

南方中证新能源交易型开放式指数证 券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人：南方基金管理股份有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。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 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告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

目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告	7
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	8
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明	10
§5 托管人报告	10
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	11
§6 中期财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表	11
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	136
7.1 期末基金资产组合情况	136
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	137
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	138
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	142
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	144
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	144
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	144
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	144
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	144

7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	144
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	144
7.12 投资组合报告附注.....	144
§8 基金份额持有人信息.....	146
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	146
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	146
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	147
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情况.....	147
§9 开放式基金份额变动.....	147
§10 重大事件揭示.....	147
10.1 基金份额持有人大会决议.....	147
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.....	147
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	147
10.4 基金投资策略的改变.....	148
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	148
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.....	148
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	148
10.8 其他重大事件.....	149
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	150
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.....	150
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	151
§12 备查文件目录.....	151
12.1 备查文件目录.....	151
12.2 存放地点.....	151
12.3 查阅方式.....	151

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	南方中证新能源 ETF
场内简称	新能源 ETF
基金主代码	516160
交易代码	516160
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021 年 1 月 22 日
基金管理人	南方基金管理股份有限公司
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	7,336,804,000.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2021 年 2 月 4 日

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金主要采用复制策略、替代策略及其他适当的策略以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.3%，年跟踪误差不超过 4%。主要投资策略包括：复制策略、替代策略、金融衍生品投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、融资及转融通证券出借业务投资策略、存托凭证投资策略等以更好的跟踪标的指数，实现基金投资目标。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为标的指数收益率。本基金标的指数为中证新能源指数，及其未来可能发生的变更。
风险收益特征	本基金属股票型基金，一般而言，其风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	南方基金管理股份有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	常克川
	联系电话	0755-82763888
	电子邮箱	manager@southernfund.com
客户服务电话	400-889-8899	95599

传真	0755-82763889	010-68121816
注册地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	北京东城区建国门内大街 69 号
办公地址	深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼	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	518017	100031
法定代表人	周易	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	http://www.nffund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人、基金托管人的办公地址、基金上市交易的证券交易所（如有）

2.5 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 - 2023 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-450,971,377.61
本期利润	-613,888,040.09
加权平均基金份额本期利润	-0.1241
本期加权平均净值利润率	-13.36%
本期基金份额净值增长率	-10.92%
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	-893,307,890.34
期末可供分配基金份额利润	-0.1218
期末基金资产净值	6,443,496,109.66
期末基金份额净值	0.8782
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	-12.18%

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

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

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

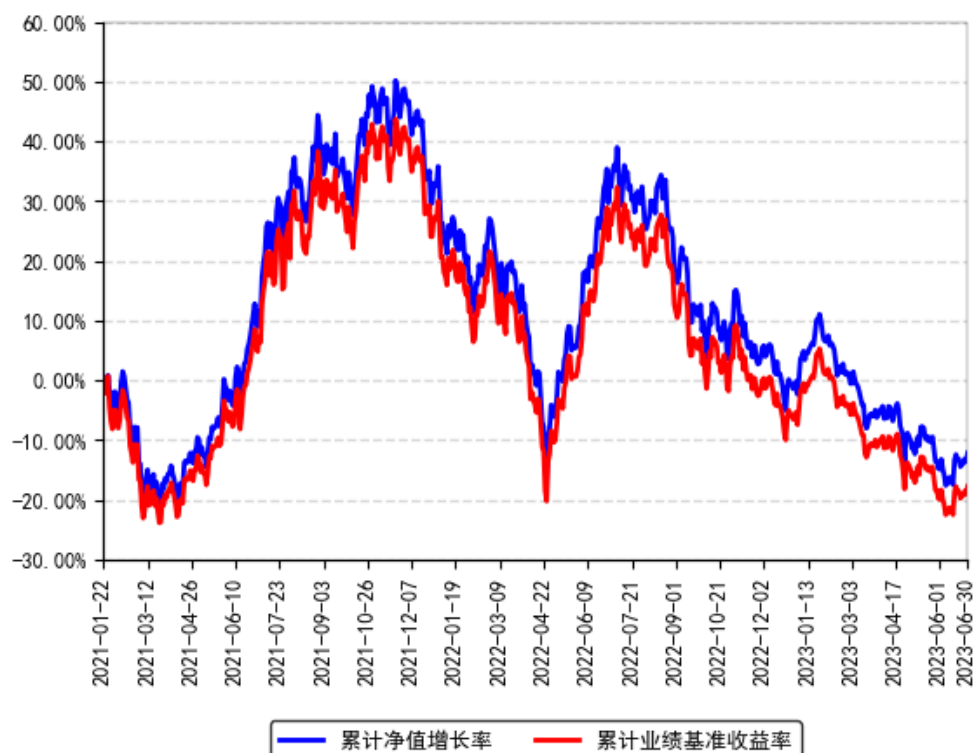
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	3.06%	1.60%	2.53%	1.60%	0.53%	0.00%
过去三个月	-7.68%	1.68%	-8.76%	1.68%	1.08%	0.00%
过去六个月	-10.92%	1.48%	-12.04%	1.49%	1.12%	-0.01%
过去一年	-33.86%	1.72%	-34.96%	1.72%	1.10%	0.00%
自基金合同生效起至今	-12.18%	2.13%	-17.79%	2.15%	5.61%	-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

南方中证新能源ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

1998 年 3 月 6 日，经中国证监会批准，南方基金管理有限公司作为国内首批规范的基金管理公司正式成立，成为我国“新基金时代”的起始标志。

2018 年 1 月，公司整体变更设立为南方基金管理股份有限公司。2019 年 7 月，根据南方基金管理股份有限公司股东大会决议，并经中国证监会核准，本公司原股东及新增股东共同认购了本公司新增的注册资本，认购完成后注册资本为 36172 万元人民币。目前，公司总部设在深圳，在北京、上海、深圳、南京、成都、合肥等地设有分公司，在香港和深圳前海设有子公司——南方东英资产管理有限公司（香港子公司）和南方资本管理有限公司（深圳子公司）。其中，南方东英是境内基金公司获批成立的第一家境外分支机构。

南方基金管理股份有限公司旗下管理公募基金、全国社保、基本养老保险、企业年金、职业年金和专户组合，已发展成为产品种类丰富、业务领域全面、经营业绩优秀、资产管理规模位居前列的基金管理公司之一。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理 （助理）期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
龚涛	本基金基金经理	2021 年 1 月 22 日	-	15 年	伦敦城市大学人工智能博士，特许金融分析师（CFA），具有基金从业资格。曾就职于巴克莱资本（伦敦）、摩根大通（伦敦）、中信期货、华泰期货、易方达基金，历任中信期货量化研究团队负责人、华泰期货研究总监兼量化组负责人、易方达基金指数与量化投资部投资经理。2019 年 5 月加入南方基金指数投资部；2019 年 7 月 12 日至 2020 年 12 月 1 日，任互联基金基金经理；2019 年 7 月 12 日至今，任南方中证 100、南方小康 ETF、南方小康 ETF 联接基金经理；2020 年 12 月 1 日至今，任互联基金基金经理；2021 年 1 月 22 日至今，任新能源 ETF 基金经理；2021 年 8 月 24 日至今，任南方中证新能源联接基金经理；2021 年 9 月 29 日至今，任南方中证科技 100ETF 基金经理；2021 年 11 月 12 日至今，兼任投资经理；2021 年 11 月 15 日至今，任南方中证物

					联网主题 ETF 基金经理 2021 年 11 月 26 日至今，任长江保护主题 ETF 基金经理 2021 年 12 月 10 日至今，任南方上证科创板 50 成份 ETF 基金经理；2021 年 12 月 17 日至今，任南方富时中国国企开放共赢 ETF 基金经理；2022 年 3 月 3 日至今，任南方上海金 ETF 基金经理；2022 年 9 月 30 日至今，任南方上证科创板新材料 ETF 基金经理；2023 年 4 月 11 日至今，任南方中证长江保护主题 ETF 联接基金经理 2023 年 4 月 27 日至今，任南方中证全指电力公用事业 ETF 基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券投资基金从业人员范围的相关规定。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
龚涛	公募基金	15	11,561,043,737.35	2019 年 07 月 12 日
	私募资产管理计划	2	27,102,795.58	2022 年 03 月 10 日
	其他组合	-	-	-
	合计	17	11,588,146,532.93	-

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、中国证监会和本基金基金合同的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，本基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。基金的投资范围、投资比例及投资组合符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执

行，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合。公司每季度对旗下组合进行股票和债券的同向交易价差专项分析。

本报告期内，两两组合间单日、3 日、5 日时间窗口内同向交易买入溢价率均值或卖出溢价率均值显著不为 0 的情况不存在，并且交易占比也没有明显异常，未发现不公平对待各组合或组合间相互利益输送的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金于本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的 5% 的交易次数为 13 次，是由于指数投资组合的投资策略导致。

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

本报告期内中证新能源指数下跌 12.04%。

期间我们通过自建的“指数化交易系统”、“日内择时交易模型”、“跟踪误差归因分析系统”、“ETF 现金流精算系统”等，将本基金的跟踪误差指标控制在较好水平，并通过严格的风险管理流程，确保了本 ETF 基金的安全运作。

我们对本基金报告期内跟踪误差归因分析如下：

- （1）新股上市初期涨幅较大的影响；
- （2）申购赎回带来的成份股权重偏差，对此我们通过日内择时交易争取跟踪误差最小化；
- （3）报告期内指数成份股（包括调出指数成份股）停牌引起的成份股权重偏离及基金整体仓位的偏离；
- （4）根据指数成份股调整进行的基金调仓，事前我们制定了详细的调仓方案，在实施过程中引入多方校验机制防范风险发生，将跟踪误差控制在理想范围内。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，本基金份额净值为 0.8782 元，报告期内，份额净值增长率为-10.92%，同期业绩基准增长率为-12.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，国内宏观环境相对宽松，经济维持弱复苏结构，股票市场行业和风格间的结构分化剧烈，资金存量博弈特征显著。

展望下半年，经济环比逐步改善，企业盈利拐点逐步出现，信用有望修复，结合当前股债风险溢价的相对判断，权益市场估值性价比较高。新能源赛道从估值和行业增速匹配度的角度具备较好的性价比，为权益类资产的重要左侧配置主线之一。

本基金为指数基金，作为基金管理人，我们将通过严格的投资管理流程、精确的数量化计算、精益求精的工作态度、恪守指数化投资的宗旨，力求实现对标的指数的有效跟踪，为持有人提供与之相近的收益。投资者可以根据自身对证券市场的判断及投资风格，借助投资本基金参与市场。

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和基金合同约定，本基金管理人应严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术，建立了估值委员会，组成人员包括副总经理、督察长、权益研究部总经理、固定收益研究部总经理、指数投资部总经理、现金及债券指数投资部总经理、风险管理部总经理及运作保障部总经理等。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策。本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据相关法律法规的规定和基金合同的约定，以及本基金的实际运作情况，本基金报告期末未进行利润分配。在符合分红条件的前提下，本基金已实现尚未分配的可供分配收益部分，将严格按照基金合同的约定适时向投资者予以分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金未出现连续二十个交易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—南方基金管理股份有限公司 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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为，南方基金管理股份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《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，南方基金管理股份有限公司的信息披露事务符合《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半年度报告中的财务指标、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，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 中期财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：南方中证新能源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	6.4.3.1	21,887,634.63	5,308,913.46
结算备付金		20,937,949.25	8,594,947.40
存出保证金		4,993,821.58	2,701,125.99
交易性金融资产	6.4.3.2	6,414,450,201.99	2,805,929,187.24
其中：股票投资		6,414,450,201.99	2,805,929,187.24
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	6.4.3.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.3.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		5,239,763.69	573,475.94
应收股利		364,124.80	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.3.5	143,373.25	181,520.39
资产总计		6,468,016,869.19	2,823,289,170.42
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	6.4.3.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,864,003.58	65,643.90
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		756,931.71	367,096.22
应付托管费		252,310.57	122,365.38
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		25,699.46	15,346.93
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.3.6	21,621,814.21	3,868,412.79
负债合计		24,520,759.53	4,438,865.22
净资产：			
实收基金	6.4.3.7	7,336,804,000.00	2,859,304,000.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.3.8	-893,307,890.34	-40,453,694.80
净资产合计		6,443,496,109.66	2,818,850,305.20
负债和净资产总计		6,468,016,869.19	2,823,289,170.42

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8782 元，基金份额总额 7,336,804,000.00 份。

6.2 利润表

会计主体：南方中证新能源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		-608,506,524.26	-48,209,128.38
1.利息收入		5,178,562.98	2,509,292.28
其中：存款利息收入	6.4.3.9	204,720.45	120,326.92
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		4,973,842.53	2,388,965.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-455,071,716.88	-241,111,752.37
其中：股票投资收益	6.4.3.10	-518,303,230.05	-250,659,404.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.3.11	572,520.10	4,816,199.46
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.3.12	-431,238.34	-3,313,233.57
股利收益	6.4.3.13	63,090,231.41	8,044,686.47
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.3.14	-162,916,662.48	189,402,738.73
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.3.15	4,303,292.12	990,592.98
减：二、营业总支出		5,381,515.83	2,977,014.02
1.管理人报酬	6.4.6.2.1	3,405,433.99	1,852,269.59
2.托管费	6.4.6.2.2	1,135,144.65	617,423.21
3.销售服务费	6.4.6.2.3	-	-
4.投资顾问费		-	-

5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失		-	-
7.税金及附加		19,643.10	8,609.45
8.其他费用	6.4.3.16	821,294.09	498,711.77
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-613,888,040.09	-51,186,142.40
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-613,888,040.09	-51,186,142.40
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-613,888,040.09	-51,186,142.40

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：南方中证新能源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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	2,859,304,000.00	-	-40,453,694.80	2,818,850,305.20
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	2,859,304,000.00	-	-40,453,694.80	2,818,850,305.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,477,500,000.00	-	-852,854,195.54	3,624,645,804.46
（一）、综合收益总额	-	-	-613,888,040.09	-613,888,040.09
（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）	4,477,500,000.00	-	-238,966,155.45	4,238,533,844.55
其中：1.基金申购款	7,653,000,000.00	-	-517,708,828.69	7,135,291,171.31

2.基金赎回款	-3,175,500,000.00	-	278,742,673.24	-2,896,757,326.76
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	7,336,804,000.00	-	-893,307,890.34	6,443,496,109.66
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	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	1,936,804,000.00	-	693,972,467.12	2,630,776,467.12
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	1,936,804,000.00	-	693,972,467.12	2,630,776,467.12
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	171,000,000.00	-	-3,271,091.68	167,728,908.32
(一)、综合收益总额	-	-	-51,186,142.40	-51,186,142.40
(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)	171,000,000.00	-	47,915,050.72	218,915,050.72
其中：1.基金申购款	2,070,000,000.00	-	328,619,971.06	2,398,619,971.06
2.基金赎回款	-1,899,000,000.00	-	-280,704,920.34	-2,179,704,920.34
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-

(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	2,107,804,000.00	-	690,701,375.44	2,798,505,375.44

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：

____ 杨小松 ____ 徐超 ____ 徐超 ____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 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。

6.4.2 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.2.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.2.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.2.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.3 重要财务报表项目的说明

6.4.3.1 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	21,887,634.63
等于：本金	21,883,434.99
加：应计利息	4,199.64
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-

其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	21,887,634.63

6.4.3.2 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	7,069,000,827.70	-	6,414,450,201.99	-654,550,625.71
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	7,069,000,827.70	-	6,414,450,201.99	-654,550,625.71

注：于 2023 年 06 月 30 日，股票投资的公允价值和公允价值变动包含的可退替代款的估值增值为 0.00 元(2022 年 12 月 31 日：0.00 元)。

6.4.3.3 衍生金融资产/负债

6.4.3.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	26,509,592.00	-	-	-
一股指期货	26,509,592.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	26,509,592.00	-	-	-

6.4.3.3.2 期末基金持有的期货合约情况

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
----	----	----------	------	--------

IC2307	IC2307	20.00	23,963,200.00	-137,760.00
IC2309	IC2309	2.00	2,388,000.00	-20,632.00
合计				-158,392.00
减：可抵销期货暂收款				-158,392.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，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期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指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。

6.4.3.4 买入返售金融资产

6.4.3.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.3.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.3.5 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	143,373.25
待摊费用	-
可收退补款	-
应收退补款	-
合计	143,373.25

6.4.3.6 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	659,493.65
其中：交易所市场	659,493.65
银行间市场	-
应付利息	-
应退退补款	20,366,411.30
预提费用	104,138.35
应付指数使用费	436,505.41
可退替代款	55,265.50

其他	-
合计	21,621,814.21

注：1、应退退款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与实际买入成本或强制退款成本之差乘以替代数量的金额。

2、可退替代款指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，替代价格与该替代证券市价之差乘以替代数量的金额。

6.4.3.7 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	2,859,304,000.00	2,859,304,000.00
本期申购	7,653,000,000.00	7,653,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-3,175,500,000.00	-3,175,500,000.00
基金拆分/份额折算前	-	-
基金份额折算变动份额	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	7,336,804,000.00	7,336,804,000.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.3.8 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	818,275,493.01	-858,729,187.81	-40,453,694.80
本期利润	-450,971,377.61	-162,916,662.48	-613,888,040.09
本期基金份额交易产生的变动数	1,152,903,514.48	-1,391,869,669.93	-238,966,155.45
其中：基金申购款	1,923,927,837.95	-2,441,636,666.64	-517,708,828.69
基金赎回款	-771,024,323.47	1,049,766,996.71	278,742,673.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,520,207,629.88	-2,413,515,520.22	-893,307,890.34

6.4.3.9 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	77,179.83
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	118,418.92
其他	9,121.70
合计	204,720.45

6.4.3.10 股票投资收益**6.4.3.10.1 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	-355,984,975.93
股票投资收益——赎回差价收入	-162,318,254.12
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	-518,303,230.05

6.4.3.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	2,862,733,841.06
减：卖出股票成本总额	3,214,350,741.99
减：交易费用	4,368,075.00
买卖股票差价收入	-355,984,975.93

注：上述交易费用（如有）包含股票买卖产生的交易费用。

6.4.3.10.3 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	2,896,757,326.76
减：现金支付赎回款总额	1,809,955,555.76
减：赎回股票成本总额	1,249,120,025.12
减：交易费用	-
赎回差价收入	-162,318,254.12

6.4.3.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.3.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.3.11 债券投资收益**6.4.3.11.1 债券投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
债券投资收益——利息收入	747.46
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	571,772.64

债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	572,520.10

6.4.3.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	4,231,711.92
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	3,659,000.00
减：应计利息总额	769.86
减：交易费用	169.42
买卖债券差价收入	571,772.64

注：上述交易费用（如有）包含债券买卖产生的交易费用。

6.4.3.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.3.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.3.12 衍生工具收益

6.4.3.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.3.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
股指期货-投资收益	-431,238.34

6.4.3.13 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	63,090,231.41
其中：证券出借权益补偿收入	2,486,859.84
基金投资产生的股利收益	-
合计	63,090,231.41

6.4.3.14 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	-163,230,260.48
——股票投资	-163,230,260.48
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	313,598.00
——权证投资	-
——期货投资	313,598.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-162,916,662.48

注：本基金本期公允价值变动损益-股票投资中包括可退替代款产生的公允价值变动损益为 0.00 元(2022 上半年度：0.00 元)。

6.4.3.15 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	4,303,292.12
合计	4,303,292.12

注：替代损益是指投资者采用可以现金替代方式申购本基金时，补入被替代股票的实际买入成本与申购确认日估值的差额，或强制退款的被替代股票在强制退款计算日与申购确认日估值的差额。

6.4.3.16 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	-
指数使用费	681,086.75
银行费用	36,068.99
合计	821,294.09

注：指数使用费为支付标的指数供应商的标的指数许可使用费，按前一日基金资产净值的 0.03%的年费率计提，逐日累计，按季支付。当本基金的季度日均基金资产净值大于人民币 5,000 万元时，标的指数许可使用费的收取下限为每季度人民币 35,000 元，当本基金的季度日均基金资产净值小于或等于人民币 5,000 万元时，无标的指数许可使用费的收取下限。

6.4.4 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.4.1 或有事项

无。

6.4.4.2 资产负债表日后事项

无。

6.4.5 关联方关系

6.4.5.1 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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.5.2 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
南方基金管理股份有限公司("南方基金")	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
华泰证券股份有限公司("华泰证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
兴业证券股份有限公司("兴业证券")	基金管理人的股东、基金销售机构
华泰联合证券有限责任公司("华泰联合")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司
南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金联接基金("南方中证新能源 ETF 联接基金")	本基金的基金管理人管理的其他基金
华泰长城资本管理有限公司("华泰长城")	基金管理人的股东华泰证券控制的公司

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。

6.4.6 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.6.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.6.1.1 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
华泰证券	200,033,026.07	2.38%	606,735,212.03	18.31%

6.4.6.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交	成交金额	占当期债券成交

		总额的比例		总额的比例
华泰证券	1,585,434.67	37.47%	7,492,491.66	32.15%

6.4.6.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.6.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.6.1.5 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
华泰证券	20,003.95	2.38%	559.98	0.08%
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
华泰证券	60,673.27	18.31%	39,354.00	21.00%

注：1. 上述佣金按市场佣金率计算。

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

6.4.6.2 关联方报酬

6.4.6.2.1 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	3,405,433.99	1,852,269.59
其中：支付销售机构的客户维护费	-	-

注：支付基金管理人南方基金的管理人报酬按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

6.4.6.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托	1,135,144.65	617,423.21

管费		
----	--	--

注：支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.05% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.05% / 当年天数。

6.4.6.2.3 销售服务费

无。

6.4.6.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.6.4 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

6.4.6.4.1 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

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	期末应收利息余额
华泰证券	322,172,668.00	338,828.24	1,886,901.00	153.92

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	期末应收利息余额
华泰证券	495,301,837.00	299,446.46	71,925,973.00	11,622.19

6.4.6.4.2 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

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：）	出借期限（单位：）	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
华泰证券	2023010300026111	东方日升	2023 年 1 月 3 日	513,484.00	20,200.00	14	3.50	678.55	-	-
华泰证券	2023010300029753	天合光能	2023 年 1 月 3 日	3,578,960.00	53,900.00	14	3.50	4,729.48	-	-

华泰 证券	20230 10300 03289 7	固德 威	2023 年 1 月 3 日	2,186, 448.0 0	6,600. 00	14	3.50	2,889. 32	-	-
华泰 证券	20230 10300 03294 7	中伟 股份	2023 年 1 月 3 日	716,6 86.00	10,70 0.00	14	3.50	947.0 8	-	-
华泰 证券	20230 10300 03294 9	天合 光能	2023 年 1 月 3 日	2,802, 080.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,702. 86	-	-
华泰 证券	20230 10300 03295 1	派能 科技	2023 年 1 月 3 日	1,168, 645.0 0	3,700. 00	14	3.50	1,544. 33	-	-
华泰 证券	20230 10300 03295 3	嘉元 科技	2023 年 1 月 3 日	442,7 52.00	9,600. 00	14	3.50	585.0 8	-	-
华泰 证券	20230 10300 03427 7	奥特 维	2023 年 1 月 3 日	324,2 40.00	1,600. 00	14	3.50	428.4 7	-	-
华泰 证券	20230 10300 03574 3	锦浪 科技	2023 年 1 月 3 日	3,198, 096.0 0	17,60 0.00	14	3.50	4,226. 18	-	-
华泰 证券	20230 10300 03851 5	锦浪 科技	2023 年 1 月 3 日	5,451, 300.0 0	30,00 0.00	14	3.50	7,203. 71	-	-
华泰 证券	20230 10300 04162 9	厦钨 新能	2023 年 1 月 3 日	270,0 28.00	3,400. 00	14	3.50	356.8 3	-	-
华泰 证券	20230 10400 00074 8	瑞泰 新材	2023 年 1 月 4 日	27,22 8.00	1,200. 00	14	3.50	35.98	-	-
华泰 证券	20230 10400 00075 2	奥特 维	2023 年 1 月 4 日	240,2 40.00	1,200. 00	14	3.50	317.4 7	-	-

华泰 证券	20230 10400 01566 4	天合 光能	2023 年 1 月 4 日	181,4 96.00	2,800. 00	14	3.50	239.8 4	-	-
华泰 证券	20230 10400 01742 2	星源 材质	2023 年 1 月 4 日	52,52 5.00	2,500. 00	14	3.50	69.41	-	-
华泰 证券	20230 10400 01742 4	晶盛 机电	2023 年 1 月 4 日	80,36 6.00	1,300. 00	14	3.50	106.2 0	-	-
华泰 证券	20230 10500 01651 3	容百 科技	2023 年 1 月 5 日	716,4 00.00	10,00 0.00	14	3.50	946.7 0	-	-
华泰 证券	20230 11000 01403 9	派能 科技	2023 年 1 月 10 日	1,203, 240.0 0	3,700. 00	20	3.50	2,271. 49	-	-
华泰 证券	20230 11100 00061 8	奥特 维	2023 年 1 月 11 日	1,838, 680.0 0	8,600. 00	19	3.50	3,297. 52	-	-
华泰 证券	20230 11100 02835 7	振华 新材	2023 年 1 月 11 日	1,764, 860.0 0	39,50 0.00	19	3.50	3,165. 13	-	-
华泰 证券	20230 11100 02900 1	海力 风电	2023 年 1 月 11 日	1,484, 726.0 0	15,80 0.00	19	3.50	2,662. 74	-	-
华泰 证券	20230 11100 02905 5	鹏辉 能源	2023 年 1 月 11 日	6,505, 728.0 0	78,80 0.00	19	3.50	11,66 7.50	-	-
华泰 证券	20230 11200 01171 9	奥特 维	2023 年 1 月 12 日	305,9 00.00	1,400. 00	18	3.50	519.7 3	-	-
华泰 证券	20230 11300 00046 2	金博 股份	2023 年 1 月 13 日	4,289, 266.0 0	17,80 0.00	17	3.50	6,882. 72	-	-

华泰 证券	20230 11300 00965 8	容百 科技	2023 年 1 月 13 日	1,238, 770.0 0	16,90 0.00	17	3.50	1,987. 78	-	-
华泰 证券	20230 11300 00980 2	东方 日升	2023 年 1 月 13 日	1,353, 600.0 0	40,00 0.00	17	3.50	2,172. 04	-	-
华泰 证券	20230 11600 00272 5	新强 联	2023 年 1 月 16 日	2,577, 861.0 0	42,90 0.00	28	3.50	6,813. 12	-	-
华泰 证券	20230 11600 00301 9	捷佳 伟创	2023 年 1 月 16 日	370,4 50.00	3,100. 00	28	3.50	979.0 7	-	-
华泰 证券	20230 11700 00039 8	厦钨 新能	2023 年 1 月 17 日	169,5 80.00	2,000. 00	28	3.50	448.1 9	-	-
华泰 证券	20230 11700 02172 5	晶盛 机电	2023 年 1 月 17 日	1,326, 600.0 0	19,80 0.00	28	3.50	3,506. 12	-	-
华泰 证券	20230 11700 02176 9	嘉元 科技	2023 年 1 月 17 日	464,5 44.00	9,600. 00	14	3.50	613.8 8	-	-
华泰 证券	20230 11700 02177 3	天合 光能	2023 年 1 月 17 日	2,981, 008.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,939. 30	-	-
华泰 证券	20230 11700 02177 7	鹏辉 能源	2023 年 1 月 17 日	91,39 2.00	1,200. 00	28	3.50	241.5 4	-	-
华泰 证券	20230 11700 02280 5	东方 日升	2023 年 1 月 17 日	706,1 92.00	20,20 0.00	14	3.50	933.2 1	-	-
华泰 证券	20230 11700 02485 9	固德 威	2023 年 1 月 17 日	2,323, 200.0 0	6,600. 00	14	3.50	3,070. 03	-	-

