

华夏中证央企结构调整交易型开放式指数
证券投资基金
2023 年中期报告
2023 年 6 月 30 日

基金管理人：华夏基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年八月三十日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	1
§2 基金简介.....	3
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	4
3.1 主要会计数据和财务指标.....	4
3.2 基金净值表现.....	4
§4 管理人报告.....	5
§5 托管人报告.....	11
§6 中期报告财务会计报告（未经审计）.....	12
6.1 资产负债表.....	12
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	14
6.4 报表附注.....	16
§7 投资组合报告.....	130
7.1 期末基金资产组合情况.....	131
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	131
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.....	132
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	134
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	136
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.....	136
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.....	136
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.....	136
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.....	136
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	136
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	136
7.12 投资组合报告附注.....	136
§8 基金份额持有人信息.....	137
§9 开放式基金份额变动.....	139
§10 重大事件揭示.....	139
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	141
§12 备查文件目录.....	141

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	华夏中证央企 ETF
场内简称	央企改革（扩位证券简称：央企改革 ETF）
基金主代码	512950
交易代码	512950
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2018 年 10 月 19 日
基金管理人	华夏基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	4,476,550,969.00 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	2019 年 1 月 18 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、固定收益品种投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略等。
业绩比较基准	本基金业绩比较基准为标的指数收益率，即中证央企结构调整指数收益率。
风险收益特征	本基金属于股票基金，风险与收益高于混合基金、债券基金与货币市场基金。基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股，在股票基金中属于较高风险、较高收益的产品。

2.3 基金管理人和基金托管人

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

2.5 信息披露方式

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

2.6 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日）
本期已实现收益	125,039,485.74
本期利润	611,341,886.86
加权平均基金份额本期利润	0.1398
本期加权平均净值利润率	10.93%
本期基金份额净值增长率	12.58%
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	1,339,654,981.71
期末可供分配基金份额利润	0.2993
期末基金资产净值	5,816,205,950.71
期末基金份额净值	1.2993
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	29.93%

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	1.96%	0.92%	1.12%	0.93%	0.84%	-0.01%

月						
过去三个月	-0.55%	1.08%	-1.61%	1.09%	1.06%	-0.01%
过去六个月	12.58%	1.06%	11.45%	1.06%	1.13%	0.00%
过去一年	5.19%	1.00%	2.41%	1.01%	2.78%	-0.01%
过去三年	37.97%	1.18%	28.70%	1.19%	9.27%	-0.01%
自基金合同生效起至今	29.93%	1.21%	40.26%	1.23%	-10.33%	-0.02%

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

华夏中证央企结构调整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
 (2018 年 10 月 19 日至 2023 年 6 月 30 日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

华夏基金管理有限公司成立于 1998 年 4 月 9 日, 是经中国证监会批准成立的首批全国性基金管

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

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

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

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

固收与固收+产品：在 QDII 债券型基金(A 类)中，华夏大中华信用债券 (QDII) (A 类)排名第

1/24、华夏收益债券（QDII）（A 类）排名第 3/24；在短期纯债债券型基金（A 类）中，华夏 30 天滚动短债债券发起式（A 类）排名第 8/108；在长期纯债债券型基金（A 类）中，华夏鼎隆债券（A 类）排名前 6%（71/1228）、华夏鼎航债券（A 类）排名前 6%（76/1228）、华夏鼎英债券（A 类）排名前 7%（87/1228）；在普通债券型基金（可投转债）（A 类）中，华夏鼎禄三个月定开债券（A 类）排名前 9%（32/376）；在普通债券型基金（二级）（A 类）中，华夏恒融债券排名前 8%（30/368）。

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 (助理) 期限		证券从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
荣膺	本基金的 基金经 理、投委 会成员	2018-10-19	-	13 年	<p>硕士。2010 年 7 月加入华夏基金管理有限公司。历任研究发展部高级产品经理，数量投资部研究员、投资经理、基金经理助理、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、MSCI 中国 A 股交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2016 年 10 月 20 日至 2018 年 9 月 16 日期间）、上证主要消费交易型开放式指数发起式证券投资基金基金经理（2015 年 11 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏智胜价值成长股票型发起式证券投资基金基金经理（2018 年 3 月 6 日至 2020 年 3 月 18 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏 MSCI 中国 A 股国际通交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 9 月 17 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金经理（2018 年 11 月 14 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏创业板低波价值交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理（2019 年 6 月 26 日至 2021 年 10 月 21 日期间）、华夏沪港通上证 50AH 优选指数证券投资基金（LOF）基金经理（2016 年 10 月 27 日至 2022 年 8 月 22 日期间）、华夏创业</p>

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

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央企结构调整指数，中证央企结构调整指数以国资委下辖央企上市公司为待选样本，综合评估其在产业结构调整、科技创新投入、国际业务发展等方面的情况，以此选取其中较具代表性的企业股票构成指数，反映央企结构调整板块在 A 股市场的整体走势。截至 2023 年 6 月 30 日，中证央企结构调整指数成份股 100 只。本基金主要采用组合复制策略及适当的替代性策略以更好地跟踪标的指数，实现基金投资目标。

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

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

为促进本基金的市场流动性和平稳运行，经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包括方正证券股份有限公司、华泰证券股份有限公司、中国国际金融有限公司、中信证券股份有限公司、中信建投证券股份有限公司、海通证券股份有限公司、中泰证券股份有限公司、广发证券股份有限公司、国泰君安证券股份有限公司、招商证券股份有限公司、兴业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 1.2993 元，本报告期份额净值增长率为 12.58%，同期业绩比较基准增长率 11.45%。本基金本报告期跟踪偏离度为+1.13%，与业绩比较基准产生偏离的主要原因为成份股分红、日常运作费用、指数结构调整、申购赎回等产生的差异。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

本基金将会根据基金合同要求，在紧密跟踪标的指数的基础上，做好相关投资工作。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定及基金合同约定，本基金管理人为准确、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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 中期报告财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：华夏中证央企结构调整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	39,653,654.29	16,497,668.03
结算备付金		20,630,589.71	20,291,096.99
存出保证金		2,947,668.22	3,678,401.61
交易性金融资产	6.4.7.2	5,784,671,969.32	5,021,137,974.75
其中：股票投资		5,784,671,969.32	5,021,137,974.75
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		-	2,196,224.40
应收股利		618,520.99	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	131,447.12	93,092.70
资产总计		5,848,653,849.65	5,063,894,458.48
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		30,159,330.09	2,011,107.02
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		714,014.82	649,894.36
应付托管费		238,004.93	216,631.45
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		22,280.84	12,217.69
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,314,268.26	5,425,317.42
负债合计		32,447,898.94	8,315,167.94
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,476,550,969.00	4,380,550,969.00
未分配利润	6.4.7.8	1,339,654,981.71	675,028,321.54
净资产合计		5,816,205,950.71	5,055,579,290.54
负债和净资产总计		5,848,653,849.65	5,063,894,458.48

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 1.2993 元，基金份额总额 4,476,550,969.00 份。

6.2 利润表

会计主体：华夏中证央企结构调整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		617,849,658.32	-544,144,888.37
1.利息收入		3,756,460.68	3,412,355.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	235,630.82	417,736.68
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		3,520,829.86	2,994,619.25
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		126,737,202.18	120,678,898.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	65,317,533.79	74,622,888.60
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-
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	-72,818.46	-6,794,855.16
股利收益	6.4.7.14	61,492,486.85	52,850,865.08
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	486,302,401.12	-668,266,603.61
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	1,053,594.34	30,460.79
减：二、营业总支出		6,507,771.46	6,042,176.06
1.管理人报酬		4,161,800.44	3,858,782.22
2.托管费		1,387,266.87	1,286,260.76
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.17	-	-
7.税金及附加		12,811.37	10,780.92
8.其他费用	6.4.7.18	945,892.78	886,352.16
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		611,341,886.86	-550,187,064.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		611,341,886.86	-550,187,064.43
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		611,341,886.86	-550,187,064.43

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：华夏中证央企结构调整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）	4,380,550,969.00	-	675,028,321.54	5,055,579,290.54
二、本期期初净资产（基金净值）	4,380,550,969.00	-	675,028,321.54	5,055,579,290.54
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	96,000,000.00	-	664,626,660.17	760,626,660.17
（一）、综合收益	-	-	611,341,886.86	611,341,886.86

总额				
(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)	96,000,000.00	-	53,284,773.31	149,284,773.31
其中: 1.基金申购款	502,000,000.00	-	169,610,422.27	671,610,422.27
2.基金赎回款	-406,000,000.00	-	-116,325,648.96	-522,325,648.96
(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)	4,476,550,969.00	-	1,339,654,981.71	5,816,205,950.71
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)	4,251,550,969.00	-	1,547,522,581.65	5,799,073,550.65
二、本期期初净资产(基金净值)	4,251,550,969.00	-	1,547,522,581.65	5,799,073,550.65
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	11,000,000.00	-	-544,969,700.72	-533,969,700.72
(一)、综合收益总额	-	-	-550,187,064.43	-550,187,064.43
(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)	11,000,000.00	-	5,217,363.71	16,217,363.71
其中: 1.基金申购款	35,000,000.00	-	8,861,597.94	43,861,597.94
2.基金赎回款	-24,000,000.00	-	-3,644,234.23	-27,644,234.23
(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）	4,262,550,969.00	-	1,002,552,880.93	5,265,103,849.93
-----------------	------------------	---	------------------	------------------

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

华夏中证央企结构调整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[2018]949 号《关于准予华夏中证央企结构调整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》、《华夏中证央企结构调整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 2018 年 8 月 27 日至 2018 年 10 月 12 日共募集 15,887,305,303.00 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（2018）验字第 60739337_A30 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于 2018 年 10 月 19 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 15,887,550,969.00 份基金份额，其中认购资金利息折合 245,666.00 份基金份额。本基金的基金管理人为华夏基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《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，本基金可少量投资于非成份股（包括中小板、创业板及其他中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、企业债、公司债、次级债、可交换债券、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）等）、资产支持证券、债券回购、银行存款、同业存单、货币市场工具、衍生工具（包括股指期货、权证、国债期货、股票期权等）及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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	39,653,654.29
等于：本金	39,649,095.26
加：应计利息	4,559.03
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	39,653,654.29

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	5,444,169,396.44	-	5,784,671,969.32	340,502,572.88
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	5,444,169,396.44	-	5,784,671,969.32	340,502,572.88

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款的估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-

货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,606,300.00	-	-	-
其中：股指期货	22,606,300.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,606,300.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2312	沪深 300 期货 IF2312 合约	14	16,158,240.00	-342,660.00
IC2309	中证 500 期货 IC2309 合约	5	5,970,000.00	-135,400.00
合计	-	-	-	-478,060.00
减：可抵销期货暂收款	-	-	-	-478,060.00
净额	-	-	-	-

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应收利息	-
其他应收款	131,447.12
待摊费用	-
合计	131,447.12

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	634,228.93
其中：交易所市场	634,228.93
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	435,941.77
应退替代款	139,959.21
合计	1,314,268.26

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	4,380,550,969.00	4,380,550,969.00
本期申购	502,000,000.00	502,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-406,000,000.00	-406,000,000.00
本期末	4,476,550,969.00	4,476,550,969.00

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	1,692,515,176.77	-1,017,486,855.23	675,028,321.54
本期利润	125,039,485.74	486,302,401.12	611,341,886.86
本期基金份额交易产生的变动数	38,382,117.98	14,902,655.33	53,284,773.31
其中：基金申购款	197,399,883.37	-27,789,461.10	169,610,422.27
基金赎回款	-159,017,765.39	42,692,116.43	-116,325,648.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,855,936,780.49	-516,281,798.78	1,339,654,981.71

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	76,603.05
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	157,472.04
其他	1,555.73
合计	235,630.82

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	35,807,144.56
股票投资收益——赎回差价收入	29,510,389.23
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	65,317,533.79

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	757,670,744.08
减：卖出股票成本总额	720,275,467.40
减：交易费用	1,588,132.12
买卖股票差价收入	35,807,144.56

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	522,325,648.96
减：现金支付赎回款总额	171,843,362.96
减：赎回股票成本总额	320,971,896.77
减：交易费用	-
赎回差价收入	29,510,389.23

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年6月30日
股指期货投资收益	-72,818.46

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	61,492,486.85
其中：证券出借权益补偿收入	1,435,829.55
基金投资产生的股利收益	-
合计	61,492,486.85

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	485,911,041.12
——股票投资	485,911,041.12
——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	391,360.00
——权证投资	-
——期货投资	391,360.00
4.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的 预估增值税	-
合计	486,302,401.12

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	1,053,594.34
合计	1,053,594.34

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	44,630.98
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行费用	9,394.35
指数使用费	832,360.08
合计	945,892.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
华夏基金管理有限公司	基金管理人
中国农业银行股份有限公司（“中国农业银行”）	基金托管人
华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金（“华夏中证央企 ETF 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	1,234,999,790.96	75.85%	400,578,527.14	24.72%

6.4.10.1.2 债券交易

无。

6.4.10.1.3 债券回购交易

无。

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	532,640.96	75.85%	467,334.41	73.69%
关联方名称	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券	172,765.69	24.72%	172,765.69	19.88%

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	4,161,800.44	3,858,782.22
其中：支付销售机构的客户维护费	2,928.87	794.50

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 0.15%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×0.15%/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	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年6月30日	2022年1月1日至2022年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,387,266.87	1,286,260.76

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 0.05%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×0.05%/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	539,670,848.00	366,765.70	-	-
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	1,511,930,469.67	1,075,383.72	130,243,019.13	46,118.59

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	2023010400018246	当升科技	2023-01-04	1,116,297.00	20,300.00	14	2.90	1,258.93	-	-
中信证券	2023010400020742	当升科技	2023-01-04	346,437.00	6,300.00	14	2.90	390.70	-	-
中信证券	2023010500001892	澜起科技	2023-01-05	2,722,434.00	41,800.00	14	2.90	3,070.30	-	-
中信证券	2023011000014679	美亚柏科	2023-01-10	1,953,732.00	144,400.00	14	3.30	3,581.84	-	-
中信证券	2023011700001163	当升科技	2023-01-17	377,580.00	6,000.00	28	2.60	763.55	-	-
中信证券	2023011900014012	澜起科技	2023-01-19	2,632,146.00	41,800.00	14	3.20	3,275.56	-	-
中信证券	2023013000075163	美亚柏科	2023-01-30	2,135,676.00	144,400.00	14	3.70	3,073.00	-	-

中信证券	20230202000 14295	澜起科技	2023-02 -02	2,362,95 4.00	41,800.0 0	14	3.10	2,848.6 7	-	-
中信证券	20230213000 63630	美亚柏科	2023-02 -13	2,249,75 2.00	144,400. 00	14	1.70	1,487.3 4	-	-
中信证券	20230214000 21717	当升科技	2023-02 -14	385,560. 00	6,000.00	28	3.00	899.64	-	-
中信证券	20230216000 15389	澜起科技	2023-02 -16	2,628,80 2.00	41,800.0 0	14	4.00	4,089.2 5	-	-
中信证券	20230227000 59676	美亚柏科	2023-02 -27	2,163,11 2.00	144,400. 00	14	3.50	2,944.2 4	-	-
中信证券	20230302000 01445	美亚柏科	2023-03 -02	297,295. 00	18,500.0 0	14	2.60	300.60	-	-
中信证券	20230302000 13135	澜起科技	2023-03 -02	2,376,74 8.00	41,800.0 0	14	4.20	3,882.0 2	-	-
中信证券	20230313000 72340	美亚柏科	2023-03 -13	2,545,77 2.00	144,400. 00	14	2.90	2,871.0 7	-	-
中信证券	20230314000 21088	当升科技	2023-03 -14	332,220. 00	6,000.00	28	2.80	723.50	-	-
中信证券	20230316000 15542	澜起科技	2023-03 -16	2,353,75 8.00	41,800.0 0	14	3.30	3,020.6 6	-	-
中信证券	20230316000 16086	美亚柏科	2023-03 -16	311,540. 00	18,500.0 0	14	2.80	339.23	-	-

中信证券	20230322000 01329	美亚柏科	2023-03 -22	25,620.0 0	1,500.00	14	3.20	34.16	-	-
中信证券	20230327000 59179	美亚柏科	2023-03 -27	2,597,75 6.00	144,400. 00	14	3.20	3,232.7 6	-	-
中信证券	20230329000 00944	华润微	2023-03 -29	610,000. 00	10,000.0 0	14	2.40	569.33	-	-
中信证券	20230330000 13407	美亚柏科	2023-03 -30	360,750. 00	18,500.0 0	14	3.40	476.99	-	-
中信证券	20230330000 14277	澜起科技	2023-03 -30	2,926,00 0.00	41,800.0 0	14	3.20	3,641.2 4	-	-
中信证券	20230406000 12144	美亚柏科	2023-04 -06	41,250.0 0	1,500.00	14	3.40	54.54	-	-
中信证券	20230410000 09773	桂冠电力	2023-04 -10	1,129,94 1.00	200,700. 00	14	1.70	747.02	-	-
中信证券	20230410000 09805	招商蛇口	2023-04 -10	150,000. 00	10,000.0 0	14	1.70	99.17	-	-
中信证券	20230410000 11005	上海石化	2023-04 -10	374,272. 00	108,800. 00	14	1.70	247.44	-	-
中信证券	20230410000 11133	光迅科技	2023-04 -10	1,956,47 2.00	71,300.0 0	14	1.70	1,293.4 5	-	-
中信证券	20230410000 11255	海康威视	2023-04 -10	680,255. 00	15,100.0 0	14	1.70	449.72	-	-

中信证券	20230410000 11267	江铃汽车	2023-04 -10	134,000. 00	10,000.0 0	14	1.70	88.59	-	-
中信证券	20230410000 13973	上海石化	2023-04 -10	34,400.0 0	10,000.0 0	14	1.70	22.74	-	-
中信证券	20230410000 14555	国电南瑞	2023-04 -10	993,836. 00	36,700.0 0	14	1.70	657.04	-	-
中信证券	20230410000 14745	中海油服	2023-04 -10	155,942. 00	10,300.0 0	14	1.70	103.09	-	-
中信证券	20230410000 14817	中国卫通	2023-04 -10	211,500. 00	10,000.0 0	14	1.70	139.83	-	-
中信证券	20230410000 28871	中国卫通	2023-04 -10	1,057,50 0.00	50,000.0 0	14	1.70	699.13	-	-
中信证券	20230410000 50627	美亚柏科	2023-04 -10	3,474,26 4.00	144,400. 00	14	3.40	4,593.7 5	-	-
中信证券	20230411000 04817	海油工程	2023-04 -11	152,304. 00	22,800.0 0	14	3.20	189.53	-	-
中信证券	20230411000 04843	中航电子	2023-04 -11	521,100. 00	30,000.0 0	14	3.20	648.48	-	-
中信证券	20230411000 04882	深南电路	2023-04 -11	671,920. 00	7,400.00	14	3.20	836.17	-	-
中信证券	20230411000 04889	中国铝业	2023-04 -11	61,800.0 0	10,300.0 0	14	3.20	76.91	-	-

中信证券	20230411000 04973	太极股份	2023-04 -11	413,511.00	9,700.00	14	3.20	514.59	-	-
中信证券	20230411000 04990	电科网安	2023-04 -11	56,266.00	1,400.00	14	3.20	70.02	-	-
中信证券	20230411000 05045	中国汽研	2023-04 -11	731,640.00	31,200.00	14	3.20	910.49	-	-
中信证券	20230411000 05063	中国西电	2023-04 -11	18,530.00	3,400.00	14	3.20	23.06	-	-
中信证券	20230411000 11690	东阿阿胶	2023-04 -11	981,563.00	18,700.00	14	1.70	648.92	-	-
中信证券	20230411000 11864	上海石化	2023-04 -11	34,600.00	10,000.00	14	1.70	22.87	-	-
中信证券	20230411000 11878	中航沈飞	2023-04 -11	547,500.00	10,000.00	14	1.70	361.96	-	-
中信证券	20230411000 11894	三峡能源	2023-04 -11	55,100.00	10,000.00	14	1.70	36.43	-	-
中信证券	20230411000 11898	三峡能源	2023-04 -11	450,718.00	81,800.00	14	1.70	297.97	-	-
中信证券	20230411000 12324	中国长城	2023-04 -11	477,848.00	37,100.00	14	1.70	315.91	-	-
中信证券	20230411000 12526	中国铝业	2023-04 -11	60,000.00	10,000.00	14	1.70	39.67	-	-

中信证券	20230411000 12570	中国 汽研	2023-04 -11	330,645. 00	14,100.0 0	14	1.70	218.59	-	-
中信证券	20230411000 12676	远 光 软 件	2023-04 -11	435,045. 00	48,500.0 0	14	1.70	287.61	-	-
中信证券	20230411000 12694	电 科 网 安	2023-04 -11	401,900. 00	10,000.0 0	14	1.70	265.70	-	-
中信证券	20230411000 12698	光 迅 科 技	2023-04 -11	269,000. 00	10,000.0 0	14	1.70	177.84	-	-
中信证券	20230411000 12700	太 极 股 份	2023-04 -11	426,300. 00	10,000.0 0	14	1.70	281.83	-	-
中信证券	20230411000 12708	海 康 威 视	2023-04 -11	443,800. 00	10,000.0 0	14	1.70	293.40	-	-
中信证券	20230411000 12748	中 国 核 电	2023-04 -11	92,540.0 0	14,000.0 0	14	1.70	61.18	-	-
中信证券	20230411000 12750	中 国 铁 建	2023-04 -11	99,600.0 0	10,000.0 0	14	1.70	65.85	-	-
中信证券	20230411000 12752	中 航 电 子	2023-04 -11	173,700. 00	10,000.0 0	14	1.70	114.84	-	-
中信证券	20230411000 12764	海 康 威 视	2023-04 -11	532,560. 00	12,000.0 0	14	1.70	352.08	-	-
中信证券	20230411000 12766	中 国 石 油	2023-04 -11	98,400.0 0	15,000.0 0	14	1.70	65.05	-	-

