
2	002594	比亚迪	4,438,806	1,146,410,425.62	9.84
3	300124	汇川技术	13,597,951	873,124,433.71	7.49
4	300014	亿纬锂能	8,960,820	542,129,610.00	4.65
5	002466	天齐锂业	7,547,714	527,660,685.74	4.53
6	002460	赣锋锂业	8,238,682	502,230,054.72	4.31
7	002050	三花智控	15,728,613	475,947,829.38	4.09
8	603799	华友钴业	9,337,764	428,696,745.24	3.68
9	002812	恩捷股份	4,284,030	412,766,290.50	3.54
10	002709	天赐材料	8,431,616	347,298,263.04	2.98
11	300450	先导智能	8,005,319	289,552,388.23	2.49
12	603659	璞泰来	7,362,297	281,386,991.34	2.42
13	002340	格林美	37,484,467	259,017,666.97	2.22
14	002074	国轩高科	7,789,194	215,137,538.28	1.85
15	002738	中矿资源	4,162,446	212,034,999.24	1.82
16	300037	新宙邦	3,810,093	197,705,725.77	1.70
17	600885	宏发股份	6,088,663	193,923,916.55	1.66
18	000009	中国宝安	15,062,440	181,803,650.80	1.56
19	300769	德方纳米	1,615,955	178,126,719.65	1.53
20	300568	星源材质	9,353,829	160,792,320.51	1.38
21	002407	多氟多	7,817,345	155,252,471.70	1.33
22	300390	天华新能	4,281,815	153,288,977.00	1.32

23	002497	雅化集团	8,412,500	149,574,250.00	1.28
24	300073	当升科技	2,958,404	148,896,473.32	1.28
25	002240	盛新锂能	4,658,537	148,467,574.19	1.27
26	002756	永兴材料	2,360,424	147,786,146.64	1.27
27	002850	科达利	1,024,797	135,529,403.25	1.16
28	600563	法拉电子	983,547	135,041,003.10	1.16
29	688567	孚能科技	6,221,676	134,325,984.84	1.15
30	600884	杉杉股份	8,263,560	125,110,298.40	1.07
31	688005	容百科技	2,304,372	124,482,175.44	1.07
32	600699	均胜电子	6,989,061	123,287,036.04	1.06
33	600549	厦门钨业	6,211,149	118,198,165.47	1.01
34	300919	中伟股份	1,960,708	118,132,657.00	1.01
35	300001	特锐德	5,317,548	110,498,647.44	0.95
36	002192	融捷股份	1,516,300	101,334,329.00	0.87
37	000762	西藏矿业	3,043,351	90,174,490.13	0.77
38	688779	长远锂科	7,040,612	79,347,697.24	0.68
39	688116	天奈科技	1,697,007	77,638,070.25	0.67
40	600110	诺德股份	10,195,864	73,818,055.36	0.63
41	603026	胜华新材	1,186,301	70,288,334.25	0.60
42	300035	中科电气	5,279,996	63,465,551.92	0.54
43	300432	富临精工	5,339,571	62,045,815.02	0.53
44	688778	厦钨新能	1,230,875	60,928,312.50	0.52
45	688707	振华新材	1,939,737	59,724,502.23	0.51
46	688006	杭可科技	1,762,386	53,699,901.42	0.46
47	301238	瑞泰新材	1,605,198	32,649,727.32	0.28
48	001301	尚太科技	570,400	32,119,224.00	0.28
49	301219	腾远钴业	859,639	32,116,113.04	0.28
50	688499	利元亨	357,965	22,737,936.80	0.20
51	301291	明阳电气	12,054	391,066.98	0.00
52	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
53	301397	溯联股份	3,618	152,606.80	0.00
54	301210	金杨股份	2,801	143,168.37	0.00
55	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
56	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
57	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
58	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
59	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
60	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
61	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
62	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
63	300804	广康生化	2,257	77,134.83	0.00
64	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
65	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00