华泰 证券	20230 11700 02489 7	奥特 维	2023 年 1 月 17 日	347,4 56.00	1,600. 00	14	3.50	459.1 5	-	-
华泰 证券	20230 11700 02651 3	锦浪 科技	2023 年 1 月 17 日	5,246, 100.0 0	30,00 0.00	14	3.50	6,932. 55	-	-
华泰 证券	20230 11700 02945 9	锦浪 科技	2023 年 1 月 17 日	3,077, 712.0 0	17,60 0.00	14	3.50	4,067. 10	-	-
华泰 证券	20230 11700 03451 5	当升 科技	2023 年 1 月 17 日	6,431, 446.0 0	102,2 00.00	28	3.50	16,99 7.89	-	-
华泰 证券	20230 11800 01358 1	晶盛 机电	2023 年 1 月 18 日	89,24 5.00	1,300. 00	14	3.50	117.9 3	-	-
华泰 证券	20230 11800 01361 3	星源 材质	2023 年 1 月 18 日	57,75 0.00	2,500. 00	14	3.50	76.31	-	-
华泰 证券	20230 11800 01548 1	孚能 科技	2023 年 1 月 18 日	37,99 5.00	1,500. 00	28	3.50	100.4 2	-	-
华泰 证券	20230 11800 01549 7	天合 光能	2023 年 1 月 18 日	197,2 60.00	2,800. 00	14	3.50	260.6 7	-	-
华泰 证券	20230 11900 01549 6	容百 科技	2023 年 1 月 19 日	766,6 00.00	10,00 0.00	14	3.50	1,013. 04	-	-
华泰 证券	20230 11900 01756 0	孚能 科技	2023 年 1 月 19 日	35,77 0.00	1,400. 00	28	3.50	94.54	-	-
华泰 证券	20230 13000 00151 6	阳光 电源	2023 年 1 月 30 日	418,8 80.00	3,200. 00	14	3.50	553.5 4	-	-

华泰 证券	20230 13000 00200 8	捷佳 伟创	2023 年 1 月 30 日	202,8 95.00	1,700. 00	28	3.50	536.2 4	-	-
华泰 证券	20230 13000 00201 0	天奈 科技	2023 年 1 月 30 日	110,7 60.00	1,300. 00	28	3.50	292.7 3	-	-
华泰 证券	20230 13000 00201 2	奥特 维	2023 年 1 月 30 日	781,7 76.00	3,600. 00	28	3.50	2,066. 18	-	-
华泰 证券	20230 13000 06889 3	奥特 维	2023 年 1 月 30 日	304,0 24.00	1,400. 00	14	3.50	401.7 6	-	-
华泰 证券	20230 13000 06890 7	海力 风电	2023 年 1 月 30 日	1,518, 380.0 0	15,80 0.00	14	3.50	2,006. 49	-	-
华泰 证券	20230 13000 07108 3	金博 股份	2023 年 1 月 30 日	4,477, 056.0 0	17,80 0.00	14	3.50	5,916. 28	-	-
华泰 证券	20230 13000 07108 5	亿纬 锂能	2023 年 1 月 30 日	1,244, 914.0 0	14,20 0.00	28	3.50	3,290. 23	-	-
华泰 证券	20230 13000 08609 9	奥特 维	2023 年 1 月 30 日	1,867, 576.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,467. 94	-	-
华泰 证券	20230 13000 08611 5	派能 科技	2023 年 1 月 30 日	1,128, 500.0 0	3,700. 00	14	3.50	1,491. 28	-	-
华泰 证券	20230 13000 08625 5	振华 新材	2023 年 1 月 30 日	1,884, 940.0 0	39,50 0.00	14	3.50	2,490. 89	-	-
华泰 证券	20230 13000 08625 7	东方 日升	2023 年 1 月 30 日	1,335, 200.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,764. 42	-	-

华泰 证券	20230 13000 08922 3	容百 科技	2023 年 1 月 30 日	1,310, 595.0 0	16,90 0.00	14	3.50	1,731. 91	-	-
华泰 证券	20230 13000 08936 3	鹏辉 能源	2023 年 1 月 30 日	5,936, 004.0 0	78,80 0.00	14	3.50	7,844. 23	-	-
华泰 证券	20230 13100 00082 9	金博 股份	2023 年 1 月 31 日	371,7 90.00	1,500. 00	14	3.50	491.3 1	-	-
华泰 证券	20230 13100 00083 1	厦钨 新能	2023 年 1 月 31 日	524,3 40.00	6,000. 00	14	3.50	692.9 0	-	-
华泰 证券	20230 13100 00322 0	金博 股份	2023 年 1 月 31 日	371,7 90.00	1,500. 00	14	3.50	491.3 1	-	-
华泰 证券	20230 13100 00322 2	厦钨 新能	2023 年 1 月 31 日	524,3 40.00	6,000. 00	14	3.50	692.9 0	-	-
华泰 证券	20230 13100 02637 9	东方 日升	2023 年 1 月 31 日	685,7 90.00	20,20 0.00	14	3.50	906.2 5	-	-
华泰 证券	20230 13100 02640 3	嘉元 科技	2023 年 1 月 31 日	471,6 48.00	9,600. 00	14	3.50	623.2 7	-	-
华泰 证券	20230 13100 02715 3	固德 威	2023 年 1 月 31 日	2,682, 240.0 0	6,600. 00	14	3.50	3,544. 49	-	-
华泰 证券	20230 13100 02719 7	锦浪 科技	2023 年 1 月 31 日	3,222, 736.0 0	17,60 0.00	14	3.50	4,258. 74	-	-
华泰 证券	20230 13100 03201 9	天合 光能	2023 年 1 月 31 日	3,011, 814.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,980. 01	-	-

华泰 证券	20230 13100 03209 3	锦浪 科技	2023 年 1 月 31 日	5,493, 300.0 0	30,00 0.00	14	3.50	7,259. 22	-	-
华泰 证券	20230 20100 01580 4	天合 光能	2023 年 2 月 1 日	194,2 08.00	2,800. 00	14	3.50	256.6 4	-	-
华泰 证券	20230 20100 01582 8	星源 材质	2023 年 2 月 1 日	60,12 5.00	2,500. 00	14	3.50	79.45	-	-
华泰 证券	20230 20100 01687 0	晶盛 机电	2023 年 2 月 1 日	89,27 1.00	1,300. 00	14	3.50	117.9 7	-	-
华泰 证券	20230 20200 00058 3	海力 风电	2023 年 2 月 2 日	99,29 0.00	1,000. 00	14	3.50	131.2 1	-	-
华泰 证券	20230 20200 01483 1	容百 科技	2023 年 2 月 2 日	816,0 00.00	10,00 0.00	14	3.50	1,078. 32	-	-
华泰 证券	20230 20300 00050 1	鹏辉 能源	2023 年 2 月 3 日	87,54 0.00	1,200. 00	14	3.50	115.6 8	-	-
华泰 证券	20230 20300 00050 3	东方 日升	2023 年 2 月 3 日	56,15 1.00	1,700. 00	14	3.50	74.20	-	-
华泰 证券	20230 20700 00130 9	东方 日升	2023 年 2 月 7 日	66,63 3.00	2,100. 00	14	3.50	88.05	-	-
华泰 证券	20230 20700 00131 1	鹏辉 能源	2023 年 2 月 7 日	108,1 05.00	1,500. 00	14	3.50	142.8 6	-	-
华泰 证券	20230 20800 00065 6	捷佳 伟创	2023 年 2 月 8 日	127,9 96.00	1,100. 00	28	3.50	338.2 9	-	-

华泰 证券	20230 20800 00065 7	东方 日升	2023 年 2 月 8 日	41,67 8.00	1,300. 00	28	3.50	110.1 5	-	-
华泰 证券	20230 21000 00230 8	鹏辉 能源	2023 年 2 月 10 日	114,3 84.00	1,600. 00	28	3.50	302.3 1	-	-
华泰 证券	20230 21000 00231 0	捷佳 伟创	2023 年 2 月 10 日	115,8 70.00	1,000. 00	28	3.50	306.2 4	-	-
华泰 证券	20230 21300 00124 4	东方 日升	2023 年 2 月 13 日	159,3 50.00	5,000. 00	28	3.50	421.1 5	-	-
华泰 证券	20230 21300 00125 2	派能 科技	2023 年 2 月 13 日	318,7 80.00	1,100. 00	14	3.50	421.2 6	-	-
华泰 证券	20230 21300 06250 8	阳光 电源	2023 年 2 月 13 日	386,9 12.00	3,200. 00	14	3.50	511.2 9	-	-
华泰 证券	20230 21300 06256 6	新强 联	2023 年 2 月 13 日	2,545, 686.0 0	42,90 0.00	28	3.50	6,728. 08	-	-
华泰 证券	20230 21300 06256 8	捷佳 伟创	2023 年 2 月 13 日	367,0 40.00	3,100. 00	28	3.50	970.0 6	-	-
华泰 证券	20230 21300 06258 6	海力 风电	2023 年 2 月 13 日	1,444, 752.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,909. 19	-	-
华泰 证券	20230 21300 06266 4	金博 股份	2023 年 2 月 13 日	4,223, 228.0 0	17,80 0.00	14	3.50	5,580. 86	-	-
华泰 证券	20230 21300 06763 4	东方 日升	2023 年 2 月 13 日	1,274, 800.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,684. 61	-	-

华泰 证券	20230 21300 06767 4	容百 科技	2023 年 2 月 13 日	1,313, 468.0 0	16,90 0.00	14	3.50	1,735. 70	-	-
华泰 证券	20230 21300 07193 6	派能 科技	2023 年 2 月 13 日	1,072, 260.0 0	3,700. 00	14	3.50	1,416. 96	-	-
华泰 证券	20230 21300 07237 8	奥特 维	2023 年 2 月 13 日	1,719, 828.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,272. 70	-	-
华泰 证券	20230 21400 00084 9	厦钨 新能	2023 年 2 月 14 日	134,8 80.00	1,600. 00	14	3.50	178.2 4	-	-
华泰 证券	20230 21400 02088 7	金博 股份	2023 年 2 月 14 日	354,0 00.00	1,500. 00	14	3.50	467.8 0	-	-
华泰 证券	20230 21400 02088 9	厦钨 新能	2023 年 2 月 14 日	505,8 00.00	6,000. 00	14	3.50	668.4 0	-	-
华泰 证券	20230 21400 02091 7	金博 股份	2023 年 2 月 14 日	354,0 00.00	1,500. 00	14	3.50	467.8 0	-	-
华泰 证券	20230 21400 02097 9	天合 光能	2023 年 2 月 14 日	2,737, 514.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,617. 53	-	-
华泰 证券	20230 21400 02104 7	固德 威	2023 年 2 月 14 日	2,486, 550.0 0	6,600. 00	14	3.50	3,285. 89	-	-
华泰 证券	20230 21400 02312 3	东方 日升	2023 年 2 月 14 日	643,9 76.00	20,20 0.00	14	3.50	850.9 9	-	-
华泰 证券	20230 21400 02364 7	锦浪 科技	2023 年 2 月 14 日	5,061, 000.0 0	30,00 0.00	14	3.50	6,687. 95	-	-

华泰 证券	20230 21400 02660 9	锦浪 科技	2023 年 2 月 14 日	2,969, 120.0 0	17,60 0.00	14	3.50	3,923. 59	-	-
华泰 证券	20230 21400 02788 9	嘉元 科技	2023 年 2 月 14 日	489,9 84.00	9,600. 00	14	3.50	647.5 0	-	-
华泰 证券	20230 21400 02791 9	鹏辉 能源	2023 年 2 月 14 日	88,68 0.00	1,200. 00	28	3.50	234.3 8	-	-
华泰 证券	20230 21500 00087 6	天合 光能	2023 年 2 月 15 日	115,5 42.00	1,800. 00	14	3.20	139.6 0	-	-
华泰 证券	20230 21500 01743 6	孚能 科技	2023 年 2 月 15 日	38,62 5.00	1,500. 00	28	3.50	102.0 8	-	-
华泰 证券	20230 21500 01908 4	天合 光能	2023 年 2 月 15 日	179,7 32.00	2,800. 00	14	3.50	237.5 1	-	-
华泰 证券	20230 21500 01908 8	晶盛 机电	2023 年 2 月 15 日	87,24 3.00	1,300. 00	14	3.50	115.2 9	-	-
华泰 证券	20230 21500 01911 6	星源 材质	2023 年 2 月 15 日	54,45 0.00	2,500. 00	14	3.50	71.95	-	-
华泰 证券	20230 21600 00086 7	鹏辉 能源	2023 年 2 月 16 日	84,81 6.00	1,200. 00	28	3.50	224.1 6	-	-
华泰 证券	20230 21600 00086 9	捷佳 伟创	2023 年 2 月 16 日	213,0 44.00	1,700. 00	28	3.50	563.0 6	-	-
华泰 证券	20230 21600 00088 1	固德 威	2023 年 2 月 16 日	575,9 84.00	1,600. 00	28	3.50	1,522. 29	-	-

华泰 证券	20230 21600 01568 3	容百 科技	2023 年 2 月 16 日	738,0 00.00	10,00 0.00	14	3.50	975.2 4	-	-
华泰 证券	20230 21600 01659 3	海力 风电	2023 年 2 月 16 日	91,77 0.00	1,000. 00	14	3.50	121.2 7	-	-
华泰 证券	20230 21600 01697 1	孚能 科技	2023 年 2 月 16 日	35,09 8.00	1,400. 00	28	3.50	92.76	-	-
华泰 证券	20230 21700 00106 0	海力 风电	2023 年 2 月 17 日	123,5 78.00	1,400. 00	14	3.50	163.3 0	-	-
华泰 证券	20230 21700 01762 8	东方 日升	2023 年 2 月 17 日	50,84 7.00	1,700. 00	14	3.50	67.19	-	-
华泰 证券	20230 21700 01940 4	鹏辉 能源	2023 年 2 月 17 日	82,53 6.00	1,200. 00	14	3.50	109.0 7	-	-
华泰 证券	20230 22000 00081 1	鹏辉 能源	2023 年 2 月 20 日	68,17 0.00	1,000. 00	28	3.50	180.1 7	-	-
华泰 证券	20230 22000 00081 3	捷佳 伟创	2023 年 2 月 20 日	134,3 43.00	1,100. 00	28	3.50	355.0 6	-	-
华泰 证券	20230 22100 00148 6	东方 日升	2023 年 2 月 21 日	89,95 8.00	2,900. 00	28	3.50	237.7 5	-	-
华泰 证券	20230 22100 00512 9	鹏辉 能源	2023 年 2 月 21 日	103,3 20.00	1,500. 00	14	3.50	136.5 3	-	-
华泰 证券	20230 22100 00513 1	东方 日升	2023 年 2 月 21 日	65,14 2.00	2,100. 00	14	3.50	86.08	-	-

华泰 证券	20230 22200 00092 7	东方 日升	2023 年 2 月 22 日	63,33 6.00	2,100. 00	28	3.50	167.3 9	-	-
华泰 证券	20230 22200 00092 8	鹏辉 能源	2023 年 2 月 22 日	120,2 40.00	1,800. 00	28	3.50	317.7 9	-	-
华泰 证券	20230 22200 00093 1	锦浪 科技	2023 年 2 月 22 日	205,0 10.00	1,300. 00	28	3.50	541.8 3	-	-
华泰 证券	20230 22700 00075 1	长远 锂科	2023 年 2 月 27 日	1,026, 350.0 0	65,00 0.00	14	1.80	697.5 2	-	-
华泰 证券	20230 22700 06215 8	派能 科技	2023 年 2 月 27 日	290,9 61.00	1,100. 00	14	3.50	384.5 0	-	-
华泰 证券	20230 22700 06420 0	海力 风电	2023 年 2 月 27 日	1,421, 368.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,878. 29	-	-
华泰 证券	20230 22700 06614 0	阳光 电源	2023 年 2 月 27 日	384,0 32.00	3,200. 00	14	3.50	507.4 9	-	-
华泰 证券	20230 22700 06618 8	金博 股份	2023 年 2 月 27 日	3,834, 298.0 0	17,80 0.00	14	3.50	5,066. 90	-	-
华泰 证券	20230 22700 06665 0	奥特 维	2023 年 2 月 27 日	708,1 92.00	3,600. 00	28	3.50	1,871. 70	-	-
华泰 证券	20230 22700 06667 2	奥特 维	2023 年 2 月 27 日	1,691, 792.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,235. 65	-	-
华泰 证券	20230 22700 06807 0	捷佳 伟创	2023 年 2 月 27 日	221,3 57.00	1,700. 00	28	3.50	585.0 3	-	-

华泰 证券	20230 22700 07410 2	派能 科技	2023 年 2 月 27 日	978,6 87.00	3,700. 00	14	3.50	1,293. 30	-	-
华泰 证券	20230 22700 07463 4	东方 日升	2023 年 2 月 27 日	1,283, 200.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,695. 71	-	-
华泰 证券	20230 22700 07728 8	容百 科技	2023 年 2 月 27 日	1,218, 490.0 0	16,90 0.00	14	3.50	1,610. 19	-	-
华泰 证券	20230 22800 02141 0	嘉元 科技	2023 年 2 月 28 日	455,4 24.00	9,600. 00	14	3.50	601.8 3	-	-
华泰 证券	20230 22800 02154 2	锦浪 科技	2023 年 2 月 28 日	2,794, 528.0 0	17,60 0.00	14	3.50	3,692. 88	-	-
华泰 证券	20230 22800 02155 2	天合 光能	2023 年 2 月 28 日	2,603, 740.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,440. 76	-	-
华泰 证券	20230 22800 02157 6	东方 日升	2023 年 2 月 28 日	634,2 80.00	20,20 0.00	14	3.50	838.1 8	-	-
华泰 证券	20230 22800 02158 6	厦钨 新能	2023 年 2 月 28 日	470,1 00.00	6,000. 00	14	3.50	621.2 2	-	-
华泰 证券	20230 22800 02199 4	锦浪 科技	2023 年 2 月 28 日	4,763, 400.0 0	30,00 0.00	14	3.50	6,294. 68	-	-
华泰 证券	20230 22800 02409 8	固德 威	2023 年 2 月 28 日	2,564, 034.0 0	6,600. 00	14	3.50	3,388. 29	-	-
华泰 证券	20230 22800 02512 6	厦钨 新能	2023 年 2 月 28 日	125,3 60.00	1,600. 00	14	3.50	165.6 6	-	-

华泰 证券	20230 30100 01755 1	晶盛 机电	2023 年 3 月 1 日	87,90 6.00	1,300. 00	14	3.50	116.1 6	-	-
华泰 证券	20230 30100 01767 3	天合 光能	2023 年 3 月 1 日	169,7 08.00	2,800. 00	14	3.50	224.2 6	-	-
华泰 证券	20230 30100 01769 5	星源 材质	2023 年 3 月 1 日	53,20 0.00	2,500. 00	14	3.50	70.30	-	-
华泰 证券	20230 30200 00107 8	东方 日升	2023 年 3 月 2 日	108,9 28.00	3,700. 00	14	3.50	143.9 4	-	-
华泰 证券	20230 30200 00108 0	鹏辉 能源	2023 年 3 月 2 日	96,75 0.00	1,500. 00	14	3.50	127.8 5	-	-
华泰 证券	20230 30200 00108 1	锦浪 科技	2023 年 3 月 2 日	152,3 50.00	1,000. 00	28	3.50	402.6 5	-	-
华泰 证券	20230 30200 01176 3	海力 风电	2023 年 3 月 2 日	85,32 0.00	1,000. 00	14	3.50	112.7 5	-	-
华泰 证券	20230 30200 01261 9	容百 科技	2023 年 3 月 2 日	705,8 00.00	10,00 0.00	14	3.50	932.6 9	-	-
华泰 证券	20230 30300 00142 1	锦浪 科技	2023 年 3 月 3 日	213,2 20.00	1,400. 00	14	3.50	281.7 6	-	-
华泰 证券	20230 30300 00142 4	东方 日升	2023 年 3 月 3 日	108,9 28.00	3,700. 00	28	3.50	287.8 9	-	-
华泰 证券	20230 30300 00142 7	鹏辉 能源	2023 年 3 月 3 日	90,87 4.00	1,400. 00	28	3.50	240.1 7	-	-

华泰 证券	20230 30300 00142 9	天合 光能	2023 年 3 月 3 日	510,2 38.00	8,600. 00	28	3.50	1,348. 53	-	-
华泰 证券	20230 30300 01001 1	鹏辉 能源	2023 年 3 月 3 日	77,89 2.00	1,200. 00	14	3.50	102.9 3	-	-
华泰 证券	20230 30300 01005 5	海力 风电	2023 年 3 月 3 日	119,6 58.00	1,400. 00	14	3.50	158.1 2	-	-
华泰 证券	20230 30300 01008 1	东方 日升	2023 年 3 月 3 日	50,04 8.00	1,700. 00	14	3.50	66.14	-	-
华泰 证券	20230 30700 00054 5	海力 风电	2023 年 3 月 7 日	117,9 78.00	1,400. 00	14	3.50	155.9 0	-	-
华泰 证券	20230 30700 00054 6	鹏辉 能源	2023 年 3 月 7 日	303,8 76.00	4,600. 00	28	3.50	803.1 2	-	-
华泰 证券	20230 30700 00054 9	锦浪 科技	2023 年 3 月 7 日	341,5 28.00	2,200. 00	28	3.50	902.6 4	-	-
华泰 证券	20230 30700 00055 1	捷佳 伟创	2023 年 3 月 7 日	888,9 20.00	7,100. 00	28	3.50	2,349. 36	-	-
华泰 证券	20230 30700 00055 2	东方 日升	2023 年 3 月 7 日	264,6 05.00	8,500. 00	28	3.50	699.3 3	-	-
华泰 证券	20230 30700 00056 3	派能 科技	2023 年 3 月 7 日	475,1 50.00	1,700. 00	14	3.50	627.9 0	-	-
华泰 证券	20230 30700 00813 0	鹏辉 能源	2023 年 3 月 7 日	99,09 0.00	1,500. 00	14	3.50	130.9 4	-	-

华泰 证券	20230 30700 00813 2	东方 日升	2023 年 3 月 7 日	65,37 3.00	2,100. 00	14	3.50	86.39	-	-
华泰 证券	20230 30800 00595 6	捷佳 伟创	2023 年 3 月 8 日	136,8 29.00	1,100. 00	29	3.50	374.5 5	-	-
华泰 证券	20230 30800 00595 8	东方 日升	2023 年 3 月 8 日	40,84 6.00	1,300. 00	29	3.50	111.8 1	-	-
华泰 证券	20230 31000 00131 9	捷佳 伟创	2023 年 3 月 10 日	294,1 70.00	2,300. 00	28	3.50	777.4 7	-	-
华泰 证券	20230 31000 00547 5	鹏辉 能源	2023 年 3 月 10 日	100,4 16.00	1,600. 00	28	3.50	265.3 9	-	-
华泰 证券	20230 31000 00552 7	捷佳 伟创	2023 年 3 月 10 日	127,9 00.00	1,000. 00	28	3.50	338.0 3	-	-
华泰 证券	20230 31300 00059 2	锦浪 科技	2023 年 3 月 13 日	151,9 50.00	1,000. 00	14	3.50	200.8 0	-	-
华泰 证券	20230 31300 00059 4	东方 日升	2023 年 3 月 13 日	84,42 0.00	2,800. 00	28	3.50	223.1 2	-	-
华泰 证券	20230 31300 05105 8	容百 科技	2023 年 3 月 13 日	1,155, 284.0 0	16,90 0.00	14	3.50	1,526. 67	-	-
华泰 证券	20230 31300 05261 6	长远 锂科	2023 年 3 月 13 日	971,7 50.00	65,00 0.00	14	1.80	660.4 1	-	-
华泰 证券	20230 31300 05298 0	东方 日升	2023 年 3 月 13 日	1,206, 000.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,593. 69	-	-

华泰 证券	20230 31300 05299 8	派能 科技	2023 年 3 月 13 日	959,0 40.00	3,700. 00	14	3.50	1,267. 34	-	-
华泰 证券	20230 31300 05787 6	新强 联	2023 年 3 月 13 日	2,116, 257.0 0	42,90 0.00	28	3.50	5,593. 13	-	-
华泰 证券	20230 31300 05791 4	捷佳 伟创	2023 年 3 月 13 日	393,5 45.00	3,100. 00	28	3.50	1,040. 11	-	-
华泰 证券	20230 31300 05793 4	派能 科技	2023 年 3 月 13 日	285,1 20.00	1,100. 00	14	3.50	376.7 8	-	-
华泰 证券	20230 31300 05793 6	东方 日升	2023 年 3 月 13 日	150,7 50.00	5,000. 00	28	3.50	398.4 2	-	-
华泰 证券	20230 31300 05927 0	金博 股份	2023 年 3 月 13 日	3,171, 960.0 0	17,80 0.00	14	3.50	4,191. 64	-	-
华泰 证券	20230 31300 05929 0	奥特 维	2023 年 3 月 13 日	1,711, 400.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,261. 56	-	-
华泰 证券	20230 31300 05930 2	海力 风电	2023 年 3 月 13 日	1,296, 864.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,713. 76	-	-
华泰 证券	20230 31400 00062 4	东方 日升	2023 年 3 月 14 日	44,40 0.00	1,500. 00	14	3.50	58.67	-	-
华泰 证券	20230 31400 00062 6	捷佳 伟创	2023 年 3 月 14 日	182,4 45.00	1,500. 00	28	3.50	482.1 9	-	-
华泰 证券	20230 31400 00062 8	东方 日升	2023 年 3 月 14 日	50,32 0.00	1,700. 00	28	3.50	132.9 9	-	-

华泰 证券	20230 31400 00063 0	派能 科技	2023 年 3 月 14 日	356,3 00.00	1,400. 00	14	3.50	470.8 4	-	-
华泰 证券	20230 31400 00063 2	固德 威	2023 年 3 月 14 日	1,425, 611.0 0	4,100. 00	28	3.50	3,767. 80	-	-
华泰 证券	20230 31400 00063 4	奥特 维	2023 年 3 月 14 日	213,9 50.00	1,100. 00	14	3.50	282.7 3	-	-
华泰 证券	20230 31400 02065 8	鹏辉 能源	2023 年 3 月 14 日	71,92 8.00	1,200. 00	28	3.50	190.1 0	-	-
华泰 证券	20230 31400 02159 8	锦浪 科技	2023 年 3 月 14 日	2,581, 568.0 0	17,60 0.00	14	3.50	3,411. 46	-	-
华泰 证券	20230 31400 02160 6	锦浪 科技	2023 年 3 月 14 日	4,400, 400.0 0	30,00 0.00	14	3.50	5,814. 98	-	-
华泰 证券	20230 31400 02171 0	厦钨 新能	2023 年 3 月 14 日	432,6 00.00	6,000. 00	14	3.50	571.6 7	-	-
华泰 证券	20230 31400 02171 4	厦钨 新能	2023 年 3 月 14 日	115,3 60.00	1,600. 00	14	3.50	152.4 4	-	-
华泰 证券	20230 31400 02311 6	嘉元 科技	2023 年 3 月 14 日	423,3 60.00	9,600. 00	14	3.50	559.4 6	-	-
华泰 证券	20230 31400 02495 8	东方 日升	2023 年 3 月 14 日	597,9 20.00	20,20 0.00	14	3.50	790.1 3	-	-
华泰 证券	20230 31400 02496 6	天合 光能	2023 年 3 月 14 日	2,397, 804.0 0	42,20 0.00	14	3.50	3,168. 62	-	-

华泰 证券	20230 31400 02497 8	固德 威	2023 年 3 月 14 日	2,294, 886.0 0	6,600. 00	14	3.50	3,032. 62	-	-
华泰 证券	20230 31500 00068 9	锦浪 科技	2023 年 3 月 15 日	266,8 86.00	1,800. 00	28	3.50	705.3 6	-	-
华泰 证券	20230 31500 00069 1	东方 日升	2023 年 3 月 15 日	58,96 0.00	2,000. 00	14	3.50	77.91	-	-
华泰 证券	20230 31500 00070 4	捷佳 伟创	2023 年 3 月 15 日	225,2 45.00	1,900. 00	28	3.50	595.3 1	-	-
华泰 证券	20230 31500 01580 3	晶盛 机电	2023 年 3 月 15 日	86,07 3.00	1,300. 00	14	3.50	113.7 4	-	-
华泰 证券	20230 31500 02123 3	孚能 科技	2023 年 3 月 15 日	33,82 5.00	1,500. 00	28	3.50	89.40	-	-
华泰 证券	20230 31500 02128 3	天合 光能	2023 年 3 月 15 日	159,4 88.00	2,800. 00	14	3.50	210.7 6	-	-
华泰 证券	20230 31500 02129 7	星源 材质	2023 年 3 月 15 日	49,00 0.00	2,500. 00	14	3.50	64.75	-	-
华泰 证券	20230 31600 00061 2	东方 日升	2023 年 3 月 16 日	84,38 2.00	3,100. 00	28	3.50	223.0 2	-	-
华泰 证券	20230 31600 01136 4	鹏辉 能源	2023 年 3 月 16 日	68,34 0.00	1,200. 00	28	3.50	180.6 2	-	-
华泰 证券	20230 31600 01137 0	孚能 科技	2023 年 3 月 16 日	30,52 0.00	1,400. 00	28	3.50	80.66	-	-