中信证券	20230411000 12780	振华重工	2023-04 -11	38,700.0 0	10,000.0 0	14	1.70	25.59	-	-
中信证券	20230411000 12784	海油工程	2023-04 -11	66,800.0 0	10,000.0 0	14	1.70	44.16	-	-
中信证券	20230411000 12786	中国中铁	2023-04 -11	125,600. 00	16,000.0 0	14	1.70	83.04	-	-
中信证券	20230411000 12788	中海油服	2023-04 -11	151,100. 00	10,000.0 0	14	1.70	99.89	-	-
中信证券	20230411000 12790	招商证券	2023-04 -11	142,600. 00	10,000.0 0	14	1.70	94.27	-	-
中信证券	20230411000 12792	桂冠电力	2023-04 -11	55,900.0 0	10,000.0 0	14	1.70	36.96	-	-
中信证券	20230411000 12794	远光软件	2023-04 -11	89,700.0 0	10,000.0 0	14	1.70	59.30	-	-
中信证券	20230411000 12796	国电南瑞	2023-04 -11	268,600. 00	10,000.0 0	14	1.70	177.57	-	-
中信证券	20230411000 12798	航天信息	2023-04 -11	152,100. 00	10,000.0 0	14	1.70	100.56	-	-
中信证券	20230411000 12800	海油发展	2023-04 -11	35,000.0 0	10,000.0 0	14	1.70	23.14	-	-
中信证券	20230411000 12802	驰宏锌锗	2023-04 -11	53,800.0 0	10,000.0 0	14	1.70	35.57	-	-

中信证券	20230411000 12808	中远海控	2023-04 -11	321,900. 00	30,000.0 0	14	1.70	212.81	-	-
中信证券	20230411000 12810	东方电气	2023-04 -11	183,700. 00	10,000.0 0	14	1.70	121.45	-	-
中信证券	20230411000 12812	上海石化	2023-04 -11	34,600.0 0	10,000.0 0	14	1.70	22.87	-	-
中信证券	20230411000 12828	天地科技	2023-04 -11	48,400.0 0	10,000.0 0	14	1.70	32.00	-	-
中信证券	20230411000 12830	马钢股份	2023-04 -11	27,900.0 0	10,000.0 0	14	1.70	18.45	-	-
中信证券	20230411000 12832	东阿阿胶	2023-04 -11	682,370. 00	13,000.0 0	14	1.70	451.12	-	-
中信证券	20230411000 12838	许继电气	2023-04 -11	214,000. 00	10,000.0 0	14	1.70	141.48	-	-
中信证券	20230411000 12866	万润股份	2023-04 -11	485,604. 00	28,700.0 0	14	1.70	321.04	-	-
中信证券	20230411000 13218	航天电器	2023-04 -11	612,900. 00	10,000.0 0	14	1.70	405.20	-	-
中信证券	20230411000 16284	中国长城	2023-04 -11	1,937,15 2.00	150,400. 00	14	1.70	1,280.6 7	-	-
中信证券	20230411000 16286	中国长城	2023-04 -11	211,232. 00	16,400.0 0	14	1.70	139.65	-	-

中信证券	20230411000 17126	许继电气	2023-04 -11	214,000.00	10,000.00	14	1.70	141.48	-	-
中信证券	20230411000 19504	当升科技	2023-04 -11	354,600.00	6,000.00	28	2.00	551.60	-	-
中信证券	20230412000 11010	中国西电	2023-04 -12	125,034.00	22,900.00	14	3.20	155.60	-	-
中信证券	20230412000 11012	中远海控	2023-04 -12	10,960.00	1,000.00	14	3.20	13.64	-	-
中信证券	20230412000 11264	电科网安	2023-04 -12	48,240.00	1,200.00	14	3.20	60.03	-	-
中信证券	20230412000 11269	太极股份	2023-04 -12	239,984.00	5,300.00	14	3.20	298.65	-	-
中信证券	20230412000 11312	东阿阿胶	2023-04 -12	73,388.00	1,400.00	14	3.20	91.33	-	-
中信证券	20230412000 11314	东阿阿胶	2023-04 -12	141,534.00	2,700.00	28	3.10	341.25	-	-
中信证券	20230412000 15370	海康威视	2023-04 -12	463,700.00	10,000.00	14	1.70	306.56	-	-
中信证券	20230412000 15416	海油工程	2023-04 -12	1,091,046.00	162,600.00	14	1.70	721.30	-	-
中信证券	20230412000 15456	电投产融	2023-04 -12	218,280.00	51,000.00	14	1.70	144.31	-	-

中信证券	20230412000 15458	上海石化	2023-04 -12	35,100.0 0	10,000.0 0	14	1.70	23.21	-	-
中信证券	20230412000 15476	中航沈飞	2023-04 -12	547,800. 00	10,000.0 0	14	1.70	362.16	-	-
中信证券	20230412000 15492	三峡能源	2023-04 -12	55,000.0 0	10,000.0 0	14	1.70	36.36	-	-
中信证券	20230412000 15548	万润股份	2023-04 -12	493,066. 00	28,700.0 0	14	1.70	325.97	-	-
中信证券	20230412000 15558	远光软件	2023-04 -12	1,885,29 0.00	197,000. 00	14	1.70	1,246.3 9	-	-
中信证券	20230412000 16216	科大讯飞	2023-04 -12	4,686,06 6.00	75,900.0 0	14	1.70	3,098.0 1	-	-
中信证券	20230412000 16446	中国电建	2023-04 -12	476,450. 00	65,000.0 0	28	1.80	667.03	-	-
中信证券	20230412000 16646	东方电气	2023-04 -12	291,360. 00	16,000.0 0	14	1.70	192.62	-	-
中信证券	20230412000 17432	中国卫星	2023-04 -12	900,916. 00	31,600.0 0	14	1.70	595.61	-	-
中信证券	20230412000 17434	中国卫星	2023-04 -12	484,670. 00	17,000.0 0	14	1.70	320.42	-	-
中信证券	20230412000 17490	光迅科技	2023-04 -12	2,155,59 0.00	77,400.0 0	14	1.70	1,425.0 8	-	-

中信证券	20230412000 17492	光迅科技	2023-04 -12	420,535. 00	15,100.0 0	14	1.70	278.02	-	-
中信证券	20230412000 17512	太极股份	2023-04 -12	452,800. 00	10,000.0 0	14	1.70	299.35	-	-
中信证券	20230412000 17514	太极股份	2023-04 -12	452,800. 00	10,000.0 0	14	1.70	299.35	-	-
中信证券	20230412000 17590	华润双鹤	2023-04 -12	176,800. 00	10,000.0 0	14	1.70	116.88	-	-
中信证券	20230412000 17592	中航电子	2023-04 -12	172,100. 00	10,000.0 0	14	1.70	113.78	-	-
中信证券	20230412000 17612	桂冠电力	2023-04 -12	55,600.0 0	10,000.0 0	14	1.70	36.76	-	-
中信证券	20230412000 17670	中兴通讯	2023-04 -12	7,390,00 0.00	200,000. 00	14	1.70	4,885.6 1	-	-
中信证券	20230412000 18084	江铃汽车	2023-04 -12	132,700. 00	10,000.0 0	14	1.70	87.73	-	-
中信证券	20230412000 18686	天山股份	2023-04 -12	408,003. 00	44,300.0 0	14	1.70	269.74	-	-
中信证券	20230412000 19328	中国电信	2023-04 -12	7,020,00 0.00	1,000,00 0.00	14	1.70	4,641.0 0	-	-
中信证券	20230412000 19330	中国电信	2023-04 -12	7,020,00 0.00	1,000,00 0.00	14	1.70	4,641.0 0	-	-

中信证券	20230412000 20310	中国移动	2023-04 -12	2,090,87 5.00	21,500.0 0	14	1.70	1,382.3 0	-	-
中信证券	20230412000 25668	海康威视	2023-04 -12	463,700. 00	10,000.0 0	14	3.20	577.05	-	-
中信证券	20230412000 25920	中国铁建	2023-04 -12	700,560. 00	69,500.0 0	14	3.20	871.81	-	-
中信证券	20230412000 25928	国电南瑞	2023-04 -12	915,810. 00	34,300.0 0	14	3.20	1,139.6 7	-	-
中信证券	20230412000 26086	中国长城	2023-04 -12	219,760. 00	16,400.0 0	14	3.20	273.48	-	-
中信证券	20230413000 04098	宝信软件	2023-04 -13	75,075.0 0	1,300.00	14	3.20	93.43	-	-
中信证券	20230413000 04100	天山股份	2023-04 -13	206,338. 00	22,600.0 0	14	3.20	256.78	-	-
中信证券	20230413000 04112	东阿阿胶	2023-04 -13	145,584. 00	2,700.00	28	3.10	351.02	-	-
中信证券	20230413000 04170	科大讯飞	2023-04 -13	1,441,79 6.00	24,400.0 0	14	3.20	1,794.2 4	-	-
中信证券	20230413000 04172	科大讯飞	2023-04 -13	1,323,61 6.00	22,400.0 0	14	3.20	1,647.1 7	-	-
中信证券	20230413000 04177	中海油服	2023-04 -13	145,544. 00	9,200.00	14	3.20	181.12	-	-

中信证券	20230413000 04190	太极股份	2023-04 -13	333,150.00	7,500.00	14	3.20	414.59	-	-
中信证券	20230413000 04270	中国交建	2023-04 -13	11,820.00	1,000.00	14	3.20	14.71	-	-
中信证券	20230413000 04351	中国西电	2023-04 -13	18,870.00	3,400.00	14	3.20	23.48	-	-
中信证券	20230413000 06707	中兴通讯	2023-04 -13	3,457,000.00	100,000.00	14	1.70	2,285.46	-	-
中信证券	20230413000 06717	中国卫星	2023-04 -13	828,900.00	30,000.00	14	1.70	548.00	-	-
中信证券	20230413000 06719	中国卫星	2023-04 -13	461,421.00	16,700.00	14	1.70	305.05	-	-
中信证券	20230413000 06761	东阿阿胶	2023-04 -13	835,760.00	15,500.00	14	1.70	552.53	-	-
中信证券	20230413000 06781	中国长城	2023-04 -13	548,250.00	42,500.00	14	1.70	362.45	-	-
中信证券	20230413000 07415	东方通信	2023-04 -13	515,968.00	46,400.00	14	1.70	341.11	-	-
中信证券	20230413000 07467	中国中免	2023-04 -13	1,766,500.00	10,000.00	14	1.70	1,167.85	-	-
中信证券	20230413000 07495	许继电气	2023-04 -13	213,000.00	10,000.00	14	1.70	140.82	-	-

中信证券	20230413000 07497	万润股份	2023-04 -13	1,794,34 4.00	106,300. 00	14	1.70	1,186.2 6	-	-
中信证券	20230413000 08833	中国长城	2023-04 -13	774,000. 00	60,000.0 0	14	1.70	511.70	-	-
中信证券	20230413000 13867	澜起科技	2023-04 -13	2,994,97 0.00	41,800.0 0	14	3.40	3,960.0 2	-	-
中信证券	20230413000 13965	美亚柏科	2023-04 -13	503,015. 00	18,500.0 0	14	3.40	665.10	-	-
中信证券	20230414000 06185	中航电子	2023-04 -14	524,100. 00	30,000.0 0	28	1.80	733.74	-	-
中信证券	20230418000 06119	中粮科技	2023-04 -18	109,115. 00	13,900.0 0	14	1.10	53.35	-	-
中信证券	20230418000 06138	中国铝业	2023-04 -18	194,238. 00	29,700.0 0	14	3.20	276.25	-	-
中信证券	20230418000 06216	上海石化	2023-04 -18	707,646. 00	199,900. 00	14	3.00	943.53	-	-
中信证券	20230418000 06284	中国西电	2023-04 -18	90,791.0 0	16,300.0 0	14	1.30	52.46	-	-
中信证券	20230418000 11295	中航电子	2023-04 -18	614,600. 00	35,000.0 0	14	3.20	874.10	-	-
中信证券	20230418000 11333	中国软件	2023-04 -18	665,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	945.78	-	-

中信证券	20230418000 11951	太极股份	2023-04 -18	468,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	665.60	-	-
中信证券	20230420000 03645	中材科技	2023-04 -20	91,512.0 0	4,100.00	14	1.10	39.15	-	-
中信证券	20230420000 03681	中国铝业	2023-04 -20	6,550.00	1,000.00	14	3.20	8.15	-	-
中信证券	20230420000 05525	中国软件	2023-04 -20	691,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	859.91	-	-
中信证券	20230420000 05637	科大讯飞	2023-04 -20	639,500. 00	10,000.0 0	14	3.20	795.82	-	-
中信证券	20230420000 05641	科大讯飞	2023-04 -20	5,116,00 0.00	80,000.0 0	14	3.20	6,366.5 8	-	-
中信证券	20230420000 05643	电科网安	2023-04 -20	545,380. 00	13,400.0 0	14	3.20	678.70	-	-
中信证券	20230420000 05785	中航电子	2023-04 -20	874,653. 00	54,700.0 0	14	3.20	1,088.4 6	-	-
中信证券	20230420000 05787	中航电子	2023-04 -20	559,650. 00	35,000.0 0	14	3.20	696.45	-	-
中信证券	20230420000 05827	美亚柏科	2023-04 -20	39,330.0 0	1,500.00	14	3.50	53.53	-	-
中信证券	20230420000 07909	国电南瑞	2023-04 -20	266,500. 00	10,000.0 0	14	3.10	321.28	-	-

中信证券	20230420000 07911	国电南瑞	2023-04 -20	279,825. 00	10,500.0 0	14	3.10	337.34	-	-
中信证券	20230420000 11355	海油工程	2023-04 -20	89,640.0 0	13,500.0 0	14	3.20	111.55	-	-
中信证券	20230420000 11357	中国卫通	2023-04 -20	317,400. 00	15,000.0 0	14	3.20	394.99	-	-
中信证券	20230420000 11853	电科网安	2023-04 -20	407,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	506.49	-	-
中信证券	20230420000 11859	海油工程	2023-04 -20	69,720.0 0	10,500.0 0	14	3.20	86.76	-	-
中信证券	20230420000 11861	东方电气	2023-04 -20	707,808. 00	40,400.0 0	14	3.20	880.83	-	-
中信证券	20230420000 11875	科大讯飞	2023-04 -20	639,500. 00	10,000.0 0	14	3.20	795.82	-	-
中信证券	20230420000 11885	中航沈飞	2023-04 -20	558,200. 00	10,000.0 0	14	3.20	694.65	-	-
中信证券	20230420000 11905	光迅科技	2023-04 -20	453,453. 00	15,100.0 0	14	3.20	564.30	-	-
中信证券	20230420000 11907	海康威视	2023-04 -20	528,574. 00	12,700.0 0	14	3.20	657.78	-	-
中信证券	20230420000 11911	中航电子	2023-04 -20	553,254. 00	34,600.0 0	14	3.20	688.49	-	-

中信证券	20230420000 13397	国电南瑞	2023-04 -20	266,500. 00	10,000.0 0	14	3.10	321.28	-	-
中信证券	20230424000 30907	江铃汽车	2023-04 -24	129,100. 00	10,000.0 0	14	3.20	160.66	-	-
中信证券	20230424000 31289	光迅科技	2023-04 -24	2,042,74 5.00	71,300.0 0	14	1.70	1,350.4 8	-	-
中信证券	20230424000 40331	桂冠电力	2023-04 -24	1,107,86 4.00	200,700. 00	14	3.00	1,292.5 1	-	-
中信证券	20230424000 42321	国电南瑞	2023-04 -24	956,035. 00	36,700.0 0	14	3.10	1,152.5 5	-	-
中信证券	20230424000 47107	上海石化	2023-04 -24	34,500.0 0	10,000.0 0	14	3.00	40.25	-	-
中信证券	20230424000 57027	中国卫通	2023-04 -24	1,028,00 0.00	50,000.0 0	14	3.40	1,359.2 4	-	-
中信证券	20230424000 61183	上海石化	2023-04 -24	375,360. 00	108,800. 00	14	3.00	437.92	-	-
中信证券	20230424000 62793	中国卫通	2023-04 -24	205,600. 00	10,000.0 0	14	3.40	271.85	-	-
中信证券	20230424000 63207	招商蛇口	2023-04 -24	140,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	174.22	-	-
中信证券	20230425000 04479	太钢不锈	2023-04 -25	220,015. 00	55,700.0 0	28	1.10	188.24	-	-

中信证券	20230425000 04483	江铃汽车	2023-04 -25	347,760. 00	27,600.0 0	14	2.80	378.67	-	-
中信证券	20230425000 04627	振华重工	2023-04 -25	1,128,82 0.00	293,200. 00	14	3.00	1,316.9 6	-	-
中信证券	20230425000 04635	华润双鹤	2023-04 -25	19,780.0 0	1,000.00	14	1.40	10.77	-	-
中信证券	20230425000 48945	东阿阿胶	2023-04 -25	650,000. 00	13,000.0 0	14	2.90	733.06	-	-
中信证券	20230425000 50935	中航电子	2023-04 -25	152,600. 00	10,000.0 0	14	2.40	142.43	-	-
中信证券	20230425000 51003	电科网安	2023-04 -25	324,400. 00	10,000.0 0	14	2.40	302.77	-	-
中信证券	20230425000 51119	太极股份	2023-04 -25	417,100. 00	9,700.00	14	1.80	291.97	-	-
中信证券	20230425000 52369	许继电气	2023-04 -25	213,900. 00	10,000.0 0	14	1.20	99.82	-	-
中信证券	20230425000 52409	航天信息	2023-04 -25	152,600. 00	10,000.0 0	14	1.40	83.08	-	-
中信证券	20230425000 52495	驰宏锌锗	2023-04 -25	54,000.0 0	10,000.0 0	14	1.10	23.10	-	-
中信证券	20230425000 52895	中海油服	2023-04 -25	161,500. 00	10,000.0 0	14	3.30	207.26	-	-

中信证券	20230425000 52931	中国西电	2023-04 -25	17,918.0 0	3,400.00	14	1.30	9.06	-	-
中信证券	20230425000 52969	许继电气	2023-04 -25	213,900. 00	10,000.0 0	14	1.20	99.82	-	-
中信证券	20230425000 52971	上海石化	2023-04 -25	34,500.0 0	10,000.0 0	14	3.00	40.25	-	-
中信证券	20230425000 52981	海油工程	2023-04 -25	63,100.0 0	10,000.0 0	14	3.10	76.07	-	-
中信证券	20230425000 52983	天地科技	2023-04 -25	49,400.0 0	10,000.0 0	14	1.10	21.13	-	-
中信证券	20230425000 53427	航天电器	2023-04 -25	611,100. 00	10,000.0 0	14	1.10	261.42	-	-
中信证券	20230425000 54459	电科网安	2023-04 -25	45,416.0 0	1,400.00	14	2.40	42.39	-	-
中信证券	20230425000 55419	光迅科技	2023-04 -25	277,600. 00	10,000.0 0	14	1.70	183.52	-	-
中信证券	20230425000 55509	中国中铁	2023-04 -25	138,720. 00	16,000.0 0	14	3.40	183.42	-	-
中信证券	20230425000 55791	中国汽研	2023-04 -25	322,326. 00	14,100.0 0	14	3.30	413.65	-	-
中信证券	20230425000 55881	三峡能源	2023-04 -25	53,600.0 0	10,000.0 0	14	3.20	66.70	-	-

中信证券	20230425000 55885	三峡能源	2023-04 -25	438,448. 00	81,800.0 0	14	3.20	545.62	-	-
中信证券	20230425000 55951	海油发展	2023-04 -25	36,100.0 0	10,000.0 0	14	1.20	16.85	-	-
中信证券	20230425000 55975	海康威视	2023-04 -25	449,400. 00	12,000.0 0	14	2.90	506.82	-	-
中信证券	20230425000 59695	远光软件	2023-04 -25	86,900.0 0	10,000.0 0	14	3.30	111.52	-	-
中信证券	20230425000 59697	远光软件	2023-04 -25	421,465. 00	48,500.0 0	14	3.30	540.88	-	-
中信证券	20230425000 59781	中远海控	2023-04 -25	337,800. 00	30,000.0 0	14	3.40	446.65	-	-
中信证券	20230425000 59873	桂冠电力	2023-04 -25	54,700.0 0	10,000.0 0	14	3.00	63.82	-	-
中信证券	20230425000 59875	中国铝业	2023-04 -25	61,600.0 0	10,000.0 0	14	3.20	76.66	-	-
中信证券	20230425000 59895	中国汽研	2023-04 -25	713,232. 00	31,200.0 0	14	3.30	915.31	-	-
中信证券	20230425000 60255	上海石化	2023-04 -25	34,500.0 0	10,000.0 0	14	3.00	40.25	-	-
中信证券	20230425000 60285	中国铝业	2023-04 -25	63,448.0 0	10,300.0 0	14	3.20	78.96	-	-

中信证券	20230425000 61619	中航沈飞	2023-04 -25	568,900. 00	10,000.0 0	14	3.10	685.84	-	-
中信证券	20230425000 61719	海康威视	2023-04 -25	374,500. 00	10,000.0 0	14	2.90	422.35	-	-
中信证券	20230425000 62639	中国长城	2023-04 -25	444,829. 00	37,100.0 0	14	2.40	415.17	-	-
中信证券	20230425000 62995	马钢股份	2023-04 -25	26,500.0 0	10,000.0 0	14	1.10	11.34	-	-
中信证券	20230425000 63099	万润股份	2023-04 -25	501,389. 00	28,700.0 0	14	3.30	643.45	-	-
中信证券	20230425000 63481	电科网安	2023-04 -25	551,480. 00	17,000.0 0	28	2.30	986.54	-	-
中信证券	20230425000 64583	东方电气	2023-04 -25	168,300. 00	10,000.0 0	14	3.40	222.53	-	-
中信证券	20230425000 64599	中国铁建	2023-04 -25	113,800. 00	10,000.0 0	14	3.10	137.19	-	-
中信证券	20230425000 64659	振华重工	2023-04 -25	38,500.0 0	10,000.0 0	14	3.00	44.92	-	-
中信证券	20230425000 64739	招商证券	2023-04 -25	137,400. 00	10,000.0 0	14	3.30	176.33	-	-
中信证券	20230425000 64861	中国石油	2023-04 -25	114,300. 00	15,000.0 0	14	3.30	146.69	-	-