66	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
67	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
68	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
69	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
70	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
71	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
72	688484	南芯科技	1,008	37,003.68	0.00
73	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
74	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
75	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
76	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
77	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
78	301310	鑫宏业	409	26,760.87	0.00
79	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
80	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
81	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
82	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
83	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
84	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
85	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
86	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
87	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
88	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
89	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
90	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
91	301383	天键股份	493	17,609.96	0.00
92	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
93	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
94	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
95	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
96	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
97	301387	光大同创	307	13,925.52	0.00
98	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
99	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
100	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
101	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
102	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
103	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
104	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
105	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
106	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
107	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
108	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00

109	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
110	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
111	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
112	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
113	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
114	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
115	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
116	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
117	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
118	301170	锡南科技	250	8,732.50	0.00
119	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
120	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
121	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
122	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
123	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
124	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
125	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
126	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
127	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
128	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
129	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
130	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
131	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
132	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
133	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
134	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	300750	宁德时代	850,804,722.77	9.16
2	002594	比亚迪	775,671,899.00	8.35
3	300124	汇川技术	521,692,722.04	5.61
4	300014	亿纬锂能	372,182,936.00	4.01
5	002466	天齐锂业	345,718,260.04	3.72
6	002460	赣锋锂业	326,778,368.67	3.52
7	002812	恩捷股份	297,683,578.93	3.20
8	002738	中矿资源	241,946,410.14	2.60
9	002050	三花智控	223,305,210.45	2.40
10	002709	天赐材料	208,094,123.09	2.24
11	300450	先导智能	188,805,678.90	2.03

12	002340	格林美	159,796,932.91	1.72
13	002756	永兴材料	158,594,109.84	1.71
14	002074	国轩高科	127,925,037.17	1.38
15	300769	德方纳米	118,266,680.39	1.27
16	300568	星源材质	115,156,653.28	1.24
17	300390	天华新能	114,200,497.23	1.23
18	300037	新宙邦	106,007,367.55	1.14
19	002497	雅化集团	104,200,985.03	1.12
20	002407	多氟多	103,374,165.15	1.11

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	300750	宁德时代	668,210,633.52	7.19
2	002594	比亚迪	584,622,751.44	6.29
3	300124	汇川技术	266,396,300.08	2.87
4	300014	亿纬锂能	192,967,863.78	2.08
5	002466	天齐锂业	182,737,730.82	1.97
6	002460	赣锋锂业	173,817,084.53	1.87
7	002812	恩捷股份	129,814,448.32	1.40
8	600066	宇通客车	121,845,655.09	1.31
9	002050	三花智控	120,939,043.42	1.30
10	002709	天赐材料	111,989,800.25	1.21
11	300450	先导智能	100,992,108.78	1.09
12	002340	格林美	83,944,212.51	0.90
13	002074	国轩高科	66,690,291.42	0.72
14	300618	寒锐钴业	65,793,935.19	0.71
15	300037	新宙邦	56,696,627.27	0.61
16	000009	中国宝安	53,859,614.88	0.58
17	002497	雅化集团	52,724,018.25	0.57
18	300073	当升科技	52,370,894.43	0.56
19	002407	多氟多	51,961,447.90	0.56
20	300390	天华新能	49,065,816.45	0.53

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	6,566,443,070.68
卖出股票收入（成交）总额	3,725,331,020.49

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

本基金本报告期末无股指期货投资。

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	3,565,151.07
2	应收清算款	79,270,252.35
3	应收股利	974,393.50
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	267,884.86