华泰 证券	20230 31600 01137 8	鹏辉 能源	2023 年 3 月 16 日	85,42 5.00	1,500. 00	14	3.50	112.8 9	-	-
华泰 证券	20230 31600 01308 4	海力 风电	2023 年 3 月 16 日	74,25 0.00	1,000. 00	14	3.50	98.12	-	-
华泰 证券	20230 31600 01365 2	固德 威	2023 年 3 月 16 日	510,4 00.00	1,600. 00	28	3.50	1,348. 95	-	-
华泰 证券	20230 31600 01376 0	捷佳 伟创	2023 年 3 月 16 日	189,7 37.00	1,700. 00	28	3.50	501.4 6	-	-
华泰 证券	20230 31600 01515 6	东方 日升	2023 年 3 月 16 日	100,7 14.00	3,700. 00	14	3.50	133.0 9	-	-
华泰 证券	20230 31600 01569 6	容百 科技	2023 年 3 月 16 日	696,9 00.00	10,00 0.00	14	3.50	920.9 3	-	-
华泰 证券	20230 31700 00102 6	锦浪 科技	2023 年 3 月 17 日	361,4 00.00	2,600. 00	28	3.50	955.1 6	-	-
华泰 证券	20230 31700 00102 7	捷佳 伟创	2023 年 3 月 17 日	370,1 58.00	3,400. 00	28	3.50	978.3 0	-	-
华泰 证券	20230 31700 00102 8	东方 日升	2023 年 3 月 17 日	178,5 96.00	6,600. 00	28	3.50	472.0 2	-	-
华泰 证券	20230 31700 00104 4	派能 科技	2023 年 3 月 17 日	376,3 84.00	1,600. 00	14	3.50	497.3 8	-	-
华泰 证券	20230 31700 00882 1	东方 日升	2023 年 3 月 17 日	46,00 2.00	1,700. 00	14	3.50	60.79	-	-

华泰 证券	20230 31700 00882 7	海力 风电	2023 年 3 月 17 日	103,0 68.00	1,400. 00	14	3.50	136.2 0	-	-
华泰 证券	20230 31700 00884 3	锦浪 科技	2023 年 3 月 17 日	194,6 00.00	1,400. 00	14	3.50	257.1 6	-	-
华泰 证券	20230 32000 00074 8	厦钨 新能	2023 年 3 月 20 日	298,2 00.00	4,200. 00	28	3.50	788.1 2	-	-
华泰 证券	20230 32000 00075 2	金博 股份	2023 年 3 月 20 日	435,3 75.00	2,500. 00	28	3.50	1,150. 67	-	-
华泰 证券	20230 32000 00729 2	鹏辉 能源	2023 年 3 月 20 日	56,83 0.00	1,000. 00	28	3.50	150.2 0	-	-
华泰 证券	20230 32000 00731 6	捷佳 伟创	2023 年 3 月 20 日	123,5 19.00	1,100. 00	28	3.50	326.4 5	-	-
华泰 证券	20230 32100 00111 2	海力 风电	2023 年 3 月 21 日	236,9 02.00	3,100. 00	14	3.50	313.0 6	-	-
华泰 证券	20230 32100 00111 6	派能 科技	2023 年 3 月 21 日	1,179, 185.0 0	4,900. 00	14	3.50	1,558. 25	-	-
华泰 证券	20230 32100 00821 6	派能 科技	2023 年 3 月 21 日	409,1 05.00	1,700. 00	14	3.50	540.6 2	-	-
华泰 证券	20230 32100 00822 8	海力 风电	2023 年 3 月 21 日	106,9 88.00	1,400. 00	14	3.50	141.3 8	-	-
华泰 证券	20230 32100 00841 8	东方 日升	2023 年 3 月 21 日	81,49 0.00	2,900. 00	28	3.50	215.3 7	-	-

华泰 证券	20230 32100 00914 0	东方 日升	2023 年 3 月 21 日	59,01 0.00	2,100. 00	14	3.50	77.98	-	-
华泰 证券	20230 32200 00791 5	鹏辉 能源	2023 年 3 月 22 日	103,8 24.00	1,800. 00	28	3.50	274.4 0	-	-
华泰 证券	20230 32200 00792 5	锦浪 科技	2023 年 3 月 22 日	178,3 47.00	1,300. 00	28	3.50	471.3 6	-	-
华泰 证券	20230 32200 00793 3	东方 日升	2023 年 3 月 22 日	58,38 0.00	2,100. 00	28	3.50	154.2 9	-	-
华泰 证券	20230 32300 00043 8	东方 日升	2023 年 3 月 23 日	33,61 2.00	1,200. 00	28	3.50	88.83	-	-
华泰 证券	20230 32300 00044 3	锦浪 科技	2023 年 3 月 23 日	174,5 12.00	1,300. 00	28	3.50	461.2 2	-	-
华泰 证券	20230 32400 00107 9	东方 日升	2023 年 3 月 24 日	108,8 88.00	3,900. 00	28	3.50	287.7 8	-	-
华泰 证券	20230 32400 00108 3	天合 光能	2023 年 3 月 24 日	327,0 33.00	6,300. 00	14	3.50	432.1 6	-	-
华泰 证券	20230 32700 00165 4	阳光 电源	2023 年 3 月 27 日	727,2 60.00	6,900. 00	28	3.50	1,922. 10	-	-
华泰 证券	20230 32700 00165 8	阳光 电源	2023 年 3 月 27 日	358,3 60.00	3,400. 00	14	3.50	473.5 6	-	-
华泰 证券	20230 32700 05158 7	奥特 维	2023 年 3 月 27 日	652,6 80.00	3,600. 00	28	3.50	1,724. 99	-	-

华泰 证券	20230 32700 05177 9	捷佳 伟创	2023 年 3 月 27 日	191,6 24.00	1,700. 00	28	3.50	506.4 5	-	-
华泰 证券	20230 32700 05732 3	长远 锂科	2023 年 3 月 27 日	982,1 50.00	65,00 0.00	14	1.80	667.4 8	-	-
华泰 证券	20230 32700 06259 7	锦浪 科技	2023 年 3 月 27 日	137,0 80.00	1,000. 00	14	3.50	181.1 5	-	-
华泰 证券	20230 32700 06274 1	东方 日升	2023 年 3 月 27 日	1,136, 000.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,501. 19	-	-
华泰 证券	20230 32700 06274 3	派能 科技	2023 年 3 月 27 日	881,8 95.00	3,700. 00	14	3.50	1,165. 40	-	-
华泰 证券	20230 32700 06354 3	海力 风电	2023 年 3 月 27 日	1,371, 756.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,812. 73	-	-
华泰 证券	20230 32700 06747 5	金博 股份	2023 年 3 月 27 日	3,131, 020.0 0	17,80 0.00	14	3.50	4,137. 54	-	-
华泰 证券	20230 32700 06749 7	容百 科技	2023 年 3 月 27 日	1,204, 463.0 0	16,90 0.00	14	3.50	1,591. 66	-	-
华泰 证券	20230 32700 06754 1	派能 科技	2023 年 3 月 27 日	262,1 85.00	1,100. 00	14	3.50	346.4 7	-	-
华泰 证券	20230 32700 06918 1	奥特 维	2023 年 3 月 27 日	1,559, 180.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,060. 41	-	-
华泰 证券	20230 32800 00185 4	德方 纳米	2023 年 3 月 28 日	832,4 37.00	4,300. 00	14	3.50	1,100. 04	-	-

华泰 证券	20230 32800 00185 6	帝尔 激光	2023 年 3 月 28 日	564,3 04.00	5,200. 00	14	3.50	745.7 1	-	-
华泰 证券	20230 32800 00186 0	派能 科技	2023 年 3 月 28 日	277,3 08.00	1,200. 00	28	3.50	732.9 1	-	-
华泰 证券	20230 32800 00186 2	嘉元 科技	2023 年 3 月 28 日	358,5 86.00	8,200. 00	28	3.50	947.7 2	-	-
华泰 证券	20230 32800 00186 4	厦钨 新能	2023 年 3 月 28 日	134,7 10.00	1,900. 00	14	3.50	178.0 1	-	-
华泰 证券	20230 32800 02141 3	派能 科技	2023 年 3 月 28 日	323,5 26.00	1,400. 00	14	3.50	427.5 3	-	-
华泰 证券	20230 32800 02141 5	奥特 维	2023 年 3 月 28 日	192,9 62.00	1,100. 00	14	3.50	254.9 9	-	-
华泰 证券	20230 32800 02143 7	东方 日升	2023 年 3 月 28 日	558,5 30.00	20,20 0.00	14	3.50	738.0 8	-	-
华泰 证券	20230 32800 02150 7	嘉元 科技	2023 年 3 月 28 日	419,8 08.00	9,600. 00	14	3.50	554.7 6	-	-
华泰 证券	20230 32800 02158 9	锦浪 科技	2023 年 3 月 28 日	2,346, 080.0 0	17,60 0.00	14	3.50	3,100. 27	-	-
华泰 证券	20230 32800 02342 1	厦钨 新能	2023 年 3 月 28 日	113,4 40.00	1,600. 00	14	3.50	149.9 1	-	-
华泰 证券	20230 32800 02513 1	锦浪 科技	2023 年 3 月 28 日	3,999, 000.0 0	30,00 0.00	14	3.50	5,284. 55	-	-

华泰 证券	20230 32800 02744 7	东方 日升	2023 年 3 月 28 日	41,47 5.00	1,500. 00	14	3.50	54.81	-	-
华泰 证券	20230 32800 02745 9	天合 光能	2023 年 3 月 28 日	2,162, 328.0 0	42,20 0.00	14	3.50	2,857. 45	-	-
华泰 证券	20230 32900 00143 2	厦钨 新能	2023 年 3 月 29 日	433,8 00.00	6,000. 00	14	3.50	573.2 5	-	-
华泰 证券	20230 32900 00143 4	奥特 维	2023 年 3 月 29 日	380,7 30.00	2,100. 00	14	3.50	503.1 2	-	-
华泰 证券	20230 32900 00144 0	东方 日升	2023 年 3 月 29 日	172,6 20.00	6,300. 00	28	3.50	456.2 2	-	-
华泰 证券	20230 32900 00144 2	锦浪 科技	2023 年 3 月 29 日	213,2 80.00	1,600. 00	28	3.50	563.6 9	-	-
华泰 证券	20230 32900 01934 8	星源 材质	2023 年 3 月 29 日	49,32 5.00	2,500. 00	14	3.50	65.18	-	-
华泰 证券	20230 32900 01943 6	东方 日升	2023 年 3 月 29 日	54,80 0.00	2,000. 00	14	3.50	72.42	-	-
华泰 证券	20230 32900 01947 6	天合 光能	2023 年 3 月 29 日	143,0 24.00	2,800. 00	14	3.50	189.0 0	-	-
华泰 证券	20230 32900 01949 6	晶盛 机电	2023 年 3 月 29 日	83,00 5.00	1,300. 00	14	3.50	109.6 9	-	-
华泰 证券	20230 33000 00197 3	捷佳 伟创	2023 年 3 月 30 日	230,6 00.00	2,000. 00	28	3.50	609.4 6	-	-

华泰 证券	20230 33000 01544 1	东方 日升	2023 年 3 月 30 日	104,3 77.00	3,700. 00	14	3.50	137.9 3	-	-
华泰 证券	20230 33000 01547 3	鹏辉 能源	2023 年 3 月 30 日	84,33 0.00	1,500. 00	14	3.50	111.4 4	-	-
华泰 证券	20230 33000 01547 5	海力 风电	2023 年 3 月 30 日	86,21 0.00	1,000. 00	14	3.50	113.9 2	-	-
华泰 证券	20230 33000 01649 3	容百 科技	2023 年 3 月 30 日	681,5 00.00	10,00 0.00	14	3.50	900.5 8	-	-
华泰 证券	20230 33000 01744 5	锦浪 科技	2023 年 3 月 30 日	134,1 50.00	1,000. 00	28	3.50	354.5 5	-	-
华泰 证券	20230 33100 00118 5	捷佳 伟创	2023 年 3 月 31 日	377,6 85.00	3,300. 00	28	3.50	998.2 0	-	-
华泰 证券	20230 33100 00118 7	东方 日升	2023 年 3 月 31 日	41,88 0.00	1,500. 00	28	3.50	110.6 9	-	-
华泰 证券	20230 33100 00899 7	派能 科技	2023 年 3 月 31 日	392,8 00.00	1,600. 00	14	3.50	519.0 7	-	-
华泰 证券	20230 33100 00900 3	天合 光能	2023 年 3 月 31 日	447,9 74.00	8,600. 00	28	3.50	1,183. 97	-	-
华泰 证券	20230 33100 00903 1	鹏辉 能源	2023 年 3 月 31 日	79,78 6.00	1,400. 00	28	3.50	210.8 7	-	-
华泰 证券	20230 33100 00905 1	东方 日升	2023 年 3 月 31 日	47,46 4.00	1,700. 00	14	3.50	62.72	-	-

华泰 证券	20230 33100 00905 3	海力 风电	2023 年 3 月 31 日	119,0 00.00	1,400. 00	14	3.50	157.2 5	-	-
华泰 证券	20230 33100 00905 7	锦浪 科技	2023 年 3 月 31 日	187,0 12.00	1,400. 00	14	3.50	247.1 3	-	-
华泰 证券	20230 33100 01024 7	东方 日升	2023 年 3 月 31 日	103,3 04.00	3,700. 00	28	3.50	273.0 3	-	-
华泰 证券	20230 40400 00146 0	天合 光能	2023 年 4 月 4 日	542,1 15.00	10,50 0.00	14	3.50	716.3 9	-	-
华泰 证券	20230 40400 01062 7	捷佳 伟创	2023 年 4 月 4 日	828,2 86.00	7,100. 00	30	3.50	2,345. 47	-	-
华泰 证券	20230 40400 01063 7	派能 科技	2023 年 4 月 4 日	1,149, 099.0 0	4,900. 00	14	3.50	1,518. 50	-	-
华泰 证券	20230 40400 01064 1	海力 风电	2023 年 4 月 4 日	256,4 01.00	3,100. 00	14	3.50	338.8 3	-	-
华泰 证券	20230 40400 01065 7	东方 日升	2023 年 4 月 4 日	233,4 10.00	8,500. 00	30	3.50	660.9 5	-	-
华泰 证券	20230 40400 01066 3	派能 科技	2023 年 4 月 4 日	398,6 67.00	1,700. 00	14	3.50	526.8 3	-	-
华泰 证券	20230 40400 01066 5	海力 风电	2023 年 4 月 4 日	115,7 94.00	1,400. 00	14	3.50	153.0 2	-	-
华泰 证券	20230 40400 01068 3	锦浪 科技	2023 年 4 月 4 日	286,6 60.00	2,200. 00	30	3.50	811.7 4	-	-

华泰 证券	20230 40400 01068 5	鹏辉 能源	2023 年 4 月 4 日	250,9 30.00	4,600. 00	30	3.50	710.5 6	-	-
华泰 证券	20230 40400 01068 7	东方 日升	2023 年 4 月 4 日	57,66 6.00	2,100. 00	14	3.50	76.20	-	-
华泰 证券	20230 40600 00194 2	鹏辉 能源	2023 年 4 月 6 日	313,7 28.00	5,700. 00	14	3.50	414.5 8	-	-
华泰 证券	20230 40600 00194 4	海力 风电	2023 年 4 月 6 日	95,04 0.00	1,200. 00	14	3.50	125.5 9	-	-
华泰 证券	20230 40600 00194 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 6 日	455,6 30.00	3,500. 00	28	3.50	1,204. 20	-	-
华泰 证券	20230 40600 00194 8	捷佳 伟创	2023 年 4 月 6 日	578,5 92.00	4,900. 00	28	3.50	1,529. 18	-	-
华泰 证券	20230 40600 00195 0	派能 科技	2023 年 4 月 6 日	382,5 12.00	1,600. 00	28	3.50	1,010. 95	-	-
华泰 证券	20230 40600 00195 2	厦钨 新能	2023 年 4 月 6 日	212,5 36.00	3,100. 00	14	3.50	280.8 6	-	-
华泰 证券	20230 40600 01449 2	捷佳 伟创	2023 年 4 月 6 日	129,8 88.00	1,100. 00	28	3.50	343.2 9	-	-
华泰 证券	20230 40600 01449 4	东方 日升	2023 年 4 月 6 日	35,45 1.00	1,300. 00	28	3.50	93.69	-	-
华泰 证券	20230 40700 00181 2	天合 光能	2023 年 4 月 7 日	86,03 7.00	1,700. 00	14	3.50	113.7 0	-	-

华泰 证券	20230 40700 00181 4	鹏辉 能源	2023 年 4 月 7 日	210,5 22.00	3,900. 00	28	3.50	556.4 0	-	-
华泰 证券	20230 40700 00181 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 7 日	306,1 92.00	2,400. 00	28	3.50	809.2 5	-	-
华泰 证券	20230 40700 00181 7	东方 日升	2023 年 4 月 7 日	505,9 20.00	18,60 0.00	28	3.50	1,337. 11	-	-
华泰 证券	20230 40700 00182 0	派能 科技	2023 年 4 月 7 日	258,1 04.00	1,100. 00	28	3.50	682.1 5	-	-
华泰 证券	20230 40700 00742 1	天合 光能	2023 年 4 月 7 日	318,8 43.00	6,300. 00	14	3.50	421.3 4	-	-
华泰 证券	20230 40700 00742 9	鹏辉 能源	2023 年 4 月 7 日	86,36 8.00	1,600. 00	28	3.50	228.2 6	-	-
华泰 证券	20230 40700 00743 1	捷佳 伟创	2023 年 4 月 7 日	116,0 20.00	1,000. 00	28	3.50	306.6 3	-	-
华泰 证券	20230 41000 00711 3	天齐 锂业	2023 年 4 月 10 日	117,2 25.00	1,500. 00	14	3.20	141.6 3	-	-
华泰 证券	20230 41000 00711 5	东方 日升	2023 年 4 月 10 日	279,8 88.00	10,20 0.00	28	3.50	739.7 3	-	-
华泰 证券	20230 41000 00711 7	锦浪 科技	2023 年 4 月 10 日	259,0 80.00	2,000. 00	28	3.50	684.7 3	-	-
华泰 证券	20230 41000 00711 9	正泰 电器	2023 年 4 月 10 日	99,14 4.00	3,600. 00	14	3.20	119.7 9	-	-

华泰 证券	20230 41000 00712 1	日月 股份	2023 年 4 月 10 日	118,3 60.00	5,500. 00	14	3.20	143.0 0	-	-
华泰 证券	20230 41000 00712 3	三峡 能源	2023 年 4 月 10 日	1,271, 347.0 0	229,9 00.00	14	3.20	1,536. 04	-	-
华泰 证券	20230 41000 00712 5	嘉元 科技	2023 年 4 月 10 日	65,89 5.00	1,500. 00	28	3.50	174.1 6	-	-
华泰 证券	20230 41000 00715 3	捷佳 伟创	2023 年 4 月 10 日	965,1 96.00	8,100. 00	28	3.50	2,550. 95	-	-
华泰 证券	20230 41000 00715 5	胜华 新材	2023 年 4 月 10 日	772,9 20.00	9,500. 00	28	3.10	1,809. 32	-	-
华泰 证券	20230 41000 05018 7	阳光 电源	2023 年 4 月 10 日	344,9 30.00	3,400. 00	14	3.50	455.8 1	-	-
华泰 证券	20230 41000 05018 9	东方 日升	2023 年 4 月 10 日	76,83 2.00	2,800. 00	28	3.50	203.0 6	-	-
华泰 证券	20230 41000 05020 1	派能 科技	2023 年 4 月 10 日	976,8 37.00	3,700. 00	14	3.50	1,290. 86	-	-
华泰 证券	20230 41000 05026 9	金博 股份	2023 年 4 月 10 日	3,500, 370.0 0	17,80 0.00	14	3.50	4,625. 62	-	-
华泰 证券	20230 41000 05028 9	奥特 维	2023 年 4 月 10 日	1,530, 026.0 0	8,600. 00	14	3.50	2,021. 88	-	-
华泰 证券	20230 41000 05036 5	派能 科技	2023 年 4 月 10 日	290,4 11.00	1,100. 00	14	3.50	383.7 7	-	-

华泰 证券	20230 41000 05155 1	海力 风电	2023 年 4 月 10 日	1,284, 382.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,697. 27	-	-
华泰 证券	20230 41000 05162 7	新强 联	2023 年 4 月 10 日	1,972, 971.0 0	42,90 0.00	28	3.50	5,214. 43	-	-
华泰 证券	20230 41000 05302 9	东方 日升	2023 年 4 月 10 日	1,097, 600.0 0	40,00 0.00	14	3.50	1,450. 44	-	-
华泰 证券	20230 41000 05475 9	长远 锂科	2023 年 4 月 10 日	986,7 00.00	65,00 0.00	14	1.80	670.5 7	-	-
华泰 证券	20230 41000 06185 1	东方 日升	2023 年 4 月 10 日	137,2 00.00	5,000. 00	28	3.50	362.6 1	-	-
华泰 证券	20230 41000 06186 3	捷佳 伟创	2023 年 4 月 10 日	369,3 96.00	3,100. 00	28	3.50	976.2 9	-	-
华泰 证券	20230 41100 00134 5	爱旭 股份	2023 年 4 月 11 日	3,033, 900.0 0	90,00 0.00	14	3.20	3,665. 55	-	-
华泰 证券	20230 41100 00356 3	海力 风电	2023 年 4 月 11 日	124,8 00.00	1,600. 00	14	3.50	164.9 2	-	-
华泰 证券	20230 41100 00356 9	新强 联	2023 年 4 月 11 日	1,560, 307.0 0	34,30 0.00	14	3.50	2,061. 89	-	-
华泰 证券	20230 41100 00357 0	阳光 电源	2023 年 4 月 11 日	277,6 14.00	2,700. 00	14	3.50	366.8 6	-	-
华泰 证券	20230 41100 00357 5	福莱 特	2023 年 4 月 11 日	33,40 0.00	1,000. 00	14	3.20	40.35	-	-

华泰 证券	20230 41100 00408 1	鹏辉 能源	2023 年 4 月 11 日	556,7 12.00	10,10 0.00	28	3.50	1,471. 35	-	-
华泰 证券	20230 41100 00408 3	捷佳 伟创	2023 年 4 月 11 日	830,7 71.00	7,100. 00	28	3.50	2,195. 67	-	-
华泰 证券	20230 41100 00408 5	璞泰 来	2023 年 4 月 11 日	7,382, 925.0 0	141,3 00.00	28	3.10	17,28 2.58	-	-
华泰 证券	20230 41100 00408 7	胜华 新材	2023 年 4 月 11 日	196,9 20.00	2,400. 00	28	3.10	460.9 7	-	-
华泰 证券	20230 41100 01838 8	东方 日升	2023 年 4 月 11 日	544,5 92.00	20,20 0.00	14	3.50	719.6 6	-	-
华泰 证券	20230 41100 01839 4	东方 日升	2023 年 4 月 11 日	40,44 0.00	1,500. 00	14	3.50	53.44	-	-
华泰 证券	20230 41100 01913 8	鹏辉 能源	2023 年 4 月 11 日	66,14 4.00	1,200. 00	28	3.50	174.8 1	-	-
华泰 证券	20230 41100 01923 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 11 日	3,870, 000.0 0	30,00 0.00	14	3.50	5,114. 08	-	-
华泰 证券	20230 41100 01923 8	锦浪 科技	2023 年 4 月 11 日	2,270, 400.0 0	17,60 0.00	14	3.50	3,000. 26	-	-
华泰 证券	20230 41100 01961 8	奥特 维	2023 年 4 月 11 日	200,2 00.00	1,100. 00	14	3.50	264.5 6	-	-
华泰 证券	20230 41100 02016 2	厦钨 新能	2023 年 4 月 11 日	133,6 65.00	1,900. 00	14	3.50	176.6 3	-	-

华泰 证券	20230 41100 02030 8	厦钨 新能	2023 年 4 月 11 日	112,5 60.00	1,600. 00	14	3.50	148.7 4	-	-
华泰 证券	20230 41100 02375 2	嘉元 科技	2023 年 4 月 11 日	420,1 92.00	9,600. 00	14	3.50	555.2 7	-	-
华泰 证券	20230 41100 02399 0	派能 科技	2023 年 4 月 11 日	360,7 80.00	1,400. 00	14	3.50	476.7 6	-	-
华泰 证券	20230 41100 02400 0	东方 日升	2023 年 4 月 11 日	45,83 2.00	1,700. 00	28	3.50	121.1 3	-	-
华泰 证券	20230 41100 02427 0	固德 威	2023 年 4 月 11 日	1,200, 685.0 0	4,100. 00	28	3.50	3,173. 33	-	-
华泰 证券	20230 41100 02431 2	天合 光能	2023 年 4 月 11 日	2,135, 320.0 0	42,20 0.00	14	3.50	2,821. 76	-	-
华泰 证券	20230 41200 00174 5	浙江 新能	2023 年 4 月 12 日	89,38 8.00	7,800. 00	14	3.20	108.0 0	-	-
华泰 证券	20230 41200 00292 8	星源 材质	2023 年 4 月 12 日	946,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	2,215. 65	-	-
华泰 证券	20230 41200 00293 0	星源 材质	2023 年 4 月 12 日	946,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	2,215. 65	-	-
华泰 证券	20230 41200 00293 2	爱旭 股份	2023 年 4 月 12 日	3,269, 000.0 0	100,0 00.00	28	3.10	7,652. 35	-	-
华泰 证券	20230 41200 01358 8	海力 风电	2023 年 4 月 12 日	146,9 84.00	1,900. 00	14	3.50	194.2 3	-	-

华泰 证券	20230 41200 01359 0	迈为 股份	2023 年 4 月 12 日	5,998, 860.0 0	20,70 0.00	14	3.20	7,247. 81	-	-
华泰 证券	20230 41200 01359 2	天齐 锂业	2023 年 4 月 12 日	3,437, 862.0 0	43,80 0.00	14	3.20	4,153. 62	-	-
华泰 证券	20230 41200 01359 4	捷佳 伟创	2023 年 4 月 12 日	388,5 00.00	3,500. 00	28	3.50	1,026. 78	-	-
华泰 证券	20230 41200 01359 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 12 日	902,8 80.00	7,200. 00	28	3.50	2,386. 25	-	-
华泰 证券	20230 41200 01359 8	东方 日升	2023 年 4 月 12 日	527,9 47.00	19,90 0.00	28	3.50	1,395. 33	-	-
华泰 证券	20230 41200 01360 1	吉电 股份	2023 年 4 月 12 日	1,001, 932.0 0	185,2 00.00	28	3.20	2,421. 07	-	-
华泰 证券	20230 41200 01442 3	派能 科技	2023 年 4 月 12 日	882,6 30.00	3,500. 00	14	3.50	1,166. 37	-	-
华泰 证券	20230 41200 01446 2	胜华 新材	2023 年 4 月 12 日	153,7 48.00	1,900. 00	28	3.10	359.9 1	-	-
华泰 证券	20230 41200 01449 5	福莱 特	2023 年 4 月 12 日	189,4 28.00	5,800. 00	14	3.20	228.8 7	-	-
华泰 证券	20230 41200 01452 0	璞泰 来	2023 年 4 月 12 日	1,604, 540.0 0	31,40 0.00	28	3.10	3,756. 04	-	-
华泰 证券	20230 41200 01454 0	嘉元 科技	2023 年 4 月 12 日	263,7 03.00	6,100. 00	14	3.50	348.4 7	-	-