中信证券	20230425000 65967	国电南瑞	2023-04 -25	253,900. 00	10,000.0 0	14	3.10	306.09	-	-
中信证券	20230425000 65973	海油工程	2023-04 -25	143,868. 00	22,800.0 0	14	3.10	173.44	-	-
中信证券	20230425000 66071	中国核电	2023-04 -25	95,060.0 0	14,000.0 0	14	3.30	121.99	-	-
中信证券	20230426000 05041	华润双鹤	2023-04 -26	22,704.0 0	1,100.00	14	1.40	12.36	-	-
中信证券	20230426000 05055	中国软件	2023-04 -26	861,000. 00	15,000.0 0	14	2.70	904.05	-	-
中信证券	20230426000 08822	中国长城	2023-04 -26	186,632. 00	16,400.0 0	14	2.40	174.19	-	-
中信证券	20230426000 12546	华润双鹤	2023-04 -26	206,400. 00	10,000.0 0	14	1.40	112.37	-	-
中信证券	20230426000 13206	电科网安	2023-04 -26	37,800.0 0	1,200.00	14	2.40	35.28	-	-
中信证券	20230426000 15148	天山股份	2023-04 -26	366,361. 00	44,300.0 0	14	3.20	455.92	-	-
中信证券	20230426000 20092	中国铁建	2023-04 -26	764,500. 00	69,500.0 0	14	3.10	921.65	-	-
中信证券	20230426000 20500	东方电气	2023-04 -26	277,440. 00	16,000.0 0	14	3.40	366.84	-	-

中信证券	20230426000 29456	海油工程	2023-04 -26	1,035,76 2.00	162,600. 00	14	3.10	1,248.6 7	-	-
中信证券	20230426000 29502	科大讯飞	2023-04 -26	4,324,78 2.00	75,900.0 0	14	3.30	5,550.1 4	-	-
中信证券	20230426000 29514	中国移动	2023-04 -26	2,095,82 0.00	21,500.0 0	14	3.10	2,526.6 3	-	-
中信证券	20230426000 29550	上海石化	2023-04 -26	34,200.0 0	10,000.0 0	14	3.00	39.90	-	-
中信证券	20230426000 31542	东阿阿胶	2023-04 -26	68,726.0 0	1,400.00	14	2.90	77.51	-	-
中信证券	20230426000 31552	中兴通讯	2023-04 -26	7,052,00 0.00	200,000. 00	14	3.50	9,598.5 6	-	-
中信证券	20230426000 31562	远光软件	2023-04 -26	1,625,25 0.00	197,000. 00	14	3.30	2,085.7 4	-	-
中信证券	20230426000 31590	中国卫星	2023-04 -26	821,600. 00	31,600.0 0	14	2.00	639.02	-	-
中信证券	20230426000 31592	中国卫星	2023-04 -26	442,000. 00	17,000.0 0	14	2.00	343.78	-	-
中信证券	20230426000 31594	三峡能源	2023-04 -26	54,000.0 0	10,000.0 0	14	3.20	67.20	-	-
中信证券	20230426000 31598	电投产融	2023-04 -26	213,180. 00	51,000.0 0	14	3.10	257.00	-	-

中信 证券	20230426000 31646	中国 西电	2023-04 -26	121,141. 00	22,900.0 0	14	1.30	61.24	-	-
中信 证券	20230426000 31674	桂冠 电力	2023-04 -26	55,200.0 0	10,000.0 0	14	3.00	64.40	-	-
中信 证券	20230426000 31680	光迅 科技	2023-04 -26	1,933,45 2.00	77,400.0 0	14	1.70	1,278.2 3	-	-
中信 证券	20230426000 31682	光迅 科技	2023-04 -26	377,198. 00	15,100.0 0	14	1.70	249.37	-	-
中信 证券	20230426000 31690	江铃 汽车	2023-04 -26	130,000. 00	10,000.0 0	14	3.20	161.78	-	-
中信 证券	20230426000 31694	中国 电信	2023-04 -26	6,490,00 0.00	1,000,00 0.00	14	3.20	8,076.4 4	-	-
中信 证券	20230426000 31698	中国 电信	2023-04 -26	6,490,00 0.00	1,000,00 0.00	14	3.20	8,076.4 4	-	-
中信 证券	20230426000 31712	中航 电子	2023-04 -26	153,000. 00	10,000.0 0	14	2.40	142.80	-	-
中信 证券	20230427000 06097	航天 电器	2023-04 -27	133,320. 00	2,000.00	28	1.30	134.80	-	-
中信 证券	20230427000 06111	东阿 阿胶	2023-04 -27	745,300. 00	14,500.0 0	14	3.00	869.52	-	-
中信 证券	20230427000 06145	太钢 不锈	2023-04 -27	124,504. 00	31,600.0 0	28	1.10	106.52	-	-

中信证券	20230427000 06146	中粮科技	2023-04 -27	8,646.00	1,100.00	14	2.30	7.73	-	-
中信证券	20230427000 06169	电科网安	2023-04 -27	76,200.0 0	2,400.00	14	1.80	53.34	-	-
中信证券	20230427000 06185	华润双鹤	2023-04 -27	21,560.0 0	1,000.00	14	1.40	11.74	-	-
中信证券	20230427000 11050	科大讯飞	2023-04 -27	1,350,78 4.00	24,400.0 0	14	3.30	1,733.5 1	-	-
中信证券	20230427000 11858	中兴通讯	2023-04 -27	3,467,00 0.00	100,000. 00	14	3.50	4,718.9 7	-	-
中信证券	20230427000 14992	澜起科技	2023-04 -27	2,635,07 2.00	41,800.0 0	14	5.00	5,123.7 5	-	-
中信证券	20230427000 15018	中国长城	2023-04 -27	678,000. 00	60,000.0 0	14	2.50	659.17	-	-
中信证券	20230427000 16486	宝信软件	2023-04 -27	70,798.0 0	1,300.00	14	2.10	57.82	-	-
中信证券	20230427000 18670	中海油服	2023-04 -27	147,844. 00	9,200.00	14	3.00	172.48	-	-
中信证券	20230427000 19546	许继电气	2023-04 -27	219,800. 00	10,000.0 0	14	1.20	102.57	-	-
中信证券	20230427000 20468	科大讯飞	2023-04 -27	1,240,06 4.00	22,400.0 0	14	3.30	1,591.4 2	-	-

中信证券	20230427000 20570	万润股份	2023-04 -27	1,947,41 6.00	106,300. 00	14	3.30	2,499.1 8	-	-
中信证券	20230427000 20584	中国卫星	2023-04 -27	435,703. 00	16,700.0 0	14	2.00	338.88	-	-
中信证券	20230427000 20598	美亚柏科	2023-04 -27	387,575. 00	18,500.0 0	14	4.30	648.11	-	-
中信证券	20230427000 20604	东阿阿胶	2023-04 -27	796,700. 00	15,500.0 0	14	2.90	898.50	-	-
中信证券	20230427000 20680	中国中免	2023-04 -27	1,616,00 0.00	10,000.0 0	14	2.60	1,633.9 6	-	-
中信证券	20230427000 21992	东方通信	2023-04 -27	467,712. 00	46,400.0 0	14	3.50	636.61	-	-
中信证券	20230427000 22024	中国卫星	2023-04 -27	782,700. 00	30,000.0 0	14	2.00	608.77	-	-
中信证券	20230427000 22098	天山股份	2023-04 -27	187,128. 00	22,600.0 0	14	3.20	232.87	-	-
中信证券	20230427000 22206	中国长城	2023-04 -27	480,250. 00	42,500.0 0	14	2.50	466.91	-	-
中信证券	20230427000 22250	中国西电	2023-04 -27	18,292.0 0	3,400.00	14	1.30	9.25	-	-
中信证券	20230504000 07098	长安汽车	2023-05 -04	15,600.0 0	1,300.00	14	3.10	18.81	-	-

中信 证券	20230504000 13629	中 粮 科 技	2023-05 -04	111,478. 00	13,900.0 0	14	2.30	99.71	-	-
中信 证券	20230504000 14019	中 国 西 电	2023-05 -04	91,606.0 0	16,300.0 0	14	1.90	67.69	-	-
中信 证券	20230504000 14049	中 国 铝 业	2023-05 -04	190,377. 00	29,700.0 0	14	1.90	140.67	-	-
中信 证券	20230504000 14175	中 国 软 件	2023-05 -04	572,900. 00	10,000.0 0	14	2.70	601.55	-	-
中信 证券	20230504000 14261	中 国 铝 业	2023-05 -04	6,410.00	1,000.00	14	1.90	4.74	-	-
中信 证券	20230504000 15581	上 海 石 化	2023-05 -04	693,653. 00	199,900. 00	14	3.10	836.24	-	-
中信 证券	20230504000 15701	中 航 沈 飞	2023-05 -04	566,100. 00	10,000.0 0	14	2.60	572.39	-	-
中信 证券	20230504000 15765	光 迅 科 技	2023-05 -04	345,035. 00	15,100.0 0	14	2.10	281.78	-	-
中信 证券	20230504000 15849	中 国 卫 通	2023-05 -04	269,850. 00	15,000.0 0	14	3.60	377.79	-	-
中信 证券	20230504000 20867	中 航 电 子	2023-05 -04	525,920. 00	34,600.0 0	14	3.60	736.29	-	-
中信 证券	20230504000 20869	中 航 电 子	2023-05 -04	831,440. 00	54,700.0 0	14	3.60	1,164.0 2	-	-

中信证券	20230504000 21421	国电南瑞	2023-05 -04	264,800. 00	10,000.0 0	14	3.20	329.53	-	-
中信证券	20230504000 21423	国电南瑞	2023-05 -04	278,040. 00	10,500.0 0	14	3.20	346.01	-	-
中信证券	20230504000 21425	国电南瑞	2023-05 -04	264,800. 00	10,000.0 0	14	3.20	329.53	-	-
中信证券	20230504000 22363	中国软件	2023-05 -04	572,900. 00	10,000.0 0	14	2.70	601.55	-	-
中信证券	20230504000 25763	中航电子	2023-05 -04	532,000. 00	35,000.0 0	14	3.60	744.80	-	-
中信证券	20230504000 27151	海油工程	2023-05 -04	68,040.0 0	10,500.0 0	14	2.90	76.73	-	-
中信证券	20230504000 30391	电科网安	2023-05 -04	319,100. 00	10,000.0 0	14	1.80	223.37	-	-
中信证券	20230504000 30861	科大讯飞	2023-05 -04	4,799,20 0.00	80,000.0 0	14	3.30	6,158.9 7	-	-
中信证券	20230504000 33299	美亚柏科	2023-05 -04	35,385.0 0	1,500.00	14	3.80	52.29	-	-
中信证券	20230504000 33353	电科网安	2023-05 -04	427,594. 00	13,400.0 0	14	1.80	299.32	-	-
中信证券	20230504000 39641	科大讯飞	2023-05 -04	599,900. 00	10,000.0 0	14	3.30	769.87	-	-

中信证券	20230504000 39951	科大讯飞	2023-05 -04	599,900. 00	10,000.0 0	14	3.30	769.87	-	-
中信证券	20230504000 42339	东方电气	2023-05 -04	721,948. 00	40,400.0 0	14	3.30	926.50	-	-
中信证券	20230504000 44453	太极股份	2023-05 -04	387,100. 00	10,000.0 0	14	2.20	331.19	-	-
中信证券	20230504000 44591	中航电子	2023-05 -04	532,000. 00	35,000.0 0	14	3.60	744.80	-	-
中信证券	20230504000 48507	海康威视	2023-05 -04	472,440. 00	12,700.0 0	14	2.50	459.32	-	-
中信证券	20230508000 13591	上海石化	2023-05 -08	374,272. 00	108,800. 00	14	3.10	451.21	-	-
中信证券	20230508000 17343	桂冠电力	2023-05 -08	1,135,96 2.00	200,700. 00	14	2.50	1,104.4 1	-	-
中信证券	20230508000 17355	江铃汽车	2023-05 -08	136,900. 00	10,000.0 0	14	2.80	149.07	-	-
中信证券	20230508000 20621	中国卫通	2023-05 -08	186,700. 00	10,000.0 0	14	3.60	261.38	-	-
中信证券	20230508000 24029	上海石化	2023-05 -08	34,400.0 0	10,000.0 0	14	3.10	41.47	-	-
中信证券	20230508000 24075	国电南瑞	2023-05 -08	964,109. 00	36,700.0 0	14	3.20	1,199.7 8	-	-

中信证券	20230508000 26309	招商蛇口	2023-05 -08	141,700.00	10,000.00	14	3.30	181.85	-	-
中信证券	20230508000 62445	中国卫通	2023-05 -08	933,500.00	50,000.00	14	3.60	1,306.90	-	-
中信证券	20230509000 06344	中航西飞	2023-05 -09	25,940.00	1,000.00	14	2.70	27.24	-	-
中信证券	20230509000 06465	当升科技	2023-05 -09	50,700.00	1,000.00	14	2.80	55.21	-	-
中信证券	20230509000 06640	中国软件	2023-05 -09	57,160.00	1,000.00	14	2.90	64.46	-	-
中信证券	20230509000 06847	中国铝业	2023-05 -09	6,350.00	1,000.00	14	3.20	7.90	-	-
中信证券	20230509000 06900	华润双鹤	2023-05 -09	267,444.00	13,800.00	14	2.40	249.61	-	-
中信证券	20230509000 12521	华润双鹤	2023-05 -09	19,380.00	1,000.00	14	1.40	10.55	-	-
中信证券	20230509000 12729	振华重工	2023-05 -09	1,199,188.00	293,200.00	14	3.00	1,399.05	-	-
中信证券	20230509000 13955	海油发展	2023-05 -09	35,600.00	10,000.00	14	1.10	15.23	-	-
中信证券	20230509000 13961	远光软件	2023-05 -09	84,000.00	10,000.00	14	3.40	111.07	-	-

中信证券	20230509000 14037	航天信息	2023-05 -09	144,500. 00	10,000.0 0	14	1.20	67.43	-	-
中信证券	20230509000 14055	中航电子	2023-05 -09	154,800. 00	10,000.0 0	14	3.60	216.72	-	-
中信证券	20230509000 14067	三峡能源	2023-05 -09	55,000.0 0	10,000.0 0	14	2.80	59.89	-	-
中信证券	20230509000 14069	三峡能源	2023-05 -09	449,900. 00	81,800.0 0	14	2.80	489.89	-	-
中信证券	20230509000 14073	招商证券	2023-05 -09	149,800. 00	10,000.0 0	14	3.00	174.77	-	-
中信证券	20230509000 14299	远光软件	2023-05 -09	407,400. 00	48,500.0 0	14	3.40	538.67	-	-
中信证券	20230509000 14421	天地科技	2023-05 -09	55,300.0 0	10,000.0 0	14	1.40	30.11	-	-
中信证券	20230509000 14423	海油工程	2023-05 -09	152,076. 00	22,800.0 0	14	2.90	171.51	-	-
中信证券	20230509000 14455	东阿阿胶	2023-05 -09	670,150. 00	13,000.0 0	14	3.00	781.84	-	-
中信证券	20230509000 14477	上海石化	2023-05 -09	34,200.0 0	10,000.0 0	14	3.10	41.23	-	-
中信证券	20230509000 14479	上海石化	2023-05 -09	34,200.0 0	10,000.0 0	14	3.10	41.23	-	-

中信证券	20230509000 14487	中国核电	2023-05 -09	99,260.0 0	14,000.0 0	14	2.50	96.50	-	-
中信证券	20230509000 15195	中国长城	2023-05 -09	422,940. 00	37,100.0 0	14	2.40	394.74	-	-
中信证券	20230509000 16129	振华重工	2023-05 -09	40,900.0 0	10,000.0 0	14	3.00	47.72	-	-
中信证券	20230509000 17379	万润股份	2023-05 -09	495,649. 00	28,700.0 0	14	3.30	636.08	-	-
中信证券	20230509000 17427	中国石油	2023-05 -09	121,350. 00	15,000.0 0	14	3.00	141.58	-	-
中信证券	20230509000 17471	海油工程	2023-05 -09	66,700.0 0	10,000.0 0	14	2.90	75.22	-	-
中信证券	20230509000 17521	许继电气	2023-05 -09	231,500. 00	10,000.0 0	14	1.10	99.03	-	-
中信证券	20230509000 17523	许继电气	2023-05 -09	231,500. 00	10,000.0 0	14	1.10	99.03	-	-
中信证券	20230509000 18371	中航沈飞	2023-05 -09	591,600. 00	10,000.0 0	14	2.60	598.17	-	-
中信证券	20230509000 18393	电科网安	2023-05 -09	325,000. 00	10,000.0 0	14	1.80	227.50	-	-
中信证券	20230509000 18469	航天电器	2023-05 -09	649,400. 00	10,000.0 0	14	1.40	353.56	-	-

中信证券	20230509000 18487	驰宏锌锗	2023-05 -09	56,400.0 0	10,000.0 0	14	1.10	24.13	-	-
中信证券	20230509000 18975	江铃汽车	2023-05 -09	377,568. 00	27,600.0 0	14	2.80	411.13	-	-
中信证券	20230509000 19061	中海油服	2023-05 -09	163,600. 00	10,000.0 0	14	3.00	190.87	-	-
中信证券	20230509000 19075	中远海控	2023-05 -09	340,800. 00	30,000.0 0	14	3.40	450.61	-	-
中信证券	20230509000 22045	中国汽研	2023-05 -09	302,163. 00	14,100.0 0	14	3.30	387.78	-	-
中信证券	20230509000 22073	中国汽研	2023-05 -09	668,616. 00	31,200.0 0	14	3.30	858.06	-	-
中信证券	20230509000 22119	马钢股份	2023-05 -09	28,300.0 0	10,000.0 0	14	1.20	13.21	-	-
中信证券	20230509000 22157	电科网安	2023-05 -09	45,500.0 0	1,400.00	14	1.80	31.85	-	-
中信证券	20230509000 22173	光迅科技	2023-05 -09	242,600. 00	10,000.0 0	14	2.10	198.12	-	-
中信证券	20230509000 22323	太极股份	2023-05 -09	406,624. 00	9,700.00	14	2.20	347.89	-	-
中信证券	20230509000 22783	桂冠电力	2023-05 -09	56,700.0 0	10,000.0 0	14	2.50	55.13	-	-

中信证券	20230509000 22787	中国 中铁	2023-05 -09	136,640. 00	16,000.0 0	14	2.30	122.22	-	-
中信证券	20230509000 22793	中国 铝业	2023-05 -09	63,500.0 0	10,000.0 0	14	1.90	46.92	-	-
中信证券	20230509000 23229	国 电南瑞	2023-05 -09	262,600. 00	10,000.0 0	14	3.20	326.79	-	-
中信证券	20230509000 23241	中国 铁建	2023-05 -09	119,700. 00	10,000.0 0	14	2.30	107.07	-	-
中信证券	20230509000 23283	中国 铝业	2023-05 -09	65,405.0 0	10,300.0 0	14	1.90	48.33	-	-
中信证券	20230509000 24587	东方 电气	2023-05 -09	180,600. 00	10,000.0 0	14	3.30	231.77	-	-
中信证券	20230509000 24595	海 康威视	2023-05 -09	431,400. 00	12,000.0 0	14	2.50	419.42	-	-
中信证券	20230509000 25173	海 康威视	2023-05 -09	359,500. 00	10,000.0 0	14	2.50	349.51	-	-
中信证券	20230510000 04942	美 亚柏科	2023-05 -10	425,500. 00	18,500.0 0	28	2.80	926.64	-	-
中信证券	20230510000 04954	长 安汽车	2023-05 -10	12,680.0 0	1,000.00	14	3.30	16.27	-	-
中信证券	20230510000 04968	中国 中铁	2023-05 -10	248,095. 00	29,500.0 0	14	3.00	289.44	-	-

中信证券	20230510000 04996	中国软件	2023-05 -10	55,830.0 0	1,000.00	14	2.90	62.96	-	-
中信证券	20230510000 05159	中国铁建	2023-05 -10	46,560.0 0	4,000.00	14	2.50	45.27	-	-
中信证券	20230510000 07592	上海石化	2023-05 -10	33,400.0 0	10,000.0 0	14	3.10	40.27	-	-
中信证券	20230510000 10526	中国软件	2023-05 -10	837,450. 00	15,000.0 0	14	2.90	944.46	-	-
中信证券	20230510000 12548	远光软件	2023-05 -10	1,658,74 0.00	197,000. 00	14	3.40	2,193.2 2	-	-
中信证券	20230510000 16274	东阿阿胶	2023-05 -10	72,100.0 0	1,400.00	14	3.00	84.12	-	-
中信证券	20230510000 16328	海油工程	2023-05 -10	1,009,74 6.00	162,600. 00	14	2.90	1,138.7 7	-	-
中信证券	20230510000 16574	天山股份	2023-05 -10	392,941. 00	44,300.0 0	14	3.30	504.27	-	-
中信证券	20230510000 16628	科大讯飞	2023-05 -10	4,967,65 5.00	75,900.0 0	14	3.30	6,375.1 6	-	-
中信证券	20230510000 16666	中国铁建	2023-05 -10	808,980. 00	69,500.0 0	14	2.30	723.59	-	-
中信证券	20230510000 16678	中国卫星	2023-05 -10	464,950. 00	17,000.0 0	14	2.30	415.87	-	-

中信证券	20230510000 19826	电投产融	2023-05 -10	232,560. 00	51,000.0 0	14	3.30	298.45	-	-
中信证券	20230510000 20030	中航电子	2023-05 -10	154,100. 00	10,000.0 0	14	3.60	215.74	-	-
中信证券	20230510000 20046	三峡能源	2023-05 -10	54,700.0 0	10,000.0 0	14	2.80	59.56	-	-
中信证券	20230510000 20092	中国移动	2023-05 -10	2,214,50 0.00	21,500.0 0	14	3.20	2,755.8 2	-	-
中信证券	20230510000 20116	华润双鹤	2023-05 -10	189,500. 00	10,000.0 0	14	1.40	103.17	-	-
中信证券	20230510000 20708	江铃汽车	2023-05 -10	150,500. 00	10,000.0 0	14	2.80	163.88	-	-
中信证券	20230510000 20738	中国卫星	2023-05 -10	864,260. 00	31,600.0 0	14	2.30	773.03	-	-
中信证券	20230510000 22234	桂冠电力	2023-05 -10	56,500.0 0	10,000.0 0	14	2.50	54.93	-	-
中信证券	20230510000 22856	东阿阿胶	2023-05 -10	139,050. 00	2,700.00	28	2.90	313.64	-	-
中信证券	20230510000 23914	光迅科技	2023-05 -10	353,642. 00	15,100.0 0	14	2.10	288.81	-	-
中信证券	20230510000 25102	华润双鹤	2023-05 -10	20,845.0 0	1,100.00	14	1.40	11.35	-	-