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	84,077,681.78

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	002050	三花智控	89,781,420.00	0.77	转融通出借证券受限
2	603799	华友钴业	76,008,596.00	0.65	转融通出借证券受限
3	002812	恩捷股份	64,381,070.00	0.55	转融通出借证券受限
4	300124	汇川技术	37,402,325.00	0.32	转融通出借证券受限
5	300750	宁德时代	7,229,764.00	0.06	转融通出借证券受限
6	002594	比亚迪	5,036,265.00	0.04	转融通出借证券受限
7	002709	天赐材料	4,164,309.00	0.04	转融通出借证券受限
8	002460	赣锋锂业	4,114,800.00	0.04	转融通出借证券受限
9	002466	天齐锂业	4,033,807.00	0.03	转融通出借证券受限
10	300014	亿纬锂能	3,115,750.00	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	华夏中证新能源汽车 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
151,861	49,942.93	4,091,756,218.00	53.95%	3,353,147,787.00	44.21%	139,479,995.00	1.84%

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	中国人寿保险股份有限公司	903,159,140.00	11.91%
2	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	259,966,500.00	3.43%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—分红一个险分红	211,573,400.00	2.79%
4	华夏基金—中央汇金资产管理有限责任公司—华夏基金—汇金资管单一资产管理计划	203,782,289.00	2.69%
5	大家人寿保险股份有限公司—传统产品	143,453,000.00	1.89%
6	大家人寿保险股份有限公司—分红产品	86,066,600.00	1.13%
7	汇添富基金—中国人寿保险股份有限公司—分红险—汇添富基金国寿股份成长股票型组合	77,010,400.00	1.02%
8	中信银行股份有限公司—中欧睿智精选一年持有期混合型基金中基金（FOF）	75,899,800.00	1.00%
9	北京诚通金控投资有限公司	70,622,638.00	0.93%
10	大家人寿保险股份有限公司—万能产品	57,465,800.00	0.76%
11	中国银行股份有限公司—华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	139,479,995.00	1.84%

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	53,800.00	0.00%

员持有本基金		
--------	--	--

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（2020年2月20日）基金份额总额	10,762,884,000.00
本报告期期初基金份额总额	5,548,384,000.00
本报告期基金总申购份额	4,288,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	2,252,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	7,584,384,000.00

§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

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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	
广发证券	3	3,128,351,129.36	30.46%	1,349,265.06	30.46%	-
长江证券	4	2,970,106,820.91	28.92%	1,281,014.55	28.92%	-
中信证券	23	1,391,901,163.10	13.55%	600,318.69	13.55%	-
招商证券	4	1,257,865,255.71	12.25%	542,520.74	12.25%	-
海通证券	5	425,876,279.92	4.15%	183,682.06	4.15%	-
华泰证券	3	419,385,091.59	4.08%	180,881.62	4.08%	-
中信建投证券	5	350,655,334.45	3.41%	151,239.21	3.41%	-
中金公司	4	257,061,810.53	2.50%	110,870.78	2.50%	-
天风证券	1	47,334,634.48	0.46%	20,414.80	0.46%	-
华安证券	1	23,003,053.10	0.22%	9,920.83	0.22%	-

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、财通证券、东北证券、东方财富证券、东方

证券、东海证券、东吴证券、东兴证券、方正证券、高华证券、国金证券、国盛证券、国泰君安证券、国信证券、华西证券、金通证券、南京证券、平安证券、瑞银证券、申万宏源证券、太平洋证券、万和证券、五矿证券、西部证券、西南证券、信达证券、兴业证券、野村东方国际、野村东方国际证券、银河证券、浙商证券、中国银河证券、中银国际证券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在上述租用的券商交易单元中，财通证券的交易单元为本基金本期新增的交易单元。本期没有剔除的券商交易单元。

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
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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	2023-01-06

		网站	
2	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	2023-01-19
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	2023-02-24
4	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
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	2023-03-11
6	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	2023-03-23
7	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	2023-03-30
8	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
9	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	2023-04-13
10	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	2023-04-15
11	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	2023-04-27
12	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	2023-05-13
13	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	2023-05-27
14	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	2023-05-31

§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

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

§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、《华夏中证新能源汽车交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证新能源汽车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