华泰 证券	20230 41200 02628 6	孚能 科技	2023 年 4 月 12 日	33,90 0.00	1,500. 00	28	3.50	89.60	-	-
华泰 证券	20230 41200 02884 4	星源 材质	2023 年 4 月 12 日	47,32 5.00	2,500. 00	14	3.50	62.54	-	-
华泰 证券	20230 41200 02987 0	东方 日升	2023 年 4 月 12 日	53,06 0.00	2,000. 00	14	3.50	70.12	-	-
华泰 证券	20230 41200 03055 0	厦钨 新能	2023 年 4 月 12 日	418,2 60.00	6,000. 00	14	3.50	552.7 2	-	-
华泰 证券	20230 41200 03055 2	奥特 维	2023 年 4 月 12 日	371,4 06.00	2,100. 00	14	3.50	490.8 0	-	-
华泰 证券	20230 41200 03116 6	晶盛 机电	2023 年 4 月 12 日	92,13 1.00	1,300. 00	14	3.50	121.7 5	-	-
华泰 证券	20230 41200 03152 0	天合 光能	2023 年 4 月 12 日	136,3 32.00	2,800. 00	14	3.50	180.1 6	-	-
华泰 证券	20230 41300 00491 8	捷佳 伟创	2023 年 4 月 13 日	545,2 72.00	4,900. 00	28	3.50	1,441. 12	-	-
华泰 证券	20230 41300 00494 4	璞泰 来	2023 年 4 月 13 日	613,3 26.00	11,90 0.00	28	3.10	1,435. 73	-	-
华泰 证券	20230 41300 00494 6	胜华 新材	2023 年 4 月 13 日	199,4 75.00	2,500. 00	28	3.10	466.9 5	-	-
华泰 证券	20230 41300 00509 5	鹏辉 能源	2023 年 4 月 13 日	471,0 77.00	8,900. 00	14	3.50	622.5 1	-	-

华泰 证券	20230 41300 00509 7	新宙 邦	2023 年 4 月 13 日	121,9 00.00	2,300. 00	14	3.50	161.0 9	-	-
华泰 证券	20230 41300 00510 0	福莱 特	2023 年 4 月 13 日	124,2 15.00	3,900. 00	14	3.20	150.0 8	-	-
华泰 证券	20230 41300 01263 1	东方 日升	2023 年 4 月 13 日	96,38 5.00	3,700. 00	14	3.50	127.3 7	-	-
华泰 证券	20230 41300 01478 7	容百 科技	2023 年 4 月 13 日	688,5 00.00	10,00 0.00	14	3.50	909.8 3	-	-
华泰 证券	20230 41300 01482 1	捷佳 伟创	2023 年 4 月 13 日	189,1 76.00	1,700. 00	28	3.50	499.9 8	-	-
华泰 证券	20230 41300 01639 3	鹏辉 能源	2023 年 4 月 13 日	79,39 5.00	1,500. 00	14	3.50	104.9 2	-	-
华泰 证券	20230 41300 01648 7	鹏辉 能源	2023 年 4 月 13 日	63,51 6.00	1,200. 00	28	3.50	167.8 7	-	-
华泰 证券	20230 41300 01648 9	固德 威	2023 年 4 月 13 日	445,7 76.00	1,600. 00	28	3.50	1,178. 16	-	-
华泰 证券	20230 41300 01649 1	孚能 科技	2023 年 4 月 13 日	31,38 8.00	1,400. 00	28	3.50	82.96	-	-
华泰 证券	20230 41300 01651 5	海力 风电	2023 年 4 月 13 日	77,17 0.00	1,000. 00	14	3.50	101.9 8	-	-
华泰 证券	20230 41300 01731 7	东方 日升	2023 年 4 月 13 日	80,75 5.00	3,100. 00	28	3.50	213.4 3	-	-

华泰 证券	20230 41400 00265 2	璞泰 来	2023 年 4 月 14 日	2,561, 844.0 0	49,20 0.00	28	3.10	5,996. 98	-	-
华泰 证券	20230 41400 00265 6	东方 电气	2023 年 4 月 14 日	27,33 0.00	1,500. 00	14	3.20	33.02	-	-
华泰 证券	20230 41400 00871 7	派能 科技	2023 年 4 月 14 日	416,1 60.00	1,600. 00	14	3.50	549.9 4	-	-
华泰 证券	20230 41400 00871 9	东方 日升	2023 年 4 月 14 日	44,60 8.00	1,700. 00	14	3.50	58.95	-	-
华泰 证券	20230 41400 00872 1	海力 风电	2023 年 4 月 14 日	106,1 20.00	1,400. 00	14	3.50	140.2 3	-	-
华泰 证券	20230 41400 00872 3	锦浪 科技	2023 年 4 月 14 日	174,5 52.00	1,400. 00	14	3.50	230.6 6	-	-
华泰 证券	20230 41400 00874 7	锦浪 科技	2023 年 4 月 14 日	324,1 68.00	2,600. 00	28	3.50	856.7 5	-	-
华泰 证券	20230 41400 00918 7	捷佳 伟创	2023 年 4 月 14 日	380,0 52.00	3,400. 00	28	3.50	1,004. 45	-	-
华泰 证券	20230 41400 01164 3	东方 日升	2023 年 4 月 14 日	173,1 84.00	6,600. 00	28	3.50	457.7 1	-	-
华泰 证券	20230 41700 00259 5	爱旭 股份	2023 年 4 月 17 日	1,599, 078.0 0	49,40 0.00	17	3.20	2,346. 00	-	-
华泰 证券	20230 41700 00374 4	鹏辉 能源	2023 年 4 月 17 日	335,1 72.00	6,200. 00	17	3.50	537.8 3	-	-

华泰 证券	20230 41700 00375 0	璞泰 来	2023 年 4 月 17 日	206,6 22.00	3,900. 00	28	3.10	483.6 8	-	-
华泰 证券	20230 41700 00375 2	天合 光能	2023 年 4 月 17 日	276,6 50.00	5,500. 00	28	3.50	731.1 7	-	-
华泰 证券	20230 41700 00376 8	德方 纳米	2023 年 4 月 17 日	961,4 00.00	4,400. 00	17	3.50	1,542. 70	-	-
华泰 证券	20230 41700 00377 0	嘉元 科技	2023 年 4 月 17 日	139,8 40.00	3,200. 00	28	3.50	369.5 9	-	-
华泰 证券	20230 41700 01056 0	厦钨 新能	2023 年 4 月 17 日	301,1 82.00	4,200. 00	28	3.50	796.0 0	-	-
华泰 证券	20230 41700 01057 4	金博 股份	2023 年 4 月 17 日	481,1 75.00	2,500. 00	28	3.50	1,271. 71	-	-
华泰 证券	20230 41700 01068 6	鹏辉 能源	2023 年 4 月 17 日	54,06 0.00	1,000. 00	28	3.50	142.8 8	-	-
华泰 证券	20230 41700 01068 8	捷佳 伟创	2023 年 4 月 17 日	122,8 92.00	1,100. 00	28	3.50	324.8 0	-	-
华泰 证券	20230 41800 00071 2	爱旭 股份	2023 年 4 月 18 日	1,917, 600.0 0	60,00 0.00	16	3.20	2,647. 82	-	-
华泰 证券	20230 41800 00161 9	东方 日升	2023 年 4 月 18 日	294,0 39.00	11,10 0.00	28	3.50	777.1 3	-	-
华泰 证券	20230 41800 00162 2	海力 风电	2023 年 4 月 18 日	137,9 70.00	1,800. 00	16	3.50	208.3 7	-	-

华泰 证券	20230 41800 00162 3	太阳 能	2023 年 4 月 18 日	1,418, 000.0 0	200,0 00.00	28	3.10	3,319. 37	-	-
华泰 证券	20230 41800 00162 7	三峡 能源	2023 年 4 月 18 日	1,081, 976.0 0	194,6 00.00	28	3.10	2,532. 78	-	-
华泰 证券	20230 41800 00959 7	派能 科技	2023 年 4 月 18 日	1,314, 572.0 0	4,900. 00	16	3.50	1,985. 33	-	-
华泰 证券	20230 41800 00959 9	海力 风电	2023 年 4 月 18 日	237,6 15.00	3,100. 00	16	3.50	358.8 6	-	-
华泰 证券	20230 41800 01180 5	东方 日升	2023 年 4 月 18 日	55,62 9.00	2,100. 00	16	3.50	84.01	-	-
华泰 证券	20230 41800 01181 1	派能 科技	2023 年 4 月 18 日	456,0 76.00	1,700. 00	16	3.50	688.7 9	-	-
华泰 证券	20230 41800 01181 3	海力 风电	2023 年 4 月 18 日	107,3 10.00	1,400. 00	16	3.50	162.0 6	-	-
华泰 证券	20230 41800 01329 3	天合 光能	2023 年 4 月 18 日	533,1 90.00	10,50 0.00	16	3.50	805.2 5	-	-
华泰 证券	20230 41800 01332 7	东方 日升	2023 年 4 月 18 日	76,82 1.00	2,900. 00	28	3.50	203.0 3	-	-
华泰 证券	20230 41900 00439 1	锦浪 科技	2023 年 4 月 19 日	687,6 10.00	5,500. 00	28	3.50	1,817. 31	-	-
华泰 证券	20230 41900 00440 0	东方 日升	2023 年 4 月 19 日	351,6 96.00	13,60 0.00	28	3.50	929.5 1	-	-

华泰 证券	20230 41900 00440 7	鹏辉 能源	2023 年 4 月 19 日	463,2 82.00	8,600. 00	28	3.50	1,224. 42	-	-
华泰 证券	20230 41900 00441 0	派能 科技	2023 年 4 月 19 日	379,8 06.00	1,400. 00	28	3.50	1,003. 80	-	-
华泰 证券	20230 41900 00441 9	海力 风电	2023 年 4 月 19 日	90,61 2.00	1,200. 00	15	3.50	128.2 9	-	-
华泰 证券	20230 41900 00493 0	鹏辉 能源	2023 年 4 月 19 日	96,96 6.00	1,800. 00	28	3.50	256.2 7	-	-
华泰 证券	20230 41900 00493 2	锦浪 科技	2023 年 4 月 19 日	162,5 26.00	1,300. 00	28	3.50	429.5 5	-	-
华泰 证券	20230 41900 00493 4	东方 日升	2023 年 4 月 19 日	54,30 6.00	2,100. 00	28	3.50	143.5 3	-	-
华泰 证券	20230 42000 00307 7	海力 风电	2023 年 4 月 20 日	87,56 4.00	1,200. 00	14	3.50	115.7 1	-	-
华泰 证券	20230 42000 00308 3	鹏辉 能源	2023 年 4 月 20 日	313,8 00.00	6,000. 00	28	3.50	829.3 5	-	-
华泰 证券	20230 42000 00411 3	奥特 维	2023 年 4 月 20 日	1,420, 896.0 0	8,200. 00	28	1.80	1,931. 31	-	-
华泰 证券	20230 42000 00422 0	固德 威	2023 年 4 月 20 日	2,445, 750.0 0	9,000. 00	28	1.80	3,324. 32	-	-
华泰 证券	20230 42000 01262 7	鹏辉 能源	2023 年 4 月 20 日	298,1 10.00	5,700. 00	14	3.50	393.9 4	-	-

华泰 证券	20230 42000 01262 9	海力 风电	2023 年 4 月 20 日	87,56 4.00	1,200. 00	14	3.50	115.7 1	-	-
华泰 证券	20230 42000 01511 3	锦浪 科技	2023 年 4 月 20 日	158,6 65.00	1,300. 00	28	3.50	419.3 4	-	-
华泰 证券	20230 42000 01511 5	东方 日升	2023 年 4 月 20 日	30,66 0.00	1,200. 00	28	3.50	81.03	-	-
华泰 证券	20230 42000 01527 5	厦钨 新能	2023 年 4 月 20 日	216,0 70.00	3,100. 00	14	3.50	285.5 3	-	-
华泰 证券	20230 42100 00213 8	海力 风电	2023 年 4 月 21 日	144,4 00.00	2,000. 00	14	3.50	190.8 2	-	-
华泰 证券	20230 42100 00214 1	正泰 电器	2023 年 4 月 21 日	200,8 16.00	7,700. 00	14	3.20	242.6 3	-	-
华泰 证券	20230 42100 00817 5	天合 光能	2023 年 4 月 21 日	80,81 8.00	1,700. 00	14	3.50	106.8 0	-	-
华泰 证券	20230 42100 01009 1	东方 日升	2023 年 4 月 21 日	98,74 8.00	3,900. 00	28	3.50	260.9 8	-	-
华泰 证券	20230 42100 01013 9	天合 光能	2023 年 4 月 21 日	299,5 02.00	6,300. 00	14	3.50	395.7 8	-	-
华泰 证券	20230 42400 00171 4	大金 重工	2023 年 4 月 24 日	171,8 55.00	5,700. 00	14	3.20	207.6 3	-	-
华泰 证券	20230 42400 00171 6	鹏辉 能源	2023 年 4 月 24 日	270,8 10.00	5,400. 00	28	3.50	715.7 3	-	-

华泰 证券	20230 42400 00171 8	东方 日升	2023 年 4 月 24 日	281,1 84.00	11,60 0.00	28	3.50	743.1 5	-	-
华泰 证券	20230 42400 00172 2	浙江 新能	2023 年 4 月 24 日	95,71 0.00	8,500. 00	14	3.20	115.6 4	-	-
华泰 证券	20230 42400 02482 5	海力 风电	2023 年 4 月 24 日	1,151, 662.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,521. 88	-	-
华泰 证券	20230 42400 02898 7	东方 日升	2023 年 4 月 24 日	969,6 00.00	40,00 0.00	14	3.50	1,281. 29	-	-
华泰 证券	20230 42400 03522 9	阳光 电源	2023 年 4 月 24 日	351,5 60.00	3,400. 00	14	3.50	464.5 7	-	-
华泰 证券	20230 42400 03527 1	捷佳 伟创	2023 年 4 月 24 日	175,6 10.00	1,700. 00	28	3.50	464.1 3	-	-
华泰 证券	20230 42400 03541 1	三峡 能源	2023 年 4 月 24 日	1,252, 955.0 0	229,9 00.00	14	3.20	1,513. 82	-	-
华泰 证券	20230 42400 03588 1	奥特 维	2023 年 4 月 24 日	568,4 04.00	3,600. 00	28	3.50	1,502. 25	-	-
华泰 证券	20230 42400 04024 5	奥特 维	2023 年 4 月 24 日	1,357, 854.0 0	8,600. 00	14	3.50	1,794. 36	-	-
华泰 证券	20230 42400 04072 3	长远 锂科	2023 年 4 月 24 日	930,8 00.00	65,00 0.00	14	1.80	632.5 8	-	-
华泰 证券	20230 42400 04504 5	金博 股份	2023 年 4 月 24 日	2,947, 146.0 0	17,80 0.00	14	3.50	3,894. 56	-	-

华泰 证券	20230 42400 04857 1	天齐 锂业	2023 年 4 月 24 日	114,0 30.00	1,500. 00	14	3.20	137.7 7	-	-
华泰 证券	20230 42400 05465 3	派能 科技	2023 年 4 月 24 日	815,7 39.00	3,700. 00	14	3.50	1,077. 97	-	-
华泰 证券	20230 42400 05631 5	阳光 电源	2023 年 4 月 24 日	713,4 60.00	6,900. 00	28	3.50	1,885. 63	-	-
华泰 证券	20230 42400 05739 1	日月 股份	2023 年 4 月 24 日	112,2 00.00	5,500. 00	14	3.20	135.5 6	-	-
华泰 证券	20230 42400 06823 5	正泰 电器	2023 年 4 月 24 日	91,98 0.00	3,600. 00	14	3.20	111.1 3	-	-
华泰 证券	20230 42500 00434 2	先导 智能	2023 年 4 月 25 日	8,275, 200.0 0	240,0 00.00	14	3.50	10,93 5.40	-	-
华泰 证券	20230 42500 00434 4	星源 材质	2023 年 4 月 25 日	3,150, 200.0 0	190,0 00.00	14	3.50	4,162. 89	-	-
华泰 证券	20230 42500 00434 6	华友 钴业	2023 年 4 月 25 日	4,265, 170.0 0	91,00 0.00	14	3.20	5,153. 17	-	-
华泰 证券	20230 42500 00438 8	鹏辉 能源	2023 年 4 月 25 日	185,0 60.00	3,800. 00	28	3.50	489.1 0	-	-
华泰 证券	20230 42500 00439 6	福莱 特	2023 年 4 月 25 日	1,436, 028.0 0	48,40 0.00	28	3.10	3,361. 58	-	-
华泰 证券	20230 42500 05006 7	阳光 电源	2023 年 4 月 25 日	276,6 15.00	2,700. 00	14	3.50	365.5 4	-	-

华泰 证券	20230 42500 05011 9	海力 风电	2023 年 4 月 25 日	118,0 80.00	1,600. 00	14	3.50	156.0 4	-	-
华泰 证券	20230 42500 05013 7	爱旭 股份	2023 年 4 月 25 日	2,551, 500.0 0	90,00 0.00	14	3.20	3,082. 72	-	-
华泰 证券	20230 42500 05019 3	东方 日升	2023 年 4 月 25 日	488,8 40.00	20,20 0.00	14	3.50	645.9 9	-	-
华泰 证券	20230 42500 05119 3	奥特 维	2023 年 4 月 25 日	171,7 43.00	1,100. 00	14	3.50	226.9 5	-	-
华泰 证券	20230 42500 05132 1	东方 日升	2023 年 4 月 25 日	36,30 0.00	1,500. 00	14	3.50	47.97	-	-
华泰 证券	20230 42500 05387 9	嘉元 科技	2023 年 4 月 25 日	307,9 10.00	8,200. 00	28	3.50	813.7 9	-	-
华泰 证券	20230 42500 05404 7	锦浪 科技	2023 年 4 月 25 日	1,959, 584.0 0	17,60 0.00	14	3.50	2,589. 53	-	-
华泰 证券	20230 42500 05483 9	厦钨 新能	2023 年 4 月 25 日	117,4 20.00	1,900. 00	14	3.50	155.1 7	-	-
华泰 证券	20230 42500 05484 1	厦钨 新能	2023 年 4 月 25 日	98,88 0.00	1,600. 00	14	3.50	130.6 7	-	-
华泰 证券	20230 42500 05520 3	福莱 特	2023 年 4 月 25 日	29,67 0.00	1,000. 00	14	3.20	35.85	-	-
华泰 证券	20230 42500 05521 5	锦浪 科技	2023 年 4 月 25 日	3,340, 200.0 0	30,00 0.00	14	3.50	4,413. 96	-	-

华泰 证券	20230 42500 05521 7	天合 光能	2023 年 4 月 25 日	1,916, 302.0 0	42,20 0.00	14	3.50	2,532. 33	-	-
华泰 证券	20230 42500 05702 1	新强 联	2023 年 4 月 25 日	1,365, 826.0 0	34,30 0.00	14	3.50	1,804. 89	-	-
华泰 证券	20230 42500 06406 1	嘉元 科技	2023 年 4 月 25 日	360,4 80.00	9,600. 00	14	3.50	476.3 6	-	-
华泰 证券	20230 42600 00146 2	天合 光能	2023 年 4 月 26 日	727,5 00.00	15,00 0.00	28	1.80	988.8 3	-	-
华泰 证券	20230 42600 00550 8	福莱 特	2023 年 4 月 26 日	180,6 70.00	5,800. 00	14	3.20	218.2 9	-	-
华泰 证券	20230 42600 00801 8	锦浪 科技	2023 年 4 月 26 日	197,5 84.00	1,600. 00	28	3.50	522.2 0	-	-
华泰 证券	20230 42600 00813 0	天合 光能	2023 年 4 月 26 日	135,8 00.00	2,800. 00	14	3.50	179.4 6	-	-
华泰 证券	20230 42600 00818 0	迈为 股份	2023 年 4 月 26 日	5,797, 035.0 0	20,70 0.00	14	3.20	7,003. 97	-	-
华泰 证券	20230 42600 01160 2	嘉元 科技	2023 年 4 月 26 日	234,7 89.00	6,100. 00	14	3.50	310.2 7	-	-
华泰 证券	20230 42600 01165 4	厦钨 新能	2023 年 4 月 26 日	387,0 60.00	6,000. 00	14	3.50	511.4 9	-	-
华泰 证券	20230 42600 01172 4	星源 材质	2023 年 4 月 26 日	43,12 5.00	2,500. 00	14	3.50	56.99	-	-

华泰 证券	20230 42600 01458 4	海力 风电	2023 年 4 月 26 日	148,2 00.00	1,900. 00	14	3.50	195.8 4	-	-
华泰 证券	20230 42600 01953 4	天齐 锂业	2023 年 4 月 26 日	3,122, 940.0 0	43,80 0.00	14	3.20	3,773. 13	-	-
华泰 证券	20230 42600 01954 2	晶盛 机电	2023 年 4 月 26 日	87,04 8.00	1,300. 00	14	3.50	115.0 3	-	-
华泰 证券	20230 42600 02351 6	东方 日升	2023 年 4 月 26 日	52,32 0.00	2,000. 00	14	3.50	69.14	-	-
华泰 证券	20230 42600 02761 0	奥特 维	2023 年 4 月 26 日	344,5 26.00	2,100. 00	14	3.50	455.2 8	-	-
华泰 证券	20230 42600 02770 4	东方 日升	2023 年 4 月 26 日	164,8 08.00	6,300. 00	28	3.50	435.5 8	-	-
华泰 证券	20230 42600 02771 8	浙江 新能	2023 年 4 月 26 日	88,92 0.00	7,800. 00	14	3.20	107.4 3	-	-
华泰 证券	20230 42700 00524 0	长远 锂科	2023 年 4 月 27 日	988,2 00.00	90,00 0.00	28	1.80	1,343. 18	-	-
华泰 证券	20230 42700 00550 2	太阳 能	2023 年 4 月 27 日	728,7 00.00	105,0 00.00	14	3.20	880.4 1	-	-
华泰 证券	20230 42700 00550 8	新强 联	2023 年 4 月 27 日	825,8 50.00	19,90 0.00	14	3.50	1,091. 33	-	-
华泰 证券	20230 42700 01285 8	海力 风电	2023 年 4 月 27 日	75,70 0.00	1,000. 00	14	3.50	100.0 4	-	-

华泰 证券	20230 42700 01308 0	鹏辉 能源	2023 年 4 月 27 日	79,53 0.00	1,500. 00	14	3.50	105.1 0	-	-
华泰 证券	20230 42700 01338 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 27 日	119,6 20.00	1,000. 00	28	3.50	316.1 5	-	-
华泰 证券	20230 42700 01345 6	东方 日升	2023 年 4 月 27 日	91,61 2.00	3,700. 00	14	3.50	121.0 6	-	-
华泰 证券	20230 42700 01476 8	鹏辉 能源	2023 年 4 月 27 日	471,8 78.00	8,900. 00	14	3.50	623.5 7	-	-
华泰 证券	20230 42700 01701 2	福莱 特	2023 年 4 月 27 日	119,6 52.00	3,900. 00	14	3.20	144.5 6	-	-
华泰 证券	20230 42800 00250 7	赣锋 锂业	2023 年 4 月 28 日	1,039, 840.0 0	16,00 0.00	14	3.20	1,256. 33	-	-
华泰 证券	20230 42800 00250 9	厦门 钨业	2023 年 4 月 28 日	365,3 98.00	18,70 0.00	14	3.20	441.4 7	-	-
华泰 证券	20230 42800 00959 8	鹏辉 能源	2023 年 4 月 28 日	73,01 0.00	1,400. 00	28	3.50	192.9 6	-	-
华泰 证券	20230 42800 00990 6	东方 日升	2023 年 4 月 28 日	37,27 5.00	1,500. 00	28	3.50	98.52	-	-
华泰 证券	20230 42800 00996 2	天合 光能	2023 年 4 月 28 日	423,1 20.00	8,600. 00	28	3.50	1,118. 28	-	-
华泰 证券	20230 42800 01006 0	东方 日升	2023 年 4 月 28 日	91,94 5.00	3,700. 00	28	3.50	243.0 0	-	-

华泰 证券	20230 42800 01282 8	东方 日升	2023 年 4 月 28 日	42,24 5.00	1,700. 00	14	3.50	55.83	-	-
华泰 证券	20230 42800 01286 2	海力 风电	2023 年 4 月 28 日	104,2 58.00	1,400. 00	14	3.50	137.7 7	-	-
华泰 证券	20230 42800 01293 6	锦浪 科技	2023 年 4 月 28 日	159,3 20.00	1,400. 00	14	3.50	210.5 4	-	-
华泰 证券	20230 42800 01295 4	派能 科技	2023 年 4 月 28 日	387,4 72.00	1,600. 00	14	3.50	512.0 3	-	-
华泰 证券	20230 42800 01372 6	东方 电气	2023 年 4 月 28 日	26,13 0.00	1,500. 00	14	3.20	31.57	-	-
华泰 证券	20230 50400 00112 7	容百 科技	2023 年 5 月 4 日	1,338, 000.0 0	20,00 0.00	7	1.80	454.6 6	-	-
华泰 证券	20230 50400 01521 1	天合 光能	2023 年 5 月 4 日	508,8 30.00	10,50 0.00	14	3.50	672.4 0	-	-
华泰 证券	20230 50400 01641 1	鹏辉 能源	2023 年 5 月 4 日	330,7 08.00	6,200. 00	14	3.50	437.0 2	-	-
华泰 证券	20230 50400 02032 3	东方 日升	2023 年 5 月 4 日	51,61 8.00	2,100. 00	14	3.50	68.21	-	-
华泰 证券	20230 50400 02067 7	派能 科技	2023 年 5 月 4 日	1,215, 200.0 0	4,900. 00	14	3.50	1,605. 85	-	-
华泰 证券	20230 50400 02638 3	派能 科技	2023 年 5 月 4 日	421,6 00.00	1,700. 00	14	3.50	557.1 3	-	-

华泰 证券	20230 50400 03065 3	厦钨 新能	2023 年 5 月 4 日	194,9 28.00	3,100. 00	14	3.50	257.5 9	-	-
华泰 证券	20230 50400 03262 1	鹏辉 能源	2023 年 5 月 4 日	304,0 38.00	5,700. 00	14	3.50	401.7 8	-	-
华泰 证券	20230 50400 03270 5	鹏辉 能源	2023 年 5 月 4 日	245,3 64.00	4,600. 00	28	3.50	648.4 8	-	-
华泰 证券	20230 50400 03291 5	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	231,1 05.00	3,100. 00	14	3.50	305.4 0	-	-
华泰 证券	20230 50400 03334 9	捷佳 伟创	2023 年 5 月 4 日	115,1 26.00	1,100. 00	28	3.50	304.2 7	-	-
华泰 证券	20230 50400 03336 1	德方 纳米	2023 年 5 月 4 日	699,6 00.00	4,400. 00	14	3.50	924.5 0	-	-
华泰 证券	20230 50400 03423 3	派能 科技	2023 年 5 月 4 日	396,8 00.00	1,600. 00	28	3.50	1,048. 72	-	-
华泰 证券	20230 50400 03628 5	爱旭 股份	2023 年 5 月 4 日	1,920, 000.0 0	60,00 0.00	14	3.20	2,319. 74	-	-
华泰 证券	20230 50400 03643 3	锦浪 科技	2023 年 5 月 4 日	252,1 42.00	2,200. 00	28	3.50	666.3 9	-	-
华泰 证券	20230 50400 03939 7	锦浪 科技	2023 年 5 月 4 日	401,1 35.00	3,500. 00	28	3.50	1,060. 17	-	-
华泰 证券	20230 50400 04024 9	东方 日升	2023 年 5 月 4 日	208,9 30.00	8,500. 00	28	3.50	552.1 9	-	-