中信证券	20230510000 25170	光迅科技	2023-05 -10	1,812,70 8.00	77,400.0 0	14	2.10	1,480.3 8	-	-
中信证券	20230510000 32868	东方电气	2023-05 -10	292,000. 00	16,000.0 0	14	3.30	374.73	-	-
中信证券	20230511000 05270	美亚柏科	2023-05 -11	324,600. 00	15,000.0 0	14	2.90	366.08	-	-
中信证券	20230511000 05340	中国中铁	2023-05 -11	8,380.00	1,000.00	14	3.00	9.78	-	-
中信证券	20230511000 05535	中国卫通	2023-05 -11	125,790. 00	7,000.00	14	3.60	176.11	-	-
中信证券	20230511000 05558	中国软件	2023-05 -11	55,340.0 0	1,000.00	14	2.90	62.41	-	-
中信证券	20230511000 05564	华润双鹤	2023-05 -11	79,507.0 0	4,300.00	14	2.40	74.21	-	-
中信证券	20230511000 06135	中国卫星	2023-05 -11	441,548. 00	16,700.0 0	14	2.30	394.94	-	-
中信证券	20230511000 10475	东方通信	2023-05 -11	482,096. 00	46,400.0 0	14	3.80	712.43	-	-
中信证券	20230511000 10481	中兴通讯	2023-05 -11	3,168,00 0.00	100,000. 00	14	2.90	3,572.8 0	-	-
中信证券	20230511000 10491	中国长城	2023-05 -11	672,000. 00	60,000.0 0	14	2.40	627.20	-	-

中信证券	20230511000 10505	中国 长城	2023-05 -11	476,000. 00	42,500.0 0	14	2.40	444.27	-	-
中信证券	20230511000 13011	中国 西电	2023-05 -11	19,244.0 0	3,400.00	14	3.20	23.95	-	-
中信证券	20230511000 14975	天山 股份	2023-05 -11	198,202. 00	22,600.0 0	14	3.20	246.65	-	-
中信证券	20230511000 16127	中国 卫星	2023-05 -11	793,200. 00	30,000.0 0	14	3.60	1,110.4 8	-	-
中信证券	20230511000 17339	东阿 阿胶	2023-05 -11	765,700. 00	15,500.0 0	14	3.00	893.32	-	-
中信证券	20230511000 17421	美亚 柏科	2023-05 -11	400,340. 00	18,500.0 0	14	3.80	591.61	-	-
中信证券	20230511000 18043	科大 讯飞	2023-05 -11	1,394,84 8.00	22,400.0 0	14	3.30	1,790.0 5	-	-
中信证券	20230511000 19047	华润 双鹤	2023-05 -11	18,490.0 0	1,000.00	14	1.40	10.07	-	-
中信证券	20230511000 20791	万润 股份	2023-05 -11	1,863,43 9.00	106,300. 00	14	3.30	2,391.4 1	-	-
中信证券	20230511000 20847	东阿 阿胶	2023-05 -11	716,300. 00	14,500.0 0	14	3.00	835.68	-	-
中信证券	20230511000 20869	中海 油服	2023-05 -11	139,564. 00	9,200.00	14	3.00	162.82	-	-

中信证券	20230511000 20871	中国中免	2023-05 -11	1,440,50 0.00	10,000.0 0	14	2.00	1,120.3 9	-	-
中信证券	20230511000 20945	东阿阿胶	2023-05 -11	133,380. 00	2,700.00	28	2.90	300.85	-	-
中信证券	20230512000 06150	中航电子	2023-05 -12	456,000. 00	30,000.0 0	28	3.50	1,241.3 3	-	-
中信证券	20230516000 02768	中国卫星	2023-05 -16	183,400. 00	7,000.00	14	3.10	221.10	-	-
中信证券	20230516000 02806	中国卫星	2023-05 -16	262,000. 00	10,000.0 0	28	3.00	611.33	-	-
中信证券	20230516000 02878	许继电气	2023-05 -16	29,052.0 0	1,200.00	14	2.10	23.73	-	-
中信证券	20230516000 02907	长安汽车	2023-05 -16	36,270.0 0	3,000.00	14	3.30	46.55	-	-
中信证券	20230516000 02919	万润股份	2023-05 -16	15,600.0 0	1,000.00	14	3.20	19.41	-	-
中信证券	20230517000 03436	中国软件	2023-05 -17	78,596.0 0	1,400.00	14	2.90	88.64	-	-
中信证券	20230517000 03515	许继电气	2023-05 -17	29,076.0 0	1,200.00	14	2.10	23.75	-	-
中信证券	20230517000 03517	科大讯飞	2023-05 -17	291,650. 00	5,000.00	14	3.30	374.28	-	-

中信证券	20230517000 03538	中国 卫通	2023-05 -17	170,400. 00	10,000.0 0	14	3.60	238.56	-	-
中信证券	20230517000 03648	中国 中铁	2023-05 -17	7,880.00	1,000.00	14	3.00	9.19	-	-
中信证券	20230518000 03894	中国 软件	2023-05 -18	55,930.0 0	1,000.00	14	2.90	63.08	-	-
中信证券	20230518000 07770	中 粮科 技	2023-05 -18	111,478. 00	13,900.0 0	14	2.50	108.38	-	-
中信证券	20230518000 14782	海 油 工 程	2023-05 -18	64,890.0 0	10,500.0 0	14	2.60	65.61	-	-
中信证券	20230518000 17874	中 航 电 子	2023-05 -18	850,038. 00	54,700.0 0	14	3.20	1,057.8 3	-	-
中信证券	20230518000 18936	国 电 南 瑞	2023-05 -18	278,200. 00	10,000.0 0	14	3.20	346.20	-	-
中信证券	20230518000 19228	国 电 南 瑞	2023-05 -18	278,200. 00	10,000.0 0	14	3.20	346.20	-	-
中信证券	20230518000 19230	国 电 南 瑞	2023-05 -18	292,110. 00	10,500.0 0	14	3.20	363.51	-	-
中信证券	20230518000 21570	中 航 电 子	2023-05 -18	537,684. 00	34,600.0 0	14	3.20	669.12	-	-
中信证券	20230518000 21594	长 安 汽 车	2023-05 -18	15,535.0 0	1,300.00	14	3.30	19.94	-	-

中信证券	20230518000 24262	中国软件	2023-05 -18	559,300. 00	10,000.0 0	14	2.90	630.77	-	-
中信证券	20230518000 32508	中国软件	2023-05 -18	559,300. 00	10,000.0 0	14	2.90	630.77	-	-
中信证券	20230518000 35826	电科网安	2023-05 -18	321,200. 00	10,000.0 0	14	3.10	387.22	-	-
中信证券	20230518000 35856	中航电子	2023-05 -18	543,900. 00	35,000.0 0	14	3.20	676.85	-	-
中信证券	20230518000 35908	科大讯飞	2023-05 -18	611,900. 00	10,000.0 0	14	3.30	785.27	-	-
中信证券	20230518000 36024	中航沈飞	2023-05 -18	598,400. 00	10,000.0 0	14	2.20	511.96	-	-
中信证券	20230518000 36042	中航电子	2023-05 -18	543,900. 00	35,000.0 0	14	3.20	676.85	-	-
中信证券	20230518000 36086	上海石化	2023-05 -18	647,676. 00	199,900. 00	14	2.40	604.50	-	-
中信证券	20230518000 36248	科大讯飞	2023-05 -18	611,900. 00	10,000.0 0	14	3.30	785.27	-	-
中信证券	20230518000 36250	科大讯飞	2023-05 -18	4,895,20 0.00	80,000.0 0	14	3.30	6,282.1 7	-	-
中信证券	20230518000 36342	中国西电	2023-05 -18	93,236.0 0	16,300.0 0	14	3.20	116.03	-	-

中信证券	20230518000 36366	美亚柏科	2023-05 -18	32,850.0 0	1,500.00	14	2.90	37.05	-	-
中信证券	20230518000 36372	太极股份	2023-05 -18	372,300. 00	10,000.0 0	14	3.50	506.74	-	-
中信证券	20230518000 36402	东方电气	2023-05 -18	766,792. 00	40,400.0 0	14	3.20	954.23	-	-
中信证券	20230518000 36412	海康威视	2023-05 -18	451,231. 00	12,700.0 0	14	3.30	579.08	-	-
中信证券	20230518000 36418	中国卫通	2023-05 -18	259,500. 00	15,000.0 0	14	3.60	363.30	-	-
中信证券	20230518000 36428	光迅科技	2023-05 -18	409,059. 00	15,100.0 0	14	3.70	588.59	-	-
中信证券	20230522000 12880	招商蛇口	2023-05 -22	128,600. 00	10,000.0 0	14	3.30	165.04	-	-
中信证券	20230522000 17780	桂冠电力	2023-05 -22	1,172,08 8.00	200,700. 00	14	2.60	1,185.1 1	-	-
中信证券	20230522000 18436	中国卫通	2023-05 -22	171,800. 00	10,000.0 0	14	3.60	240.52	-	-
中信证券	20230522000 18988	江铃汽车	2023-05 -22	132,500. 00	10,000.0 0	14	2.90	149.43	-	-
中信证券	20230522000 20168	中国卫通	2023-05 -22	859,000. 00	50,000.0 0	14	3.60	1,202.6 0	-	-

中信证券	20230522000 23194	上海石化	2023-05 -22	32,100.0 0	10,000.0 0	14	3.10	38.70	-	-
中信证券	20230523000 05157	长安汽车	2023-05 -23	95,827.0 0	7,900.00	14	3.30	122.98	-	-
中信证券	20230523000 05158	光迅科技	2023-05 -23	25,210.0 0	1,000.00	14	3.30	32.35	-	-
中信证券	20230523000 05345	华润双鹤	2023-05 -23	19,310.0 0	1,000.00	14	3.00	22.53	-	-
中信证券	20230523000 06594	东阿阿胶	2023-05 -23	641,290. 00	13,000.0 0	14	3.10	773.11	-	-
中信证券	20230523000 07036	光迅科技	2023-05 -23	252,100. 00	10,000.0 0	14	3.10	303.92	-	-
中信证券	20230523000 07214	中航沈飞	2023-05 -23	580,600. 00	10,000.0 0	14	2.80	632.21	-	-
中信证券	20230523000 07650	远光软件	2023-05 -23	400,610. 00	48,500.0 0	14	3.10	482.96	-	-
中信证券	20230523000 08316	中国长城	2023-05 -23	398,825. 00	37,100.0 0	14	3.00	465.30	-	-
中信证券	20230523000 08344	电科网安	2023-05 -23	321,000. 00	10,000.0 0	14	2.90	362.02	-	-
中信证券	20230523000 08378	中国软件	2023-05 -23	55,910.0 0	1,000.00	14	2.90	63.05	-	-

中信证券	20230523000 08976	上海石化	2023-05 -23	31,600.0 0	10,000.0 0	14	3.10	38.10	-	-
中信证券	20230523000 09058	三峡能源	2023-05 -23	448,264. 00	81,800.0 0	14	2.60	453.24	-	-
中信证券	20230523000 09108	万润股份	2023-05 -23	459,200. 00	28,700.0 0	14	3.20	571.45	-	-
中信证券	20230523000 09446	江铃汽车	2023-05 -23	362,940. 00	27,600.0 0	14	2.90	409.32	-	-
中信证券	20230523000 09550	中国汽研	2023-05 -23	628,056. 00	31,200.0 0	14	3.20	781.58	-	-
中信证券	20230523000 12704	海康威视	2023-05 -23	366,800. 00	10,000.0 0	14	2.80	399.40	-	-
中信证券	20230523000 20496	桂冠电力	2023-05 -23	57,700.0 0	10,000.0 0	14	2.60	58.34	-	-
中信证券	20230523000 20516	海油发展	2023-05 -23	32,700.0 0	10,000.0 0	14	1.10	13.99	-	-
中信证券	20230523000 20524	中远海控	2023-05 -23	334,200. 00	30,000.0 0	14	3.30	428.89	-	-
中信证券	20230523000 20568	许继电气	2023-05 -23	230,000. 00	10,000.0 0	14	2.10	187.83	-	-
中信证券	20230523000 20580	东方电气	2023-05 -23	184,000. 00	10,000.0 0	14	3.30	236.13	-	-

中信证券	20230523000 20584	海康威视	2023-05 -23	440,160. 00	12,000.0 0	14	2.80	479.29	-	-
中信证券	20230523000 20590	中国汽研	2023-05 -23	283,833. 00	14,100.0 0	14	3.20	353.21	-	-
中信证券	20230523000 20614	航天信息	2023-05 -23	134,900. 00	10,000.0 0	14	1.50	78.69	-	-
中信证券	20230523000 22638	上海石化	2023-05 -23	31,600.0 0	10,000.0 0	14	3.10	38.10	-	-
中信证券	20230523000 22668	中航电子	2023-05 -23	150,400. 00	10,000.0 0	14	3.30	193.01	-	-
中信证券	20230523000 22702	招商证券	2023-05 -23	139,600. 00	10,000.0 0	14	3.10	168.30	-	-
中信证券	20230523000 22720	驰宏锌锗	2023-05 -23	52,800.0 0	10,000.0 0	14	1.10	22.59	-	-
中信证券	20230523000 22730	三峡能源	2023-05 -23	54,800.0 0	10,000.0 0	14	2.60	55.41	-	-
中信证券	20230523000 23416	天地科技	2023-05 -23	55,900.0 0	10,000.0 0	14	2.40	52.17	-	-
中信证券	20230523000 23418	海油工程	2023-05 -23	58,900.0 0	10,000.0 0	14	2.90	66.43	-	-
中信证券	20230523000 23446	中国铁建	2023-05 -23	102,300. 00	10,000.0 0	14	2.60	103.44	-	-

中信证券	20230523000 23484	马钢股份	2023-05 -23	26,500.0 0	10,000.0 0	14	1.70	17.52	-	-
中信证券	20230523000 24128	中国中铁	2023-05 -23	120,320. 00	16,000.0 0	14	3.00	140.37	-	-
中信证券	20230523000 24144	远光软件	2023-05 -23	82,600.0 0	10,000.0 0	14	3.20	102.79	-	-
中信证券	20230523000 24148	振华重工	2023-05 -23	36,700.0 0	10,000.0 0	14	3.00	42.82	-	-
中信证券	20230523000 24154	中国石油	2023-05 -23	110,250. 00	15,000.0 0	14	3.10	132.91	-	-
中信证券	20230523000 24172	中国核电	2023-05 -23	96,180.0 0	14,000.0 0	14	2.50	93.51	-	-
中信证券	20230523000 24200	国电南瑞	2023-05 -23	270,500. 00	10,000.0 0	14	3.20	336.62	-	-
中信证券	20230523000 25488	许继电气	2023-05 -23	230,000. 00	10,000.0 0	14	2.10	187.83	-	-
中信证券	20230523000 25490	中海油服	2023-05 -23	146,700. 00	10,000.0 0	14	3.10	176.86	-	-
中信证券	20230523000 25496	当升科技	2023-05 -23	52,450.0 0	1,000.00	14	2.60	53.03	-	-
中信证券	20230523000 25506	航天电器	2023-05 -23	632,400. 00	10,000.0 0	14	1.10	270.53	-	-

中信证券	20230523000 25512	振华重工	2023-05 -23	1,076,04 4.00	293,200. 00	14	3.00	1,255.3 8	-	-
中信证券	20230523000 25514	华润双鹤	2023-05 -23	19,310.0 0	1,000.00	14	2.80	21.03	-	-
中信证券	20230523000 25522	海油工程	2023-05 -23	134,292. 00	22,800.0 0	14	2.90	151.45	-	-
中信证券	20230523000 26914	中国铝业	2023-05 -23	54,200.0 0	10,000.0 0	14	2.90	61.13	-	-
中信证券	20230523000 26916	中国铝业	2023-05 -23	55,826.0 0	10,300.0 0	14	2.90	62.96	-	-
中信证券	20230524000 03229	长安汽车	2023-05 -24	712,816. 00	59,600.0 0	14	3.30	914.78	-	-
中信证券	20230524000 03231	长安汽车	2023-05 -24	581,256. 00	48,600.0 0	14	3.30	745.95	-	-
中信证券	20230524000 03250	中国软件	2023-05 -24	55,340.0 0	1,000.00	14	3.00	64.56	-	-
中信证券	20230524000 03275	中国联通	2023-05 -24	2,000,53 8.00	419,400. 00	14	3.30	2,567.3 6	-	-
中信证券	20230524000 03343	中国中免	2023-05 -24	747,656. 00	5,600.00	14	2.60	755.96	-	-
中信证券	20230524000 03403	中国中免	2023-05 -24	614,146. 00	4,600.00	14	2.60	620.97	-	-

中信证券	20230524000 03466	中国 铁建	2023-05 -24	2,182,00 4.00	222,200. 00	14	2.70	2,291.1 0	-	-
中信证券	20230524000 05916	长安 汽车	2023-05 -24	11,960.0 0	1,000.00	14	3.30	15.35	-	-
中信证券	20230524000 06428	华润 双鹤	2023-05 -24	186,600. 00	10,000.0 0	14	2.80	203.19	-	-
中信证券	20230524000 08596	中国 铁建	2023-05 -24	682,490. 00	69,500.0 0	14	2.60	690.07	-	-
中信证券	20230524000 08672	中国 卫星	2023-05 -24	820,968. 00	31,600.0 0	14	3.10	989.72	-	-
中信证券	20230524000 09830	海油 工程	2023-05 -24	952,836. 00	162,600. 00	14	2.90	1,074.5 9	-	-
中信证券	20230524000 11124	东阿 阿胶	2023-05 -24	67,200.0 0	1,400.00	14	3.10	81.01	-	-
中信证券	20230524000 11128	三峡 能源	2023-05 -24	54,000.0 0	10,000.0 0	14	2.60	54.60	-	-
中信证券	20230524000 11130	电投 产融	2023-05 -24	227,970. 00	51,000.0 0	14	2.90	257.10	-	-
中信证券	20230524000 11164	中国 软件	2023-05 -24	55,340.0 0	1,000.00	14	2.90	62.41	-	-
中信证券	20230524000 11208	东方 电气	2023-05 -24	292,960. 00	16,000.0 0	14	3.30	375.97	-	-

中信证券	20230524000 11224	远光软件	2023-05 -24	1,627,22 0.00	197,000. 00	14	3.20	2,024.9 8	-	-
中信证券	20230524000 11234	中航电子	2023-05 -24	148,300. 00	10,000.0 0	14	3.30	190.32	-	-
中信证券	20230524000 11248	科大讯飞	2023-05 -24	4,293,66 3.00	75,900.0 0	14	3.30	5,510.2 0	-	-
中信证券	20230524000 13788	江铃汽车	2023-05 -24	130,100. 00	10,000.0 0	14	2.90	146.72	-	-
中信证券	20230524000 13834	光迅科技	2023-05 -24	1,969,83 0.00	77,400.0 0	14	3.10	2,374.7 4	-	-
中信证券	20230524000 13836	光迅科技	2023-05 -24	384,295. 00	15,100.0 0	14	3.10	463.29	-	-
中信证券	20230524000 13856	中国移动	2023-05 -24	1,941,23 5.00	21,500.0 0	14	3.30	2,491.2 5	-	-
中信证券	20230524000 13874	上海石化	2023-05 -24	31,300.0 0	10,000.0 0	14	3.10	37.73	-	-
中信证券	20230524000 13884	天山股份	2023-05 -24	358,830. 00	44,300.0 0	14	3.10	432.59	-	-
中信证券	20230524000 13896	中国卫星	2023-05 -24	441,660. 00	17,000.0 0	14	3.10	532.45	-	-
中信证券	20230524000 13908	桂冠电力	2023-05 -24	57,400.0 0	10,000.0 0	14	2.60	58.04	-	-

中信证券	20230525000 04789	电科网安	2023-05 -25	31,740.0 0	1,000.00	14	3.10	38.26	-	-
中信证券	20230525000 04830	中国电信	2023-05 -25	3,287,46 6.00	579,800. 00	14	3.20	4,091.0 7	-	-
中信证券	20230525000 04835	长安汽车	2023-05 -25	12,030.0 0	1,000.00	14	3.30	15.44	-	-
中信证券	20230525000 04872	中国移动	2023-05 -25	366,000. 00	4,000.00	14	3.30	469.70	-	-
中信证券	20230525000 04889	中国石油	2023-05 -25	1,898,83 2.00	265,200. 00	14	3.20	2,362.9 9	-	-
中信证券	20230525000 04915	中航沈飞	2023-05 -25	518,408. 00	8,800.00	14	2.80	564.49	-	-
中信证券	20230525000 04916	中国石油	2023-05 -25	817,672. 00	114,200. 00	14	3.20	1,017.5 5	-	-
中信证券	20230525000 04937	中国动力	2023-05 -25	171,362. 00	9,400.00	14	2.20	146.61	-	-
中信证券	20230525000 04951	中航沈飞	2023-05 -25	777,612. 00	13,200.0 0	14	2.80	846.73	-	-
中信证券	20230525000 04966	中芯国际	2023-05 -25	1,762,60 0.00	35,000.0 0	14	2.60	1,782.1 8	-	-
中信证券	20230525000 04981	中国铁建	2023-05 -25	2,180,79 0.00	221,400. 00	14	2.70	2,289.8 3	-	-

中信证券	20230525000 04988	中芯国际	2023-05 -25	50,360.0 0	1,000.00	14	2.60	50.92	-	-
中信证券	20230525000 05003	华润双鹤	2023-05 -25	18,570.0 0	1,000.00	14	3.00	21.67	-	-
中信证券	20230525000 12070	中国长城	2023-05 -25	454,325. 00	42,500.0 0	14	3.00	530.05	-	-
中信证券	20230525000 12280	中兴通讯	2023-05 -25	3,215,00 0.00	100,000. 00	14	3.20	4,000.8 9	-	-
中信证券	20230525000 12284	中国长城	2023-05 -25	641,400. 00	60,000.0 0	14	3.00	748.30	-	-
中信证券	20230525000 12294	东阿阿胶	2023-05 -25	742,760. 00	15,500.0 0	14	3.10	895.44	-	-
中信证券	20230525000 12296	东阿阿胶	2023-05 -25	694,840. 00	14,500.0 0	14	3.10	837.67	-	-
中信证券	20230525000 12400	中国卫星	2023-05 -25	777,900. 00	30,000.0 0	14	3.10	937.80	-	-
中信证券	20230525000 14872	科大讯飞	2023-05 -25	1,245,66 4.00	22,400.0 0	14	3.30	1,598.6 0	-	-
中信证券	20230525000 16300	华润双鹤	2023-05 -25	18,570.0 0	1,000.00	14	3.00	21.67	-	-
中信证券	20230525000 16922	天山股份	2023-05 -25	182,608. 00	22,600.0 0	14	3.10	220.14	-	-