华泰 证券	20230 50400 05283 7	东方 日升	2023 年 5 月 4 日	31,95 4.00	1,300. 00	28	3.50	84.45	-	-
华泰 证券	20230 50400 05562 3	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	134,1 90.00	1,800. 00	14	3.50	177.3 3	-	-
华泰 证券	20230 50400 05581 1	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	104,3 70.00	1,400. 00	14	3.50	137.9 2	-	-
华泰 证券	20230 50400 05591 9	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	89,46 0.00	1,200. 00	14	3.50	118.2 2	-	-
华泰 证券	20230 50400 05602 1	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	89,46 0.00	1,200. 00	14	3.50	118.2 2	-	-
华泰 证券	20230 50400 05608 1	海力 风电	2023 年 5 月 4 日	89,46 0.00	1,200. 00	14	3.50	118.2 2	-	-
华泰 证券	20230 50500 00852 3	海力 风电	2023 年 5 月 5 日	146,0 00.00	2,000. 00	14	3.50	192.9 3	-	-
华泰 证券	20230 50500 01170 5	捷佳 伟创	2023 年 5 月 5 日	105,7 80.00	1,000. 00	28	3.50	279.5 7	-	-
华泰 证券	20230 50500 01187 9	正泰 电器	2023 年 5 月 5 日	212,4 43.00	7,700. 00	14	3.20	256.6 7	-	-
华泰 证券	20230 50500 01188 1	鹏辉 能源	2023 年 5 月 5 日	198,8 22.00	3,900. 00	28	3.50	525.4 7	-	-
华泰 证券	20230 50500 01190 5	锦浪 科技	2023 年 5 月 5 日	268,3 20.00	2,400. 00	28	3.50	709.1 5	-	-

华泰 证券	20230 50500 01193 5	天合 光能	2023 年 5 月 5 日	299,2 50.00	6,300. 00	14	3.50	395.4 5	-	-
华泰 证券	20230 50500 01193 7	天合 光能	2023 年 5 月 5 日	80,75 0.00	1,700. 00	14	3.50	106.7 1	-	-
华泰 证券	20230 50500 01194 3	鹏辉 能源	2023 年 5 月 5 日	81,56 8.00	1,600. 00	28	3.50	215.5 8	-	-
华泰 证券	20230 50500 01194 9	东方 日升	2023 年 5 月 5 日	444,5 40.00	18,60 0.00	28	3.50	1,174. 89	-	-
华泰 证券	20230 50800 00254 9	天华 新能	2023 年 5 月 8 日	177,5 28.00	5,200. 00	7	3.50	117.3 0	-	-
华泰 证券	20230 50800 00256 4	天华 新能	2023 年 5 月 8 日	2,085, 954.0 0	61,10 0.00	14	3.50	2,756. 52	-	-
华泰 证券	20230 50800 01185 9	三峡 能源	2023 年 5 月 8 日	1,266, 749.0 0	229,9 00.00	14	3.20	1,530. 48	-	-
华泰 证券	20230 50800 01505 5	锦浪 科技	2023 年 5 月 8 日	222,3 60.00	2,000. 00	28	3.50	587.6 8	-	-
华泰 证券	20230 50800 02891 1	奥特 维	2023 年 5 月 8 日	1,441, 360.0 0	8,600. 00	14	3.50	1,904. 71	-	-
华泰 证券	20230 50800 02905 7	派能 科技	2023 年 5 月 8 日	854,4 04.00	3,700. 00	14	3.50	1,129. 07	-	-
华泰 证券	20230 50800 03124 3	东方 日升	2023 年 5 月 8 日	957,2 00.00	40,00 0.00	14	3.50	1,264. 91	-	-

华泰 证券	20230 50800 03178 7	捷佳 伟创	2023 年 5 月 8 日	332,6 30.00	3,100. 00	28	3.50	879.1 2	-	-
华泰 证券	20230 50800 03429 5	嘉元 科技	2023 年 5 月 8 日	56,77 5.00	1,500. 00	28	3.50	150.0 5	-	-
华泰 证券	20230 50800 03821 5	东方 日升	2023 年 5 月 8 日	119,6 50.00	5,000. 00	28	3.50	316.2 3	-	-
华泰 证券	20230 50800 03983 7	金博 股份	2023 年 5 月 8 日	2,918, 132.0 0	17,80 0.00	14	3.50	3,856. 22	-	-
华泰 证券	20230 50800 04045 3	新强 联	2023 年 5 月 8 日	1,722, 435.0 0	42,90 0.00	28	3.50	4,552. 28	-	-
华泰 证券	20230 50800 04391 1	东方 日升	2023 年 5 月 8 日	244,0 86.00	10,20 0.00	28	3.50	645.1 0	-	-
华泰 证券	20230 50800 04434 5	阳光 电源	2023 年 5 月 8 日	366,5 20.00	3,400. 00	14	3.50	484.3 4	-	-
华泰 证券	20230 50800 05073 3	浙江 新能	2023 年 5 月 8 日	95,54 0.00	8,500. 00	14	3.20	115.4 3	-	-
华泰 证券	20230 50800 05106 5	大金 重工	2023 年 5 月 8 日	181,9 44.00	5,700. 00	14	3.20	219.8 2	-	-
华泰 证券	20230 50800 05327 3	东方 日升	2023 年 5 月 8 日	67,00 4.00	2,800. 00	28	3.50	177.0 9	-	-
华泰 证券	20230 50800 05400 9	海力 风电	2023 年 5 月 8 日	1,182, 156.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,562. 18	-	-

华泰 证券	20230 50800 05667 3	正泰 电器	2023 年 5 月 8 日	100,2 24.00	3,600. 00	14	3.20	121.0 9	-	-
华泰 证券	20230 50800 05932 9	长远 锂科	2023 年 5 月 8 日	721,5 00.00	65,00 0.00	14	1.80	490.3 4	-	-
华泰 证券	20230 50900 00463 6	德方 纳米	2023 年 5 月 9 日	875,5 77.00	5,700. 00	14	3.50	1,157. 05	-	-
华泰 证券	20230 50900 00463 7	天华 新能	2023 年 5 月 9 日	288,8 16.00	8,800. 00	14	3.50	381.6 6	-	-
华泰 证券	20230 50900 00464 0	天华 新能	2023 年 5 月 9 日	72,20 4.00	2,200. 00	28	3.50	190.8 3	-	-
华泰 证券	20230 50900 00464 1	阳光 电源	2023 年 5 月 9 日	289,1 70.00	2,700. 00	14	3.50	382.1 3	-	-
华泰 证券	20230 50900 00464 4	德方 纳米	2023 年 5 月 9 日	353,3 03.00	2,300. 00	28	3.50	933.7 6	-	-
华泰 证券	20230 50900 00464 6	正泰 电器	2023 年 5 月 9 日	83,97 9.00	3,100. 00	14	3.20	101.4 6	-	-
华泰 证券	20230 50900 00464 8	天合 光能	2023 年 5 月 9 日	1,921, 534.0 0	41,90 0.00	28	3.50	5,078. 49	-	-
华泰 证券	20230 50900 00762 7	鹏辉 能源	2023 年 5 月 9 日	501,5 66.00	10,10 0.00	28	3.50	1,325. 61	-	-
华泰 证券	20230 50900 00764 5	新强 联	2023 年 5 月 9 日	1,343, 874.0 0	34,30 0.00	14	3.50	1,775. 89	-	-

华泰 证券	20230 50900 00766 7	璞泰 来	2023 年 5 月 9 日	4,924, 305.0 0	141,3 00.00	28	3.10	11,52 7.23	-	-
华泰 证券	20230 50900 01167 3	东方 日升	2023 年 5 月 9 日	34,87 5.00	1,500. 00	14	3.50	46.09	-	-
华泰 证券	20230 50900 01184 3	嘉元 科技	2023 年 5 月 9 日	355,9 68.00	9,600. 00	14	3.50	470.4 0	-	-
华泰 证券	20230 50900 01204 7	东方 日升	2023 年 5 月 9 日	39,52 5.00	1,700. 00	28	3.50	104.4 6	-	-
华泰 证券	20230 50900 01357 9	厦钨 新能	2023 年 5 月 9 日	115,5 58.00	1,900. 00	14	3.50	152.7 1	-	-
华泰 证券	20230 50900 01358 1	厦钨 新能	2023 年 5 月 9 日	97,31 2.00	1,600. 00	14	3.50	128.5 9	-	-
华泰 证券	20230 50900 02106 7	阳光 电源	2023 年 5 月 9 日	289,1 70.00	2,700. 00	14	3.50	382.1 3	-	-
华泰 证券	20230 50900 02107 9	锦浪 科技	2023 年 5 月 9 日	1,920, 336.0 0	17,60 0.00	14	3.50	2,537. 66	-	-
华泰 证券	20230 50900 02117 9	鹏辉 能源	2023 年 5 月 9 日	59,59 2.00	1,200. 00	28	3.50	157.5 0	-	-
华泰 证券	20230 50900 02120 5	爱旭 股份	2023 年 5 月 9 日	2,757, 600.0 0	90,00 0.00	14	3.20	3,331. 73	-	-
华泰 证券	20230 50900 02123 5	奥特 维	2023 年 5 月 9 日	181,6 87.00	1,100. 00	14	3.50	240.0 9	-	-

华泰 证券	20230 50900 02178 5	星源 材质	2023 年 5 月 9 日	3,195, 800.0 0	190,0 00.00	14	3.50	4,223. 14	-	-
华泰 证券	20230 50900 02180 1	先导 智能	2023 年 5 月 9 日	8,786, 400.0 0	240,0 00.00	14	3.50	11,61 0.94	-	-
华泰 证券	20230 50900 02522 3	锦浪 科技	2023 年 5 月 9 日	3,273, 300.0 0	30,00 0.00	14	3.50	4,325. 56	-	-
华泰 证券	20230 50900 02523 5	海力 风电	2023 年 5 月 9 日	116,2 40.00	1,600. 00	14	3.50	153.6 1	-	-
华泰 证券	20230 50900 02596 3	华友 钴业	2023 年 5 月 9 日	4,694, 690.0 0	91,00 0.00	14	3.20	5,672. 12	-	-
华泰 证券	20230 50900 02647 7	东方 日升	2023 年 5 月 9 日	469,6 50.00	20,20 0.00	14	3.50	620.6 3	-	-
华泰 证券	20230 51000 00359 3	阳光 电源	2023 年 5 月 10 日	395,4 24.00	3,600. 00	14	3.50	522.5 4	-	-
华泰 证券	20230 51000 00359 5	晶澳 科技	2023 年 5 月 10 日	772,2 80.00	21,50 0.00	28	3.10	1,807. 82	-	-
华泰 证券	20230 51000 00360 3	晶澳 科技	2023 年 5 月 10 日	1,117, 112.0 0	31,10 0.00	14	3.20	1,349. 69	-	-
华泰 证券	20230 51000 00360 6	固德 威	2023 年 5 月 10 日	976,3 19.00	3,700. 00	28	3.50	2,580. 35	-	-
华泰 证券	20230 51000 00630 2	爱旭 股份	2023 年 5 月 10 日	3,091, 000.0 0	100,0 00.00	28	3.10	7,235. 67	-	-

华泰 证券	20230 51000 00634 4	璞泰 来	2023 年 5 月 10 日	1,142, 332.0 0	31,40 0.00	28	3.10	2,674. 07	-	-
华泰 证券	20230 51000 00793 6	星源 材质	2023 年 5 月 10 日	866,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	2,028. 38	-	-
华泰 证券	20230 51000 00793 8	星源 材质	2023 年 5 月 10 日	866,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	2,028. 38	-	-
华泰 证券	20230 51000 00795 0	锦浪 科技	2023 年 5 月 10 日	792,0 00.00	7,200. 00	28	3.50	2,093. 20	-	-
华泰 证券	20230 51000 00796 0	东方 日升	2023 年 5 月 10 日	472,6 25.00	19,90 0.00	28	3.50	1,249. 12	-	-
华泰 证券	20230 51000 00799 8	奥特 维	2023 年 5 月 10 日	346,7 31.00	2,100. 00	14	3.50	458.1 9	-	-
华泰 证券	20230 51000 00806 0	晶盛 机电	2023 年 5 月 10 日	88,04 9.00	1,300. 00	14	3.50	116.3 5	-	-
华泰 证券	20230 51000 00808 8	厦钨 新能	2023 年 5 月 10 日	372,5 40.00	6,000. 00	14	3.50	492.3 0	-	-
华泰 证券	20230 51000 00932 0	迈为 股份	2023 年 5 月 10 日	5,464, 800.0 0	20,70 0.00	14	3.20	6,602. 56	-	-
华泰 证券	20230 51000 00933 0	东方 日升	2023 年 5 月 10 日	47,50 0.00	2,000. 00	14	3.50	62.77	-	-
华泰 证券	20230 51000 00947 8	孚能 科技	2023 年 5 月 10 日	32,01 0.00	1,500. 00	28	3.50	84.60	-	-

华泰 证券	20230 51000 00972 4	吉电 股份	2023 年 5 月 10 日	1,033, 416.0 0	185,2 00.00	28	3.20	2,497. 14	-	-
华泰 证券	20230 51000 02520 6	海力 风电	2023 年 5 月 10 日	145,7 49.00	1,900. 00	14	3.50	192.6 0	-	-
华泰 证券	20230 51000 02524 4	浙江 新能	2023 年 5 月 10 日	86,89 2.00	7,800. 00	14	3.20	104.9 8	-	-
华泰 证券	20230 51000 02525 2	嘉元 科技	2023 年 5 月 10 日	232,7 15.00	6,100. 00	14	3.50	307.5 3	-	-
华泰 证券	20230 51000 02526 4	天合 光能	2023 年 5 月 10 日	128,5 48.00	2,800. 00	14	3.50	169.8 7	-	-
华泰 证券	20230 51000 02527 4	星源 材质	2023 年 5 月 10 日	43,32 5.00	2,500. 00	14	3.50	57.25	-	-
华泰 证券	20230 51100 00217 7	金风 科技	2023 年 5 月 11 日	78,33 0.00	7,000. 00	14	3.20	94.64	-	-
华泰 证券	20230 51100 00219 6	东方 电气	2023 年 5 月 11 日	20,00 9.00	1,100. 00	14	3.20	24.17	-	-
华泰 证券	20230 51100 00699 9	孚能 科技	2023 年 5 月 11 日	30,75 8.00	1,400. 00	28	3.50	81.29	-	-
华泰 证券	20230 51100 00705 5	鹏辉 能源	2023 年 5 月 11 日	79,68 0.00	1,500. 00	14	3.50	105.2 9	-	-
华泰 证券	20230 51100 00764 3	容百 科技	2023 年 5 月 11 日	1,329, 600.0 0	20,00 0.00	14	1.80	903.6 1	-	-

华泰 证券	20230 51100 01461 3	鹏辉 能源	2023 年 5 月 11 日	63,74 4.00	1,200. 00	28	3.50	168.4 7	-	-
华泰 证券	20230 51100 01473 1	璞泰 来	2023 年 5 月 11 日	442,3 23.00	11,90 0.00	28	3.10	1,035. 43	-	-
华泰 证券	20230 51100 01654 5	福莱 特	2023 年 5 月 11 日	118,6 77.00	3,900. 00	14	3.20	143.3 9	-	-
华泰 证券	20230 51100 01736 1	太阳 能	2023 年 5 月 11 日	742,3 50.00	105,0 00.00	14	3.20	896.9 1	-	-
华泰 证券	20230 51100 02151 7	捷佳 伟创	2023 年 5 月 11 日	173,7 57.00	1,700. 00	28	3.50	459.2 3	-	-
华泰 证券	20230 51100 02155 1	海力 风电	2023 年 5 月 11 日	79,52 0.00	1,000. 00	14	3.50	105.0 8	-	-
华泰 证券	20230 51100 02179 9	鹏辉 能源	2023 年 5 月 11 日	472,7 68.00	8,900. 00	14	3.50	624.7 5	-	-
华泰 证券	20230 51100 02188 5	东方 日升	2023 年 5 月 11 日	87,09 8.00	3,700. 00	14	3.50	115.1 0	-	-
华泰 证券	20230 51100 02192 9	东方 日升	2023 年 5 月 11 日	72,97 4.00	3,100. 00	28	3.50	192.8 7	-	-
华泰 证券	20230 51200 00124 1	海力 风电	2023 年 5 月 12 日	86,13 0.00	1,100. 00	14	3.50	113.8 2	-	-
华泰 证券	20230 51200 00472 0	海力 风电	2023 年 5 月 12 日	109,6 20.00	1,400. 00	14	3.50	144.8 6	-	-

华泰 证券	20230 51200 00608 0	赣锋 锂业	2023 年 5 月 12 日	1,033, 600.0 0	16,00 0.00	14	3.20	1,248. 79	-	-
华泰 证券	20230 51200 00860 4	锦浪 科技	2023 年 5 月 12 日	149,8 70.00	1,400. 00	14	3.50	198.0 5	-	-
华泰 证券	20230 51200 00869 2	东方 日升	2023 年 5 月 12 日	38,67 5.00	1,700. 00	14	3.50	51.11	-	-
华泰 证券	20230 51200 00901 4	厦门 钨业	2023 年 5 月 12 日	358,1 05.00	18,70 0.00	14	3.20	432.6 6	-	-
华泰 证券	20230 51500 00587 9	天华 新能	2023 年 5 月 15 日	191,2 04.00	5,200. 00	7	3.50	126.3 3	-	-
华泰 证券	20230 51600 00143 6	融捷 股份	2023 年 5 月 16 日	264,4 25.00	3,500. 00	14	3.20	319.4 8	-	-
华泰 证券	20230 51800 00175 9	太阳 能	2023 年 5 月 18 日	6,706, 000.0 0	958,0 00.00	14	3.20	8,102. 18	-	-
华泰 证券	20230 51800 00176 5	捷佳 伟创	2023 年 5 月 18 日	6,372, 680.0 0	62,60 0.00	14	3.50	8,421. 29	-	-
华泰 证券	20230 51800 00176 8	金博 股份	2023 年 5 月 18 日	980,2 20.00	6,200. 00	14	1.80	666.1 7	-	-
华泰 证券	20230 51800 00177 5	厦钨 新能	2023 年 5 月 18 日	480,4 80.00	7,000. 00	7	1.80	163.2 7	-	-
华泰 证券	20230 51800 00177 9	三峡 能源	2023 年 5 月 18 日	1,530, 272.0 0	281,3 00.00	14	3.20	1,848. 87	-	-

华泰 证券	20230 51800 00182 8	天华 新能	2023 年 5 月 18 日	73,82 0.00	2,000. 00	14	3.50	97.55	-	-
华泰 证券	20230 51800 00448 4	奥特 维	2023 年 5 月 18 日	1,371, 532.0 0	8,200. 00	14	1.80	932.1 1	-	-
华泰 证券	20230 51800 01753 4	派能 科技	2023 年 5 月 18 日	378,7 60.00	1,700. 00	14	3.50	500.5 2	-	-
华泰 证券	20230 51800 02419 8	鹏辉 能源	2023 年 5 月 18 日	317,3 16.00	6,200. 00	14	3.50	419.3 2	-	-
华泰 证券	20230 51800 02439 2	鹏辉 能源	2023 年 5 月 18 日	291,7 26.00	5,700. 00	14	3.50	385.5 1	-	-
华泰 证券	20230 51800 02502 2	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	102,4 80.00	1,200. 00	14	3.50	135.4 2	-	-
华泰 证券	20230 51800 02517 4	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	153,7 20.00	1,800. 00	14	3.50	203.1 4	-	-
华泰 证券	20230 51800 02520 2	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	102,4 80.00	1,200. 00	14	3.50	135.4 2	-	-
华泰 证券	20230 51800 02521 2	德方 纳米	2023 年 5 月 18 日	759,0 00.00	4,400. 00	14	3.50	1,002. 99	-	-
华泰 证券	20230 51800 02992 2	东方 日升	2023 年 5 月 18 日	50,10 6.00	2,100. 00	14	3.50	66.21	-	-
华泰 证券	20230 51800 02994 0	派能 科技	2023 年 5 月 18 日	1,091, 720.0 0	4,900. 00	14	3.50	1,442. 67	-	-

华泰 证券	20230 51800 03001 0	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	264,7 40.00	3,100. 00	14	3.50	349.8 5	-	-
华泰 证券	20230 51800 03092 2	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	102,4 80.00	1,200. 00	14	3.50	135.4 2	-	-
华泰 证券	20230 51800 03103 8	海力 风电	2023 年 5 月 18 日	119,5 60.00	1,400. 00	14	3.50	157.9 9	-	-
华泰 证券	20230 51800 03949 8	爱旭 股份	2023 年 5 月 18 日	1,806, 600.0 0	60,00 0.00	14	3.20	2,182. 73	-	-
华泰 证券	20230 51800 03950 2	厦钨 新能	2023 年 5 月 18 日	212,7 84.00	3,100. 00	14	3.50	281.1 9	-	-
华泰 证券	20230 51900 00308 1	鹏辉 能源	2023 年 5 月 19 日	461,8 25.00	9,100. 00	14	3.50	610.2 9	-	-
华泰 证券	20230 51900 00308 3	天华 新能	2023 年 5 月 19 日	632,9 75.00	17,50 0.00	14	3.50	836.4 6	-	-
华泰 证券	20230 51900 00309 3	固德 威	2023 年 5 月 19 日	936,2 88.00	3,600. 00	14	3.50	1,237. 27	-	-
华泰 证券	20230 51900 00309 5	东方 电气	2023 年 5 月 19 日	24,41 4.00	1,300. 00	14	3.20	29.50	-	-
华泰 证券	20230 51900 00800 7	正泰 电器	2023 年 5 月 19 日	210,1 33.00	7,700. 00	14	3.20	253.8 8	-	-
华泰 证券	20230 51900 01254 7	海力 风电	2023 年 5 月 19 日	167,0 20.00	2,000. 00	14	3.50	220.7 1	-	-

华泰 证券	20230 52200 00392 5	东方 日升	2023 年 5 月 22 日	55,38 4.00	2,300. 00	14	3.50	73.19	-	-
华泰 证券	20230 52200 00393 2	固德 威	2023 年 5 月 22 日	278,3 88.00	1,100. 00	14	3.50	367.8 8	-	-
华泰 证券	20230 52200 00393 7	派能 科技	2023 年 5 月 22 日	369,7 50.00	1,700. 00	14	3.50	488.6 1	-	-
华泰 证券	20230 52200 02450 6	东方 日升	2023 年 5 月 22 日	963,2 00.00	40,00 0.00	14	3.50	1,272. 84	-	-
华泰 证券	20230 52200 02450 8	派能 科技	2023 年 5 月 22 日	804,7 50.00	3,700. 00	14	3.50	1,063. 45	-	-
华泰 证券	20230 52200 02853 6	长远 锂科	2023 年 5 月 22 日	774,8 00.00	65,00 0.00	14	1.80	526.5 6	-	-
华泰 证券	20230 52200 04012 8	浙江 新能	2023 年 5 月 22 日	104,7 20.00	8,500. 00	14	3.20	126.5 2	-	-
华泰 证券	20230 52200 04257 8	奥特 维	2023 年 5 月 22 日	1,478, 168.0 0	8,600. 00	14	3.50	1,953. 35	-	-
华泰 证券	20230 52200 05321 0	大金 重工	2023 年 5 月 22 日	199,3 86.00	5,700. 00	14	3.20	240.9 0	-	-
华泰 证券	20230 52200 05648 2	海力 风电	2023 年 5 月 22 日	1,350, 742.0 0	15,80 0.00	14	3.50	1,784. 96	-	-
华泰 证券	20230 52200 05739 0	金博 股份	2023 年 5 月 22 日	2,759, 178.0 0	17,80 0.00	14	3.50	3,646. 16	-	-

华泰 证券	20230 52200 05949 8	正泰 电器	2023 年 5 月 22 日	98,82 0.00	3,600. 00	14	3.20	119.3 9	-	-
华泰 证券	20230 52200 05997 8	天华 新能	2023 年 5 月 22 日	2,214, 264.0 0	61,10 0.00	14	3.50	2,926. 08	-	-
华泰 证券	20230 52200 06076 6	阳光 电源	2023 年 5 月 22 日	386,9 20.00	3,400. 00	14	3.50	511.3 0	-	-
华泰 证券	20230 52200 06096 4	三峡 能源	2023 年 5 月 22 日	1,278, 244.0 0	229,9 00.00	14	3.20	1,544. 37	-	-
华泰 证券	20230 52200 06235 2	天华 新能	2023 年 5 月 22 日	188,4 48.00	5,200. 00	7	3.50	124.5 1	-	-
华泰 证券	20230 52300 00452 8	天华 新能	2023 年 5 月 23 日	64,15 2.00	1,800. 00	14	3.50	84.77	-	-
华泰 证券	20230 52300 00453 1	锦浪 科技	2023 年 5 月 23 日	464,2 88.00	4,400. 00	14	3.50	613.5 4	-	-
华泰 证券	20230 52300 00453 3	海力 风电	2023 年 5 月 23 日	92,45 5.00	1,100. 00	14	3.50	122.1 8	-	-
华泰 证券	20230 52300 00453 4	鹏辉 能源	2023 年 5 月 23 日	341,4 81.00	6,900. 00	14	3.50	451.2 6	-	-
华泰 证券	20230 52300 00453 7	金风 科技	2023 年 5 月 23 日	22,22 0.00	2,000. 00	14	3.20	26.85	-	-
华泰 证券	20230 52300 00454 9	派能 科技	2023 年 5 月 23 日	216,2 80.00	1,000. 00	14	3.50	285.8 1	-	-

华泰 证券	20230 52300 00603 4	新强 联	2023 年 5 月 23 日	1,380, 575.0 0	34,30 0.00	14	3.50	1,824. 38	-	-
华泰 证券	20230 52300 00652 8	嘉元 科技	2023 年 5 月 23 日	365,6 64.00	9,600. 00	14	3.50	483.2 1	-	-
华泰 证券	20230 52300 00694 8	华友 钴业	2023 年 5 月 23 日	4,539, 990.0 0	91,00 0.00	14	3.20	5,485. 21	-	-
华泰 证券	20230 52300 01446 2	天华 新能	2023 年 5 月 23 日	313,6 32.00	8,800. 00	14	3.50	414.4 5	-	-
华泰 证券	20230 52300 01446 8	德方 纳米	2023 年 5 月 23 日	974,7 00.00	5,700. 00	14	3.50	1,288. 03	-	-
华泰 证券	20230 52300 01447 2	正泰 电器	2023 年 5 月 23 日	84,04 1.00	3,100. 00	14	3.20	101.5 4	-	-
华泰 证券	20230 52300 01448 0	阳光 电源	2023 年 5 月 23 日	308,7 45.00	2,700. 00	14	3.50	408.0 0	-	-
华泰 证券	20230 52300 01960 8	东方 日升	2023 年 5 月 23 日	35,86 5.00	1,500. 00	14	3.50	47.39	-	-
华泰 证券	20230 52300 02070 4	先导 智能	2023 年 5 月 23 日	8,659, 200.0 0	240,0 00.00	14	3.50	11,44 2.85	-	-
华泰 证券	20230 52300 02319 8	阳光 电源	2023 年 5 月 23 日	308,7 45.00	2,700. 00	14	3.50	408.0 0	-	-
华泰 证券	20230 52300 02362 8	星源 材质	2023 年 5 月 23 日	3,254, 700.0 0	190,0 00.00	14	3.50	4,300. 98	-	-

华泰 证券	20230 52300 02366 4	锦浪 科技	2023 年 5 月 23 日	1,857, 152.0 0	17,60 0.00	14	3.50	2,454. 17	-	-
华泰 证券	20230 52300 02430 4	奥特 维	2023 年 5 月 23 日	200,8 93.00	1,100. 00	14	3.50	265.4 7	-	-
华泰 证券	20230 52300 02468 6	厦钨 新能	2023 年 5 月 23 日	128,7 44.00	1,900. 00	14	3.50	170.1 3	-	-
华泰 证券	20230 52300 02468 8	厦钨 新能	2023 年 5 月 23 日	108,4 16.00	1,600. 00	14	3.50	143.2 7	-	-
华泰 证券	20230 52300 02515 8	海力 风电	2023 年 5 月 23 日	134,4 80.00	1,600. 00	14	3.50	177.7 1	-	-
华泰 证券	20230 52300 02522 2	锦浪 科技	2023 年 5 月 23 日	3,165, 600.0 0	30,00 0.00	14	3.50	4,183. 24	-	-
华泰 证券	20230 52300 02576 6	东方 日升	2023 年 5 月 23 日	482,9 82.00	20,20 0.00	14	3.50	638.2 4	-	-
华泰 证券	20230 52400 00420 8	晶盛 机电	2023 年 5 月 24 日	95,01 7.00	1,300. 00	14	3.50	125.5 6	-	-
华泰 证券	20230 52400 00435 6	迈为 股份	2023 年 5 月 24 日	5,739, 903.0 0	20,70 0.00	14	3.20	6,934. 94	-	-
华泰 证券	20230 52400 00466 4	浙江 新能	2023 年 5 月 24 日	97,18 8.00	7,800. 00	14	3.20	117.4 2	-	-
华泰 证券	20230 52400 00591 2	奥特 维	2023 年 5 月 24 日	387,3 24.00	2,100. 00	14	3.50	511.8 4	-	-

华泰 证券	20230 52400 00738 8	天合 光能	2023 年 5 月 24 日	732,7 50.00	15,00 0.00	14	1.80	497.9 9	-	-
华泰 证券	20230 52400 00904 2	东方 日升	2023 年 5 月 24 日	49,20 0.00	2,000. 00	14	3.50	65.02	-	-
华泰 证券	20230 52400 01575 4	阳光 电源	2023 年 5 月 24 日	422,2 80.00	3,600. 00	14	3.50	558.0 3	-	-
华泰 证券	20230 52400 01576 0	晶澳 科技	2023 年 5 月 24 日	1,262, 660.0 0	31,10 0.00	14	3.20	1,525. 54	-	-
华泰 证券	20230 52400 01726 6	厦钨 新能	2023 年 5 月 24 日	403,0 80.00	6,000. 00	14	3.50	532.6 6	-	-
华泰 证券	20230 52400 01995 2	嘉元 科技	2023 年 5 月 24 日	230,4 58.00	6,100. 00	14	3.50	304.5 4	-	-
华泰 证券	20230 52400 02643 4	天合 光能	2023 年 5 月 24 日	136,7 80.00	2,800. 00	14	3.50	180.7 5	-	-
华泰 证券	20230 52400 02780 0	海力 风电	2023 年 5 月 24 日	159,8 28.00	1,900. 00	14	3.50	211.2 1	-	-
华泰 证券	20230 52500 01323 4	厦钨 新能	2023 年 5 月 25 日	473,2 70.00	7,000. 00	7	1.80	160.8 2	-	-
华泰 证券	20230 52500 01324 4	容百 科技	2023 年 5 月 25 日	1,217, 600.0 0	20,00 0.00	14	1.80	827.5 0	-	-
华泰 证券	20230 52500 01588 6	长远 锂科	2023 年 5 月 25 日	1,043, 100.0 0	90,00 0.00	14	1.80	708.9 0	-	-

华泰 证券	20230 52600 00957 2	厦门 钨业	2023 年 5 月 26 日	352,3 08.00	18,70 0.00	14	3.20	425.6 6	-	-
华泰 证券	20230 52600 01381 0	赣锋 锂业	2023 年 5 月 26 日	984,8 00.00	16,00 0.00	14	3.20	1,189. 83	-	-
华泰 证券	20230 53000 01360 8	天合 光能	2023 年 5 月 30 日	702,8 67.00	17,70 0.00	28	1.80	955.3 5	-	-
华泰 证券	20230 53000 01361 2	厦钨 新能	2023 年 5 月 30 日	994,0 00.00	14,00 0.00	28	1.80	1,351. 07	-	-
华泰 证券	20230 60100 02287 0	三峡 能源	2023 年 6 月 1 日	1,521, 833.0 0	281,3 00.00	14	3.20	1,838. 68	-	-
华泰 证券	20230 60100 02415 0	太阳 能	2023 年 6 月 1 日	6,658, 100.0 0	958,0 00.00	14	3.20	8,044. 31	-	-
华泰 证券	20230 60100 02661 2	捷佳 伟创	2023 年 6 月 1 日	6,003, 340.0 0	62,60 0.00	14	3.50	7,933. 22	-	-
华泰 证券	20230 60100 03035 1	金博 股份	2023 年 6 月 1 日	935,2 70.00	6,200. 00	14	1.80	635.6 2	-	-
华泰 证券	20230 60100 03285 8	奥特 维	2023 年 6 月 1 日	1,417, 616.0 0	8,200. 00	14	1.80	963.4 3	-	-
华泰 证券	20230 60200 00416 5	东方 日升	2023 年 6 月 2 日	951,2 00.00	40,00 0.00	14	3.50	1,256. 98	-	-
华泰 证券	20230 60500 02540 9	长远 锂科	2023 年 6 月 5 日	783,9 00.00	65,00 0.00	14	1.80	532.7 5	-	-

华泰 证券	20230 60600 00164 4	锦浪 科技	2023 年 6 月 6 日	1,045, 176.0 0	10,70 0.00	14	3.50	1,381. 17	-	-
华泰 证券	20230 60600 01537 0	先导 智能	2023 年 6 月 6 日	7,704, 000.0 0	240,0 00.00	14	3.50	10,18 0.58	-	-
华泰 证券	20230 60600 01800 6	华友 钴业	2023 年 6 月 6 日	4,331, 600.0 0	91,00 0.00	14	3.20	5,233. 43	-	-
华泰 证券	20230 60600 02065 2	星源 材质	2023 年 6 月 6 日	3,152, 100.0 0	190,0 00.00	14	3.50	4,165. 40	-	-
华泰 证券	20230 60700 00135 4	容百 科技	2023 年 6 月 7 日	5,602, 000.0 0	100,0 00.00	14	3.50	7,402. 86	-	-
华泰 证券	20230 60700 00247 3	派能 科技	2023 年 6 月 7 日	837,5 84.00	4,400. 00	7	3.50	553.4 2	-	-
华泰 证券	20230 60700 00257 8	派能 科技	2023 年 6 月 7 日	304,5 76.00	1,600. 00	7	3.20	183.9 9	-	-
华泰 证券	20230 60700 00384 1	派能 科技	2023 年 6 月 7 日	190,3 60.00	1,000. 00	7	3.20	115.0 0	-	-
华泰 证券	20230 60700 01941 5	天合 光能	2023 年 6 月 7 日	539,7 00.00	15,00 0.00	14	1.80	366.7 9	-	-
华泰 证券	20230 60700 02034 4	星源 材质	2023 年 6 月 7 日	808,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	1,554. 64	859,5 00.00	1,601. 28
华泰 证券	20230 60700 02111 9	星源 材质	2023 年 6 月 7 日	808,5 00.00	50,00 0.00	28	3.10	1,554. 64	859,5 00.00	1,601. 28

华泰 证券	20230 60700 02218 9	爱旭 股份	2023 年 6 月 7 日	3,760, 000.0 0	100,0 00.00	28	3.10	7,229. 99	3,075, 000.0 0	7,446. 89
华泰 证券	20230 60700 02290 7	浙江 新能	2023 年 6 月 7 日	91,96 2.00	7,800. 00	14	3.20	111.1 1	-	-
华泰 证券	20230 60800 00249 9	锦浪 科技	2023 年 6 月 8 日	2,579, 304.0 0	27,30 0.00	18	3.50	4,382. 31	-	-
华泰 证券	20230 60800 01705 8	长远 锂科	2023 年 6 月 8 日	1,054, 800.0 0	90,00 0.00	18	1.80	921.6 7	-	-
华泰 证券	20230 60800 02254 9	容百 科技	2023 年 6 月 8 日	1,103, 400.0 0	20,00 0.00	18	1.80	964.1 4	-	-
华泰 证券	20230 60900 00872 9	赣锋 锂业	2023 年 6 月 9 日	1,022, 560.0 0	16,00 0.00	17	3.20	1,500. 20	-	-
华泰 证券	20230 60900 00906 6	厦门 钨业	2023 年 6 月 9 日	348,7 55.00	18,70 0.00	17	3.20	511.6 6	-	-
华泰 证券	20230 61300 00732 8	大金 重工	2023 年 6 月 13 日	1,511, 640.0 0	46,80 0.00	14	3.20	1,826. 36	-	-
华泰 证券	20230 61400 02097 2	天华 新能	2023 年 6 月 14 日	36,58 0.00	1,000. 00	14	2.40	33.15	-	-
华泰 证券	20230 61400 02097 4	雅化 集团	2023 年 6 月 14 日	335,0 62.00	18,20 0.00	14	2.40	303.6 2	-	-
华泰 证券	20230 61400 02097 5	中矿 资源	2023 年 6 月 14 日	659,0 22.00	11,90 0.00	14	2.40	597.1 7	-	-

华泰 证券	20230 61400 02097 6	科达 利	2023 年 6 月 14 日	237,2 20.00	2,000. 00	14	2.40	214.9 6	-	-
华泰 证券	20230 61400 02097 7	东方 日升	2023 年 6 月 14 日	335,5 48.00	14,90 0.00	14	2.40	304.0 6	-	-
华泰 证券	20230 61400 02098 2	晶澳 科技	2023 年 6 月 14 日	277,2 00.00	7,500. 00	14	2.40	251.1 8	-	-
华泰 证券	20230 61400 02098 3	永兴 材料	2023 年 6 月 14 日	294,4 92.00	4,600. 00	14	2.40	266.8 5	-	-
华泰 证券	20230 61400 02098 6	湘电 股份	2023 年 6 月 14 日	490,0 64.00	28,10 0.00	14	2.40	444.0 7	-	-
华泰 证券	20230 61400 02098 8	振华 新材	2023 年 6 月 14 日	253,3 52.00	8,800. 00	14	2.40	229.5 7	-	-
华泰 证券	20230 61400 02099 0	孚能 科技	2023 年 6 月 14 日	247,2 96.00	11,20 0.00	14	2.40	224.0 9	-	-
华泰 证券	20230 61400 02099 2	特变 电工	2023 年 6 月 14 日	1,020, 882.0 0	45,80 0.00	14	2.40	925.0 7	-	-
华泰 证券	20230 61400 04882 2	派能 科技	2023 年 6 月 14 日	829,3 56.00	4,400. 00	7	3.50	547.9 8	-	-
华泰 证券	20230 61400 05112 9	派能 科技	2023 年 6 月 14 日	301,5 84.00	1,600. 00	7	3.20	182.1 9	-	-
华泰 证券	20230 61500 02672 1	三峡 能源	2023 年 6 月 15 日	1,488, 077.0 0	281,3 00.00	14	3.20	1,797. 89	-	-

华泰 证券	20230 61500 02689 9	太阳 能	2023 年 6 月 15 日	6,658, 100.0 0	958,0 00.00	14	3.20	8,044. 31	-	-
华泰 证券	20230 61500 03317 1	捷佳 伟创	2023 年 6 月 15 日	6,002, 088.0 0	62,60 0.00	14	3.50	7,931. 56	-	-
华泰 证券	20230 61500 03648 0	金博 股份	2023 年 6 月 15 日	954,1 80.00	6,200. 00	14	1.80	648.4 7	-	-
华泰 证券	20230 61500 03911 2	奥特 维	2023 年 6 月 15 日	1,478, 460.0 0	8,200. 00	14	1.80	1,004. 78	-	-
华泰 证券	20230 61600 02115 4	东方 日升	2023 年 6 月 16 日	963,6 00.00	40,00 0.00	14	3.50	1,273. 37	-	-
华泰 证券	20230 61900 00639 8	永兴 材料	2023 年 6 月 19 日	104,3 36.00	1,600. 00	14	3.20	99.05	100,1 76.00	102.0 2
华泰 证券	20230 61900 00644 4	禾迈 股份	2023 年 6 月 19 日	562,3 50.00	1,500. 00	14	3.50	583.8 9	532,7 25.00	601.4 0
华泰 证券	20230 61900 02220 4	长远 锂科	2023 年 6 月 19 日	738,4 00.00	65,00 0.00	14	1.80	394.2 9	732,5 50.00	406.1 2
华泰 证券	20230 62000 01926 4	禾迈 股份	2023 年 6 月 20 日	1,551, 900.0 0	4,200. 00	14	3.50	1,464. 85	1,491, 630.0 0	1,508. 79
华泰 证券	20230 62000 03051 8	华友 钴业	2023 年 6 月 20 日	4,266, 990.0 0	91,00 0.00	14	3.20	3,682. 41	4,177, 810.0 0	3,792. 88
华泰 证券	20230 62000 03104 4	锦浪 科技	2023 年 6 月 20 日	1,115, 475.0 0	10,70 0.00	14	3.50	1,052. 90	1,113, 870.0 0	1,084. 49

华泰 证券	20230 62000 03135 2	星源 材质	2023 年 6 月 20 日	3,264, 200.0 0	190,0 00.00	14	3.50	3,081. 10	3,266, 100.0 0	3,173. 53
华泰 证券	20230 62000 03137 4	先导 智能	2023 年 6 月 20 日	8,205, 600.0 0	240,0 00.00	14	3.50	7,745. 31	8,680, 800.0 0	7,977. 67
华泰 证券	20230 62100 00431 1	弘元 绿能	2023 年 6 月 21 日	1,182, 932.0 0	16,40 0.00	14	3.20	918.7 8	1,222, 620.0 0	946.3 5
华泰 证券	20230 62100 00431 5	爱旭 股份	2023 年 6 月 21 日	238,5 80.00	7,900. 00	14	3.00	173.7 2	242,9 25.00	178.9 4
华泰 证券	20230 62100 00452 9	弘元 绿能	2023 年 6 月 21 日	115,4 08.00	1,600. 00	14	3.20	89.64	119,2 80.00	92.33
华泰 证券	20230 62100 01280 4	天合 光能	2023 年 6 月 21 日	633,7 50.00	15,00 0.00	14	1.80	276.8 8	639,1 50.00	285.1 9
华泰 证券	20230 62100 01286 8	容百 科技	2023 年 6 月 21 日	5,065, 000.0 0	100,0 00.00	14	3.00	3,688. 11	5,402, 000.0 0	3,798. 75
华泰 证券	20230 62100 01555 8	浙江 新能	2023 年 6 月 21 日	99,06 0.00	7,800. 00	14	3.20	76.94	97,96 8.00	79.25
华泰 证券	20230 62600 03157 1	厦门 钨业	2023 年 6 月 26 日	352,1 21.00	18,70 0.00	14	3.20	121.5 5	355,8 61.00	125.2 0
华泰 证券	20230 62600 03249 9	锦浪 科技	2023 年 6 月 26 日	2,846, 571.0 0	27,30 0.00	14	3.50	1,074. 76	2,841, 930.0 0	1,107. 00
华泰 证券	20230 62600 03681 1	赣锋 锂业	2023 年 6 月 26 日	978,8 80.00	16,00 0.00	14	3.20	337.9 1	975,3 60.00	348.0 5

华泰 证券	20230 62600 04139 7	容百 科技	2023 年 6 月 26 日	1,044, 600.0 0	20,00 0.00	14	1.80	202.8 3	1,080, 400.0 0	208.9 2
华泰 证券	20230 62600 04181 8	长远 锂科	2023 年 6 月 26 日	1,005, 300.0 0	90,00 0.00	14	1.80	195.2 0	1,014, 300.0 0	201.0 6
华泰 证券	20230 62700 00399 2	科达 利	2023 年 6 月 27 日	6,275, 000.0 0	50,00 0.00	14	3.20	1,624. 60	6,612, 500.0 0	1,673. 33
华泰 证券	20230 62700 00799 1	爱旭 股份	2023 年 6 月 27 日	619,0 00.00	20,00 0.00	14	3.20	160.2 6	615,0 00.00	165.0 7
华泰 证券	20230 62700 00843 3	龙源 电力	2023 年 6 月 27 日	38,93 4.00	1,800. 00	14	3.20	10.08	40,50 0.00	10.38
华泰 证券	20230 62700 01841 4	大金 重工	2023 年 6 月 27 日	1,476, 072.0 0	46,80 0.00	14	3.20	382.1 5	1,443, 312.0 0	393.6 2
华泰 证券	20230 62700 01956 9	厦钨 新能	2023 年 6 月 27 日	679,8 40.00	14,00 0.00	28	1.80	99.01	693,0 00.00	101.9 8
华泰 证券	20230 62700 02094 9	天合 光能	2023 年 6 月 27 日	743,4 00.00	17,70 0.00	28	1.80	108.2 6	754,1 97.00	111.5 1
华泰 证券	20230 62800 03590 9	东方 日升	2023 年 6 月 28 日	380,9 93.00	14,90 0.00	14	2.40	49.32	381,8 87.00	50.80
华泰 证券	20230 62800 03611 6	雅化 集团	2023 年 6 月 28 日	325,4 16.00	18,20 0.00	14	2.40	42.13	323,5 96.00	43.39
华泰 证券	20230 62800 03643 4	湘电 股份	2023 年 6 月 28 日	508,0 48.00	28,10 0.00	14	2.40	65.77	536,4 29.00	67.74

华泰 证券	20230 62800 03654 4	振华 新材	2023 年 6 月 28 日	260,3 92.00	8,800. 00	14	2.40	33.71	270,9 52.00	34.72
华泰 证券	20230 62800 03720 4	天华 新能	2023 年 6 月 28 日	34,33 0.00	1,000. 00	14	2.40	4.44	35,80 0.00	4.58
华泰 证券	20230 62800 04388 9	科达 利	2023 年 6 月 28 日	262,5 80.00	2,000. 00	14	2.40	33.99	264,5 00.00	35.01
华泰 证券	20230 62800 04389 0	晶澳 科技	2023 年 6 月 28 日	317,6 25.00	7,500. 00	14	2.40	41.12	312,7 50.00	42.35
华泰 证券	20230 62800 04744 4	特变 电工	2023 年 6 月 28 日	1,019, 508.0 0	45,80 0.00	14	2.40	131.9 8	1,020, 882.0 0	135.9 3
华泰 证券	20230 62800 04849 4	永兴 材料	2023 年 6 月 28 日	284,8 78.00	4,600. 00	14	2.40	36.88	288,0 06.00	37.98
华泰 证券	20230 62800 04944 4	孚能 科技	2023 年 6 月 28 日	242,4 80.00	11,20 0.00	14	2.40	31.39	241,8 08.00	32.33
华泰 证券	20230 62800 04992 5	中矿 资源	2023 年 6 月 28 日	604,5 20.00	11,90 0.00	14	2.40	78.26	606,1 86.00	80.60
华泰 证券	20230 62900 00176 2	科达 利	2023 年 6 月 29 日	4,014, 500.0 0	31,00 0.00	14	3.20	346.4 5	4,099, 750.0 0	356.8 4
华泰 证券	20230 62900 00698 5	南网 能源	2023 年 6 月 29 日	57,44 0.00	8,000. 00	14	3.20	4.96	56,96 0.00	5.11
华泰 证券	20230 62900 00702 8	天顺 风能	2023 年 6 月 29 日	262,4 72.00	17,20 0.00	14	3.20	22.65	261,9 56.00	23.33

华泰 证券	20230 62900 03723 8	金博 股份	2023 年 6 月 29 日	1,059, 828.0 0	6,200. 00	14	1.80	51.45	1,063, 300.0 0	52.99
华泰 证券	20230 62900 03968 9	三峡 能源	2023 年 6 月 29 日	1,510, 581.0 0	281,3 00.00	14	3.20	130.3 6	1,510, 581.0 0	134.2 7
华泰 证券	20230 62900 04094 0	捷佳 伟创	2023 年 6 月 29 日	6,991, 794.0 0	62,60 0.00	14	3.50	659.9 6	7,033, 110.0 0	679.7 6
华泰 证券	20230 62900 04226 3	太阳 能	2023 年 6 月 29 日	6,485, 660.0 0	958,0 00.00	14	3.20	559.7 1	6,495, 240.0 0	576.5 0
华泰 证券	20230 62900 04289 6	奥特 维	2023 年 6 月 29 日	1,549, 636.0 0	8,200. 00	14	1.80	75.23	1,544, 880.0 0	77.48
华泰 证券	20230 63000 01537 7	东方 日升	2023 年 6 月 30 日	1,025, 200.0 0	40,00 0.00	14	3.50	-	1,025, 200.0 0	-
兴业 证券	20230 51500 00262 4	天齐 锂业	2023 年 5 月 15 日	345,1 56.00	4,200. 00	14	3.50	456.1 1	-	-

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:)	出借 期限 (单 位:)	费率	利息 收入	期末 证券 出借 业务 余额	期末 应收 利息 余额
华泰 证券	20220 10400 02099 1	东方 日升	2022 年 1 月 4 日	83,49 6.00	2,800. 00	14	2.00	63.05	-	-
华泰 证券	20220 10400 02099 3	宁德 时代	2022 年 1 月 4 日	5,176, 808.0 0	9,100. 00	14	2.00	3,909. 13	-	-
华泰	20220	中伟	2022	143,5	1,000.	14	2.00	108.4	-	-

证券	10400 02099 5	股份	年 1 月 4 日	60.00	00			1		
华泰 证券	20220 10400 02099 7	亿纬 锂能	2022 年 1 月 4 日	1,996, 566.0 0	17,90 0.00	14	2.00	1,507. 66	-	-
华泰 证券	20220 10400 02099 9	寒锐 钴业	2022 年 1 月 4 日	265,6 08.00	3,400. 00	14	2.00	200.5 7	-	-
华泰 证券	20220 10400 02100 1	当升 科技	2022 年 1 月 4 日	492,8 00.00	5,600. 00	14	2.00	372.1 3	-	-
华泰 证券	20220 10400 02100 3	新宙 邦	2022 年 1 月 4 日	522,6 52.00	4,600. 00	14	2.00	394.6 7	-	-
华泰 证券	20220 10400 02252 9	迈为 股份	2022 年 1 月 4 日	589,9 30.00	1,000. 00	14	2.00	445.4 7	-	-
华泰 证券	20220 10400 02253 1	亿华 通	2022 年 1 月 4 日	262,3 20.00	1,000. 00	14	2.00	198.0 8	-	-
华泰 证券	20220 10400 02253 3	固德 威	2022 年 1 月 4 日	427,7 30.00	1,000. 00	14	2.00	322.9 9	-	-
华泰 证券	20220 10400 02253 5	天奈 科技	2022 年 1 月 4 日	411,1 91.00	2,900. 00	14	2.00	310.5 0	-	-
华泰 证券	20220 10400 02253 7	嘉元 科技	2022 年 1 月 4 日	328,4 84.00	2,600. 00	14	2.00	248.0 5	-	-
华泰 证券	20220 10400 02253 9	金博 股份	2022 年 1 月 4 日	357,9 90.00	1,000. 00	14	2.00	270.3 3	-	-
华泰	20220	容百	2022	519,4	4,300.	14	2.00	392.2	-	-

证券	10400 02254 1	科技	年 1 月 4 日	40.00	00			4		
华泰 证券	20220 10400 02254 3	杭可 科技	2022 年 1 月 4 日	198,8 92.00	1,900. 00	14	2.00	150.1 9	-	-
华泰 证券	20220 10400 02254 5	中信 博	2022 年 1 月 4 日	216,5 15.00	1,300. 00	14	2.00	163.5 0	-	-
华泰 证券	20220 10400 02254 7	天合 光能	2022 年 1 月 4 日	945,5 58.00	13,10 0.00	14	2.00	714.0 1	-	-
华泰 证券	20220 10400 02254 9	阳光 电源	2022 年 1 月 4 日	2,234, 100.0 0	16,50 0.00	14	2.00	1,687. 02	-	-
华泰 证券	20220 10400 02255 1	晶盛 机电	2022 年 1 月 4 日	659,2 26.00	10,20 0.00	14	2.00	497.8 0	-	-
华泰 证券	20220 10400 02255 3	先导 智能	2022 年 1 月 4 日	1,236, 950.0 0	17,30 0.00	14	2.00	934.0 5	-	-
华泰 证券	20220 11200 01548 5	东方 日升	2022 年 1 月 12 日	3,265, 071.0 0	124,1 00.00	14	3.50	4,314. 68	-	-
华泰 证券	20220 11800 00127 9	迈为 股份	2022 年 1 月 18 日	3,885, 048.0 0	7,200. 00	20	3.50	7,334. 23	-	-
华泰 证券	20220 11800 00128 4	晶盛 机电	2022 年 1 月 18 日	874,5 80.00	14,00 0.00	20	3.50	1,651. 04	-	-
华泰 证券	20220 11800 02390 4	嘉元 科技	2022 年 1 月 18 日	350,5 06.00	2,600. 00	20	2.00	378.1 1	-	-
华泰	20220	当升	2022	491,1	5,600.	20	2.00	529.8	-	-

证券	11800 02391 2	科技	年 1 月 18 日	20.00	00			0		
华泰 证券	20220 11800 02391 4	新宙 邦	2022 年 1 月 18 日	461,1 96.00	4,600. 00	20	2.00	497.5 1	-	-
华泰 证券	20220 11800 02391 6	东方 日升	2022 年 1 月 18 日	70,39 2.00	2,800. 00	20	2.00	75.94	-	-
华泰 证券	20220 11800 02391 8	先导 智能	2022 年 1 月 18 日	1,285, 390.0 0	17,30 0.00	20	2.00	1,386. 61	-	-
华泰 证券	20220 11800 02392 0	天合 光能	2022 年 1 月 18 日	881,1 06.00	13,10 0.00	20	2.00	950.4 9	-	-
华泰 证券	20220 11800 02392 2	亿华 通	2022 年 1 月 18 日	243,4 00.00	1,000. 00	20	2.00	262.5 7	-	-
华泰 证券	20220 11800 02392 4	固德 威	2022 年 1 月 18 日	359,4 40.00	1,000. 00	20	2.00	387.7 5	-	-
华泰 证券	20220 11800 02432 6	亿纬 锂能	2022 年 1 月 18 日	1,921, 923.0 0	17,90 0.00	20	2.00	2,073. 27	-	-
华泰 证券	20220 11800 02432 8	阳光 电源	2022 年 1 月 18 日	2,060, 025.0 0	16,50 0.00	20	2.00	2,222. 25	-	-
华泰 证券	20220 11800 02433 0	晶盛 机电	2022 年 1 月 18 日	637,1 94.00	10,20 0.00	20	2.00	687.3 7	-	-
华泰 证券	20220 11800 02433 2	金博 股份	2022 年 1 月 18 日	275,3 60.00	1,000. 00	20	2.00	297.0 4	-	-
华泰	20220	寒锐	2022	263,6	3,400.	20	2.00	284.4	-	-

证券	11800 02433 4	钴业	年 1 月 18 日	36.00	00			0		
华泰 证券	20220 11800 02433 6	天奈 科技	2022 年 1 月 18 日	464,6 67.00	2,900. 00	20	2.00	501.2 6	-	-
华泰 证券	20220 11800 02433 8	中信 博	2022 年 1 月 18 日	165,1 00.00	1,300. 00	20	2.00	178.1 0	-	-
华泰 证券	20220 11800 02471 0	迈为 股份	2022 年 1 月 18 日	539,5 90.00	1,000. 00	20	2.00	582.0 8	-	-
华泰 证券	20220 11800 02471 2	杭可 科技	2022 年 1 月 18 日	179,5 12.00	1,900. 00	20	2.00	193.6 5	-	-
华泰 证券	20220 11800 02471 4	中伟 股份	2022 年 1 月 18 日	150,3 30.00	1,000. 00	20	2.00	162.1 7	-	-
华泰 证券	20220 11800 02471 6	宁德 时代	2022 年 1 月 18 日	5,339, 880.0 0	9,100. 00	20	2.00	5,760. 39	-	-
华泰 证券	20220 11800 02471 8	容百 科技	2022 年 1 月 18 日	566,2 24.00	4,300. 00	20	2.00	610.8 1	-	-
华泰 证券	20220 12500 00084 9	中伟 股份	2022 年 1 月 25 日	217,4 40.00	1,600. 00	14	3.50	287.3 4	-	-
华泰 证券	20220 12600 01193 8	东方 日升	2022 年 1 月 26 日	2,869, 192.0 0	124,1 00.00	14	3.50	3,791. 54	-	-
华泰 证券	20220 20700 04643 7	金博 股份	2022 年 2 月 7 日	276,0 50.00	1,000. 00	14	2.00	208.4 5	-	-
华泰	20220	迈为	2022	511,5	1,000.	14	2.00	386.2	-	-