中信证券	20230525000 18254	万润股份	2023-05 -25	1,722,06 0.00	106,300. 00	14	3.20	2,143.0 1	-	-
中信证券	20230525000 18312	东方通信	2023-05 -25	473,744. 00	46,400.0 0	14	3.00	552.70	-	-
中信证券	20230525000 18352	中国西电	2023-05 -25	18,326.0 0	3,400.00	14	2.40	17.10	-	-
中信证券	20230525000 18376	中国中免	2023-05 -25	1,314,00 0.00	10,000.0 0	14	2.60	1,328.6 0	-	-
中信证券	20230525000 19916	美亚柏科	2023-05 -25	443,815. 00	18,500.0 0	14	2.60	448.75	-	-
中信证券	20230525000 21072	华润双鹤	2023-05 -25	79,851.0 0	4,300.00	14	3.00	93.16	-	-
中信证券	20230525000 22236	中海油服	2023-05 -25	132,480. 00	9,200.00	14	3.10	159.71	-	-
中信证券	20230525000 23430	美亚柏科	2023-05 -25	359,850. 00	15,000.0 0	14	2.60	363.85	-	-
中信证券	20230525000 23444	中国软件	2023-05 -25	54,500.0 0	1,000.00	14	2.90	61.46	-	-
中信证券	20230530000 19563	万润股份	2023-05 -30	16,220.0 0	1,000.00	7	3.30	10.41	-	-
中信证券	20230530000 20102	中国卫星	2023-05 -30	186,340. 00	7,000.00	7	3.20	115.94	-	-

中信 证券	20230530000 20115	许继 电气	2023-05 -30	27,960.0 0	1,200.00	7	3.00	16.31	-	-
中信 证券	20230530000 20117	长安 汽车	2023-05 -30	36,450.0 0	3,000.00	7	3.40	24.10	-	-
中信 证券	20230531000 07351	科大 讯飞	2023-05 -31	298,750. 00	5,000.00	7	3.40	197.51	-	-
中信 证券	20230531000 07591	许继 电气	2023-05 -31	27,840.0 0	1,200.00	7	3.00	16.24	-	-
中信 证券	20230531000 07707	中国 卫通	2023-05 -31	179,400. 00	10,000.0 0	7	4.00	139.53	-	-
中信 证券	20230531000 09244	中国 软件	2023-05 -31	85,022.0 0	1,400.00	7	3.10	51.25	-	-
中信 证券	20230601000 23042	中国 卫通	2023-06 -01	275,100. 00	15,000.0 0	7	4.00	213.97	-	-
中信 证券	20230601000 23067	科大 讯飞	2023-06 -01	657,300. 00	10,000.0 0	7	3.40	434.55	-	-
中信 证券	20230601000 25894	科大 讯飞	2023-06 -01	657,300. 00	10,000.0 0	7	3.40	434.55	-	-
中信 证券	20230601000 26454	国电 南瑞	2023-06 -01	269,800. 00	10,000.0 0	7	3.30	173.12	-	-
中信 证券	20230601000 26525	上海 石化	2023-06 -01	633,683. 00	199,900. 00	7	3.30	406.61	-	-

中信证券	20230601000 26554	中国西电	2023-06-01	86,879.0 0	16,300.0 0	7	3.10	52.37	-	-
中信证券	20230601000 27021	海康威视	2023-06-01	455,930.00	12,700.0 0	7	3.20	283.69	-	-
中信证券	20230601000 27650	科大讯飞	2023-06-01	5,258,400.00	80,000.0 0	7	3.40	3,476.39	-	-
中信证券	20230601000 28163	国电南瑞	2023-06-01	283,290.00	10,500.0 0	7	3.30	181.78	-	-
中信证券	20230601000 29151	国电南瑞	2023-06-01	269,800.00	10,000.0 0	7	3.30	173.12	-	-
中信证券	20230601000 30340	长安汽车	2023-06-01	15,431.0 0	1,300.00	7	3.40	10.20	-	-
中信证券	20230601000 31017	中国软件	2023-06-01	61,020.0 0	1,000.00	7	3.10	36.78	-	-
中信证券	20230601000 31687	中国软件	2023-06-01	610,200.00	10,000.0 0	7	3.20	379.68	-	-
中信证券	20230601000 32136	光迅科技	2023-06-01	415,552.00	15,100.0 0	7	3.40	274.73	-	-
中信证券	20230601000 33072	中航沈飞	2023-06-01	592,500.00	10,000.0 0	7	2.90	334.10	-	-
中信证券	20230601000 33412	中国软件	2023-06-01	610,200.00	10,000.0 0	7	3.20	379.68	-	-

中信证券	20230601000 33452	海油工程	2023-06 -01	65,100.0 0	10,500.0 0	7	3.00	37.98	-	-
中信证券	20230601000 34461	美亚柏科	2023-06 -01	36,840.0 0	1,500.00	7	2.80	20.06	-	-
中信证券	20230601000 34553	太极股份	2023-06 -01	392,800. 00	10,000.0 0	7	3.40	259.68	-	-
中信证券	20230601000 35691	中航电子	2023-06 -01	519,750. 00	35,000.0 0	7	3.30	333.51	-	-
中信证券	20230601000 35881	电科网安	2023-06 -01	298,900. 00	10,000.0 0	7	3.20	185.98	-	-
中信证券	20230601000 36548	中航电子	2023-06 -01	812,295. 00	54,700.0 0	7	3.30	521.22	-	-
中信证券	20230601000 36849	中航电子	2023-06 -01	513,810. 00	34,600.0 0	7	3.30	329.69	-	-
中信证券	20230601000 37688	东方电气	2023-06 -01	721,544. 00	40,400.0 0	7	3.20	448.96	-	-
中信证券	20230605000 18264	桂冠电力	2023-06 -05	1,170,08 1.00	200,700. 00	7	3.10	705.30	-	-
中信证券	20230605000 20700	中国卫通	2023-06 -05	181,200. 00	10,000.0 0	7	4.00	140.93	-	-
中信证券	20230605000 21390	中国卫通	2023-06 -05	906,000. 00	50,000.0 0	7	4.00	704.67	-	-

中信证券	20230605000 25667	江铃汽车	2023-06 -05	133,300. 00	10,000.0 0	7	3.00	77.76	-	-
中信证券	20230605000 26210	招商蛇口	2023-06 -05	127,400. 00	10,000.0 0	7	3.40	84.23	-	-
中信证券	20230606000 14284	三峡能源	2023-06 -06	53,200.0 0	10,000.0 0	7	3.00	31.03	-	-
中信证券	20230606000 14839	海油工程	2023-06 -06	136,800. 00	22,800.0 0	7	3.00	79.80	-	-
中信证券	20230606000 14844	中国石油	2023-06 -06	114,900. 00	15,000.0 0	7	3.30	73.73	-	-
中信证券	20230606000 14966	中国铝业	2023-06 -06	56,856.0 0	10,300.0 0	7	3.10	34.27	-	-
中信证券	20230606000 14970	光迅科技	2023-06 -06	260,200. 00	10,000.0 0	7	3.40	172.02	-	-
中信证券	20230606000 15021	海油发展	2023-06 -06	31,700.0 0	10,000.0 0	7	2.60	16.03	-	-
中信证券	20230606000 15132	招商证券	2023-06 -06	137,300. 00	10,000.0 0	7	3.20	85.43	-	-
中信证券	20230606000 15196	长安汽车	2023-06 -06	93,694.0 0	7,900.00	7	3.40	61.94	-	-
中信证券	20230606000 15263	中航电子	2023-06 -06	143,400. 00	10,000.0 0	7	3.20	89.23	-	-

中信证券	20230606000 15364	中国 铁建	2023-06 -06	101,500. 00	10,000.0 0	7	2.80	55.26	-	-
中信证券	20230606000 15980	远 光 软 件	2023-06 -06	427,770. 00	48,500.0 0	7	3.00	249.53	-	-
中信证券	20230606000 16003	国 电 南 瑞	2023-06 -06	267,800. 00	10,000.0 0	7	3.30	171.84	-	-
中信证券	20230606000 17085	海 油 工 程	2023-06 -06	60,000.0 0	10,000.0 0	7	3.00	35.00	-	-
中信证券	20230606000 17215	光 迅 科 技	2023-06 -06	26,020.0 0	1,000.00	7	3.40	17.20	-	-
中信证券	20230606000 17297	中 国 软 件	2023-06 -06	47,190.0 0	1,000.00	7	3.20	29.36	-	-
中信证券	20230606000 17403	许 继 电 气	2023-06 -06	222,100. 00	10,000.0 0	7	3.00	129.56	-	-
中信证券	20230606000 17598	许 继 电 气	2023-06 -06	222,100. 00	10,000.0 0	7	3.00	129.56	-	-
中信证券	20230606000 18079	海 康 威 视	2023-06 -06	349,000. 00	10,000.0 0	7	3.10	210.37	-	-
中信证券	20230606000 18163	中 国 汽 研	2023-06 -06	279,603. 00	14,100.0 0	7	3.40	184.85	-	-
中信证券	20230606000 18213	中 国 铝 业	2023-06 -06	55,200.0 0	10,000.0 0	7	3.10	33.27	-	-

中信证券	20230606000 18259	桂冠电力	2023-06 -06	55,700.0 0	10,000.0 0	7	3.10	33.57	-	-
中信证券	20230606000 18326	江铃汽车	2023-06 -06	356,868. 00	27,600.0 0	7	3.00	208.17	-	-
中信证券	20230606000 18485	万润股份	2023-06 -06	466,088. 00	28,700.0 0	7	3.20	290.01	-	-
中信证券	20230606000 18498	东阿阿胶	2023-06 -06	666,120. 00	13,000.0 0	7	3.20	414.47	-	-
中信证券	20230606000 19043	海康威视	2023-06 -06	418,800. 00	12,000.0 0	7	3.10	252.44	-	-
中信证券	20230606000 19063	航天信息	2023-06 -06	142,100. 00	10,000.0 0	7	2.00	55.26	-	-
中信证券	20230606000 19271	远光软件	2023-06 -06	88,200.0 0	10,000.0 0	7	3.00	51.45	-	-
中信证券	20230606000 19774	航天电器	2023-06 -06	576,800. 00	10,000.0 0	7	2.80	314.04	-	-
中信证券	20230606000 20076	东方电气	2023-06 -06	177,200. 00	10,000.0 0	7	3.20	110.26	-	-
中信证券	20230606000 20088	中航沈飞	2023-06 -06	562,200. 00	10,000.0 0	7	3.10	338.88	-	-
中信证券	20230606000 20178	电科网安	2023-06 -06	289,200. 00	10,000.0 0	7	2.70	151.83	-	-

中信证券	20230606000 20395	马钢股份	2023-06 -06	26,600.0 0	10,000.0 0	7	2.20	11.38	-	-
中信证券	20230606000 20724	中国汽研	2023-06 -06	618,696. 00	31,200.0 0	7	3.40	409.03	-	-
中信证券	20230606000 21037	振华重工	2023-06 -06	1,043,79 2.00	293,200. 00	7	2.70	547.99	-	-
中信证券	20230606000 21115	中国核电	2023-06 -06	93,800.0 0	14,000.0 0	7	2.20	40.13	-	-
中信证券	20230606000 21315	三峡能源	2023-06 -06	435,176. 00	81,800.0 0	7	3.00	253.85	-	-
中信证券	20230606000 21366	中远海控	2023-06 -06	315,000. 00	30,000.0 0	7	3.20	196.00	-	-
中信证券	20230606000 21393	振华重工	2023-06 -06	35,600.0 0	10,000.0 0	7	2.70	18.69	-	-
中信证券	20230606000 21478	驰宏锌锗	2023-06 -06	52,000.0 0	10,000.0 0	7	2.40	24.27	-	-
中信证券	20230606000 21493	天地科技	2023-06 -06	53,300.0 0	10,000.0 0	7	2.50	25.91	-	-
中信证券	20230606000 21535	中国中铁	2023-06 -06	125,760. 00	16,000.0 0	7	3.20	78.25	-	-
中信证券	20230607000 05304	烽火通信	2023-06 -07	280,731. 00	14,100.0 0	14	1.20	131.01	-	-

中信证券	20230607000 05315	烽火通信	2023-06 -07	340,461. 00	17,100.0 0	14	1.20	158.88	-	-
中信证券	20230607000 05347	中国软件	2023-06 -07	135,156. 00	2,800.00	14	2.70	141.91	-	-
中信证券	20230607000 16140	中国软件	2023-06 -07	48,270.0 0	1,000.00	7	3.20	30.03	-	-
中信证券	20230607000 16490	光迅科技	2023-06 -07	2,117,66 4.00	77,400.0 0	7	3.40	1,400.0 1	-	-
中信证券	20230607000 17133	天山股份	2023-06 -07	360,159. 00	44,300.0 0	7	2.70	189.08	-	-
中信证券	20230607000 17240	江铃汽车	2023-06 -07	129,000. 00	10,000.0 0	7	3.00	75.25	-	-
中信证券	20230607000 17623	科大讯飞	2023-06 -07	324,700. 00	5,000.00	7	3.40	214.66	-	-
中信证券	20230607000 17844	中国软件	2023-06 -07	67,578.0 0	1,400.00	7	2.80	36.79	-	-
中信证券	20230607000 18344	长安汽车	2023-06 -07	11,530.0 0	1,000.00	7	3.50	7.85	-	-
中信证券	20230607000 18560	远光软件	2023-06 -07	1,773,00 0.00	197,000. 00	7	3.00	1,034.2 5	-	-
中信证券	20230607000 19189	中国铁建	2023-06 -07	2,230,88 8.00	222,200. 00	7	2.80	1,214.5 9	-	-

中信证券	20230607000 19489	三峡能源	2023-06 -07	52,600.0 0	10,000.0 0	7	3.10	31.71	-	-
中信证券	20230607000 20172	中国移动	2023-06 -07	2,060,77 5.00	21,500.0 0	7	3.30	1,322.3 3	-	-
中信证券	20230607000 20187	中国卫通	2023-06 -07	175,700. 00	10,000.0 0	7	4.00	136.66	-	-
中信证券	20230607000 20326	桂冠电力	2023-06 -07	55,400.0 0	10,000.0 0	7	3.10	33.39	-	-
中信证券	20230607000 20423	中国卫星	2023-06 -07	454,410. 00	17,000.0 0	7	2.90	256.24	-	-
中信证券	20230607000 21174	光迅科技	2023-06 -07	413,136. 00	15,100.0 0	7	3.40	273.13	-	-
中信证券	20230607000 21335	美亚柏科	2023-06 -07	465,830. 00	18,500.0 0	7	3.00	271.73	-	-
中信证券	20230607000 21700	科大讯飞	2023-06 -07	4,928,94 6.00	75,900.0 0	7	3.40	3,258.5 8	-	-
中信证券	20230607000 21976	东阿阿胶	2023-06 -07	138,483. 00	2,700.00	7	3.30	88.86	-	-
中信证券	20230607000 22664	东方电气	2023-06 -07	279,840. 00	16,000.0 0	7	3.20	174.12	-	-
中信证券	20230607000 22724	中国软件	2023-06 -07	48,270.0 0	1,000.00	7	3.20	30.03	-	-

中信证券	20230607000 23536	中国 铁建	2023-06 -07	697,780. 00	69,500.0 0	7	2.80	379.90	-	-
中信证券	20230607000 24208	中航 电子	2023-06 -07	141,900. 00	10,000.0 0	7	3.10	85.53	-	-
中信证券	20230607000 25112	海油 工程	2023-06 -07	985,356. 00	162,600. 00	7	3.00	574.79	-	-
中信证券	20230607000 25114	东阿 阿胶	2023-06 -07	71,806.0 0	1,400.00	7	3.20	44.68	-	-
中信证券	20230608000 04252	中航 西飞	2023-06 -08	23,500.0 0	1,000.00	14	2.90	34.08	-	-
中信证券	20230608000 04263	碧水 源	2023-06 -08	16,860.0 0	3,000.00	14	2.70	22.76	-	-
中信证券	20230608000 04277	中工 国际	2023-06 -08	115,600. 00	10,000.0 0	14	3.00	173.40	-	-
中信证券	20230608000 04282	长安 汽车	2023-06 -08	18,608.0 0	1,600.00	14	3.40	31.63	-	-
中信证券	20230608000 04493	岳阳 林纸	2023-06 -08	481,492. 00	70,600.0 0	14	3.30	794.46	-	-
中信证券	20230608000 04638	中国 动力	2023-06 -08	307,008. 00	16,400.0 0	14	2.20	337.71	-	-
中信证券	20230608000 04646	中国 软件	2023-06 -08	104,236. 00	2,200.00	14	2.70	140.72	-	-

中信证券	20230608000 04818	中远海控	2023-06 -08	10,680.0 0	1,000.00	14	3.10	16.55	-	-
中信证券	20230608000 16979	中国软件	2023-06 -08	47,380.0 0	1,000.00	7	2.80	25.80	-	-
中信证券	20230608000 16980	美亚柏科	2023-06 -08	36,405.0 0	1,500.00	7	3.30	23.36	-	-
中信证券	20230608000 17773	科大讯飞	2023-06 -08	642,100. 00	10,000.0 0	7	3.40	424.50	-	-
中信证券	20230608000 17845	中芯国际	2023-06 -08	53,560.0 0	1,000.00	7	2.70	28.12	-	-
中信证券	20230608000 18353	华润双鹤	2023-06 -08	17,480.0 0	1,000.00	7	2.70	9.18	-	-
中信证券	20230608000 18592	中国动力	2023-06 -08	175,968. 00	9,400.00	7	2.40	82.12	-	-
中信证券	20230608000 18798	华润双鹤	2023-06 -08	17,480.0 0	1,000.00	7	2.70	9.18	-	-
中信证券	20230608000 18908	东阿阿胶	2023-06 -08	137,700. 00	2,700.00	7	3.30	88.36	-	-
中信证券	20230608000 19222	太极股份	2023-06 -08	392,800. 00	10,000.0 0	7	2.80	213.86	-	-
中信证券	20230608000 19481	美亚柏科	2023-06 -08	448,995. 00	18,500.0 0	7	3.00	261.91	-	-

中信证券	20230608000 19493	中国 长城	2023-06 -08	828,000. 00	60,000.0 0	7	3.30	531.30	-	-
中信证券	20230608000 19611	美亚 柏科	2023-06 -08	364,050. 00	15,000.0 0	7	3.00	212.36	-	-
中信证券	20230608000 19652	长安 汽车	2023-06 -08	11,630.0 0	1,000.00	7	3.50	7.91	-	-
中信证券	20230608000 20252	中国 软件	2023-06 -08	47,380.0 0	1,000.00	7	3.20	29.48	-	-
中信证券	20230608000 20298	中国 电信	2023-06 -08	3,577,36 6.00	579,800. 00	7	3.40	2,365.0 4	-	-
中信证券	20230608000 20431	华润 双鹤	2023-06 -08	75,164.0 0	4,300.00	7	2.70	39.46	-	-
中信证券	20230608000 20611	中国 软件	2023-06 -08	473,800. 00	10,000.0 0	7	2.80	257.96	-	-
中信证券	20230608000 20670	中国 软件	2023-06 -08	473,800. 00	10,000.0 0	7	2.80	257.96	-	-
中信证券	20230608000 21157	中兴 通讯	2023-06 -08	3,539,00 0.00	100,000. 00	7	3.30	2,270.8 6	-	-
中信证券	20230608000 21291	中国 卫通	2023-06 -08	259,800. 00	15,000.0 0	7	4.00	202.07	-	-
中信证券	20230608000 21484	长安 汽车	2023-06 -08	15,119.0 0	1,300.00	7	3.50	10.29	-	-

中信证券	20230608000 21701	天山股份	2023-06 -08	187,128. 00	22,600.0 0	7	2.70	98.24	-	-
中信证券	20230608000 22653	中国卫星	2023-06 -08	795,000. 00	30,000.0 0	7	2.90	448.29	-	-
中信证券	20230608000 22759	东阿阿胶	2023-06 -08	739,500. 00	14,500.0 0	7	3.20	460.13	-	-
中信证券	20230608000 22898	海油工程	2023-06 -08	64,050.0 0	10,500.0 0	7	3.40	42.34	-	-
中信证券	20230608000 23451	中国中免	2023-06 -08	1,175,80 0.00	10,000.0 0	7	2.70	617.30	-	-
中信证券	20230608000 23600	中国铁建	2023-06 -08	2,320,27 2.00	221,400. 00	7	2.80	1,263.2 6	-	-
中信证券	20230608000 23651	海康威视	2023-06 -08	438,785. 00	12,700.0 0	7	3.00	255.96	-	-
中信证券	20230608000 23754	光迅科技	2023-06 -08	405,888. 00	15,100.0 0	7	3.10	244.66	-	-
中信证券	20230608000 23835	科大讯飞	2023-06 -08	5,136,80 0.00	80,000.0 0	7	3.40	3,396.0 0	-	-
中信证券	20230608000 23931	万润股份	2023-06 -08	1,711,43 0.00	106,300. 00	7	3.20	1,064.8 9	-	-
中信证券	20230608000 24077	东方电气	2023-06 -08	706,192. 00	40,400.0 0	7	3.20	439.41	-	-

中信证券	20230608000 24470	中国西电	2023-06-08	17,680.00	3,400.00	7	3.20	11.00	-	-
中信证券	20230608000 24495	科大讯飞	2023-06-08	642,100.00	10,000.00	7	3.40	424.50	-	-
中信证券	20230608000 24737	科大讯飞	2023-06-08	1,438,304.00	22,400.00	7	3.40	950.88	-	-
中信证券	20230608000 24822	中国西电	2023-06-08	84,760.00	16,300.00	7	2.50	41.20	-	-
中信证券	20230608000 25292	电科网安	2023-06-08	28,400.00	1,000.00	7	2.70	14.91	-	-
中信证券	20230609000 08655	中航电子	2023-06-09	428,100.00	30,000.00	14	3.00	606.48	-	-
中信证券	20230612000 39152	招商蛇口	2023-06-12	134,400.00	10,000.00	7	2.00	52.27	-	-
中信证券	20230612000 39335	中国卫通	2023-06-12	873,500.00	50,000.00	7	4.00	679.39	-	-
中信证券	20230612000 40027	桂冠电力	2023-06-12	1,143,990.00	200,700.00	7	3.10	689.57	-	-
中信证券	20230612000 40372	江铃汽车	2023-06-12	135,500.00	10,000.00	7	3.00	79.04	-	-
中信证券	20230612000 40656	中国卫通	2023-06-12	174,700.00	10,000.00	7	4.00	135.88	-	-