证券	20700 04643 9	股份	年 2 月 7 日	60.00	00			9		
华泰 证券	20220 20700 04644 1	固德 威	2022 年 2 月 7 日	407,9 90.00	1,000. 00	14	2.00	308.0 8	-	-
华泰 证券	20220 20700 04644 3	当升 科技	2022 年 2 月 7 日	467,0 40.00	5,600. 00	14	2.00	352.6 7	-	-
华泰 证券	20220 20700 04644 5	天合 光能	2022 年 2 月 7 日	880,9 75.00	13,10 0.00	14	2.00	665.2 5	-	-
华泰 证券	20220 20700 04644 7	容百 科技	2022 年 2 月 7 日	560,5 05.00	4,300. 00	14	2.00	423.2 5	-	-
华泰 证券	20220 20700 04644 9	天奈 科技	2022 年 2 月 7 日	422,9 65.00	2,900. 00	14	2.00	319.3 9	-	-
华泰 证券	20220 20700 04645 1	阳光 电源	2022 年 2 月 7 日	1,862, 685.0 0	16,50 0.00	14	2.00	1,406. 56	-	-
华泰 证券	20220 20700 04645 5	迈为 股份	2022 年 2 月 7 日	3,683, 232.0 0	7,200. 00	14	3.50	4,867. 27	-	-
华泰 证券	20220 20700 04871 1	新宙 邦	2022 年 2 月 7 日	436,9 54.00	4,600. 00	14	2.00	329.9 5	-	-
华泰 证券	20220 20700 04871 3	中伟 股份	2022 年 2 月 7 日	123,9 00.00	1,000. 00	14	2.00	93.56	-	-
华泰 证券	20220 20700 04871 5	晶盛 机电	2022 年 2 月 7 日	606,1 86.00	10,20 0.00	14	2.00	457.7 5	-	-
华泰	20220	寒锐	2022	248,4	3,400.	14	2.00	187.5	-	-

证券	20700 04871 7	钴业	年 2 月 7 日	04.00	00			8		
华泰 证券	20220 20700 04871 9	嘉元 科技	2022 年 2 月 7 日	313,7 16.00	2,600. 00	14	2.00	236.8 9	-	-
华泰 证券	20220 20700 04872 1	宁德 时代	2022 年 2 月 7 日	5,272, 904.0 0	9,100. 00	14	2.00	3,981. 70	-	-
华泰 证券	20220 20700 04872 3	中信 博	2022 年 2 月 7 日	161,8 37.00	1,300. 00	14	2.00	122.2 1	-	-
华泰 证券	20220 20700 04872 5	先导 智能	2022 年 2 月 7 日	1,249, 752.0 0	17,30 0.00	14	2.00	943.7 2	-	-
华泰 证券	20220 20900 01642 4	东方 日升	2022 年 2 月 9 日	2,784, 804.0 0	124,1 00.00	14	3.50	3,680. 03	-	-
华泰 证券	20220 22100 04046 3	迈为 股份	2022 年 2 月 21 日	476,5 60.00	1,000. 00	14	2.00	359.8 6	-	-
华泰 证券	20220 22100 04047 1	新宙 邦	2022 年 2 月 21 日	415,1 50.00	4,600. 00	14	2.00	313.4 9	-	-
华泰 证券	20220 22100 04047 9	天奈 科技	2022 年 2 月 21 日	398,9 24.00	2,900. 00	14	2.00	301.2 4	-	-
华泰 证券	20220 22100 04048 9	寒锐 钴业	2022 年 2 月 21 日	257,7 54.00	3,400. 00	14	2.00	194.6 4	-	-
华泰 证券	20220 22100 04686 1	先导 智能	2022 年 2 月 21 日	1,075, 195.0 0	17,30 0.00	14	2.00	811.9 1	-	-
华泰	20220	中伟	2022	123,2	1,000.	14	2.00	93.10	-	-

证券	22100 04686 3	股份	年 2 月 21 日	90.00	00					
华泰 证券	20220 22100 04686 5	宁德 时代	2022 年 2 月 21 日	4,641, 000.0 0	9,100. 00	14	2.00	3,504. 53	-	-
华泰 证券	20220 22100 04686 7	嘉元 科技	2022 年 2 月 21 日	286,0 00.00	2,600. 00	14	2.00	215.9 7	-	-
华泰 证券	20220 22100 04686 9	中信 博	2022 年 2 月 21 日	135,2 00.00	1,300. 00	14	2.00	102.0 9	-	-
华泰 证券	20220 22100 04687 3	金博 股份	2022 年 2 月 21 日	264,4 80.00	1,000. 00	14	2.00	199.7 2	-	-
华泰 证券	20220 22100 04687 5	容百 科技	2022 年 2 月 21 日	568,8 04.00	4,300. 00	14	2.00	429.5 2	-	-
华泰 证券	20220 22100 04687 9	天合 光能	2022 年 2 月 21 日	771,3 28.00	13,10 0.00	14	2.00	582.4 5	-	-
华泰 证券	20220 22100 04688 3	固德 威	2022 年 2 月 21 日	381,3 20.00	1,000. 00	14	2.00	287.9 4	-	-
华泰 证券	20220 22100 04688 9	阳光 电源	2022 年 2 月 21 日	1,749, 825.0 0	16,50 0.00	14	2.00	1,321. 33	-	-
华泰 证券	20220 22100 04689 1	晶盛 机电	2022 年 2 月 21 日	584,5 62.00	10,20 0.00	14	2.00	441.4 2	-	-
华泰 证券	20220 22100 04755 9	迈为 股份	2022 年 2 月 21 日	3,431, 232.0 0	7,200. 00	14	3.50	4,534. 26	-	-
华泰	20220	东方	2022	2,992,	124,1	14	3.50	3,953.	-	-

证券	22300 01166 8	日升	年 2 月 23 日	051.0 0	00.00			90		
华泰 证券	20220 30100 00119 7	东方 日升	2022 年 3 月 1 日	244,4 40.00	9,000. 00	14	3.50	323.0 2	-	-
华泰 证券	20220 30700 03393 2	寒锐 钴业	2022 年 3 月 7 日	255,0 34.00	3,400. 00	14	2.00	192.5 8	-	-
华泰 证券	20220 30700 03393 4	中伟 股份	2022 年 3 月 7 日	116,2 00.00	1,000. 00	14	2.00	87.75	-	-
华泰 证券	20220 30700 03393 6	嘉元 科技	2022 年 3 月 7 日	252,4 60.00	2,600. 00	14	2.00	190.6 4	-	-
华泰 证券	20220 30700 03393 8	固德 威	2022 年 3 月 7 日	435,9 00.00	1,000. 00	14	2.00	329.1 6	-	-
华泰 证券	20220 30700 04512 4	迈为 股份	2022 年 3 月 7 日	3,752, 856.0 0	7,200. 00	14	3.50	4,959. 28	-	-
华泰 证券	20220 30700 04512 6	容百 科技	2022 年 3 月 7 日	544,1 65.00	4,300. 00	14	2.00	410.9 1	-	-
华泰 证券	20220 30700 04512 8	天奈 科技	2022 年 3 月 7 日	391,4 71.00	2,900. 00	14	2.00	295.6 1	-	-
华泰 证券	20220 30700 04513 0	中信 博	2022 年 3 月 7 日	131,5 60.00	1,300. 00	14	2.00	99.34	-	-
华泰 证券	20220 30700 04513 2	阳光 电源	2022 年 3 月 7 日	2,044, 680.0 0	16,50 0.00	14	2.00	1,543. 99	-	-
华泰	20220	天合	2022	958,7	13,10	14	2.00	724.0	-	-

证券	30700 04513 4	光能	年 3 月 7 日	89.00	0.00			0		
华泰 证券	20220 30700 04513 6	新宙 邦	2022 年 3 月 7 日	387,7 34.00	4,600. 00	14	2.00	292.7 9	-	-
华泰 证券	20220 30700 04513 8	晶盛 机电	2022 年 3 月 7 日	619,5 48.00	10,20 0.00	14	2.00	467.8 4	-	-
华泰 证券	20220 30700 04514 0	迈为 股份	2022 年 3 月 7 日	521,2 30.00	1,000. 00	14	2.00	393.5 9	-	-
华泰 证券	20220 30900 00100 2	亿华 通	2022 年 3 月 9 日	235,6 05.00	1,500. 00	14	3.40	302.4 5	-	-
华泰 证券	20220 30900 01653 3	东方 日升	2022 年 3 月 9 日	3,576, 562.0 0	124,1 00.00	14	3.50	4,726. 31	-	-
华泰 证券	20220 31500 01077 5	东方 日升	2022 年 3 月 15 日	249,3 00.00	9,000. 00	14	3.50	329.4 4	-	-
华泰 证券	20220 31600 00147 8	东方 日升	2022 年 3 月 16 日	39,78 8.00	1,400. 00	14	3.50	52.58	-	-
华泰 证券	20220 31800 00088 7	天合 光能	2022 年 3 月 18 日	741,8 52.00	10,80 0.00	28	3.50	1,960. 67	-	-
华泰 证券	20220 32100 02899 9	寒锐 钴业	2022 年 3 月 21 日	228,0 38.00	3,400. 00	16	2.00	196.8 0	-	-
华泰 证券	20220 32100 02900 5	晶盛 机电	2022 年 3 月 21 日	642,8 04.00	10,20 0.00	16	2.00	554.7 4	-	-
华泰	20220	容百	2022	593,6	4,300.	16	2.00	512.2	-	-

证券	32100 02901 9	科技	年 3 月 21 日	15.00	00			9		
华泰 证券	20220 32100 02902 3	天合 光能	2022 年 3 月 21 日	891,4 55.00	13,10 0.00	16	2.00	769.3 2	-	-
华泰 证券	20220 32100 02902 5	天奈 科技	2022 年 3 月 21 日	440,8 00.00	2,900. 00	16	2.00	380.4 1	-	-
华泰 证券	20220 32100 03359 7	中信 博	2022 年 3 月 21 日	117,1 95.00	1,300. 00	16	2.00	101.1 4	-	-
华泰 证券	20220 32100 03377 7	中伟 股份	2022 年 3 月 21 日	132,7 00.00	1,000. 00	16	2.00	114.5 2	-	-
华泰 证券	20220 32100 03393 1	迈为 股份	2022 年 3 月 21 日	4,006, 224.0 0	7,200. 00	16	3.50	6,050. 39	-	-
华泰 证券	20220 32300 01196 3	东方 日升	2022 年 3 月 23 日	3,224, 118.0 0	124,1 00.00	14	3.50	4,260. 57	-	-
华泰 证券	20220 32300 01381 1	亿华 通	2022 年 3 月 23 日	267,0 00.00	1,500. 00	14	3.40	342.7 5	-	-
华泰 证券	20220 32800 00067 5	亿华 通	2022 年 3 月 28 日	642,4 00.00	4,000. 00	14	3.50	848.9 1	-	-
华泰 证券	20220 32900 00575 8	东方 日升	2022 年 3 月 29 日	216,0 00.00	9,000. 00	14	3.50	285.4 4	-	-
华泰 证券	20220 33000 00748 9	东方 日升	2022 年 3 月 30 日	34,72 0.00	1,400. 00	14	3.50	45.88	-	-
华泰	20220	晶盛	2022	581,2	10,20	14	2.00	438.9	-	-

证券	40600 05355 9	机电	年 4 月 6 日	98.00	0.00			5		
华泰 证券	20220 40600 05547 1	亿华 通	2022 年 4 月 6 日	236,7 15.00	1,500. 00	14	3.40	303.8 7	-	-
华泰 证券	20220 40600 05821 1	东方 日升	2022 年 4 月 6 日	2,872, 915.0 0	124,1 00.00	14	3.50	3,796. 46	-	-
华泰 证券	20220 40600 05822 7	迈为 股份	2022 年 4 月 6 日	3,682, 800.0 0	7,200. 00	14	3.50	4,866. 70	-	-
华泰 证券	20220 40600 06032 3	中伟 股份	2022 年 4 月 6 日	115,3 30.00	1,000. 00	14	2.00	87.09	-	-
华泰 证券	20220 40600 06032 7	容百 科技	2022 年 4 月 6 日	533,2 00.00	4,300. 00	14	2.00	402.6 3	-	-
华泰 证券	20220 40600 06655 1	天奈 科技	2022 年 4 月 6 日	396,5 75.00	2,900. 00	14	2.00	299.4 6	-	-
华泰 证券	20220 41100 00639 9	亿华 通	2022 年 4 月 11 日	542,2 40.00	4,000. 00	14	3.50	716.5 5	-	-
华泰 证券	20220 41200 00053 1	晶盛 机电	2022 年 4 月 12 日	838,9 71.00	16,10 0.00	14	3.50	1,108. 67	-	-
华泰 证券	20220 41200 01077 9	东方 日升	2022 年 4 月 12 日	186,3 00.00	9,000. 00	14	3.50	246.1 9	-	-
华泰 证券	20220 41300 00967 8	东方 日升	2022 年 4 月 13 日	27,79 0.00	1,400. 00	14	3.50	36.72	-	-
华泰	20220	天合	2022	520,5	10,80	28	3.50	1,375.	-	-

证券	41500 00478 4	光能	年 4 月 15 日	60.00	0.00			81		
华泰 证券	20220 42000 04537 6	东方 日升	2022 年 4 月 20 日	2,522, 953.0 0	124,1 00.00	15	3.50	3,572. 14	-	-
华泰 证券	20220 42000 04538 2	天奈 科技	2022 年 4 月 20 日	340,7 50.00	2,900. 00	15	2.00	275.6 9	-	-
华泰 证券	20220 42000 04604 2	容百 科技	2022 年 4 月 20 日	427,2 91.00	4,300. 00	15	2.00	345.7 0	-	-
华泰 证券	20220 42000 04896 2	晶盛 机电	2022 年 4 月 20 日	539,5 80.00	10,20 0.00	15	2.00	436.5 5	-	-
华泰 证券	20220 42000 04896 8	迈为 股份	2022 年 4 月 20 日	2,311, 200.0 0	7,200. 00	15	3.50	3,272. 33	-	-
华泰 证券	20220 42000 04897 4	中伟 股份	2022 年 4 月 20 日	86,22 0.00	1,000. 00	15	2.00	69.76	-	-
华泰 证券	20220 42500 00481 7	亿华 通	2022 年 4 月 25 日	406,0 00.00	4,000. 00	14	3.50	536.5 2	-	-
华泰 证券	20220 42600 00693 5	东方 日升	2022 年 4 月 26 日	150,3 00.00	9,000. 00	14	3.50	198.6 2	-	-
华泰 证券	20220 42600 00771 9	晶盛 机电	2022 年 4 月 26 日	708,8 83.00	16,10 0.00	14	3.50	936.7 7	-	-
华泰 证券	20220 42800 00072 6	容百 科技	2022 年 4 月 28 日	3,225, 222.0 0	35,80 0.00	14	3.50	4,262. 02	-	-
华泰	20220	晶盛	2022	523,7	10,20	14	2.00	395.5	-	-

证券	50500 05726 1	机电	年 5 月 5 日	70.00	0.00			1		
华泰 证券	20220 50500 05728 3	东方 日升	2022 年 5 月 5 日	2,690, 488.0 0	124,1 00.00	14	3.50	3,555. 39	-	-
华泰 证券	20220 50500 05729 7	中伟 股份	2022 年 5 月 5 日	82,20 0.00	1,000. 00	14	2.00	62.07	-	-
华泰 证券	20220 50500 07134 5	容百 科技	2022 年 5 月 5 日	387,8 60.00	4,300. 00	14	2.00	292.8 8	-	-
华泰 证券	20220 50500 07135 7	天奈 科技	2022 年 5 月 5 日	330,6 00.00	2,900. 00	14	2.00	249.6 4	-	-
华泰 证券	20220 50900 00175 7	金博 股份	2022 年 5 月 9 日	489,2 36.00	2,200. 00	14	3.50	646.5 1	-	-
华泰 证券	20220 50900 00964 5	亿华 通	2022 年 5 月 9 日	428,4 00.00	4,000. 00	14	3.50	566.1 2	-	-
华泰 证券	20220 51000 01436 5	晶盛 机电	2022 年 5 月 10 日	811,2 79.00	16,10 0.00	14	3.50	1,072. 08	-	-
华泰 证券	20220 51100 00056 0	东方 日升	2022 年 5 月 11 日	156,3 78.00	6,700. 00	14	3.50	206.6 5	-	-
华泰 证券	20220 51200 00905 8	容百 科技	2022 年 5 月 12 日	3,260, 664.0 0	35,80 0.00	14	3.50	4,308. 86	-	-
华泰 证券	20220 51300 00507 0	天合 光能	2022 年 5 月 13 日	603,2 88.00	10,80 0.00	28	3.50	1,594. 45	-	-
华泰	20220	容百	2022	418,0	4,300.	14	2.00	315.7	-	-

证券	51900 04857 3	科技	年 5 月 19 日	89.00	00			1		
华泰 证券	20220 51900 04989 9	晶盛 机电	2022 年 5 月 19 日	573,2 40.00	10,20 0.00	14	2.00	432.8 7	-	-
华泰 证券	20220 51900 04990 7	天奈 科技	2022 年 5 月 19 日	391,1 52.00	2,900. 00	14	2.00	295.3 7	-	-
华泰 证券	20220 51900 05253 3	中伟 股份	2022 年 5 月 19 日	106,8 30.00	1,000. 00	14	2.00	80.67	-	-
华泰 证券	20220 52300 00587 3	亿华 通	2022 年 5 月 23 日	476,8 80.00	4,000. 00	14	3.50	630.1 8	-	-
华泰 证券	20220 52300 00713 7	金博 股份	2022 年 5 月 23 日	533,5 44.00	2,200. 00	14	3.50	705.0 6	-	-
华泰 证券	20220 52500 00669 7	东方 日升	2022 年 5 月 25 日	180,4 98.00	6,700. 00	14	3.50	238.5 2	-	-
华泰 证券	20220 52600 00666 2	容百 科技	2022 年 5 月 26 日	3,199, 088.0 0	35,80 0.00	14	3.50	4,227. 49	-	-
华泰 证券	20220 60800 00083 5	金博 股份	2022 年 6 月 8 日	1,499, 190.0 0	5,500. 00	14	3.50	1,981. 13	-	-
华泰 证券	20220 60800 00083 7	金博 股份	2022 年 6 月 8 日	1,035, 804.0 0	3,800. 00	14	3.50	1,368. 78	-	-
华泰 证券	20220 61000 00366 5	天合 光能	2022 年 6 月 10 日	677,1 60.00	10,80 0.00	28	3.50	1,278. 35	704,7 00.00	1,316. 70
华泰	20220	中伟	2022	181,0	1,400.	14	3.50	222.1	173,4	228.8

证券	61700 00142 3	股份	年 6 月 17 日	62.00	00			8	60.00	4
华泰 证券	20220 62200 01396 7	金博 股份	2022 年 6 月 22 日	1,673, 650.0 0	5,500. 00	14	3.50	1,263. 81	1,620, 850.0 0	1,301. 73
华泰 证券	20220 62200 01396 9	金博 股份	2022 年 6 月 22 日	1,156, 340.0 0	3,800. 00	14	3.50	873.1 8	1,119, 860.0 0	899.3 8
华泰 证券	20220 62300 00127 4	海力 风电	2022 年 6 月 23 日	321,6 33.00	3,900. 00	14	3.50	212.5 1	354,9 00.00	218.8 9
华泰 证券	20220 62300 00127 6	杭可 科技	2022 年 6 月 23 日	113,8 88.00	1,600. 00	14	3.50	75.25	112,0 96.00	77.51
华泰 证券	20220 62400 00110 6	海力 风电	2022 年 6 月 24 日	89,88 0.00	1,000. 00	14	3.50	50.90	91,00 0.00	52.43
华泰 证券	20220 62800 00057 6	迈为 股份	2022 年 6 月 28 日	552,2 00.00	1,100. 00	14	3.10	92.33	539,9 90.00	95.10
华泰 证券	20220 62800 00057 7	亿纬 锂能	2022 年 6 月 28 日	1,815, 342.0 0	17,40 0.00	14	3.10	303.5 4	1,696, 500.0 0	312.6 4
华泰 证券	20220 62800 00057 8	当升 科技	2022 年 6 月 28 日	508,1 40.00	5,400. 00	14	3.10	84.96	487,8 36.00	87.51
华泰 证券	20220 62800 00058 0	新宙 邦	2022 年 6 月 28 日	449,1 20.00	8,000. 00	14	3.10	75.10	420,4 80.00	77.35
华泰 证券	20220 62800 00058 3	东方 日升	2022 年 6 月 28 日	345,0 99.00	11,10 0.00	14	3.10	57.70	325,5 63.00	59.43
华泰	20220	寒锐	2022	199,2	3,300.	14	3.10	33.32	191,1	34.32

证券	62800 00058 4	钴业	年 6 月 28 日	54.00	00				36.00	
华泰 证券	20220 62800 00058 5	阳光 电源	2022 年 6 月 28 日	1,543, 413.0 0	15,90 0.00	14	3.10	258.0 7	1,562, 175.0 0	265.8 1
华泰 证券	20220 62800 00058 6	晶盛 机电	2022 年 6 月 28 日	681,1 20.00	9,900. 00	14	3.10	113.8 9	669,1 41.00	117.3 0
华泰 证券	20220 62800 00058 7	中伟 股份	2022 年 6 月 28 日	356,1 60.00	2,800. 00	14	3.10	59.55	346,9 20.00	61.34
华泰 证券	20220 62800 00059 0	海力 风电	2022 年 6 月 28 日	92,75 0.00	1,000. 00	14	3.10	15.51	91,00 0.00	15.97
华泰 证券	20220 62800 00059 6	先导 智能	2022 年 6 月 28 日	1,139, 880.0 0	16,80 0.00	14	3.10	190.5 9	1,061, 424.0 0	196.3 1
华泰 证券	20220 62800 00059 8	海优 新材	2022 年 6 月 28 日	206,4 60.00	1,000. 00	14	3.10	34.52	198,7 00.00	35.56
华泰 证券	20220 62800 00060 0	容百 科技	2022 年 6 月 28 日	552,0 65.00	4,100. 00	14	3.10	92.31	530,7 04.00	95.08
华泰 证券	20220 62800 00060 2	杭可 科技	2022 年 6 月 28 日	139,5 93.00	1,900. 00	14	3.10	23.34	133,1 14.00	24.04
华泰 证券	20220 62800 00060 4	派能 科技	2022 年 6 月 28 日	349,3 80.00	1,200. 00	14	3.10	58.42	374,6 40.00	60.17
华泰 证券	20220 62800 00060 6	金博 股份	2022 年 6 月 28 日	305,0 00.00	1,000. 00	14	3.10	51.00	294,7 00.00	52.53
华泰	20220	天合	2022	1,143,	16,60	14	3.10	191.2	1,083,	196.9

证券	62800 00060 8	光能	年 6 月 28 日	740.0 0	0.00			4	150.0 0	8
华泰 证券	20220 62800 00061 0	嘉元 科技	2022 年 6 月 28 日	224,9 50.00	2,500. 00	14	3.10	37.61	212,1 75.00	38.74
华泰 证券	20220 62800 00061 2	固德 威	2022 年 6 月 28 日	278,7 30.00	1,000. 00	14	3.10	46.61	313,0 10.00	48.00
华泰 证券	20220 62800 00061 4	中信 博	2022 年 6 月 28 日	116,1 60.00	1,200. 00	14	3.10	19.42	110,9 76.00	20.01
华泰 证券	20220 62800 00061 6	天奈 科技	2022 年 6 月 28 日	506,1 00.00	2,800. 00	14	3.10	84.62	474,5 44.00	87.16
华泰 证券	20220 62800 00061 8	奥特 维	2022 年 6 月 28 日	273,7 00.00	1,000. 00	14	3.10	45.76	266,9 50.00	47.14
华泰 证券	20220 62900 00198 2	东方 日升	2022 年 6 月 29 日	94,84 2.00	3,300. 00	14	3.50	8.95	96,78 9.00	9.22
华泰 证券	20220 62900 00198 6	奥特 维	2022 年 6 月 29 日	668,0 70.00	2,600. 00	14	3.50	63.06	694,0 70.00	64.95

6.4.6.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.6.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.6.5.2 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
华泰长城资本管理有限	2,040,500.00	0.03%	-	-

公司				
华泰证券股份有限公司	882,700.00	0.01%	2,631,000.00	0.09%
南方中证新能源交易型 开放式指数证券投资基 金联接基金	928,833,249.0 0	12.66%	312,965,924.0 0	10.95%
兴业证券股份有限公司	3,886,700.00	0.05%	-	-
-	-	-	-	-

注：南方中证新能源 ETF 联接基金、华泰证券投资本基金适用的认（申）购/赎回费率按照本基金招募说明书的规定执行。

6.4.6.6 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	21,887,634.63	77,179.83	8,216,352.62	36,404.61

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管，按银行约定利率计息。

6.4.6.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

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	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	118031	天 23 转债	配债	36,570	3,657,000.00
华泰联合	688472	阿特斯	网下申购	62,602	694,882.20
华泰联合	688512	慧智微	网下申购	7,209	150,812.28
华泰联合	688429	时创能源	网下申购	3,452	66,278.40
华泰联合	600925	苏能股份	网下申购	8,960	55,372.80
华泰联合	603291	联合水务	网下申购	536	3,140.96
兴业证券	301322	绿通科技	网下申购	2,604	341,410.44
兴业证券	301315	威士顿	网下申购	2,253	72,749.37
兴业证券,华泰联合	688469	中芯集成	网下申购	137,994	785,185.86

上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
华泰联合	110085	通 22 转债	配债	56,060	5,606,000.00
华泰联合	301153	中科江南	网下申购	3,973	133,810.64

6.4.6.8 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.7 利润分配情况

6.4.7.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.8 期末（2023 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.8.1 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

6.4.8.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
301486	致尚科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
688249	晶合集成	2023 年 4 月 24 日	6 个月	新股锁定期	19.86	18.06	7,405	147,063.30	133,734.30	-
688472	阿特斯	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁定期	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	1 个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	2,356	93,721.68	93,721.68	-
301488	豪恩汽电	2023 年 6 月 26 日	6 个月	新股锁定期	39.78	39.78	262	10,422.36	10,422.36	-
688443	智翔金泰	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁定期	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	1 个月内（含）	新股未上市	25.82	25.82	2,754	71,108.28	71,108.28	-
301202	朗威股份	2023 年 6 月 28 日	6 个月	新股锁定期	25.82	25.82	306	7,900.92	7,900.92	-
688603	天承科技	2023 年 6 月 30 日	1 个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688469	中芯集成	2023 年 4 月	6 个月	新股锁定期	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-

		28 日								
301260	格力博	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
301261	恒工精密	2023 年 6 月 29 日	1 个月 内 (含)	新股未 上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688361	中科飞测	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023 年 3 月 24 日	6 个月	新股锁 定期	152.3 8	135.9 7	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	76.80	107.9 5	364	27,955.20	39,293.80	-
001286	陕西能源	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
601061	中信金属	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
001287	中电港	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023 年 5 月 30 日	6 个月	新股锁 定期	135.8 0	120.4 1	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
688507	索辰科技	2023 年 4 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	245.5 6	122.1 1	150	36,834.00	18,316.50	-
688507	索辰科技	2023 年 6 月 20 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	122.1 1	72	-	8,791.92	-
688582	芯动联科	2023 年 6 月 21 日	6 个月	新股锁 定期	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023 年 4 月 25 日	6 个月	新股锁 定期	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
688570	天玛智控	2023	6 个月	新股锁	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-

		年 5 月 29 日		定期						
688543	国科军工	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023 年 2 月 27 日	6 个月	新股锁 定期	131.1 1	53.24	261	34,219.71	13,895.64	-
301322	绿通科技	2023 年 5 月 25 日	1-6 个 月 (含)	锁定期 转增	-	53.24	130	-	6,921.20	-
688458	美芯晟	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
301317	鑫磊股份	2023 年 1 月 12 日	6 个月	新股锁 定期	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
688562	航天软件	2023 年 5 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
301439	泓淋电力	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-
688623	双元科技	2023 年 5 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	125.8 8	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-
688334	西高院	2023 年 6 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688512	慧智微	2023 年 5 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023 年 5 月 9 日	6 个月	新股锁 定期	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023 年 6 月 1 日	6 个月	新股锁 定期	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023 年 4 月 7 日	6 个月	新股锁 定期	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-
688629	华丰科技	2023 年 6 月 16 日	6 个月	新股锁 定期	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-