中信证券	20230613000 18221	国电南瑞	2023-06 -13	266,100. 00	10,000.0 0	7	3.30	170.75	-	-
中信证券	20230613000 18242	中国卫星	2023-06 -13	273,100. 00	10,000.0 0	28	2.20	283.72	273,100. 00	283.72
中信证券	20230613000 18529	中远海控	2023-06 -13	317,100. 00	30,000.0 0	7	3.20	197.31	-	-
中信证券	20230613000 19053	万润股份	2023-06 -13	466,662. 00	28,700.0 0	7	3.40	308.52	-	-
中信证券	20230613000 19446	许继电气	2023-06 -13	225,500. 00	10,000.0 0	7	2.20	96.46	-	-
中信证券	20230613000 19449	三峡能源	2023-06 -13	53,300.0 0	10,000.0 0	7	3.10	32.13	-	-
中信证券	20230613000 19463	光迅科技	2023-06 -13	289,700. 00	10,000.0 0	7	3.10	174.62	-	-
中信证券	20230613000 19541	中国核电	2023-06 -13	96,180.0 0	14,000.0 0	7	2.20	41.14	-	-
中信证券	20230613000 19745	天地科技	2023-06 -13	54,100.0 0	10,000.0 0	7	1.20	12.62	-	-
中信证券	20230613000 19845	海油发展	2023-06 -13	31,300.0 0	10,000.0 0	7	1.20	7.30	-	-
中信证券	20230613000 19847	海油工程	2023-06 -13	60,000.0 0	10,000.0 0	7	3.40	39.67	-	-

中信证券	20230613000 19892	光迅科技	2023-06 -13	28,970.0 0	1,000.00	7	3.10	17.46	-	-
中信证券	20230613000 19894	东方电气	2023-06 -13	172,900. 00	10,000.0 0	7	3.20	107.58	-	-
中信证券	20230613000 20066	航天信息	2023-06 -13	147,600. 00	10,000.0 0	7	1.20	34.44	-	-
中信证券	20230613000 20071	振华重工	2023-06 -13	1,067,24 8.00	293,200. 00	7	4.90	1,016.8 5	-	-
中信证券	20230613000 20386	许继电气	2023-06 -13	225,500. 00	10,000.0 0	7	2.20	96.46	-	-
中信证券	20230613000 20454	振华重工	2023-06 -13	36,400.0 0	10,000.0 0	7	4.90	34.68	-	-
中信证券	20230613000 20467	中航沈飞	2023-06 -13	554,300. 00	10,000.0 0	7	3.10	334.12	-	-
中信证券	20230613000 20485	驰宏锌锗	2023-06 -13	51,800.0 0	10,000.0 0	7	1.20	12.09	-	-
中信证券	20230613000 20495	海康威视	2023-06 -13	402,960. 00	12,000.0 0	7	3.00	235.06	-	-
中信证券	20230613000 20496	江铃汽车	2023-06 -13	377,016. 00	27,600.0 0	7	3.00	219.93	-	-
中信证券	20230613000 20669	马钢股份	2023-06 -13	26,200.0 0	10,000.0 0	7	1.20	6.11	-	-

中信证券	20230613000 20706	中国 汽研	2023-06 -13	296,100. 00	14,100.0 0	7	3.40	195.76	-	-
中信证券	20230613000 20769	东阿 阿胶	2023-06 -13	630,500. 00	13,000.0 0	7	3.30	404.57	-	-
中信证券	20230613000 20783	中国 铁建	2023-06 -13	101,300. 00	10,000.0 0	7	2.90	57.12	-	-
中信证券	20230613000 20997	三峡 能源	2023-06 -13	435,994. 00	81,800.0 0	7	3.10	262.81	-	-
中信证券	20230613000 21003	中国 铝业	2023-06 -13	55,300.0 0	10,000.0 0	7	3.10	33.33	-	-
中信证券	20230613000 21102	海油 工程	2023-06 -13	136,800. 00	22,800.0 0	7	3.40	90.44	-	-
中信证券	20230613000 21114	中国 汽研	2023-06 -13	655,200. 00	31,200.0 0	7	3.40	433.16	-	-
中信证券	20230613000 21180	中国 铝业	2023-06 -13	56,959.0 0	10,300.0 0	7	3.10	34.33	-	-
中信证券	20230613000 21298	桂冠 电力	2023-06 -13	56,200.0 0	10,000.0 0	7	3.10	33.88	-	-
中信证券	20230613000 21414	远光 软件	2023-06 -13	89,800.0 0	10,000.0 0	7	3.00	52.38	-	-
中信证券	20230613000 21438	电科 网安	2023-06 -13	294,100. 00	10,000.0 0	7	2.30	131.53	-	-

中信证券	20230613000 21503	中国 中铁	2023-06 -13	121,120. 00	16,000.0 0	7	3.20	75.36	-	-
中信证券	20230613000 21685	航天 电器	2023-06 -13	562,100. 00	10,000.0 0	7	1.20	131.16	-	-
中信证券	20230613000 21744	中国 软件	2023-06 -13	49,030.0 0	1,000.00	7	2.80	26.69	-	-
中信证券	20230613000 21758	招商 证券	2023-06 -13	138,900. 00	10,000.0 0	7	3.20	86.43	-	-
中信证券	20230613000 21778	长安 汽车	2023-06 -13	96,459.0 0	7,900.00	7	3.50	65.65	-	-
中信证券	20230613000 21850	中航 电子	2023-06 -13	143,900. 00	10,000.0 0	7	3.10	86.74	-	-
中信证券	20230613000 22110	远光 软件	2023-06 -13	435,530. 00	48,500.0 0	7	3.00	254.06	-	-
中信证券	20230613000 22162	中国 石油	2023-06 -13	114,150. 00	15,000.0 0	7	3.30	73.25	-	-
中信证券	20230613000 22279	海康 威视	2023-06 -13	335,800. 00	10,000.0 0	7	3.00	195.88	-	-
中信证券	20230614000 00801	长安 汽车	2023-06 -14	15,873.0 0	1,300.00	14	4.10	25.31	-	-
中信证券	20230614000 00822	中工 国际	2023-06 -14	112,200. 00	10,000.0 0	14	3.00	130.90	-	-

中信证券	2023061400000933	中国软件	2023-06-14	49,000.00	1,000.00	14	2.70	51.45	-	-
中信证券	2023061400000943	东方通信	2023-06-14	113,500.00	10,000.00	14	4.10	180.97	-	-
中信证券	2023061400000966	太极股份	2023-06-14	40,670.00	1,000.00	14	2.70	42.70	-	-
中信证券	2023061400001019	中国电研	2023-06-14	52,250.00	2,200.00	14	3.50	71.12	-	-
中信证券	2023061400048836	中国卫通	2023-06-14	179,600.00	10,000.00	14	3.90	272.39	-	-
中信证券	2023061400049126	美亚柏科	2023-06-14	458,430.00	18,500.00	14	3.30	588.32	-	-
中信证券	2023061400049356	东阿阿胶	2023-06-14	69,146.00	1,400.00	14	3.20	86.05	-	-
中信证券	2023061400049522	中国卫星	2023-06-14	469,200.00	17,000.00	14	2.10	383.18	-	-
中信证券	2023061400049538	中国软件	2023-06-14	49,000.00	1,000.00	14	2.70	51.45	-	-
中信证券	2023061400049596	中国软件	2023-06-14	68,600.00	1,400.00	14	2.70	72.03	-	-
中信证券	2023061400049700	天山股份	2023-06-14	375,221.00	44,300.00	14	2.20	321.02	-	-

中信证券	20230614000 50076	东阿阿胶	2023-06 -14	133,353. 00	2,700.00	14	3.20	165.95	-	-
中信证券	20230614000 50245	中国软件	2023-06 -14	49,000.0 0	1,000.00	14	2.70	51.45	-	-
中信证券	20230614000 50352	长安汽车	2023-06 -14	12,210.0 0	1,000.00	14	4.10	19.47	-	-
中信证券	20230614000 50576	三峡能源	2023-06 -14	52,500.0 0	10,000.0 0	14	3.10	63.29	-	-
中信证券	20230614000 50594	桂冠电力	2023-06 -14	56,100.0 0	10,000.0 0	14	1.60	34.91	-	-
中信证券	20230614000 50846	科大讯飞	2023-06 -14	375,650. 00	5,000.00	7	3.40	248.35	-	-
中信证券	20230614000 51377	科大讯飞	2023-06 -14	5,702,36 7.00	75,900.0 0	7	3.40	3,769.9 0	-	-
中信证券	20230614000 51493	海油工程	2023-06 -14	975,600. 00	162,600. 00	14	4.80	1,821.1 2	-	-
中信证券	20230614000 51522	光迅科技	2023-06 -14	481,237. 00	15,100.0 0	14	3.00	561.44	-	-
中信证券	20230614000 51964	东方电气	2023-06 -14	272,000. 00	16,000.0 0	14	3.00	317.33	-	-
中信证券	20230614000 52142	远光软件	2023-06 -14	1,778,91 0.00	197,000. 00	14	1.90	1,314.4 2	-	-

中信证券	20230615000 12405	长安汽车	2023-06 -15	16,263.0 0	1,300.00	14	4.10	25.93	-	-
中信证券	20230615000 12464	中工国际	2023-06 -15	112,400. 00	10,000.0 0	14	3.00	131.13	-	-
中信证券	20230615000 12636	中国软件	2023-06 -15	48,850.0 0	1,000.00	14	2.70	51.29	-	-
中信证券	20230615000 12647	长安汽车	2023-06 -15	267,714. 00	21,400.0 0	14	4.10	426.86	-	-
中信证券	20230615000 12660	中材科技	2023-06 -15	346,970. 00	17,000.0 0	28	1.00	144.57	346,970. 00	144.57
中信证券	20230615000 12697	中工国际	2023-06 -15	1,124,00 0.00	100,000. 00	14	3.00	1,311.3 3	-	-
中信证券	20230615000 12711	太钢不锈	2023-06 -15	150,100. 00	38,000.0 0	28	1.10	68.80	150,100. 00	68.80
中信证券	20230615000 12714	中材科技	2023-06 -15	565,357. 00	27,700.0 0	14	1.10	241.85	-	-
中信证券	20230615000 12722	东方通信	2023-06 -15	113,000. 00	10,000.0 0	28	4.00	738.34	113,000. 00	738.34
中信证券	20230615000 12736	中国动力	2023-06 -15	526,960. 00	28,000.0 0	14	2.80	573.80	-	-
中信证券	20230615000 12751	光迅科技	2023-06 -15	1,342,79 8.00	38,300.0 0	14	3.00	1,566.6 0	-	-

中信证券	20230615000 12906	岳阳林纸	2023-06 -15	2,040,80 9.00	290,300. 00	14	3.40	2,698.4 0	-	-
中信证券	20230615000 13004	中国电研	2023-06 -15	52,910.0 0	2,200.00	28	3.40	74.96	52,910.0 0	74.96
中信证券	20230615000 28857	中国软件	2023-06 -15	48,850.0 0	1,000.00	14	2.70	51.29	-	-
中信证券	20230615000 29028	中国西电	2023-06 -15	17,952.0 0	3,400.00	14	2.40	16.76	-	-
中信证券	20230615000 29254	华润双鹤	2023-06 -15	17,280.0 0	1,000.00	14	2.60	17.47	-	-
中信证券	20230615000 29335	中国西电	2023-06 -15	86,064.0 0	16,300.0 0	14	2.40	80.33	-	-
中信证券	20230615000 29887	中国长城	2023-06 -15	855,600. 00	60,000.0 0	7	3.10	810.44	-	-
中信证券	20230615000 29991	美亚柏科	2023-06 -15	35,715.0 0	1,500.00	14	3.30	45.83	-	-
中信证券	20230615000 30488	华润双鹤	2023-06 -15	17,280.0 0	1,000.00	14	2.60	17.47	-	-
中信证券	20230615000 30501	中国软件	2023-06 -15	48,850.0 0	1,000.00	14	2.70	51.29	-	-
中信证券	20230615000 30720	海油工程	2023-06 -15	62,895.0 0	10,500.0 0	14	4.80	117.40	-	-

中信证券	20230615000 32857	中国中免	2023-06 -15	1,300,00 0.00	10,000.0 0	14	2.10	1,061.6 7	-	-
中信证券	20230615000 33920	中国动力	2023-06 -15	176,908. 00	9,400.00	14	2.80	192.63	-	-
中信证券	20230615000 34955	电科网安	2023-06 -15	29,220.0 0	1,000.00	14	2.50	28.41	-	-
中信证券	20230615000 35141	东方电气	2023-06 -15	707,404. 00	40,400.0 0	14	3.00	825.30	-	-
中信证券	20230615000 35690	中国软件	2023-06 -15	488,500. 00	10,000.0 0	14	2.70	512.93	-	-
中信证券	20230615000 35702	太极股份	2023-06 -15	400,700. 00	10,000.0 0	14	2.70	420.74	-	-
中信证券	20230615000 35780	海康威视	2023-06 -15	424,688. 00	12,700.0 0	14	2.90	478.95	-	-
中信证券	20230615000 36552	科大讯飞	2023-06 -15	1,632,51 2.00	22,400.0 0	14	3.30	2,095.0 6	-	-
中信证券	20230615000 36844	美亚柏科	2023-06 -15	357,150. 00	15,000.0 0	14	3.30	458.34	-	-
中信证券	20230615000 37067	光迅科技	2023-06 -15	529,406. 00	15,100.0 0	14	3.00	617.64	-	-
中信证券	20230615000 37079	天山股份	2023-06 -15	190,970. 00	22,600.0 0	14	2.20	163.39	-	-

中信证券	20230615000 37084	中国软件	2023-06 -15	488,500. 00	10,000.0 0	14	2.70	512.93	-	-
中信证券	20230615000 38032	科大讯飞	2023-06 -15	5,830,40 0.00	80,000.0 0	14	3.30	7,482.3 5	-	-
中信证券	20230615000 38115	华润双鹤	2023-06 -15	74,304.0 0	4,300.00	14	2.60	75.13	-	-
中信证券	20230615000 38914	万润股份	2023-06 -15	1,781,58 8.00	106,300. 00	14	3.20	2,217.0 9	-	-
中信证券	20230615000 39039	美亚柏科	2023-06 -15	440,485. 00	18,500.0 0	14	3.30	565.29	-	-
中信证券	20230619000 19102	中国卫通	2023-06 -19	188,000. 00	10,000.0 0	14	3.90	224.03	188,000. 00	224.03
中信证券	20230619000 19199	招商蛇口	2023-06 -19	133,400. 00	10,000.0 0	14	2.00	81.53	133,400. 00	81.53
中信证券	20230619000 19359	中国卫通	2023-06 -19	940,000. 00	50,000.0 0	14	3.90	1,120.1 7	940,000. 00	1,120.1 7
中信证券	20230620000 22009	中国卫星	2023-06 -20	281,750. 00	9,800.00	14	1.20	93.91	281,750. 00	93.91
中信证券	20230620000 22074	中国软件	2023-06 -20	1,126,35 6.00	21,200.0 0	14	1.90	594.46	1,126,35 6.00	594.46
中信证券	20230620000 22120	中航沈飞	2023-06 -20	1,552,20 0.00	26,000.0 0	14	2.50	11,477. 91	2,783,14 4.00	11,477. 91

中信证券	20230620000 22181	招商蛇口	2023-06 -20	5,004,60 0.00	380,000. 00	14	2.90	4,031.4 9	5,004,60 0.00	4,031.4 9
中信证券	20230620000 22186	电科网安	2023-06 -20	615,308. 00	19,900.0 0	14	1.20	205.10	615,308. 00	205.10
中信证券	20230620000 22202	航发动力	2023-06 -20	988,320. 00	24,000.0 0	14	2.60	713.79	988,320. 00	713.79
中信证券	20230620000 22228	航天电器	2023-06 -20	519,350. 00	8,500.00	14	1.20	4,166.1 1	519,350. 00	4,166.1 1
中信证券	20230620000 22230	烽火通信	2023-06 -20	1,230,78 0.00	56,200.0 0	14	1.20	410.26	1,230,78 0.00	410.26
中信证券	20230620000 22239	万润股份	2023-06 -20	241,220. 00	14,000.0 0	14	1.30	87.11	241,220. 00	87.11
中信证券	20230620000 22322	国网信通	2023-06 -20	221,540. 00	10,600.0 0	14	1.20	1,470.8 5	221,540. 00	1,470.8 5
中信证券	20230620000 22420	国电电力	2023-06 -20	338,572. 00	88,400.0 0	14	2.10	197.50	338,572. 00	197.50
中信证券	20230620000 22444	远光软件	2023-06 -20	600,996. 00	63,800.0 0	14	1.90	3,507.1 9	822,509. 60	3,507.1 9
中信证券	20230620000 30438	许继电气	2023-06 -20	217,700. 00	10,000.0 0	14	2.10	126.99	217,700. 00	126.99
中信证券	20230620000 30651	海康威视	2023-06 -20	436,080. 00	12,000.0 0	14	2.90	351.29	436,080. 00	351.29

中信证券	20230620000 31285	中国汽研	2023-06 -20	290,601. 00	14,100.0 0	14	1.60	129.16	290,601. 00	129.16
中信证券	20230620000 32358	江铃汽车	2023-06 -20	377,568. 00	27,600.0 0	14	3.90	409.03	377,568. 00	409.03
中信证券	20230620000 33004	中国中铁	2023-06 -20	117,120. 00	16,000.0 0	14	3.00	97.60	117,120. 00	97.60
中信证券	20230620000 33110	中国汽研	2023-06 -20	643,032. 00	31,200.0 0	14	1.60	2,035.7 9	643,032. 00	2,035.7 9
中信证券	20230620000 33111	航天信息	2023-06 -20	150,000. 00	10,000.0 0	14	1.10	1,795.8 4	150,000. 00	1,795.8 4
中信证券	20230620000 33224	中国石油	2023-06 -20	110,550. 00	15,000.0 0	14	3.10	3,395.1 9	110,550. 00	3,395.1 9
中信证券	20230620000 33533	东方电气	2023-06 -20	182,600. 00	10,000.0 0	14	3.00	152.16	182,600. 00	152.16
中信证券	20230620000 33963	中远海控	2023-06 -20	320,100. 00	30,000.0 0	14	3.10	41,975. 64	320,100. 00	41,975. 64
中信证券	20230620000 34075	中国核电	2023-06 -20	95,760.0 0	14,000.0 0	14	1.80	47.88	95,760.0 0	47.88
中信证券	20230620000 34288	万润股份	2023-06 -20	494,501. 00	28,700.0 0	14	1.30	178.57	494,501. 00	178.57
中信证券	20230620000 34395	中国铁建	2023-06 -20	97,600.0 0	10,000.0 0	14	2.70	73.20	97,600.0 0	73.20

中信证券	20230620000 34571	中航电子	2023-06 -20	151,800. 00	10,000.0 0	14	2.90	122.29	151,800. 00	122.29
中信证券	20230620000 34703	海油工程	2023-06 -20	57,800.0 0	10,000.0 0	14	4.80	3,977.0 6	169,680. 00	3,977.0 6
中信证券	20230620000 34705	国电南瑞	2023-06 -20	279,700. 00	10,000.0 0	14	3.20	4,148.6 2	391,580. 00	4,148.6 2
中信证券	20230620000 34763	天地科技	2023-06 -20	56,200.0 0	10,000.0 0	14	1.10	17.17	56,200.0 0	17.17
中信证券	20230620000 35334	振华重工	2023-06 -20	36,600.0 0	10,000.0 0	14	4.80	48.80	36,600.0 0	48.80
中信证券	20230620000 35436	海油工程	2023-06 -20	131,784. 00	22,800.0 0	14	4.80	175.71	131,784. 00	175.71
中信证券	20230620000 35470	驰宏锌锗	2023-06 -20	51,000.0 0	10,000.0 0	14	1.20	1,217.0 0	51,000.0 0	1,217.0 0
中信证券	20230620000 35582	海油发展	2023-06 -20	30,200.0 0	10,000.0 0	14	1.10	9.23	30,200.0 0	9.23
中信证券	20230620000 35632	振华重工	2023-06 -20	1,073,11 2.00	293,200. 00	14	4.80	1,430.8 1	1,073,11 2.00	1,430.8 1
中信证券	20230620000 35963	光迅科技	2023-06 -20	44,360.0 0	1,000.00	14	3.00	36.96	44,360.0 0	36.96
中信证券	20230620000 36021	马钢股份	2023-06 -20	25,800.0 0	10,000.0 0	14	1.60	11.46	25,800.0 0	11.46

中信证券	20230620000 36348	光迅科技	2023-06 -20	443,600.00	10,000.00	14	3.00	369.66	443,600.00	369.66
中信证券	20230620000 36412	远光软件	2023-06 -20	94,200.00	10,000.00	14	1.90	549.71	128,920.00	549.71
中信证券	20230620000 36485	桂冠电力	2023-06 -20	53,600.00	10,000.00	14	1.60	23.82	53,600.00	23.82
中信证券	20230620000 36821	招商证券	2023-06 -20	138,300.00	10,000.00	14	3.00	115.25	138,300.00	115.25
中信证券	20230621000 06042	天山股份	2023-06 -21	215,952.00	26,400.00	14	2.20	118.77	215,952.00	118.77
中信证券	20230621000 06409	中国中铁	2023-06 -21	524,690.00	71,000.00	14	3.00	393.52	524,690.00	393.52
中信证券	20230621000 06501	中远海控	2023-06 -21	2,470,988.00	231,800.00	14	3.10	324,117.01	2,470,988.00	324,117.01
中信证券	20230621000 12950	科大讯飞	2023-06 -21	5,889,840.00	75,900.00	14	3.30	4,859.12	5,889,840.00	4,859.12
中信证券	20230621000 13162	烽火通信	2023-06 -21	366,624.00	17,100.00	14	1.10	100.82	366,624.00	100.82
中信证券	20230621000 13373	科大讯飞	2023-06 -21	388,000.00	5,000.00	14	3.30	320.10	388,000.00	320.10
中信证券	20230621000 13496	烽火通信	2023-06 -21	302,304.00	14,100.00	14	1.10	83.13	302,304.00	83.13

中信证券	20230621000 16085	中国软件	2023-06 -21	138,320.00	2,800.00	14	2.70	93.37	138,320.00	93.37
中信证券	20230626000 31319	中航电子	2023-06 -26	452,400.00	30,000.00	14	2.90	145.77	452,400.00	145.77
中信证券	20230626000 31497	碧水源	2023-06 -26	15,690.00	3,000.00	14	2.20	3.83	15,690.00	3.83
中信证券	20230626000 34060	岳阳林纸	2023-06 -26	465,254.00	70,600.00	14	3.40	175.76	465,254.00	175.76
中信证券	20230626000 40269	中工国际	2023-06 -26	105,700.00	10,000.00	14	3.00	35.23	105,700.00	35.23
中信证券	20230626000 42722	中航西飞	2023-06 -26	23,970.00	1,000.00	14	2.90	107.72	23,970.00	107.72
中信证券	20230626000 43650	中国软件	2023-06 -26	102,696.00	2,200.00	14	1.90	21.68	102,696.00	21.68
中信证券	20230626000 43949	中国长城	2023-06 -26	818,400.00	60,000.00	14	3.00	272.80	818,400.00	272.80
中信证券	20230627000 08904	东方通信	2023-06 -27	531,552.00	45,200.00	14	2.80	2,610.03	531,552.00	2,610.03
中信证券	20230628000 10114	中国动力	2023-06 -28	340,760.00	14,000.00	14	1.20	22.72	340,760.00	22.72
中信证券	20230628000 10160	澜起科技	2023-06 -28	1,905,072.00	34,400.00	14	4.10	433.93	1,905,072.00	433.93

中信证券	20230628000 34960	中国软件	2023-06 -28	46,280.0 0	1,000.00	14	1.90	4.89	46,280.0 0	4.89
中信证券	20230628000 35507	中国电研	2023-06 -28	55,550.0 0	2,200.00	14	3.40	10.49	55,550.0 0	10.49
中信证券	20230628000 35812	东方通信	2023-06 -28	129,400. 00	10,000.0 0	14	2.70	569.41	129,400. 00	569.41
中信证券	20230628000 37197	长安汽车	2023-06 -28	16,978.0 0	1,300.00	14	4.20	3.96	16,978.0 0	3.96
中信证券	20230628000 39867	东阿阿胶	2023-06 -28	131,868. 00	2,700.00	14	1.20	8.79	131,868. 00	8.79
中信证券	20230628000 44110	东方电气	2023-06 -28	291,840. 00	16,000.0 0	14	2.50	40.53	291,840. 00	40.53
中信证券	20230628000 44929	天山股份	2023-06 -28	366,804. 00	44,300.0 0	14	2.20	44.83	366,804. 00	44.83
中信证券	20230628000 47262	海油工程	2023-06 -28	946,332. 00	162,600. 00	14	1.60	84.12	946,332. 00	84.12
中信证券	20230628000 47284	桂冠电力	2023-06 -28	58,300.0 0	10,000.0 0	14	1.90	6.15	58,300.0 0	6.15
中信证券	20230628000 48411	美亚柏科	2023-06 -28	372,960. 00	18,500.0 0	14	3.30	68.38	372,960. 00	68.38
中信证券	20230628000 48566	长安汽车	2023-06 -28	13,060.0 0	1,000.00	14	4.20	3.05	13,060.0 0	3.05

中信证券	20230628000 50579	中国 卫 通	2023-06 -28	207,600. 00	10,000.0 0	14	3.50	40.37	207,600. 00	40.37
中信证券	20230628000 52068	中 工 国 际	2023-06 -28	119,900. 00	10,000.0 0	14	2.50	16.65	119,900. 00	16.65
中信证券	20230628000 54590	远 光 软 件	2023-06 -28	1,704,05 0.00	197,000. 00	14	1.90	10,029. 87	2,388,03 4.00	10,029. 87
中信证券	20230628000 54719	东 阿 阿 胶	2023-06 -28	68,376.0 0	1,400.00	14	1.20	4.56	68,376.0 0	4.56
中信证券	20230628000 55141	光 迅 科 技	2023-06 -28	524,876. 00	15,100.0 0	14	2.70	78.73	524,876. 00	78.73
中信证券	20230629000 09464	碧 水 源	2023-06 -29	11,151.0 0	2,100.00	14	1.20	0.37	11,151.0 0	0.37
中信证券	20230629000 09585	远 光 软 件	2023-06 -29	17,520.0 0	2,000.00	14	1.80	100.88	24,464.0 0	100.88
中信证券	20230629000 32416	中 国 软 件	2023-06 -29	46,450.0 0	1,000.00	14	1.90	2.45	46,450.0 0	2.45
中信证券	20230629000 33392	天 山 股 份	2023-06 -29	184,416. 00	22,600.0 0	14	2.30	11.78	184,416. 00	11.78
中信证券	20230629000 34138	华 润 双 鹤	2023-06 -29	73,444.0 0	4,300.00	14	1.20	2.45	73,444.0 0	2.45
中信证券	20230629000 36093	长 安 汽 车	2023-06 -29	276,488. 00	21,400.0 0	14	4.20	32.26	276,488. 00	32.26

中信证券	20230629000 36200	光迅科技	2023-06 -29	1,342,79 8.00	38,300.0 0	14	2.70	100.71	1,342,79 8.00	100.71
中信证券	20230629000 36367	中工国际	2023-06 -29	119,200. 00	10,000.0 0	14	2.50	8.28	119,200. 00	8.28
中信证券	20230629000 36439	东方电气	2023-06 -29	744,976. 00	40,400.0 0	14	2.10	43.46	744,976. 00	43.46
中信证券	20230629000 37368	中材科技	2023-06 -29	557,878. 00	27,700.0 0	14	1.20	18.60	557,878. 00	18.60
中信证券	20230629000 37898	中国动力	2023-06 -29	663,600. 00	28,000.0 0	14	1.40	25.81	663,600. 00	25.81
中信证券	20230629000 37971	长安汽车	2023-06 -29	16,796.0 0	1,300.00	14	4.10	1.91	16,796.0 0	1.91
中信证券	20230629000 38017	岳阳林纸	2023-06 -29	1,971,13 7.00	290,300. 00	14	2.50	136.88	1,971,13 7.00	136.88
中信证券	20230629000 38646	中工国际	2023-06 -29	1,192,00 0.00	100,000. 00	14	2.50	82.78	1,192,00 0.00	82.78
中信证券	20230629000 40444	中国动力	2023-06 -29	222,780. 00	9,400.00	14	1.40	8.66	222,780. 00	8.66
中信证券	20230629000 40781	美亚柏科	2023-06 -29	378,880. 00	18,500.0 0	14	3.30	34.73	378,880. 00	34.73
中信证券	20230629000 41134	华润双鹤	2023-06 -29	17,080.0 0	1,000.00	14	1.20	0.57	17,080.0 0	0.57

中信证券	20230629000 41169	中国软件	2023-06 -29	46,450.0 0	1,000.00	14	1.90	2.45	46,450.0 0	2.45
中信证券	20230629000 41430	科大讯飞	2023-06 -29	1,546,72 0.00	22,400.0 0	14	3.40	146.08	1,546,72 0.00	146.08
中信证券	20230629000 41546	美亚柏科	2023-06 -29	30,720.0 0	1,500.00	14	3.30	2.82	30,720.0 0	2.82
中信证券	20230629000 41722	美亚柏科	2023-06 -29	307,200. 00	15,000.0 0	14	3.30	28.16	307,200. 00	28.16
中信证券	20230629000 42000	科大讯飞	2023-06 -29	5,524,00 0.00	80,000.0 0	14	3.40	521.71	5,524,00 0.00	521.71
中信证券	20230629000 42421	光迅科技	2023-06 -29	529,406. 00	15,100.0 0	14	2.70	39.71	529,406. 00	39.71
中信证券	20230629000 42489	中国西电	2023-06 -29	18,224.0 0	3,400.00	14	1.20	0.61	18,224.0 0	0.61
中信证券	20230629000 42937	中国软件	2023-06 -29	464,500. 00	10,000.0 0	14	1.90	24.52	464,500. 00	24.52
中信证券	20230629000 42988	中国西电	2023-06 -29	87,368.0 0	16,300.0 0	14	1.20	2.91	87,368.0 0	2.91
中信证券	20230629000 43290	太极股份	2023-06 -29	426,100. 00	10,000.0 0	14	1.20	14.20	426,100. 00	14.20
中信证券	20230629000 43900	华润双鹤	2023-06 -29	17,080.0 0	1,000.00	14	1.20	0.57	17,080.0 0	0.57

中信证券	20230629000 44058	中国中免	2023-06-29	1,108,900.00	10,000.00	14	2.10	64.69	1,108,900.00	64.69
中信证券	20230629000 44185	海油工程	2023-06-29	60,270.00	10,500.00	14	1.60	2.68	60,270.00	2.68
中信证券	20230629000 44316	万润股份	2023-06-29	1,838,990.00	106,300.00	14	1.30	66.41	1,838,990.00	66.41
中信证券	20230630000 04242	中远海控	2023-06-30	982,300.00	104,500.00	14	3.10	-	982,300.00	-
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	20220104000 00921	碧水源	2022-01-04	896,670.00	123,000.00	14	3.60	1,255.34	-	-
中信证券	20220104000 21357	美亚柏科	2022-01-04	915,075.00	52,500.00	14	3.40	1,209.93	-	-
中信证券	20220106000 01220	当升科技	2022-01-06	83,930.00	1,000.00	14	3.30	107.71	-	-
中信证券	20220114000 20814	美亚柏科	2022-01-14	258,228.00	16,200.00	14	3.50	351.48	-	-
中	20220114000	当	2022-01	1,996,25	23,400.0	14	3.30	2,561.8	-	-

信 证 券	23660	升 科 技	-14	4.00	0			6		
中 信 证 券	20220118000 25500	美 亚 柏 科	2022-01 -18	885,150. 00	52,500.0 0	14	3.50	1,721.1 3	-	-
中 信 证 券	20220118000 25504	碧 水 源	2022-01 -18	870,840. 00	123,000. 00	14	3.40	1,644.9 2	-	-
中 信 证 券	20220120000 10782	当 升 科 技	2022-01 -20	82,460.0 0	1,000.00	14	2.70	111.32	-	-
中 信 证 券	20220128000 22086	美 亚 柏 科	2022-01 -28	237,330. 00	16,200.0 0	14	3.00	276.89	-	-
中 信 证 券	20220128000 22088	当 升 科 技	2022-01 -28	2,012,40 0.00	23,400.0 0	14	2.50	1,956.5 0	-	-
中 信 证 券	20220207000 50493	当 升 科 技	2022-02 -07	83,400.0 0	1,000.00	14	2.80	90.81	-	-
中 信 证 券	20220207000 50507	碧 水 源	2022-02 -07	824,100. 00	123,000. 00	14	2.80	897.35	-	-
中 信 证 券	20220207000 50511	美 亚 柏 科	2022-02 -07	783,300. 00	52,500.0 0	14	3.10	944.31	-	-
中 信 证 券	20220211000 18998	美 亚 柏 科	2022-02 -11	244,782. 00	16,200.0 0	14	3.70	352.21	-	-
中 信 证 券	20220211000 19000	当 升 科 技	2022-02 -11	1,734,87 6.00	23,400.0 0	14	3.20	2,158.9 6	-	-
中	20220217000	美	2022-02	811,960.	53,000.0	14	3.00	947.29	-	-

信 证 券	01136	亚 柏 科	-17	00	0					
中 信 证 券	20220221000 45497	碧 水 源	2022-02 -21	859,770. 00	123,000. 00	14	2.00	668.71	-	-
中 信 证 券	20220221000 45499	当 升 科 技	2022-02 -21	80,530.0 0	1,000.00	14	3.20	100.22	-	-
中 信 证 券	20220221000 45501	美 亚 柏 科	2022-02 -21	833,700. 00	52,500.0 0	14	3.70	1,199.6 0	-	-
中 信 证 券	20220225000 17845	美 亚 柏 科	2022-02 -25	247,050. 00	16,200.0 0	14	3.00	288.23	-	-
中 信 证 券	20220225000 17847	当 升 科 技	2022-02 -25	1,981,74 6.00	23,400.0 0	14	3.30	2,543.2 4	-	-
中 信 证 券	20220301000 01276	碧 水 源	2022-03 -01	889,770. 00	133,000. 00	14	3.30	1,141.8 7	-	-
中 信 证 券	20220303000 04468	美 亚 柏 科	2022-03 -03	834,750. 00	53,000.0 0	14	3.10	1,006.3 4	-	-
中 信 证 券	20220307000 41944	当 升 科 技	2022-03 -07	73,920.0 0	1,000.00	14	3.10	89.11	-	-
中 信 证 券	20220307000 41946	碧 水 源	2022-03 -07	788,430. 00	123,000. 00	14	3.30	1,011.8 2	-	-
中 信 证 券	20220307000 44384	美 亚 柏 科	2022-03 -07	785,925. 00	52,500.0 0	14	3.40	1,039.1 7	-	-
中	20220311000	美	2022-03	246,240.	16,200.0	14	3.40	325.58	-	-

信 证 券	16276	亚 柏 科	-11	00	0					
中 信 证 券	20220311000 16278	当 升 科 技	2022-03 -11	1,789,86 6.00	23,400.0 0	14	3.10	2,157.7 8	-	-
中 信 证 券	20220315000 11447	碧 水 源	2022-03 -15	755,440. 00	133,000. 00	14	3.30	969.48	-	-
中 信 证 券	20220317000 01103	碧 水 源	2022-03 -17	1,015,51 0.00	173,000. 00	28	3.10	2,448.5 1	-	-
中 信 证 券	20220317000 04728	美 亚 柏 科	2022-03 -17	825,210. 00	53,000.0 0	14	3.00	962.75	-	-
中 信 证 券	20220321000 35967	当 升 科 技	2022-03 -21	84,260.0 0	1,000.00	14	3.30	123.58	-	-
中 信 证 券	20220321000 36615	美 亚 柏 科	2022-03 -21	890,925. 00	52,500.0 0	14	2.90	1,148.3 1	-	-
中 信 证 券	20220321000 36643	碧 水 源	2022-03 -21	731,850. 00	123,000. 00	14	3.20	1,040.8 6	-	-
中 信 证 券	20220325000 19296	美 亚 柏 科	2022-03 -25	262,116. 00	16,200.0 0	14	2.90	295.61	-	-
中 信 证 券	20220329000 05066	碧 水 源	2022-03 -29	774,060. 00	133,000. 00	14	3.00	903.07	-	-
中 信 证 券	20220331000 06262	美 亚 柏 科	2022-03 -31	865,490. 00	53,000.0 0	14	3.50	1,178.0 3	-	-
中	20220406000	当	2022-04	73,290.0	1,000.00	14	3.10	88.36	-	-

信 证 券	49533	升 科 技	-06	0						
中 信 证 券	20220406000 54003	碧 水 源	2022-04 -06	747,840. 00	123,000. 00	14	2.20	639.82	-	-
中 信 证 券	20220406000 54005	美 亚 柏 科	2022-04 -06	862,575. 00	52,500.0 0	14	3.70	1,241.1 5	-	-
中 信 证 券	20220408000 17083	美 亚 柏 科	2022-04 -08	244,134. 00	16,200.0 0	14	3.70	351.28	-	-
中 信 证 券	20220412000 11151	碧 水 源	2022-04 -12	739,480. 00	133,000. 00	14	2.20	632.67	-	-
中 信 证 券	20220414000 06909	碧 水 源	2022-04 -14	939,390. 00	173,000. 00	28	3.40	2,484.1 6	-	-
中 信 证 券	20220414000 06915	美 亚 柏 科	2022-04 -14	773,800. 00	53,000.0 0	14	3.70	1,113.4 1	-	-
中 信 证 券	20220420000 39136	美 亚 柏 科	2022-04 -20	782,775. 00	52,500.0 0	14	3.80	1,239.4 0	-	-
中 信 证 券	20220420000 48228	当 升 科 技	2022-04 -20	69,450.0 0	1,000.00	14	3.40	98.39	-	-
中 信 证 券	20220420000 48240	碧 水 源	2022-04 -20	630,990. 00	123,000. 00	14	3.30	867.61	-	-
中 信 证 券	20220422000 15150	美 亚 柏 科	2022-04 -22	231,498. 00	16,200.0 0	14	3.80	342.10	-	-
中	20220426000	美	2022-04	566,880.	48,000.0	14	3.40	749.54	-	-

信 证 券	01144	亚 柏 科	-26	00	0					
中 信 证 券	20220426000 07531	碧 水 源	2022-04 -26	606,480. 00	133,000. 00	14	3.50	825.49	-	-
中 信 证 券	20220427000 00951	美 亚 柏 科	2022-04 -27	571,830. 00	49,000.0 0	14	3.40	756.09	-	-
中 信 证 券	20220428000 07596	美 亚 柏 科	2022-04 -28	597,840. 00	53,000.0 0	14	3.40	790.48	-	-
中 信 证 券	20220505000 72727	当 升 科 技	2022-05 -05	66,810.0 0	1,000.00	14	2.30	59.76	-	-
中 信 证 券	20220505000 72729	美 亚 柏 科	2022-05 -05	632,100. 00	52,500.0 0	14	3.40	835.78	-	-
中 信 证 券	20220505000 73345	碧 水 源	2022-05 -05	569,490. 00	123,000. 00	14	3.30	730.85	-	-
中 信 证 券	20220506000 18445	美 亚 柏 科	2022-05 -06	195,696. 00	16,200.0 0	14	3.40	258.75	-	-
中 信 证 券	20220510000 14971	美 亚 柏 科	2022-05 -10	584,640. 00	48,000.0 0	14	3.40	773.02	-	-
中 信 证 券	20220510000 15013	碧 水 源	2022-05 -10	641,060. 00	133,000. 00	14	3.30	822.69	-	-
中 信 证 券	20220511000 11354	美 亚 柏 科	2022-05 -11	599,270. 00	49,000.0 0	14	3.40	792.37	-	-
中	20220512000	碧	2022-05	833,860.	173,000.	28	3.30	2,140.2	-	-

信 证 券	08942	水 源	-12	00	00			4		
中 信 证 券	20220512000 08948	美 亚 柏 科	2022-05 -12	677,870. 00	53,000.0 0	14	3.40	896.29	-	-
中 信 证 券	20220519000 41367	当 升 科 技	2022-05 -19	71,800.0 0	1,000.00	14	3.20	89.35	-	-
中 信 证 券	20220519000 47869	碧 水 源	2022-05 -19	590,400. 00	123,000. 00	14	3.50	803.60	-	-
中 信 证 券	20220520000 14072	美 亚 柏 科	2022-05 -20	208,656. 00	16,200.0 0	14	3.40	335.01	-	-
中 信 证 券	20220524000 06592	美 亚 柏 科	2022-05 -24	606,720. 00	48,000.0 0	14	3.50	825.81	-	-
中 信 证 券	20220524000 07654	碧 水 源	2022-05 -24	619,780. 00	133,000. 00	14	3.40	819.49	-	-
中 信 证 券	20220525000 08291	美 亚 柏 科	2022-05 -25	622,300. 00	49,000.0 0	14	3.50	847.02	-	-
中 信 证 券	20220525000 10135	当 升 科 技	2022-05 -19	424.00	-	14	3.20	-	-	-
中 信 证 券	20220526000 07264	美 亚 柏 科	2022-05 -26	675,750. 00	53,000.0 0	14	3.50	919.77	-	-
中 信 证 券	20220526000 14348	碧 水 源	2022-05 -12	4,498.00	-	28	3.30	-	-	-
中	20220526000	碧	2022-05	3,198.00	-	14	3.50	-	-	-

信 证 券	14420	水 源	-19							
中 信 证 券	20220526000 14510	碧 水 源	2022-05 -24	3,458.00	-	14	3.40	-	-	-
中 信 证 券	20220531000 01396	碧 水 源	2022-05 -31	195,200. 00	40,000.0 0	14	3.50	265.69	-	-
中 信 证 券	20220602000 13610	当 升 科 技	2022-06 -02	74,900.0 0	1,000.00	14	3.40	99.03	-	-
中 信 证 券	20220602000 13624	碧 水 源	2022-06 -02	596,550. 00	123,000. 00	14	3.50	811.97	-	-
中 信 证 券	20220606000 09914	美 亚 柏 科	2022-06 -06	216,108. 00	16,200.0 0	14	3.50	294.15	-	-
中 信 证 券	20220607000 08002	碧 水 源	2022-06 -07	643,720. 00	133,000. 00	14	3.50	876.17	-	-
中 信 证 券	20220607000 08224	美 亚 柏 科	2022-06 -07	633,120. 00	48,000.0 0	14	3.50	861.75	-	-
中 信 证 券	20220608000 06651	美 亚 柏 科	2022-06 -08	650,720. 00	49,000.0 0	14	3.50	885.70	-	-
中 信 证 券	20220609000 11155	碧 水 源	2022-06 -09	826,940. 00	173,000. 00	28	3.40	1,640.1 0	901,330. 00	1,640.1 0
中 信 证 券	20220609000 11161	美 亚 柏 科	2022-06 -09	685,820. 00	53,000.0 0	14	3.50	933.48	-	-
中	20220614000	碧	2022-06	195,600.	40,000.0	14	3.50	266.23	-	-

信 证 券	07698	水 源	-14	00	0					
中 信 证 券	20220616000 01306	当 升 科 技	2022-06 -16	2,679,76 0.00	30,400.0 0	14	3.50	3,647.4 5	-	-
中 信 证 券	20220616000 12211	碧 水 源	2022-06 -16	610,080. 00	123,000. 00	14	3.50	830.39	-	-
中 信 证 券	20220616000 19091	美 亚 柏 科	2022-06 -06	1,944.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	20220616000 19097	美 亚 柏 科	2022-06 -07	5,760.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	20220616000 19101	美 亚 柏 科	2022-06 -08	5,880.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	20220616000 19109	美 亚 柏 科	2022-06 -09	6,360.00	-	14	3.50	-	-	-
中 信 证 券	20220621000 07816	美 亚 柏 科	2022-06 -21	644,160. 00	48,000.0 0	14	3.40	547.53	647,040. 00	547.53
中 信 证 券	20220621000 09680	碧 水 源	2022-06 -21	654,360. 00	133,000. 00	14	3.60	588.92	692,930. 00	588.92
中 信 证 券	20220622000 13781	美 亚 柏 科	2022-06 -22	639,450. 00	49,000.0 0	14	3.40	483.14	660,520. 00	483.14
中 信 证 券	20220623000 09813	美 亚 柏 科	2022-06 -23	708,610. 00	53,000.0 0	14	3.40	468.47	714,440. 00	468.47
中	20220628000	碧	2022-06	202,000.	40,000.0	14	3.60	40.40	208,400.	40.40