688620	安凯微	2023 年 6 月 15 日	6 个月	新股锁 定期	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301345	涛涛车业	2023 年 3 月 10 日	6 个月	新股锁 定期	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023 年 6 月 13 日	6 个月	新股锁 定期	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688631	莱斯信息	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁 定期	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023 年 5 月 4 日	6 个月	新股锁 定期	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023 年 6 月 8 日	6 个月	新股锁 定期	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
601065	江盐集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁 定期	10.36	11.84	802	8,308.72	9,495.68	-
301376	致欧科技	2023 年 6 月 14 日	6 个月	新股锁 定期	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023 年 6 月 2 日	6 个月	新股锁 定期	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023 年 4 月 11 日	6 个月	新股锁 定期	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301323	新莱福	2023 年 5 月 29 日	6 个月	新股锁 定期	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	时创能源	2023 年 6 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023 年 1 月 20 日	6 个月	新股锁 定期	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
688535	华海诚科	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁 定期	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023 年 3 月	6 个月	新股锁 定期	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-

		31 日								
301157	华塑科技	2023 年 3 月 1 日	6 个月	新股锁定期	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	美硕科技	2023 年 6 月 19 日	6 个月	新股锁定期	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
301203	国泰环保	2023 年 3 月 28 日	6 个月	新股锁定期	46.13	34.40	225	10,379.25	7,740.00	-
301337	亚华电子	2023 年 5 月 16 日	6 个月	新股锁定期	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
301428	世纪恒通	2023 年 5 月 10 日	6 个月	新股锁定期	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-
603125	常青科技	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-
001328	登康口腔	2023 年 3 月 29 日	6 个月	新股锁定期	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-
001360	南矿集团	2023 年 3 月 31 日	6 个月	新股锁定期	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-
001324	长青科技	2023 年 5 月 12 日	6 个月	新股锁定期	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-
001367	海森药业	2023 年 3 月 30 日	6 个月	新股锁定期	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
603172	万丰股份	2023 年 4 月 28 日	6 个月	新股锁定期	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

6.4.8.1.2 受限证券类别：债券

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

6.4.8.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

6.4.8.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.8.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.8.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.8.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量(单位: 股)	期末估值 总额
1	002459	晶澳科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	41.70	966,000.00	40,282,200.00
2	002812	恩捷股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	96.35	293,500.00	28,278,725.00
3	603799	华友钴业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	45.91	544,900.00	25,016,359.00
4	600732	爱旭股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.75	608,300.00	18,705,225.00
5	600905	三峡能源	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	5.37	2,960,700.00	15,898,959.00
6	300390	天华新能	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	35.80	366,900.00	13,135,020.00
7	300450	先导智能	2023 年 7 月 4 日	36.17	340,000.00	12,297,800.00
8	601865	福莱特	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	38.51	311,500.00	11,995,865.00
9	002850	科达利	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	132.25	83,000.00	10,976,750.00

10	688005	容百科技	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	54.02	185,800.00	10,036,916.00
11	688390	固德威	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	166.86	58,600.00	9,777,996.00
12	300118	东方日升	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	25.63	376,300.00	9,644,569.00
13	688063	派能科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	198.25	46,200.00	9,159,150.00
14	300438	鹏辉能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	48.04	187,700.00	9,017,108.00
15	603185	弘元绿能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	74.55	120,000.00	8,946,000.00
16	300724	捷佳伟创	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	112.35	75,100.00	8,437,485.00
17	000591	太阳能	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 13 日	6.78	1,203,300.00	8,158,374.00
18	300763	锦浪科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	104.10	66,000.00	6,870,600.00
19	688567	孚能科技	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	21.59	300,600.00	6,489,954.00
20	003035	南网能源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	7.12	856,800.00	6,100,416.00

21	002487	大金重工	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	30.84	183,800.00	5,668,392.00
22	300568	星源材质	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	17.19	322,300.00	5,540,337.00
23	688032	禾迈股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 11 日	355.15	15,200.00	5,398,280.00
24	688303	大全能源	2023 年 7 月 13 日 -2023 年 7 月 25 日	40.45	115,900.00	4,688,155.00
25	688707	振华新材	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 14 日	30.79	149,400.00	4,600,026.00
26	600438	通威股份	2023 年 7 月 10 日 -2023 年 7 月 13 日	34.31	133,500.00	4,580,385.00
27	688598	金博股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	171.50	25,300.00	4,338,950.00
28	002192	融捷股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	66.83	59,500.00	3,976,385.00
29	000537	广宇发展	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	11.67	337,500.00	3,938,625.00
30	002466	天齐锂业	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 28 日	69.91	46,600.00	3,257,806.00
31	600416	湘电股份	2023 年 7 月 11 日 -2023 年 7 月 12 日	19.09	158,400.00	3,023,856.00

32	300014	亿纬锂能	2023 年 7 月 10 日	60.50	48,900.00	2,958,450.00
33	688779	长远锂科	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 10 日	11.27	241,800.00	2,725,086.00
34	300850	新强联	2023 年 7 月 11 日	37.38	71,900.00	2,687,622.00
35	000762	西藏矿业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	29.63	86,100.00	2,551,143.00
36	300751	迈为股份	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	169.38	14,700.00	2,489,886.00
37	002756	永兴材料	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	62.61	39,500.00	2,473,095.00
38	601016	节能风电	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	3.67	637,800.00	2,340,726.00
39	300776	帝尔激光	2023 年 7 月 14 日	64.90	36,000.00	2,336,400.00
40	300769	德方纳米	2023 年 7 月 7 日 -2023 年 7 月 14 日	110.23	18,900.00	2,083,347.00
41	001289	龙源电力	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 27 日	22.50	89,600.00	2,016,000.00
42	002080	中材科技	2023 年 7 月 3 日	20.52	96,300.00	1,976,076.00
43	300274	阳光电源	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 28 日	116.63	16,500.00	1,924,395.00
44	688516	奥特维	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 13 日	188.40	10,200.00	1,921,680.00

45	002497	雅化集团	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 14 日	17.78	96,900.00	1,722,882.00
46	002531	天顺风能	2023 年 7 月 13 日	15.23	107,800.00	1,641,794.00
47	688778	厦钨新能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 25 日	49.50	29,400.00	1,455,300.00
48	688599	天合光能	2023 年 7 月 5 日 -2023 年 7 月 25 日	42.61	32,700.00	1,393,347.00
49	000155	川能动力	2023 年 7 月 14 日	14.40	74,400.00	1,071,360.00
50	600032	浙江新能	2023 年 7 月 5 日	12.56	83,800.00	1,052,528.00
51	600089	特变电工	2023 年 7 月 12 日	22.29	45,800.00	1,020,882.00
52	002460	赣锋锂业	2023 年 7 月 10 日	60.96	16,000.00	975,360.00
53	600549	厦门钨业	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 10 日	19.03	42,100.00	801,163.00
54	300037	新宙邦	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	51.89	14,100.00	731,649.00
55	300073	当升科技	2023 年 7 月 4 日	50.33	14,500.00	729,785.00
56	601877	正泰电器	2023 年 7 月 28 日	27.65	25,700.00	710,605.00
57	002738	中矿资源	2023 年 7 月 12 日	50.94	11,900.00	606,186.00
58	600481	双良节能	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 13 日	13.98	31,200.00	436,176.00
59	688116	天奈科技	2023 年 7 月 4 日 -2023 年 7 月 14 日	45.75	9,300.00	425,475.00

60	000009	中国宝安	2023 年 7 月 3 日 -2023 年 7 月 4 日	12.07	33,800.00	407,966.00
61	002240	盛新锂能	2023 年 7 月 13 日	31.87	9,800.00	312,326.00
62	003816	中国广核	2023 年 7 月 5 日	3.11	79,400.00	246,934.00
63	002056	横店东磁	2023 年 7 月 4 日	18.21	10,000.00	182,100.00
64	002202	金风科技	2023 年 7 月 4 日	10.62	14,500.00	153,990.00
合计	-	-	-	-	13,689,900.00	364,798,382.00

6.4.9 金融工具风险及管理

6.4.9.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式指数基金，紧密跟踪中证新能源指数，具有与标的指数以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征，属于证券投资基金中风险较高、收益较高的品种。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪中证新能源指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但在因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以风险控制委员会为核心的、由督察长、风险控制委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的四级风险管理架构体系。本基金的基金管理人在董事会下设立合规与风险管理委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部和风险管理部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估，督察长负责组织指导监察稽核工作。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的

限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.9.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险。信用等级评估以内部信用评级为主，外部信用评级为辅。内部债券信用评级主要考察发行人的经营风险、财务风险和流动性风险，以及信用产品的条款和担保人的情况等。此外，本基金的基金管理人根据信用产品的内部评级，通过单只信用产品投资占基金资产净值的比例及占发行量的比例进行控制，通过分散化投资以分散信用风险。

6.4.9.3 流动性风险

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

本基金将根据风险管理的原则，以套期保值为目的投资股指期货，以对冲系统性风险和某些特殊情况下的流动性风险等，主要采用流动性好、交易活跃的股指期货合约，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金力争利用股指期货的杠杆作用，降低股票仓位频繁调整的交易成本和跟踪误差，达到有效跟踪标的指数的目的。

6.4.9.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限

制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注“期末本基金持有的流通受限证券”。此外，如根据基金合同的规定，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

同时，基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度，按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度，根据质押品的资质确定质押率水平，持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额，并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.9.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.9.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金和存出保证金等。

6.4.9.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	21,887,634.63	-	-	-	21,887,634.63
结算备付金	20,937,949.2	-	-	-	20,937,949.2

	5				5
存出保证金	1,831,677.58	-	-	3,162,144.00	4,993,821.58
交易性金融资产	-	-	-	6,414,450,201.99	6,414,450,201.99
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	5,239,763.69	5,239,763.69
应收股利	-	-	-	364,124.80	364,124.80
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	143,373.25	143,373.25
资产总计	44,657,261.46	-	-	6,423,359,607.73	6,468,016,869.19
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	1,864,003.58	1,864,003.58
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	756,931.71	756,931.71
应付托管费	-	-	-	252,310.57	252,310.57
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	25,699.46	25,699.46
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	21,621,814.2	21,621,814.2

				1	1
负债总计	-	-	-	24,520,759.53	24,520,759.53
利率敏感度缺口	44,657,261.46	-	-	6,398,838.84	6,443,496.10
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	5,308,913.46	-	-	-	5,308,913.46
结算备付金	8,594,947.40	-	-	-	8,594,947.40
存出保证金	727,327.59	-	-	1,973,798.40	2,701,125.99
交易性金融资产	-	-	-	2,805,929.18	2,805,929.18
				7.24	7.24
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
其他债权投资	-	-	-	-	-
其他权益工具投资	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	573,475.94	573,475.94
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
递延所得税资产	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	181,520.39	181,520.39
资产总计	14,631,188.45	-	-	2,808,657.98	2,823,289.17
				1.97	0.42
负债					
短期借款	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-
衍生金融负债	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付清算款	-	-	-	65,643.90	65,643.90
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	367,096.22	367,096.22

应付托管费	-	-	-	122,365.38	122,365.38
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	15,346.93	15,346.93
应付利润	-	-	-	-	-
递延所得税负债	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	3,868,412.79	3,868,412.79
负债总计	-	-	-	4,438,865.22	4,438,865.22
利率敏感度缺口	14,631,188.45	-	-	2,804,219.116.75	2,818,850.305.20

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.9.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率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）
	1. 市场利率平行上升 25 个基点	0.00	0.00
	2. 市场利率平行下降 25 个基点	0.00	0.00

6.4.9.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.9.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市交易的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法，跟踪中证新能源指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，本基金投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于基金资产净值的 90%，且不低于非现金基金资产的 80%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.9.4.3.1 其他价格风险敞口

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	6,414,450,201.99	99.55	2,805,929,187.24	99.54
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产-贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	6,414,450,201.99	99.55	2,805,929,187.24	99.54

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资。在当日无负债结算制度下，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。

6.4.9.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准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）
	1.组合自身基准上升 5%	320,000,135.00	139,958,195.72
	2.组合自身基准下降 5%	-320,000,135.00	-139,958,195.72

6.4.10 公允价值

6.4.10.1 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。

6.4.10.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.10.2.1 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	6,412,559,089.16

第二层次	610,383.14
第三层次	1,280,729.69
合计	6,414,450,201.99

6.4.10.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.10.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 06 月 30 日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

6.4.10.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.11 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	6,414,450,201.99	99.17
	其中：股票	6,414,450,201.99	99.17
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	42,825,583.88	0.66
8	其他资产	10,741,083.32	0.17
9	合计	6,468,016,869.19	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下表中的合计项中不含可退替代款估值增值；

2、通过转融通证券出借业务出借的证券公允价值为 364,798,382.00 元，占基金资产净值的比例为 5.66%。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	61,862,587.00	0.96
C	制造业	5,738,657,995.00	89.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	512,507,168.08	7.95
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	15,374,058.00	0.24
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	25,436,200.00	0.39
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	58,721,081.08	0.91
	合计	6,412,559,089.16	99.52

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,630,440.62	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00

E	建筑业	8,140.64	0.00
F	批发和零售业	69,029.20	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	102,137.56	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	7,740.00	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,891,112.83	0.03

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

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

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

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	2,821,711	645,579,259.69	10.02
2	601012	隆基绿能	14,297,877	409,920,133.59	6.36
3	300274	阳光电源	2,451,300	285,895,119.00	4.44
4	002129	TCL 中环	7,619,756	252,975,899.20	3.93
5	600438	通威股份	6,367,600	218,472,356.00	3.39
6	600089	特变电工	9,166,487	204,320,995.23	3.17
7	600905	三峡能源	33,738,584	181,176,196.08	2.81
8	300014	亿纬锂能	2,894,057	175,090,448.50	2.72
9	002466	天齐锂业	2,437,900	170,433,589.00	2.65
10	002459	晶澳科技	3,889,828	162,205,827.60	2.52
11	002460	赣锋锂业	2,660,767	162,200,356.32	2.52
12	601985	中国核电	22,241,312	156,801,249.60	2.43
13	603799	华友钴业	3,016,411	138,483,429.01	2.15
14	002812	恩捷股份	1,383,300	133,280,955.00	2.07
15	002709	天赐材料	2,723,645	112,186,937.55	1.74
16	300316	晶盛机电	1,542,884	109,390,475.60	1.70

17	688599	天合光能	2,561,958	109,165,030.38	1.69
18	300450	先导智能	2,585,001	93,499,486.17	1.45
19	603659	璞泰来	2,376,969	90,847,755.18	1.41
20	002340	格林美	12,108,800	83,671,808.00	1.30
21	600732	爱旭股份	2,583,701	79,448,805.75	1.23
22	300724	捷佳伟创	656,849	73,796,985.15	1.15
23	601877	正泰电器	2,534,139	70,068,943.35	1.09
24	002074	国轩高科	2,516,635	69,509,458.70	1.08
25	002202	金风科技	6,510,519	69,141,711.78	1.07
26	002738	中矿资源	1,345,268	68,527,951.92	1.06
27	688223	晶科能源	4,714,596	66,287,219.76	1.03
28	603806	福斯特	1,757,674	65,367,896.06	1.01
29	300037	新宙邦	1,230,655	63,858,687.95	0.99
30	601615	明阳智能	3,748,981	63,282,799.28	0.98
31	688303	大全能源	1,511,640	61,145,838.00	0.95
32	000009	中国宝安	4,865,044	58,721,081.08	0.91
33	300769	德方纳米	523,900	57,749,497.00	0.90
34	003816	中国广核	18,549,100	57,687,701.00	0.90
35	300751	迈为股份	328,287	55,605,252.06	0.86
36	300568	星源材质	3,022,105	51,949,984.95	0.81
37	300390	天华新能	1,382,300	49,486,340.00	0.77
38	600875	东方电气	2,620,100	48,864,865.00	0.76
39	300763	锦浪科技	467,665	48,683,926.50	0.76
40	002497	雅化集团	2,717,500	48,317,150.00	0.75
41	300073	当升科技	955,369	48,083,721.77	0.75
42	002240	盛新锂能	1,505,100	47,967,537.00	0.74
43	002756	永兴材料	762,593	47,745,947.73	0.74
44	601865	福莱特	1,199,847	46,206,107.97	0.72
45	002850	科达利	331,662	43,862,299.50	0.68
46	000591	太阳能	6,452,200	43,745,916.00	0.68
47	688567	孚能科技	2,009,377	43,382,449.43	0.67
48	300118	东方日升	1,612,814	41,336,422.82	0.64
49	688063	派能科技	207,134	41,064,315.50	0.64
50	688390	固德威	244,107	40,731,694.02	0.63
51	600884	杉杉股份	2,668,363	40,399,015.82	0.63
52	688005	容百科技	744,090	40,195,741.80	0.62
53	600549	厦门钨业	2,006,300	38,179,889.00	0.59
54	300919	中伟股份	632,600	38,114,150.00	0.59
55	688598	金博股份	221,902	38,056,193.00	0.59
56	600481	双良节能	2,645,700	36,986,886.00	0.57
57	300438	鹏辉能源	761,287	36,572,227.48	0.57
58	603185	弘元绿能	484,180	36,095,619.00	0.56
59	002056	横店东磁	1,917,700	34,921,317.00	0.54

60	688516	奥特维	182,603	34,402,405.20	0.53
61	601016	节能风电	9,158,020	33,609,933.40	0.52
62	002192	融捷股份	489,800	32,733,334.00	0.51
63	002080	中材科技	1,582,759	32,478,214.68	0.50
64	002531	天顺风能	2,125,100	32,365,273.00	0.50
65	600416	湘电股份	1,562,300	29,824,307.00	0.46
66	000762	西藏矿业	983,100	29,129,253.00	0.45
67	688032	禾迈股份	78,530	27,889,929.50	0.43
68	688779	长远锂科	2,273,817	25,625,917.59	0.40
69	003035	南网能源	3,572,500	25,436,200.00	0.39
70	688116	天奈科技	547,870	25,065,052.50	0.39
71	000155	川能动力	1,739,900	25,054,560.00	0.39
72	002487	大金重工	751,799	23,185,481.16	0.36
73	002518	科士达	549,300	21,977,493.00	0.34
74	300776	帝尔激光	321,888	20,890,531.20	0.32
75	688778	厦钨新能	396,406	19,622,097.00	0.30
76	688707	振华新材	626,276	19,283,038.04	0.30
77	300850	新强联	466,387	17,433,546.06	0.27
78	000537	广宇发展	1,317,400	15,374,058.00	0.24
79	001289	龙源电力	356,600	8,023,500.00	0.12
80	600032	浙江新能	510,200	6,408,112.00	0.10

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
2	688249	晶合集成	7,405	133,734.30	0.00
3	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
5	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
6	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
8	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
9	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
10	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
11	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
12	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
13	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
14	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
15	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
16	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
17	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00

18	688352	顾中科技	2,361	28,497.27	0.00
19	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
20	688582	芯动联科	648	26,360.64	0.00
21	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
22	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
23	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
24	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
25	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
26	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
27	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
28	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
29	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
30	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
31	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
32	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
33	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
34	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
35	688629	华丰科技	708	13,161.72	0.00
36	688620	安凯微	1,016	12,537.44	0.00
37	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
38	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
39	688631	莱斯信息	336	10,036.32	0.00
40	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
41	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
42	601065	江盐集团	802	9,495.68	0.00
43	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
44	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
45	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
46	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
47	688429	时创能源	346	8,833.38	0.00
48	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
49	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
50	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
51	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
52	301295	美硕科技	215	7,755.05	0.00
53	301203	国泰环保	225	7,740.00	0.00
54	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
55	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
56	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
57	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
58	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
59	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
60	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00

61	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
----	--------	------	-----	----------	------

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	300750	宁德时代	818,458,951.15	29.04
2	300274	阳光电源	334,262,857.09	11.86
3	002129	TCL 中环	309,338,128.79	10.97
4	300014	亿纬锂能	238,802,373.13	8.47
5	002466	天齐锂业	222,451,802.49	7.89
6	002460	赣锋锂业	207,894,230.68	7.38
7	600089	特变电工	200,544,538.48	7.11
8	002812	恩捷股份	183,420,028.26	6.51
9	002459	晶澳科技	163,584,184.13	5.80
10	002709	天赐材料	133,428,320.59	4.73
11	300450	先导智能	117,438,995.37	4.17
12	300316	晶盛机电	117,170,238.65	4.16
13	300724	捷佳伟创	112,414,618.36	3.99
14	002340	格林美	100,911,532.65	3.58
15	300769	德方纳米	100,339,301.18	3.56
16	002074	国轩高科	87,144,754.25	3.09
17	002202	金风科技	85,012,040.66	3.02
18	002738	中矿资源	84,645,137.83	3.00
19	300751	迈为股份	78,563,309.73	2.79
20	300037	新宙邦	77,555,393.39	2.75
21	002850	科达利	69,785,648.54	2.48
22	300763	锦浪科技	68,744,862.83	2.44
23	000009	中国宝安	64,753,004.56	2.30
24	600905	三峡能源	64,397,356.60	2.28
25	003816	中国广核	64,038,912.00	2.27
26	300073	当升科技	60,302,771.18	2.14
27	688223	晶科能源	59,521,599.48	2.11
28	300390	天华新能	58,505,611.51	2.08
29	300438	鹏辉能源	57,942,926.29	2.06
30	002240	盛新锂能	57,844,229.32	2.05
31	300568	星源材质	57,236,803.69	2.03

注：买入包括二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，买入金额按成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	481,518,194.37	17.08
2	300274	阳光电源	181,989,215.65	6.46
3	002129	TCL 中环	147,852,954.59	5.25
4	300014	亿纬锂能	122,128,095.90	4.33
5	002466	天齐锂业	110,161,849.65	3.91
6	002460	赣锋锂业	102,473,058.11	3.64
7	002812	恩捷股份	86,894,944.25	3.08
8	300724	捷佳伟创	68,006,334.21	2.41
9	002709	天赐材料	65,675,647.69	2.33
10	002459	晶澳科技	61,628,509.87	2.19
11	300769	德方纳米	59,297,700.34	2.10
12	300450	先导智能	56,664,763.71	2.01
13	300316	晶盛机电	55,605,711.34	1.97
14	002340	格林美	48,508,115.37	1.72
15	002074	国轩高科	44,637,143.55	1.58
16	002850	科达利	44,108,361.80	1.56
17	002202	金风科技	42,822,382.57	1.52
18	601012	隆基绿能	42,520,199.00	1.51
19	002506	协鑫集成	42,088,811.00	1.49
20	300037	新宙邦	41,457,404.65	1.47

注：卖出包括二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票，卖出金额按成交金额（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	5,564,261,231.26
卖出股票收入（成交）总额	2,862,733,841.06

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

无。

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

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 声明本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。如是，还应对相关证券的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中，江西赣锋锂业集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到中国证券监督管理委员会江西监管局的处罚。除上述证券的发行主体外，本基金投资的前十名证券的发行主体本期未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2 声明基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库。如是，还应对相关股票的投资决策程序做出说明

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

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（元）
1	存出保证金	4,993,821.58
2	应收清算款	5,239,763.69
3	应收股利	364,124.80
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	143,373.25
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,741,083.32

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债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	002459	晶澳科技	40,282,200.00	0.63	转融通融出
2	600905	三峡能源	15,898,959.00	0.25	转融通融出
3	600438	通威股份	4,580,385.00	0.07	转融通融出
4	002466	天齐锂业	3,257,806.00	0.05	转融通融出
5	300014	亿纬锂能	2,958,450.00	0.05	转融通融出
6	300274	阳光电源	1,924,395.00	0.03	转融通融出
7	600089	特变电工	1,020,882.00	0.02	转融通融出

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.00	新股未上市
2	688249	晶合集成	133,734.30	0.00	新股锁定期
3	688472	阿特斯	106,687.44	0.00	新股锁定期
4	301488	豪恩汽电	93,721.68	0.00	新股未上市
5	301488	豪恩汽电	10,422.36	0.00	新股锁定期

6	688443	智翔金泰	89,443.17	0.00	新股锁定期
---	--------	------	-----------	------	-------

§ 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		南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
137,414	53,391.97	1,478,872,067.00	20.16%	4,929,098,684.00	67.18%	928,833,249.00	12.66%

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	中国银河证券股份有限公司	101,082,300.00	1.38%
2	招商信诺人寿保险有限公司-传统	100,104,900.00	1.36%
3	安信证券股份有限公司	78,637,600.00	1.07%
4	北京诚通金控投资有限公司	50,321,300.00	0.69%
5	百年人寿保险股份有限公司-传统保险产品	50,000,000.00	0.68%
6	中国农业银行福利负债基金-农行	48,693,500.00	0.66%
7	东兴证券股份有限公司	45,920,000.00	0.63%
8	中金公司-建设银行-中金铭杉1号集合资产管理计划	38,159,100.00	0.52%
9	中国国际金融股份有限公司	36,589,856.00	0.50%
10	中信建投证券股份有限公司	34,290,237.00	0.47%
11	中国农业银行股份有限公司-南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金联接基金	928,833,249.00	12.66%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

本公司的所有从业人员(包含高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理)均未持有本基金份额。

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情况

本公司的高级管理人员、基金投资和研究部门负责人和本基金基金经理均未持有本基金份额。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021 年 1 月 22 日)基金份额总额	2,038,804,000.00
本报告期期初基金份额总额	2,859,304,000.00
本报告期基金总申购份额	7,653,000,000.00
减：报告期基金总赎回份额	3,175,500,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	7,336,804,000.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期末召开基金份额持有人大会。

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，本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，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

本报告期内，无涉及基金管理人主营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

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

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
银河证券	2	6,200,556,692.26	73.70%	620,094.34	73.70%	-
平安证券	2	1,887,948,087.61	22.44%	188,804.65	22.44%	-
华泰证券	3	200,033,026.07	2.38%	20,003.95	2.38%	-
申万宏源	2	90,002,151.11	1.07%	9,000.99	1.07%	-
东北证券	2	34,887,464.89	0.41%	3,488.72	0.41%	-
国泰君安	1	-	-	-	-	-
招商证券	1	-	-	-	-	-

注：交易单元的选择标准和程序根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字[2007]48号）的有关规定，我公司制定了租用证券公司交易单元的选择标准和程序：

A：选择标准

- 1、公司经营行为规范，财务状况和经营状况良好；
- 2、公司具有较强的研究能力，能及时、全面地为基金提供高质量的宏观经济研究、行业研究及市场走向、个股分析报告和专门研究报告；
- 3、公司内部管理规范，能满足基金操作的保密要求；
- 4、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯服务。

B：选择流程 公司研究部门定期对券商服务质量从以下几方面进行量化评比，并根据评比的结果选择席位：

- 1、服务的主动性。主要针对证券公司承接调研课题的态度、协助安排上市公司调研、以及就有关专题提供研究报告和讲座；
- 2、研究报告的质量。主要是指证券公司所提供研究报告是否详实，投资建议是否准确；
- 3、资讯提供的及时性及便利性。主要是指证券公司提供资讯的时效性、及时性以及提供资讯的渠道是否便利、提供的资讯是否充足全面。

C：报告期内基金租用券商交易单元的变更情况：

新增交易单元：

无

退租交易单元：

无

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	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
银河证券	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	1,585,434.67	37.47%	-	-	-	-
申万宏源	2,646,277.25	62.53%	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
国泰君安	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销可转换公司债券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-16
2	南方基金关于旗下部分基金增加国金证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-02-20
3	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-01
4	南方基金关于旗下部分基金增加东海证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-10
5	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-22
6	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-23
7	南方基金关于旗下部分基金增加东方财富证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-03-31
8	南方基金关于旗下部分基金增加华宝证券为申	证券日报、基金管理	2023-04-07

	购赎回代理券商的公告	人网站、中国证监会基金电子披露网站	
9	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-04-29
10	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-10
11	南方基金关于旗下部分基金增加联储证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-16
12	南方基金关于旗下部分基金增加华福证券为申购赎回代理券商的公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-05-30
13	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-03
14	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-15
15	南方基金管理股份有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的关联交易公告	证券日报、基金管理人网站、中国证监会基金电子披露网站	2023-06-21

§ 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

报告期内单一投资者持有基金份额比例不存在达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金的文件；
- 2、《南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 3、《南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；

- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、报告期内在选定报刊上披露的各项公告；
- 6、《南方中证新能源交易型开放式指数证券投资基金 2023 年中期报告》原文。

12.2 存放地点

深圳市福田区莲花街道益田路 5999 号基金大厦 32-42 楼。

12.3 查阅方式

网站：<http://www.nffund.com>