信 证 券	09954	水 源	-28	00	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
华夏中证央企 ETF 联接	279,765,788.00	6.25%	220,730,050.00	5.04%
中信中证资本	11,376,871.00	0.25%	-	-
中信证券	11,059,527.00	0.25%	2,453,809.00	0.06%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年1月1日至2023年6月30日		上年度可比期间 2022年1月1日至2022年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行活期存款	39,653,654.29	76,603.05	14,732,868.31	51,181.96

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信证券	301439	泓淋电力	新股发行	9,486	189,625.14
中信证券	603281	江瀚新材	新股发行	863	30,714.17

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	301200	大族数控	新股发行	8,566	655,812.96
中信证券	301109	军信股份	新股发行	12,250	426,422.50
中信证券	301302	华如科技	新股发行	4,651	241,991.53
中信证券	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
301358	湖南裕能	2023-02-01	6 个月	新发流通受限	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-
301260	格力博	2023-01-20	6 个月	新发流通受限	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301246	宏源药业	2023-03-10	6 个月	新发流通受限	50.00	30.71	931	46,550.00	28,591.01	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6 个月	新发流通	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-

				受限						
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	新发 流通 受限	131.11	53.24	392	34,219.71	20,870.08	含 证 券 送 配
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	新发 流通 受限	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	新发 流通 受限	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	新发 流通 受限	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301141	中科磁业	2023-03-27	6个月	新发 流通 受限	41.20	42.69	262	10,794.40	11,184.78	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	新发 流通 受限	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
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	-

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	002230	科大讯飞	2023年7月4日 -2023年7月24日	67.96	853,300.00	57,990,268.00
2	000063	中兴通讯	2023年7月4日 -2023年7月13日	45.54	562,300.00	25,607,142.00
3	000625	长安汽车	2023年7月5日 -2023年7月13日	12.93	1,456,000.00	18,826,080.00
4	688008	澜起科技	2023年7月5日 -2023年7月12日	57.42	223,400.00	12,827,628.00
5	001979	招商蛇口	2023年7月3日 -2023年7月10日	13.03	733,100.00	9,552,293.00
6	601669	中国电建	2023年7月4日 -2023年7月12日	5.74	1,633,500.00	9,376,290.00
7	600050	中国联通	2023年7月5日 -2023年7月10日	4.80	1,828,700.00	8,777,760.00
8	600372	中航电子	2023年7月4日 -2023年7月14日	15.18	521,500.00	7,916,370.00
9	600536	中国软件	2023年7月4日 -2023年7月13日	46.88	158,000.00	7,407,040.00
10	002281	光迅科技	2023年7月4日 -2023年7月13日	37.09	182,500.00	6,768,925.00
11	002368	太极股份	2023年7月4日 -2023年7月13日	41.17	148,600.00	6,117,862.00
12	000423	东阿阿胶	2023年7月3日 -2023年7月13日	53.45	96,300.00	5,147,235.00
13	600482	中国动力	2023年7月4日 -2023年7月13日	23.44	207,600.00	4,866,144.00
14	601868	中国能建	2023年7月12日 -2023年7月12日	2.34	2,000,000.00	4,680,000.00
15	600497	驰宏锌锗	2023年7月4日 -2023年7月10日	5.02	927,800.00	4,657,556.00
16	601698	中国卫通	2023年7月3日 -2023年7月12日	19.88	200,000.00	3,976,000.00
17	300188	美亚柏科	2023年7月3日	20.79	190,400.00	3,958,416.00

			-2023 年 7 月 13 日			
18	601919	中远海控	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	9.40	366,300.00	3,443,220.00
19	600118	中国卫星	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	28.21	120,000.00	3,385,200.00
20	600776	东方通信	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	14.25	222,300.00	3,167,775.00
21	002643	万润股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	17.41	162,900.00	2,836,089.00
22	000066	中国长城	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	13.83	203,100.00	2,808,873.00
23	002051	中工国际	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	11.93	234,900.00	2,802,357.00
24	600963	岳阳林纸	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	7.37	360,900.00	2,659,833.00
25	300070	碧水源	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	5.36	485,000.00	2,599,600.00
26	301269	华大九天	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	122.84	21,100.00	2,591,924.00
27	002063	远光软件	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	8.68	272,800.00	2,367,904.00
28	600236	桂冠电力	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	5.57	407,500.00	2,269,775.00
29	600498	烽火通信	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 11 日	20.37	106,000.00	2,159,220.00
30	600760	中航沈飞	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	45.00	45,600.00	2,052,000.00
31	600875	东方电气	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	18.65	94,400.00	1,760,560.00
32	601728	中国电信	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	5.63	300,000.00	1,689,000.00
33	601965	中国汽研	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 5 日	20.65	65,300.00	1,348,445.00
34	600941	中国移动	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	93.30	14,200.00	1,324,860.00
35	000825	太钢不锈	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	3.87	340,600.00	1,318,122.00
36	002268	电科网安	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	27.87	46,100.00	1,284,807.00
37	000550	江铃汽车	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 12 日	13.84	90,500.00	1,252,520.00
38	600583	海油工程	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	5.85	205,900.00	1,204,515.00
39	600517	国网英大	2023 年 7 月 5 日	5.70	211,300.00	1,204,410.00

			-2023 年 7 月 11 日			
40	600062	华润双鹤	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	17.42	65,800.00	1,146,236.00
41	600320	振华重工	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	3.73	303,200.00	1,130,936.00
42	601888	中国中免	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	110.53	10,000.00	1,105,300.00
43	601179	中国西电	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	5.41	201,000.00	1,087,410.00
44	600893	航发动力	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	42.26	25,000.00	1,056,500.00
45	601618	中国中冶	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	3.97	253,000.00	1,004,410.00
46	600161	天坛生物	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	27.15	34,800.00	944,820.00
47	002080	中材科技	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 13 日	20.52	44,700.00	917,244.00
48	002025	航天电器	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 5 日	63.80	13,700.00	874,060.00
49	600406	国电南瑞	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	23.10	34,800.00	803,880.00
50	300073	当升科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 3 日	50.33	15,700.00	790,181.00
51	688128	中国电研	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	25.50	30,600.00	780,300.00
52	002916	深南电路	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	75.37	10,300.00	776,311.00
53	000877	天山股份	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 13 日	8.14	93,300.00	759,462.00
54	000050	深天马 A	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 10 日	9.18	82,300.00	755,514.00
55	600808	马钢股份	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 5 日	2.57	288,800.00	742,216.00
56	601390	中国中铁	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 5 日	7.58	87,000.00	659,460.00
57	601808	中海油服	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 5 日	13.88	42,900.00	595,452.00
58	601186	中国铁建	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	9.85	60,000.00	591,000.00
59	000768	中航西飞	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 10 日	26.75	21,000.00	561,750.00
60	600378	昊华科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	37.64	13,900.00	523,196.00
61	000400	许继电气	2023 年 7 月 4 日	23.05	20,000.00	461,000.00

			-2023 年 7 月 5 日			
62	600905	三峡能源	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 5 日	5.37	84,600.00	454,302.00
63	600968	海油发展	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	3.07	142,300.00	436,861.00
64	002415	海康威视	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	33.11	12,000.00	397,320.00
65	600795	国电电力	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	3.83	88,400.00	338,572.00
66	600061	国投资本	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 10 日	7.12	40,000.00	284,800.00
67	688187	时代电气	2023 年 7 月 12 日 -2023 年 7 月 12 日	41.86	5,400.00	226,044.00
68	600131	国网信通	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	20.19	10,600.00	214,014.00
69	600271	航天信息	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	13.69	10,000.00	136,900.00
70	600999	招商证券	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	13.57	10,000.00	135,700.00
71	601857	中国石油	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	7.47	15,000.00	112,050.00
72	601985	中国核电	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	7.05	14,000.00	98,700.00
73	600582	天地科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	5.83	10,000.00	58,300.00
74	601600	中国铝业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	5.49	8,000.00	43,920.00
75	600025	华能水电	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 4 日	7.13	2,000.00	14,260.00
合计	-	-	-	-	18,503,800.00	267,002,399.00

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內。

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	5,784,671,969.32	99.46	5,021,137,974.75	99.32
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	5,784,671,969.32	99.46	5,021,137,974.75	99.32

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	除中证央企结构调整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%	-285,063,231.76	-243,603,883.05
	+5%	285,063,231.76	243,603,883.05

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	5,784,363,854.25
第二层次	-
第三层次	308,115.07
合计	5,784,671,969.32

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	5,784,671,969.32	98.91
	其中：股票	5,784,671,969.32	98.91
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	60,284,244.00	1.03
8	其他各项资产	3,697,636.33	0.06
9	合计	5,848,653,849.65	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 267,002,399.00 元, 占本基金期末资产净值的 4.59%。

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	473,647,472.50	8.14
C	制造业	2,543,418,492.25	43.73
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	487,126,187.59	8.38
E	建筑业	467,370,802.59	8.04
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	76,137,251.60	1.31
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,136,914,158.12	19.55
J	金融业	264,476,342.57	4.55
K	房地产业	159,518,458.97	2.74
L	租赁和商务服务业	128,526,605.13	2.21
M	科学研究和技术服务业	19,762,050.00	0.34
N	水利、环境和公共设施管理业	27,774,148.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,784,671,969.32	99.46

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	002230	科大讯飞	4,102,380	278,797,744.80	4.79
2	002415	海康威视	7,986,680	264,438,974.80	4.55
3	600406	国电南瑞	9,568,914	221,041,913.40	3.80
4	000063	中兴通讯	4,785,340	217,924,383.60	3.75
5	600036	招商银行	5,221,251	171,048,182.76	2.94
6	600900	长江电力	7,684,213	169,513,738.78	2.91
7	000625	长安汽车	11,835,430	153,032,109.90	2.63
8	600028	中国石化	22,659,200	144,112,512.00	2.48
9	601668	中国建筑	24,974,893	143,355,885.82	2.46
10	002179	中航光电	3,030,360	137,426,826.00	2.36
11	600893	航发动力	3,175,097	134,179,599.22	2.31
12	601888	中国中免	1,162,821	128,526,605.13	2.21
13	601088	中国神华	3,928,662	120,806,356.50	2.08
14	688981	中芯国际	2,331,539	117,789,350.28	2.03
15	600048	保利发展	8,555,075	111,472,627.25	1.92
16	600050	中国联通	22,730,131	109,104,628.80	1.88
17	688008	澜起科技	1,894,516	108,783,108.72	1.87
18	601728	中国电信	18,493,611	104,119,029.93	1.79
19	601857	中国石油	13,501,023	100,852,641.81	1.73
20	600941	中国移动	1,075,275	100,323,157.50	1.72
21	601766	中国中车	14,488,880	94,177,720.00	1.62
22	601390	中国中铁	12,235,833	92,747,614.14	1.59
23	600905	三峡能源	17,107,200	91,865,664.00	1.58
24	000768	中航西飞	3,313,408	88,633,664.00	1.52
25	600845	宝信软件	1,593,902	80,986,160.62	1.39
26	601985	中国核电	11,277,602	79,507,094.10	1.37
27	601919	中远海控	7,587,914	71,326,391.60	1.23
28	000066	中国长城	4,667,402	64,550,169.66	1.11
29	600536	中国软件	1,333,442	62,511,760.96	1.07
30	600999	招商证券	4,420,313	59,983,647.41	1.03
31	600019	宝钢股份	10,606,975	59,611,199.50	1.02
32	000786	北新建材	2,414,902	59,189,248.02	1.02
33	600760	中航沈飞	1,313,005	59,085,225.00	1.02

34	000423	东阿阿胶	1,090,642	58,294,814.90	1.00
35	601186	中国铁建	5,480,808	53,985,958.80	0.93
36	601600	中国铝业	9,446,392	51,860,692.08	0.89
37	300073	当升科技	965,340	48,585,562.20	0.84
38	001979	招商蛇口	3,687,324	48,045,831.72	0.83
39	601669	中国电建	8,207,455	47,110,791.70	0.81
40	601800	中国交建	4,232,800	46,179,848.00	0.79
41	600886	国投电力	3,564,027	45,084,941.55	0.78
42	600497	驰宏锌锗	8,490,243	42,621,019.86	0.73
43	002025	航天电器	653,000	41,661,400.00	0.72
44	600795	国电电力	10,659,500	40,825,885.00	0.70
45	600372	中航电子	2,671,150	40,548,057.00	0.70
46	600176	中国巨石	2,860,986	40,511,561.76	0.70
47	002368	太极股份	966,123	39,775,283.91	0.68
48	000400	许继电气	1,681,455	38,757,537.75	0.67
49	002916	深南电路	494,705	37,285,915.85	0.64
50	002268	电科网安	1,311,248	36,544,481.76	0.63
51	601868	中国能建	15,450,900	36,155,106.00	0.62
52	002281	光迅科技	944,914	35,046,860.26	0.60
53	600498	烽火通信	1,718,376	35,003,319.12	0.60
54	601618	中国中冶	8,506,029	33,768,935.13	0.58
55	600271	航天信息	2,462,001	33,704,793.69	0.58
56	688396	华润微	628,965	32,964,055.65	0.57
57	002080	中材科技	1,599,105	32,813,634.60	0.56
58	600528	中铁工业	3,175,425	31,373,199.00	0.54
59	600583	海油工程	5,266,445	30,808,703.25	0.53
60	600482	中国动力	1,286,800	30,162,592.00	0.52
61	003816	中国广核	9,403,400	29,244,574.00	0.50
62	300070	碧水源	5,180,300	27,766,408.00	0.48
63	000050	深天马 A	2,963,429	27,204,278.22	0.47
64	600161	天坛生物	981,379	26,644,439.85	0.46
65	688187	时代电气	620,993	25,994,766.98	0.45
66	600875	东方电气	1,323,880	24,690,362.00	0.42
67	002063	远光软件	2,812,664	24,413,923.52	0.42
68	301269	华大九天	193,970	23,827,274.80	0.41
69	300188	美亚柏科	1,142,028	23,742,762.12	0.41
70	002643	万润股份	1,345,762	23,429,716.42	0.40
71	600582	天地科技	3,943,740	22,992,004.20	0.40
72	600061	国投资本	3,061,395	21,797,132.40	0.37
73	000825	太钢不锈	5,461,000	21,134,070.00	0.36
74	601698	中国卫通	1,006,325	20,005,741.00	0.34
75	600118	中国卫星	704,246	19,866,779.66	0.34
76	601965	中国汽研	957,000	19,762,050.00	0.34

77	601808	中海油服	1,410,491	19,577,615.08	0.34
78	600963	岳阳林纸	2,578,900	19,006,493.00	0.33
79	688009	中国通号	3,080,650	17,867,770.00	0.31
80	600320	振华重工	4,748,300	17,711,159.00	0.30
81	600062	华润双鹤	994,000	17,315,480.00	0.30
82	000877	天山股份	2,063,900	16,800,146.00	0.29
83	600776	东方通信	1,153,700	16,440,225.00	0.28
84	600236	桂冠电力	2,826,588	15,744,095.16	0.27
85	600025	华能水电	2,151,500	15,340,195.00	0.26
86	600968	海油发展	4,843,200	14,868,624.00	0.26
87	600808	马钢股份	5,752,600	14,784,182.00	0.25
88	002051	中工国际	1,179,100	14,066,663.00	0.24
89	601179	中国西电	2,442,300	13,212,843.00	0.23
90	300396	迪瑞医疗	393,398	12,781,501.02	0.22
91	600378	昊华科技	325,740	12,260,853.60	0.21
92	600131	国网信通	580,500	11,720,295.00	0.20
93	600517	国网英大	2,043,400	11,647,380.00	0.20
94	000778	新兴铸管	2,851,600	11,634,528.00	0.20
95	000800	一汽解放	1,108,017	9,274,102.29	0.16
96	000898	鞍钢股份	2,854,971	7,936,819.38	0.14
97	000550	江铃汽车	494,800	6,848,032.00	0.12
98	300105	龙源技术	741,800	4,977,478.00	0.09
99	688128	中国电研	192,726	4,914,513.00	0.08
100	002320	海峡股份	796,500	4,810,860.00	0.08
101	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
102	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
103	301246	宏源药业	931	28,591.01	0.00
104	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
105	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
106	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
107	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
108	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
109	301141	中科磁业	262	11,184.78	0.00
110	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
111	301203	国泰环保	225	7,740.00	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	000625	长安汽车	74,828,154.24	1.48
2	601888	中国中免	44,949,219.00	0.89

3	002415	海康威视	44,497,227.16	0.88
4	000768	中航西飞	42,203,142.20	0.83
5	600941	中国移动	39,038,394.45	0.77
6	002230	科大讯飞	39,006,610.93	0.77
7	600028	中国石化	37,962,060.00	0.75
8	601868	中国能建	36,874,636.13	0.73
9	600905	三峡能源	33,210,308.00	0.66
10	002179	中航光电	31,763,966.18	0.63
11	600528	中铁工业	31,095,649.30	0.62
12	300070	碧水源	29,334,328.00	0.58
13	000063	中兴通讯	28,896,997.81	0.57
14	600372	中航电子	27,836,315.81	0.55
15	600900	长江电力	26,467,639.00	0.52
16	600036	招商银行	24,764,315.00	0.49
17	600963	岳阳林纸	17,979,119.60	0.36
18	002051	中工国际	13,458,034.08	0.27
19	301269	华大九天	12,843,718.04	0.25
20	600131	国网信通	11,374,712.00	0.22

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	002230	科大讯飞	71,451,771.49	1.41
2	000063	中兴通讯	70,021,733.99	1.39
3	002415	海康威视	39,511,828.16	0.78
4	002013	中航机电	26,279,312.50	0.52
5	000930	中粮科技	24,799,924.00	0.49
6	688779	长远锂科	23,854,191.80	0.47
7	600900	长江电力	23,805,279.00	0.47
8	600406	国电南瑞	19,364,051.72	0.38
9	601668	中国建筑	13,889,259.00	0.27
10	002179	中航光电	12,843,597.88	0.25
11	000786	北新建材	12,371,020.60	0.24
12	600893	航发动力	12,038,719.00	0.24
13	688981	中芯国际	11,871,463.87	0.23
14	000423	东阿阿胶	11,324,706.98	0.22
15	600845	宝信软件	11,240,201.60	0.22
16	600048	保利发展	10,974,259.00	0.22
17	002268	电科网安	10,960,737.00	0.22
18	600050	中国联通	10,763,993.00	0.21
19	000066	中国长城	10,693,782.00	0.21

20	601088	中国神华	10,467,519.00	0.21
----	--------	------	---------------	------

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	874,285,821.81
卖出股票收入（成交）总额	757,670,744.08

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于以标的指数或与标的指数相关性较高的其他指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体中，招商银行股份有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。本基金为指数型基金，采取完全复制策略，招商银行系标的

指数成份股，上述股票的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	2,947,668.22
2	应收清算款	-
3	应收股利	618,520.99
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	131,447.12
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,697,636.33

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	002230	科大讯飞	57,990,268.00	1.00	转融通出借证券受限
2	000063	中兴通讯	25,607,142.00	0.44	转融通出借证券受限
3	000625	长安汽车	18,826,080.00	0.32	转融通出借证券受限
4	600406	国电南瑞	803,880.00	0.01	转融通出借证券受限
5	002415	海康威视	397,320.00	0.01	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		华夏中证央企 ETF 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
4,515	991,484.16	4,105,923,400.00	91.72%	90,861,781.00	2.03%	279,765,788.00	6.25%

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	中国石油天然气集团有限公司	3,419,905,325.00	76.40%
2	中国海洋石油集团有限公司	326,150,000.00	7.29%
3	中国平安人寿保险股份有限公司－自有资金	184,568,500.00	4.12%
4	中信中证资本管理有限公司	11,376,871.00	0.25%
5	中信证券股份有限公司	11,059,527.00	0.25%
6	广发证券股份有限公司	11,024,173.00	0.25%
7	国泰君安证券股份有限公司	10,558,169.00	0.24%
8	众诚汽车保险股份有限公司－传统保险产品	10,000,000.00	0.22%
9	华泰证券股份有限公司	9,227,102.00	0.21%
10	中国国际金融股份有限公司	8,751,775.00	0.20%
11	中国农业银行股份有限公司－华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金联接基金	279,765,788.00	6.25%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

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

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、	0

基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	
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（2018 年 10 月 19 日）基金份额总额	15,887,550,969.00
本报告期期初基金份额总额	4,380,550,969.00
本报告期基金总申购份额	502,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	406,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	4,476,550,969.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金无基金份额持有人大会决议。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金管理人及其高级管理人员在本报告期内无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	11	1,234,999,790.96	75.85%	532,640.96	75.85%	-
广发证券	2	340,783,931.91	20.93%	146,982.51	20.93%	-
华泰证券	1	34,066,595.89	2.09%	14,693.27	2.09%	-
方正证券	2	15,839,026.00	0.97%	6,831.51	0.97%	-
中金公司	2	2,571,971.00	0.16%	1,109.31	0.16%	-

注：①为了贯彻中国证监会的有关规定，我公司制定了选择券商的标准，即：

i 经营行为规范。

ii 公司财务状况良好。

iii有良好的内控制度，在业内有良好的声誉。

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

v 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

②券商专用交易单元选择程序：

i 本基金管理人根据上述标准进行评估并确定选用的券商。

ii 本基金管理人与被选择的券商签订交易单元租用协议/证券经纪服务协议。

③除本表列示外，本基金还选择了北京高华证券、长江证券、东方证券、高华证券、国泰君安证券、西部证券、招商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本报告期内，本基金租用的券商交易单元未发生变更。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额	成交金额	占当期债券回购成交	成交金额	占当期权证成交总额	成交金额	占当期基金成交总额

		的比例		总额的 比例		的比例		的比例
中信 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金 公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	华夏基金管理有限公司公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-01-06
2	华夏基金管理有限公司关于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	2023-03-11
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	2023-03-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2023-01-01 至 2023-06-30	3,419,905,325.00	-	-	3,419,905,325.00	76.40%
产品特有风险							
<p>本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额20%的情形,在市场流动性不足的情况下,如遇投资者巨额赎回或集中赎回,基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产,有可能对基金净值产生一定的影响,甚至可能引发基金的流动性风险。</p> <p>在特定情况下,若持有基金份额占比较高的投资者大量赎回本基金,可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平,面临转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等情形。</p>							

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《华夏中证央企结构调整交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《华夏中证央企结构调整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